

# 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

## 運用報告書(全体版)

第6期(決算日2015年2月9日)

作成対象期間(2014年8月8日～2015年2月9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	追加型投資/内外/不動産投資	
信託期間	2012年4月19日から2022年8月8日(当初、2017年8月7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・リート・プレミアム通貨セレクトクラス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、世界各国の金融商品取引所に上場されているREIT(不動産投資信託証券)等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・リート・プレミアム通貨セレクトクラス受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定することを基本とします。	
主な投資対象	野村グローバルREIT プレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・リート・プレミアム通貨セレクトクラス受益証券および野村マネー マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。
	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・リート・プレミアム通貨セレクトクラス	世界各国の金融商品取引所に上場されているREIT等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「REITプレミアム戦略」を活用します。
	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。
主な投資制限	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	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。
	野村マネー マザーファンド	株式への投資は行いません。
分配方針	毎決算時に、原則として、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買取益等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

## 野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



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

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			純 資 産 額
		税 分 込 配 金	期 騰 落	中 率	
	円	円		%	百万円
2期(2013年2月7日)	12,714	10		31.2	26,777
3期(2013年8月7日)	12,333	10	△	2.9	11,491
4期(2014年2月7日)	12,160	10	△	1.3	8,211
5期(2014年8月7日)	13,995	10		15.2	7,933
6期(2015年2月9日)	16,763	10		19.8	12,027

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

\* 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。

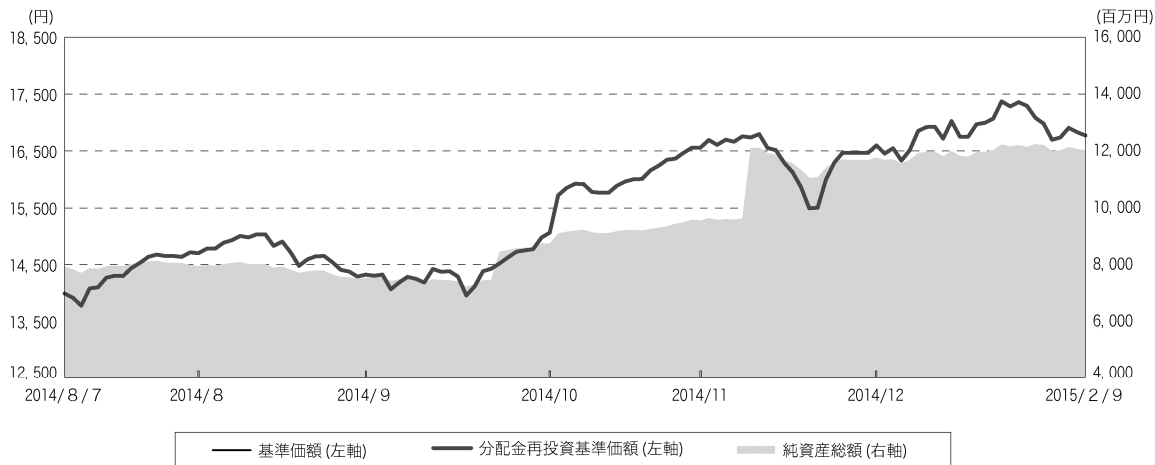
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額	
		騰 落	率
(期 首)		円	%
2014年8月7日	13,995		—
8月末	14,704		5.1
9月末	14,326		2.4
10月末	15,069		7.7
11月末	16,558		18.3
12月末	16,598		18.6
2015年1月末	17,087		22.1
(期 末)			
2015年2月9日	16,773		19.8

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

## ◎運用経過

## ○期中の基準価額等の推移



期首：13,995円  
 期末：16,763円（既払分配金（税込み）：10円）  
 騰落率：19.8%（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（2014年8月7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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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13,995円から当作成期末には16,763円となりました。当作成期末に、1万口当たり10円の分配金をお支払いいたしました。

- ・実質的に投資している世界のREIT等からのインカムゲイン
- ・実質的に投資している世界のREIT等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『REITプレミアム戦略』による、オプションのプレミアム収入（またはオプションにおける支払い）
- ・円／選定通貨<sup>\*</sup>の為替変動

<sup>\*</sup>選定通貨は、投資対象とする外国投資信託の共同投資顧問会社が選定した通貨を指します。

## ○投資環境

### ・世界のREIT市場

世界のREIT市場の騰落は以下ようになりました。



(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、S&P先進国REIT指数(配当込み)を用いています。  
出所：スタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シーから取得  
したデータを基に、野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー作成

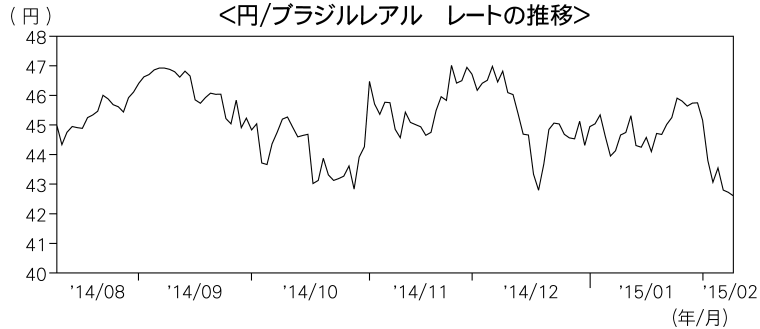
### 【世界のREIT市場】

世界のREIT市場は、サンフランシスコ連銀レポートが、米国での利上げ時期について市場参加者が楽観視していると指摘したことにより、早期利上げ懸念が高まったことから2014年9月に下落する場面がありましたが、その後は、米国企業決算が概ね堅調だったことや、ECB(欧州中央銀行)が追加金融緩和を決定したことなどから堅調に推移し、当作成期間においては値上がりとなりました。

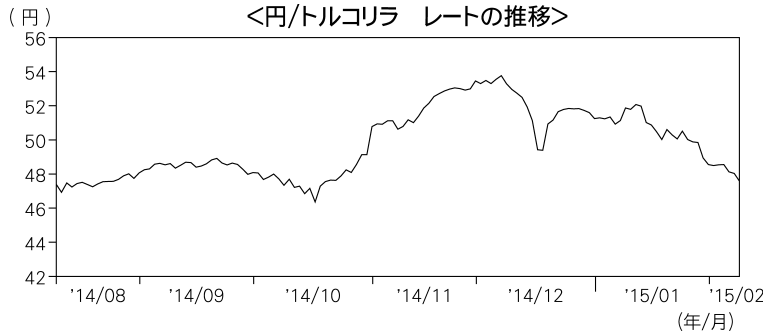
「S&P先進国REIT指数」はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シーの所有する登録商標であり、野村アセットマネジメントに対して利用許諾が与えられています。スタンダード&プアーズは本商品を推奨・支持・販売・促進等するものではなく、また本商品に対する投資適格性等に関しいかなる意思表示等を行なうものではありません。

・ 為替レート

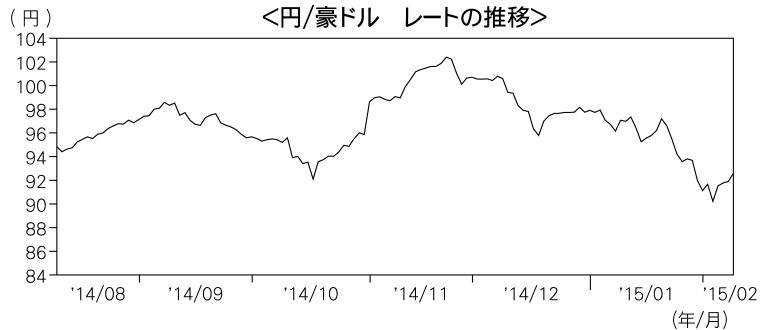
当作成期に通貨セレクトコースにおいて選定した通貨の円に対する為替レートは以下のように推移いたしました。



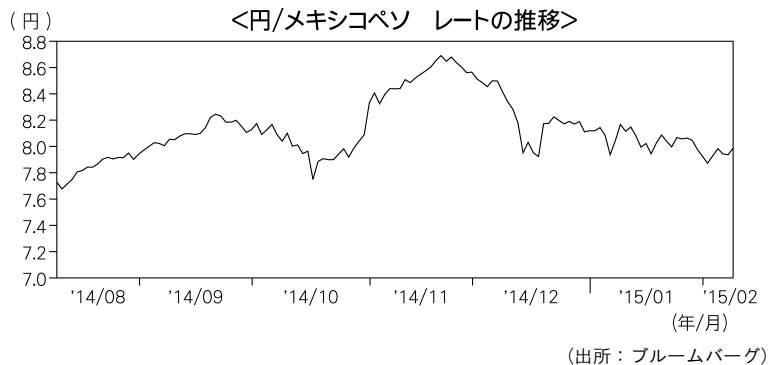
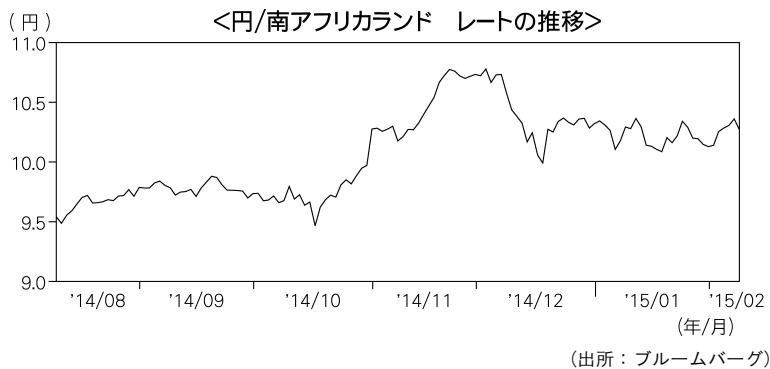
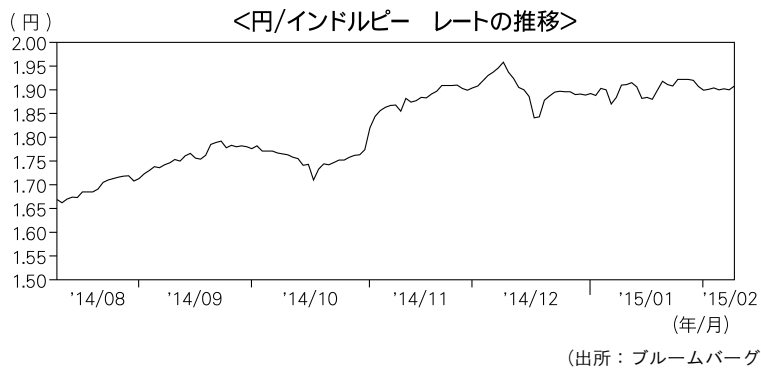
(出所：ブルームバーグ)



(出所：ブルームバーグ)



(出所：ブルームバーグ)



足元の投資環境については、10月末の日銀による量的金融緩和の拡大を受け、新興国通貨が対円で概ね上昇しました。一方その後には、欧米から経済制裁を受けているロシアの通貨が急落したことなどから広くリスク回避的な動きが広がり、新興国通貨が概ね軟調に推移しました。また、原油に対する世界的な需要不足と、産油国の減産に消極的な姿勢を受けて原油価格が下落基調を強めたため、資源国の通貨が相対的に軟調に推移する一方で、価格下落の恩恵を受けやすいエネルギー純輸入国の通貨が相対的に堅調に推移しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [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]

[ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・リート・プレミアムー通貨セレクトクラス] 受益証券および [野村マネー マザーファンド] 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする [ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・リート・プレミアムー通貨セレクトクラス] 受益証券への投資比率は、概ね高位を維持しました。

### [ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・リート・プレミアムー通貨セレクトクラス]

#### ・ポートフォリオ特性値

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・リート・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	95.1%
カバー率	40.8%
平均行使価格	100.8%
平均行使期間	30.1日
配当利回り(米ドル為替取引後)*	2.8%
プレミアム(年率)	3.8%

- ・左記のポートフォリオ特性値は、各副投資顧問会社のポートフォリオの特性値(カバー率、平均行使価格等)を、その組入比率で加重平均したものです(米ドル建て)。
  - ・カバー率：純資産に対するオプションのポジション
  - ・平均行使価格：原資産価格(REIT等の価格)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：純資産に対する実績配当利回り
  - ・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REIT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REIT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。  
出所：各副投資顧問会社からの情報を基に、野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー作成

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・リート・プレミアム] のポートフォリオにおける地域別比率については、当作成期末現在で、米州64.5%、アジア・太平洋18.0%、欧州12.6%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、REIT(リテール)24.3%、REIT(オフィスビル)18.1%、REIT(分散型)13.2%となりました。

\*地域別比率の算出において、国・地域は原則発行国・地域で区分しております。

また、REIT等への投資に加えて、『REITプレミアム戦略』に則り、REIT等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。

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

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

#### [野村マネー マザーファンド]

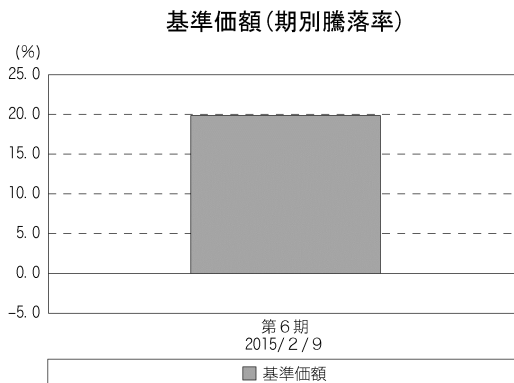
国債を中心に残存期間の短い高格付けの社債等への投資を行い、あわせてコール・ローン等で運用を行うことで流動性の確保を図りました。



## ○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6期
	2014年8月8日～ 2015年2月9日
当期分配金	10
(対基準価額比率)	0.060%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	7,411

(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REITプレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型]

[ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・リート・プレミアムー通貨セレクトクラス] 受益証券および [野村マネー マザーファンド] 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする [ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・リート・プレミアムー通貨セレクトクラス] 受益証券への投資比率を高位で維持することを目指します。

### [ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・リート・プレミアムー通貨セレクトクラス]

世界各国の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されているREIT(不動産投資信託証券)等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図ることを目指します。なお、不動産関連の株式等にも投資する場合があります。

REIT等への投資に加えて、『REIT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。

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、米ドルを売り、選定通貨(米ドルを除く)を買う為替取引を行うことで、各通貨への投資効果を追求します。通貨の選択にあたっては、原則として、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・ブロード構成国の通貨の中から、金利水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定することを基本とします。選定通貨は、定期的に(原則、毎月)見直すこととします。

### [野村マネー マザーファンド]

残存期間の短い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により利息等収益の確保を図り、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る運用を行う方針です。

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の動きについて

店頭デリバティブ取引に関して、将来、国際的に規制の強化等が予定されています。ファンドが投資対象とする外国投資信託が原則として活用する店頭デリバティブ取引(オプション、NDFおよびNDO等を含みます。)が当該規制強化等の対象取引となり、かつ、当該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、当該現金等を資産の一部として追加的に保有することとなります。その場合、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

(2014年8月8日～2015年2月9日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 76	% 0.484	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	(30)	(0.195)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
( 販 売 会 社 )	(43)	(0.273)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口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
( そ の 他 )	( 0 )	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	76	0.486	
期中の平均基準価額は、15,723円です。			

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

\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

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

## ○売買及び取引の状況

(2014年8月8日～2015年2月9日)

## 投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV- グローバル・リート・プレミアム-通貨セレクトクラス	口 403,277	千円 4,157,109	口 104,907	千円 1,022,115

\* 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

(2014年8月8日～2015年2月9日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;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&gt;

該当事項はございません。

## &lt;野村マネー マザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 14,656	百万円 2,394	% 16.3	百万円 50	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

(2015年2月9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
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV- グローバル・リート・プレミアム-通貨セレクトクラス	口 841,113	口 1,139,483	千円 11,915,573	% 99.1
合 計	841,113	1,139,483	11,915,573	99.1

\*評価額の単位未満は切り捨て。

\*比率は、純資産総額に対する投資信託受益証券評価額の比率。

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
野村マネー マザーファンド	千口 982	千口 982	千円 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

(2015年2月9日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	11,915,573	98.3
野村マネー マザーファンド	1,002	0.0
コール・ローン等、その他	201,193	1.7
投資信託財産総額	12,117,768	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 (2015年2月9日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	12,117,768,974
コール・ローン等	201,192,297
投資信託受益証券(評価額)	11,915,573,731
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,002,554
未収利息	392
(B) 負債	90,550,178
未払収益分配金	7,175,002
未払解約金	37,239,974
未払信託報酬	45,978,514
その他未払費用	156,688
(C) 純資産総額(A-B)	12,027,218,796
元本	7,175,002,063
次期繰越損益金	4,852,216,733
(D) 受益権総口数	7,175,002,063口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,763円

(注)期首元本額5,668百万円、期中追加設定元本額2,868百万円、期中一部解約元本額1,361百万円、計算口数当たり純資産額16,763円。

(注)投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額2,424,515円。

## ○損益の状況 (2014年8月8日～2015年2月9日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	674,446,342
受取配当金	674,369,474
受取利息	76,868
(B) 有価証券売買損益	803,391,948
売買益	911,281,220
売買損	△ 107,889,272
(C) 信託報酬等	△ 46,135,202
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,431,703,088
(E) 前期繰越損益金	1,152,750,270
(F) 追加信託差損益金	2,274,938,377
(配当等相当額)	( 2,740,593,112)
(売買損益相当額)	(△ 465,654,735)
(G) 計(D+E+F)	4,859,391,735
(H) 収益分配金	△ 7,175,002
次期繰越損益金(G+H)	4,852,216,733
追加信託差損益金	2,274,938,377
(配当等相当額)	( 2,740,593,239)
(売買損益相当額)	(△ 465,654,862)
分配準備積立金	2,577,278,356

\*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(2014年8月8日～2015年2月9日)は以下の通りです。

項目	第6期
	2014年8月8日～ 2015年2月9日
a. 配当等収益(経費控除後)	653,392,068円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	208,903,016円
c. 信託約款に定める収益調整金	2,740,593,239円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	1,722,158,274円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	5,325,046,597円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	7,421円
g. 分配金	7,175,002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

- ①運用報告書(全体版)について電磁的方法により提供する所要の約款変更を行いました。  
 <変更適用日:2014年12月1日>
- ②書面決議の要件緩和等に関する所要の約款変更を行いました。  
 <変更適用日:2014年12月1日>
- ③書面決議に反対した受益者が受託者に対して行う受益権の買取請求を不適用とする所要の約款変更を行いました。  
 <変更適用日:2014年12月1日>

## ○ (参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2015年2月9日現在)

## &lt;野村マネー マザーファンド&gt;

下記は、野村マネー マザーファンド全体(14,654,588千口)の内容です。

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	3,979,000	3,979,532	26.6	—	—	—	26.6
	(3,040,000)	(3,040,011)	(20.3)	(—)	(—)	(—)	(20.3)
特殊債券 (除く金融債)	2,223,000	2,230,914	14.9	—	—	—	14.9
	(2,223,000)	(2,230,914)	(14.9)	(—)	(—)	(—)	(14.9)
金融債券	1,260,000	1,261,554	8.4	—	—	—	8.4
	(1,260,000)	(1,261,554)	( 8.4)	(—)	(—)	(—)	( 8.4)
普通社債券 (含む投資法人債券)	600,000	600,717	4.0	—	—	—	4.0
	( 600,000)	( 600,717)	( 4.0)	(—)	(—)	(—)	( 4.0)
合 計	8,062,000	8,072,717	54.0	—	—	—	54.0
	(7,123,000)	(7,133,196)	(47.7)	(—)	(—)	(—)	(47.7)

\*( )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。

\*—印は組み入れなし。

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

\*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
国庫短期証券 第474回※	—	100,000	100,003	—
国庫短期証券 第492回	—	500,000	499,999	2015/2/16
国庫短期証券 第496回	—	1,000,000	999,999	2015/3/9
国庫短期証券 第502回	—	500,000	499,999	2015/3/30
国庫短期証券 第508回	—	300,000	299,999	2015/4/27
国庫短期証券 第510回	—	500,000	499,999	2015/5/12
国庫債券 利付(2年)第325回	0.1	140,000	140,009	2015/2/15
国庫債券 利付(2年)第327回	0.1	209,000	209,021	2015/4/15
国庫債券 利付(2年)第328回	0.1	250,000	250,061	2015/5/15
国庫債券 利付(2年)第330回	0.2	170,000	170,116	2015/7/15
国庫債券 利付(2年)第331回	0.1	60,000	60,018	2015/8/15
国庫債券 利付(2年)第333回	0.1	50,000	50,027	2015/10/15
国庫債券 利付(5年)第89回	0.4	200,000	200,275	2015/6/20
小 計		3,979,000	3,979,532	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>				
日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第337回	1.3	171,000	171,103	2015/2/27
日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第338回	1.5	154,000	154,279	2015/3/27
日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第341回	1.3	100,000	100,357	2015/5/29
日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第343回	1.3	171,000	171,803	2015/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第345回	1.2	50,000	50,259	2015/7/29
日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第346回	1.4	300,000	302,153	2015/8/26
日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第347回	1.3	252,000	253,900	2015/9/22
首都高速道路債券 政府保証第198回	1.3	10,000	10,046	2015/6/26
首都高速道路債券 政府保証第199回	1.4	50,000	50,363	2015/8/28
阪神高速道路債券 政府保証第144回	1.5	100,000	100,141	2015/3/17
阪神高速道路債券 政府保証第145回	1.4	10,000	10,025	2015/4/20
阪神高速道路債券 政府保証第147回	1.2	50,000	50,261	2015/7/29
阪神高速道路債券 政府保証第148回	1.3	20,000	20,154	2015/9/30
公営企業債券 政府保証第848回	1.3	205,000	205,097	2015/2/24
公営企業債券 政府保証第849回	1.5	100,000	100,145	2015/3/20
日本政策金融公庫債券 政府保証第3回	0.8	30,000	30,112	2015/8/14
都市再生債券 政府保証第22回	0.4	300,000	300,078	2015/3/10
関西国際空港債券 政府保証第47回	1.3	150,000	150,631	2015/6/17
小 計		2,223,000	2,230,914	
<b>金融債券</b>				
商工債券 利付第718回い号	0.65	70,000	70,053	2015/3/27
商工債券 利付第720回い号	0.65	30,000	30,048	2015/5/27
商工債券 利付第721回い号	0.55	30,000	30,051	2015/6/26
商工債券 利付第724回い号	0.5	20,000	20,050	2015/9/25
農林債券 利付第717回い号	0.75	100,000	100,037	2015/2/27
農林債券 利付第718回い号	0.7	100,000	100,076	2015/3/27
農林債券 利付第719回い号	0.7	100,000	100,128	2015/4/27
農林債券 利付第720回い号	0.65	150,000	150,240	2015/5/27
農林債券 利付第722回い号	0.55	100,000	100,202	2015/7/27
農林債券 利付第723回い号	0.55	50,000	50,120	2015/8/27
農林債券 利付第724回い号	0.5	50,000	50,126	2015/9/25
しんきん中金債券 利付第244回	0.65	100,000	100,068	2015/3/27



銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>金融債券</b>		%	千円	千円	
しんきん中金債券	利付第245回	0.7	40,000	40,051	2015/4/27
しんきん中金債券	利付第246回	0.65	70,000	70,112	2015/5/27
しんきん中金債券	利付第247回	0.55	50,000	50,085	2015/6/26
商工債券	利付(3年)第146回	0.3	100,000	100,029	2015/3/27
商工債券	利付(3年)第152回	0.2	100,000	100,068	2015/9/25
小	計		1,260,000	1,261,554	
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>					
みずほコーポレート銀行	第20回特定社債間限定同順位特約付	0.71	200,000	200,227	2015/4/20
三菱東京UFJ銀行	第114回特定社債間限定同順位特約付	0.67	200,000	200,208	2015/4/17
三菱東京UFJ銀行	第116回特定社債間限定同順位特約付	0.49	100,000	100,171	2015/7/16
三井住友銀行	第49回社債間限定同順位特約付	0.67	100,000	100,109	2015/4/20
小	計		600,000	600,717	
合	計		8,062,000	8,072,717	

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

\* ※印は現先で保有している債券です。

### 国内その他有価証券

区 分	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 1,899,314	% 12.7

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

\* 金額の単位未満は切り捨て。

## Nomura Multi Managers Fund V-Global REIT Premium

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・リート・プレミアム

2013年11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
主要投資対象	<ul style="list-style-type: none"> <li>◆世界各国の金融商品取引所に上場されているREIT等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「REITプレミアム戦略」を活用します。</li> </ul>
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>●世界各国の金融商品取引所に上場されているREIT等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。なお、不動産関連の株式等にも投資する場合があります。</li> <li>●REIT等への投資に加えて、「REIT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。「REIT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、REIT等保有する銘柄にかかる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。</li> <li>●REIT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、投資口価格（または株価）が権利行使価格を上回って値上がりした局面では、収益の一部を享受できない場合があります。</li> <li>●米ドル建て以外の資産に投資を行なった場合は、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。</li> <li>●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。 &lt;通貨セレクトクラスにおける通貨運用方針&gt;</li> <li>●原則として、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・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。</li> <li>●1通貨当りのエクスポージャーについては、原則として、純資産総額の10%～30%程度の範囲内に維持することを基本とします。</li> <li>●ファンダメンタルズおよび流動性を考慮して、選択される通貨が4以下または6以上となる場合があります。この場合、1通貨当りのエクスポージャーは上記の範囲を超える場合があります。</li> <li>●NFR&amp;Tが、REIT等やREIT等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。</li> <li>●副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、REIT等やREIT等オプションの運用において優れていると判断した運用会社を原則として複数選定します。</li> <li>●NFR&amp;T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。</li> </ul>
受託会社	グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー
投資顧問会社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジーズ株式会社
共同投資顧問会社	野村アセットマネジメント株式会社
通貨運用会社	ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド
管理事務代行会社 保管銀行	ノムラ・バンク（ルクセンブルグ）エス・エー

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

※掲載している組入資産の明細および計算書等は、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・リート・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**  
**2013年11月30日現在**  
(金額は米ドル表示)

資産		
投資有価証券時価		855,145,198
(取得原価: 855,452,417米ドル)		
現金預金等		34,950,906
未収配当金		1,335,465
設立費用		9,160
受益証券発行未収金		464,822
資産合計		891,905,551
負債		
投資オプション契約時価(売り)		2,639,272
(取得原価: 6,868,743米ドル)		
銀行借越金		2,181
外国為替先渡し契約に係る評価差損		12,013,168
受益証券買戻支払金		3,747,344
ブローカーへの未払金		1,372,692
未払費用		2,655,314
負債合計		22,429,971
純資産総額		869,475,580

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
通貨セレクトクラス(円)	9,239	8,694,306	80,326,243,016
日本円クラス(円)	9,509	907,597	8,629,898,332

**運用計算書**  
**2013年11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	39,004
受取配当金等	53,504,083
雑収益	3,273
	53,546,360
収益合計	53,546,360
費用	
投資顧問及び共同投資顧問報酬	17,043,080
事務管理代行報酬	1,882,737
保管費用	565,756
源泉徴収税	791,640
当座借越利息	7,159
取引銀行報酬	254,129
銀行手数料	139,740
受託報酬	376,936
法務報酬	6,372
海外登記手数料	214
立替費用	240,866
専門家報酬	60,035
設定費用償却	7,328
雑費用	304
	21,376,296
費用合計	21,376,296
純投資収益	32,170,064
投資有価証券売買に係る損益	183,343,421
オプション契約に係る損益	(28,429,557)
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	(10,873,658)
	144,040,206
当期実現純損益	144,040,206
投資有価証券評価損益の増減	(77,393,545)
オプション契約に係る評価損益の増減	4,767,597
外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減	(16,982,416)
	(89,608,364)
当期評価差損益	(89,608,364)
運用の結果による純資産の増減額	86,601,906

**純資産変動計算書**  
**2013年11月30日に終了する計測期間**  
(金額は米ドル表示)

期初純資産総額	3,115,520,652
純投資収益	32,170,064
当期実現純損益	144,040,206
当期評価差損益	(89,608,364)
運用の結果による純資産の増減額	86,601,906
受益証券の発行手取金	70,611,947
受益証券の買戻支払金	(2,131,550,083)
	(2,060,938,136)
受益者への支払分配金	(271,708,842)
期末純資産総額	869,475,580

**発行済受益証券数の変動表**  
**2013年11月30日に終了する計測期間**  
 (未監査)

通貨セレクトクラス	
期首受益証券数	26,311,696
発行受益証券数	377,312
買戻受益証券数	(17,994,702)
	8,694,306
	8,694,306
日本円クラス	
期首受益証券数	2,325,868
発行受益証券数	262,870
買戻受益証券数	(1,681,141)
	907,597
	907,597

**統計情報**  
**2013年11月30日現在**  
 (未監査)

	2013	2012
期末純資産総額(米ドル)	869,475,580	3,115,520,652
通貨セレクトクラス(円)		
期末純資産総額	80,326,243,016	234,824,456,040
期末1口当たり純資産価格	9,239	8,925
日本円クラス(円)		
期末純資産総額	8,629,898,332	22,735,779,556
期末1口当たり純資産価格	9,509	9,775

**組入資産明細**  
**2013年11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 (%)
		<b>オーストラリア</b>			
普通株式					
	2,420,670	WESTFIELD GROUP	24,967,866	22,931,883	2.63
	6,997,420	WESTFIELD RETAIL TRUST	19,949,275	19,440,550	2.23
	1,906,650	GPT GROUP	6,549,404	6,217,629	0.72
	1,278,413	GOODMAN GROUP STAPLED	5,916,901	5,636,212	0.65
	3,589,000	MIRVAC GROUP	4,808,113	5,557,675	0.64
	5,191,200	DEXUS PROPERTY GROUP	5,502,280	4,941,455	0.57
	1,280,000	STOCKLAND	4,135,766	4,488,916	0.52
	2,010,778	FEDERATIONS CENTRES	5,103,203	4,359,251	0.50
	381,580	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE FUND	401,796	441,428	0.05
			<u>77,334,604</u>	<u>74,014,999</u>	<u>8.51</u>
		合計：オーストラリア	<u>77,334,604</u>	<u>74,014,999</u>	<u>8.51</u>
		<b>バミューダ諸島</b>			
普通株式					
	650,000	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD USD	3,975,153	3,841,500	0.44
			<u>3,975,153</u>	<u>3,841,500</u>	<u>0.44</u>
		合計：バミューダ諸島	<u>3,975,153</u>	<u>3,841,500</u>	<u>0.44</u>
		<b>カナダ</b>			
普通株式					
	444,295	RIOCAN REAL ESTATE INV TST REIT	11,472,601	10,352,059	1.18
	103,720	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	3,062,857	3,183,699	0.37
	104,920	CALLOWAY REAL ESTATE INV TST REIT	3,095,416	2,507,062	0.29
	190,002	CHARTWELL RETIREMENT RESIDENCES	2,050,217	1,798,093	0.21
	69,300	CAN APARTMENT PROP REAL ESTATE INV	1,723,202	1,352,882	0.16
	31,710	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	1,355,429	1,275,828	0.15
	47,500	DUNDEE REAL ESTATE INV TST REIT	1,673,408	1,250,307	0.14
	22,230	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1,299,781	1,247,341	0.14
			<u>25,732,911</u>	<u>22,967,271</u>	<u>2.64</u>
		合計：カナダ	<u>25,732,911</u>	<u>22,967,271</u>	<u>2.64</u>
		<b>ケイマン諸島</b>			
普通株式					
	1,050,000	SOHO CHINA LTD	796,800	948,049	0.11
			<u>796,800</u>	<u>948,049</u>	<u>0.11</u>
		合計：ケイマン諸島	<u>796,800</u>	<u>948,049</u>	<u>0.11</u>

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
		<b>中国</b>			
<b>普通株式</b>					
	1,650,000	GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD H	2,177,999	2,651,829	0.30
			2,177,999	2,651,829	0.30
		合計：中国	2,177,999	2,651,829	0.30
		<b>フランス</b>			
<b>普通株式</b>					
	120,423	UNIBAIL-RODAMCO SE REIT	24,128,360	31,537,129	3.62
	109,460	KLEPIERRE	3,414,571	5,089,736	0.59
	55,900	FONCIERE DES REGIONS	4,047,605	4,761,907	0.55
	24,849	GECINA SA	2,844,565	3,269,191	0.38
	14,350	ICADE SA	1,175,141	1,318,302	0.15
			35,610,242	45,976,265	5.29
		合計：フランス	35,610,242	45,976,265	5.29
		<b>ドイツ</b>			
<b>普通株式</b>					
	40,544	LEG IMMOBILIEN AG	2,430,613	2,333,790	0.27
	97,113	ALSTRIA OFFICE REIT AG	1,060,307	1,225,309	0.14
	39,892	DEUTSCHE WOHNEN AG	647,672	783,338	0.09
			4,138,592	4,342,437	0.50
		合計：ドイツ	4,138,592	4,342,437	0.50
		<b>香港</b>			
<b>普通株式</b>					
	2,558,493	THE LINK REAL ESTATE INV TST REIT	11,799,156	12,540,400	1.44
	2,307,000	HANG LUNG PROPERTIES LTD	8,182,020	7,751,735	0.89
	4,400,000	SINO LAND CO LTD	7,175,450	6,027,272	0.69
	1,009,000	FORTUNE REIT	572,225	839,449	0.10
			27,728,851	27,158,856	3.12
		合計：香港	27,728,851	27,158,856	3.12



	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
		日本			
普通株式					
	1,396	JAPAN REAL ESTATE INVESTMENT JREIT	13,583,778	14,763,680	1.71
	1,200	NP BUILDING FUND INC JREIT	12,114,239	14,121,787	1.62
	6,568	JAPAN RETAIL FD INVEST CORP JREIT	11,332,731	12,967,804	1.49
	2,220	ADVANCE RESIDENCE INVEST CORP JREIT	4,730,699	4,819,294	0.55
	479	NIPPON PROLOGIS REIT INC	3,272,977	4,635,031	0.53
	2,530	ORIX JREIT INC JREIT	2,951,249	3,157,863	0.36
	262	MORI TRUST SOGO REIT INC JREIT	2,245,597	2,197,205	0.25
	1,750	AEON REIT INVESTMENT CORP	1,856,248	1,958,508	0.23
	1,464	GLP J-REIT	1,390,545	1,466,719	0.17
			53,478,063	60,087,891	6.91
		合計：日本	53,478,063	60,087,891	6.91
		オランダ			
普通株式					
	54,500	WERELDHAVE NV	3,778,908	4,168,740	0.48
	640,345	NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	3,470,926	4,016,202	0.46
	48,465	CORIO NV	2,030,257	2,105,164	0.24
			9,280,091	10,290,106	1.18
		合計：オランダ	9,280,091	10,290,106	1.18
		シンガポール			
普通株式					
	6,154,600	ASCENDAS REAL ESTATE INV TST REIT	11,344,026	10,890,486	1.26
	5,233,074	CAPITAMALL TRUST REITS	8,277,147	8,112,804	0.93
	4,134,000	CAPITALCOMMERCIAL TRUST REIT	4,254,955	4,893,183	0.56
	1,782,900	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST REIT	1,625,009	1,918,471	0.22
	1,350,000	SUNTEC REIT	1,425,010	1,678,622	0.19
	709,000	CDL HOSPITALITY TRUSTS REITS	1,153,540	918,320	0.11
			28,079,687	28,411,886	3.27
		合計：シンガポール	28,079,687	28,411,886	3.27
		スウェーデン			
普通株式					
	111,500	WIHLBORGS FASTIGHETER AB	1,896,809	1,928,904	0.22

	数量	銘柄名		取得時価	評価金額	組入比率 (%)
	85,400	CASTELLUM AB		1,289,573	1,290,597	0.15
				3,186,382	3,219,501	0.37
		合計：スウェーデン		3,186,382	3,219,501	0.37
		スイス				
普通株式	13,107	PSP SWISS PROPERTY AG-REG		1,198,913	1,124,801	0.13
				1,198,913	1,124,801	0.13
		合計：スイス		1,198,913	1,124,801	0.13
		イギリス				
普通株式	2,516,901	BRITISH LAND CO PLC	REIT	19,991,383	25,111,179	2.89
	714,551	LAND SECURITIES GROUP PLC		8,248,280	11,119,516	1.28
	1,213,990	HAMMERSON PLC		8,761,198	10,119,769	1.16
	1,536,357	LONDONMETRIC PROPERTY PLC		2,779,660	3,261,334	0.38
	339,011	BIG YELLOW GROUP PLC		1,985,622	2,650,499	0.30
	35,245	DERWENT LONDON PLC		1,155,928	1,394,475	0.16
	242,000	SEGRO PLC	REIT	870,863	1,321,817	0.15
				43,792,934	54,978,589	6.32
		合計：イギリス		43,792,934	54,978,589	6.32
		アメリカ				
投資信託	27,100	ISHARES US REAL ESTATE ETF *		1,825,299	1,714,346	0.20
	21,636	ISHARES SPDR DJ INTL REAL ESTAT ETF		909,432	916,068	0.11
				2,734,731	2,630,414	0.31
普通株式	426,523	SIMON PROPERTY GRP INC *		66,027,917	64,131,997	7.37
	727,959	PROLOGIS INC *		26,111,165	27,698,839	3.18
	478,330	EQUITY RESIDENTIAL *		29,033,188	24,629,211	2.83
	275,280	VORNADO REALTY TRUST		23,563,934	24,271,438	2.79
	401,420	VENTAS INC		24,566,959	22,892,983	2.63
	145,510	PUBLIC STORAGE		21,459,452	22,332,875	2.57
	390,770	HEALTH CARE REIT INC	REIT	24,025,719	21,930,012	2.52

数量	銘柄名		取得時価	評価金額	組入比率 (%)
306,280	MACERICH CO	REIT	18,160,904	17,552,907	2.02
897,904	DDR CORP		14,280,458	14,402,380	1.66
612,630	UDR INC		15,835,189	14,317,163	1.65
233,300	CAMDEN PROPERTY TRUST		15,875,338	13,573,394	1.56
251,214	KILROY REALTY CORP		12,072,641	12,696,356	1.46
340,620	HCP INC	REIT	15,221,313	12,569,219	1.45
122,280	BOSTON PROPERTIES INC		13,162,969	12,204,767	1.40
473,430	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC		9,511,569	9,828,407	1.13
62,940	ESSEX PROPERTY TRUST		10,079,335	9,581,356	1.10
459,210	KIMCO REALTY CORP		8,843,728	9,501,055	1.09
137,400	TAUBMAN CENTERS INC		10,556,705	9,016,188	1.04
263,380	LIBERTY PROPERTY TRUST *		9,963,789	8,559,850	0.98
247,920	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC *		11,089,746	8,052,442	0.93
431,510	HOST HOTEL & RESORTS INC		7,051,245	7,987,250	0.92
154,740	BRE PROPERTIES INC		7,955,032	7,962,920	0.92
684,298	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO		7,022,497	7,876,270	0.91
218,510	HIGHWOOD PROPERTIES INC		7,831,449	7,875,100	0.91
80,510	SL GREEN REALTY CORPORATION		6,774,414	7,311,113	0.84
69,240	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST *		7,166,168	7,196,806	0.83
202,970	TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC		6,451,183	6,714,248	0.77
116,697	DIGITAL REALTY TRUST INC	REIT	8,137,137	5,527,937	0.64
108,530	EPR PROPERTIES		5,449,993	5,499,215	0.63
83,080	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITY		5,969,401	5,274,749	0.61
271,200	BIOMED REALTY TRUST INC		5,490,311	5,057,880	0.58
127,900	REALTY INCOME CORP		5,126,802	4,893,454	0.56
151,160	LASALLE HOTEL PROPERTIES		4,347,366	4,763,052	0.55
218,800	STAG INDUSTRIAL INC		4,341,870	4,758,900	0.55
417,740	SPIRIT REALTY CAPITAL INC		3,977,239	4,164,868	0.48
129,300	WEINGARTEN REALTY INVESTORS		3,425,942	3,708,324	0.43
161,030	EQUITY ONE INC		3,786,487	3,621,565	0.42
621,600	HERSHA HOSPITALITY TRUST		3,556,370	3,555,552	0.41
261,015	BRANDWINE REALTY TRUST SBI		3,552,837	3,471,500	0.40
151,800	SENIOR HOUSING PROPERTY TRUST REIT		4,185,658	3,444,342	0.40
178,580	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC		3,888,108	3,251,942	0.37
61,400	HOME PROPERTIES INC		3,852,743	3,248,060	0.37
26,990	AVALONBAY COMMUNITIES INC		3,761,417	3,201,284	0.37
205,350	DUKE REALTY CORP		3,048,239	3,123,374	0.36
234,230	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC		2,872,170	3,061,386	0.35
62,200	REGENCY CENTERS CORP		2,847,887	2,927,754	0.34
44,600	MID AMERICA APARTMENT COMM		3,129,295	2,699,638	0.31
126,580	MACK-CALI REALTY CORP	REIT	3,553,191	2,582,232	0.30
53,000	EXTRA SPACE STORAGE INC		2,341,665	2,228,120	0.26
140,380	EMPIRE STATE REALTY TRUST INC		1,826,318	2,025,683	0.23
66,848	SABRA HEALTH CARE REIT INC		1,805,949	1,804,228	0.21
65,618	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST		1,864,351	1,792,028	0.21
72,400	RLJ LODGING TRUST		1,755,446	1,747,736	0.20
109,330	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC		1,463,244	1,519,687	0.17

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
77,928	PARKWAY PROPERTIES INC	1,410,656	1,433,875	0.16
61,670	HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	1,256,189	1,279,653	0.15
122,000	HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC A	1,511,254	1,244,400	0.14
56,470	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,137,717	1,142,388	0.13
65,510	PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST A	1,163,186	1,076,984	0.12
11,860	NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	676,020	702,468	0.08
		<u>536,206,464</u>	<u>512,500,804</u>	<u>58.95</u>
	合計：アメリカ	<u>538,941,195</u>	<u>515,131,218</u>	<u>59.26</u>
	合計：投資有価証券	<u>855,452,417</u>	<u>855,145,198</u>	<u>98.35</u>

\*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証券

## 財務書類に関する注記

2013年11月30日現在

(購入金額、売却金額、契約数は通貨を欄左側に表示)

## 注記1-外国為替先渡し契約

2013年11月30日現在、ファンドは以下の未決済外国為替先渡し契約を有していた。外国為替先渡し契約は投資目的とヘッジ目的で用いられた。

購入通貨	購入金額	売却通貨	売却金額	満期日	未実現損益 (米ドル)
USD	28,245,980	AUD	29,850,000	2013年12月16日	1,086,294
USD	22,621,146	JPY	2,233,370,000	2013年12月16日	787,994
USD	7,805,682	CAD	8,140,000	2013年12月16日	121,095
USD	10,754,150	SGD	13,360,000	2013年12月16日	105,300
USD	5,186,377	HKD	40,200,000	2013年12月16日	904
JPY	9,414,355	USD	92,973	2013年12月27日	(930)
JPY	9,415,099	USD	92,973	2013年12月10日	(938)
USD	120,157	GBP	75,000	2013年12月16日	(2,295)
USD	21,214,794	EUR	15,690,000	2013年12月16日	(135,979)
USD	18,190,020	GBP	11,310,000	2013年12月16日	(275,910)
JPY	4,505,159,121	USD	45,114,751	2013年12月27日	(1,067,955)
JPY	4,613,406,228	USD	46,978,979	2013年12月10日	(1,881,523)
TRY	47,000,000	USD	22,579,870	2014年1月24日	460,968
TRY	47,000,000	USD	22,618,990	2014年1月24日	421,848
TRY	47,000,000	USD	22,655,242	2014年1月24日	385,596
USD	8,061,765	RUB	260,000,000	2013年12月20日	264,210
USD	5,781,097	AUD	6,200,000	2014年1月24日	154,755
USD	7,720,219	MXN	100,000,000	2014年1月24日	106,379
USD	6,483,418	TRY	13,000,000	2013年12月20日	66,359
USD	6,619,527	RUB	220,000,000	2014年1月24日	58,435
USD	5,420,740	TRY	11,000,000	2014年1月24日	28,204
MXN	1,275,000,000	USD	97,068,160	2014年1月24日	8,301
USD	3,911,789	TRY	8,000,000	2014年1月24日	(10,056)
RUB	193,000,000	USD	5,801,423	2014年1月24日	(45,556)
RUB	193,000,000	USD	5,809,141	2014年1月24日	(53,274)
RUB	194,000,000	USD	5,871,581	2014年1月24日	(85,891)
TRY	45,300,000	USD	22,603,098	2013年12月20日	(242,115)
TRY	45,400,000	USD	22,773,444	2013年12月20日	(363,099)
TRY	45,300,000	USD	22,744,674	2013年12月20日	(383,691)
AUD	22,500,000	USD	20,846,587	2014年1月24日	(428,411)
AUD	22,500,000	USD	20,902,500	2014年1月24日	(484,324)
AUD	22,700,000	USD	21,201,800	2014年1月24日	(602,129)
MXN	1,525,000,000	USD	117,578,121	2013年12月20日	(1,161,489)
RUB	1,950,000,000	USD	59,808,612	2013年12月20日	(1,326,948)
RUB	1,950,000,000	USD	60,096,524	2013年12月20日	(1,614,860)
RUB	1,960,000,000	USD	60,906,449	2013年12月20日	(2,124,880)
BRL	430,100,000	USD	186,658,334	2014年1月3日	(2,676,495)
AUD	71,784,392	USD	68,260,496	2013年12月20日	(2,963,150)
USD	1,032,216	JPY	104,130,562	2013年12月10日	14,308
USD	1,032,216	JPY	104,122,303	2013年12月27日	14,216
USD	444,538	JPY	44,444,778	2013年12月10日	10,078
USD	444,538	JPY	44,440,998	2013年12月27日	10,041
USD	233,317	JPY	22,928,346	2013年12月10日	9,186
USD	225,384	JPY	22,248,633	2013年12月10日	7,898
GBP	375,000	USD	604,728	2013年12月16日	7,537
USD	187,746	JPY	18,674,244	2013年12月10日	5,201
EUR	725,000	USD	981,665	2013年12月16日	4,906

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	165,780	JPY	16,489,333	2013年12月10日	4,592
USD	168,722	JPY	16,834,914	2013年12月10日	4,156
USD	168,722	JPY	16,833,395	2013年12月27日	4,143
GBP	250,000	USD	404,187	2013年12月16日	3,989
EUR	575,000	USD	778,752	2013年12月16日	3,701
USD	100,343	JPY	9,889,340	2013年12月10日	3,673
USD	149,454	JPY	14,998,804	2013年12月10日	2,837
USD	237,898	JPY	24,125,612	2013年12月10日	2,063
USD	237,898	JPY	24,123,709	2013年12月27日	2,041
USD	191,724	JPY	19,415,205	2013年12月10日	1,935
USD	191,724	JPY	19,413,671	2013年12月27日	1,918
USD	134,962	JPY	13,615,073	2013年12月10日	1,871
USD	134,962	JPY	13,613,993	2013年12月27日	1,859
USD	68,451	JPY	6,829,965	2013年12月10日	1,686
USD	68,451	JPY	6,829,349	2013年12月27日	1,681
USD	34,925	JPY	3,429,805	2013年12月10日	1,398
USD	235,847	JPY	24,018,871	2013年12月10日	1,056
USD	235,847	JPY	24,016,984	2013年12月27日	1,034
USD	76,393	JPY	7,779,998	2013年12月10日	342
USD	76,393	JPY	7,779,387	2013年12月27日	335
USD	33,428	JPY	3,390,086	2013年12月10日	290
USD	33,428	JPY	3,389,819	2013年12月27日	287
USD	42,813	JPY	4,360,133	2013年12月10日	191
USD	42,813	JPY	4,359,790	2013年12月27日	188
HKD	3,400,000	USD	438,667	2013年12月16日	(95)
SGD	550,000	USD	439,871	2013年12月16日	(1,483)
CAD	325,000	USD	308,450	2013年12月16日	(1,633)
SGD	1,000,000	USD	800,898	2013年12月16日	(3,829)
CAD	375,000	USD	358,018	2013年12月16日	(3,999)
JPY	55,000,000	USD	542,263	2013年12月16日	(4,590)
JPY	30,000,000	USD	301,033	2013年12月16日	(7,757)
AUD	1,400,000	USD	1,285,860	2013年12月16日	(12,040)
JPY	80,000,000	USD	794,313	2013年12月16日	(12,243)
AUD	700,000	USD	650,337	2013年12月16日	(13,427)
USD	38,104,084	AUD	40,494,000	2014年1月23日	1,354,273
USD	25,845,359	JPY	2,525,089,000	2014年1月23日	1,154,262
USD	18,415,730	JPY	1,803,237,000	2013年12月5日	789,422
USD	10,849,591	CAD	11,289,000	2014年1月23日	202,632
USD	8,575,396	CAD	8,879,000	2013年12月5日	190,777
GBP	1,621,000	USD	2,513,182	2013年12月5日	133,641
USD	18,722,543	EUR	13,686,000	2014年1月23日	98,259
USD	10,280,789	SGD	12,783,000	2014年1月23日	91,574
EUR	2,060,000	USD	2,747,648	2013年12月5日	55,595
USD	1,841,097	JPY	183,750,000	2014年1月23日	44,333
GBP	1,533,342	USD	2,467,108	2014年1月23日	35,668
USD	735,932	JPY	72,005,000	2014年1月23日	31,846
SGD	1,629,000	USD	1,269,061	2013年12月5日	29,363
USD	1,278,011	JPY	127,812,000	2013年12月5日	28,673
AUD	1,105,000	USD	982,455	2013年12月5日	23,689
USD	3,549,840	SEK	23,163,000	2014年1月23日	23,446
GBP	588,000	USD	942,034	2013年12月5日	18,071
GBP	593,000	USD	956,434	2013年12月5日	11,835
EUR	945,000	USD	1,276,940	2013年12月5日	9,013
USD	342,951	AUD	370,000	2014年1月23日	7,163

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)
SGD	430,000	USD	335,906	2013年12月5日	6,833
USD	243,169	CAD	251,000	2013年12月5日	6,146
GBP	518,000	USD	839,719	2013年12月5日	6,088
EUR	788,000	USD	1,066,471	2013年12月5日	5,837
EUR	101,705	USD	135,828	2014年1月23日	2,574
USD	21,343,479	HKD	165,457,000	2013年12月5日	1,401
CAD	2,444,000	USD	2,303,604	2014年1月23日	1,398
HKD	10,174,000	USD	1,312,098	2013年12月5日	232
HKD	6,630,000	USD	855,106	2013年12月5日	88
USD	346,377	HKD	2,685,000	2014年1月23日	6
HKD	4,655,000	USD	600,476	2013年12月5日	(34)
USD	712,599	HKD	5,525,000	2013年12月5日	(63)
CAD	600,000	USD	566,920	2013年12月5日	(328)
USD	7,119,632	HKD	55,198,000	2014年1月23日	(1,040)
USD	527,256	SGD	664,000	2013年12月5日	(1,997)
USD	258,328	SGD	328,000	2013年12月5日	(3,110)
USD	363,413	GBP	225,000	2014年1月23日	(3,840)
USD	363,284	GBP	225,000	2014年1月23日	(3,969)
SGD	878,000	USD	704,599	2013年12月5日	(4,774)
USD	1,137,891	EUR	840,000	2014年1月23日	(5,204)
AUD	964,000	USD	883,718	2013年12月5日	(5,959)
USD	1,175,998	CHF	1,071,254	2014年1月23日	(7,022)
CAD	414,000	USD	398,437	2013年12月5日	(7,488)
EUR	413,000	USD	570,918	2013年12月5日	(8,909)
JPY	97,854,000	USD	967,116	2013年12月5日	(10,612)
SGD	1,396,000	USD	1,124,935	2013年12月5日	(12,228)
AUD	903,000	USD	836,421	2013年12月5日	(14,206)
SEK	3,089,039	USD	486,136	2014年1月23日	(15,854)
USD	1,686,121	EUR	1,255,071	2014年1月23日	(21,814)
JPY	75,719,000	USD	765,921	2013年12月5日	(25,782)
JPY	69,944,000	USD	711,225	2013年12月5日	(27,535)
USD	1,206,930	GBP	757,000	2013年12月5日	(29,125)
JPY	187,441,736	USD	1,874,983	2014年1月23日	(42,121)
USD	20,152,991	AUD	22,181,000	2013年12月5日	(43,662)
JPY	191,573,000	USD	1,917,108	2013年12月5日	(44,518)
JPY	121,249,000	USD	1,239,399	2013年12月5日	(54,213)
AUD	2,168,000	USD	2,037,594	2013年12月5日	(63,547)
AUD	1,891,691	USD	1,802,004	2014年1月23日	(85,224)
AUD	1,840,778	USD	1,766,533	2014年1月23日	(95,959)
USD	17,186,096	GBP	10,650,000	2014年1月23日	(197,221)
USD	12,446,155	SGD	15,877,000	2013年12月5日	(208,898)
USD	24,712,832	EUR	18,504,000	2013年12月5日	(467,372)
USD	24,727,745	GBP	15,792,000	2013年12月5日	(1,057,963)
					<u>(12,013,168)</u>

## 注記2-未決済オプション契約

2013年11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)
<b>売り持ちポジション</b>							
USD	(47,411)	CALL ACC 36.6808 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(13,545)	0	13,545
USD	(39,200)	CALL ACC 36.753 05/12/13	OTC	2013年12月5日	(27,252)	0	27,252
USD	(25,593)	CALL ARE 69.0872 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(18,023)	0	18,023
SGD	(612,870)	CALL AREIT 2.4336 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(6,021)	0	6,021
USD	(109,000)	CALL BMR 20.17 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(42,619)	0	42,619
USD	(17,217)	CALL BRE 55.9520 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(9,912)	0	9,912
EUR	(11,191)	CALL CORA 33.6232 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(3,492)	0	3,492
USD	(23,707)	CALL CPT 66.9240 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(16,019)	0	16,019
USD	(14,600)	CALL CPT 69.4192 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(9,423)	0	9,423
USD	(44,900)	CALL EQR 58.2526 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(30,712)	0	30,712
USD	(42,000)	CALL HCP 43.3 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(32,760)	0	32,760
USD	(23,844)	CALL HCP 44.0856 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(9,197)	0	9,197
USD	(30,900)	CALL HIW 37.86 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(18,540)	0	18,540
USD	(110,000)	CALL HKL 7.1089 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(6,302)	0	6,302
GBP	(108,171)	CALL HMSO 5.5120 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(8,355)	0	8,355
USD	(10,000)	CALL HTA 11.825 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(2,300)	0	2,300
USD	(78,688)	CALL KIM 22.0688 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(16,367)	0	16,367
GBP	(181,055)	CALL LAND 10.3012 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(17,414)	0	17,414
USD	(29,900)	CALL LRY 35.764 03/12/13	OTC	2013年12月3日	(27,529)	0	27,529
USD	(51,800)	CALL LRY 36.24 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(60,502)	0	60,502
AUD	(1,514,690)	CALL MGR 1.8148 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(29,821)	0	29,821
SGD	(403,920)	CALL MINT 1.4404 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(2,309)	0	2,309
USD	(55,683)	CALL PDM 19.4376 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(8,636)	0	8,636
USD	(84,832)	CALL PLD 42.0368 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(24,347)	0	24,347
USD	(37,415)	CALL PSA 178.7552 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(41,800)	0	41,800
USD	(50,222)	CALL SKT 36.4936 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(8,814)	0	8,814
USD	(46,278)	CALL SPG 166.92 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(37,883)	0	37,883
SGD	(287,000)	CALL SUN 1.7709 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(4,823)	0	4,823
USD	(23,500)	CALL TCO 74.6137 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(20,060)	0	20,060
USD	(39,600)	CALL UDR 25.109 04/12/13	OTC	2013年12月4日	(17,230)	0	17,230
USD	(8,288)	CALL VTR 68.6608 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(5,800)	0	5,800
AUD	(2,219,612)	CALL WRT 3.2136 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(40,272)	0	40,272
USD	(28,600)	CALL ACC 16/01/14 33.33 OTC		2014年1月16日	(22,308)	(7,375)	14,933
USD	(20,615)	CALL ACC 34.4136 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(7,368)	(918)	6,450
JPY	(248)	CALL ADV RES 219938.8275 18/12/13 O		2013年12月18日	(15,416)	(11,190)	4,226
JPY	(260)	CALL ADV RES 224397.5716 15/1/14 OT		2014年1月15日	(11,209)	(10,401)	808
JPY	(265)	CALL ADVAN RES 218915.606 3/12/13 O		2013年12月3日	(18,168)	(9,526)	8,643
JPY	(179)	CALL ADVAN RES 227344 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(3,888)	(1,166)	2,722
JPY	(269)	CALL ADVAN RES 231088 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(4,018)	(1,352)	2,665
EUR	(33,172)	CALL AOX 9.464 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(2,645)	(609)	2,036
EUR	(26,495)	CALL AOX 9.7760 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(2,985)	(2)	2,983
CAD	(26,000)	CALL AP-U 32.825 03/12/13	OTC	2013年12月3日	(16,746)	(1,716)	15,030



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)
CAD	(25,660)	CALL AP-U 34.5592 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(3,664)	(170)	3,494
USD	(10,603)	CALL ARE 66.9760 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(5,395)	(1)	5,394
USD	(34,422)	CALL ARE 67.1632 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(14,894)	(631)	14,263
SGD	(784,000)	CALL AREIT 2.2928 29/01/14	OTC	2014年1月29日	(23,914)	(12,186)	11,728
SGD	(244,000)	CALL AREIT 2.3256 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(4,384)	(4,261)	122
SGD	(622,000)	CALL AREIT 2.3474 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(19,502)	(684)	18,817
SGD	(143,000)	CALL AREIT 2.3603 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(2,493)	(30)	2,464
SGD	(717,330)	CALL AREIT 2.3665 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(9,019)	(2,727)	6,292
SGD	(240,000)	CALL AREIT 2.4011 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(5,557)	(800)	4,757
SGD	(205,000)	CALL AREIT 2.4593 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(4,784)	(5)	4,779
SGD	(232,000)	CALL AREIT 2.4901 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(6,138)	(361)	5,778
USD	(6,977)	CALL AVB 123.0944 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(6,359)	(6,036)	323
USD	(13,526)	CALL AVB 127.7328 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(9,303)	(111)	9,192
USD	(68,400)	CALL BDN 12.787 27/11/13	OTC	2013年11月27日	(28,317)	(34,405)	(6,088)
USD	(37,000)	CALL BDN 14.195 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(9,990)	(29)	9,961
CAD	(8,734)	CALL BEI-U 61.7656 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(2,900)	(1)	2,899
CAD	(11,273)	CALL BEI-U 62.348 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(3,422)	(2,205)	1,216
GBP	(402,800)	CALL BLND 5.8972 04/12/13	OTC	2013年12月4日	(76,791)	(142,628)	(65,837)
GBP	(163,125)	CALL BLND 608.854 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(24,542)	(30,904)	(6,362)
GBP	(153,843)	CALL BLND 614.984 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(19,563)	(17,233)	2,330
GBP	(156,025)	CALL BLND 632.873 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(24,664)	(27,551)	(2,887)
GBP	(152,250)	CALL BLND 634.315 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(21,406)	(13,838)	7,568
GBP	(133,673)	CALL BLND 634.838 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(20,901)	(17,575)	3,325
GBP	(373,512)	CALL BLND 6.3648 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(27,575)	(6,441)	21,134
GBP	(303,749)	CALL BLND 6.4116 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(19,191)	(9,305)	9,887
USD	(21,700)	CALL BRE 53.98 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(13,597)	(83)	13,514
USD	(25,487)	CALL BRE 54.08 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(12,458)	(2,358)	10,101
USD	(18,700)	CALL BRE 54.7652 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(12,005)	(111)	11,894
USD	(15,900)	CALL BRE 55.1246 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(13,221)	(4,148)	9,072
USD	(16,400)	CALL BRE 56.6616 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(12,403)	(1,036)	11,368
USD	(13,900)	CALL BRE 57.2024 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(9,266)	(234)	9,032
USD	(228)	CALL BXP 105 18/01/14		2014年1月18日	(51,101)	(42,180)	8,922
USD	(16,697)	CALL BXP 105.2792 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(14,368)	(1,585)	12,783
USD	(9,522)	CALL BXP 105.6432 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(8,802)	(2,182)	6,620
USD	(38,068)	CALL BXP 106.4544 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(35,460)	(18,292)	17,168
GBP	(19,000)	CALL BYG 4.4427 04/12/13	OTC	2013年12月4日	(4,691)	(10,728)	(6,037)
GBP	(19,000)	CALL BYG 4.7198 17/12/13	OTC	2013年12月17日	(4,170)	(2,376)	1,794
GBP	(19,000)	CALL BYG 4.7256 27/02/14	OTC	2014年2月27日	(4,107)	(6,019)	(1,912)
GBP	(19,000)	CALL BYG 4.8205 18/02/14	OTC	2014年2月18日	(4,594)	(4,190)	404
GBP	(16,900)	CALL BYG 4.8618 05/02/14	OTC	2014年2月5日	(3,690)	(2,713)	977
GBP	(16,900)	CALL BYG 4.8618 22/01/14	OTC	2014年1月22日	(3,034)	(2,127)	908
GBP	(21,400)	CALL BYG 4.9827 03/01/14	OTC	2014年1月3日	(3,950)	(880)	3,070
GBP	(21,400)	CALL BYG 4.9827 10/01/14	OTC	2014年1月10日	(4,884)	(1,109)	3,775
CAD	(21,000)	CALL CAR-U 21.341 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(5,098)	(2)	5,097

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)
CAD	(210)	CALL CAR-U 22 21/12/13		2013年12月21日	(4,687)	(2,975)	1,712
SEK	(30,400)	CALL CAST 10/01/14 99.081 OTC		2014年1月10日	(8,629)	(5,527)	3,102
SEK	(8,000)	CALL CAST 98.778 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(3,110)	(881)	2,230
USD	(38,100)	CALL CBL 19.22 16/01/14	OTC	2014年1月16日	(24,289)	(2,064)	22,225
USD	(42,200)	CALL CBL 20.10 13/12/13	OTC	2013年12月13日	(36,541)	(14)	36,527
SGD	(330,000)	CALL CCT 1.4994 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(5,414)	(6,286)	(873)
SGD	(152,000)	CALL CCT 1.5072 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(1,247)	(1,104)	143
SGD	(343,000)	CALL CCT 1.508 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(4,908)	(5,143)	(234)
SGD	(348,000)	CALL CCT 1.5102 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(4,946)	(6,879)	(1,933)
SGD	(1,087,080)	CALL CCT 1.5184 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(10,278)	(511)	9,767
SGD	(816,920)	CALL CCT 1.5444 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(4,391)	(2,181)	2,210
SGD	(305,000)	CALL CCT 1.5681 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(4,494)	(411)	4,083
USD	(56,900)	CALL CLI 22.0945 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(34,186)	(6)	34,180
EUR	(3,597)	CALL CORA 33.7295 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(1,877)	(989)	888
EUR	(6,854)	CALL CORA 33.9552 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(3,717)	(77)	3,640
AUD	(267,106)	CALL CPA 1.2376 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(2,475)	(8,129)	(5,654)
USD	(15,200)	CALL CPT 61.3409 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(12,443)	(3,050)	9,393
USD	(44,845)	CALL CPT 61.4536 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(21,198)	(829)	20,369
USD	(15,800)	CALL CPT 65.9107 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(15,919)	0	15,918
USD	(13,000)	CALL CPT 69.7902 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(14,266)	(4)	14,262
SGD	(286,000)	CALL CT 1.9879 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(5,298)	(8,799)	(3,501)
SGD	(1,144,000)	CALL CT 1.9998 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(35,077)	(20,507)	14,570
SGD	(155,000)	CALL CT 2.0121 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(1,712)	(405)	1,307
SGD	(742,050)	CALL CT 2.0329 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(7,191)	(6,358)	832
SGD	(282,000)	CALL CT 2.04 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(5,509)	(2,886)	2,623
SGD	(272,000)	CALL CT 2.0884 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(5,272)	(2,190)	3,082
SGD	(244,000)	CALL CT 2.122 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(3,867)	(51)	3,817
USD	(99,800)	CALL DDR 16.329 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(39,920)	(27)	39,893
USD	(44,600)	CALL DDR 16.7789 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(6,971)	(7)	6,964
USD	(25,600)	CALL DDR 16.7856 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(5,939)	(5)	5,934
USD	(15,575)	CALL DDR 16.8792 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(2,452)	(68)	2,384
USD	(197,970)	CALL DDR 16.90 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(29,280)	(2)	29,278
USD	(38,400)	CALL DDR 17.2302 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(8,709)	(936)	7,773
USD	(33,000)	CALL DDR 17.3067 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(8,696)	(234)	8,462
USD	(1,008)	CALL DDR 17.5 21/12/13		2013年12月21日	(41,794)	(35,280)	6,515
USD	(37,600)	CALL DDR 17.8436 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(9,122)	(5)	9,117
GBP	(23,500)	CALL DLN 24.48 04/12/13	OTC	2013年12月4日	(27,476)	(823)	26,653
USD	(168,105)	CALL DRE 16.0784 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(34,831)	(5,906)	28,926
USD	(55,600)	CALL DRH 11.09 10/12/13	OTC	2013年12月10日	(18,459)	(23,047)	(4,588)
USD	(90,600)	CALL DRH 11.404 10/12/13	OTC	2013年12月10日	(32,163)	(15,727)	16,436
USD	(53,900)	CALL DRH 11.566 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(5,519)	(5,485)	35
USD	(48,700)	CALL DRH 11.8519 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(5,143)	(2,173)	2,970
USD	(41,300)	CALL DRH 12.0204 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(8,954)	(2,877)	6,076

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	(65,370)	CALL DRH 12.0848	16/12/13	OTC	2013年12月16日	(7,518)	(862)	6,656
USD	(24,400)	CALL DRH 12.3239	26/02/14	OTC	2014年2月26日	(3,897)	(3,507)	390
USD	(41,800)	CALL DRH 12.3754	06/02/14	OTC	2014年2月6日	(6,717)	(3,243)	3,474
AUD	(2,336,000)	CALL DXS 1.107	15/01/14	OTC	2014年1月15日	(33,478)	(2,894)	30,584
USD	(27,900)	CALL EPR 51.44	06/01/14	OTC	2014年1月6日	(18,099)	(12,523)	5,576
USD	(20,900)	CALL EPR 52.47	14/01/14	OTC	2014年1月14日	(19,646)	(5,664)	13,982
USD	(610)	CALL EQR 52.5	18/01/14		2014年1月18日	(44,266)	(48,800)	(4,533)
USD	(38,500)	CALL EQR 54.1996	26/02/14	OTC	2014年2月26日	(28,032)	(24,490)	3,542
USD	(88,391)	CALL EQR 54.5480	09/12/13	OTC	2013年12月9日	(28,276)	(600)	27,676
USD	(38,400)	CALL EQR 55.1666	06/02/14	OTC	2014年2月6日	(28,308)	(10,182)	18,126
USD	(40,600)	CALL EQR 57.5329	18/12/13	OTC	2013年12月18日	(35,436)	(16)	35,419
USD	(36,900)	CALL EQR 58.5077	15/01/14	OTC	2014年1月15日	(25,646)	(253)	25,392
USD	(25,100)	CALL EQY 23.16	05/02/14	OTC	2014年2月5日	(15,293)	(4,393)	10,900
USD	(20,600)	CALL EQY 23.497	06/12/13	OTC	2013年12月6日	(10,506)	(4)	10,502
USD	(26,700)	CALL EQY 24.11	08/01/14	OTC	2014年1月8日	(17,916)	(258)	17,658
USD	(20,536)	CALL ESS 160.7216	07/01/14	OTC	2014年1月7日	(27,929)	(15,708)	12,221
USD	(174)	CALL ESS 165	21/12/13		2013年12月21日	(49,930)	(24,360)	25,570
USD	(238)	CALL EXR 50	21/12/13		2013年12月21日	(16,413)	(16,660)	(248)
AUD	(904,800)	CALL FDC 2.3634	03/12/13	OTC	2013年12月3日	(33,498)	(20,530)	12,968
EUR	(2,002)	CALL FDR 64.5804	12/12/13	OTC	2013年12月12日	(1,158)	(47)	1,111
EUR	(8,832)	CALL FDR 65.3121	26/02/14	OTC	2014年2月26日	(10,492)	(7,963)	2,529
EUR	(8,385)	CALL FDR 65.3378	18/12/13	OTC	2013年12月18日	(10,056)	(185)	9,870
EUR	(8,385)	CALL FDR 67.074	06/02/14	OTC	2014年2月6日	(8,682)	(1,735)	6,947
EUR	(7,826)	CALL FDR 67.6068	15/01/14	OTC	2014年1月15日	(9,776)	(290)	9,486
USD	(19,800)	CALL FRT 106.068	04/12/13	OTC	2013年12月4日	(42,570)	(4,254)	38,316
USD	(8,637)	CALL FRT 110.2192	07/01/14	OTC	2014年1月7日	(6,133)	(3,455)	2,678
USD	(14,079)	CALL FRT 111.6648	16/12/13	OTC	2013年12月16日	(9,070)	(1,228)	7,841
EUR	(11,200)	CALL GFC 100.2122	19/12/13	OTC	2013年12月19日	(36,736)	(766)	35,970
USD	(78,200)	CALL GGP 21.142	05/12/13	OTC	2013年12月5日	(32,578)	(10,376)	22,202
USD	(78,200)	CALL GGP 21.142	19/12/13	OTC	2013年12月19日	(39,092)	(23,576)	15,516
USD	(106,836)	CALL GGP 21.6320	16/12/13	OTC	2013年12月16日	(13,557)	(14,678)	(1,121)
JPY	(810)	CALL GLP J-REIT 102960	09/12/13	OTC	2013年12月9日	(8,943)	(14,010)	(5,068)
AUD	(448,800)	CALL GMG 5.0703	15/01/14	OTC	2014年1月15日	(37,547)	(16,573)	20,974
AUD	(238,901)	CALL GMG 5.252	16/12/13	OTC	2013年12月16日	(9,139)	(705)	8,434
AUD	(37,900)	CALL GPT 3.5519	29/01/14	OTC	2014年1月29日	(1,752)	(2,134)	(382)
AUD	(236,850)	CALL GPT 3.6622	18/12/13	OTC	2013年12月18日	(11,289)	(4,149)	7,141
AUD	(213,120)	CALL GPT 3.7106	26/02/14	OTC	2014年2月26日	(11,318)	(6,668)	4,650
AUD	(150,000)	CALL GPT 3.8117	18/12/13	OTC	2013年12月18日	(7,952)	(294)	7,658
AUD	(268,430)	CALL GPT 3.8257	12/12/13	OTC	2013年12月12日	(6,610)	(125)	6,486
AUD	(221,060)	CALL GPT 3.9177	15/01/14	OTC	2014年1月15日	(9,682)	(286)	9,396
AUD	(236,850)	CALL GPT 4.0088	06/02/14	OTC	2014年2月6日	(10,147)	(386)	9,760
HKD	(190,000)	CALL GUANGZHO R&F 14.628	18/12/13	O	2013年12月18日	(4,320)	(172)	4,147
HKD	(247,200)	CALL GUANGZHO R&F 15.607	06/02/14	O	2014年2月6日	(5,769)	(1,994)	3,775

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	(230,800)	CALL GUANGZHO R&F 16.303 15/01/14 O	2014年1月15日	(5,914)	(503)	5,411
HKD	(260,400)	CALL GUANGZHOU R&F 14.664 26/2/14 O	2014年2月26日	(5,747)	(6,524)	(777)
HKD	(211,200)	CALL GUANGZHOU R&F 16.358 12/12/13O	2013年12月12日	(3,459)	(1)	3,458
HKD	(343,000)	CALL HANG LUNG PR 28.305 15/01/14 O	2014年1月15日	(14,102)	(5,170)	8,932
HKD	(368,000)	CALL HANG LUNG PR 28.694 06/02/14 O	2014年2月6日	(17,180)	(8,677)	8,503
HKD	(417,000)	CALL HANG LUNG PR 29.121 12/12/13 O	2013年12月12日	(12,341)	(26)	12,315
HKD	(341,000)	CALL HANG LUNG PR 29.336 18/12/13 O	2013年12月18日	(14,568)	(95)	14,473
HKD	(353,000)	CALL HANG LUNG PRO 29.098 26/2/14 O	2014年2月26日	(11,976)	(10,195)	1,781
USD	(22,600)	CALL HCN 60.3465 26/02/14 OTC	2014年2月26日	(12,830)	(11,134)	1,696
USD	(44,480)	CALL HCN 62.9824 16/12/13 OTC	2013年12月16日	(15,621)	(402)	15,219
USD	(27,400)	CALL HCN 64.8387 12/12/13 OTC	2013年12月12日	(23,512)	(33)	23,479
USD	(23,600)	CALL HCN 65.3263 06/02/14 OTC	2014年2月6日	(20,905)	(1,111)	19,794
USD	(24,800)	CALL HCN 65.8336 18/12/13 OTC	2013年12月18日	(25,070)	(91)	24,980
USD	(485)	CALL HCN 67.5 21/12/13 OTC	2013年12月21日	(31,546)	(2,425)	29,121
USD	(22,500)	CALL HCN 67.7116 15/01/14 OTC	2014年1月15日	(24,233)	(263)	23,969
USD	(25,800)	CALL HCP 40.092 06/01/14 OTC	2014年1月6日	(29,670)	(4,665)	25,005
USD	(137,061)	CALL HCP 42.0680 09/12/13 OTC	2013年12月9日	(41,022)	(97)	40,925
USD	(4,700)	CALL HCP 43.3367 18/12/13 OTC	2013年12月18日	(3,906)	(21)	3,885
USD	(10,600)	CALL HIW 36.8138 12/12/13 OTC	2013年12月12日	(4,418)	(404)	4,015
USD	(17,600)	CALL HIW 37.1832 18/12/13 OTC	2013年12月18日	(9,052)	(482)	8,569
USD	(15,100)	CALL HIW 37.4928 26/02/14 OTC	2014年2月26日	(9,856)	(4,083)	5,773
USD	(24,200)	CALL HIW 38.834 07/01/14 OTC	2014年1月7日	(15,730)	(362)	15,368
USD	(15,200)	CALL HIW 39.033 06/02/14 OTC	2014年2月6日	(9,088)	(826)	8,263
USD	(14,000)	CALL HIW 39.3029 15/01/14 OTC	2014年1月15日	(6,566)	(201)	6,365
USD	(102,000)	CALL HKL 6.2582 26/02/14 OTC	2014年2月26日	(9,710)	(11,467)	(1,756)
USD	(97,000)	CALL HKL 6.553 06/02/14 OTC	2014年2月6日	(9,516)	(3,522)	5,994
USD	(91,000)	CALL HKL 6.8918 15/01/14 OTC	2014年1月15日	(8,390)	(390)	8,000
USD	(97,000)	CALL HKL 7.1808 18/12/13 OTC	2013年12月18日	(8,003)	(1)	8,002
USD	(27,600)	CALL HME 57.469 09/12/13 OTC	2013年12月9日	(17,664)	(7)	17,657
GBP	(43,600)	CALL HMSO 5.1359 10/12/13 OTC	2013年12月10日	(7,769)	(1,811)	5,958
GBP	(73,000)	CALL HMSO 5.22675 07/01/14 OTC	2014年1月7日	(13,927)	(3,747)	10,181
GBP	(105,600)	CALL HMSO 5.3328 03/01/14 OTC	2014年1月3日	(22,165)	(1,490)	20,676
GBP	(94,800)	CALL HMSO 535.08 26/02/14 OTC	2014年2月26日	(12,660)	(8,229)	4,431
GBP	(96,000)	CALL HMSO 544.095 18/12/13 OTC	2013年12月18日	(9,791)	(49)	9,743
GBP	(106,240)	CALL HMSO 546.953 12/12/13 OTC	2013年12月12日	(7,558)	(5)	7,552
GBP	(68,560)	CALL HMSO 553.8 06/02/14 OTC	2014年2月6日	(8,029)	(1,020)	7,009
GBP	(89,600)	CALL HMSO 553.85 15/01/14 OTC	2014年1月15日	(7,852)	(339)	7,513
USD	(10,500)	CALL HPT 28.03 06/01/14 OTC	2014年1月6日	(4,988)	(5,072)	(84)
USD	(19,000)	CALL HPT 30.62 10/12/13 OTC	2013年12月10日	(11,799)	(28)	11,771
USD	(59,159)	CALL HST 19.4064 02/12/13 OTC	2013年12月2日	(13,027)	(8)	13,019
USD	(267,733)	CALL HST 19.4792 07/01/14 OTC	2014年1月7日	(45,622)	(29,178)	16,444
USD	(39,891)	CALL HST 19.5624 16/12/13 OTC	2013年12月16日	(6,079)	(1,050)	5,030
USD	(280,000)	CALL HT 5.755 13/01/14 OTC	2014年1月13日	(36,400)	(32,838)	3,562

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	(38,600)	CALL HTA 10.705 03/12/13	OTC	2013年12月3日	(11,194)	(3)	11,191
USD	(20,700)	CALL IYR 64.8625 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(19,148)	(4,576)	14,571
JPY	(212)	CALL JAP REA 1165901.106 18/12/13	O	2013年12月18日	(62,638)	(3,818)	58,820
JPY	(27)	CALL JAP REAL ES 1120274 26/02/14	O	2014年2月26日	(3,965)	(8,775)	(4,810)
JPY	(40)	CALL JAP REAL ES 1126320 9/12/13	OT	2013年12月9日	(2,855)	(1,085)	1,770
JPY	(64)	CALL JAP REAL ES 1193572 06/02/14	O	2014年2月6日	(9,998)	(6,062)	3,936
JPY	(83)	CALL JAP REAL ES 1311138 12/12/13	O	2013年12月12日	(7,155)	(2)	7,154
JPY	(73)	CALL JAP REAL EST 1273337 18/12/13O		2013年12月18日	(12,415)	(41)	12,374
JPY	(120)	CALL JAP RET 207605.8758 03/12/13	O	2013年12月3日	(5,224)	(528)	4,696
JPY	(300)	CALL JAP RETA 197032.7338 15/1/14	O	2014年1月15日	(11,648)	(29,440)	(17,792)
JPY	(301)	CALL JAP RETAIL 202904 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(3,096)	(9,073)	(5,977)
JPY	(308)	CALL JAP RETAIL 204993 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(9,664)	(24,173)	(14,510)
JPY	(474)	CALL JAP RETAIL 215537 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(13,182)	(17,523)	(4,341)
JPY	(519)	CALL JAP RETAIL 227166 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(16,973)	(755)	16,218
JPY	(588)	CALL JAP RETAIL 231961 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(8,999)	(101)	8,898
JPY	(172)	CALL JAPAN REAL E 1148160 2/12/13	O	2013年12月2日	(17,169)	(17)	17,151
JPY	(109)	CALL JAPAN REAL E 1151280 16/12/13	O	2013年12月16日	(7,626)	(2,620)	5,006
JPY	(57)	CALL JAPAN REAL E 1242297 15/1/14	O	2014年1月15日	(6,880)	(1,053)	5,827
JPY	(164)	CALL JAPAN REAL 1092540 07/01/14	OT	2014年1月7日	(15,742)	(42,528)	(26,785)
JPY	(492)	CALL JAPAN RET 202085.46 3/12/13	OT	2013年12月3日	(40,755)	(10,526)	30,229
JPY	(639)	CALL JAPAN RET 204984 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(15,011)	(4,892)	10,119
JPY	(474)	CALL JAPAN RET 212264 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(5,144)	(5,397)	(253)
JPY	(382)	CALL JAPAN RET 223222 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(11,314)	(5,216)	6,098
USD	(20,100)	CALL KIM 21.4822 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(5,938)	(298)	5,640
USD	(75,089)	CALL KIM 21.7984 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(8,027)	(912)	7,115
USD	(20,200)	CALL KIM 21.8767 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(5,109)	(20)	5,089
USD	(13,400)	CALL KIM 21.9427 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(4,627)	(164)	4,463
USD	(122,226)	CALL KIM 21.9648 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(14,459)	(21)	14,439
USD	(21,200)	CALL KIM 22.1328 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(6,197)	(1,046)	5,151
USD	(20,100)	CALL KIM 22.5131 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(5,158)	(250)	4,908
USD	(29,900)	CALL KRC 53.97 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(21,833)	(4,185)	17,648
USD	(31,500)	CALL KRC 54.1155 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(22,434)	(25,941)	(3,506)
USD	(29,900)	CALL KRC 54.9707 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(24,925)	(13,575)	11,350
USD	(230)	CALL KRC 55 21/12/13		2013年12月21日	(19,380)	(14,950)	4,430
USD	(33,100)	CALL KRC 55.1423 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(12,383)	(911)	11,471
USD	(27,900)	CALL KRC 56.8735 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(21,600)	(2,907)	18,693
GBP	(41,408)	CALL LAND 1007.654 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(9,064)	(2,170)	6,894
GBP	(53,200)	CALL LAND 1041.11 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(10,336)	(281)	10,055
GBP	(57,000)	CALL LAND 971.899 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(10,593)	(1,183)	9,410
GBP	(63,080)	CALL LAND 977.546 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(9,068)	(332)	8,737
GBP	(53,720)	CALL LAND 989.516 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(11,658)	(7,983)	3,675
GBP	(137,313)	CALL LAND 9.9320 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(9,496)	(3,664)	5,832
EUR	(10,900)	CALL LEG GY 42.60 17/12/13	OTC	2013年12月17日	(22,889)	(9,078)	13,810

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	(98)	CALL LHO 29.25 11/12/13	FLEX	2013年12月11日	(9,698)	(22,340)	(12,642)
USD	(45,000)	CALL LHO 31.77 11/12/13	OTC	2013年12月11日	(29,250)	(20,669)	8,581
USD	(26,747)	CALL LHO 32.1152 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(6,689)	(7,626)	(936)
EUR	(12,450)	CALL LI 32.9934 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(7,727)	(20,057)	(12,330)
EUR	(10,220)	CALL LI 34.125 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(6,525)	(4,468)	2,057
EUR	(7,740)	CALL LI 34.1997 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(2,860)	(811)	2,049
EUR	(19,672)	CALL LI 34.6372 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(5,316)	(12)	5,304
EUR	(10,950)	CALL LI 34.6448 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(6,831)	(3,752)	3,079
EUR	(16,706)	CALL LI 35.152 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(7,200)	(249)	6,951
EUR	(12,352)	CALL LI 35.5628 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(3,414)	0	3,413
EUR	(4,460)	CALL LI 35.5784 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(2,904)	(797)	2,107
HKD	(332,000)	CALL LINK REAL E 39.1928 15/01/14 O		2014年1月15日	(25,422)	(19,811)	5,612
HKD	(332,000)	CALL LINK REAL E 39.1928 29/01/14 O		2014年1月29日	(29,910)	(24,821)	5,089
HKD	(741,166)	CALL LINK REAL E 41.1320 16/12/13 O		2013年12月16日	(13,612)	(866)	12,746
HKD	(52,500)	CALL LINK REIT 40.212 18/12/13 OTC		2013年12月18日	(3,721)	(340)	3,381
HKD	(43,500)	CALL LINK REIT 40.233 06/02/14 OTC		2014年2月6日	(3,025)	(2,074)	951
HKD	(46,000)	CALL LINK REIT 40.725 26/02/14 OTC		2014年2月26日	(3,169)	(2,376)	793
HKD	(49,000)	CALL LINK REIT 41.357 15/01/14 OTC		2014年1月15日	(3,518)	(607)	2,912
USD	(84,328)	CALL LRY 35.9216 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(22,431)	(8)	22,423
USD	(26,400)	CALL MAC 59.9627 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(21,920)	(321)	21,599
USD	(10,416)	CALL MAC 59.9872 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(5,467)	(962)	4,505
USD	(200)	CALL MAC 60 21/12/13		2013年12月21日	(20,392)	(3,000)	17,392
USD	(44,485)	CALL MAC 60.3304 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(18,065)	(227)	17,838
USD	(28,600)	CALL MAC 60.7364 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(19,757)	(6,498)	13,259
USD	(27,200)	CALL MAC 61.5698 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(22,222)	(3,092)	19,131
USD	(25,300)	CALL MAC 62.3384 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(21,718)	(632)	21,086
USD	(29,000)	CALL MAC 62.9565 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(12,398)	(1)	12,396
AUD	(1,238,270)	CALL MGR 1.7566 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(13,014)	(4,816)	8,198
SGD	(339,690)	CALL MINT 1.4196 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(1,526)	(27)	1,499
JPY	(119)	CALL MORI TRUST 869445 07/01/14 OTC		2014年1月7日	(6,818)	(16,054)	(9,236)
JPY	(116)	CALL MORI TST SO 884000 09/12/13 OTC		2013年12月9日	(6,597)	(1,924)	4,673
JPY	(90)	CALL NIPPO PR 929800.5157 29/1/14 O		2014年1月29日	(22,401)	(63,864)	(41,463)
JPY	(125)	CALL NIPPON PROL 967660.4 3/12/13 O		2013年12月3日	(45,603)	(29,944)	15,659
JPY	(140)	CALL NP BLD 1216598.5895 03/12/13 O		2013年12月3日	(37,933)	(7,067)	30,866
JPY	(26)	CALL NP BLDG 1218253 26/02/14 OTC		2014年2月26日	(5,453)	(8,885)	(3,432)
JPY	(186)	CALL NP BLDG 1235362.5 07/01/14 OTC		2014年1月7日	(13,167)	(23,381)	(10,214)
JPY	(41)	CALL NP BLDG 1241760 02/12/13 OTC		2013年12月2日	(6,388)	(160)	6,227
JPY	(187)	CALL NP BLDG 1260480 16/12/13 OTC		2013年12月16日	(16,371)	(7,019)	9,351
JPY	(61)	CALL NP BLDG 1282942 06/02/14 OTC		2014年2月6日	(8,873)	(6,654)	2,219
JPY	(44)	CALL NP BLDG 1291908 15/01/14 OTC		2014年1月15日	(5,592)	(2,140)	3,451
JPY	(64)	CALL NP BLDG 1366737 18/12/13 OTC		2013年12月18日	(11,712)	(53)	11,658
JPY	(73)	CALL NP BLDG 1377457 12/12/13 OTC		2013年12月12日	(6,541)	(5)	6,535
USD	(20,200)	CALL O 40.5148 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(9,292)	(2,162)	7,130

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	(21,700)	CALL O 42.6555 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(12,668)	(2)	12,667
USD	(19,100)	CALL O 43.831 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(11,202)	(44)	11,158
USD	(20,300)	CALL O 44.1506 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(12,422)	(14)	12,407
JPY	(440)	CALL ORIX JRE 123012 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(11,361)	(27,730)	(16,369)
JPY	(700)	CALL ORIX JRE 125372.586 18/12/13	O	2013年12月18日	(27,910)	(25,631)	2,279
USD	(590)	CALL PLD 40 18/01/14		2014年1月18日	(35,449)	(25,370)	10,079
USD	(79,052)	CALL PLD 40.0608 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(26,799)	(16,801)	9,998
USD	(39,200)	CALL PLD 40.5685 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(24,139)	(20,827)	3,313
USD	(42,700)	CALL PLD 40.6882 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(15,825)	(231)	15,594
USD	(38,600)	CALL PLD 40.981 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(18,482)	(567)	17,915
USD	(515)	CALL PLD 41 21/12/13		2013年12月21日	(32,315)	(5,150)	27,165
USD	(33,700)	CALL PLD 42.3632 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(18,821)	(4,655)	14,166
USD	(35,700)	CALL PLD 42.3863 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(20,727)	(2,032)	18,695
USD	(8,000)	CALL PSA 164.9833 26/2/14	OTC	2014年2月26日	(12,335)	(10,730)	1,606
USD	(120)	CALL PSA 165 21/12/13		2013年12月21日	(8,048)	(1,800)	6,248
USD	(9,000)	CALL PSA 165.5147 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(17,544)	(188)	17,356
USD	(6,300)	CALL PSA 168.2807 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(16,389)	(198)	16,191
USD	(7,900)	CALL PSA 170.6146 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(20,814)	(2,907)	17,907
USD	(122)	CALL PSA 175 21/12/13		2013年12月21日	(30,739)	(610)	30,129
USD	(7,600)	CALL PSA 177.0401 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(26,229)	(344)	25,885
CHF	(5,800)	CALL PSPN 79.25 17/12/13	OTC	2013年12月17日	(11,811)	(1,216)	10,595
CAD	(17,200)	CALL REF-U 43.299 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(8,476)	(197)	8,278
USD	(9,800)	CALL REG 50.2381 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(6,520)	(1,973)	4,547
USD	(12,100)	CALL REG 50.9807 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(8,504)	(26)	8,478
USD	(10,000)	CALL REG 52.4754 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(8,085)	(381)	7,704
USD	(10,100)	CALL REG 53.8003 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(8,614)	(63)	8,552
USD	(32,500)	CALL RLJ 25.56 13/12/13	OTC	2013年12月13日	(14,008)	(263)	13,744
USD	(195)	CALL RWX 43 21/12/13		2013年12月21日	(11,498)	(2,925)	8,573
USD	(30,000)	CALL SBRA 27.88 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(16,647)	(4,799)	11,848
AUD	(104,800)	CALL SGP 4.0598 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(6,580)	(1,214)	5,366
AUD	(324,000)	CALL SGP 4.0923 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(17,139)	(1,735)	15,404
AUD	(204,000)	CALL SGP 4.1905 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(9,341)	(2,308)	7,033
AUD	(367,200)	CALL SGP 4.1996 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(13,088)	(201)	12,888
GBP	(81,672)	CALL SGRO 331.67 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(5,486)	(7,300)	(1,814)
GBP	(51,300)	CALL SGRO 337.921 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(3,747)	(6,840)	(3,094)
GBP	(38,236)	CALL SGRO 347.272 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(2,889)	(3,874)	(985)
USD	(30,198)	CALL SHO 13.4160 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(4,246)	(3,562)	684
USD	(133,763)	CALL SHO 13.8840 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(19,289)	(10,882)	8,407
HKD	(704,000)	CALL SINO LAND 11.634 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(17,527)	(10,879)	6,648
HKD	(694,000)	CALL SINO LAND 11.858 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(13,509)	(11,883)	1,625
HKD	(798,000)	CALL SINO LAND 12.166 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(10,188)	(20)	10,168
HKD	(548,000)	CALL SINO LAND 12.254 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(11,314)	(1,522)	9,792
HKD	(704,000)	CALL SINO LAND 12.372 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(15,061)	(59)	15,002

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	(57,400)	CALL SKT 35.1104 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(14,534)	(8,043)	6,490
USD	(14,700)	CALL SLG 89.24 06/12/13	OTC	2013年12月6日	(40,715)	(27,455)	13,259
USD	(18,816)	CALL SLG 95.0872 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(11,182)	(1,143)	10,039
USD	(16,156)	CALL SLG 95.8048 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(8,335)	(1,966)	6,369
USD	(41,600)	CALL SNH 24.24 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(19,552)	(229)	19,323
HKD	(157,500)	CALL SOHO CHINA 7.211 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(1,706)	(968)	738
HKD	(147,000)	CALL SOHO CHINA 7.322 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(1,350)	(1,707)	(357)
HKD	(157,500)	CALL SOHO CHINA 7.353 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(1,650)	(2,733)	(1,083)
USD	(31,100)	CALL SPG 154.38 08/01/14	OTC	2014年1月8日	(91,278)	(45,869)	45,409
USD	(20,451)	CALL SPG 156.7176 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(24,962)	(16,927)	8,036
USD	(29,269)	CALL SPG 158.1424 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(20,919)	(1,557)	19,361
USD	(20,300)	CALL SPG 159.7675 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(30,470)	(721)	29,749
USD	(423)	CALL SPG 160 21/12/13		2013年12月21日	(107,424)	(4,653)	102,771
USD	(19,100)	CALL SPG 160.0752 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(34,777)	(27,989)	6,789
USD	(22,500)	CALL SPG 162.4627 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(25,027)	(44)	24,983
USD	(19,300)	CALL SPG 163.6401 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(36,166)	(12,932)	23,234
USD	(18,400)	CALL SPG 166.53 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(36,478)	(2,874)	33,604
USD	(156,422)	CALL SRC 10.6080 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(12,920)	(3,856)	9,065
USD	(31,200)	CALL STAG 20.50 02/12/13	OTC	2013年12月2日	(19,343)	(37,203)	(17,859)
USD	(713)	CALL STAG 22.5 21/12/13		2013年12月21日	(22,432)	(21,390)	1,042
SGD	(104,000)	CALL SUN 1.6105 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(1,287)	(1,054)	234
SGD	(108,000)	CALL SUN 1.6399 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(1,193)	(5)	1,188
SGD	(277,000)	CALL SUN 1.764 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(4,455)	(33)	4,422
SGD	(290,000)	CALL SUN 1.7886 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(5,689)	(2)	5,686
USD	(20,600)	CALL TCO 68.8188 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(18,703)	(5,547)	13,156
USD	(21,300)	CALL TCO 71.3181 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(23,044)	(17)	23,027
USD	(21,700)	CALL TCO 72.2776 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(20,294)	(1,776)	18,518
USD	(19,800)	CALL TCO 75.5753 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(23,257)	(61)	23,196
USD	(51,900)	CALL UDR 24.67 03/01/14	OTC	2014年1月3日	(29,308)	(805)	28,502
USD	(33,000)	CALL UDR 24.9087 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(10,949)	(2,215)	8,734
USD	(192,608)	CALL UDR 24.9288 09/12/13	OTC	2013年12月9日	(25,848)	(4)	25,844
USD	(36,600)	CALL UDR 25.1535 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(10,976)	(20)	10,957
USD	(32,400)	CALL UDR 25.4701 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(11,048)	(459)	10,589
USD	(34,100)	CALL UDR 26.1251 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(10,636)	(56)	10,580
EUR	(5,127)	CALL UL 197.248 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(18,440)	(7,543)	10,898
EUR	(20,500)	CALL UL 198.0772 19/12/13	OTC	2013年12月19日	(126,876)	(26,369)	100,507
EUR	(24,190)	CALL UL 199.16 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(45,389)	(51,336)	(5,947)
EUR	(11,846)	CALL UL 199.368 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(16,822)	(8,917)	7,905
EUR	(4,443)	CALL UL 200.6993 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(7,876)	(1,404)	6,473
EUR	(4,133)	CALL UL 202.51 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(15,145)	(16,854)	(1,709)
EUR	(4,196)	CALL UL 204.156 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(15,281)	(9,780)	5,501
EUR	(4,365)	CALL UL 205.0856 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(16,341)	(4,422)	11,920
USD	(26,700)	CALL VNO 87.9552 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(36,060)	(39,305)	(3,244)



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	(24,500)	CALL VNO 89.13 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(37,412)	(20,610)	16,801
USD	(29,600)	CALL VNO 89.9466 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(29,949)	(12,536)	17,413
USD	(46)	CALL VNO 90 21/12/13		2013年12月21日	(6,622)	(4,600)	2,022
USD	(26,700)	CALL VNO 92.4233 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(38,089)	(34,521)	3,569
USD	(25,041)	CALL VNO 93.0176 16/12/13	OTC	2013年12月16日	(12,318)	(2,338)	9,980
USD	(24,200)	CALL VNO 93.3329 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(31,385)	(11,855)	19,530
USD	(14,025)	CALL VNO 93.3504 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(10,449)	(5,196)	5,253
USD	(25,900)	CALL VNO 93.903 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(32,867)	(16,156)	16,711
USD	(29,000)	CALL VTR 61.0408 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(23,403)	(21,009)	2,394
USD	(108,094)	CALL VTR 62.1504 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(52,328)	(10,346)	41,983
USD	(30,500)	CALL VTR 65.773 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(27,776)	(5)	27,771
USD	(27,500)	CALL VTR 66.2316 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(27,572)	(31)	27,541
USD	(27,500)	CALL VTR 67.4812 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(24,651)	(1,337)	23,314
USD	(25,700)	CALL VTR 70.1696 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(24,528)	(96)	24,432
AUD	(44,160)	CALL WDC 10.8068 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(5,073)	(4,020)	1,054
AUD	(587,000)	CALL WDC 11.0312 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(100,130)	(20,270)	79,859
AUD	(56,550)	CALL WDC 11.4262 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(6,982)	(1,205)	5,777
AUD	(56,550)	CALL WDC 11.4874 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(8,377)	(52)	8,325
AUD	(52,780)	CALL WDC 11.5694 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(8,068)	(402)	7,666
AUD	(64,090)	CALL WDC 11.6208 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(7,981)	(5)	7,976
EUR	(9,877)	CALL WHA 55.0605 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(6,800)	(18,213)	(11,413)
EUR	(8,611)	CALL WHA 58.4834 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(9,307)	(7,502)	1,805
EUR	(8,330)	CALL WHA 59.2594 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(6,655)	(1,509)	5,146
EUR	(8,175)	CALL WHA 59.8243 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(8,954)	(2,246)	6,708
SEK	(10,800)	CALL WIHL 103.02 17/12/13	OTC	2013年12月17日	(4,109)	(17,358)	(13,250)
SEK	(15,400)	CALL WIHL 105.0876 04/12/13	OTC	2013年12月4日	(5,585)	(19,781)	(14,196)
SEK	(5,700)	CALL WIHL 113.985 10/01/14	OTC	2014年1月10日	(1,666)	(1,155)	511
SEK	(18,200)	CALL WIHL 114.13 11/12/13	OTC	2013年12月11日	(5,849)	(1,045)	4,804
USD	(20,400)	CALL WRI 30.555 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(7,071)	(2,543)	4,528
USD	(16,700)	CALL WRI 30.8547 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(4,813)	(1)	4,811
USD	(22,500)	CALL WRI 30.9638 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(9,693)	(14)	9,678
USD	(21,000)	CALL WRI 32.4927 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(10,826)	(56)	10,768
USD	(18,800)	CALL WRI 32.58 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(8,178)	(146)	8,031
AUD	(121,890)	CALL WRT 3.0862 26/02/14	OTC	2014年2月26日	(4,060)	(5,031)	(971)
AUD	(1,014,800)	CALL WRT 3.1006 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(61,100)	(39,508)	21,592
AUD	(170,700)	CALL WRT 3.1464 18/12/13	OTC	2013年12月18日	(5,999)	(1,258)	4,740
AUD	(933,182)	CALL WRT 3.1588 07/01/14	OTC	2014年1月7日	(18,140)	(16,015)	2,125
AUD	(159,320)	CALL WRT 3.1903 15/01/14	OTC	2014年1月15日	(5,792)	(2,509)	3,282
AUD	(170,700)	CALL WRT 3.233 06/02/14	OTC	2014年2月6日	(6,890)	(3,230)	3,660
AUD	(193,460)	CALL WRT 3.2338 12/12/13	OTC	2013年12月12日	(4,764)	(97)	4,666
					(6,868,743)	(2,639,272)	4,229,471

# 野村マネー マザーファンド

第12期(2014年8月19日決算)  
(計算期間：2013年8月20日～2014年8月19日)

## 《運用報告書》

受益者のみなさまへ

野村マネー マザーファンドの第12期の運用状況をご報告申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12-1

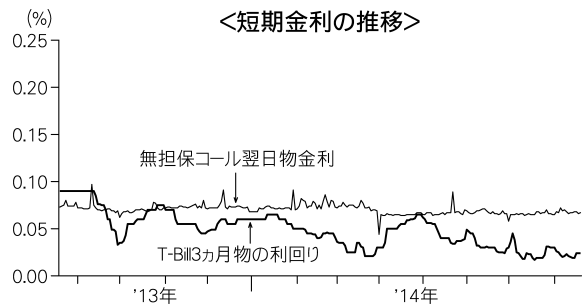
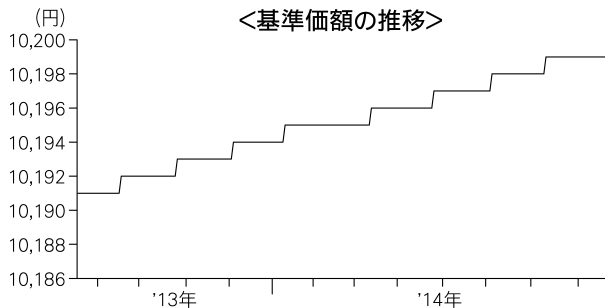
<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ◎運用経過

### 1. 基準価額の推移

\* 基準価額は0.08%の上昇

基準価額は、期初10,191円から期末は10,199円となりました。



## ○運用環境

国内経済は、2014年4月の消費税増税に伴う駆け込み需要の反動減の影響を受けつつも、期を通じて底堅く推移した個人消費や、企業収益の改善に伴い緩やかな増加がみられる設備投資などの内需が下支えとなる一方、輸出は弱めの動きとなりました。このような中、日本銀行は、前年比2%の物価上昇を目指す「量的・質的金融緩和」を継続しました。

### ●無担保コール翌日物金利の推移

概ね0.06%台～0.07%台で推移しました。

### ●T-Bill(国庫短期証券)3ヵ月物の利回りの推移

- ・ 期初から2013年9月半ばまでは概ね0.09%台で推移しました。
- ・ 2013年9月末以降、需給の変化を受けて概ね0.02%台から0.07%台の範囲で推移し、期末には0.02%台となりました。

## 2. ポートフォリオ

- (1) 残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー (CP) 等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、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るという方針のもと、運用してまいりました。
- (2) 今期の運用につきましては、国債を中心に政府保証債や利付金融債、CPによってポートフォリオを構築し、流動性に関しては、債券現先取引やコール・ローンなどにより運用してまいりました。

### ◎今後の運用方針

残存期間の短い公社債やCP等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、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る運用を行なう方針です。

今後とも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の明細

項 目	当 期
(a) 保 管 費 用 等	0円
合 計	0

\* (a) 保管費用等は、期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

\* 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

### ◎期中の売買及び取引の状況 (自2013年8月20日 至2014年8月19日)

#### (1) 公社債

	買付額	売付額
国 内	千円	千円
国 債 証 券	84,793,709	58,094,433 (28,403,900)
特 殊 債 券	4,391,973	— (1,935,000)
社債券 (投資法人債券を含む)	841,662	— (700,000)

\* 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。

## (2) その他有価証券

		買付額	売付額
国	内	千円	千円
	コマーシャル・ペーパー	1,099,678	— (600,000)

- \*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。

## ◎組入資産の明細

## (1) 国内(邦貨建)公社債

区 分	期 首					当 期					末				
	組入比率	うちBBB格 以下組入比率		残存期間別組入比率			額面金額	評価額	組入比率	うちBBB格 以下組入比率		残存期間別組入比率			
		%	%	%	%	%				%	%	%	%	%	
国 債 証 券	73.4 (60.2)	— (—)	— (—)	— (—)	73.4 (60.2)	2,179,350 (—)	2,179,848 (—)	25.2 (—)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	25.2 (—)		
特殊債券(除く金融債)	6.6 (6.6)	— (—)	— (—)	— (—)	6.6 (6.6)	2,290,000 (2,290,000)	2,301,511 (2,301,511)	26.6 (26.6)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	26.6 (26.6)		
金 融 債 券	0.9 (0.9)	— (—)	— (—)	— (—)	0.9 (0.9)	540,000 (540,000)	540,935 (540,935)	6.3 (6.3)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	6.3 (6.3)		
普通社債券(含む投資法人債券)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	140,000 (140,000)	140,014 (140,014)	1.6 (1.6)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	1.6 (1.6)		
合 計	80.9 (67.7)	— (—)	— (—)	— (—)	80.9 (67.7)	5,149,350 (2,970,000)	5,162,309 (2,982,460)	59.7 (34.5)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	59.7 (34.5)		

- \* ( )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。  
 \*—印は組み入れなし。  
 \*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。

## 国内(邦貨建)公社債銘柄別

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評価額	償還年月日
			千円	千円	
国 債 証 券	国庫債券 利付(2年)第320回	0.1	260,000	260,016	2014/9/15
	国庫債券 利付(2年)第321回	0.1	547,300	547,339	2014/10/15
	国庫債券 利付(2年)第322回	0.1	395,000	395,047	2014/11/15
	国庫債券 利付(2年)第323回	0.1	202,650	202,676	2014/12/15
	国庫債券 利付(2年)第324回	0.1	190,000	190,037	2015/1/15
	国庫債券 利付(2年)第325回	0.1	140,000	140,036	2015/2/15
	国庫債券 利付(2年)第327回	0.1	129,000	129,026	2015/4/15
	国庫債券 利付(5年)第85回	0.7	132,200	132,277	2014/9/20
	国庫債券 利付(5年)第86回	0.6	115,100	115,155	2014/9/20
	国庫債券 利付(10年)第263回	1.6	39,900	39,955	2014/9/20
	国庫債券 利付(10年)第264回	1.5	15,050	15,069	2014/9/20
	国庫債券 利付(20年)第27回	5.0	13,150	13,210	2014/9/22
小 計		—	—	2,179,848	—
特殊債券(除く金融債)	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第331回	1.8	63,000	63,029	2014/8/29
	道路債券 政府保証第334回	1.5	100,000	100,379	2014/11/28
	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第336回	1.4	170,000	170,984	2015/1/28

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第337回	1.3	千円 71,000	千円 71,447	2015/2/27
	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第338回	1.5	54,000	54,453	2015/3/27
	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第341回	1.3	100,000	100,927	2015/5/29
	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第343回	1.3	171,000	172,781	2015/6/30
	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第345回	1.2	50,000	50,524	2015/7/29
	首都高速道路債券 政府保証第193回	1.5	100,000	100,139	2014/9/26
	首都高速道路債券 政府保証第195回	1.4	211,000	212,205	2015/1/26
	首都高速道路債券 政府保証第198回	1.3	10,000	10,103	2015/6/26
	阪神高速道路債券 政府保証第141回	1.5	53,000	53,202	2014/11/28
	阪神高速道路債券 政府保証第145回	1.4	10,000	10,087	2015/4/20
	阪神高速道路債券 政府保証第147回	1.2	50,000	50,526	2015/7/29
	公営企業債券 政府保証第842回	1.8	55,000	55,019	2014/8/26
	公営企業債券 政府保証第843回	1.5	30,000	30,048	2014/9/29
	公営企業債券 政府保証第844回	1.6	12,000	12,034	2014/10/28
	公営企業債券 政府保証第845回	1.5	60,000	60,228	2014/11/28
	公営企業債券 政府保証第847回	1.4	100,000	100,572	2015/1/27
	公営企業債券 政府保証第848回	1.3	105,000	105,654	2015/2/24
	中小企業債券 政府保証第182回	1.5	70,000	70,098	2014/9/24
	国民生活債券 政府保証第14回	1.5	375,000	375,359	2014/9/17
	都市再生債券 政府保証第22回	0.4	120,000	120,214	2015/3/10
関西国際空港債券 政府保証第47回	1.3	150,000	151,488	2015/6/17	
小 計		—	—	2,301,511	—
金 融 債 券	商工債券 利付第711回い号	1.0	100,000	100,022	2014/8/27
	商工債券 利付第718回い号	0.65	70,000	70,231	2015/3/27
	農林債券 利付第711回い号	1.05	70,000	70,016	2014/8/27
	農林債券 利付第719回い号	0.7	100,000	100,404	2015/4/27
	しんきん中金債券 利付第237回	1.0	50,000	50,011	2014/8/27
	しんきん中金債券 利付第242回	0.7	50,000	50,130	2015/1/27
商工債券 利付(3年)第146回	0.3	100,000	100,118	2015/3/27	
小 計		—	—	540,935	—
普通社債券(含む投資法人債券)	東邦瓦斯 第35回社債間限定同順位特約付	0.3	140,000	140,014	2014/9/9
小 計		—	—	140,014	—
合 計		—	—	5,162,309	—

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## (2) 国内その他有価証券

区 分	期 首		当 期 末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 —	% —	千円 499,839	% 5.8

\*比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\*一印は組み入れなし。

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ◎投資信託財産の構成

(2014年8月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	5,162,309	58.5
そ の 他 有 価 証 券	499,839	5.7
コール・ローン等、その他	3,165,958	35.8
投資信託財産総額	8,828,106	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

(2014年8月19日)現在

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	8,828,106,541
コール・ローン等	3,153,091,003
公社債(評価額)	5,162,309,235
その他有価証券	499,839,922
未 収 利 息	7,954,384
前 払 費 用	4,911,997
(B) 負 債	180,029,000
未 払 金	180,029,000
(C) 純資産総額(A-B)	8,648,077,541
元 本	8,478,942,189
次期繰越損益金	169,135,352
(D) 受益権総口数	8,478,942,189口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,199円

## ◎損益の状況

(自2013年8月20日 至2014年8月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	24,840,577
受 取 利 息	23,802,394
そ の 他 収 益 金	1,038,183
(B) 有価証券売買損益	△ 19,039,618
売 買 益	69,649
売 買 損	△ 19,109,267
(C) 信 託 報 酬 等	△ 108,072
(D) 当期損益金(A+B+C)	5,692,887
(E) 前期繰越損益金	99,189,715
(F) 追加信託差損益金	209,503,691
(G) 解約差損益金	△ 145,250,941
(H) 計(D+E+F+G)	169,135,352
次期繰越損益金(H)	169,135,352

\*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。

\*損益の状況の中で(G)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。

(注)期首元本額5,198百万円、期中追加設定元本額10,671百万円、期中一部解約元本額7,391百万円、計算口数当たり純資産額10,199円。

## ◎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
	百万円
野村アフリカ株投資 マネーボール・ファンド	14
野村米国ハイ・イールド債券投資(マネーボールファンド)年2回決算型	86
野村新中國株投資 マネーボール・ファンド	34
野村日本ブランド株投資(マネーボールファンド)年2回決算型	557
野村新米國ハイ・イールド債券投資(マネーボールファンド)年2回決算型	13
野村ビクテ・ジェネリック&ゲノム マネーボール・ファンド	7
野村RCM・グリーン・テクノロジー マネーボール・ファンド	1
野村新興國消費関連株投資 マネーボール・ファンド	10
野村世界業種別投資シリーズ(マネーボール・ファンド)	34
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド)	304
野村新エマージング債券投資(マネーボールファンド)年2回決算型	6
野村クラウドコンピューティング&スマートグリッド関連株投資 マネーボールファンド	19
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(マネーボールファンド)年2回決算型	9
野村グローバルCB投資(マネーボールファンド)年2回決算型	4
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	65
野村PIMCO新興國インフラ関連債券投資(マネーボールファンド)年2回決算型	1
野村日本スマートシティ株投資 マネーボールファンド	18
野村世界高金利通貨投資	151
野村新世界高金利通貨投資	0
コインの未来(毎月分配型)	3
コインの未来(年2回分配型)	0
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)	0
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース)	0
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース)	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(ユーロコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(米ドルコース)年2回決算型	0
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	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	0
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	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資(円コース)毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	0
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	0
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資(円コース)年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
野村新米國ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村新米國ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)毎月分配型	0
野村新米國ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	0
野村新米國ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	0
野村新米國ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)毎月分配型	0
野村新米國ハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型	0
野村新米國ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)年2回決算型	0
野村新米國ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	0
野村新米國ハイ・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	0
野村新米國ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)年2回決算型	0

ファンド名	当期末
	元本額
	百万円
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投資 Aコース	0
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投資 Bコース	0
野村新エマージング債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(豪ドルコース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(中国元コース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(インドネシアルピアコース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(円コース)年2回決算型	0
野村新エマージング債券投資(米ドルコース)年2回決算型	0
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	0
野村新エマージング債券投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	0
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	0
野村新エマージング債券投資(中国元コース)年2回決算型	0
野村新エマージング債券投資(インドネシアルピアコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
野村高金利国際機関債投資(毎月分配型)	49
野村アジアCB投資(毎月分配型)	0
野村グローバルCB投資(円コース)毎月分配型	0
野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)毎月分配型	0
野村グローバルCB投資(アジア通貨コース)毎月分配型	0
野村グローバルCB投資(円コース)年2回決算型	0
野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)年2回決算型	0
野村グローバルCB投資(アジア通貨コース)年2回決算型	0
ノムラ新興國債券ファンズ(野村SMA向け)	0
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	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(米ドルコース)毎月分配型	0
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	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	0
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	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(米ドルコース)年2回決算型	0
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	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	0
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	0
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	0
野村PIMCO新興國インフラ関連債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村PIMCO新興國インフラ関連債券投資(資源国通貨コース)毎月分配型	0
野村PIMCO新興國インフラ関連債券投資(アジア通貨コース)毎月分配型	0
野村PIMCO新興國インフラ関連債券投資(円コース)年2回決算型	0
野村PIMCO新興國インフラ関連債券投資(資源国通貨コース)年2回決算型	0
野村PIMCO新興國インフラ関連債券投資(アジア通貨コース)年2回決算型	0
野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	0
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	0
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	0
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型	0
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	0
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	0



ファンド名	当期末 元本額
	百万円
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型	0
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	0
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	0
野村テンブルトン・トータル・リターン Aコース	0
野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース	0
野村テンブルトン・トータル・リターン Cコース	0
野村テンブルトン・トータル・リターン Dコース	0
野村高金利国際機関債投資(年2回決算型)	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース)年2回決算型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(通貨セレクトコース)毎月分配型	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
ノムラ・アジア・コレクション(短期アジア現地通貨建て債券 Aコース)	0
ノムラ・アジア・コレクション(短期アジア現地通貨建て債券 Bコース)	0
野村アジアハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村アジアハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース)毎月分配型	0
野村アジアハイ・イールド債券投資(アジア通貨セレクトコース)毎月分配型	0
野村アジアハイ・イールド債券投資(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型	0
野村アジアハイ・イールド債券投資(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型	0
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	0
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	0
野村グローバルREITプレミアム(円コース)毎月分配型	0
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	0
野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型	0
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	0
野村日本高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	0
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	0
野村日本高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
野村カルミニャック・ファンド Aコース	0
野村カルミニャック・ファンド Bコース	0
野村通貨選択日本株投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投資(ユーロコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投資(豪ドルコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投資(トルコリラコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投資(メキシコペソコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投資(中国元コース)毎月分配型	0
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	0
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	0
野村通貨選択日本株投資(ユーロコース)年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投資(豪ドルコース)年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	0
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	0
野村通貨選択日本株投資(メキシコペソコース)年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投資(中国元コース)年2回決算型	0
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	0

ファンド名	当期末 元本額
	百万円
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	0
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	0
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	0
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	0
ノムラ THE USA Aコース	0
ノムラ THE USA Bコース	0
ノムラ THE EUROPE Aコース	0
ノムラ THE EUROPE Bコース	0
米国変動好金利ファンド Aコース	8
米国変動好金利ファンド Bコース	0
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	0
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	0
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
野村グローバルボンド投資 Aコース	0
野村グローバルボンド投資 Bコース	0
野村グローバルボンド投資 Cコース	0
野村グローバルボンド投資 Dコース	0
野村グローバルボンド投資 Eコース	0
野村グローバルボンド投資 Fコース	0
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	0
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	0
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	0
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	0
第1回 野村短期公社債ファンド	0
第2回 野村短期公社債ファンド	0
第3回 野村短期公社債ファンド	0
第4回 野村短期公社債ファンド	0
第5回 野村短期公社債ファンド	0
第6回 野村短期公社債ファンド	0
第7回 野村短期公社債ファンド	0
第8回 野村短期公社債ファンド	0
第9回 野村短期公社債ファンド	0
第10回 野村短期公社債ファンド	0
第11回 野村短期公社債ファンド	0
第12回 野村短期公社債ファンド	0
野村グローバル債券為替ファンド(適格機関投資家販売制限付)	110
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(非課税適格機関投資家専用)	3,806
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)	3,030
グローバル・マルチテーマ・ファンドP ハイブリッド型(適格機関投資家専用)	0
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース	0
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Bコース	0

\*単位未満は切り捨て。

### ＜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。

(2015年2月9日現在)

年 月	日
2015年2月	16
3月	—
4月	3、6
5月	1、14、25
6月	23
7月	3
8月	31
9月	7
10月	—
11月	11、26
12月	24、25、28

※2015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。