

野村外国債券インデックス (野村SMA向け)

運用報告書(全体版)

第6期(決算日2016年7月20日)

作成対象期間(2015年7月22日～2016年7月20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/海外/債券/インデックス型 | |
| 信託期間 | 2010年7月30日以降、無期限とします。 | |
| 運用方針 | 主として外国債券マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、外国の公社債に実質的に投資し、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。実質組入外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 | |
| 主な投資対象 | 野村外国債券インデックス(野村SMA向け) | マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資する場合があります。 |
| | マザーファンド | 外国の公社債を主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 野村外国債券インデックス(野村SMA向け) | 株式への直接投資は行いません。株式への投資は、転換社債を転換したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。 |
| | マザーファンド | 外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 |
| 分配方針 | 毎決算時に経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益等から基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。 | |

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



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

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | ベンチマーク シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) | | 債券 組入比率 | 債券 先物比率 | 純資産 総額 |
|----------------|--------|--------|--------|--|--------|------------|------------|-----------|
| | (分配落) | 税 分 | 込 配 | み 金 | 期 騰 | | | |
| | 円 | | 円 | | | % | % | 百万円 |
| 2期(2012年7月20日) | 9,809 | | 0 | | 1.5 | 97.81 | 1.9 | 194 |
| 3期(2013年7月22日) | 12,883 | | 5 | | 31.4 | 129.49 | 32.4 | 1,059 |
| 4期(2014年7月22日) | 13,998 | | 5 | | 8.7 | 140.52 | 8.5 | 3,974 |
| 5期(2015年7月21日) | 15,775 | | 5 | | 12.7 | 159.32 | 13.4 | 5,993 |
| 6期(2016年7月20日) | 14,255 | | 5 | | △ 9.6 | 144.73 | △ 9.2 | 3,520 |

* 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。

| |
|--|
| <p>*ベンチマーク（＝シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））は、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとに、設定時を100として再指数化しています。</p> <p>*シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス（為替ヘッジを行わない円ベースの指数）です。</p> <p>シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。</p> <p>(出所) Citigroup Index LLC</p> |
|--|

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | ベンチマーク シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 |
|---------------------|-------------|--------|--|--------|----------------|----------------|
| | | 騰 落 率 | | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2015年7月21日 | 円 15,775 | % — | 159.32 | % — | % 98.9 | % — |
| 7 月 末 | 15,903 | 0.8 | 160.79 | 0.9 | 98.8 | — |
| 8 月 末 | 15,665 | △ 0.7 | 157.82 | △ 0.9 | 98.9 | — |
| 9 月 末 | 15,612 | △ 1.0 | 157.38 | △ 1.2 | 98.8 | — |
| 10 月 末 | 15,624 | △ 1.0 | 157.87 | △ 0.9 | 98.9 | — |
| 11 月 末 | 15,613 | △ 1.0 | 157.80 | △ 1.0 | 99.0 | — |
| 12 月 末 | 15,388 | △ 2.5 | 155.17 | △ 2.6 | 98.9 | — |
| 2016年1 月 末 | 15,627 | △ 0.9 | 155.15 | △ 2.6 | 98.5 | — |
| 2 月 末 | 14,821 | △ 6.0 | 150.27 | △ 5.7 | 99.0 | — |
| 3 月 末 | 15,084 | △ 4.4 | 152.45 | △ 4.3 | 99.0 | — |
| 4 月 末 | 14,606 | △ 7.4 | 149.67 | △ 6.1 | 98.9 | — |
| 5 月 末 | 14,733 | △ 6.6 | 149.18 | △ 6.4 | 99.0 | — |
| 6 月 末 | 13,917 | △11.8 | 140.35 | △11.9 | 99.0 | — |
| (期 末) 2016年7月20日 | 14,260 | △ 9.6 | 144.73 | △ 9.2 | 98.8 | — |

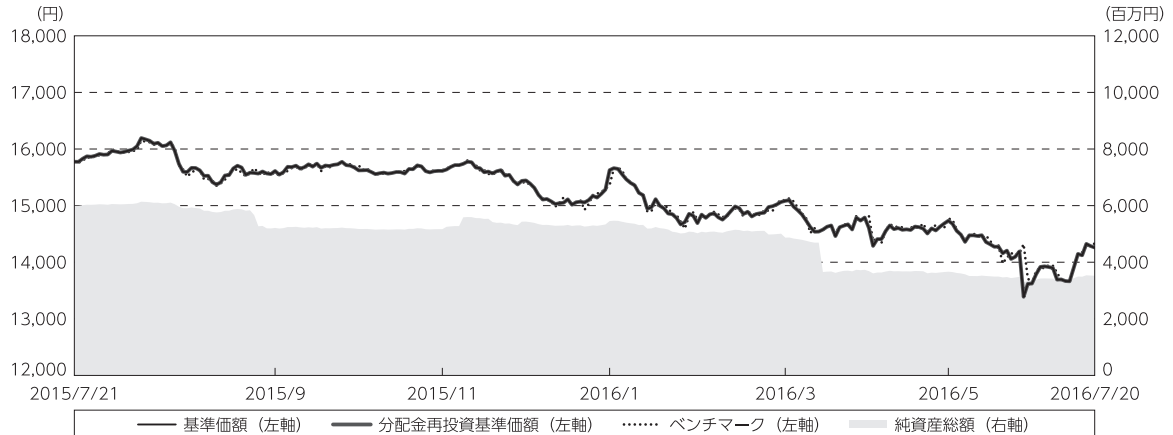
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期首：15,775円

期末：14,250円（既払分配金（税込み）：5円）

騰落率：△ 9.6%（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（2015年7月21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) ベンチマークは、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。ベンチマークは、作成期首（2015年7月21日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (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、期首15,775円から期末14,260円（分配金込み）へと下落し、値下がり額は1,515円となりました。

外国債券利回りが長期債を中心に低下（価格は上昇）したことはプラスに寄与しましたが、ECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和や米国の利上げペースの鈍化観測などを背景に主要通貨が対円で下落（円高）したことがマイナスに影響したため、基準価額は下落しました。

○投資環境

2015年12月における米国の政策金利引上げに伴い、米国の短期債利回りが上昇（価格は下落）する局面もありましたが、2016年1月以降は、ECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和や、米国の利上げペースが緩やかなものにとどまるとの観測などを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に低下（価格は上昇）しました。

為替市場は、ECBによる追加金融緩和や米国の利上げペースの鈍化観測などを背景に、主要通貨は対円で下落（円高）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村外国債券インデックス（野村SMA向け）]

シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きを概ね捉えるために、外国債券マザーファンドへ投資しました。マザーファンドの組入比率は期を通じて高位に維持しました。

[外国債券マザーファンド]

シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は-9.6%となり、ベンチマークの-9.2%を0.4ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

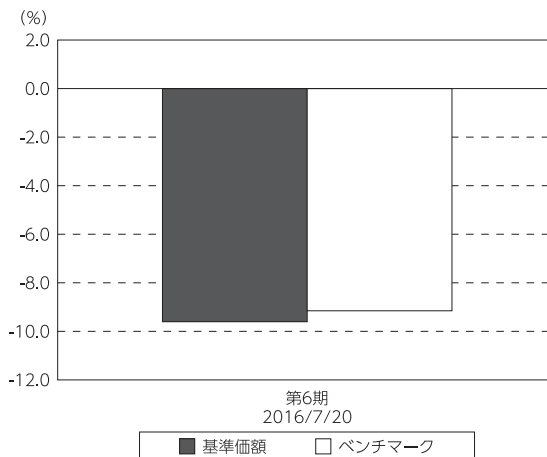
(マイナス要因)

コスト負担（当ファンドの信託報酬や、債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

(その他の要因)

ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なること

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。

◎分配金

- (1) 収益分配金は、分配対象額の範囲内で基準価額水準などを勘案し決定しました。
 (2) 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 |
|-----------|---------------------------|
| | 2015年7月22日～ 2016年7月20日 |
| 当期分配金 | 5 |
| (対基準価額比率) | 0.035% |
| 当期の収益 | 5 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 4,255 |

(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

[外国債券マザーファンド]

引き続き、外国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きを概ね捉える運用を行ってまいります。

[野村外国債券インデックス（野村SMA向け）]

引き続き、主要投資対象である[外国債券マザーファンド]を高位に組入れ、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きを概ね捉える運用を行ってまいります。

今後とも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

(2015年7月22日～2016年7月20日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|---------|------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 49 | % 0.323 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (36) | (0.237) | 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 ） | (8) | (0.054) | 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 ） | (5) | (0.032) | 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 | 2 | 0.012 | (b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (2) | (0.010) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 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 | 51 | 0.335 | |
| 期中の平均基準価額は、15,216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

(2015年7月22日～2016年7月20日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄 | 設 定 | | 解 約 | |
|-------------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外国債券マザーファンド | 千口 269,139 | 千円 617,131 | 千口 1,166,088 | 千円 2,606,874 |

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2015年7月22日～2016年7月20日)

利害関係人との取引状況

<野村外国債券インデックス（野村SMA向け）>

| 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 | $\frac{D}{C}$ |
|-----|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 預金 | 百万円 80 | 百万円 80 | % 100.0 | 百万円 80 | 百万円 80 | % 100.0 |

<外国債券マザーファンド>

| 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 260,544 | 百万円 649 | % 0.2 | 百万円 122,589 | 百万円 38 | % 0.0 |
| 為替直物取引 | 169,787 | 10,033 | 5.9 | 49,087 | 3,062 | 6.2 |
| 預金 | 20,359 | 20,359 | 100.0 | 20,359 | 20,359 | 100.0 |

平均保有割合 0.8%

※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、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年7月20日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 | 末 |
|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| 外国債券マザーファンド | 千口 2,549,110 | 千口 1,652,162 | 千円 3,520,097 |

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

（2016年7月20日現在）

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 外国債券マザーファンド | 千円 3,520,097 | % 99.7 |
| コール・ローン等、その他 | 9,031 | 0.3 |
| 投資信託財産総額 | 3,529,128 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（639,745,157千円）の投資信託財産総額（640,666,205千円）に対する比率は99.9%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=106.03円、1カナダドル=81.38円、1英ポンド=138.85円、1スイスフラン=107.58円、1スウェーデンクローナ=12.30円、1ノルウェークローネ=12.46円、1デンマーククローネ=15.70円、1ユーロ=116.80円、1ズロチ=26.65円、1シンガポールドル=78.19円、1リンギ=26.31円、1豪ドル=79.51円、1メキシコペソ=5.71円、1ランド=7.39円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2016年7月20日現在）

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 3,529,128,116 |
| コール・ローン等 | 7,137,091 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 3,520,097,531 |
| 未収入金 | 1,893,494 |
| (B) 負債 | 8,178,384 |
| 未払収益分配金 | 1,234,979 |
| 未払信託報酬 | 6,897,471 |
| 未払利息 | 9 |
| その他未払費用 | 45,925 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 3,520,949,732 |
| 元本 | 2,469,958,446 |
| 次期繰越損益金 | 1,050,991,286 |
| (D) 受益権総口数 | 2,469,958,446口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,255円 |

(注) 期首元本額は3,799,338,120円、期中追加設定元本額は401,695,735円、期中一部解約元本額は1,731,075,409円、1口当たり純資産額は1.4255円です。

○損益の状況（2015年7月22日～2016年7月20日）

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 829 |
| 受取利息 | 1,657 |
| 支払利息 | △ 828 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 346,011,796 |
| 売買益 | 117,939,156 |
| 売買損 | △ 463,950,952 |
| (C) 信託報酬等 | △ 15,934,889 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 361,945,856 |
| (E) 前期繰越損益金 | 369,341,473 |
| (F) 追加信託差損益金 | 1,044,830,648 |
| (配当等相当額) | (344,760,377) |
| (売買損益相当額) | (700,070,271) |
| (G) 計(D+E+F) | 1,052,226,265 |
| (H) 収益分配金 | △ 1,234,979 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 1,050,991,286 |
| 追加信託差損益金 | 1,044,830,648 |
| (配当等相当額) | (346,288,051) |
| (売買損益相当額) | (698,542,597) |
| 分準備積立金 | 464,432,543 |
| 繰越損益金 | △ 458,271,905 |

*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（2015年7月22日～2016年7月20日）は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|---------------------------|
| | 2015年7月22日～ 2016年7月20日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 96,326,049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 | 586,558,743円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 369,341,473円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 1,052,226,265円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 4,260円 |
| g. 分配金 | 1,234,979円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 5円 |

○分配金のお知らせ

| | |
|----------------|----|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 5円 |
|----------------|----|

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合

分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2016年7月20日現在）

<外国債券マザーファンド>

下記は、外国債券マザーファンド全体(300,518,692千口)の内容です。

外国公社債

(A)外国(外貨建)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 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| アメリカ | 千米ドル 2,361,400 | 千米ドル 2,588,425 | 千円 274,450,705 | % 42.9 | % — | % 18.8 | % 15.6 | % 8.5 |
| カナダ | 千カナダドル 135,280 | 千カナダドル 159,235 | 12,958,587 | 2.0 | — | 1.0 | 0.7 | 0.4 |
| イギリス | 千英ポンド 269,960 | 千英ポンド 354,071 | 49,162,858 | 7.7 | — | 5.6 | 2.0 | 0.0 |
| スイス | 千スイスフラン 10,700 | 千スイスフラン 13,680 | 1,471,751 | 0.2 | — | 0.1 | 0.1 | — |
| スウェーデン | 千スウェーデンクローナ 210,800 | 千スウェーデンクローナ 258,078 | 3,174,362 | 0.5 | — | 0.3 | 0.2 | 0.0 |
| ノルウェー | 千ノルウェークローネ 113,800 | 千ノルウェークローネ 130,087 | 1,620,889 | 0.3 | — | 0.1 | 0.1 | — |
| デンマーク | 千デンマーククローネ 204,000 | 千デンマーククローネ 275,406 | 4,323,879 | 0.7 | — | 0.6 | 0.1 | — |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ドイツ | 216,100 | 305,555 | 35,688,908 | 5.6 | — | 4.8 | 0.8 | — |
| イタリア | 460,900 | 583,241 | 68,122,578 | 10.6 | — | 6.3 | 3.2 | 1.1 |
| フランス | 368,600 | 494,738 | 57,785,506 | 9.0 | — | 6.5 | 2.1 | 0.4 |
| オランダ | 93,600 | 120,317 | 14,053,124 | 2.2 | — | 1.4 | 0.5 | 0.3 |
| スペイン | 315,800 | 384,515 | 44,911,459 | 7.0 | — | 3.2 | 2.6 | 1.2 |
| ベルギー | 100,400 | 138,304 | 16,153,936 | 2.5 | — | 2.0 | 0.3 | 0.2 |
| オーストリア | 57,700 | 76,046 | 8,882,173 | 1.4 | — | 1.0 | 0.3 | 0.1 |
| フィンランド | 26,200 | 30,817 | 3,599,535 | 0.6 | — | 0.4 | 0.1 | 0.0 |
| アイルランド | 43,700 | 52,386 | 6,118,783 | 1.0 | — | 0.4 | 0.5 | 0.1 |
| ポーランド | 千ズロチ 127,400 | 千ズロチ 139,157 | 3,708,557 | 0.6 | — | 0.2 | 0.3 | 0.1 |
| シンガポール | 千シンガポールドル 28,380 | 千シンガポールドル 30,939 | 2,419,183 | 0.4 | — | 0.2 | 0.2 | — |
| マレーシア | 千リンギ 112,900 | 千リンギ 116,350 | 3,061,183 | 0.5 | — | 0.3 | 0.2 | 0.1 |
| オーストラリア | 千豪ドル 137,050 | 千豪ドル 156,062 | 12,408,513 | 1.9 | — | 1.1 | 0.7 | 0.2 |
| メキシコ | 千メキシコペソ 878,500 | 千メキシコペソ 974,560 | 5,564,742 | 0.9 | — | 0.5 | 0.3 | 0.1 |
| 南アフリカ | 千ランド 441,900 | 千ランド 407,451 | 3,011,064 | 0.5 | — | 0.4 | 0.1 | 0.0 |
| 合 計 | — | — | 632,652,285 | 98.8 | — | 55.2 | 30.9 | 12.7 |

*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

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

*金額の単位未満は切り捨て。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 | |
|------|------|------------------|-------|--------|--------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| | 国債証券 | US TREASURY BOND | 8.875 | 10,500 | 12,677 | 1,344,197 | 2019/2/15 |
| | | US TREASURY BOND | 8.125 | 19,300 | 23,571 | 2,499,300 | 2019/8/15 |
| | | US TREASURY BOND | 8.75 | 12,700 | 16,634 | 1,763,705 | 2020/8/15 |
| | | US TREASURY BOND | 8.0 | 21,100 | 28,559 | 3,028,129 | 2021/11/15 |
| | | US TREASURY BOND | 6.25 | 19,400 | 25,841 | 2,739,964 | 2023/8/15 |
| | | US TREASURY BOND | 2.375 | 31,200 | 33,393 | 3,540,739 | 2024/8/15 |
| | | US TREASURY BOND | 6.0 | 43,200 | 60,503 | 6,415,199 | 2026/2/15 |
| | | US TREASURY BOND | 6.5 | 13,800 | 20,325 | 2,155,154 | 2026/11/15 |
| | | US TREASURY BOND | 6.125 | 23,700 | 34,761 | 3,685,733 | 2027/11/15 |
| | | US TREASURY BOND | 5.5 | 12,000 | 17,051 | 1,807,944 | 2028/8/15 |
| | | US TREASURY BOND | 5.25 | 5,000 | 6,996 | 741,837 | 2028/11/15 |
| | | US TREASURY BOND | 5.25 | 2,800 | 3,935 | 417,284 | 2029/2/15 |
| | | US TREASURY BOND | 4.375 | 700 | 997 | 105,712 | 2038/2/15 |
| | | US TREASURY BOND | 2.875 | 22,300 | 25,169 | 2,668,709 | 2043/5/15 |
| | | US TREASURY BOND | 3.75 | 16,000 | 21,153 | 2,242,931 | 2043/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.375 | 13,000 | 13,235 | 1,403,319 | 2017/7/31 |
| | | US TREASURY N/B | 0.5 | 3,400 | 3,396 | 360,121 | 2017/7/31 |
| | | US TREASURY N/B | 4.75 | 29,800 | 31,108 | 3,298,424 | 2017/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 0.875 | 9,000 | 9,024 | 956,916 | 2017/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.875 | 21,900 | 22,202 | 2,354,166 | 2017/8/31 |
| | | US TREASURY N/B | 0.625 | 10,000 | 10,000 | 1,060,341 | 2017/8/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.875 | 34,500 | 35,006 | 3,711,762 | 2017/9/30 |
| | | US TREASURY N/B | 0.625 | 8,000 | 7,999 | 848,173 | 2017/9/30 |
| | | US TREASURY N/B | 0.875 | 1,000 | 1,002 | 106,332 | 2017/10/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.875 | 18,500 | 18,788 | 1,992,127 | 2017/10/31 |
| | | US TREASURY N/B | 4.25 | 49,600 | 51,919 | 5,504,991 | 2017/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.25 | 18,600 | 19,000 | 2,014,605 | 2017/11/30 |
| | | US TREASURY N/B | 2.75 | 17,000 | 17,502 | 1,855,810 | 2017/12/31 |
| | | US TREASURY N/B | 0.75 | 6,000 | 6,006 | 636,826 | 2017/12/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.625 | 16,900 | 17,398 | 1,844,754 | 2018/1/31 |
| | | US TREASURY N/B | 0.875 | 4,000 | 4,012 | 425,395 | 2018/1/31 |
| | | US TREASURY N/B | 3.5 | 41,000 | 42,795 | 4,537,590 | 2018/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.0 | 12,000 | 12,058 | 1,278,572 | 2018/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.75 | 7,100 | 7,334 | 777,720 | 2018/2/28 |
| | | US TREASURY N/B | 1.0 | 4,000 | 4,019 | 426,224 | 2018/3/15 |
| | | US TREASURY N/B | 0.75 | 2,000 | 2,001 | 212,242 | 2018/3/31 |
| | | US TREASURY N/B | 0.75 | 34,000 | 34,027 | 3,607,977 | 2018/4/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.625 | 8,000 | 8,274 | 877,298 | 2018/4/30 |
| | | US TREASURY N/B | 0.625 | 1,200 | 1,198 | 127,076 | 2018/4/30 |
| | | US TREASURY N/B | 3.875 | 15,200 | 16,081 | 1,705,144 | 2018/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.375 | 5,000 | 5,155 | 546,592 | 2018/5/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.0 | 15,500 | 15,585 | 1,652,580 | 2018/5/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.125 | 18,500 | 18,646 | 1,977,109 | 2018/6/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.375 | 31,200 | 32,222 | 3,416,554 | 2018/6/30 |
| | | US TREASURY N/B | 1.375 | 8,500 | 8,607 | 912,696 | 2018/6/30 |
| | | US TREASURY N/B | 2.25 | 8,800 | 9,075 | 962,258 | 2018/7/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.375 | 3,400 | 3,444 | 365,261 | 2018/7/31 |

| 銘柄 | 当 | 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|-----------------|-------|--------|--------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | | | | | | |
| 国債証券 | US TREASURY N/B | 4.0 | 4,800 | 5,132 | 544,192 | 2018/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 20,600 | 20,934 | 2,219,711 | 2018/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 27,400 | 27,781 | 2,945,622 | 2018/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 7,000 | 7,158 | 759,025 | 2018/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.75 | 35,400 | 37,848 | 4,013,124 | 2018/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 5,000 | 5,058 | 536,383 | 2018/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 6,500 | 6,596 | 699,425 | 2018/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 5,500 | 5,597 | 593,552 | 2018/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 5,100 | 5,161 | 547,258 | 2019/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 2,000 | 2,036 | 215,920 | 2019/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 27,500 | 28,898 | 3,064,121 | 2019/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 4,500 | 4,570 | 484,571 | 2019/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 4,000 | 4,074 | 432,039 | 2019/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 4,000 | 4,076 | 432,237 | 2019/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 25,500 | 26,067 | 2,763,965 | 2019/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 5,600 | 5,726 | 607,220 | 2019/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 27,600 | 29,408 | 3,118,131 | 2019/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 10,600 | 10,806 | 1,145,825 | 2019/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.0 | 2,000 | 2,010 | 213,169 | 2019/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 7,900 | 8,082 | 857,007 | 2019/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 14,500 | 14,838 | 1,573,348 | 2019/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 37,000 | 40,120 | 4,253,969 | 2019/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.0 | 3,000 | 3,012 | 319,456 | 2019/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 8,800 | 9,007 | 955,041 | 2019/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.0 | 3,000 | 3,011 | 319,357 | 2019/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 17,700 | 18,186 | 1,928,341 | 2019/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 3.375 | 49,300 | 53,321 | 5,653,628 | 2019/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.0 | 8,800 | 8,828 | 936,052 | 2019/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 1,800 | 1,835 | 194,589 | 2019/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.125 | 12,000 | 12,082 | 1,281,107 | 2019/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 3,800 | 3,890 | 412,483 | 2019/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 2,000 | 2,029 | 215,207 | 2020/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 51,800 | 56,729 | 6,014,985 | 2020/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 2,700 | 2,728 | 289,322 | 2020/2/29 |
| | US TREASURY N/B | 1.125 | 4,000 | 4,024 | 426,737 | 2020/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 21,300 | 21,614 | 2,291,786 | 2020/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.5 | 47,700 | 52,192 | 5,533,956 | 2020/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 6,500 | 6,623 | 702,332 | 2020/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 16,600 | 17,157 | 1,819,226 | 2020/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 13,200 | 13,512 | 1,432,726 | 2020/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 11,000 | 11,425 | 1,211,434 | 2020/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 42,500 | 45,211 | 4,793,725 | 2020/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 7,000 | 7,306 | 774,739 | 2020/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 6,000 | 6,235 | 661,179 | 2020/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 1,600 | 1,646 | 174,551 | 2020/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 50,100 | 53,403 | 5,662,369 | 2020/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 6,800 | 7,182 | 761,560 | 2020/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 5,300 | 5,543 | 587,730 | 2021/1/31 |

| 銘柄 | 当 | 期 | 末 | | | 償還年月日 | |
|------|-----------------|-------|--------|--------|-----------|------------|--------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | | 邦貨換算金額 |
| | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | | |
| アメリカ | | | | | | | |
| 国債証券 | US TREASURY N/B | 3.625 | 45,800 | 50,988 | 5,406,287 | 2021/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 5,000 | 5,203 | 551,770 | 2021/2/28 | |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 1,800 | 1,894 | 200,903 | 2021/3/31 | |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 2,900 | 3,054 | 323,822 | 2021/4/30 | |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 36,400 | 39,843 | 4,224,635 | 2021/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 12,500 | 13,023 | 1,380,875 | 2021/5/31 | |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 34,000 | 35,636 | 3,778,511 | 2021/6/30 | |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 9,700 | 10,228 | 1,084,495 | 2021/7/31 | |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 26,800 | 28,103 | 2,979,799 | 2021/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 7,300 | 7,607 | 806,672 | 2021/8/31 | |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 16,000 | 16,776 | 1,778,785 | 2021/9/30 | |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 11,000 | 11,472 | 1,216,400 | 2021/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 8,000 | 8,290 | 879,021 | 2021/11/30 | |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 12,400 | 13,006 | 1,379,072 | 2021/12/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 5,000 | 5,076 | 538,267 | 2022/1/31 | |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 33,700 | 35,126 | 3,724,513 | 2022/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 7,300 | 7,509 | 796,211 | 2022/2/28 | |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 5,900 | 6,066 | 643,220 | 2022/3/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 5,000 | 5,140 | 545,019 | 2022/4/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 11,900 | 12,230 | 1,296,849 | 2022/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 9,700 | 10,037 | 1,064,247 | 2022/5/31 | |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 27,000 | 28,322 | 3,003,042 | 2022/6/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 18,500 | 18,870 | 2,000,862 | 2022/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 12,800 | 13,037 | 1,382,366 | 2022/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 13,000 | 13,629 | 1,445,155 | 2022/12/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 22,000 | 22,553 | 2,391,340 | 2023/1/31 | |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 17,000 | 17,710 | 1,877,849 | 2023/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 25,000 | 25,236 | 2,675,807 | 2023/2/28 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 11,000 | 11,097 | 1,176,626 | 2023/3/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 42,200 | 43,284 | 4,589,473 | 2023/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 14,400 | 15,501 | 1,643,610 | 2023/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 16,800 | 18,399 | 1,950,945 | 2023/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 27,300 | 29,931 | 3,173,678 | 2024/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 30,400 | 32,805 | 3,478,406 | 2024/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 25,100 | 26,619 | 2,822,489 | 2024/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 6,000 | 6,243 | 661,975 | 2025/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 7,600 | 8,066 | 855,247 | 2025/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 6.25 | 1,100 | 1,720 | 182,439 | 2030/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 5.375 | 300 | 443 | 46,995 | 2031/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 1,600 | 2,299 | 243,855 | 2036/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 5.0 | 1,000 | 1,534 | 162,706 | 2037/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 500 | 724 | 76,855 | 2038/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 3.5 | 1,500 | 1,893 | 200,781 | 2039/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 4,500 | 6,288 | 666,721 | 2039/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 5,500 | 7,952 | 843,174 | 2039/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 7,700 | 10,944 | 1,160,480 | 2039/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.625 | 8,000 | 11,760 | 1,246,912 | 2040/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 8,000 | 11,381 | 1,206,753 | 2040/5/15 | |

| 銘柄 | 当 | 期 | 末 | | | 償還年月日 | |
|------|---------------------|---|-------|--------|--------|-------------|------------|
| | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | | 邦貨換算金額 |
| アメリカ | | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 国債証券 | US TREASURY N/B | | 3.875 | 8,000 | 10,628 | 1,126,900 | 2040/8/15 |
| | US TREASURY N/B | | 4.25 | 7,800 | 10,934 | 1,159,333 | 2040/11/15 |
| | US TREASURY N/B | | 4.75 | 7,000 | 10,516 | 1,115,112 | 2041/2/15 |
| | US TREASURY N/B | | 4.375 | 7,000 | 10,003 | 1,060,722 | 2041/5/15 |
| | US TREASURY N/B | | 3.125 | 6,500 | 7,693 | 815,753 | 2041/11/15 |
| | US TREASURY N/B | | 3.125 | 3,200 | 3,790 | 401,933 | 2042/2/15 |
| | US TREASURY N/B | | 3.0 | 4,500 | 5,217 | 553,252 | 2042/5/15 |
| | US TREASURY N/B | | 2.75 | 9,300 | 10,288 | 1,090,849 | 2042/8/15 |
| | US TREASURY N/B | | 2.75 | 9,600 | 10,595 | 1,123,414 | 2042/11/15 |
| | US TREASURY N/B | | 3.125 | 18,200 | 21,541 | 2,284,035 | 2043/2/15 |
| | US TREASURY N/B | | 3.625 | 15,700 | 20,302 | 2,152,627 | 2043/8/15 |
| | US TREASURY N/B | | 3.625 | 23,200 | 29,978 | 3,178,646 | 2044/2/15 |
| | US TREASURY N/B | | 3.375 | 15,900 | 19,660 | 2,084,560 | 2044/5/15 |
| | US TREASURY N/B | | 3.125 | 30,100 | 35,548 | 3,769,214 | 2044/8/15 |
| | US TREASURY N/B | | 3.0 | 36,400 | 42,022 | 4,455,602 | 2044/11/15 |
| | US TREASURY N/B | | 2.5 | 16,200 | 16,949 | 1,797,128 | 2045/2/15 |
| | US TREASURY N/B | | 3.0 | 14,700 | 16,976 | 1,799,986 | 2045/5/15 |
| | US TREASURY N/B | | 3.0 | 6,000 | 6,936 | 735,434 | 2045/11/15 |
| | US TREASURY NOTE | | 2.875 | 33,600 | 34,832 | 3,693,283 | 2018/3/31 |
| 小計 | | | | | | 274,450,705 | |
| カナダ | | | | 千カナダドル | 千カナダドル | | |
| 国債証券 | CANADA GOVERNMENT | | 2.75 | 4,600 | 5,131 | 417,570 | 2022/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 1.25 | 3,100 | 3,122 | 254,086 | 2017/8/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 1.5 | 10,100 | 10,206 | 830,593 | 2017/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 1.25 | 10,000 | 10,102 | 822,174 | 2018/2/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 1.25 | 3,200 | 3,234 | 263,262 | 2018/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 4.25 | 3,700 | 3,952 | 321,629 | 2018/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 1.25 | 9,500 | 9,639 | 784,482 | 2018/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 1.75 | 3,800 | 3,918 | 318,861 | 2019/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 3.75 | 7,000 | 7,634 | 621,316 | 2019/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 1.75 | 4,000 | 4,144 | 337,248 | 2019/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 1.5 | 3,600 | 3,718 | 302,597 | 2020/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 3.5 | 7,800 | 8,664 | 705,121 | 2020/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 0.75 | 2,800 | 2,815 | 229,096 | 2020/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 3.25 | 10,000 | 11,246 | 915,248 | 2021/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 1.5 | 3,900 | 4,076 | 331,762 | 2023/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 2.5 | 5,700 | 6,395 | 520,439 | 2024/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 2.25 | 6,900 | 7,646 | 622,284 | 2025/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 8.0 | 3,700 | 6,260 | 509,474 | 2027/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 5.75 | 5,180 | 7,844 | 638,376 | 2029/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 5.75 | 3,000 | 4,834 | 393,470 | 2033/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 5.0 | 7,000 | 11,037 | 898,262 | 2037/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 4.0 | 6,400 | 9,342 | 760,258 | 2041/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 3.5 | 8,500 | 12,008 | 977,248 | 2045/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | | 2.75 | 1,800 | 2,257 | 183,721 | 2048/12/1 |
| 小計 | | | | | | 12,958,587 | |
| イギリス | | | | 千英ポンド | 千英ポンド | | |
| 国債証券 | UK TREASURY | | 5.0 | 100 | 107 | 14,994 | 2018/3/7 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | 償還年月日 |
|--------|----------------------------|------|-------------|-------------|------------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 債還年月日 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| イギリス | | % | 千英ポンド | 千英ポンド | 千円 | |
| 国債証券 | UK TREASURY | 1.25 | 23,550 | 24,058 | 3,340,547 | 2018/7/22 |
| | UK TREASURY | 4.5 | 3,600 | 4,014 | 557,343 | 2019/3/7 |
| | UK TREASURY | 1.75 | 18,100 | 18,914 | 2,626,278 | 2019/7/22 |
| | UK TREASURY | 3.75 | 3,000 | 3,336 | 463,286 | 2019/9/7 |
| | UK TREASURY | 4.75 | 5,700 | 6,629 | 920,450 | 2020/3/7 |
| | UK TREASURY | 2.0 | 15,490 | 16,510 | 2,292,523 | 2020/7/22 |
| | UK TREASURY | 3.75 | 7,200 | 8,228 | 1,142,480 | 2020/9/7 |
| | UK TREASURY | 8.0 | 9,340 | 12,801 | 1,777,474 | 2021/6/7 |
| | UK TREASURY | 3.75 | 8,900 | 10,421 | 1,446,957 | 2021/9/7 |
| | UK TREASURY | 4.0 | 4,650 | 5,579 | 774,718 | 2022/3/7 |
| | UK TREASURY | 1.75 | 8,300 | 8,919 | 1,238,428 | 2022/9/7 |
| | UK TREASURY | 2.25 | 6,600 | 7,357 | 1,021,522 | 2023/9/7 |
| | UK TREASURY | 2.75 | 10,100 | 11,719 | 1,627,187 | 2024/9/7 |
| | UK TREASURY | 5.0 | 13,450 | 18,248 | 2,533,868 | 2025/3/7 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 8,530 | 11,516 | 1,599,045 | 2027/12/7 |
| | UK TREASURY | 6.0 | 3,850 | 6,074 | 843,501 | 2028/12/7 |
| | UK TREASURY | 4.75 | 6,700 | 9,782 | 1,358,323 | 2030/12/7 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 7,250 | 10,223 | 1,419,494 | 2032/6/7 |
| | UK TREASURY | 4.5 | 6,700 | 9,910 | 1,376,092 | 2034/9/7 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 6,900 | 10,072 | 1,398,583 | 2036/3/7 |
| | UK TREASURY | 4.75 | 4,900 | 7,790 | 1,081,712 | 2038/12/7 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 4,200 | 6,307 | 875,804 | 2039/9/7 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 5,700 | 8,674 | 1,204,500 | 2040/12/7 |
| | UK TREASURY | 4.5 | 6,100 | 9,816 | 1,363,052 | 2042/12/7 |
| | UK TREASURY | 3.5 | 20,000 | 28,252 | 3,922,790 | 2045/1/22 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 5,950 | 9,624 | 1,336,392 | 2046/12/7 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 4,250 | 7,182 | 997,349 | 2049/12/7 |
| | UK TREASURY | 3.75 | 7,250 | 11,642 | 1,616,599 | 2052/7/22 |
| | UK TREASURY | 3.5 | 5,500 | 9,507 | 1,320,088 | 2068/7/22 |
| | UK TSY 3 1/4% 2044 | 3.25 | 21,700 | 29,197 | 4,054,052 | 2044/1/22 |
| | UNITED KINGDOM(GOVERNMENT) | 4.25 | 6,400 | 11,648 | 1,617,413 | 2055/12/7 |
| 小計 | | | | | 49,162,858 | |
| スイス | | | 千スイスフラン | 千スイスフラン | | |
| 国債証券 | SWITZERLAND GOVERNMENT | 2.0 | 7,100 | 8,141 | 875,870 | 2021/4/28 |
| | SWITZERLAND GOVERNMENT | 4.0 | 3,600 | 5,538 | 595,881 | 2028/4/8 |
| 小計 | | | | | 1,471,751 | |
| スウェーデン | | | 千スウェーデンクローナ | 千スウェーデンクローナ | | |
| 国債証券 | SWEDISH GOVERNMENT | 3.75 | 7,000 | 7,334 | 90,212 | 2017/8/12 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 4.25 | 16,200 | 18,320 | 225,340 | 2019/3/12 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 5.0 | 49,400 | 61,241 | 753,266 | 2020/12/1 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 3.5 | 56,600 | 69,281 | 852,159 | 2022/6/1 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 1.5 | 22,400 | 25,204 | 310,020 | 2023/11/13 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 2.5 | 41,700 | 51,032 | 627,699 | 2025/5/12 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 1.0 | 1,200 | 1,302 | 16,023 | 2026/11/12 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 3.5 | 16,300 | 24,361 | 299,640 | 2039/3/30 |
| 小計 | | | | | 3,174,362 | |
| ノルウェー | | | 千ノルウェークローネ | 千ノルウェークローネ | | |
| 国債証券 | NORWEGIAN GOVERNMENT | 4.5 | 23,300 | 25,951 | 323,356 | 2019/5/22 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|-------|------|--------------------------|-------|------------|------------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ノルウェー | | | % | 千ノルウェークローネ | 千ノルウェークローネ | 千円 | |
| | 国債証券 | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.75 | 27,600 | 31,846 | 396,804 | 2021/5/25 |
| | | NORWEGIAN GOVERNMENT | 2.0 | 14,300 | 15,549 | 193,741 | 2023/5/24 |
| | | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.0 | 48,600 | 56,740 | 706,986 | 2024/3/14 |
| 小 計 | | | | | | 1,620,889 | |
| デンマーク | | | | 千デンマーククローネ | 千デンマーククローネ | | |
| | 国債証券 | KINGDOM OF DENMARK | 4.0 | 25,100 | 28,917 | 454,008 | 2019/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 3.0 | 52,100 | 61,481 | 965,265 | 2021/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 1.5 | 42,000 | 46,993 | 737,802 | 2023/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 7.0 | 14,500 | 23,158 | 363,588 | 2024/11/10 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 1.75 | 22,000 | 25,251 | 396,450 | 2025/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 4.5 | 48,300 | 89,602 | 1,406,763 | 2039/11/15 |
| 小 計 | | | | | | 4,323,879 | |
| ユーロ | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESBLIGATION | 0.25 | 1,700 | 1,750 | 204,437 | 2019/10/11 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.5 | 3,900 | 4,384 | 512,095 | 2019/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25 | 8,700 | 9,890 | 1,155,170 | 2020/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.0 | 7,000 | 8,017 | 936,479 | 2020/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.25 | 3,100 | 3,475 | 405,927 | 2020/9/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 7,300 | 8,324 | 972,308 | 2021/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25 | 7,000 | 8,344 | 974,660 | 2021/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.25 | 3,500 | 4,011 | 468,525 | 2021/9/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.0 | 20,000 | 22,799 | 2,662,969 | 2022/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.75 | 9,600 | 10,906 | 1,273,852 | 2022/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 5,000 | 5,616 | 655,960 | 2022/9/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 5,200 | 5,872 | 685,964 | 2023/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 5,200 | 5,891 | 688,181 | 2023/5/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.0 | 13,400 | 15,711 | 1,835,087 | 2023/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25 | 14,100 | 21,205 | 2,476,825 | 2024/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.75 | 5,700 | 6,623 | 773,659 | 2024/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 1,500 | 1,717 | 200,625 | 2024/5/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0 | 2,300 | 2,542 | 296,973 | 2024/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.5 | 26,900 | 46,493 | 5,430,494 | 2027/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.625 | 6,000 | 9,941 | 1,161,120 | 2028/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 3,400 | 5,355 | 625,503 | 2028/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25 | 3,500 | 6,437 | 751,926 | 2030/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.5 | 5,300 | 9,391 | 1,096,969 | 2031/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 6,600 | 11,852 | 1,384,425 | 2034/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.0 | 8,400 | 14,518 | 1,695,803 | 2037/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.25 | 7,400 | 13,689 | 1,598,885 | 2039/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 5,200 | 10,354 | 1,209,450 | 2040/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25 | 5,500 | 9,265 | 1,082,219 | 2042/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 4,700 | 7,181 | 838,839 | 2044/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 9,000 | 13,986 | 1,633,564 | 2046/8/15 |
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.75 | 10,500 | 10,632 | 1,241,926 | 2018/1/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 33,900 | 36,283 | 4,237,913 | 2018/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5 | 12,100 | 12,908 | 1,507,687 | 2018/6/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 24,900 | 27,200 | 3,177,048 | 2018/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5 | 8,000 | 8,674 | 1,013,169 | 2018/12/1 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|--------------------------|------|---------------------------|--------|-----------|----------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.25 | 17,000 | 18,846 | 2,201,236 | 2019/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 3,800 | 4,250 | 496,435 | 2019/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5 | 4,100 | 4,384 | 512,066 | 2019/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.5 | 500 | 522 | 61,016 | 2019/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.25 | 25,900 | 29,298 | 3,422,015 | 2019/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 10,300 | 11,908 | 1,390,954 | 2020/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.25 | 29,200 | 33,600 | 3,924,531 | 2020/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0 | 14,500 | 16,793 | 1,961,527 | 2020/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 11,000 | 12,767 | 1,491,272 | 2021/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 7,000 | 8,145 | 951,359 | 2021/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 7,800 | 9,136 | 1,067,101 | 2021/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 10,400 | 12,723 | 1,486,088 | 2021/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 16,800 | 21,005 | 2,453,388 | 2022/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.5 | 9,600 | 12,449 | 1,454,075 | 2022/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.5 | 20,700 | 26,926 | 3,145,022 | 2022/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 3,700 | 4,630 | 540,877 | 2023/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 6,200 | 7,918 | 924,897 | 2023/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 9.0 | 11,700 | 18,478 | 2,158,344 | 2023/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 15,900 | 20,113 | 2,349,256 | 2024/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 2,300 | 2,792 | 326,182 | 2024/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 14,900 | 19,737 | 2,305,363 | 2025/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 8,500 | 11,050 | 1,290,640 | 2026/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 7.25 | 8,600 | 13,563 | 1,584,265 | 2026/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.5 | 18,200 | 27,893 | 3,257,939 | 2027/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 7,300 | 9,990 | 1,166,837 | 2028/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.25 | 12,100 | 17,517 | 2,046,005 | 2029/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.0 | 18,300 | 28,780 | 3,361,551 | 2031/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.75 | 6,400 | 10,086 | 1,178,091 | 2033/2/1 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 8,400 | 12,493 | 1,459,219 | 2034/8/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0 | 5,700 | 7,655 | 894,182 | 2037/2/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 8,000 | 12,292 | 1,435,705 | 2039/8/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 15,600 | 24,038 | 2,807,643 | 2040/9/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 7,000 | 10,730 | 1,253,299 | 2044/9/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.25 | 4,100 | 5,020 | 586,436 | 2046/9/1 | | |
| フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF) | 1.0 | 8,000 | 8,344 | 974,604 | 2019/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.5 | 8,500 | 8,778 | 1,025,280 | 2019/11/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.5 | 3,500 | 4,464 | 521,485 | 2030/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.25 | 9,700 | 10,294 | 1,202,408 | 2017/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.0 | 6,000 | 6,483 | 757,327 | 2018/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 1.0 | 4,500 | 4,628 | 540,584 | 2018/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.25 | 10,800 | 11,975 | 1,398,684 | 2018/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 1.0 | 6,600 | 6,836 | 798,479 | 2018/11/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.25 | 11,500 | 13,023 | 1,521,153 | 2019/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 8.5 | 4,000 | 5,180 | 605,070 | 2019/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 3.75 | 10,800 | 12,306 | 1,437,404 | 2019/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 3.5 | 14,800 | 17,030 | 1,989,163 | 2020/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 2.5 | 17,300 | 19,478 | 2,275,139 | 2020/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 3.75 | 11,800 | 14,143 | 1,651,958 | 2021/4/25 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|------------------------|------|--------------------------|-------|---------|-----------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.25 | 15,100 | 17,983 | 2,100,454 | 2021/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.0 | 14,800 | 17,638 | 2,060,158 | 2022/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 2.25 | 20,600 | 23,838 | 2,784,279 | 2022/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8.5 | 8,200 | 13,074 | 1,527,139 | 2023/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.25 | 29,500 | 39,007 | 4,556,116 | 2023/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.75 | 8,000 | 9,169 | 1,070,939 | 2024/11/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 6.0 | 19,800 | 30,693 | 3,585,054 | 2025/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.5 | 26,500 | 35,096 | 4,099,282 | 2026/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 2.75 | 7,200 | 9,158 | 1,069,701 | 2027/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5.5 | 23,100 | 38,052 | 4,444,587 | 2029/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5.75 | 17,600 | 31,940 | 3,730,648 | 2032/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.75 | 8,500 | 14,622 | 1,707,913 | 2035/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 9,800 | 16,153 | 1,886,767 | 2038/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.5 | 11,400 | 20,587 | 2,404,627 | 2041/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.25 | 11,200 | 17,536 | 2,048,316 | 2045/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 4,700 | 8,854 | 1,034,229 | 2055/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 3,800 | 7,345 | 857,920 | 2060/4/25 |
| | | FRENCH TREASURY NOTE | 1.0 | 1,000 | 1,015 | 118,622 | 2017/7/25 |
| オランダ | 国債証券 | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.5 | 4,000 | 4,205 | 491,167 | 2017/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 1.25 | 4,500 | 4,625 | 540,229 | 2018/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0 | 6,500 | 7,090 | 828,211 | 2018/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 1.25 | 2,500 | 2,615 | 305,522 | 2019/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0 | 7,100 | 8,078 | 943,554 | 2019/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.25 | 2,000 | 2,059 | 240,564 | 2020/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.5 | 5,800 | 6,750 | 788,472 | 2020/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.25 | 5,900 | 7,013 | 819,140 | 2021/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.25 | 1,500 | 1,740 | 203,267 | 2022/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.75 | 5,900 | 7,492 | 875,079 | 2023/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 7.5 | 4,300 | 6,523 | 761,898 | 2023/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 1.75 | 1,400 | 1,602 | 187,152 | 2023/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.0 | 13,500 | 15,857 | 1,852,109 | 2024/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5 | 3,000 | 3,122 | 364,731 | 2026/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 5.5 | 6,300 | 10,185 | 1,189,632 | 2028/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5 | 4,700 | 6,366 | 743,566 | 2033/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0 | 5,000 | 8,544 | 997,947 | 2037/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.75 | 5,200 | 9,253 | 1,080,859 | 2042/1/15 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.75 | 4,500 | 7,191 | 840,017 | 2047/1/15 | | |
| スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.5 | 28,700 | 28,941 | 3,380,318 | 2017/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.5 | 30,700 | 32,892 | 3,841,794 | 2018/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.25 | 3,000 | 3,020 | 352,782 | 2018/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.1 | 17,800 | 19,327 | 2,257,467 | 2018/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.75 | 17,100 | 18,608 | 2,173,440 | 2018/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.75 | 14,300 | 15,402 | 1,799,017 | 2019/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.6 | 7,500 | 8,544 | 997,983 | 2019/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.3 | 23,800 | 27,143 | 3,170,407 | 2019/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.0 | 27,900 | 32,044 | 3,742,753 | 2020/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.85 | 11,600 | 13,945 | 1,628,804 | 2020/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.5 | 7,500 | 9,401 | 1,098,118 | 2021/4/30 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|----------------------|------|--------------------------|--------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.85 | 9,200 | 11,979 | 1,399,200 | 2022/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.4 | 17,000 | 22,287 | 2,603,169 | 2023/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.4 | 6,000 | 7,558 | 882,879 | 2023/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.8 | 7,100 | 9,182 | 1,072,565 | 2024/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.8 | 8,300 | 10,079 | 1,177,287 | 2024/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.65 | 14,000 | 18,309 | 2,138,547 | 2025/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.9 | 18,400 | 26,487 | 3,093,752 | 2026/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15 | 4,800 | 6,751 | 788,540 | 2028/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.9 | 4,900 | 7,510 | 877,258 | 2040/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.7 | 4,400 | 6,613 | 772,428 | 2041/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15 | 7,300 | 11,798 | 1,378,053 | 2044/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.45 | 1,000 | 1,168 | 136,478 | 2066/7/30 |
| | | SPANISH GOVERNMENT | 6.0 | 9,800 | 14,921 | 1,742,846 | 2029/1/31 |
| | | SPANISH GOVERNMENT | 5.75 | 8,500 | 13,410 | 1,566,340 | 2032/7/30 |
| SPANISH GOVERNMENT | 4.2 | 5,200 | 7,185 | 839,223 | 2037/1/31 | | |
| ベルギー | 国債証券 | BELGIUM KINGDOM | 1.25 | 4,000 | 4,141 | 483,709 | 2018/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.0 | 3,100 | 3,454 | 403,429 | 2019/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.75 | 7,000 | 8,260 | 964,849 | 2020/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 7,200 | 8,968 | 1,047,499 | 2021/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.0 | 5,000 | 6,261 | 731,351 | 2022/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 6,400 | 8,237 | 962,132 | 2022/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 2.25 | 5,000 | 5,867 | 685,331 | 2023/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 2.6 | 10,400 | 12,599 | 1,471,633 | 2024/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.5 | 6,400 | 9,112 | 1,064,308 | 2026/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.0 | 3,500 | 5,316 | 621,011 | 2032/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 6,800 | 11,902 | 1,390,205 | 2041/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.75 | 5,800 | 9,838 | 1,149,107 | 2045/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.5 | 2,000 | 2,145 | 250,617 | 2017/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 4.0 | 2,500 | 2,694 | 314,717 | 2018/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 4.0 | 5,200 | 5,844 | 682,687 | 2019/3/28 |
| BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.5 | 10,600 | 16,926 | 1,976,997 | 2028/3/28 | | |
| BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.0 | 9,500 | 16,732 | 1,954,344 | 2035/3/28 | | |
| オーストリア | 国債証券 | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.3 | 1,500 | 1,584 | 185,098 | 2017/9/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.65 | 3,000 | 3,233 | 377,690 | 2018/1/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.15 | 2,300 | 2,388 | 278,928 | 2018/10/19 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.35 | 2,500 | 2,825 | 329,960 | 2019/3/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.95 | 1,700 | 1,822 | 212,915 | 2019/6/18 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.25 | 2,400 | 2,460 | 287,356 | 2019/10/18 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.9 | 4,600 | 5,411 | 632,109 | 2020/7/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.5 | 4,400 | 5,297 | 618,759 | 2021/9/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.65 | 3,300 | 4,067 | 475,054 | 2022/4/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.4 | 5,000 | 6,197 | 723,868 | 2022/11/22 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.75 | 2,300 | 2,640 | 308,432 | 2023/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.65 | 3,000 | 3,433 | 401,067 | 2024/10/21 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.85 | 5,400 | 7,892 | 921,860 | 2026/3/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 6.25 | 4,600 | 7,676 | 896,593 | 2027/7/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.15 | 5,900 | 9,911 | 1,157,645 | 2037/3/15 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.15 | 5,800 | 9,202 | 1,074,830 | 2044/6/20 | | |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|---------------------|-------|---------------------------|-------|-----------|-----------|-------------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| フィンランド | 国債証券 | FINNISH GOVERNMENT | 3.875 | 2,000 | 2,103 | 245,713 | 2017/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.125 | 1,500 | 1,555 | 181,647 | 2018/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 4.375 | 1,300 | 1,491 | 174,250 | 2019/7/4 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 3.375 | 2,000 | 2,292 | 267,775 | 2020/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 3.5 | 2,000 | 2,377 | 277,732 | 2021/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.625 | 3,200 | 3,591 | 419,440 | 2022/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.5 | 4,200 | 4,701 | 549,093 | 2023/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 4.0 | 2,400 | 3,273 | 382,356 | 2025/7/4 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.5 | 2,000 | 2,073 | 242,146 | 2026/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 2.75 | 3,500 | 4,555 | 532,055 | 2028/7/4 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.75 | 700 | 735 | 85,857 | 2031/4/15 |
| FINNISH GOVERNMENT | 2.625 | 1,400 | 2,067 | 241,467 | 2042/7/4 | | |
| アイルランド | 国債証券 | IRELAND (REPUBLIC OF) 4.4 | 4.4 | 3,600 | 4,111 | 480,188 | 2019/6/18 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 5.5 | 7,500 | 8,058 | 941,262 | 2017/10/18 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 4.5 | 5,600 | 6,225 | 727,140 | 2018/10/18 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 5.9 | 3,400 | 4,098 | 478,748 | 2019/10/18 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 4.5 | 5,300 | 6,269 | 732,299 | 2020/4/18 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 5.0 | 3,500 | 4,291 | 501,250 | 2020/10/18 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 5.4 | 6,000 | 8,534 | 996,789 | 2025/3/13 |
| | | IRISH TSY 2% 2045 | 2.0 | 1,500 | 1,768 | 206,593 | 2045/2/18 |
| | | IRISH TSY 2.4% 2030 | 2.4 | 2,600 | 3,153 | 368,330 | 2030/5/15 |
| IRISH TSY 3.4% 2024 | 3.4 | 1,300 | 1,609 | 187,994 | 2024/3/18 | | |
| REPUBLIC OF IRELAND | 3.9 | 3,400 | 4,265 | 498,187 | 2023/3/20 | | |
| 小 計 | | | | | | 255,316,006 | |
| ポーランド | | | | 千ズロチ | 千ズロチ | | |
| | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.25 | 7,500 | 7,839 | 208,934 | 2017/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.75 | 8,100 | 8,406 | 224,046 | 2018/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5 | 10,900 | 11,094 | 295,655 | 2018/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.25 | 5,800 | 6,042 | 161,029 | 2019/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.5 | 11,100 | 12,370 | 329,681 | 2019/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 1.5 | 4,300 | 4,226 | 112,645 | 2020/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.25 | 30,700 | 34,648 | 923,369 | 2020/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.75 | 6,700 | 7,844 | 209,052 | 2021/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.75 | 9,400 | 11,198 | 298,435 | 2022/9/23 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 4.0 | 9,600 | 10,493 | 279,645 | 2023/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.25 | 19,600 | 20,253 | 539,749 | 2025/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.75 | 3,700 | 4,739 | 126,313 | 2029/4/25 |
| | | 小 計 | | | | | |
| シンガポール | | | | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | | |
| | 国債証券 | SINGAPORE GOVERNMENT | 4.0 | 1,600 | 1,702 | 133,123 | 2018/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.5 | 5,400 | 5,622 | 439,621 | 2019/6/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.25 | 4,000 | 4,336 | 339,031 | 2020/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.25 | 2,580 | 2,699 | 211,084 | 2021/6/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.125 | 1,200 | 1,323 | 103,492 | 2022/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 3,000 | 3,252 | 254,273 | 2023/7/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.0 | 1,500 | 1,664 | 130,127 | 2024/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.5 | 3,300 | 3,859 | 301,762 | 2027/3/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.875 | 2,400 | 2,660 | 208,014 | 2030/9/1 |

| 銘柄 | 柄 | 当期末 | | | | | |
|---------|------|-----------------------|-----------|-----------|--------|------------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| シンガポール | | % | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | 千円 | | |
| | 国債証券 | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.375 | 500 | 591 | 46,277 | 2033/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 2,900 | 3,227 | 252,373 | 2042/4/1 |
| 小 | 計 | | | | | 2,419,183 | |
| マレーシア | | | 千リンギ | 千リンギ | | | |
| | 国債証券 | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.012 | 4,000 | 4,076 | 107,262 | 2017/9/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.24 | 8,200 | 8,429 | 221,782 | 2018/2/7 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.26 | 3,700 | 3,745 | 98,554 | 2018/3/1 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.58 | 4,300 | 4,395 | 115,644 | 2018/9/28 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.654 | 1,000 | 1,023 | 26,916 | 2019/10/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.378 | 11,900 | 12,432 | 327,097 | 2019/11/29 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.492 | 10,000 | 10,174 | 267,692 | 2020/3/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.889 | 2,400 | 2,470 | 65,009 | 2020/7/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.16 | 6,000 | 6,258 | 164,668 | 2021/7/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.048 | 8,700 | 9,061 | 238,396 | 2021/9/30 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.418 | 4,600 | 4,595 | 120,908 | 2022/8/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.48 | 10,400 | 10,426 | 274,308 | 2023/3/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.181 | 5,800 | 6,076 | 159,877 | 2024/7/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.392 | 8,800 | 9,367 | 246,461 | 2026/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.502 | 4,000 | 3,907 | 102,793 | 2027/5/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.733 | 1,800 | 1,783 | 46,925 | 2028/6/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 5.248 | 2,700 | 3,053 | 80,342 | 2028/9/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.498 | 2,500 | 2,642 | 69,535 | 2030/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.232 | 4,400 | 4,567 | 120,183 | 2031/6/30 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.127 | 4,700 | 4,723 | 124,272 | 2032/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.844 | 400 | 385 | 10,150 | 2033/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.935 | 2,600 | 2,751 | 72,401 | 2043/9/30 |
| 小 | 計 | | | | | 3,061,183 | |
| オーストラリア | | | 千豪ドル | 千豪ドル | | | |
| | 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.25 | 3,700 | 3,796 | 301,872 | 2017/7/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.5 | 9,800 | 10,370 | 824,583 | 2018/1/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 4,500 | 4,667 | 371,104 | 2018/10/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.25 | 15,600 | 17,110 | 1,360,457 | 2019/3/15 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 2,900 | 3,014 | 239,700 | 2019/10/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.5 | 13,100 | 14,522 | 1,154,686 | 2020/4/15 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.75 | 900 | 907 | 72,165 | 2020/11/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.75 | 10,200 | 12,162 | 967,068 | 2021/5/15 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.75 | 7,900 | 9,721 | 772,975 | 2022/7/15 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.5 | 7,500 | 9,281 | 738,010 | 2023/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 7,900 | 8,421 | 669,585 | 2024/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 16,000 | 17,751 | 1,411,387 | 2025/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.25 | 9,500 | 11,457 | 910,946 | 2026/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.75 | 6,050 | 7,675 | 610,315 | 2027/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 10,100 | 11,394 | 905,941 | 2029/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.5 | 3,600 | 4,717 | 375,110 | 2033/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,800 | 1,889 | 150,195 | 2035/6/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.75 | 5,400 | 6,527 | 519,027 | 2037/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 600 | 671 | 53,378 | 2039/6/21 |
| 小 | 計 | | | | | 12,408,513 | |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|-------|--------------------------|------|---------|---------|-------------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| メキシコ | | % | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | 千円 | |
| 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 4.75 | 146,200 | 145,330 | 829,839 | 2018/6/14 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 104,500 | 112,429 | 641,969 | 2018/12/13 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.0 | 29,000 | 28,678 | 163,754 | 2019/12/11 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0 | 60,700 | 66,113 | 377,509 | 2020/6/11 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.5 | 85,600 | 88,943 | 507,868 | 2021/6/10 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.5 | 38,400 | 40,080 | 228,857 | 2022/6/9 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 30,700 | 39,047 | 222,962 | 2024/12/5 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5 | 71,600 | 79,550 | 454,234 | 2027/6/3 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 47,100 | 56,569 | 323,014 | 2029/5/31 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 41,000 | 46,682 | 266,554 | 2031/5/29 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 10,000 | 11,436 | 65,304 | 2034/11/23 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 46,000 | 64,610 | 368,924 | 2036/11/20 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 30,500 | 37,951 | 216,702 | 2038/11/18 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 54,200 | 63,265 | 361,245 | 2042/11/13 |
| | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 8.0 | 83,000 | 93,870 | 536,002 | 2023/12/7 |
| 小計 | | | | | 5,564,742 | |
| 南アフリカ | | | 千ランド | 千ランド | | |
| 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.25 | 10,300 | 10,350 | 76,493 | 2017/9/15 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.0 | 28,800 | 28,793 | 212,781 | 2018/12/21 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.25 | 25,300 | 24,576 | 181,619 | 2020/1/15 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.75 | 26,100 | 24,490 | 180,986 | 2021/3/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.75 | 25,200 | 24,184 | 178,720 | 2023/2/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 10.5 | 65,800 | 73,267 | 541,449 | 2026/12/21 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.0 | 27,000 | 24,503 | 181,080 | 2030/1/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.0 | 30,000 | 24,648 | 182,148 | 2031/2/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.25 | 41,000 | 37,408 | 276,445 | 2032/3/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.25 | 47,100 | 34,056 | 251,676 | 2036/3/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.5 | 22,500 | 20,544 | 151,825 | 2037/1/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.5 | 24,600 | 17,709 | 130,873 | 2041/2/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.75 | 22,100 | 20,421 | 150,916 | 2044/1/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.75 | 46,100 | 42,496 | 314,046 | 2048/2/28 |
| 小計 | | | | | 3,011,064 | |
| 合計 | | | | | 632,652,285 | |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

外国債券マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日2016年5月10日）

作成対象期間（2015年5月12日～2016年5月10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 | シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 |
| 主な投資対象 | 外国の公社債を主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 |

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|------|--------|------|-------|--------|---------|
| | 円 | 騰落率 | | 騰落率 | | | |
| 11期(2012年5月10日) | 14,713 | 2.4 | 148.79 | 1.8 | 98.2 | — | 278,390 |
| 12期(2013年5月10日) | 19,680 | 33.8 | 196.85 | 32.3 | 98.1 | — | 309,517 |
| 13期(2014年5月12日) | 20,704 | 5.2 | 209.27 | 6.3 | 98.6 | — | 293,247 |
| 14期(2015年5月11日) | 23,251 | 12.3 | 236.29 | 12.9 | 98.9 | — | 526,058 |
| 15期(2016年5月10日) | 21,725 | △6.6 | 220.26 | △6.8 | 99.0 | — | 632,898 |

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*ベンチマーク (=シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)) は、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。
 *シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス (為替ヘッジを行わない円ベースの指数) です。シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。
 (出所) Citigroup Index LLC

○当期中の基準価額と市況等の推移

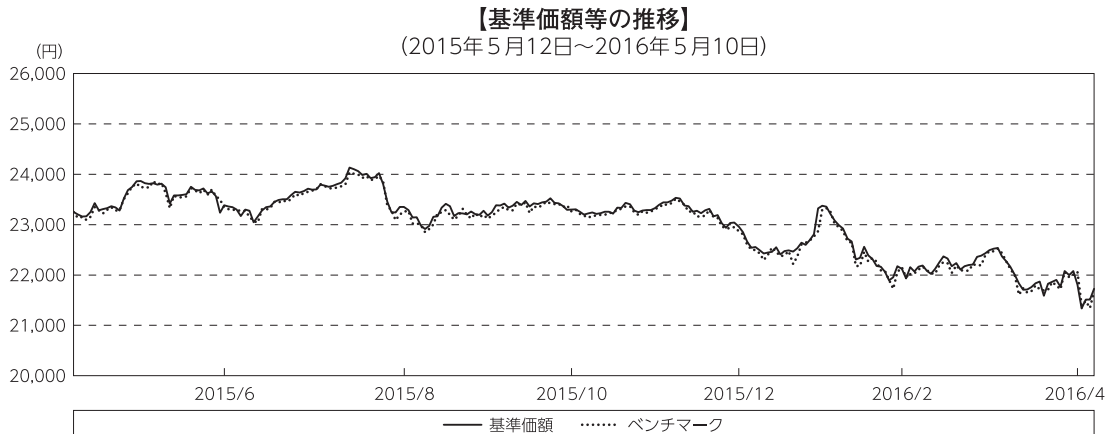
| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|--------------------|--------|------|--------|------|-------|--------|
| | 円 | 騰落率 | | 騰落率 | | |
| (期首) 2015年5月11日 | 23,251 | — | 236.29 | — | 98.9 | — |
| 5月末 | 23,746 | 2.1 | 241.38 | 2.2 | 99.0 | — |
| 6月末 | 23,385 | 0.6 | 237.28 | 0.4 | 98.9 | — |
| 7月末 | 23,699 | 1.9 | 240.84 | 1.9 | 98.9 | — |
| 8月末 | 23,351 | 0.4 | 236.40 | 0.0 | 98.9 | — |
| 9月末 | 23,275 | 0.1 | 235.74 | △0.2 | 98.8 | — |
| 10月末 | 23,300 | 0.2 | 236.47 | 0.1 | 98.9 | — |
| 11月末 | 23,289 | 0.2 | 236.36 | 0.0 | 99.1 | — |
| 12月末 | 22,960 | △1.3 | 232.42 | △1.6 | 98.9 | — |
| 2016年1月末 | 23,322 | 0.3 | 232.41 | △1.6 | 98.5 | — |
| 2月末 | 22,124 | △4.8 | 225.09 | △4.7 | 99.0 | — |
| 3月末 | 22,522 | △3.1 | 228.36 | △3.4 | 99.0 | — |
| 4月末 | 21,808 | △6.2 | 224.19 | △5.1 | 98.9 | — |
| (期末) 2016年5月10日 | 21,725 | △6.6 | 220.26 | △6.8 | 99.0 | — |

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の変動要因

基準価額は、期首23,251円から期末21,725円へと下落し、値下がり額は1,526円となりました。

外国債券利回りが長期債を中心に低下（価格は上昇）したことはプラスに寄与しましたが、ECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和や米国の利上げペースの鈍化観測などを背景に主要通貨が対円で下落（円高）したことがマイナスに影響したため、基準価額は下落しました。

○投資環境

当運用期間では、米国の政策金利引上げに伴い米国の短期債券利回りは上昇（価格は下落）しましたが、商品価格下落に伴う低インフレの長期化観測やECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和、米国の利上げペースが緩やかなものにとどまるとの観測などを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に低下（価格は上昇）しました。

為替市場は、ECBによる追加金融緩和や米国の利上げペースの鈍化観測などを背景に、主要通貨は対円で下落（円高）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

○当ファンドのベンチマークとの差異

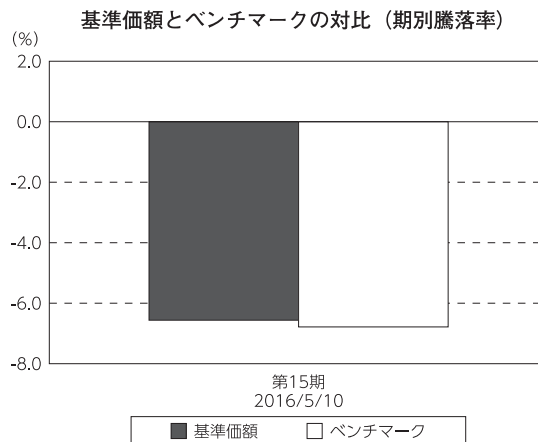
今期の基準価額の騰落率は-6.6%となり、ベンチマークの-6.8%を0.2ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

（その他の要因）

ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なること



（注）ベンチマークは、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。

◎今後の運用方針

引き続き、外国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きを概ね捉える運用を行ってまいります。

今後とも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

(2015年5月12日～2016年5月10日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|--------|------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 2 | % 0.011 | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (2) | (0.011) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 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 | 2 | 0.011 | |
| 期中の平均基準価額は、23,065円です。 | | | |

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*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

(2015年5月12日～2016年5月10日)

公 社 債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 | |
|-----|--------|------|-----------------------|-----------------------|---------|
| 外 国 | アメリカ | 国債証券 | 千米ドル 1,164,271 | 千米ドル 549,584 | |
| | カナダ | 国債証券 | 千カナダドル 72,837 | 千カナダドル 42,081 | |
| | イギリス | 国債証券 | 千英ポンド 110,916 | 千英ポンド 39,649 | |
| | スイス | 国債証券 | 千スイスフラン 4,001 | 千スイスフラン - | |
| | スウェーデン | 国債証券 | 千スウェーデンクローナ 81,361 | 千スウェーデンクローナ 23,206 | |
| | ノルウェー | 国債証券 | 千ノルウェークローネ 49,712 | 千ノルウェークローネ 732 | |
| | デンマーク | 国債証券 | 千デンマーククローネ 79,204 | 千デンマーククローネ 26,206 | |
| | ユーロ | | 千ユーロ | 千ユーロ | |
| | | ドイツ | 国債証券 | 102,024 | 14,451 |
| | | イタリア | 国債証券 | 266,332 | 128,788 |
| | フランス | 国債証券 | 135,861 | 36,498 | |

| | | 買付額 | | 売付額 | |
|---------|--------|-------|---------------------|----------------|--------------------|
| 外 | ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| | オランダ | 国債証券 | 24,619 | | 7,810 |
| | スペイン | 国債証券 | 169,524 | | 74,703 |
| | ベルギー | 国債証券 | 35,540 | | 3,974 |
| | オーストリア | 国債証券 | 18,442 | | 5,988 |
| | フィンランド | 国債証券 | 2,391 | | — |
| | アイルランド | 国債証券 | 7,426 | | — |
| | ポーランド | 国債証券 | 千ズロチ 60,022 | | 千ズロチ 20,105 |
| | シンガポール | 国債証券 | 千シンガポールドル 11,142 | | 千シンガポールドル 5,113 |
| | 国 | マレーシア | 国債証券 | 千リンギ 42,868 | |
| オーストラリア | | 国債証券 | 千豪ドル 61,091 | | 千豪ドル 18,091 |
| メキシコ | | 国債証券 | 千メキシコペソ 395,496 | | 千メキシコペソ 118,842 |
| 南アフリカ | | 国債証券 | 千ランド 128,597 | | 千ランド 7,431 |

*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。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月12日～2016年5月10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 283,335 | 百万円 7,530 | % 2.7 | 百万円 115,284 | 百万円 1,324 | % 1.1 |
| 為替直物取引 | 195,271 | 19,369 | 9.9 | 44,170 | 2,035 | 4.6 |
| 預金 | 20,359 | 20,359 | 100.0 | 20,359 | 20,359 | 100.0 |

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、野村信託銀行です。

(2016年5月10日現在)

○組入資産の明細

外国公社債

(A)外国(外貨建)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 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 2,264,900 | 2,457,940 | 266,588,179 | 42.1 | — | 18.5 | 15.3 | 8.3 |
| カナダ | 千カナダドル 135,080 | 千カナダドル 155,553 | 13,002,750 | 2.1 | — | 1.1 | 0.6 | 0.4 |
| イギリス | 千英ポンド 260,000 | 千英ポンド 318,585 | 49,782,224 | 7.9 | — | 5.8 | 1.9 | 0.2 |
| スイス | 千スイスフラン 12,700 | 千スイスフラン 15,811 | 1,766,102 | 0.3 | — | 0.1 | 0.2 | — |
| スウェーデン | 千スウェーデンクローナ 197,900 | 千スウェーデンクローナ 236,699 | 3,143,364 | 0.5 | — | 0.3 | 0.2 | 0.0 |
| ノルウェー | 千ノルウェークローネ 132,000 | 千ノルウェークローネ 146,577 | 1,933,359 | 0.3 | — | 0.2 | 0.1 | 0.0 |
| デンマーク | 千デンマーククローネ 194,400 | 千デンマーククローネ 258,674 | 4,293,992 | 0.7 | — | 0.6 | 0.1 | — |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ドイツ | 209,750 | 290,409 | 35,862,618 | 5.7 | — | 4.9 | 0.7 | — |
| イタリア | 468,000 | 576,919 | 71,243,836 | 11.3 | — | 6.2 | 3.6 | 1.4 |
| フランス | 356,800 | 467,118 | 57,684,422 | 9.1 | — | 6.4 | 2.4 | 0.3 |
| オランダ | 89,600 | 113,391 | 14,002,739 | 2.2 | — | 1.5 | 0.5 | 0.2 |
| スペイン | 298,700 | 357,246 | 44,116,372 | 7.0 | — | 3.1 | 2.7 | 1.2 |
| ベルギー | 96,900 | 128,719 | 15,895,550 | 2.5 | — | 2.0 | 0.4 | 0.1 |
| オーストリア | 56,400 | 72,337 | 8,932,926 | 1.4 | — | 1.0 | 0.3 | 0.1 |
| フィンランド | 22,200 | 26,026 | 3,214,047 | 0.5 | — | 0.3 | 0.2 | 0.0 |
| アイルランド | 42,600 | 50,566 | 6,244,400 | 1.0 | — | 0.3 | 0.5 | 0.2 |
| ポーランド | 千ズロチ 120,500 | 千ズロチ 131,685 | 3,668,764 | 0.6 | — | 0.2 | 0.3 | 0.1 |
| シンガポール | 千シンガポールドル 26,480 | 千シンガポールドル 28,258 | 2,234,693 | 0.4 | — | 0.2 | 0.1 | — |
| マレーシア | 千リンギ 107,000 | 千リンギ 108,117 | 2,895,398 | 0.5 | — | 0.3 | 0.1 | 0.1 |
| オーストラリア | 千豪ドル 127,400 | 千豪ドル 142,035 | 11,249,226 | 1.8 | — | 1.1 | 0.4 | 0.2 |
| メキシコ | 千メキシコペソ 887,300 | 千メキシコペソ 990,729 | 5,904,747 | 0.9 | — | 0.6 | 0.3 | 0.1 |
| 南アフリカ | 千ランド 420,500 | 千ランド 377,269 | 2,701,252 | 0.4 | — | 0.3 | 0.1 | 0.0 |
| 合 計 | — | — | 626,360,972 | 99.0 | — | 55.2 | 30.8 | 13.0 |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 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。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 柄 | 当期末 | | | | 償還年月日 |
|------|------------------|-------|--------|--------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 国債証券 | US TREASURY BOND | 8.875 | 10,500 | 12,829 | 1,391,507 | 2019/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 8.125 | 19,300 | 23,778 | 2,578,983 | 2019/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 8.75 | 12,700 | 16,743 | 1,815,963 | 2020/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 8.0 | 18,500 | 25,119 | 2,724,464 | 2021/11/15 |
| | US TREASURY BOND | 6.25 | 19,400 | 25,744 | 2,792,238 | 2023/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 2.375 | 31,200 | 32,955 | 3,574,299 | 2024/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 6.0 | 42,000 | 58,189 | 6,311,253 | 2026/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 6.5 | 13,800 | 20,045 | 2,174,143 | 2026/11/15 |
| | US TREASURY BOND | 6.125 | 17,700 | 25,532 | 2,769,227 | 2027/11/15 |
| | US TREASURY BOND | 5.5 | 12,000 | 16,697 | 1,811,044 | 2028/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 5.25 | 5,000 | 6,850 | 742,951 | 2028/11/15 |
| | US TREASURY BOND | 5.25 | 2,800 | 3,850 | 417,571 | 2029/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 4.375 | 2,200 | 2,984 | 323,710 | 2038/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 2.875 | 22,300 | 23,599 | 2,559,620 | 2043/5/15 |
| | US TREASURY BOND | 3.75 | 16,600 | 20,674 | 2,242,386 | 2043/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 0.875 | 7,200 | 7,223 | 783,443 | 2017/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 24,600 | 25,160 | 2,728,878 | 2017/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 0.625 | 8,500 | 8,504 | 922,378 | 2017/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 0.875 | 5,000 | 5,016 | 544,058 | 2017/6/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 9,000 | 9,193 | 997,149 | 2017/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 0.75 | 8,000 | 8,014 | 869,205 | 2017/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 0.875 | 16,900 | 16,954 | 1,838,845 | 2017/7/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 28,200 | 28,801 | 3,123,805 | 2017/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 0.5 | 3,400 | 3,395 | 368,288 | 2017/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.75 | 29,800 | 31,354 | 3,400,657 | 2017/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 21,900 | 22,251 | 2,413,408 | 2017/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 0.625 | 10,000 | 9,997 | 1,084,303 | 2017/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 34,500 | 35,080 | 3,804,867 | 2017/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 0.625 | 8,000 | 7,997 | 867,374 | 2017/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 0.875 | 1,000 | 1,003 | 108,794 | 2017/10/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 18,500 | 18,827 | 2,042,015 | 2017/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 49,600 | 52,291 | 5,671,502 | 2017/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 18,600 | 19,052 | 2,066,450 | 2017/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 17,000 | 17,574 | 1,906,120 | 2017/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 0.75 | 6,000 | 6,005 | 651,395 | 2017/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 16,900 | 17,463 | 1,894,049 | 2018/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 0.875 | 4,000 | 4,012 | 435,229 | 2018/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.5 | 41,000 | 43,006 | 4,664,512 | 2018/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 7,100 | 7,361 | 798,432 | 2018/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 0.75 | 2,000 | 2,001 | 217,114 | 2018/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 0.75 | 34,000 | 34,022 | 3,690,088 | 2018/4/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 8,000 | 8,303 | 900,590 | 2018/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 0.625 | 1,200 | 1,197 | 129,928 | 2018/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 3.875 | 11,300 | 12,026 | 1,304,447 | 2018/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 5,000 | 5,169 | 560,687 | 2018/5/31 |

| 銘柄 | 当 | 期 | 末 | | | 償還年月日 | |
|------|-----------------|-------|--------|--------|-----------|------------|--------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | | 邦貨換算金額 |
| | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | | |
| アメリカ | | | | | | | |
| 国債証券 | US TREASURY N/B | 1.0 | 13,500 | 13,574 | 1,472,331 | 2018/5/31 | |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 29,300 | 30,323 | 3,288,855 | 2018/6/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 8,500 | 8,616 | 934,550 | 2018/6/30 | |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 8,600 | 8,885 | 963,689 | 2018/7/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 3,400 | 3,446 | 373,834 | 2018/7/31 | |
| | US TREASURY N/B | 4.0 | 4,800 | 5,161 | 559,856 | 2018/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 20,600 | 20,954 | 2,272,677 | 2018/8/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 25,500 | 25,862 | 2,805,055 | 2018/9/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 7,000 | 7,166 | 777,281 | 2018/10/31 | |
| | US TREASURY N/B | 3.75 | 30,600 | 32,879 | 3,566,106 | 2018/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 5,000 | 5,056 | 548,400 | 2018/11/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 6,500 | 6,596 | 715,427 | 2018/12/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 5,500 | 5,598 | 607,248 | 2018/12/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 5,100 | 5,158 | 559,498 | 2019/1/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 2,000 | 2,036 | 220,851 | 2019/1/31 | |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 27,500 | 28,964 | 3,141,452 | 2019/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 4,500 | 4,567 | 495,410 | 2019/2/28 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 4,000 | 4,074 | 441,872 | 2019/2/28 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 4,000 | 4,075 | 442,025 | 2019/3/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 25,500 | 26,065 | 2,827,094 | 2019/3/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 5,600 | 5,725 | 620,947 | 2019/4/30 | |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 26,400 | 28,177 | 3,056,172 | 2019/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 10,600 | 10,799 | 1,171,277 | 2019/5/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.0 | 2,000 | 2,006 | 217,665 | 2019/6/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 7,900 | 8,080 | 876,447 | 2019/6/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 14,500 | 14,830 | 1,608,546 | 2019/7/31 | |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 37,000 | 40,237 | 4,364,159 | 2019/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.0 | 3,000 | 3,007 | 326,142 | 2019/8/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 8,800 | 9,000 | 976,184 | 2019/8/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.0 | 3,000 | 3,005 | 326,015 | 2019/9/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 8,700 | 8,932 | 968,813 | 2019/9/30 | |
| | US TREASURY N/B | 3.375 | 49,300 | 53,382 | 5,789,882 | 2019/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.0 | 8,800 | 8,810 | 955,566 | 2019/11/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 1,800 | 1,832 | 198,797 | 2019/11/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.125 | 12,000 | 12,055 | 1,307,569 | 2019/12/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 3,800 | 3,885 | 421,453 | 2019/12/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 2,000 | 2,026 | 219,758 | 2020/1/31 | |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 51,800 | 56,810 | 6,161,615 | 2020/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 2,700 | 2,722 | 295,301 | 2020/2/29 | |
| | US TREASURY N/B | 1.125 | 4,000 | 4,013 | 435,331 | 2020/3/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 20,500 | 20,757 | 2,251,396 | 2020/3/31 | |
| | US TREASURY N/B | 3.5 | 46,600 | 51,023 | 5,533,993 | 2020/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 14,500 | 14,959 | 1,622,553 | 2020/6/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 10,000 | 10,212 | 1,107,647 | 2020/6/30 | |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 11,000 | 11,402 | 1,236,681 | 2020/7/31 | |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 42,500 | 45,162 | 4,898,366 | 2020/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 7,000 | 7,292 | 790,952 | 2020/8/31 | |

| 銘柄 | | 当期末 | | | | 償還年月日 |
|------|-----------------|-------|--------|--------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 国債証券 | US TREASURY N/B | 2.0 | 6,000 | 6,222 | 674,909 | 2020/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 1,600 | 1,641 | 178,009 | 2020/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 50,100 | 53,313 | 5,782,376 | 2020/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 6,800 | 7,167 | 777,400 | 2020/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 5,300 | 5,527 | 599,538 | 2021/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 44,200 | 49,169 | 5,332,874 | 2021/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 5,000 | 5,185 | 562,466 | 2021/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 1,800 | 1,889 | 204,882 | 2021/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 2,900 | 3,043 | 330,137 | 2021/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 36,400 | 39,755 | 4,311,895 | 2021/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 14,000 | 14,528 | 1,575,737 | 2021/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 8,700 | 9,081 | 985,031 | 2021/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 9,700 | 10,185 | 1,104,665 | 2021/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 26,800 | 27,968 | 3,033,443 | 2021/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 7,300 | 7,570 | 821,046 | 2021/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 16,000 | 16,695 | 1,810,739 | 2021/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 11,000 | 11,402 | 1,236,681 | 2021/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 8,000 | 8,240 | 893,812 | 2021/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 12,400 | 12,931 | 1,402,587 | 2021/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 5,000 | 5,040 | 546,663 | 2022/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 33,700 | 34,937 | 3,789,312 | 2022/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 7,300 | 7,456 | 808,706 | 2022/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 5,900 | 6,022 | 653,162 | 2022/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 5,000 | 5,102 | 553,400 | 2022/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 11,900 | 12,141 | 1,316,890 | 2022/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 9,700 | 9,967 | 1,081,075 | 2022/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 27,000 | 28,122 | 3,050,132 | 2022/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 18,500 | 18,732 | 2,031,748 | 2022/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 12,800 | 12,929 | 1,402,333 | 2022/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 13,000 | 13,528 | 1,467,260 | 2022/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 15,000 | 15,241 | 1,653,082 | 2023/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 17,000 | 17,563 | 1,904,896 | 2023/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 40,600 | 41,247 | 4,473,656 | 2023/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 16,300 | 17,396 | 1,886,816 | 2023/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 16,800 | 18,233 | 1,977,578 | 2023/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 27,300 | 29,637 | 3,214,490 | 2024/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 30,400 | 32,430 | 3,517,425 | 2024/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 24,300 | 25,412 | 2,756,237 | 2024/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 6.25 | 2,600 | 3,967 | 430,308 | 2030/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 5.375 | 300 | 429 | 46,631 | 2031/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 2,000 | 2,755 | 298,807 | 2036/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 5.0 | 1,000 | 1,467 | 159,181 | 2037/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 500 | 689 | 74,799 | 2038/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.5 | 1,500 | 1,792 | 194,414 | 2039/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 5,000 | 6,642 | 720,411 | 2039/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 5,500 | 7,565 | 820,508 | 2039/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 7,700 | 10,404 | 1,128,420 | 2039/11/15 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|------|------|---------------------|-------|--------|--------|-------------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 国債証券 | US TREASURY N/B | 4.625 | 8,000 | 11,187 | 1,213,430 | 2040/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4.375 | 8,000 | 10,811 | 1,172,655 | 2040/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.875 | 8,000 | 10,071 | 1,092,327 | 2040/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4.25 | 7,800 | 10,369 | 1,124,635 | 2040/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4.75 | 7,000 | 9,980 | 1,082,481 | 2041/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4.375 | 7,000 | 9,480 | 1,028,209 | 2041/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.125 | 6,500 | 7,255 | 786,889 | 2041/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.125 | 3,200 | 3,569 | 387,175 | 2042/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.0 | 4,500 | 4,899 | 531,348 | 2042/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.75 | 9,300 | 9,650 | 1,046,739 | 2042/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.75 | 9,600 | 9,944 | 1,078,553 | 2042/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.125 | 18,200 | 20,231 | 2,194,347 | 2043/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.625 | 15,700 | 19,120 | 2,073,850 | 2043/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.625 | 23,200 | 28,195 | 3,058,056 | 2044/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.375 | 15,900 | 18,460 | 2,002,187 | 2044/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.125 | 18,600 | 20,611 | 2,235,482 | 2044/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.0 | 33,500 | 36,216 | 3,928,056 | 2044/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.5 | 13,200 | 12,880 | 1,396,998 | 2045/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.0 | 14,700 | 15,878 | 1,722,159 | 2045/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.0 | 5,000 | 5,398 | 585,556 | 2045/11/15 |
| | | US TREASURY NOTE | 2.875 | 31,000 | 32,272 | 3,500,296 | 2018/3/31 |
| 小 | | 計 | | | | 266,588,179 | |
| カナダ | | | | 千カナダドル | 千カナダドル | | |
| | 国債証券 | CANADA GOVERNMENT | 2.75 | 4,600 | 5,109 | 427,133 | 2022/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 5,400 | 5,447 | 455,349 | 2017/8/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 13,800 | 13,974 | 1,168,122 | 2017/9/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 9,700 | 9,819 | 820,820 | 2018/2/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 3,200 | 3,242 | 271,005 | 2018/3/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 4.25 | 3,700 | 3,981 | 332,841 | 2018/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 7,500 | 7,625 | 637,451 | 2018/9/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.75 | 3,800 | 3,930 | 328,514 | 2019/3/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 3.75 | 7,100 | 7,784 | 650,719 | 2019/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.75 | 4,000 | 4,155 | 347,349 | 2019/9/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 3,600 | 3,721 | 311,041 | 2020/3/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 3.5 | 7,500 | 8,361 | 698,946 | 2020/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 0.75 | 2,500 | 2,511 | 209,959 | 2020/9/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 3.25 | 9,200 | 10,356 | 865,671 | 2021/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 3,900 | 4,034 | 337,244 | 2023/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 2.5 | 5,700 | 6,306 | 527,120 | 2024/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25 | 7,200 | 7,834 | 654,870 | 2025/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 8.0 | 2,200 | 3,678 | 307,492 | 2027/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75 | 5,180 | 7,694 | 643,155 | 2029/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75 | 3,000 | 4,710 | 393,774 | 2033/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 5.0 | 7,000 | 10,671 | 891,989 | 2037/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 4.0 | 6,400 | 8,940 | 747,340 | 2041/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 3.5 | 7,100 | 9,533 | 796,907 | 2045/12/1 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | | | | |
|--------|-------|------------------------|--------|-------------|-------------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| カナダ | | % | 千カナダドル | 千カナダドル | 千円 | | |
| | 国債証券 | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,800 | 2,128 | 177,930 | 2048/12/1 |
| 小 | 計 | | | | | | 13,002,750 |
| イギリス | | | 千英ポンド | 千英ポンド | | | |
| | 国債証券 | UK TREASURY | 1.0 | 2,100 | 2,117 | 330,836 | 2017/9/7 |
| | | UK TREASURY | 5.0 | 5,700 | 6,193 | 967,725 | 2018/3/7 |
| | | UK TREASURY | 1.25 | 23,400 | 23,839 | 3,725,225 | 2018/7/22 |
| | | UK TREASURY | 4.5 | 4,000 | 4,462 | 697,357 | 2019/3/7 |
| | | UK TREASURY | 1.75 | 14,200 | 14,736 | 2,302,766 | 2019/7/22 |
| | | UK TREASURY | 3.75 | 3,000 | 3,323 | 519,314 | 2019/9/7 |
| | | UK TREASURY | 4.75 | 5,800 | 6,714 | 1,049,142 | 2020/3/7 |
| | | UK TREASURY | 2.0 | 13,500 | 14,212 | 2,220,892 | 2020/7/22 |
| | | UK TREASURY | 3.75 | 7,200 | 8,151 | 1,273,806 | 2020/9/7 |
| | | UK TREASURY | 8.0 | 5,300 | 7,200 | 1,125,079 | 2021/6/7 |
| | | UK TREASURY | 3.75 | 8,900 | 10,250 | 1,601,685 | 2021/9/7 |
| | | UK TREASURY | 4.0 | 4,650 | 5,480 | 856,381 | 2022/3/7 |
| | | UK TREASURY | 1.75 | 8,300 | 8,678 | 1,356,099 | 2022/9/7 |
| | | UK TREASURY | 2.25 | 7,200 | 7,745 | 1,210,239 | 2023/9/7 |
| | | UK TREASURY | 2.75 | 8,600 | 9,575 | 1,496,227 | 2024/9/7 |
| | | UK TREASURY | 5.0 | 12,800 | 16,741 | 2,615,967 | 2025/3/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 8,300 | 10,626 | 1,660,495 | 2027/12/7 |
| | | UK TREASURY | 6.0 | 3,750 | 5,625 | 878,962 | 2028/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.75 | 6,700 | 9,166 | 1,432,321 | 2030/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 7,250 | 9,522 | 1,488,044 | 2032/6/7 |
| | | UK TREASURY | 4.5 | 6,700 | 9,162 | 1,431,797 | 2034/9/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 6,900 | 9,236 | 1,443,270 | 2036/3/7 |
| | | UK TREASURY | 4.75 | 4,900 | 7,114 | 1,111,682 | 2038/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 4,200 | 5,743 | 897,479 | 2039/9/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 5,700 | 7,875 | 1,230,566 | 2040/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.5 | 6,100 | 8,848 | 1,382,691 | 2042/12/7 |
| | | UK TREASURY | 3.5 | 14,300 | 17,956 | 2,805,884 | 2045/1/22 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 5,950 | 8,573 | 1,339,672 | 2046/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 4,250 | 6,319 | 987,457 | 2049/12/7 |
| | | UK TREASURY | 3.75 | 7,250 | 10,134 | 1,583,659 | 2052/7/22 |
| | | UK TREASURY | 3.5 | 5,000 | 7,185 | 1,122,806 | 2068/7/22 |
| | | UK TSY 3 1/4% 2044 | 3.25 | 21,700 | 26,005 | 4,063,585 | 2044/1/22 |
| | | UNITED KINGDOM(GOVEMEN | 4.25 | 6,400 | 10,067 | 1,573,100 | 2055/12/7 |
| 小 | 計 | | | | | | 49,782,224 |
| スイス | | | | 千スイスフラン | 千スイスフラン | | |
| | 国債証券 | SWITZERLAND GOVERNMENT | 2.0 | 9,100 | 10,377 | 1,159,182 | 2021/4/28 |
| | | SWITZERLAND GOVERNMENT | 4.0 | 3,600 | 5,433 | 606,919 | 2028/4/8 |
| 小 | 計 | | | | | | 1,766,102 |
| スウェーデン | | | | 千スウェーデンクローナ | 千スウェーデンクローナ | | |
| | 国債証券 | SWEDISH GOVERNMENT | 3.75 | 7,000 | 7,384 | 98,071 | 2017/8/12 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 4.25 | 16,200 | 18,373 | 244,001 | 2019/3/12 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 5.0 | 49,400 | 61,241 | 813,282 | 2020/12/1 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 3.5 | 50,900 | 61,118 | 811,649 | 2022/6/1 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 1.5 | 17,900 | 19,407 | 257,734 | 2023/11/13 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|--------|------|--------------------------|-------|-------------|-------------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| スウェーデン | | | % | 千スウェーデンクローナ | 千スウェーデンクローナ | 千円 | |
| | 国債証券 | SWEDISH GOVERNMENT | 2.5 | 40,200 | 47,202 | 626,853 | 2025/5/12 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 3.5 | 16,300 | 21,970 | 291,771 | 2039/3/30 |
| 小 計 | | | | | | 3,143,364 | |
| ノルウェー | | | | 千ノルウェークローネ | 千ノルウェークローネ | | |
| | 国債証券 | NORWEGIAN GOVERNMENT | 4.25 | 21,900 | 22,728 | 299,787 | 2017/5/19 |
| | | NORWEGIAN GOVERNMENT | 4.5 | 24,100 | 26,949 | 355,458 | 2019/5/22 |
| | | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.75 | 27,600 | 31,505 | 415,556 | 2021/5/25 |
| | | NORWEGIAN GOVERNMENT | 2.0 | 14,300 | 15,200 | 200,490 | 2023/5/24 |
| | | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.0 | 44,100 | 50,194 | 662,067 | 2024/3/14 |
| 小 計 | | | | | | 1,933,359 | |
| デンマーク | | | | 千デンマーククローネ | 千デンマーククローネ | | |
| | 国債証券 | KINGDOM OF DENMARK | 4.0 | 25,100 | 28,952 | 480,617 | 2019/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 3.0 | 52,100 | 61,134 | 1,014,826 | 2021/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 1.5 | 35,800 | 39,516 | 655,966 | 2023/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 7.0 | 14,500 | 22,976 | 381,413 | 2024/11/10 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 1.75 | 18,600 | 20,913 | 347,169 | 2025/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 4.5 | 48,300 | 85,180 | 1,413,999 | 2039/11/15 |
| 小 計 | | | | | | 4,293,992 | |
| ユーロ | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESBLIGATION | 0.25 | 1,700 | 1,744 | 215,380 | 2019/10/11 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.5 | 5,150 | 5,805 | 716,932 | 2019/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25 | 8,700 | 9,900 | 1,222,571 | 2020/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.0 | 7,000 | 8,013 | 989,642 | 2020/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.25 | 3,100 | 3,466 | 428,106 | 2020/9/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 7,300 | 8,300 | 1,025,069 | 2021/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25 | 7,000 | 8,319 | 1,027,375 | 2021/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.25 | 3,500 | 3,991 | 492,876 | 2021/9/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.0 | 20,000 | 22,672 | 2,799,765 | 2022/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.75 | 9,600 | 10,824 | 1,336,774 | 2022/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 5,000 | 5,574 | 688,333 | 2022/9/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 5,200 | 5,820 | 718,788 | 2023/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 4,200 | 4,713 | 582,089 | 2023/5/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.0 | 5,400 | 6,275 | 774,941 | 2023/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25 | 14,100 | 21,087 | 2,604,152 | 2024/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.75 | 5,700 | 6,543 | 808,069 | 2024/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 1,500 | 1,695 | 209,361 | 2024/5/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0 | 5,700 | 6,209 | 766,821 | 2024/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.5 | 26,900 | 45,814 | 5,657,661 | 2027/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.625 | 6,000 | 9,755 | 1,204,731 | 2028/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 3,400 | 5,244 | 647,601 | 2028/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25 | 3,500 | 6,291 | 776,949 | 2030/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.5 | 5,300 | 9,142 | 1,128,974 | 2031/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 6,600 | 11,391 | 1,406,676 | 2034/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.0 | 9,400 | 15,490 | 1,912,956 | 2037/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.25 | 5,400 | 9,477 | 1,170,370 | 2039/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 5,200 | 9,823 | 1,213,087 | 2040/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25 | 5,500 | 8,723 | 1,077,301 | 2042/7/4 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|------|--------------------------|-------|--------|--------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 4,700 | 6,715 | 829,341 | 2044/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 8,000 | 11,579 | 1,429,915 | 2046/8/15 |
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.25 | 10,300 | 10,973 | 1,355,119 | 2017/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5 | 18,900 | 19,894 | 2,456,820 | 2017/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.75 | 10,500 | 10,644 | 1,314,512 | 2018/1/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 26,900 | 29,009 | 3,582,382 | 2018/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5 | 9,900 | 10,623 | 1,311,947 | 2018/6/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 23,800 | 26,184 | 3,233,556 | 2018/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5 | 8,000 | 8,716 | 1,076,338 | 2018/12/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.25 | 17,000 | 18,958 | 2,341,172 | 2019/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 3,800 | 4,276 | 528,107 | 2019/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5 | 14,100 | 15,115 | 1,866,576 | 2019/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.5 | 500 | 522 | 64,505 | 2019/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.25 | 25,900 | 29,417 | 3,632,732 | 2019/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 10,300 | 11,950 | 1,475,712 | 2020/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.25 | 21,800 | 25,155 | 3,106,393 | 2020/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0 | 12,600 | 14,592 | 1,801,973 | 2020/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 11,000 | 12,741 | 1,573,425 | 2021/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 7,000 | 8,124 | 1,003,343 | 2021/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 7,800 | 9,100 | 1,123,791 | 2021/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 10,400 | 12,692 | 1,567,354 | 2021/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 16,800 | 20,924 | 2,583,954 | 2022/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.5 | 9,600 | 12,378 | 1,528,588 | 2022/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.5 | 17,100 | 22,105 | 2,729,767 | 2022/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 4,600 | 5,702 | 704,165 | 2023/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 7,200 | 9,087 | 1,122,168 | 2023/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 9.0 | 10,700 | 16,769 | 2,070,808 | 2023/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 11,700 | 14,599 | 1,802,862 | 2024/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 2,300 | 2,744 | 338,901 | 2024/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 14,900 | 19,370 | 2,392,056 | 2025/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 8,500 | 10,817 | 1,335,803 | 2026/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 7.25 | 8,600 | 13,274 | 1,639,324 | 2026/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.5 | 18,200 | 27,139 | 3,351,498 | 2027/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 7,300 | 9,644 | 1,190,941 | 2028/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.25 | 12,100 | 16,897 | 2,086,690 | 2029/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.0 | 14,700 | 22,214 | 2,743,285 | 2031/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.75 | 6,400 | 9,625 | 1,188,665 | 2033/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 8,400 | 11,855 | 1,464,067 | 2034/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0 | 5,700 | 7,191 | 888,031 | 2037/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 8,000 | 11,508 | 1,421,122 | 2039/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 14,600 | 20,972 | 2,589,943 | 2040/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 7,000 | 9,927 | 1,225,934 | 2044/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.25 | 3,100 | 3,477 | 429,484 | 2046/9/1 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF) | 1.0 | 8,000 | 8,341 | 1,030,093 | 2019/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.5 | 8,500 | 8,756 | 1,081,364 | 2019/11/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.5 | 3,500 | 4,253 | 525,227 | 2030/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.25 | 9,700 | 10,373 | 1,280,993 | 2017/10/25 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|-------------------------|------|--------------------------|--------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 6,000 | 6,525 | 805,892 | 2018/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.0 | 4,500 | 4,632 | 572,089 | 2018/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.25 | 10,800 | 12,050 | 1,488,157 | 2018/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.0 | 6,600 | 6,839 | 844,606 | 2018/11/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.25 | 11,500 | 13,096 | 1,617,235 | 2019/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8.5 | 4,000 | 5,231 | 646,050 | 2019/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.75 | 10,800 | 12,349 | 1,525,070 | 2019/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.5 | 14,800 | 17,049 | 2,105,400 | 2020/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 2.5 | 17,300 | 19,442 | 2,400,967 | 2020/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.75 | 11,800 | 14,128 | 1,744,756 | 2021/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.25 | 15,100 | 17,919 | 2,212,931 | 2021/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.0 | 14,800 | 17,545 | 2,166,681 | 2022/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 2.25 | 17,600 | 20,207 | 2,495,449 | 2022/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8.5 | 8,200 | 13,066 | 1,613,627 | 2023/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.25 | 28,500 | 37,369 | 4,614,722 | 2023/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.75 | 8,000 | 9,007 | 1,112,304 | 2024/11/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 6.0 | 19,800 | 30,253 | 3,736,018 | 2025/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.5 | 20,500 | 26,600 | 3,284,932 | 2026/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 2.75 | 7,200 | 8,875 | 1,096,028 | 2027/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5.5 | 23,100 | 36,530 | 4,511,131 | 2029/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5.75 | 16,600 | 28,664 | 3,539,826 | 2032/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.75 | 8,500 | 13,768 | 1,700,234 | 2035/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 9,800 | 14,978 | 1,849,733 | 2038/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.5 | 11,400 | 19,040 | 2,351,348 | 2041/4/25 |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.25 | 10,400 | 14,791 | 1,826,592 | 2045/5/25 | | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 4,700 | 7,911 | 977,034 | 2055/4/25 | | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 3,800 | 6,496 | 802,256 | 2060/4/25 | | |
| FRENCH TREASURY NOTE | 1.0 | 1,000 | 1,017 | 125,663 | 2017/7/25 | | |
| オランダ | 国債証券 | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.5 | 4,000 | 4,236 | 523,183 | 2017/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 1.25 | 4,500 | 4,632 | 572,083 | 2018/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0 | 6,500 | 7,140 | 881,812 | 2018/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 1.25 | 2,500 | 2,616 | 323,165 | 2019/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0 | 7,100 | 8,112 | 1,001,807 | 2019/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.25 | 2,000 | 2,051 | 253,350 | 2020/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.5 | 5,800 | 6,752 | 833,884 | 2020/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.25 | 5,900 | 6,989 | 863,072 | 2021/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.25 | 1,500 | 1,724 | 212,983 | 2022/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.75 | 5,900 | 7,430 | 917,645 | 2023/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 7.5 | 4,300 | 6,493 | 801,926 | 2023/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 1.75 | 1,400 | 1,579 | 194,998 | 2023/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.0 | 13,500 | 15,580 | 1,924,017 | 2024/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 5.5 | 6,300 | 9,948 | 1,228,597 | 2028/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5 | 3,700 | 4,752 | 586,856 | 2033/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0 | 5,000 | 8,079 | 997,725 | 2037/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.75 | 5,200 | 8,648 | 1,068,048 | 2042/1/15 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.75 | 4,500 | 6,620 | 817,582 | 2047/1/15 | | |
| スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.5 | 28,700 | 28,941 | 3,573,933 | 2017/10/31 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|----------------------|------|--------------------------|--------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.5 | 20,700 | 22,335 | 2,758,175 | 2018/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.25 | 1,300 | 1,307 | 161,484 | 2018/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.1 | 17,100 | 18,682 | 2,307,155 | 2018/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.75 | 17,100 | 18,706 | 2,310,075 | 2018/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.75 | 13,800 | 14,903 | 1,840,375 | 2019/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.6 | 9,100 | 10,411 | 1,285,718 | 2019/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.3 | 23,800 | 27,201 | 3,359,053 | 2019/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.0 | 19,900 | 22,808 | 2,816,602 | 2020/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.85 | 11,600 | 13,880 | 1,714,131 | 2020/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.5 | 7,500 | 9,348 | 1,154,417 | 2021/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.85 | 9,200 | 11,903 | 1,470,001 | 2022/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.4 | 14,600 | 18,897 | 2,333,664 | 2023/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.4 | 4,700 | 5,813 | 717,906 | 2023/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.8 | 7,100 | 9,006 | 1,112,194 | 2024/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.8 | 8,300 | 9,897 | 1,222,273 | 2024/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.65 | 13,700 | 17,427 | 2,152,138 | 2025/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.9 | 18,400 | 25,753 | 3,180,284 | 2026/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15 | 4,800 | 6,523 | 805,609 | 2028/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.9 | 4,900 | 6,852 | 846,216 | 2040/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.7 | 4,400 | 6,015 | 742,839 | 2041/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15 | 4,900 | 7,199 | 889,121 | 2044/10/31 |
| SPANISH GOVERNMENT | 5.5 | 10,400 | 11,114 | 1,372,507 | 2017/7/30 | | |
| SPANISH GOVERNMENT | 6.0 | 9,800 | 14,312 | 1,767,403 | 2029/1/31 | | |
| SPANISH GOVERNMENT | 5.75 | 7,300 | 10,877 | 1,343,290 | 2032/7/30 | | |
| SPANISH GOVERNMENT | 4.2 | 5,600 | 7,124 | 879,796 | 2037/1/31 | | |
| ベルギー | 国債証券 | BELGIUM KINGDOM | 3.5 | 1,700 | 1,777 | 219,450 | 2017/6/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.25 | 4,000 | 4,150 | 512,488 | 2018/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.0 | 3,100 | 3,455 | 426,690 | 2019/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.75 | 7,000 | 8,255 | 1,019,513 | 2020/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 7,200 | 8,925 | 1,102,163 | 2021/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.0 | 5,000 | 6,222 | 768,428 | 2022/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 6,400 | 8,167 | 1,008,547 | 2022/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 2.25 | 5,000 | 5,781 | 713,930 | 2023/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 2.6 | 7,300 | 8,687 | 1,072,757 | 2024/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.5 | 6,400 | 8,918 | 1,101,358 | 2026/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.0 | 3,500 | 5,030 | 621,261 | 2032/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 6,800 | 10,920 | 1,348,629 | 2041/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.75 | 3,700 | 5,671 | 700,401 | 2045/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.5 | 2,000 | 2,165 | 267,405 | 2017/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 4.0 | 2,500 | 2,711 | 334,812 | 2018/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 4.0 | 5,200 | 5,867 | 724,599 | 2019/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.5 | 10,600 | 16,324 | 2,015,850 | 2028/3/28 |
| BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.0 | 9,500 | 15,687 | 1,937,260 | 2035/3/28 | | |
| オーストリア | 国債証券 | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.3 | 1,500 | 1,597 | 197,219 | 2017/9/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.65 | 3,000 | 3,260 | 402,623 | 2018/1/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.15 | 2,300 | 2,390 | 295,160 | 2018/10/19 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.35 | 2,500 | 2,839 | 350,649 | 2019/3/15 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|--------------------|------------------------|------------------------|-------|-----------------------|--------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| オーストリア | 国債証券 | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.95 | 1,700 | 1,824 | 225,363 | 2019/6/18 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.25 | 2,400 | 2,452 | 302,896 | 2019/10/18 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.9 | 4,600 | 5,422 | 669,622 | 2020/7/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.5 | 4,400 | 5,281 | 652,244 | 2021/9/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.65 | 3,300 | 4,046 | 499,738 | 2022/4/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.4 | 5,000 | 6,147 | 759,093 | 2022/11/22 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.75 | 2,300 | 2,598 | 320,939 | 2023/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.65 | 3,000 | 3,369 | 416,074 | 2024/10/21 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.85 | 5,400 | 7,729 | 954,456 | 2026/3/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 6.25 | 4,600 | 7,503 | 926,611 | 2027/7/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.15 | 5,900 | 9,304 | 1,148,961 | 2037/3/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.15 | 4,500 | 6,569 | 811,270 | 2044/6/20 |
| | | フィンランド | 国債証券 | FINNISH GOVERNMENT | 3.875 | 2,000 | 2,118 |
| FINNISH GOVERNMENT | 1.125 | | | 1,500 | 1,556 | 192,161 | 2018/9/15 |
| FINNISH GOVERNMENT | 4.375 | | | 1,300 | 1,498 | 184,997 | 2019/7/4 |
| FINNISH GOVERNMENT | 3.375 | | | 2,000 | 2,293 | 283,162 | 2020/4/15 |
| FINNISH GOVERNMENT | 3.5 | | | 2,000 | 2,370 | 292,786 | 2021/4/15 |
| FINNISH GOVERNMENT | 1.625 | | | 3,200 | 3,545 | 437,891 | 2022/9/15 |
| FINNISH GOVERNMENT | 1.5 | | | 2,200 | 2,429 | 299,975 | 2023/4/15 |
| FINNISH GOVERNMENT | 4.0 | | | 2,400 | 3,210 | 396,521 | 2025/7/4 |
| FINNISH GOVERNMENT | 2.75 | | | 3,500 | 4,387 | 541,777 | 2028/7/4 |
| FINNISH GOVERNMENT | 0.75 | | | 700 | 695 | 85,869 | 2031/4/15 |
| FINNISH GOVERNMENT | 2.625 | | | 1,400 | 1,921 | 237,253 | 2042/7/4 |
| アイルランド | 国債証券 | | | IRELAND (REPUBLIC OF) | 4.4 | 3,600 | 4,120 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 5.5 | 7,500 | 8,136 | 1,004,809 | 2017/10/18 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 4.5 | 5,600 | 6,260 | 773,091 | 2018/10/18 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 5.9 | 3,400 | 4,109 | 507,507 | 2019/10/18 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 4.5 | 5,300 | 6,258 | 772,849 | 2020/4/18 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 5.0 | 3,500 | 4,278 | 528,402 | 2020/10/18 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 5.4 | 6,000 | 8,360 | 1,032,482 | 2025/3/13 |
| | | IRISH TSY 2% 2045 | 2.0 | 1,500 | 1,556 | 192,230 | 2045/2/18 |
| | | IRISH TSY 2.4% 2030 | 2.4 | 1,500 | 1,713 | 211,564 | 2030/5/15 |
| | | IRISH TSY 3.4% 2024 | 3.4 | 1,300 | 1,574 | 194,494 | 2024/3/18 |
| | | REPUBLIC OF IRELAND | 3.9 | 3,400 | 4,196 | 518,183 | 2023/3/20 |
| | | 小 計 | | | | | |
| ポーランド | | | | 千ズロチ | 千ズロチ | | |
| 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.25 | 7,500 | 7,906 | 220,272 | 2017/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.75 | 8,100 | 8,428 | 234,805 | 2018/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5 | 9,500 | 9,666 | 269,301 | 2018/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.25 | 5,800 | 6,067 | 169,039 | 2019/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.5 | 11,100 | 12,420 | 346,046 | 2019/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 1.5 | 5,200 | 5,111 | 142,411 | 2020/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.25 | 29,900 | 33,906 | 944,637 | 2020/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.75 | 4,000 | 4,696 | 130,830 | 2021/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.75 | 9,400 | 11,209 | 312,296 | 2022/9/23 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 4.0 | 9,600 | 10,438 | 290,818 | 2023/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.25 | 16,700 | 17,166 | 478,267 | 2025/7/25 |

| 銘柄 | 柄 | 当期末 | | | | | |
|---------|------|------------------------|-----------|-----------|--------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| ポーランド | | % | 千ズロチ | 千ズロチ | 千円 | | |
| | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.75 | 3,700 | 4,667 | 130,037 | 2029/4/25 |
| 小 | 計 | | | | | 3,668,764 | |
| シンガポール | | | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | | | |
| | 国債証券 | SINGAPORE GOVERNMENT | 4.0 | 1,600 | 1,707 | 135,043 | 2018/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.5 | 4,100 | 4,260 | 336,937 | 2019/6/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.25 | 4,000 | 4,304 | 340,360 | 2020/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.25 | 2,580 | 2,660 | 210,400 | 2021/6/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.125 | 1,200 | 1,294 | 102,392 | 2022/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 2,400 | 2,532 | 200,230 | 2023/7/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.0 | 1,500 | 1,613 | 127,575 | 2024/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.5 | 3,300 | 3,724 | 294,497 | 2027/3/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.875 | 2,400 | 2,548 | 201,504 | 2030/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.375 | 500 | 565 | 44,722 | 2033/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 2,900 | 3,047 | 241,027 | 2042/4/1 |
| 小 | 計 | | | | | 2,234,693 | |
| マレーシア | | | | 千リンギ | 千リンギ | | |
| | 国債証券 | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.012 | 4,000 | 4,056 | 108,630 | 2017/9/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.24 | 8,200 | 8,363 | 223,985 | 2018/2/7 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.26 | 3,700 | 3,712 | 99,413 | 2018/3/1 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.58 | 3,000 | 3,018 | 80,834 | 2018/9/28 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.378 | 11,900 | 12,263 | 328,406 | 2019/11/29 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.492 | 10,000 | 9,996 | 267,714 | 2020/3/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.889 | 2,400 | 2,436 | 65,261 | 2020/7/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.16 | 6,000 | 6,144 | 164,541 | 2021/7/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.048 | 8,700 | 8,856 | 237,178 | 2021/9/30 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.418 | 4,600 | 4,506 | 120,683 | 2022/8/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.48 | 7,800 | 7,683 | 205,764 | 2023/3/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.181 | 5,800 | 5,907 | 158,192 | 2024/7/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.392 | 8,800 | 9,082 | 243,241 | 2026/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.502 | 4,000 | 3,765 | 100,849 | 2027/5/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.733 | 1,800 | 1,722 | 46,116 | 2028/6/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 5.248 | 2,700 | 2,959 | 79,254 | 2028/9/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.498 | 2,500 | 2,563 | 68,657 | 2030/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.232 | 4,400 | 4,417 | 118,301 | 2031/6/30 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.127 | 4,700 | 4,620 | 123,740 | 2032/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.844 | 400 | 378 | 10,129 | 2033/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.935 | 1,600 | 1,661 | 44,500 | 2043/9/30 |
| 小 | 計 | | | | | 2,895,398 | |
| オーストラリア | | | | 千豪ドル | 千豪ドル | | |
| | 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.25 | 5,000 | 5,154 | 408,224 | 2017/7/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.5 | 9,400 | 10,014 | 793,122 | 2018/1/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 4,700 | 4,888 | 387,181 | 2018/10/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.25 | 11,400 | 12,566 | 995,274 | 2019/3/15 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 2,900 | 3,012 | 238,560 | 2019/10/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.5 | 13,100 | 14,527 | 1,150,593 | 2020/4/15 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.75 | 900 | 901 | 71,359 | 2020/11/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.75 | 9,400 | 11,177 | 885,274 | 2021/5/15 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | 償還年月日 |
|---------|--------------------------|------|---------|---------|-------------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 債還年月日 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| オーストラリア | | % | 千豪ドル | 千豪ドル | 千円 | |
| 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.75 | 7,900 | 9,639 | 763,423 | 2022/7/15 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.5 | 7,300 | 8,918 | 706,349 | 2023/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 8,200 | 8,529 | 675,547 | 2024/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 16,000 | 17,269 | 1,367,709 | 2025/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.25 | 9,500 | 10,720 | 849,083 | 2026/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.75 | 4,800 | 5,892 | 466,675 | 2027/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 6,100 | 6,569 | 520,339 | 2029/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.5 | 3,600 | 4,449 | 352,368 | 2033/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,800 | 1,753 | 138,838 | 2035/6/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.75 | 5,400 | 6,051 | 479,300 | 2037/4/21 |
| 小計 | | | | | 11,249,226 | |
| メキシコ | | | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | | |
| 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.0 | 6,400 | 6,467 | 38,548 | 2017/6/15 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 60,800 | 64,276 | 383,090 | 2017/12/14 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 4.75 | 108,800 | 109,372 | 651,857 | 2018/6/14 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 94,500 | 103,307 | 615,712 | 2018/12/13 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.0 | 29,000 | 28,955 | 172,575 | 2019/12/11 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0 | 60,700 | 67,014 | 399,408 | 2020/6/11 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.5 | 85,600 | 89,956 | 536,141 | 2021/6/10 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.5 | 27,400 | 28,748 | 171,339 | 2022/6/9 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 30,700 | 39,482 | 235,316 | 2024/12/5 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5 | 71,600 | 80,001 | 476,807 | 2027/6/3 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 47,100 | 56,799 | 338,523 | 2029/5/31 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 41,000 | 46,552 | 277,455 | 2031/5/29 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 10,000 | 11,373 | 67,786 | 2034/11/23 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 46,000 | 64,233 | 382,830 | 2036/11/20 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 30,500 | 37,504 | 223,523 | 2038/11/18 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 54,200 | 62,140 | 370,356 | 2042/11/13 |
| | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 8.0 | 83,000 | 94,542 | 563,472 | 2023/12/7 |
| 小計 | | | | | 5,904,747 | |
| 南アフリカ | | | 千ランド | 千ランド | | |
| 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.25 | 10,300 | 10,349 | 74,105 | 2017/9/15 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.0 | 23,800 | 23,668 | 169,466 | 2018/12/21 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.25 | 25,300 | 24,316 | 174,106 | 2020/1/15 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.75 | 26,100 | 24,158 | 172,976 | 2021/3/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.75 | 25,200 | 23,740 | 169,982 | 2023/2/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 10.5 | 61,900 | 67,588 | 483,934 | 2026/12/21 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.0 | 24,300 | 21,482 | 153,813 | 2030/1/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.0 | 30,000 | 23,853 | 170,787 | 2031/2/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.25 | 41,000 | 36,329 | 260,119 | 2032/3/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.25 | 47,100 | 32,950 | 235,927 | 2036/3/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.5 | 22,500 | 19,831 | 141,993 | 2037/1/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.5 | 24,600 | 17,062 | 122,168 | 2041/2/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.75 | 12,300 | 10,966 | 78,523 | 2044/1/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.75 | 46,100 | 40,970 | 293,346 | 2048/2/28 |
| 小計 | | | | | 2,701,252 | |
| 合計 | | | | | 626,360,972 | |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年5月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 626,360,972 | % 98.3 |
| コール・ローン等、その他 | 11,133,784 | 1.7 |
| 投資信託財産総額 | 637,494,756 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産(631,449,795千円)の投資信託財産総額(637,494,756千円)に対する比率は99.1%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=108.46円、1カナダドル=83.59円、1英ポンド=156.26円、1スイスフラン=111.70円、1スウェーデンクローナ=13.28円、1ノルウェークローネ=13.19円、1デンマーククローネ=16.60円、1ユーロ=123.49円、1ズロチ=27.86円、1シンガポールドル=79.08円、1リンギ=26.78円、1豪ドル=79.20円、1メキシコペソ=5.96円、1ランド=7.16円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 639,133,070,846 |
| コール・ローン等 | 4,545,792,238 |
| 公社債(評価額) | 626,360,972,586 |
| 未収入金 | 1,823,000,886 |
| 未収利息 | 5,918,367,356 |
| 前払費用 | 484,937,780 |
| (B) 負債 | 6,235,070,181 |
| 前受収益 | 10,513 |
| 未払金 | 5,707,149,631 |
| 未払解約金 | 520,172,349 |
| 未払利息 | 3,488 |
| その他未払費用 | 7,734,200 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 632,898,000,665 |
| 元本 | 291,325,475,847 |
| 次期繰越損益金 | 341,572,524,818 |
| (D) 受益権総口数 | 291,325,475,847口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 21,725円 |

(注) 期首元本額は226,250,611,838円、期中追加設定元本額は93,884,664,448円、期中一部解約元本額は28,809,800,439円、1口当たり純資産額は2.1725円です。

○損益の状況 (2015年5月12日～2016年5月10日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 17,097,914,261 |
| 受取利息 | 17,098,505,784 |
| 支払利息 | △ 591,523 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 61,369,438,009 |
| 売買益 | 9,743,040,445 |
| 売買損 | △ 71,112,478,454 |
| (C) 保管費用等 | △ 66,787,725 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 44,338,311,473 |
| (E) 前期繰越損益金 | 299,807,870,946 |
| (F) 追加信託差損益金 | 123,857,945,032 |
| (G) 解約差損益金 | △ 37,754,979,687 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 341,572,524,818 |
| 次期繰越損益金(H) | 341,572,524,818 |

*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(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。

○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 |
| 野村外国債券インデックス（野村投資一任口座向け） | 176,457,397,990 |
| 野村世界6資産分散投信（分配コース） | 30,422,937,991 |
| 野村外国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け） | 12,220,623,842 |
| グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用） | 9,732,837,067 |
| マイ・ロード | 8,243,352,955 |
| 野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用） | 7,294,994,580 |
| のむらップ・ファンド（普通型） | 6,049,210,521 |
| のむらップ・ファンド（保守型） | 4,203,459,238 |
| グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用） | 2,511,358,868 |
| 野村DC外国債券インデックスファンド | 2,493,189,250 |
| マイバランス50（確定拠出年金向け） | 2,400,306,707 |
| マイバランス70（確定拠出年金向け） | 2,163,660,740 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用） | 2,115,180,803 |
| 野村外国債券インデックス（野村SMA向け） | 2,018,404,437 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用） | 1,907,486,569 |
| マイバランス30（確定拠出年金向け） | 1,820,986,375 |
| グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用） | 1,804,312,476 |
| 野村世界6資産分散投信（安定コース） | 1,745,367,331 |
| 野村外国債券インデックス（野村SMA向け） | 1,689,490,286 |
| 野村世界6資産分散投信（成長コース） | 1,515,216,664 |
| のむらップ・ファンド（積極型） | 1,486,329,678 |
| 野村世界6資産分散投信（配分変更コース） | 1,421,173,277 |
| ノムラ外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用） | 1,251,940,876 |
| 野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用） | 1,112,958,024 |
| マイバランスDC30 | 1,012,111,671 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 754,737,592 |
| グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用） | 650,873,984 |
| マイバランスDC50 | 586,652,515 |
| 野村インデックスファンド・外国債券 | 571,229,988 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用） | 520,369,883 |
| 野村外国債券バッシブファンド（確定拠出年金向け） | 518,466,464 |
| ネクストコア | 483,317,021 |
| マイバランスDC70 | 354,395,352 |
| 野村外国債券インデックスファンド | 286,101,969 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用） | 240,094,682 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用） | 210,656,574 |
| ノムラFOfs用インデックスファンド・外国債券（適格機関投資家専用） | 197,213,360 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用） | 105,881,930 |
| バランスセレクト50 | 89,600,390 |
| バランスセレクト30 | 86,883,757 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 83,971,392 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 72,555,388 |
| バランスセレクト70 | 67,555,802 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 50,467,803 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 46,681,186 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 46,648,867 |
| 野村外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用） | 43,530,310 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 39,447,006 |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用） | 36,879,283 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 25,922,484 |
| マイターゲット2050（確定拠出年金向け） | 11,597,920 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用） | 8,766,188 |
| バランスセレクト50（確定拠出年金向け） | 7,574,123 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 5,375,804 |

| ファンド名 | 当期末 |
|-----------------------------------|-----------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| バランスセレクト70 (確定拠出年金向け) | 5,063,000 |
| 野村DC運用戦略ファンドM | 5,055,226 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型 (適格機関投資家専用) | 4,450,812 |
| バランスセレクト30 (確定拠出年金向け) | 4,353,670 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型 | 2,628,781 |
| 野村DC運用戦略ファンドA | 2,591,399 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 2,348,224 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型 | 347,674 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型 | 266,217 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型 | 244,786 |
| マイターゲット2040 (確定拠出年金向け) | 218,042 |
| マイターゲット2030 (確定拠出年金向け) | 170,783 |

○お知らせ

信託金限度額を、1兆円から3兆円に変更する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日：2016年4月15日>