

# 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10期(決算日2020年7月20日)

作成対象期間(2019年7月23日～2020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、FTSE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

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額				ベンチマーク FTSE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	中 落				率
	円		円		%	%	%	%	百万円	
6期(2016年7月20日)	14,255		5		△9.6	144.73	△9.2	98.8	—	3,520
7期(2017年7月20日)	14,972		5		5.1	151.77	4.9	98.9	—	3,477
8期(2018年7月20日)	15,165		5		1.3	154.63	1.9	99.0	—	2,335
9期(2019年7月22日)	15,195		5		0.2	154.94	0.2	99.0	—	2,213
10期(2020年7月20日)	16,258		5		7.0	166.03	7.2	99.0	—	1,447

\* 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（＝FTSE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>*FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> <p>(出所) FTSE Fixed Income 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 FTSE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	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2019年7月22日	円 15,195	% —	154.94	% —	% 99.0	% —
7 月 末	15,240	0.3	155.63	0.4	98.9	—
8 月 末	15,339	0.9	156.84	1.2	99.2	—
9 月 末	15,408	1.4	157.92	1.9	99.1	—
10 月 末	15,558	2.4	158.79	2.5	99.0	—
11 月 末	15,560	2.4	159.08	2.7	99.2	—
12 月 末	15,627	2.8	159.73	3.1	99.0	—
2020年1月末	15,750	3.7	160.58	3.6	98.9	—
2 月 末	15,932	4.9	163.77	5.7	98.8	—
3 月 末	15,944	4.9	162.35	4.8	98.5	—
4 月 末	15,639	2.9	159.75	3.1	98.8	—
5 月 末	15,864	4.4	162.51	4.9	99.1	—
6 月 末	16,117	6.1	165.13	6.6	99.0	—
(期 末) 2020年7月20日	16,263	7.0	166.03	7.2	99.0	—

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

\* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



- (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（2019年7月22日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、FTSE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（2019年7月22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

米ドルなどの主要通貨が概ね対円で下落（円高）したことはマイナスに影響しましたが、外国債券利回りが米国を中心に低下（価格は上昇）したことがプラスに寄与したため、基準価額は上昇しました。

### ○投資環境

新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の減速懸念から、主要国の中央銀行が政策金利の引き下げや金融緩和姿勢の強化を打ち出したことなどを背景に、外国債券利回りは米国を中心に低下（価格は上昇）しました。

為替市場は、ユーロなど金融緩和余地が相対的に小さい一部の通貨は対円で上昇（円安）しましたが、米ドルなどの主要通貨は概ね内外長期金利差の縮小などを背景に対円で下落（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）]

FTSE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]

FTSE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+7.0%となり、ベンチマークの+7.2%を0.2ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

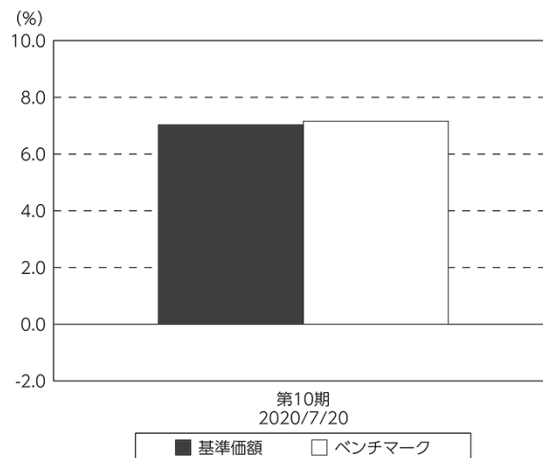
### (マイナス要因)

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、FTSE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10期
	2019年7月23日～ 2020年7月20日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.031%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	6,257

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

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

## ◎今後の運用方針

### [野村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、FTSE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運用を行ってまいります。

### [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、FTSE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

（2019年7月23日～2020年7月20日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 51	% 0.328	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(38)	(0.241)	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 ）	(9)	(0.055)	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)	(0.033)	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	3	0.016	(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 ）	(1)	(0.004)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	54	0.344	
期中の平均基準価額は、15,664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。

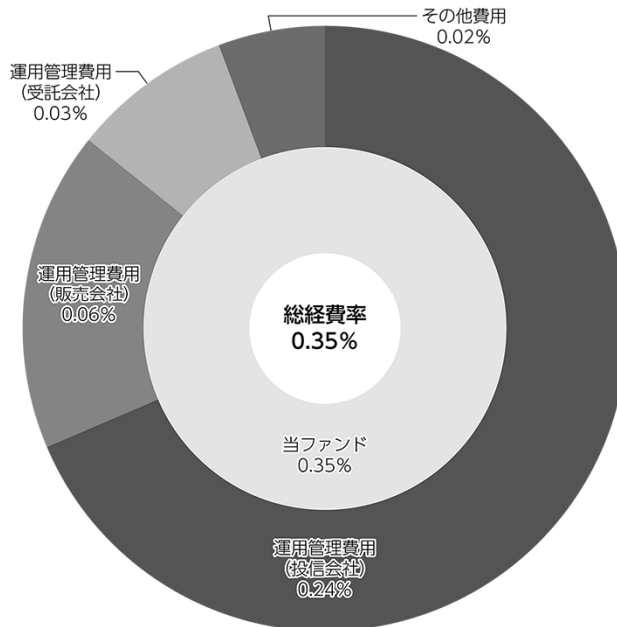
\* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

\* 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。

## （参考情報）

### ○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.35%です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

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



## ○売買及び取引の状況

(2019年7月23日～2020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 1,582	千円 3,740	千口 378,897	千円 899,331

\*単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年7月23日～2020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）>  
該当事項はございません。

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	B A	%	うち利害関係人 との取引状況D	D C	%
為替直物取引	百万円 92,740	百万円 455	0.5	百万円 154,408	百万円 628	0.4

平均保有割合 0.3%

※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信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2020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 965,207	千口 587,892	千円 1,447,155

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

（2020年7月20日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券マザーファンド	1,447,155	99.8
コール・ローン等、その他	3,470	0.2
投資信託財産総額	1,450,625	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（588,981,317千円）の投資信託財産総額（749,406,425千円）に対する比率は78.6%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=107.52円、1カナダドル=79.13円、1英ポンド=134.89円、1スウェーデンクローナ=11.88円、1ノルウェークローネ=11.55円、1デンマーククローネ=16.50円、1ユーロ=122.79円、1ズロチ=27.41円、1シンガポールドル=77.35円、1リンギ=25.21円、1豪ドル=75.12円、1新シッケル=31.32円、1メキシコペソ=4.77円、1ランド=6.43円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年7月20日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,450,625,420
コール・ローン等	2,972,238
外国債券マザーファンド(評価額)	1,447,155,902
未収入金	497,280
(B) 負債	3,325,275
未払収益分配金	445,108
未払信託報酬	2,861,151
未払利息	3
その他未払費用	19,013
(C) 純資産総額(A-B)	1,447,300,145
元本	890,217,806
次期繰越損益金	557,082,339
(D) 受益権総口数	890,217,806口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,258円

(注) 期首元本額は1,457,047,970円、期中追加設定元本額は2,439,105円、期中一部解約元本額は569,269,269円、1口当たり純資産額は1.6258円です。

## ○損益の状況（2019年7月23日～2020年7月20日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 438
支払利息	△ 438
(B) 有価証券売買損益	100,662,406
売買益	127,206,575
売買損	△ 26,544,169
(C) 信託報酬等	△ 6,211,972
(D) 当期損益金(A+B+C)	94,449,996
(E) 前期繰越損益金	69,504,782
(F) 追加信託差損益金	393,572,669
(配当等相当額)	( 200,601,540)
(売買損益相当額)	( 192,971,129)
(G) 計(D+E+F)	557,527,447
(H) 収益分配金	△ 445,108
次期繰越損益金(G+H)	557,082,339
追加信託差損益金	393,572,669
(配当等相当額)	( 200,655,941)
(売買損益相当額)	( 192,916,728)
分配準備積立金	230,960,459
繰越損益金	△ 67,450,789

\*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（2019年7月23日～2020年7月20日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2019年7月23日～ 2020年7月20日
a. 配当等収益(経費控除後)	36,333,396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	326,121,880円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	195,072,171円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	557,527,447円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	6,262円
g. 分配金	445,108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

（2020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(239,453,217千口)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 2,134,510	千米ドル 2,453,891	千円 263,842,371	% 44.8	% —	% 21.0	% 14.3	% 9.4
カナダ	千カナダドル 110,140	千カナダドル 137,872	10,909,823	1.9	—	1.0	0.6	0.3
イギリス	千英ポンド 190,970	千英ポンド 278,470	37,562,928	6.4	—	5.3	1.0	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 129,800	千スウェーデンクローナ 146,486	1,740,255	0.3	—	0.1	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 100,100	千ノルウェークローネ 109,221	1,261,506	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 144,770	千デンマーククローネ 187,577	3,095,025	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	237,450	326,351	40,072,737	6.8	—	5.0	1.5	0.3
イタリア	382,150	473,113	58,093,631	9.9	—	5.6	2.7	1.5
フランス	359,520	474,319	58,241,738	9.9	—	7.4	2.0	0.4
オランダ	60,550	80,693	9,908,325	1.7	—	1.3	0.4	0.0
スペイン	242,150	317,607	38,999,082	6.6	—	4.6	1.2	0.8
ベルギー	86,400	115,496	14,181,781	2.4	—	1.9	0.5	0.0
オーストリア	49,900	64,568	7,928,306	1.3	—	1.2	0.1	0.1
フィンランド	18,900	21,468	2,636,143	0.4	—	0.3	0.1	0.0
アイルランド	45,780	51,993	6,384,260	1.1	—	0.6	0.5	0.0
ポーランド	千ズロチ 123,400	千ズロチ 132,659	3,636,205	0.6	—	0.2	0.2	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 28,700	千シンガポールドル 32,732	2,531,864	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マレーシア	千リンギ 108,580	千リンギ 119,570	3,014,383	0.5	—	0.3	0.1	0.0
オーストラリア	千豪ドル 146,800	千豪ドル 172,719	12,974,670	2.2	—	1.6	0.4	0.2
イスラエル	千新シェケル 59,600	千新シェケル 71,284	2,232,629	0.4	—	0.2	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコペソ 813,800	千メキシコペソ 917,513	4,376,537	0.7	—	0.5	0.2	0.1
合 計	—	—	583,624,209	99.0	—	58.9	26.4	13.7

\* 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	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 BOND	8.0	50,500	55,741	5,993,309	2021/11/15
	US TREASURY BOND	6.25	38,800	46,044	4,950,724	2023/8/15
	US TREASURY BOND	2.375	45,100	49,028	5,271,558	2024/8/15
	US TREASURY BOND	6.0	72,200	94,751	10,187,650	2026/2/15
	US TREASURY BOND	6.125	10,800	15,220	1,636,497	2027/11/15
	US TREASURY BOND	5.5	46,200	64,438	6,928,392	2028/8/15
	US TREASURY BOND	5.25	49,300	68,276	7,341,104	2028/11/15
	US TREASURY BOND	5.25	27,500	38,362	4,124,736	2029/2/15
	US TREASURY BOND	4.375	100	156	16,826	2038/2/15
	US TREASURY BOND	2.875	17,500	23,236	2,498,412	2043/5/15
	US TREASURY BOND	3.75	2,000	3,020	324,811	2043/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	32,800	33,415	3,592,780	2021/6/30
	US TREASURY N/B	1.125	500	504	54,264	2021/6/30
	US TREASURY N/B	1.625	19,200	19,470	2,093,494	2021/6/30
	US TREASURY N/B	2.625	3,500	3,585	385,536	2021/7/15
	US TREASURY N/B	2.25	11,400	11,647	1,252,349	2021/7/31
	US TREASURY N/B	1.125	4,300	4,343	467,013	2021/7/31
	US TREASURY N/B	2.125	26,100	26,655	2,866,014	2021/8/15
	US TREASURY N/B	2.0	12,200	12,453	1,338,952	2021/8/31
	US TREASURY N/B	2.125	17,900	18,320	1,969,866	2021/9/30
	US TREASURY N/B	1.125	9,650	9,761	1,049,605	2021/9/30
	US TREASURY N/B	2.0	30,400	31,107	3,344,705	2021/10/31
	US TREASURY N/B	1.25	1,900	1,925	207,080	2021/10/31
	US TREASURY N/B	1.5	13,000	13,217	1,421,183	2021/10/31
	US TREASURY N/B	2.0	7,500	7,680	825,772	2021/11/15
	US TREASURY N/B	1.875	1,000	1,023	110,010	2021/11/30
	US TREASURY N/B	1.75	3,700	3,778	406,308	2021/11/30
	US TREASURY N/B	2.125	12,400	12,743	1,370,224	2021/12/31
	US TREASURY N/B	2.0	6,700	6,876	739,350	2021/12/31
	US TREASURY N/B	2.5	80,000	82,759	8,898,287	2022/1/15
	US TREASURY N/B	1.5	6,400	6,530	702,105	2022/1/31
	US TREASURY N/B	1.875	14,000	14,363	1,544,323	2022/1/31
	US TREASURY N/B	1.375	2,300	2,341	251,807	2022/1/31
	US TREASURY N/B	2.0	32,800	33,749	3,628,736	2022/2/15
	US TREASURY N/B	1.75	6,800	6,972	749,642	2022/2/28
	US TREASURY N/B	1.875	3,500	3,595	386,580	2022/2/28
	US TREASURY N/B	1.75	3,900	4,003	430,433	2022/3/31
	US TREASURY N/B	1.875	500	514	55,309	2022/3/31
	US TREASURY N/B	2.25	1,300	1,346	144,826	2022/4/15
	US TREASURY N/B	1.75	32,800	33,725	3,626,118	2022/4/30
	US TREASURY N/B	1.875	25,300	26,066	2,802,713	2022/4/30
	US TREASURY N/B	1.75	8,800	9,052	973,341	2022/5/15
	US TREASURY N/B	1.875	200	206	22,191	2022/5/31
	US TREASURY N/B	1.75	900	926	99,610	2022/5/31
	US TREASURY N/B	2.125	16,400	17,030	1,831,105	2022/6/30
	US TREASURY N/B	1.75	100	103	11,084	2022/6/30
	US TREASURY N/B	2.0	100	103	11,156	2022/7/31

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	1.875	1,000	1,035	111,283	2022/7/31
	US TREASURY N/B	1.625	900	927	99,727	2022/8/15
	US TREASURY N/B	1.875	19,100	19,798	2,128,717	2022/8/31
	US TREASURY N/B	1.75	900	931	100,185	2022/9/30
	US TREASURY N/B	2.0	1,500	1,562	168,033	2022/10/31
	US TREASURY N/B	1.625	7,600	7,857	844,890	2022/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	10,200	10,693	1,149,739	2022/12/31
	US TREASURY N/B	1.75	47,900	49,827	5,357,423	2023/1/31
	US TREASURY N/B	2.0	400	418	45,030	2023/2/15
	US TREASURY N/B	1.5	20,000	20,701	2,225,831	2023/2/28
	US TREASURY N/B	2.625	14,300	15,218	1,636,274	2023/2/28
	US TREASURY N/B	1.5	400	414	44,556	2023/3/31
	US TREASURY N/B	1.625	15,000	15,605	1,677,941	2023/4/30
	US TREASURY N/B	1.75	34,800	36,341	3,907,441	2023/5/15
	US TREASURY N/B	1.625	9,200	9,583	1,030,451	2023/5/31
	US TREASURY N/B	1.25	4,800	4,956	532,949	2023/7/31
	US TREASURY N/B	2.75	41,100	44,298	4,762,931	2023/7/31
	US TREASURY N/B	2.5	6,500	6,963	748,675	2023/8/15
	US TREASURY N/B	1.375	10,900	11,304	1,215,458	2023/8/31
	US TREASURY N/B	1.375	35,200	36,539	3,928,699	2023/9/30
	US TREASURY N/B	1.625	11,800	12,357	1,328,703	2023/10/31
	US TREASURY N/B	2.75	42,600	46,204	4,967,892	2023/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	9,200	9,798	1,053,480	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.875	30,000	32,697	3,515,651	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	43,000	46,046	4,950,968	2023/12/31
	US TREASURY N/B	2.5	1,300	1,405	151,121	2024/1/31
	US TREASURY N/B	2.75	800	872	93,851	2024/2/15
	US TREASURY N/B	2.125	1,700	1,820	195,721	2024/3/31
	US TREASURY N/B	2.5	20,900	22,720	2,442,917	2024/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	17,700	18,937	2,036,172	2024/6/30
	US TREASURY N/B	2.125	3,800	4,089	439,666	2024/7/31
	US TREASURY N/B	2.125	42,700	46,065	4,953,012	2024/9/30
	US TREASURY N/B	2.25	3,600	3,907	420,124	2024/10/31
	US TREASURY N/B	2.25	34,200	37,147	3,994,053	2024/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,300	2,487	267,485	2024/11/30
	US TREASURY N/B	2.0	16,900	18,234	1,960,609	2025/2/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,900	2,116	227,573	2025/2/28
	US TREASURY N/B	2.625	32,700	36,289	3,901,829	2025/3/31
	US TREASURY N/B	2.875	34,500	38,763	4,167,903	2025/4/30
	US TREASURY N/B	2.125	8,050	8,760	941,878	2025/5/15
	US TREASURY N/B	2.75	4,100	4,594	494,041	2025/6/30
	US TREASURY N/B	2.0	27,000	29,311	3,151,612	2025/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	19,200	21,864	2,350,817	2025/9/30
	US TREASURY N/B	2.25	50,300	55,420	5,958,799	2025/11/15
	US TREASURY N/B	1.625	2,000	2,141	230,227	2026/2/15
	US TREASURY N/B	2.375	8,600	9,589	1,031,081	2026/4/30
	US TREASURY N/B	1.625	1,800	1,929	207,491	2026/5/15
	US TREASURY N/B	1.5	21,100	22,509	2,420,212	2026/8/15

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	1.375	12,000	12,704	1,365,940	2026/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	5,600	6,020	647,317	2026/10/31
	US TREASURY N/B	2.0	13,000	14,285	1,536,007	2026/11/15
	US TREASURY N/B	1.625	30,000	32,268	3,469,536	2026/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	11,300	12,631	1,358,115	2027/2/15
	US TREASURY N/B	0.5	17,000	17,053	1,833,552	2027/4/30
	US TREASURY N/B	2.375	38,000	42,922	4,614,993	2027/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	8,400	9,441	1,015,146	2027/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	500	583	62,764	2028/2/15
	US TREASURY N/B	2.875	1,800	2,125	228,508	2028/5/15
	US TREASURY N/B	3.125	1,200	1,451	156,088	2028/11/15
	US TREASURY N/B	1.5	2,000	2,165	232,864	2030/2/15
	US TREASURY N/B	6.25	1,700	2,619	281,687	2030/5/15
	US TREASURY N/B	5.375	34,100	50,737	5,455,249	2031/2/15
	US TREASURY N/B	4.5	15,450	23,782	2,557,055	2036/2/15
	US TREASURY N/B	5.0	200	330	35,484	2037/5/15
	US TREASURY N/B	4.5	100	158	17,081	2038/5/15
	US TREASURY N/B	3.5	100	142	15,350	2039/2/15
	US TREASURY N/B	4.25	100	155	16,763	2039/5/15
	US TREASURY N/B	4.5	100	160	17,278	2039/8/15
	US TREASURY N/B	4.375	100	158	17,063	2039/11/15
	US TREASURY N/B	4.625	100	163	17,592	2040/2/15
	US TREASURY N/B	4.375	100	159	17,154	2040/5/15
	US TREASURY N/B	3.875	200	301	32,383	2040/8/15
	US TREASURY N/B	4.25	100	157	16,982	2040/11/15
	US TREASURY N/B	4.75	100	167	18,034	2041/2/15
	US TREASURY N/B	4.375	100	160	17,301	2041/5/15
	US TREASURY N/B	3.75	100	149	16,050	2041/8/15
	US TREASURY N/B	3.125	300	412	44,304	2041/11/15
	US TREASURY N/B	3.125	100	137	14,806	2042/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	100	135	14,532	2042/5/15
	US TREASURY N/B	2.75	200	260	28,017	2042/8/15
	US TREASURY N/B	3.125	1,290	1,776	191,038	2043/2/15
	US TREASURY N/B	3.625	100	148	15,945	2043/8/15
	US TREASURY N/B	3.625	7,400	10,998	1,182,593	2044/2/15
	US TREASURY N/B	3.375	15,200	21,832	2,347,396	2044/5/15
	US TREASURY N/B	3.125	23,000	31,867	3,426,401	2044/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	36,900	50,209	5,398,573	2044/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	39,400	49,410	5,312,569	2045/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	21,900	29,881	3,212,861	2045/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	17,500	23,437	2,520,020	2045/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	3,700	5,066	544,801	2045/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	51,500	64,890	6,976,972	2046/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	28,200	35,582	3,825,848	2046/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	34,500	41,639	4,477,120	2046/8/15
	US TREASURY N/B	2.875	14,200	19,193	2,063,663	2046/11/15
	US TREASURY N/B	3.0	1,700	2,355	253,255	2047/5/15
	US TREASURY N/B	2.75	11,400	15,154	1,629,452	2047/8/15

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		2.75	9,300	12,387	1,331,867	2047/11/15
	US TREASURY N/B		3.0	9,500	13,240	1,423,632	2048/2/15
	US TREASURY N/B		3.125	5,100	7,273	782,044	2048/5/15
	US TREASURY N/B		3.0	10,500	14,690	1,579,485	2048/8/15
	US TREASURY N/B		3.0	2,470	3,469	373,049	2049/2/15
	US TREASURY N/B		2.875	100	137	14,799	2049/5/15
	US TREASURY N/B		2.25	9,400	11,517	1,238,329	2049/8/15
	US TREASURY N/B		2.375	300	377	40,577	2049/11/15
小 計						263,842,371	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	CANADA GOVERNMENT		2.75	5,500	5,758	455,691	2022/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		1.5	11,600	11,759	930,492	2021/8/1
	CANADIAN GOVERNMENT		0.75	1,000	1,006	79,634	2021/9/1
	CANADIAN GOVERNMENT		0.5	300	301	23,850	2022/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT		1.0	10,400	10,568	836,283	2022/9/1
	CANADIAN GOVERNMENT		1.75	300	311	24,664	2023/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT		1.5	4,460	4,617	365,377	2023/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		2.0	1,100	1,158	91,704	2023/9/1
	CANADIAN GOVERNMENT		2.25	500	535	42,350	2024/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT		2.5	6,800	7,374	583,519	2024/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		1.25	17,000	17,721	1,402,341	2025/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT		2.25	3,700	4,041	319,831	2025/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		1.5	300	320	25,328	2026/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		8.0	7,250	10,977	868,622	2027/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		1.0	200	208	16,488	2027/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		2.0	100	112	8,874	2028/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		5.75	10,080	14,699	1,163,144	2029/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		2.25	1,000	1,155	91,416	2029/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		5.75	5,700	9,265	733,189	2033/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		5.0	3,800	6,315	499,732	2037/6/1
CANADIAN GOVERNMENT		4.0	7,100	11,278	892,455	2041/6/1	
CANADIAN GOVERNMENT		3.5	9,950	15,597	1,234,231	2045/12/1	
CANADIAN GOVERNMENT		2.75	1,300	1,863	147,482	2048/12/1	
CANADIAN GOVERNMENT		2.0	600	761	60,260	2051/12/1	
CANADIAN GOVERNMENT		2.75	100	162	12,855	2064/12/1	
小 計						10,909,823	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
国債証券	UK TREASURY		3.75	470	490	66,118	2021/9/7
	UK TREASURY		4.0	650	693	93,528	2022/3/7
	UK TREASURY		1.75	400	415	56,080	2022/9/7
	UK TREASURY		0.125	6,000	6,029	813,305	2023/1/31
	UK TREASURY		0.75	14,000	14,358	1,936,880	2023/7/22
	UK TREASURY		2.25	1,100	1,180	159,232	2023/9/7
	UK TREASURY		1.0	1,600	1,666	224,815	2024/4/22
	UK TREASURY		2.75	7,450	8,329	1,123,522	2024/9/7
	UK TREASURY		5.0	9,950	12,290	1,657,924	2025/3/7
	UK TREASURY		0.625	200	206	27,895	2025/6/7
	UK TREASURY		2.0	200	221	29,902	2025/9/7



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
イギリス			%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
国債証券	UK TREASURY		1.5	160	174	23,593	2026/7/22
	UK TREASURY		1.25	400	434	58,673	2027/7/22
	UK TREASURY		4.25	9,630	12,646	1,705,821	2027/12/7
	UK TREASURY		1.625	200	226	30,496	2028/10/22
	UK TREASURY		6.0	7,900	11,796	1,591,221	2028/12/7
	UK TREASURY		4.75	6,000	8,836	1,191,915	2030/12/7
	UK TREASURY		4.25	5,550	8,124	1,095,858	2032/6/7
	UK TREASURY		4.5	15,700	24,603	3,318,762	2034/9/7
	UK TREASURY		4.25	2,600	4,088	551,532	2036/3/7
	UK TREASURY		4.75	100	173	23,468	2038/12/7
	UK TREASURY		4.25	600	1,000	134,973	2039/9/7
	UK TREASURY		4.25	500	848	114,467	2040/12/7
	UK TREASURY		1.25	400	448	60,484	2041/10/22
	UK TREASURY		4.5	920	1,660	223,973	2042/12/7
	UK TREASURY		3.5	18,440	30,202	4,074,065	2045/1/22
	UK TREASURY		4.25	6,300	11,735	1,582,935	2046/12/7
	UK TREASURY		1.5	8,200	9,867	1,331,078	2047/7/22
	UK TREASURY		1.75	16,100	20,595	2,778,075	2049/1/22
	UK TREASURY		4.25	5,350	10,446	1,409,188	2049/12/7
	UK TREASURY		3.75	6,750	12,772	1,722,862	2052/7/22
	UK TREASURY		1.625	1,000	1,294	174,588	2054/10/22
	UK TREASURY		1.75	700	957	129,123	2057/7/22
	UK TREASURY		2.5	100	174	23,474	2065/7/22
	UK TREASURY		3.5	650	1,434	193,462	2068/7/22
	UK TSY 3 1/4% 2044		3.25	27,900	43,515	5,869,823	2044/1/22
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)		4.25	6,800	14,528	1,959,800	2055/12/7
小計						37,562,928	
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		3.5	36,050	38,601	458,587	2022/6/1
	SWEDISH GOVERNMENT		1.5	7,900	8,383	99,598	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT		2.5	32,250	36,624	435,101	2025/5/12
	SWEDISH GOVERNMENT		1.0	12,000	12,955	153,906	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT		0.75	16,800	18,029	214,192	2028/5/12
	SWEDISH GOVERNMENT		0.75	14,300	15,410	183,076	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT		3.5	10,500	16,480	195,793	2039/3/30
小計						1,740,255	
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		2.0	10,300	10,832	125,115	2023/5/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT		3.0	38,900	42,826	494,651	2024/3/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.75	4,700	5,013	57,903	2025/3/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.5	4,700	4,991	57,656	2026/2/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.75	9,600	10,405	120,182	2027/2/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT		2.0	7,200	8,006	92,473	2028/4/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.75	22,000	24,252	280,119	2029/9/6
	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.375	2,700	2,892	33,403	2030/8/19
小計						1,261,506	
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		3.0	14,400	15,084	248,902	2021/11/15

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		
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	千円		
国債証券	KINGDOM OF DENMARK	0.25	400	407	6,730	2022/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	1.5	22,770	24,377	402,229	2023/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	1.75	32,000	35,908	592,495	2025/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	0.5	15,700	16,803	277,261	2027/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	0.5	21,400	23,082	380,853	2029/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	4.5	38,100	71,912	1,186,552	2039/11/15	
小 計					3,095,025		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	BUNDES OblIGATION	—	100	100	12,375	2021/10/8
		BUNDES OblIGATION	—	3,700	3,742	459,584	2022/4/8
		BUNDES OblIGATION	—	750	761	93,507	2022/10/7
		BUNDES OblIGATION	—	1,000	1,019	125,183	2023/4/14
		BUNDES OblIGATION	—	2,000	2,059	252,827	2024/10/18
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	350	363	44,580	2021/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	400	413	50,733	2021/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	4,000	4,192	514,745	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	700	733	90,012	2022/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	390	412	50,641	2023/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	9,200	9,774	1,200,215	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	2,580	2,797	343,501	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	23,900	29,715	3,648,776	2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	1,700	1,851	227,306	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	10,800	11,720	1,439,118	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	8,100	8,666	1,064,201	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	2,700	2,850	349,959	2025/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	9,100	9,890	1,214,400	2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	20,800	22,194	2,725,228	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	1,041	127,858	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	700	742	91,141	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	20,200	30,446	3,738,494	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	200	216	26,566	2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	18,200	26,863	3,298,599	2028/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	600	651	80,000	2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	7,300	10,476	1,286,367	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	19,200	31,845	3,910,309	2030/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	6,200	10,173	1,249,221	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	8,600	14,912	1,831,060	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	8,400	14,465	1,776,183	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	3,800	7,103	872,220	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	6,200	12,485	1,533,104	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	1,430	2,524	309,989	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	5,800	9,492	1,165,633	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	11,200	18,787	2,306,951	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	12,950	17,633	2,165,217	2048/8/15
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	1,500	1,513	185,896	2021/12/10
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	1,700	1,718	211,020	2022/3/11
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	8,000	8,318	1,021,406	2021/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	16,500	17,383	2,134,488	2021/9/1

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		
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	2.3	5,900	6,078	746,397	2021/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	10,050	10,105	1,240,814	2021/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.15	2,600	2,680	329,195	2021/12/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	18,900	20,434	2,509,127	2022/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2	6,200	6,321	776,265	2022/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	1,900	1,942	238,564	2022/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9	400	406	49,911	2022/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	8,200	9,138	1,122,064	2022/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	3,100	3,189	391,661	2022/9/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	31,100	34,884	4,283,513	2022/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.05	1,900	1,894	232,624	2023/1/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	100	101	12,522	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,100	1,230	151,128	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	500	567	69,720	2023/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	18,700	23,986	2,945,301	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	14,700	16,838	2,067,642	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.85	300	315	38,785	2024/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	5,800	6,552	804,623	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	4,700	4,884	599,793	2024/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,000	1,083	132,981	2024/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	16,800	20,174	2,477,208	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	800	829	101,905	2025/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	3,000	3,128	384,093	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	7,000	7,659	940,497	2025/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	3,000	3,207	393,898	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	11,500	13,863	1,702,268	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1	2,000	2,150	264,096	2026/7/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7.25	18,100	25,193	3,093,496	2026/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	17,500	24,262	2,979,130	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	5,800	7,486	919,213	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	29,900	40,783	5,007,818	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	16,000	23,566	2,893,718	2031/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	500	518	63,648	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	10,900	16,284	1,999,586	2033/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,400	1,567	192,483	2033/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	15,400	22,045	2,706,917	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.35	8,000	9,846	1,209,039	2035/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	700	929	114,188	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	500	590	72,495	2038/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	5,000	7,562	928,537	2039/8/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.1	200	241	29,594	2040/3/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	11,700	17,778	2,182,979	2040/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	8,800	13,400	1,645,464	2044/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	5,500	6,833	839,116	2046/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.45	2,800	3,602	442,382	2048/3/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.85	7,000	9,624	1,181,767	2049/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	9,000	9,701	1,191,198	2050/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	1,700	1,941	238,351	2067/3/1		

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	6,000	6,060	744,184	2022/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,600	2,643	324,553	2023/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	1,570	1,676	205,885	2023/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	100	102	12,543	2024/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	9,600	10,658	1,308,722	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,800	1,844	226,519	2025/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	11,000	11,558	1,419,302	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,800	1,903	233,692	2026/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	13,300	13,878	1,704,184	2026/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	7,700	8,442	1,036,682	2027/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	2,000	2,171	266,611	2028/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	11,600	12,625	1,550,323	2028/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	2,000	2,136	262,293	2029/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	9,500	12,053	1,480,091	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	10,500	12,249	1,504,150	2034/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	100	117	14,405	2036/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	100	128	15,717	2039/6/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	10,600	14,793	1,816,508	2048/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.5	2,500	3,167	388,996	2050/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	500	524	64,402	2052/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	1,700	1,783	218,994	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.0	8,500	9,047	1,110,992	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	—	3,400	3,439	422,379	2022/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.25	19,100	20,354	2,499,322	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8.5	10,900	13,666	1,678,099	2023/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	27,000	31,334	3,847,606	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.75	3,000	3,305	405,876	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6.0	19,800	26,783	3,288,741	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	6,000	6,489	796,894	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	34,100	42,064	5,165,045	2026/4/25
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.75	3,000	3,692	453,389	2027/10/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	27,000	40,889	5,020,835	2029/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.5	13,500	15,914	1,954,199	2031/5/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.75	20,100	34,593	4,247,754	2032/10/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.75	10,300	17,489	2,147,523	2035/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	300	504	61,990	2038/10/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.5	7,900	14,595	1,792,218	2041/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	29,450	49,152	6,035,409	2045/5/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	4,900	10,171	1,248,993	2055/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	4,700	10,307	1,265,698	2060/4/25		
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	50	51	6,374	2021/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	1,500	1,513	185,895	2022/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.25	100	105	12,990	2022/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	200	222	27,277	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	5,700	6,877	844,502	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	400	428	52,664	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	100	102	12,553	2024/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	8,700	9,626	1,181,990	2024/7/15

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	1,500	1,565	192,166	2025/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	1,900	2,023	248,453	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	2,500	2,721	334,192	2027/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	12,300	17,922	2,200,682	2028/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,000	1,098	134,847	2028/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	3,400	3,600	442,075	2029/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	9,500	12,817	1,573,877	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	2,200	3,719	456,739	2037/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	500	555	68,158	2040/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	1,500	2,741	336,603	2042/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	7,500	13,000	1,596,276	2047/1/15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	5,100	5,162	633,868	2021/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.05	10,700	10,766	1,322,043	2021/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	18,650	20,445	2,510,506	2022/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4	4,350	4,411	541,726	2022/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.45	3,000	3,057	375,369	2022/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	15,100	17,312	2,125,777	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.35	4,200	4,285	526,198	2023/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	5,300	6,129	752,645	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	14,600	17,250	2,118,145	2024/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	6,900	7,972	978,913	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	450	507	62,361	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	900	976	119,939	2025/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	15,100	18,772	2,305,038	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.15	5,000	5,603	688,082	2025/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	4,000	4,473	549,252	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	22,400	30,459	3,740,063	2026/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	3,100	3,402	417,781	2027/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	2,000	2,194	269,432	2028/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	5,000	5,487	673,810	2028/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	9,300	13,084	1,606,605	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	2,000	2,314	284,139	2030/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	5,400	6,593	809,603	2033/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	1,500	2,596	318,795	2040/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	5,700	9,776	1,200,403	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	9,100	17,048	2,093,421	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	3,200	4,491	551,467	2046/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	8,800	12,049	1,479,551	2048/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	3,000	5,053	620,495	2066/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	16,000	23,803	2,922,785	2029/1/31
		SPANISH GOVERNMENT	5.75	31,800	51,360	6,306,516	2032/7/30
SPANISH GOVERNMENT	4.2	500	768	94,339	2037/1/31		
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.25	700	740	90,909	2021/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	800	863	106,000	2022/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	600	664	81,549	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	11,100	12,038	1,478,221	2023/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.2	2,900	2,978	365,723	2023/10/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	4,000	4,501	552,751	2024/6/22

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	0.5	1,000	1,044	128,315	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	3,000	3,197	392,654	2025/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.5	6,000	7,714	947,208	2026/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.0	3,300	3,584	440,117	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	2,000	2,163	265,634	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	1,000	1,088	133,700	2028/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.9	3,000	3,307	406,172	2029/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,500	1,679	206,267	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	3,500	5,167	634,502	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.25	100	116	14,257	2033/4/22
		BELGIUM KINGDOM	1.45	500	601	73,895	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	100	128	15,801	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	3,400	6,019	739,142	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	4,000	7,073	868,518	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	5,200	6,584	808,502	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.7	4,000	5,237	643,139	2050/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.25	1,200	1,839	225,884	2057/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	1,000	1,583	194,463	2066/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	11,500	16,720	2,053,154	2028/3/28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	11,000	18,855	2,315,293	2035/3/28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5	700	733	90,038	2021/9/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	3,200	3,440	422,397	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	100	101	12,448	2022/9/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	200	219	26,891	2022/11/22
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	900	916	112,478	2023/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	150	161	19,844	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	1,300	1,329	163,298	2024/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	700	767	94,283	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	1,300	1,420	174,398	2025/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	5,400	7,068	867,953	2026/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	2,155	264,684	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	7,600	11,192	1,374,341	2027/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	7,600	8,139	999,461	2029/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	4,800	6,446	791,582	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	400	675	82,883	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	3,200	5,461	670,613	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	7,100	9,411	1,155,582	2047/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	2,269	278,681	2051/3/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	450	1,045	128,388	2062/1/26		
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1	800	1,612	198,053	2117/9/20		
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	—	500	505	62,051	2022/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.625	100	104	12,881	2022/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	100	105	13,000	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	—	400	407	50,087	2023/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.0	700	769	94,466	2024/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	4.0	3,600	4,431	544,134	2025/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.875	100	107	13,191	2025/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,000	2,116	259,885	2026/4/15

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	
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	2.75	3,300	4,132	507,462	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,400	2,574	316,178	2029/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.75	800	883	108,482	2031/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	200	233	28,629	2034/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.125	4,000	4,079	500,978	2036/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	400	621	76,258	2042/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	1.375	300	394	48,456	2047/4/15
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	5.4	2,430	3,094	379,982	2025/3/13
		IRISH GOVERNMENT	0.9	4,000	4,349	534,080	2028/5/15
		IRISH TSY 0.8% 2022	0.8	1,200	1,227	150,734	2022/3/15
		IRISH TSY 1% 2026	1.0	4,600	4,964	609,612	2026/5/15
		IRISH TSY 1.10% 2029	1.1	600	665	81,773	2029/5/15
		IRISH TSY 1.3% 2033	1.3	2,400	2,771	340,269	2033/5/15
		IRISH TSY 1.35% 2031	1.35	2,000	2,292	281,553	2031/3/18
		IRISH TSY 1.5% 2050	1.5	1,500	1,870	229,650	2050/5/15
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	700	863	106,067	2037/5/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	3,100	4,220	518,202	2045/2/18
		IRISH TSY 2.4% 2030	2.4	3,700	4,601	565,056	2030/5/15
		IRISH TSY 2022	—	9,000	9,113	1,119,087	2022/10/18
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	6,100	6,974	856,413	2024/3/18
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	4,450	4,982	611,774	2023/3/20
小 計						236,446,009	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	51,600	53,610	1,469,461	2022/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	34,800	37,553	1,029,347	2024/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	22,000	24,523	672,193	2028/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	15,000	16,972	465,202	2029/10/25
小 計						3,636,205	
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	1.25	2,400	2,428	187,811	2021/10/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.75	400	410	31,743	2022/4/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	2,400	2,545	196,926	2022/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.75	300	311	24,068	2023/2/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	3,600	3,859	298,509	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.0	1,450	1,534	118,696	2024/2/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	1,900	2,102	162,602	2024/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	1,100	1,199	92,787	2025/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	700	762	58,969	2026/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	3,900	4,612	356,779	2027/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	500	570	44,108	2028/5/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	300	352	27,272	2029/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	2,400	2,860	221,282	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	1,200	1,550	119,923	2033/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	2,100	2,445	189,174	2036/8/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	2,050	2,667	206,296	2042/4/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	1,000	1,344	103,997	2046/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	1,000	1,175	90,914	2050/3/1
小 計						2,531,864	

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
マレーシア			%	千リンギ	千リンギ	千円	
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT		3.882	1,100	1,134	28,599	2022/3/10
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.059	400	430	10,851	2024/9/30
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.642	2,600	3,027	76,332	2033/11/7
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.828	3,800	4,118	103,820	2034/7/5
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.762	400	473	11,945	2037/4/7
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.16	400	409	10,314	2021/7/15
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.048	6,200	6,363	160,412	2021/9/30
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.62	500	511	12,906	2021/11/30
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.418	4,600	4,738	119,447	2022/8/15
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.795	500	519	13,101	2022/9/30
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.48	13,500	14,017	353,377	2023/3/15
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.757	3,500	3,661	92,307	2023/4/20
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.8	2,200	2,313	58,324	2023/8/17
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.181	5,800	6,265	157,962	2024/7/15
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.955	600	652	16,443	2025/9/15
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.392	9,600	10,671	269,021	2026/4/15
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.892	4,600	5,001	126,096	2027/3/15
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.502	7,000	7,480	188,588	2027/5/31
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.733	2,200	2,373	59,841	2028/6/15
	MALAYSIA GOVERNMENT		5.248	2,700	3,213	81,008	2028/9/15
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.885	280	308	7,769	2029/8/15
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.498	12,700	14,584	367,669	2030/4/15
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.232	4,400	4,963	125,135	2031/6/30
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.127	400	443	11,179	2032/4/15
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.844	800	860	21,692	2033/4/15
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.254	900	1,010	25,474	2035/5/31
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.893	2,800	3,369	84,936	2038/6/8
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.935	9,700	11,576	291,837	2043/9/30
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.736	4,100	4,717	118,936	2046/3/15
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.921	300	358	9,047	2048/7/6
小計						3,014,383	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.0	9,800	10,042	754,371	2021/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		5.75	3,040	3,368	253,057	2022/7/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.25	80	83	6,286	2022/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		5.5	5,400	6,174	463,828	2023/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.75	7,200	7,849	589,622	2024/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		3.25	15,200	17,234	1,294,653	2025/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		4.25	12,780	15,498	1,164,241	2026/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		4.75	12,100	15,434	1,159,430	2027/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.75	3,200	3,680	276,469	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.25	17,800	19,873	1,492,912	2028/5/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.75	2,100	2,437	183,132	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		3.25	10,100	12,198	916,339	2029/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.75	13,300	15,576	1,170,141	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.5	11,500	13,266	996,573	2030/5/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		1.0	2,400	2,419	181,746	2030/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		4.5	7,700	10,912	819,709	2033/4/21



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	2.75	1,800	2,177	163,558	2035/6/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	4,000	5,428	407,800	2037/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	700	893	67,102	2039/6/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,300	1,551	116,576	2041/5/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	5,300	6,617	497,112	2047/3/21
小計					12,974,670	
イスラエル			千新シェケル	千新シェケル		
国債証券	ISRAEL FIXED BOND	5.5	2,600	2,817	88,234	2022/1/31
	ISRAEL FIXED BOND	0.75	5,000	5,067	158,707	2022/7/31
	ISRAEL FIXED BOND	1.25	5,000	5,136	160,873	2022/11/30
	ISRAEL FIXED BOND	4.25	5,000	5,558	174,080	2023/3/31
	ISRAEL FIXED BOND	1.5	5,000	5,221	163,526	2023/11/30
	ISRAEL FIXED BOND	3.75	5,000	5,652	177,043	2024/3/31
	ISRAEL FIXED BOND	1.75	5,000	5,372	168,261	2025/8/31
	ISRAEL FIXED BOND	6.25	5,000	6,834	214,043	2026/10/30
	ISRAEL FIXED BOND	2.0	5,000	5,573	174,549	2027/3/31
	ISRAEL FIXED BOND	2.25	5,000	5,691	178,267	2028/9/28
	ISRAEL FIXED BOND	1.0	2,000	2,070	64,858	2030/3/31
	ISRAEL FIXED BOND	5.5	5,000	8,910	279,089	2042/1/31
	ISRAEL FIXED BOND	3.75	5,000	7,378	231,093	2047/3/31
小計					2,232,629	
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	7.25	84,700	87,682	418,246	2021/12/9
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	44,400	45,926	219,067	2022/6/9
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.75	300	315	1,505	2023/3/9
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	53,300	59,569	284,144	2024/9/5
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	40,000	47,983	228,879	2024/12/5
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	51,300	52,666	251,217	2026/3/5
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	112,300	125,198	597,198	2027/6/3
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	45,300	53,857	256,898	2029/5/31
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	83,500	95,044	453,363	2031/5/29
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	10,000	11,410	54,427	2034/11/23
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	56,300	76,497	364,890	2036/11/20
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	35,800	42,982	205,026	2038/11/18
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	66,500	73,759	351,831	2042/11/13
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	43,000	48,731	232,447	2047/11/7
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	87,100	95,889	457,391	2023/12/7
小計					4,376,537	
合計					583,624,209	

\* 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19期（決算日2020年5月11日）

作成対象期間（2019年5月11日～2020年5月11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	FTSE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	円	騰落率			
15期(2016年5月10日)	21,725	△6.6	220.26	△6.8	99.0	—	632,898
16期(2017年5月10日)	22,009	1.3	223.71	1.6	99.0	—	664,754
17期(2018年5月10日)	22,325	1.4	226.02	1.0	99.0	—	616,573
18期(2019年5月10日)	22,598	1.2	228.62	1.1	99.0	—	605,827
19期(2020年5月11日)	23,625	4.5	238.73	4.4	98.9	—	564,663

\*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（＝FTSE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。  
 \*FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。  
 (出所) FTSE Fixed Income LLC

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

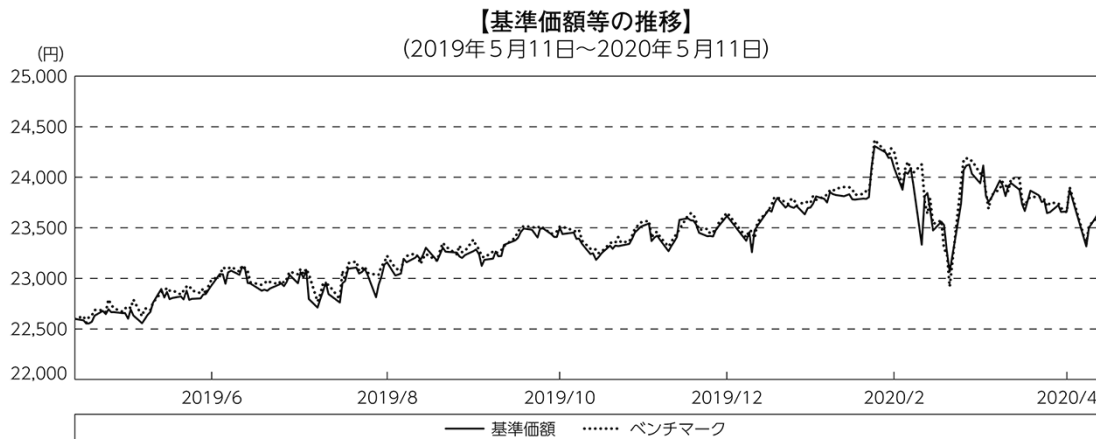
年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) 2019年5月10日	22,598	—	228.62	—	99.0	—
5月末	22,633	0.2	230.56	0.9	98.8	—
6月末	22,930	1.5	232.54	1.7	99.1	—
7月末	23,004	1.8	233.12	2.0	99.0	—
8月末	23,160	2.5	234.94	2.8	99.2	—
9月末	23,270	3.0	236.55	3.5	99.1	—
10月末	23,500	4.0	237.86	4.0	99.0	—
11月末	23,510	4.0	238.28	4.2	99.2	—
12月末	23,618	4.5	239.25	4.7	99.0	—
2020年1月末	23,811	5.4	240.53	5.2	98.9	—
2月末	24,091	6.6	245.31	7.3	98.8	—
3月末	24,116	6.7	243.18	6.4	98.5	—
4月末	23,661	4.7	239.28	4.7	98.8	—
(期末) 2020年5月11日	23,625	4.5	238.73	4.4	98.9	—

\*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、FTSE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。

### ○基準価額の主な変動要因

主要通貨が対円で下落（円高）したことはマイナスに影響しましたが、外国債券利回りが米国を中心に低下（価格は上昇）したことがプラスに寄与したため、基準価額は上昇しました。

### ○投資環境

当運用期間では、新型肺炎の感染拡大に伴う世界景気の減速懸念から、主要国の中央銀行が政策金利の引き下げや金融緩和姿勢の強化を打ち出したことなどを背景に、外国債券利回りは米国を中心に低下（価格は上昇）しました。

為替市場は、新型肺炎の感染拡大による世界景気の減速懸念を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことや内外長期金利差縮小などを背景に、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

FTSE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。債券組入比率は当運用期間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

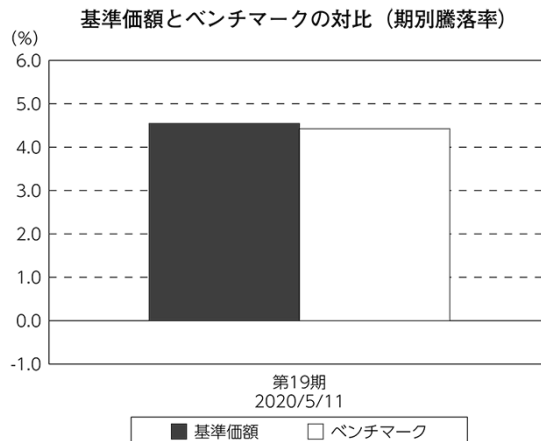
当運用期間の基準価額の騰落率は+4.5%となり、ベンチマークの+4.4%を0.1ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです

### （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、FTSE 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FTSE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

(2019年5月11日～2020年5月11日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(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)	(0.010)	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
( そ の 他 )	(1)	(0.003)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	3	0.014	
期中の平均基準価額は、23,442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

(2019年5月11日～2020年5月11日)

## 公 社 債

			買 付 額	売 付 額
外	アメリカ	国債証券	千米ドル 959,762	千米ドル 1,365,556
	カナダ	国債証券	千カナダドル 63,239	千カナダドル 71,933
	イギリス	国債証券	千英ポンド 82,647	千英ポンド 109,068
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 11,477	千スウェーデンクローナ 46,143
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 16,323	千ノルウェークローネ 6,545
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 30,988	千デンマーククローネ 37,425
国	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	119,181	104,445
	イタリア	国債証券	93,145	79,272
	フランス	国債証券	104,604	121,403
	オランダ	国債証券	25,180	33,002
	スペイン	国債証券	55,298	62,199

		買付額		売付額	
外             国	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ベルギー	国債証券	27,745		40,250
	オーストリア	国債証券	29,649		34,208
	フィンランド	国債証券	8,989		17,756
	アイルランド	国債証券	14,124		12,595
	ポーランド	国債証券	千ズロチ 202,225		千ズロチ 202,670
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 7,842		千シンガポールドル 6,446
	マレーシア	国債証券	千リンギ 10,594		千リンギ 18,952
	オーストラリア	国債証券	千豪ドル 28,634		千豪ドル 29,248
	イスラエル	国債証券	千新シェケル 73,083		千新シェケル -
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 195,362		千メキシコペソ 193,677
	南アフリカ	国債証券	千ランド 66,322		千ランド 465,650

\*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

(2019年5月11日～2020年5月11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		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 85,089	百万円 60	% 0.1	百万円 153,760	百万円 598	% 0.4

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信託銀行です。

(2020年5月11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		期 末		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
	額面金額	評 価 額		5年以上			2年以上	2年未満	
		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	2,126,950	2,437,268	260,665,884	46.2	—	21.2	15.1	9.8	
カナダ	千カナダドル 116,290	千カナダドル 142,546	10,939,051	1.9	—	1.0	0.6	0.4	
イギリス	千英ポンド 194,290	千英ポンド 286,143	38,014,149	6.7	—	5.6	1.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 129,800	千スウェーデンクローナ 147,275	1,608,244	0.3	—	0.2	0.1	—	
ノルウェー	千ノルウェークローネ 121,700	千ノルウェークローネ 133,149	1,390,080	0.2	—	0.1	0.1	0.0	
デンマーク	千デンマーククローネ 140,570	千デンマーククローネ 183,151	2,848,012	0.5	—	0.4	0.1	0.0	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ							
ドイツ	218,070	304,169	35,283,643	6.2	—	4.7	1.4	0.2	
イタリア	386,250	460,218	53,385,370	9.5	—	5.3	2.5	1.6	
フランス	354,370	463,352	53,748,894	9.5	—	7.3	1.8	0.4	
オランダ	54,050	71,738	8,321,625	1.5	—	1.2	0.2	0.0	
スペイン	256,750	323,955	37,578,841	6.7	—	4.3	1.2	1.2	
ベルギー	85,400	112,907	13,097,321	2.3	—	1.9	0.4	0.0	
オーストリア	49,900	63,919	7,414,659	1.3	—	1.2	0.1	0.1	
フィンランド	16,900	19,298	2,238,592	0.4	—	0.4	0.0	0.0	
アイルランド	41,580	46,972	5,448,814	1.0	—	0.5	0.4	0.0	
ポーランド	千ズロチ 121,600	千ズロチ 129,394	3,299,550	0.6	—	0.3	0.0	0.2	
シンガポール	千シンガポールドル 30,330	千シンガポールドル 34,287	2,594,561	0.5	—	0.3	0.1	0.1	
マレーシア	千リンギ 94,780	千リンギ 103,313	2,549,773	0.5	—	0.3	0.1	0.0	
オーストラリア	千豪ドル 138,300	千豪ドル 163,458	11,422,475	2.0	—	1.4	0.4	0.2	
イスラエル	千新シェケル 61,500	千新シェケル 72,402	2,203,927	0.4	—	0.2	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコペソ 870,100	千メキシコペソ 961,590	4,356,003	0.8	—	0.4	0.2	0.1	
合 計	—	—	558,409,476	98.9	—	58.1	26.3	14.5	

\* 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	8.0	36,200	40,525	4,334,214	2021/11/15
	US TREASURY BOND	6.25	38,800	46,438	4,966,624	2023/8/15
	US TREASURY BOND	2.375	45,100	49,070	5,248,133	2024/8/15
	US TREASURY BOND	6.0	72,200	95,270	10,189,142	2026/2/15
	US TREASURY BOND	6.125	10,800	15,267	1,632,875	2027/11/15
	US TREASURY BOND	5.5	46,200	64,542	6,902,856	2028/8/15
	US TREASURY BOND	5.25	49,300	68,376	7,312,897	2028/11/15
	US TREASURY BOND	5.25	27,500	38,424	4,109,532	2029/2/15
	US TREASURY BOND	4.375	100	155	16,639	2038/2/15
	US TREASURY BOND	2.875	17,500	22,847	2,443,494	2043/5/15
	US TREASURY BOND	3.75	2,000	2,978	318,577	2043/11/15
	US TREASURY N/B	3.125	34,400	35,438	3,790,170	2021/5/15
	US TREASURY N/B	2.625	1,000	1,025	109,644	2021/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	6,300	6,423	687,023	2021/5/31
	US TREASURY N/B	2.625	900	924	98,898	2021/6/15
	US TREASURY N/B	2.125	34,000	34,770	3,718,684	2021/6/30
	US TREASURY N/B	1.125	1,600	1,618	173,065	2021/6/30
	US TREASURY N/B	1.625	28,300	28,785	3,078,587	2021/6/30
	US TREASURY N/B	2.625	3,500	3,602	385,335	2021/7/15
	US TREASURY N/B	2.25	11,400	11,694	1,250,758	2021/7/31
	US TREASURY N/B	1.125	4,300	4,352	465,453	2021/7/31
	US TREASURY N/B	2.125	26,100	26,741	2,859,980	2021/8/15
	US TREASURY N/B	2.0	12,200	12,495	1,336,441	2021/8/31
	US TREASURY N/B	2.125	17,900	18,389	1,966,751	2021/9/30
	US TREASURY N/B	1.125	9,650	9,779	1,045,935	2021/9/30
	US TREASURY N/B	2.0	30,400	31,212	3,338,149	2021/10/31
	US TREASURY N/B	1.25	1,900	1,931	206,554	2021/10/31
	US TREASURY N/B	2.0	7,500	7,709	824,496	2021/11/15
	US TREASURY N/B	1.875	1,000	1,026	109,803	2021/11/30
	US TREASURY N/B	1.75	3,700	3,791	405,484	2021/11/30
	US TREASURY N/B	2.125	12,400	12,799	1,368,866	2021/12/31
	US TREASURY N/B	2.0	6,700	6,899	737,949	2021/12/31
	US TREASURY N/B	2.5	80,000	83,134	8,891,220	2022/1/15
	US TREASURY N/B	1.5	6,400	6,546	700,148	2022/1/31
	US TREASURY N/B	1.875	14,000	14,411	1,541,283	2022/1/31
	US TREASURY N/B	1.375	2,300	2,347	251,068	2022/1/31
	US TREASURY N/B	2.0	32,800	33,864	3,621,831	2022/2/15
	US TREASURY N/B	1.75	6,800	6,994	748,055	2022/2/28
	US TREASURY N/B	1.875	3,500	3,608	385,876	2022/2/28
	US TREASURY N/B	1.75	3,900	4,017	429,618	2022/3/31
	US TREASURY N/B	1.875	500	516	55,212	2022/3/31
	US TREASURY N/B	2.25	1,300	1,352	144,601	2022/4/15
	US TREASURY N/B	1.75	32,800	33,830	3,618,131	2022/4/30
	US TREASURY N/B	1.875	25,300	26,149	2,796,734	2022/4/30
	US TREASURY N/B	1.75	8,800	9,080	971,196	2022/5/15
	US TREASURY N/B	1.875	200	207	22,141	2022/5/31
	US TREASURY N/B	1.75	900	929	99,383	2022/5/31

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	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY N/B		2.125	17,600	18,338	1,961,289	2022/6/30
	US TREASURY N/B		1.75	100	103	11,056	2022/6/30
	US TREASURY N/B		2.0	100	104	11,129	2022/7/31
	US TREASURY N/B		1.875	1,000	1,037	111,002	2022/7/31
	US TREASURY N/B		1.625	900	929	99,356	2022/8/15
	US TREASURY N/B		1.875	19,100	19,850	2,123,018	2022/8/31
	US TREASURY N/B		1.75	900	933	99,849	2022/9/30
	US TREASURY N/B		2.0	1,500	1,567	167,606	2022/10/31
	US TREASURY N/B		1.625	7,600	7,874	842,125	2022/11/15
	US TREASURY N/B		2.125	10,200	10,718	1,146,371	2022/12/31
	US TREASURY N/B		1.75	47,900	49,917	5,338,626	2023/1/31
	US TREASURY N/B		2.0	400	419	44,905	2023/2/15
	US TREASURY N/B		1.5	20,000	20,731	2,217,207	2023/2/28
	US TREASURY N/B		2.625	14,300	15,270	1,633,215	2023/2/28
	US TREASURY N/B		1.5	400	415	44,390	2023/3/31
	US TREASURY N/B		1.625	15,000	15,628	1,671,427	2023/4/30
	US TREASURY N/B		1.75	34,800	36,406	3,893,704	2023/5/15
	US TREASURY N/B		1.625	9,200	9,594	1,026,141	2023/5/31
	US TREASURY N/B		1.25	4,800	4,957	530,204	2023/7/31
	US TREASURY N/B		2.75	41,100	44,429	4,751,760	2023/7/31
	US TREASURY N/B		2.5	6,500	6,979	746,444	2023/8/15
	US TREASURY N/B		1.375	10,900	11,307	1,209,288	2023/8/31
	US TREASURY N/B		1.375	35,200	36,542	3,908,166	2023/9/30
	US TREASURY N/B		1.625	11,800	12,361	1,322,054	2023/10/31
	US TREASURY N/B		2.75	42,600	46,334	4,955,437	2023/11/15
	US TREASURY N/B		2.125	9,200	9,811	1,049,356	2023/11/30
	US TREASURY N/B		2.875	30,000	32,793	3,507,291	2023/11/30
	US TREASURY N/B		2.25	43,000	46,114	4,931,906	2023/12/31
	US TREASURY N/B		2.5	1,300	1,408	150,592	2024/1/31
	US TREASURY N/B		2.75	800	874	93,541	2024/2/15
	US TREASURY N/B		2.125	1,700	1,822	194,882	2024/3/31
	US TREASURY N/B		2.5	20,100	21,876	2,339,640	2024/5/15
	US TREASURY N/B		2.0	17,700	18,950	2,026,709	2024/6/30
	US TREASURY N/B		2.125	3,800	4,090	437,525	2024/7/31
	US TREASURY N/B		2.125	42,700	46,095	4,929,965	2024/9/30
	US TREASURY N/B		2.25	3,600	3,909	418,167	2024/10/31
	US TREASURY N/B		2.25	34,200	37,171	3,975,451	2024/11/15
	US TREASURY N/B		2.125	2,300	2,488	266,144	2024/11/30
	US TREASURY N/B		2.0	16,900	18,238	1,950,639	2025/2/15
	US TREASURY N/B		2.75	3,400	3,792	405,561	2025/2/28
	US TREASURY N/B		2.625	32,700	36,330	3,885,515	2025/3/31
	US TREASURY N/B		2.875	30,000	33,742	3,608,810	2025/4/30
	US TREASURY N/B		2.125	6,500	7,074	756,600	2025/5/15
	US TREASURY N/B		2.75	4,100	4,599	491,902	2025/6/30
	US TREASURY N/B		2.0	27,000	29,286	3,132,197	2025/8/15
	US TREASURY N/B		3.0	19,200	21,878	2,339,958	2025/9/30
	US TREASURY N/B		2.25	50,300	55,349	5,919,644	2025/11/15
	US TREASURY N/B		1.625	2,000	2,136	228,488	2026/2/15

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	2.375	8,600	9,577	1,024,321	2026/4/30	
	US TREASURY N/B	1.625	1,800	1,925	205,955	2026/5/15	
	US TREASURY N/B	1.5	21,100	22,435	2,399,448	2026/8/15	
	US TREASURY N/B	1.375	12,000	12,666	1,354,688	2026/8/31	
	US TREASURY N/B	1.625	5,600	6,003	642,060	2026/10/31	
	US TREASURY N/B	2.0	13,000	14,252	1,524,279	2026/11/15	
	US TREASURY N/B	1.625	30,000	32,177	3,441,366	2026/11/30	
	US TREASURY N/B	2.25	11,300	12,605	1,348,177	2027/2/15	
	US TREASURY N/B	2.375	38,000	42,856	4,583,542	2027/5/15	
	US TREASURY N/B	2.25	8,400	9,429	1,008,431	2027/8/15	
	US TREASURY N/B	2.75	500	582	62,344	2028/2/15	
	US TREASURY N/B	2.875	1,800	2,122	227,041	2028/5/15	
	US TREASURY N/B	3.125	1,200	1,449	155,040	2028/11/15	
	US TREASURY N/B	1.5	2,000	2,154	230,427	2030/2/15	
	US TREASURY N/B	6.25	3,900	6,019	643,775	2030/5/15	
	US TREASURY N/B	5.375	36,700	54,654	5,845,280	2031/2/15	
	US TREASURY N/B	4.5	2,200	3,372	360,637	2036/2/15	
	US TREASURY N/B	5.0	200	328	35,122	2037/5/15	
	US TREASURY N/B	4.5	100	157	16,889	2038/5/15	
	US TREASURY N/B	3.5	100	142	15,192	2039/2/15	
	US TREASURY N/B	4.25	100	155	16,578	2039/5/15	
	US TREASURY N/B	4.5	100	159	17,095	2039/8/15	
	US TREASURY N/B	4.375	100	157	16,861	2039/11/15	
	US TREASURY N/B	4.625	100	162	17,378	2040/2/15	
	US TREASURY N/B	4.375	100	158	16,929	2040/5/15	
	US TREASURY N/B	3.875	200	298	31,884	2040/8/15	
	US TREASURY N/B	4.25	100	156	16,713	2040/11/15	
	US TREASURY N/B	4.75	100	165	17,728	2041/2/15	
	US TREASURY N/B	4.375	100	159	17,009	2041/5/15	
	US TREASURY N/B	3.75	100	147	15,750	2041/8/15	
	US TREASURY N/B	3.125	300	405	43,397	2041/11/15	
	US TREASURY N/B	3.125	100	135	14,513	2042/2/15	
	US TREASURY N/B	3.0	100	133	14,233	2042/5/15	
	US TREASURY N/B	2.75	200	255	27,364	2042/8/15	
	US TREASURY N/B	2.75	800	1,023	109,470	2042/11/15	
	US TREASURY N/B	3.125	2,600	3,524	376,893	2043/2/15	
	US TREASURY N/B	3.625	100	146	15,620	2043/8/15	
	US TREASURY N/B	3.625	7,400	10,846	1,160,063	2044/2/15	
	US TREASURY N/B	3.375	15,200	21,524	2,301,994	2044/5/15	
	US TREASURY N/B	3.125	23,000	31,395	3,357,695	2044/8/15	
	US TREASURY N/B	3.0	36,900	49,474	5,291,332	2044/11/15	
	US TREASURY N/B	2.5	39,400	48,671	5,205,396	2045/2/15	
	US TREASURY N/B	3.0	21,900	29,455	3,150,265	2045/5/15	
	US TREASURY N/B	2.875	17,500	23,114	2,472,080	2045/8/15	
	US TREASURY N/B	3.0	3,700	5,000	534,756	2045/11/15	
	US TREASURY N/B	2.5	51,500	63,962	6,840,799	2046/2/15	
	US TREASURY N/B	2.5	28,200	35,056	3,749,252	2046/5/15	
	US TREASURY N/B	2.25	31,500	37,462	4,006,651	2046/8/15	

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	2.875	14,200	18,935	2,025,196	2046/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	1,700	2,323	248,482	2047/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	11,400	14,929	1,596,714	2047/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	9,300	12,197	1,304,525	2047/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	9,500	13,033	1,393,978	2048/2/15
		US TREASURY N/B	3.125	6,100	8,570	916,614	2048/5/15
		US TREASURY N/B	3.0	10,500	14,465	1,547,117	2048/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	3,400	4,705	503,286	2049/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	100	135	14,509	2049/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	3,000	3,621	387,326	2049/8/15
		US TREASURY N/B	2.375	1,000	1,239	132,584	2049/11/15
小	計					260,665,884	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル			
	国債証券	CANADA GOVERNMENT	2.75	5,500	5,784	443,899	2022/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.25	11,750	12,129	930,819	2021/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	12,200	12,389	950,739	2021/8/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	1,000	1,006	77,253	2021/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.5	300	301	23,133	2022/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	6,700	6,816	523,109	2022/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.75	300	312	24,007	2023/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	4,460	4,632	355,495	2023/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	1,100	1,163	89,260	2023/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	500	537	41,212	2024/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	6,800	7,401	568,019	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	17,000	17,725	1,360,285	2025/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	3,700	4,050	310,863	2025/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	300	320	24,564	2026/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	8.0	7,250	11,063	849,029	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	200	207	15,929	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	100	112	8,595	2028/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	10,080	14,776	1,133,962	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	4,200	6,806	522,332	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	3,800	6,234	478,409	2037/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	7,100	10,979	842,534	2041/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5	9,950	15,097	1,158,584	2045/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,300	1,804	138,463	2048/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	600	737	56,591	2051/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	100	155	11,953	2064/12/1
小	計					10,939,051	
イギリス			千英ポンド	千英ポンド			
	国債証券	UK TREASURY	8.0	40	43	5,766	2021/6/7
		UK TREASURY	3.75	470	493	65,506	2021/9/7
		UK TREASURY	4.0	350	375	49,900	2022/3/7
		UK TREASURY	0.5	300	303	40,298	2022/7/22
		UK TREASURY	1.75	400	416	55,307	2022/9/7
		UK TREASURY	0.125	6,000	6,008	798,215	2023/1/31
		UK TREASURY	0.75	14,000	14,327	1,903,359	2023/7/22
		UK TREASURY	2.25	4,800	5,157	685,128	2023/9/7

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		
イギリス		%	千英ポンド	千英ポンド	千円		
	国債証券	UK TREASURY	1.0	1,600	1,660	220,650	2024/4/22
		UK TREASURY	2.75	7,450	8,321	1,105,550	2024/9/7
		UK TREASURY	5.0	9,950	12,313	1,635,891	2025/3/7
		UK TREASURY	0.625	200	205	27,309	2025/6/7
		UK TREASURY	2.0	200	221	29,402	2025/9/7
		UK TREASURY	1.5	160	174	23,164	2026/7/22
		UK TREASURY	1.25	400	433	57,545	2027/7/22
		UK TREASURY	4.25	9,630	12,609	1,675,108	2027/12/7
		UK TREASURY	1.625	200	225	29,909	2028/10/22
		UK TREASURY	6.0	6,900	10,336	1,373,255	2028/12/7
		UK TREASURY	4.75	6,000	8,830	1,173,083	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	5,550	8,109	1,077,379	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	15,700	24,629	3,271,967	2034/9/7
		UK TREASURY	4.25	2,600	4,105	545,436	2036/3/7
		UK TREASURY	4.75	100	175	23,336	2038/12/7
		UK TREASURY	4.25	600	1,012	134,470	2039/9/7
		UK TREASURY	4.25	500	861	114,504	2040/12/7
		UK TREASURY	1.25	400	455	60,448	2041/10/22
		UK TREASURY	4.5	1,200	2,205	293,053	2042/12/7
		UK TREASURY	3.5	18,440	30,879	4,102,382	2045/1/22
		UK TREASURY	4.25	6,300	12,030	1,598,188	2046/12/7
		UK TREASURY	1.5	9,100	11,285	1,499,321	2047/7/22
		UK TREASURY	1.75	16,100	21,221	2,819,225	2049/1/22
		UK TREASURY	4.25	5,350	10,756	1,429,048	2049/12/7
		UK TREASURY	3.75	6,750	13,267	1,762,614	2052/7/22
		UK TREASURY	1.625	1,000	1,357	180,350	2054/10/22
		UK TREASURY	1.75	1,100	1,585	210,589	2057/7/22
		UK TREASURY	2.5	100	185	24,617	2065/7/22
		UK TREASURY	3.5	650	1,529	203,176	2068/7/22
		UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	26,900	42,852	5,692,912	2044/1/22
		UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	4.25	6,800	15,180	2,016,768	2055/12/7
小	計					38,014,149	
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	3.5	36,050	38,914	424,942	2022/6/1
		SWEDISH GOVERNMENT	1.5	7,900	8,416	91,908	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT	2.5	32,250	36,826	402,142	2025/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	1.0	12,000	12,988	141,833	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT	0.75	16,800	18,063	197,252	2028/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	0.75	14,300	15,446	168,671	2029/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	10,500	16,620	181,491	2039/3/30
小	計					1,608,244	
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	3.75	23,600	24,511	255,901	2021/5/25
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	13,300	14,141	147,633	2023/5/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	38,900	43,412	453,225	2024/3/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	4,700	5,087	53,108	2025/3/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	4,700	5,076	53,003	2026/2/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	9,600	10,592	110,587	2027/2/17

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	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	7,200	8,159	85,187	2028/4/26
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	17,000	19,210	200,552	2029/9/6
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.375	2,700	2,957	30,881	2030/8/19
		小 計				1,390,080	
デンマーク	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	3.0	14,400	15,185	236,139	2021/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.25	400	408	6,350	2022/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.5	18,570	19,951	310,239	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	32,000	35,972	559,377	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	15,700	16,819	261,540	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	21,400	23,019	357,960	2029/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	38,100	71,794	1,116,403	2039/11/15
		小 計				2,848,012	
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	BUNDESobligation	—	100	101	11,716	2021/10/8
		BUNDESobligation	—	700	710	82,430	2022/4/8
		BUNDESobligation	—	750	764	88,653	2022/10/7
		BUNDESobligation	—	1,000	1,023	118,763	2023/4/14
		BUNDESobligation	—	2,000	2,069	240,115	2024/10/18
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	350	365	42,427	2021/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	400	415	48,198	2021/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	4,000	4,220	489,580	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	700	737	85,535	2022/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	390	415	48,176	2023/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	9,200	9,847	1,142,298	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	2,580	2,819	327,068	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	23,900	30,127	3,494,748	2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	1,700	1,866	216,507	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	800	874	101,498	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	8,100	8,730	1,012,691	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	2,700	2,867	332,668	2025/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	9,100	9,962	1,155,681	2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	20,800	22,325	2,589,778	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	1,046	121,360	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	700	746	86,564	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	21,500	32,774	3,801,828	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,000	1,087	126,190	2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	8,200	12,223	1,417,896	2028/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,400	1,528	177,337	2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	7,300	10,557	1,224,684	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	19,500	32,656	3,788,126	2030/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	6,200	10,283	1,192,843	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	8,600	15,068	1,747,911	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	8,400	14,618	1,695,717	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	4,500	8,494	985,400	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	5,400	10,990	1,274,884	2040/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	1,900	3,384	392,582	2042/7/4		
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	5,800	9,612	1,115,028	2044/7/4		

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		
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	10,200	17,365	2,014,409	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	10,900	15,100	1,751,623	2048/8/15
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	2,300	2,327	269,985	2021/12/10
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	4,000	4,057	470,726	2022/3/11
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	12,200	12,608	1,462,609	2021/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.45	5,100	5,106	592,369	2021/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	8,000	8,330	966,363	2021/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	16,500	17,424	2,021,298	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.3	5,900	6,050	701,852	2021/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	1,050	1,047	121,514	2021/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.15	2,600	2,665	309,200	2021/12/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	18,900	20,398	2,366,257	2022/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2	6,200	6,268	727,096	2022/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	400	405	47,047	2022/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9	400	401	46,627	2022/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	8,200	9,099	1,055,546	2022/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	3,100	3,155	366,058	2022/9/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	31,100	34,716	4,027,163	2022/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.05	1,900	1,866	216,465	2023/1/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	100	100	11,659	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,100	1,219	141,404	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	500	560	65,070	2023/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	18,700	23,878	2,769,851	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	14,700	16,600	1,925,682	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.85	300	309	35,854	2024/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	5,800	6,422	744,991	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	4,700	4,761	552,287	2024/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,000	1,056	122,554	2024/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	16,800	19,745	2,290,522	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	800	805	93,440	2025/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	3,000	3,032	351,821	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	7,000	7,420	860,720	2025/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	3,000	3,106	360,319	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	11,500	13,483	1,564,115	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1	2,000	2,065	239,540	2026/7/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7.25	18,100	24,538	2,846,427	2026/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	17,500	23,451	2,720,403	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	5,800	7,169	831,715	2028/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	29,200	37,945	4,401,666	2029/11/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	16,000	22,398	2,598,214	2031/5/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	500	485	56,260	2032/3/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	10,900	15,345	1,780,022	2033/2/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,400	1,463	169,805	2033/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	15,400	20,713	2,402,708	2034/8/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.35	8,000	9,182	1,065,158	2035/3/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	700	863	100,160	2037/2/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	500	541	62,854	2038/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	5,000	6,994	811,362	2039/8/1		

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	3.1	200	220	25,598	2040/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	11,700	16,367	1,898,587	2040/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	8,800	12,191	1,414,216	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	3,500	3,928	455,694	2046/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.45	2,800	3,244	376,345	2048/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.85	7,000	8,644	1,002,738	2049/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	9,000	8,692	1,008,295	2050/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	1,700	1,722	199,831	2067/3/1
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	800	804	93,273	2021/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	6,000	6,063	703,339	2022/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,600	2,642	306,576	2023/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	1,570	1,682	195,222	2023/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	100	102	11,837	2024/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	9,600	10,691	1,240,160	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,800	1,839	213,382	2025/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	11,000	11,534	1,338,039	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,800	1,892	219,573	2026/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	13,300	13,774	1,597,826	2026/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	1,700	1,849	214,572	2027/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	2,000	2,148	249,245	2028/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	11,600	12,478	1,447,504	2028/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	9,500	11,911	1,381,701	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	10,500	11,953	1,386,576	2034/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	100	114	13,262	2036/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	100	124	14,389	2039/6/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	10,600	14,170	1,643,794	2048/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	500	501	58,149	2052/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	4,100	4,327	501,978	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.0	8,500	9,098	1,055,457	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	—	5,100	5,163	598,917	2022/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.25	17,600	18,842	2,185,680	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	8.5	10,900	13,836	1,604,992	2023/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.25	27,000	31,553	3,660,211	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.75	3,000	3,309	383,851	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	6.0	19,800	26,796	3,108,411	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.0	6,000	6,466	750,114	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.5	34,100	41,954	4,866,772	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.75	4,500	5,510	639,241	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5.5	27,000	40,646	4,714,969	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.5	13,500	15,676	1,818,511	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5.75	20,100	34,124	3,958,408	2032/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.75	10,300	17,089	1,982,364	2035/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	300	491	56,996	2038/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.5	8,100	14,557	1,688,727	2041/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	29,700	47,936	5,560,690	2045/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	4,900	9,803	1,137,262	2055/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	4,700	9,887	1,146,907	2060/4/25
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	50	52	6,061	2021/7/15



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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	—	1,500	1,517	176,000	2022/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.25	100	106	12,355	2022/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	200	224	25,999	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	200	244	28,373	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	400	431	50,033	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	100	102	11,886	2024/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	8,700	9,677	1,122,610	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	1,500	1,567	181,795	2025/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	4,000	4,260	494,252	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	2,500	2,721	315,674	2027/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	12,300	17,966	2,084,118	2028/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,000	1,096	127,182	2028/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	3,400	3,583	415,697	2029/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	7,500	10,093	1,170,865	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	2,200	3,708	430,184	2037/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	500	551	63,942	2040/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	2,400	4,365	506,395	2042/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	5,500	9,467	1,098,195	2047/1/15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5	19,400	20,465	2,374,000	2021/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	5,100	5,161	598,752	2021/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.05	10,700	10,741	1,246,019	2021/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	14,550	16,065	1,863,577	2022/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4	4,350	4,400	510,503	2022/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.45	3,000	3,042	352,872	2022/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	15,100	17,369	2,014,804	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.35	4,200	4,251	493,121	2023/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	5,300	6,114	709,275	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	14,600	17,194	1,994,559	2024/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	6,900	7,910	917,578	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	450	502	58,303	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	900	959	111,284	2025/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	15,100	18,551	2,152,029	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.15	5,000	5,509	639,078	2025/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	4,000	4,378	507,915	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	22,400	29,962	3,475,671	2026/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	3,100	3,293	382,039	2027/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	2,000	2,123	246,372	2028/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	5,000	5,293	614,046	2028/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	9,300	12,704	1,473,748	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	2,000	2,224	258,014	2030/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	6,400	7,450	864,227	2033/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	1,500	2,444	283,580	2040/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	5,700	9,185	1,065,533	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	9,100	15,929	1,847,859	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	3,200	4,150	481,400	2046/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	8,800	11,092	1,286,691	2048/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	1,700	2,613	303,189	2066/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	16,000	23,177	2,688,615	2029/1/31

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	5.75	31,400	48,962	5,679,594	2032/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	500	729	84,580	2037/1/31
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.25	700	746	86,575	2021/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	800	869	100,890	2022/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	600	669	77,645	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	9,700	10,555	1,224,395	2023/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.2	2,900	2,970	344,574	2023/10/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	4,000	4,506	522,742	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.5	1,000	1,041	120,792	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	3,000	3,179	368,875	2025/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.5	6,000	7,708	894,211	2026/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.0	3,300	3,557	412,715	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	2,000	2,140	248,345	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	1,000	1,074	124,685	2028/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.9	3,000	3,256	377,744	2029/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,500	1,649	191,389	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	3,500	5,083	589,721	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.25	100	113	13,145	2033/4/22
		BELGIUM KINGDOM	1.45	500	581	67,412	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	100	124	14,407	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	3,400	5,829	676,242	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	4,400	7,552	876,048	2045/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.6	5,200	6,347	736,339	2047/6/22		
BELGIUM KINGDOM	1.7	4,000	5,013	581,615	2050/6/22		
BELGIUM KINGDOM	2.25	1,200	1,750	203,070	2057/6/22		
BELGIUM KINGDOM	2.15	1,000	1,491	173,008	2066/6/22		
BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	11,500	16,653	1,931,810	2028/3/28		
BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	11,000	18,438	2,138,914	2035/3/28		
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5	700	739	85,748	2021/9/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	3,200	3,469	402,455	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	100	101	11,781	2022/9/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	200	220	25,601	2022/11/22
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	900	916	106,341	2023/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	150	162	18,827	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	1,300	1,328	154,087	2024/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	700	768	89,136	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	1,300	1,417	164,393	2025/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	5,400	7,076	820,834	2026/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	2,144	248,784	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	7,600	11,179	1,296,842	2027/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	7,600	8,041	932,820	2029/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	4,800	6,345	736,085	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	400	667	77,425	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	3,200	5,385	624,718	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	7,100	9,215	1,068,950	2047/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	2,195	254,627	2051/3/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	450	1,019	118,245	2062/1/26
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1	800	1,525	176,951	2117/9/20

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	—	500	506	58,717	2022/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.625	100	105	12,222	2022/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	100	106	12,328	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	—	400	408	47,335	2023/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.0	700	771	89,441	2024/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	4.0	3,600	4,441	515,172	2025/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.875	100	107	12,428	2025/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,000	2,109	244,654	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	3,300	4,107	476,514	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,400	2,543	295,010	2029/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.75	800	873	101,284	2031/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	200	229	26,585	2034/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.125	2,000	1,996	231,610	2036/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	400	608	70,619	2042/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	1.375	300	385	44,667	2047/4/15
		アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	5.4	2,430	3,094
IRISH GOVERNMENT	0.9			4,000	4,275	495,938	2028/5/15
IRISH TSY 0.8% 2022	0.8			1,200	1,227	142,432	2022/3/15
IRISH TSY 1% 2026	1.0			4,600	4,911	569,701	2026/5/15
IRISH TSY 1.10% 2029	1.1			600	652	75,725	2029/5/15
IRISH TSY 1.3% 2033	1.3			2,400	2,679	310,765	2033/5/15
IRISH TSY 1.35% 2031	1.35			2,000	2,234	259,179	2031/3/18
IRISH TSY 1.5% 2050	1.5			1,500	1,744	202,322	2050/5/15
IRISH TSY 1.7% 2037	1.7			700	827	95,947	2037/5/15
IRISH TSY 2% 2045	2.0			3,100	3,989	462,749	2045/2/18
IRISH TSY 2.4% 2030	2.4			3,700	4,511	523,355	2030/5/15
IRISH TSY 2022	—			4,800	4,848	562,443	2022/10/18
IRISH TSY 3.4% 2024	3.4			6,100	6,978	809,521	2024/3/18
REPUBLIC OF IRELAND	3.9	4,450	4,998	579,771	2023/3/20		
小 計						216,517,762	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	46,300	47,004	1,198,613	2021/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	4,800	5,118	130,530	2024/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	28,500	31,673	807,666	2025/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	25,000	26,833	684,263	2026/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,000	2,150	54,834	2027/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	15,000	16,613	423,641	2029/10/25
小 計						3,299,550	
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	2.25	480	489	37,055	2021/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.25	2,400	2,429	183,859	2021/10/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.75	2,300	2,358	178,461	2022/4/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	2,400	2,548	192,867	2022/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.75	300	310	23,500	2023/2/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	3,600	3,853	291,617	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.0	700	738	55,898	2024/2/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	1,900	2,098	158,826	2024/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	1,100	1,197	90,603	2025/6/1

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		
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	2.125	700	761	57,630	2026/6/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	3,900	4,617	349,413	2027/3/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	500	571	43,226	2028/5/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	300	352	26,658	2029/7/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	2,400	2,851	215,750	2030/9/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	1,200	1,541	116,634	2033/9/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	2,100	2,429	183,855	2036/8/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	2,050	2,646	200,264	2042/4/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	1,000	1,327	100,414	2046/3/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	1,000	1,163	88,024	2050/3/1
小計					2,594,561	
マレーシア			千リンギ	千リンギ		
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	3.882	1,100	1,132	27,950	2022/3/10
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.059	400	426	10,523	2024/9/30
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.642	2,600	3,017	74,466	2033/11/7
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.762	400	471	11,630	2037/4/7
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.16	400	409	10,103	2021/7/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.048	6,200	6,358	156,931	2021/9/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.62	500	510	12,607	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.418	4,600	4,718	116,454	2022/8/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.795	500	517	12,776	2022/9/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	13,500	13,943	344,117	2023/3/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.757	3,500	3,641	89,883	2023/4/20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.8	2,200	2,298	56,736	2023/8/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	5,800	6,195	152,912	2024/7/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.955	600	643	15,890	2025/9/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	9,600	10,527	259,820	2026/4/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.892	4,600	4,952	122,218	2027/3/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.502	7,000	7,372	181,941	2027/5/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	2,200	2,344	57,858	2028/6/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5.248	2,700	3,176	78,407	2028/9/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.885	280	304	7,518	2029/8/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	5,700	6,443	159,030	2030/4/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.232	4,400	4,909	121,170	2031/6/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.127	400	442	10,917	2032/4/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	800	859	21,217	2033/4/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.254	900	996	24,597	2035/5/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.893	2,800	3,359	82,917	2038/6/8
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.935	9,700	11,672	288,069	2043/9/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.736	1,100	1,298	32,051	2046/3/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.921	300	366	9,050	2048/7/6
小計					2,549,773	
オーストラリア			千豪ドル	千豪ドル		
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	5,700	6,016	420,445	2021/5/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0	7,500	7,713	539,025	2021/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	3,040	3,403	237,863	2022/7/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	80	84	5,871	2022/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	5,400	6,234	435,664	2023/4/21

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		
オーストラリア		%	千豪ドル	千豪ドル	千円		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	7,200	7,887	551,210	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	15,200	17,334	1,211,323	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	12,780	15,591	1,089,510	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	12,100	15,509	1,083,828	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	3,200	3,686	257,617	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	17,800	19,847	1,386,908	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	2,100	2,440	170,530	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	10,100	12,214	853,526	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	13,300	15,547	1,086,473	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5	2,000	2,307	161,257	2030/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	7,700	10,912	762,581	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,800	2,169	151,619	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	4,000	5,411	378,163	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	700	890	62,255	2039/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,300	1,561	109,139	2041/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	5,300	6,692	467,658	2047/3/21
小	計					11,422,475	
イスラエル			千新シェケル	千新シェケル			
	国債証券	ISRAEL FIXED BOND	5.5	4,500	4,919	149,764	2022/1/31
		ISRAEL FIXED BOND	0.75	5,000	5,063	154,147	2022/7/31
		ISRAEL FIXED BOND	1.25	5,000	5,133	156,268	2022/11/30
		ISRAEL FIXED BOND	4.25	5,000	5,575	169,722	2023/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	1.5	5,000	5,210	158,593	2023/11/30
		ISRAEL FIXED BOND	3.75	5,000	5,655	172,166	2024/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	1.75	5,000	5,325	162,096	2025/8/31
		ISRAEL FIXED BOND	6.25	5,000	6,786	206,581	2026/10/30
		ISRAEL FIXED BOND	2.0	5,000	5,450	165,913	2027/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	2.25	5,000	5,594	170,308	2028/9/28
		ISRAEL FIXED BOND	1.0	2,000	2,024	61,624	2030/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	5.5	5,000	8,590	261,484	2042/1/31
		ISRAEL FIXED BOND	3.75	5,000	7,071	215,254	2047/3/31
小	計					2,203,927	
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	6.5	95,300	96,711	438,100	2021/6/10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.25	84,700	87,557	396,636	2021/12/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	44,400	45,707	207,055	2022/6/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.75	300	314	1,424	2023/3/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	53,300	59,344	268,831	2024/9/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	40,000	47,979	217,345	2024/12/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	51,300	52,417	237,450	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	112,300	124,897	565,787	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	45,300	53,420	241,994	2029/5/31
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	68,500	77,140	349,446	2031/5/29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	10,000	11,306	51,216	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	56,300	75,177	340,556	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	11,800	13,819	62,602	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	66,500	72,305	327,543	2042/11/13
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	43,000	48,040	217,625	2047/11/7

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	
メキシコ	%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
国債証券 MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	87,100	95,449	432,385	2023/12/7
小 計				4,356,003	
合 計				558,409,476	

\*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。

## ○有価証券の貸付及び借入の状況

(2020年5月11日現在)

区 分	当 期 末
	数 量
貸付有価証券<債券>券面総額	米ドル 1,154,028,000
貸付有価証券<債券>券面総額	ユーロ 16,600,000
貸付有価証券<債券>券面総額	豪ドル 27,100,000

## ○投資信託財産の構成

(2020年5月11日現在)

項 目	当 期 末
	評 価 額 比 率
公社債	千円 558,409,476 76.7%
コール・ローン等、その他	169,403,992 23.3%
投資信託財産総額	727,813,468 100.0%

\*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（564,686,472千円）の投資信託財産総額（727,813,468千円）に対する比率は77.6%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=106.95円、1カナダドル=76.74円、1英ポンド=132.85円、1スウェーデンクローナ=10.92円、1ノルウェークローネ=10.44円、1デンマーククローネ=15.55円、1ユーロ=116.00円、1ズロチ=25.50円、1シンガポールドル=75.67円、1リンギ=24.68円、1豪ドル=69.88円、1新シェケル=30.44円、1メキシコペソ=4.53円、1ランド=5.83円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月11日現在)

項目	当期末	円
(A) 資産	729,549,346,520	
コール・ローン等	7,952,791,636	
公社債(評価額)	558,409,476,994	
未収入金	2,587,032,330	
未収利息	4,594,710,138	
前払費用	459,504,024	
その他未収収益	15,452,860	
受入担保代用有価証券	155,530,378,538	
(B) 負債	164,886,261,127	
未払金	1,744,348,986	
未払解約金	7,600,292,063	
未払利息	5,485	
受入担保金	155,530,378,538	
その他未払費用	11,236,055	
(C) 純資産総額(A-B)	564,663,085,393	
元本	239,006,740,496	
次期繰越損益金	325,656,344,897	
(D) 受益権総口数	239,006,740,496口	
1万口当たり基準価額(C/D)	23,625円	

(注) 期首元本額は268,084,419,000円、期中追加設定元本額は33,092,232,394円、期中一部解約元本額は62,169,910,898円、1口当たり純資産額は2.3625円です。

(注) 2020年5月11日現在、有価証券の貸付などに係る受入担保代用有価証券として担保に受け入れている資産は以下の通りです。  
・有価証券 155,530,378,537円

## ○損益の状況 (2019年5月11日～2020年5月11日)

項目	当期	円
(A) 配当等収益	16,507,705,850	
受取利息	16,444,664,276	
その他収益金	64,333,611	
支払利息	△ 1,292,037	
(B) 有価証券売買損益	10,989,677,354	
売買益	42,322,261,855	
売買損	△ 31,332,584,501	
(C) 保管費用等	△ 82,371,970	
(D) 当期損益金(A+B+C)	27,415,011,234	
(E) 前期繰越損益金	337,743,397,144	
(F) 追加信託差損益金	44,217,348,963	
(G) 解約差損益金	△ 83,719,412,444	
(H) 計(D+E+F+G)	325,656,344,897	
次期繰越損益金(H)	325,656,344,897	

\* 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 Bコース(野村投資一任口座向け)	102,686,407,275	
野村世界6資産分散投信(分配コース)	23,127,565,619	
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	16,118,719,507	
のむらっぴ・ファンド(普通型)	11,330,020,953	
マイ・ロード	8,732,790,392	
野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	7,313,848,903	
野村外国債券インデックス Bコース(野村SMA・EW向け)	6,268,102,023	
野村DC外国債券インデックスファンド	6,012,148,045	
のむらっぴ・ファンド(保守型)	5,649,317,080	
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,530,137,578	
マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,969,011,331	
マイバランス70(確定拠出年金向け)	3,871,221,089	
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,527,503,854	
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,337,502,044	
野村DC運用戦略ファンド	2,944,954,434	
NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジなし) 連動型上場投信	2,423,390,560	
のむらっぴ・ファンド(積極型)	2,267,517,840	

ファンド名	当期末元本額	円
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)	1,988,901,353	
マイバランスDC30	1,727,999,247	
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)	1,655,570,027	
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	1,602,137,819	
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)	1,521,677,602	
野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,404,525,492	
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)	1,364,895,324	
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)	1,215,579,071	
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,189,269,436	
マイバランスDC50	1,104,260,061	
野村インデックスファンド・外国債券	822,665,833	
野村6資産均等バランス	780,497,633	
野村外国債券インデックス(野村SMA向け)	753,468,107	
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)	695,976,449	
マイバランスDC70	677,624,248	
野村外国債券バッシブファンド(確定拠出年金向け)	575,181,053	
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	474,917,230	

ファンド名	当期末
	元本額
	円
のむらっぴ・ファンド (やや積極型)	327,819,456
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)	325,036,964
野村外国債券インデックスファンド	302,722,100
野村DC運用戦略ファンド (マイルド)	301,710,390
ネクストコア	199,230,377
マイターゲット2030 (確定拠出年金向け)	194,349,584
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)	177,170,939
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)	165,087,446
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	139,895,334
マイターゲット2050 (確定拠出年金向け)	134,621,908
野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用)	102,337,977
マイターゲット2040 (確定拠出年金向け)	92,201,365
バランスセレクト50	81,769,911
バランスセレクト30	81,630,740
世界6資産分散ファンド	78,161,936
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)	77,383,072
バランスセレクト70	67,707,889
野村資産設計ファンド2040	54,106,972
マイターゲット2035 (確定拠出年金向け)	50,849,809
野村資産設計ファンド2025	44,722,632
野村資産設計ファンド2030	42,849,078
マイターゲット2045 (確定拠出年金向け)	32,048,381
野村資産設計ファンド2035	29,290,609
野村資産設計ファンド2020	29,279,193
野村資産設計ファンド2015	26,005,469
野村世界6資産分散投信 (DC) インカムコース	22,257,309
野村世界インデックス・バランス40VA (適格機関投資家専用)	16,010,887
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)	15,998,722

ファンド名	当期末
	元本額
	円
マイターゲット2060 (確定拠出年金向け)	15,478,601
マイターゲット2055 (確定拠出年金向け)	13,197,003
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)	9,135,215
野村世界6資産分散投信 (DC) 安定コース	8,810,074
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)	8,546,080
野村資産設計ファンド2050	8,422,485
野村世界6資産分散投信 (DC) 成長コース	7,877,418
野村資産設計ファンド2045	6,720,865
バランスセレクト50 (確定拠出年金向け)	6,048,480
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	5,628,330
バランスセレクト70 (確定拠出年金向け)	5,256,339
インデックス・ブレンド (タイプIII)	5,095,015
野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2030	3,445,395
バランスセレクト30 (確定拠出年金向け)	3,357,237
インデックス・ブレンド (タイプV)	3,145,615
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)	2,729,205
野村資産設計ファンド2060	2,366,982
野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2040	2,161,268
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	2,048,108
インデックス・ブレンド (タイプI)	2,026,660
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	1,471,130
インデックス・ブレンド (タイプIV)	1,352,642
野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2050	1,317,745
インデックス・ブレンド (タイプII)	1,276,241
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	1,028,642
野村PFRs用・ターゲット・リターン・8資産バランス (2%コース向け) (適格機関投資家専用)	525,844
野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2060	455,561
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)	255,355

## ○お知らせ

有価証券の貸付に係る事務処理費用を信託財産中から支弁することを明確化するための所要の約款変更を行いました。  
 <変更適用日：2019年7月31日>