

# 野村外国債券インデックス Aコース (野村SMA・EW向け)

## 運用報告書(全体版)

第4期(決算日2019年12月6日)

作成対象期間(2018年12月7日～2019年12月6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	2016年8月25日以降、無期限とします。	
運用方針	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド(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、主とし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、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。為替ヘッジはマザーファンドにおいて行うため、当ファンドにおいては原則として行いません。	
主な投資対象	野村外国債券インデックス Aコース (野村SMA・EW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 Aコース (野村SMA・EW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	株式への投資は行いません。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、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

## 野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



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

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○設定以来の運用実績

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、円ヘッジ・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 分 配	み 金 騰 落	中 率	期 騰 落			
(設定日)	円	円	%		%	%	%	百万円
2016年8月25日	10,000	—	—	100.00	—	—	—	1
1期(2016年12月6日)	9,518	0	△4.8	95.36	△4.6	98.0	—	123
2期(2017年12月6日)	9,636	0	1.2	96.89	1.6	97.1	24.9	835
3期(2018年12月6日)	9,452	0	△1.9	95.32	△1.6	98.3	—	2,783
4期(2019年12月6日)	10,029	5	6.2	101.63	6.6	98.8	—	5,072

\*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。

*FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) は、設定時を100として再指数化しています。
*FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・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 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落	率	騰 落	率		
(期首)	円	%		%	%	%
2018年12月6日	9,452	—	95.32	—	98.3	—
12月末	9,526	0.8	96.11	0.8	96.9	—
2019年1月末	9,564	1.2	96.55	1.3	98.4	—
2月末	9,552	1.1	96.45	1.2	100.1	—
3月末	9,727	2.9	98.23	3.1	98.0	—
4月末	9,657	2.2	97.57	2.4	99.1	—
5月末	9,795	3.6	99.01	3.9	97.2	—
6月末	9,949	5.3	100.58	5.5	99.3	—
7月末	9,991	5.7	101.03	6.0	98.2	—
8月末	10,295	8.9	104.17	9.3	96.5	—
9月末	10,219	8.1	103.40	8.5	99.9	—
10月末	10,091	6.8	102.13	7.1	100.9	—
11月末	10,077	6.6	102.07	7.1	99.2	—
(期末)						
2019年12月6日	10,034	6.2	101.63	6.6	98.8	—

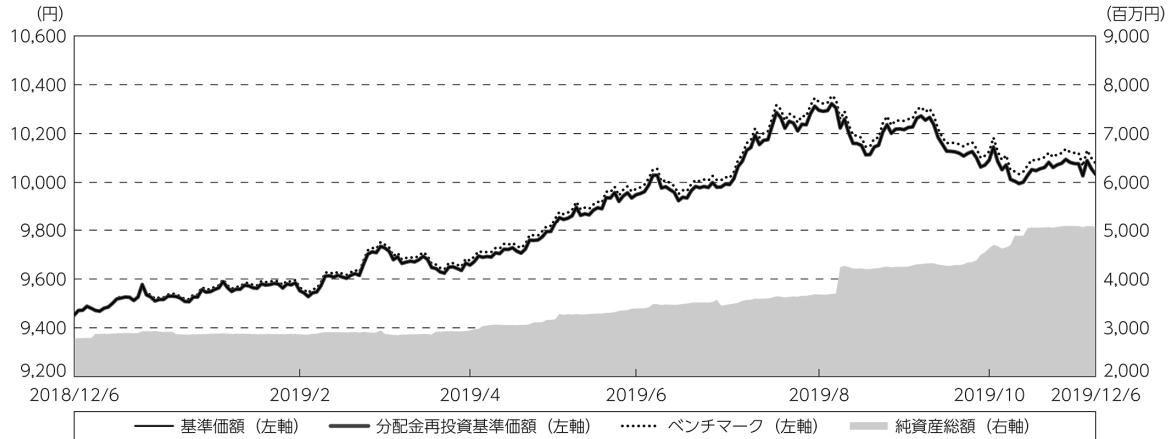
\*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



期首：9,452円

期末：10,029円（既払分配金（税込み）：5円）

騰落率：6.2%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2018年12月6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、円ヘッジ・円ベース）です。ベンチマークは、作成期首（2018年12月6日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首9,452円から期末10,034円（分配金込み）へと上昇し、値上がり額は582円となりました。

外国債券利回りの低下（価格は上昇）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、米中貿易摩擦による世界景気の鈍化懸念や低インフレの継続観測、FRB（米連邦準備制度理事会）による利下げ実施やECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和などを背景に、外国債券利回りは低下（価格は上昇）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 Aコース（野村SMA・EW向け）]

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指すため、外国債券為替ヘッジ型マザーファンドへ投資しました。期を通じてマザーファンドの組入比率を高位に維持しました。

### [外国債券為替ヘッジ型マザーファンド]

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指すため、地域構成、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（地域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、外貨建て資産については概ねベンチマークと同様に為替ヘッジを行いました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+6.2%となり、ベンチマークの+6.6%を0.4ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

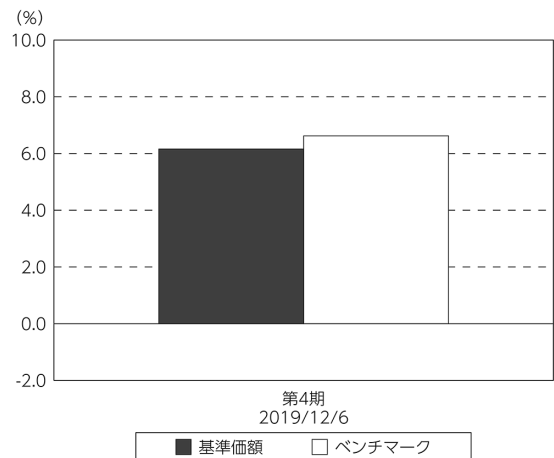
### (マイナス要因)

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

### (その他の要因)

ベンチマークとファンドで評価に用いる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、円ヘッジ・円ベース）です。

## ◎分配金

収益分配金は、基準価額水準等を勘案し決定しました。  
留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

## ○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

項 目	第4期
	2018年12月7日～ 2019年12月6日
当期分配金	5
（対基準価額比率）	0.050%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	528

（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 Aコース（野村SMA・EW向け）〕

引き続き、主要投資対象である〔外国債券為替ヘッジ型マザーファンド〕を高位に組入れ、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ってまいります。

### 〔外国債券為替ヘッジ型マザーファンド〕

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、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して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

（2018年12月7日～2019年12月6日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(24)	(0.242)	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 ）	( 5)	(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 ）	( 3)	(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	2	0.017	(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 ）	( 1)	(0.015)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	( 0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	( 0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	35	0.347	
期中の平均基準価額は、9,870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。

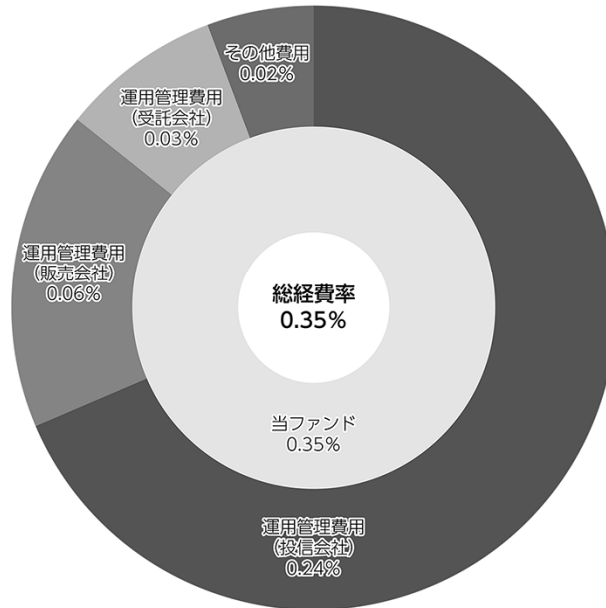
\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\* 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

(2018年12月7日～2019年12月6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
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	千口 2,189,233	千円 2,597,514	千口 417,763	千円 484,995

\*単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2018年12月7日～2019年12月6日)

該当事項はございません。

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す。

## ○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2018年12月7日～2019年12月6日)

期首残高 (元 本)	当期設定 元 本	当期解約 元 本	期末残高 (元 本)	取 引 の 理 由
百万円 0	百万円 -	百万円 -	百万円 0	当初設定時における取得

## ○組入資産の明細

(2019年12月6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
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	千口 2,489,636	千口 4,261,106	千円 5,071,995

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。



## ○投資信託財産の構成

（2019年12月6日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	5,071,995	99.7
コール・ローン等、その他	12,828	0.3
投資信託財産総額	5,084,823	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*外国債券為替ヘッジ型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（60,251,517千円）の投資信託財産総額（61,247,110千円）に対する比率は98.4%です。

\*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=108.81円、1カナダドル=82.57円、1英ポンド=143.19円、1スウェーデンクローナ=11.47円、1ノルウェークローネ=11.91円、1デンマーククローネ=16.17円、1ユーロ=120.81円、1ズロチ=28.25円、1シンガポールドル=80.00円、1豪ドル=74.38円、1メキシコペソ=5.62円、1ランド=7.43円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2019年12月6日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,084,823,558
コール・ローン等	10,299,612
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)	5,071,995,007
未収入金	2,528,939
(B) 負債	12,320,249
未払収益分配金	2,528,938
未払解約金	3,178,748
未払信託報酬	6,568,824
未払利息	4
その他未払費用	43,735
(C) 純資産総額(A-B)	5,072,503,309
元本	5,057,877,237
次期繰越損益金	14,626,072
(D) 受益権総口数	5,057,877,237口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,029円

(注) 期首元本額は2,944,697,040円、期中追加設定元本額は2,934,598,029円、期中一部解約元本額は821,417,832円、1口当たり純資産額は1.0029円です。

## ○損益の状況（2018年12月7日～2019年12月6日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 2,429
支払利息	△ 2,429
(B) 有価証券売買損益	149,673,217
売買益	181,735,011
売買損	△ 32,061,794
(C) 信託報酬等	△ 11,363,735
(D) 当期損益金(A+B+C)	138,307,053
(E) 前期繰越損益金	8,165,213
(F) 追加信託差損益金	△ 129,317,256
(配当等相当額)	( 118,102,056)
(売買損益相当額)	(△247,419,312)
(G) 計(D+E+F)	17,155,010
(H) 収益分配金	△ 2,528,938
次期繰越損益金(G+H)	14,626,072
追加信託差損益金	△ 129,317,256
(配当等相当額)	( 123,445,262)
(売買損益相当額)	(△252,762,518)
分配準備積立金	143,943,328

\*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（2018年12月7日～2019年12月6日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2018年12月7日～ 2019年12月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	70,266,281円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	53,631,337円
c. 信託約款に定める収益調整金	123,445,262円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	22,574,648円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	269,917,528円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	533円
g. 分配金	2,528,938円
h. 分配金(1万円当たり)	5円

## ○分配金のお知らせ

1万円当たり分配金(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

（2019年12月6日現在）

## &lt;外国債券為替ヘッジ型マザーファンド&gt;

下記は、外国債券為替ヘッジ型マザーファンド全体（51,075,923千口）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	額面金額	当 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		
		評 価 額		組入比率			5年以上	2年以上	2年未満
		外貨建金額	邦貨換算金額						
アメリカ	千米ドル 248,060	千米ドル 262,110	千円 28,520,217	% 46.9	% —	% 19.2	% 18.0	% 9.7	
カナダ	千カナダドル 12,600	千カナダドル 13,948	1,151,764	1.9	—	0.9	0.7	0.3	
イギリス	千英ポンド 20,950	千英ポンド 27,383	3,921,032	6.4	—	5.0	1.2	0.3	
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 15,150	千スウェーデンクローナ 16,872	193,528	0.3	—	0.2	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェークローネ 10,650	千ノルウェークローネ 11,070	131,848	0.2	—	0.1	0.1	0.0	
デンマーク	千デンマーククローネ 14,150	千デンマーククローネ 18,693	302,278	0.5	—	0.4	0.0	0.0	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ							
ドイツ	23,160	28,596	3,454,797	5.7	—	3.4	1.8	0.5	
イタリア	40,820	46,228	5,584,807	9.2	—	4.9	3.0	1.3	
フランス	40,230	48,418	5,849,490	9.6	—	6.4	2.5	0.8	
オランダ	6,940	8,806	1,063,953	1.8	—	1.1	0.5	0.1	
スペイン	24,780	29,796	3,599,720	5.9	—	3.5	2.1	0.3	
ベルギー	10,680	12,699	1,534,175	2.5	—	1.5	0.9	0.1	
オーストリア	5,820	7,141	862,810	1.4	—	0.9	0.6	—	
フィンランド	2,360	2,722	328,920	0.5	—	0.3	0.2	—	
アイルランド	5,130	5,573	673,308	1.1	—	0.5	0.6	—	
ポーランド	千ズロチ 13,100	千ズロチ 13,482	380,872	0.6	—	0.2	0.1	0.3	
シンガポール	千シンガポールドル 5,670	千シンガポールドル 6,016	481,342	0.8	—	0.5	0.2	0.1	
オーストラリア	千豪ドル 13,830	千豪ドル 15,943	1,185,911	2.0	—	1.4	0.6	—	
メキシコ	千メキシコペソ 88,800	千メキシコペソ 91,472	514,076	0.8	—	0.5	0.3	0.1	
南アフリカ	千ランド 49,300	千ランド 45,799	340,289	0.6	—	0.5	0.1	0.0	
合 計	—	—	60,075,147	98.8	—	51.3	33.4	14.1	

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

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

\* 金額の単位未満は切り捨て。

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

## (B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY BOND	6.25	70	81	8,879	2023/8/15
	US TREASURY BOND	2.375	4,500	4,649	505,940	2024/8/15
	US TREASURY BOND	6.0	610	764	83,133	2026/2/15
	US TREASURY BOND	6.5	2,680	3,519	382,944	2026/11/15
	US TREASURY BOND	6.125	1,800	2,385	259,595	2027/11/15
	US TREASURY BOND	5.5	2,280	2,963	322,415	2028/8/15
	US TREASURY BOND	5.25	20	25	2,799	2028/11/15
	US TREASURY BOND	5.25	80	103	11,265	2029/2/15
	US TREASURY BOND	2.875	510	569	61,983	2043/5/15
	US TREASURY BOND	3.75	3,450	4,425	481,502	2043/11/15
	US TREASURY N/B	3.625	2,100	2,148	233,802	2021/2/15
	US TREASURY N/B	2.0	3,580	3,596	391,335	2021/2/28
	US TREASURY N/B	2.375	4,000	4,038	439,405	2021/4/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,700	3,685	401,024	2021/4/30
	US TREASURY N/B	2.0	3,000	3,015	328,074	2021/5/31
	US TREASURY N/B	1.375	1,000	996	108,376	2021/5/31
	US TREASURY N/B	2.625	2,000	2,029	220,807	2021/6/15
	US TREASURY N/B	2.125	3,500	3,526	383,721	2021/6/30
	US TREASURY N/B	2.625	2,000	2,030	220,977	2021/7/15
	US TREASURY N/B	2.25	1,000	1,009	109,881	2021/7/31
	US TREASURY N/B	1.125	2,900	2,876	312,960	2021/7/31
	US TREASURY N/B	2.125	6,150	6,199	674,618	2021/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,500	1,527	166,217	2021/8/15
	US TREASURY N/B	1.125	4,000	3,965	431,465	2021/8/31
	US TREASURY N/B	2.125	1,500	1,513	164,655	2021/9/30
	US TREASURY N/B	1.125	1,500	1,486	161,697	2021/9/30
	US TREASURY N/B	2.875	2,100	2,147	233,704	2021/10/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,600	2,618	284,939	2021/10/31
	US TREASURY N/B	1.25	1,500	1,489	162,105	2021/10/31
	US TREASURY N/B	2.0	1,000	1,007	109,655	2021/11/15
	US TREASURY N/B	2.875	800	819	89,125	2021/11/15
	US TREASURY N/B	1.875	1,500	1,507	164,082	2021/11/30
	US TREASURY N/B	1.75	1,000	1,002	109,116	2021/11/30
	US TREASURY N/B	2.0	1,000	1,007	109,668	2021/12/31
	US TREASURY N/B	2.0	600	605	65,844	2022/2/15
	US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,505	163,788	2022/2/28
	US TREASURY N/B	1.75	3,200	3,211	349,470	2022/3/31
	US TREASURY N/B	1.75	3,000	3,011	327,628	2022/4/30
	US TREASURY N/B	1.75	3,400	3,413	371,370	2022/5/31
	US TREASURY N/B	2.125	2,700	2,737	297,895	2022/6/30
	US TREASURY N/B	1.75	1,200	1,204	131,112	2022/6/30
	US TREASURY N/B	2.0	3,000	3,032	329,949	2022/7/31
	US TREASURY N/B	1.875	1,000	1,007	109,592	2022/7/31
	US TREASURY N/B	1.625	300	300	32,674	2022/8/15
	US TREASURY N/B	1.875	3,100	3,123	339,867	2022/8/31

## 野村外国債券インデックス Aコース (野村SMA・EW向け)

銘柄	当 期 末					償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額		千円	
			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	700	705	76,773	2022/9/30
	US TREASURY N/B	1.875	1,500	1,511	164,490	2022/10/31
	US TREASURY N/B	2.0	1,000	1,011	110,059	2022/10/31
	US TREASURY N/B	1.625	2,150	2,151	234,151	2022/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,260	2,296	249,849	2022/12/31
	US TREASURY N/B	2.0	110	111	12,118	2023/2/15
	US TREASURY N/B	2.625	1,000	1,032	112,303	2023/2/28
	US TREASURY N/B	1.5	1,100	1,097	119,373	2023/3/31
	US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,507	163,992	2023/5/15
	US TREASURY N/B	1.625	2,000	2,001	217,756	2023/5/31
	US TREASURY N/B	1.375	2,500	2,480	269,857	2023/6/30
	US TREASURY N/B	1.25	3,500	3,455	376,015	2023/7/31
	US TREASURY N/B	2.5	1,200	1,237	134,693	2023/8/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,000	2,974	323,701	2023/8/31
	US TREASURY N/B	2.75	2,500	2,601	283,118	2023/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	700	700	76,196	2023/10/31
	US TREASURY N/B	2.75	1,000	1,043	113,536	2023/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	3,000	3,059	332,856	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	2,096	228,075	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	2,049	222,975	2023/12/31
	US TREASURY N/B	2.25	3,000	3,075	334,616	2024/1/31
	US TREASURY N/B	2.75	3,400	3,553	386,688	2024/2/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	2,041	222,091	2024/3/31
	US TREASURY N/B	2.0	3,500	3,555	386,845	2024/4/30
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	2,052	223,298	2024/4/30
	US TREASURY N/B	2.5	1,500	1,555	169,233	2024/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	4,000	4,065	442,380	2024/6/30
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	2,010	218,725	2024/6/30
	US TREASURY N/B	2.125	3,000	3,065	333,596	2024/7/31
	US TREASURY N/B	1.875	2,000	2,021	219,966	2024/8/31
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	2,045	222,516	2024/9/30
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	2,057	223,893	2024/10/31
	US TREASURY N/B	2.25	4,000	4,114	447,719	2024/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	1,500	1,534	166,989	2024/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	800	823	89,618	2024/12/31
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	2,034	221,394	2025/2/15
	US TREASURY N/B	2.125	800	819	89,139	2025/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,780	2,829	307,856	2025/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	600	634	69,075	2025/8/31
	US TREASURY N/B	2.25	1,640	1,691	184,066	2025/11/15
	US TREASURY N/B	1.625	2,000	1,990	216,548	2026/2/15
	US TREASURY N/B	1.625	4,200	4,176	454,467	2026/5/15
	US TREASURY N/B	1.5	3,800	3,745	407,598	2026/8/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,600	2,646	287,989	2026/11/15
	US TREASURY N/B	2.25	700	725	78,892	2027/2/15
	US TREASURY N/B	2.375	1,800	1,881	204,702	2027/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	3,200	3,316	360,841	2027/8/15

野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額		千円	
			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	2.25	600	622	67,708	2027/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	4,200	4,517	491,598	2028/2/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,500	2,716	295,635	2028/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,100	2,285	248,691	2028/8/15
	US TREASURY N/B	3.125	4,000	4,442	483,422	2028/11/15
	US TREASURY N/B	2.625	2,300	2,462	267,937	2029/2/15
	US TREASURY N/B	6.25	500	711	77,429	2030/5/15
	US TREASURY N/B	5.0	340	490	53,348	2037/5/15
	US TREASURY N/B	4.5	2,060	2,837	308,729	2038/5/15
	US TREASURY N/B	3.5	400	489	53,228	2039/2/15
	US TREASURY N/B	4.25	2,300	3,087	335,978	2039/5/15
	US TREASURY N/B	4.625	2,150	3,033	330,095	2040/2/15
	US TREASURY N/B	3.875	2,340	3,012	327,837	2040/8/15
	US TREASURY N/B	4.75	300	432	47,059	2041/2/15
	US TREASURY N/B	3.125	500	580	63,169	2041/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	500	547	59,543	2042/11/15
	US TREASURY N/B	3.125	800	930	101,206	2043/2/15
	US TREASURY N/B	3.625	700	882	96,029	2044/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	1,800	1,887	205,421	2045/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	2,540	2,914	317,078	2045/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,760	3,097	337,080	2045/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	3,020	3,470	377,589	2045/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	1,530	1,604	174,621	2046/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	3,400	3,568	388,249	2046/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	2,230	2,228	242,494	2046/8/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,400	2,705	294,337	2046/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	2,020	2,226	242,308	2047/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,500	1,655	180,174	2047/11/15
	US TREASURY N/B	3.0	2,800	3,237	352,248	2048/2/15
	US TREASURY N/B	3.125	1,500	1,775	193,231	2048/5/15
	US TREASURY N/B	3.0	500	579	63,012	2048/8/15
小計					28,520,217	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	0.75	2,570	2,539	209,666	2021/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5	2,000	1,949	160,935	2022/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.75	1,000	1,002	82,810	2023/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	800	796	65,752	2023/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.5	1,060	1,099	90,818	2024/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,000	992	81,974	2026/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	8.0	330	476	39,344	2027/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0	400	411	34,016	2028/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	5.75	1,020	1,386	114,443	2029/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	5.75	200	298	24,626	2033/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	5.0	400	600	49,552	2037/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0	780	1,100	90,860	2041/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,040	1,295	106,963	2048/12/1
小計					1,151,764	

野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）

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	1,400	1,412	202,270	2021/1/22
	UK TREASURY	4.0	520	560	80,195	2022/3/7
	UK TREASURY	1.75	1,000	1,032	147,846	2022/9/7
	UK TREASURY	0.75	900	905	129,706	2023/7/22
	UK TREASURY	2.25	550	584	83,686	2023/9/7
	UK TREASURY	1.0	500	509	72,903	2024/4/22
	UK TREASURY	2.75	1,200	1,322	189,335	2024/9/7
	UK TREASURY	1.5	1,370	1,452	207,967	2026/7/22
	UK TREASURY	4.25	300	385	55,161	2027/12/7
	UK TREASURY	1.625	900	972	139,323	2028/10/22
	UK TREASURY	6.0	90	131	18,882	2028/12/7
	UK TREASURY	0.875	300	302	43,378	2029/10/22
	UK TREASURY	4.75	600	849	121,671	2030/12/7
	UK TREASURY	4.25	200	278	39,889	2032/6/7
	UK TREASURY	4.5	200	294	42,223	2034/9/7
	UK TREASURY	4.25	1,160	1,702	243,752	2036/3/7
	UK TREASURY	1.75	370	403	57,753	2037/9/7
	UK TREASURY	4.5	1,350	2,224	318,491	2042/12/7
	UK TREASURY	3.5	400	589	84,470	2045/1/22
	UK TREASURY	4.25	2,180	3,654	523,295	2046/12/7
	UK TREASURY	1.5	1,700	1,783	255,375	2047/7/22
	UK TREASURY	1.75	900	1,000	143,227	2049/1/22
	UK TREASURY	4.25	840	1,460	209,154	2049/12/7
	UK TREASURY	3.75	860	1,438	205,920	2052/7/22
	UK TREASURY	3.5	280	519	74,392	2068/7/22
	UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	100	140	20,146	2044/1/22
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	4.25	780	1,470	210,610	2055/12/7
小 計					3,921,032	
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	5.0	600	631	7,248	2020/12/1
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5	3,500	3,833	43,974	2022/6/1
	SWEDISH GOVERNMENT	1.5	3,000	3,213	36,861	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT	2.5	250	287	3,293	2025/5/12
	SWEDISH GOVERNMENT	1.0	2,700	2,913	33,412	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	0.75	4,000	4,268	48,956	2028/5/12
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5	1,100	1,724	19,781	2039/3/30
小 計					193,528	
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	1,050	1,087	12,949	2021/5/25
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,900	1,945	23,169	2023/5/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	2,750	2,947	35,104	2024/3/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	1,700	1,719	20,475	2026/2/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	1,750	1,797	21,403	2027/2/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,500	1,573	18,745	2028/4/26
小 計					131,848	
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	1,500	1,608	26,017	2021/11/15

## 野村外国債券インデックス Aコース (野村SMA・EW向け)

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	1.5	1,650	1,789	28,932	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	3,400	3,860	62,416	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	2,300	2,466	39,883	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	1,400	1,506	24,367	2029/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	3,900	7,462	120,661	2039/11/15
小 計						302,278	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESobligation	—	700	705	85,284	2021/4/9
		BUNDESobligation	—	1,700	1,719	207,788	2021/10/8
		BUNDESobligation	—	1,100	1,126	136,065	2023/10/13
		BUNDESobligation	—	1,000	1,025	123,868	2024/4/5
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	850	897	108,444	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	1,300	1,380	166,766	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,310	1,406	169,969	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	700	768	92,837	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	400	513	62,012	2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	610	670	81,028	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	700	765	92,487	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	440	472	57,122	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	900	956	115,607	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	300	309	37,424	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	1,270	1,335	161,362	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	1,300	1,990	240,517	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	850	912	110,183	2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,000	1,075	129,906	2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	500	527	63,674	2029/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	400	411	49,709	2029/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	1,100	1,813	219,106	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	700	1,205	145,590	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	100	169	20,494	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	510	935	112,984	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	60	118	14,309	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	750	1,284	155,180	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,300	2,050	247,712	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,110	1,788	216,065	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	200	258	31,288	2048/8/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	170	178	21,522	2021/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	700	737	89,058	2021/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.45	2,300	2,317	279,971	2021/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	710	767	92,734	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.3	1,000	1,040	125,748	2021/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	1,450	1,456	175,994	2021/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2	700	716	86,579	2022/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	1,030	1,057	127,806	2022/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9	500	509	61,492	2022/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	900	930	112,355	2022/9/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	200	230	27,791	2022/11/1



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	0.95	2,400	2,444	295,365	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	150	170	20,612	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,500	1,609	194,407	2023/10/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	1,000	1,008	121,824	2023/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	180	238	28,871	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	2,200	2,558	309,051	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	1,500	1,712	206,838	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	700	724	87,577	2024/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,000	1,084	131,066	2024/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	350	425	51,381	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	500	513	62,002	2025/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	330	350	42,362	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6	550	571	69,070	2026/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.25	2,100	2,132	257,607	2026/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2	3,100	3,339	403,423	2027/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	400	560	67,658	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	800	850	102,707	2028/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	2,040	2,627	317,406	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.0	500	573	69,320	2029/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	1,000	1,353	163,552	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	700	1,024	123,772	2031/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	100	100	12,140	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,070	1,155	139,633	2033/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,110	1,550	187,363	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.25	500	520	62,923	2036/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	1,080	1,381	166,877	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	400	450	54,465	2038/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	150	217	26,218	2039/8/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	300	434	52,454	2040/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	2,180	3,141	379,483	2044/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	960	1,127	136,204	2046/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7	300	321	38,852	2047/3/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	10	10	1,251	2067/3/1		
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	1,600	1,614	195,006	2021/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	500	506	61,185	2022/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	2,800	3,025	365,565	2023/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	800	816	98,653	2024/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	3,010	3,379	408,293	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,000	1,019	123,118	2025/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	400	419	50,648	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	700	735	88,819	2026/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	1,250	1,292	156,102	2026/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	800	871	105,276	2027/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	2,300	2,469	298,298	2028/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	2,500	2,683	324,169	2028/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	1,020	1,282	154,949	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	1,350	1,534	185,437	2036/5/25

野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）

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	
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1.75	460	567	68,598	2039/6/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	2,110	2,789	336,966	2048/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.5	300	356	43,114	2050/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.75	1,140	1,208	146,052	2021/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	1,000	1,073	129,678	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.0	1,320	1,434	173,272	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	—	900	913	110,364	2022/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.25	610	660	79,775	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	800	949	114,755	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.75	600	665	80,352	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6.0	600	825	99,689	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	910	1,131	136,690	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.75	1,900	2,342	282,952	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	1,200	1,829	220,975	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.5	1,640	1,900	229,644	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.75	300	514	62,181	2032/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.75	1,490	2,489	300,712	2035/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	400	658	79,569	2038/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.5	720	1,299	156,936	2041/4/25
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	1,200	1,926	232,764	2045/5/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	600	1,232	148,916	2060/4/25		
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	500	531	64,183	2021/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	500	506	61,170	2022/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	230	261	31,590	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	300	376	45,506	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	300	325	39,336	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	1,000	1,116	134,943	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	400	423	51,163	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,000	1,080	130,549	2027/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	600	883	106,706	2028/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	850	1,131	136,721	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	610	1,087	131,387	2042/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	650	1,081	130,694	2047/1/15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.05	500	502	60,734	2021/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	730	744	89,915	2021/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.05	500	504	60,905	2021/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	1,490	1,690	204,174	2022/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.45	1,400	1,428	172,635	2022/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	900	1,060	128,082	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.35	300	305	36,919	2023/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	1,940	2,282	275,797	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	1,920	2,250	271,851	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	1,400	1,590	192,166	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	500	628	75,894	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	720	802	96,932	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	1,000	1,074	129,832	2026/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5	1,000	1,089	131,598	2027/4/30

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,100	1,200	145,010	2027/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,300	1,411	170,469	2028/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,600	1,742	210,538	2028/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	330	467	56,503	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,000	1,145	138,329	2030/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	900	1,086	131,246	2033/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	1,000	1,689	204,150	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	800	1,475	178,237	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	1,150	1,566	189,214	2046/10/31
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	90	134	16,304	2029/1/31
		SPANISH GOVERNMENT	5.75	800	1,297	156,724	2032/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	410	625	75,551	2037/1/31
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.25	340	370	44,706	2021/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	500	553	66,867	2022/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	700	794	95,937	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	200	219	26,569	2023/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.2	1,400	1,437	173,666	2023/10/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	230	261	31,618	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.5	1,300	1,356	163,839	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	100	108	13,076	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	950	1,018	123,061	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.9	800	868	104,980	2029/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,200	1,319	159,389	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	550	808	97,664	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.45	200	233	28,149	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	420	524	63,320	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	300	519	62,781	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	550	946	114,301	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	200	243	29,378	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.7	200	247	29,874	2050/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.15	170	241	29,212	2066/6/22		
BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	370	627	75,781	2035/3/28		
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	800	880	106,361	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	700	711	85,906	2022/9/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	1,120	1,219	147,274	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	300	321	38,805	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	400	421	50,902	2027/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	700	751	90,828	2028/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	530	698	84,349	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	230	381	46,060	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	400	655	79,189	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	300	375	45,390	2047/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	330	713	86,160	2062/1/26
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	10	13	1,581	2086/11/2
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	—	300	304	36,759	2022/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.625	300	318	38,484	2022/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	150	160	19,388	2023/4/15

野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）

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	
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	2.0	200	221	26,787	2024/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	310	325	39,356	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	740	924	111,647	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	200	226	27,419	2034/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	160	240	29,078	2042/7/4
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	0.9	800	863	104,306	2028/5/15
		IRISH TSY 0.8% 2022	0.8	1,300	1,339	161,827	2022/3/15
		IRISH TSY 1% 2026	1.0	650	700	84,612	2026/5/15
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	550	657	79,476	2037/5/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	250	324	39,211	2045/2/18
		IRISH TSY 2022	—	1,000	1,014	122,546	2022/10/18
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	500	581	70,258	2024/3/18
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	80	91	11,071	2023/3/20
小 計						22,951,984	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	—	1,600	1,569	44,338	2021/5/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	4,700	4,729	133,601	2021/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,000	2,066	58,383	2024/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	2,800	3,003	84,834	2025/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	2,000	2,113	59,714	2028/4/25
小 計						380,872	
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	1,030	1,024	81,994	2021/10/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	1,400	1,457	116,625	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	400	415	33,248	2025/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	730	819	65,589	2027/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	300	321	25,692	2028/5/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	610	675	54,046	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	700	734	58,772	2036/8/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	500	567	45,375	2046/3/1
小 計						481,342	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0	1,200	1,231	91,572	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	120	135	10,082	2022/7/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	1,200	1,254	93,285	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	800	927	69,020	2023/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,000	1,085	80,743	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	340	383	28,539	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	520	626	46,575	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	820	1,040	77,404	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	900	1,019	75,832	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	2,820	3,083	229,342	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,000	1,142	85,001	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	800	921	68,506	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	1,170	1,645	122,374	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	150	203	15,147	2037/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	420	538	40,083	2039/6/21		

## 野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）

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		
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	300	362	26,956	2041/5/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	270	342	25,440	2047/3/21
小計					1,185,911	
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	9,200	9,158	51,472	2021/6/10
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.25	2,800	2,820	15,850	2021/12/9
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	15,000	14,888	83,673	2022/6/9
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	14,000	13,145	73,876	2026/3/5
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	20,100	20,647	116,041	2027/6/3
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	3,100	3,262	18,336	2034/11/23
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	6,000	7,628	42,871	2036/11/20
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	5,000	5,612	31,543	2038/11/18
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	4,300	4,646	26,115	2047/11/7
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	9,300	9,660	54,293	2023/12/7
小計					514,076	
南アフリカ			千ランド	千ランド		
国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	800	800	5,946	2021/3/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	4,500	4,552	33,822	2023/2/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	6,900	7,646	56,814	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	6,650	6,124	45,502	2030/1/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	2,800	2,333	17,335	2031/2/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.875	3,500	3,224	23,958	2035/2/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	8,800	7,678	57,047	2037/1/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0	6,000	5,383	40,003	2040/1/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	2,100	1,813	13,473	2044/1/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	7,250	6,242	46,385	2048/2/28
小計					340,289	
合計					60,075,147	

\* 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。

# 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

## 運用報告書

第6期（決算日2019年9月6日）

作成対象期間（2018年9月7日～2019年9月6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、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動す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す。
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	株式への投資は行いません。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

**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	純資産総額
	騰落	中率	騰落	中率			
	円	%	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	%	%	%	百万円
2期(2015年9月7日)	11,088	3.1	111.34	3.3	96.0	—	1,354
3期(2016年9月6日)	11,711	5.6	117.74	5.7	99.2	—	4,324
4期(2017年9月6日)	11,412	△2.6	114.81	△2.5	84.6	—	15,515
5期(2018年9月6日)	11,174	△2.1	112.61	△1.9	98.8	—	50,125
6期(2019年9月6日)	12,118	8.4	122.22	8.5	99.7	—	59,275

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

\*FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス(為替ヘッジを行なう円ベースの指数)です。なお、設定時を100として再指数化しています。

\*FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・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

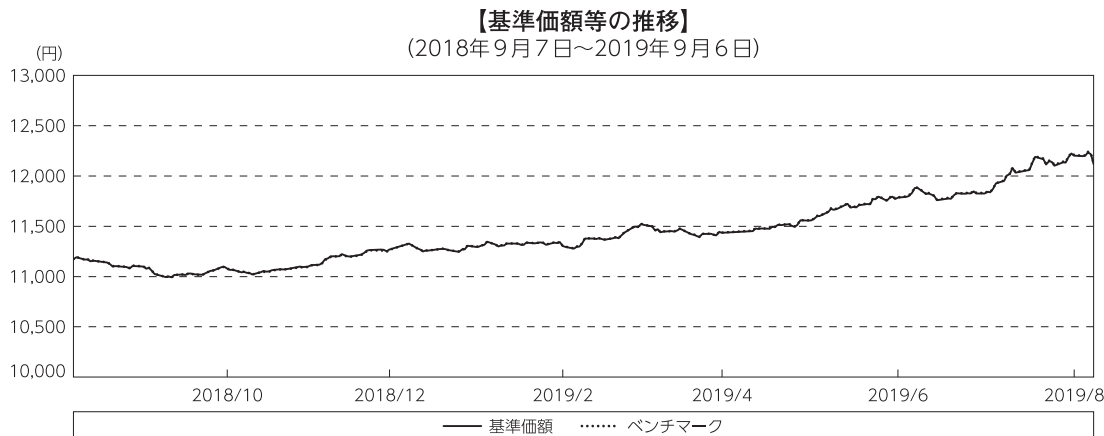
年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
	騰落	中率	騰落	中率		
(期首) 2018年9月6日	円	%	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	%	%	%
	11,174	—	112.61	—	98.8	—
9月末	11,105	△0.6	111.95	△0.6	100.9	—
10月末	11,078	△0.9	111.65	△0.9	96.4	—
11月末	11,114	△0.5	111.99	△0.6	99.7	—
12月末	11,268	0.8	113.53	0.8	97.0	—
2019年1月末	11,316	1.3	114.05	1.3	98.4	—
2月末	11,305	1.2	113.94	1.2	100.2	—
3月末	11,514	3.0	116.04	3.0	98.0	—
4月末	11,435	2.3	115.26	2.4	99.1	—
5月末	11,601	3.8	116.96	3.9	97.3	—
6月末	11,786	5.5	118.81	5.5	99.3	—
7月末	11,839	6.0	119.35	6.0	98.2	—
8月末	12,203	9.2	123.06	9.3	96.5	—
(期末) 2019年9月6日	円	%	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	%	%	%
	12,118	8.4	122.22	8.5	99.7	—

\*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、円ヘッジ・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

基準価額は、期首11,174円から期末12,118円へと上昇し、値上がり額は944円となりました。

外国債券利回りの低下（価格は上昇）がプラスに寄与したため、基準価額は上昇しました。

### ○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、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指すため、地域構成、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（地域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、外貨建て資産については概ねベンチマークと同様に為替ヘッジを行いました。



## ○当ファンドのベンチマークとの差異

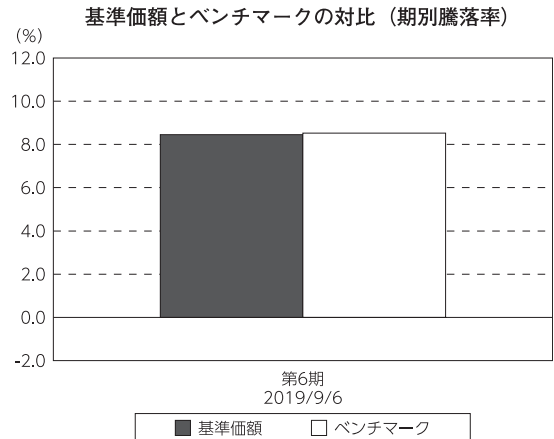
今期の基準価額の騰落率は+8.4%となり、ベンチマークの+8.5%を0.1ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

### (マイナス要因)

コスト負担（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、円ヘッジ・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、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して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

(2018年9月7日～2019年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 2	% 0.015	(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)	(0.015)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	2	0.015	
期中の平均基準価額は、11,463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

(2018年9月7日～2019年9月6日)

## 公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券 千米ドル 134,421	千米ドル 92,147
	カナダ	国債証券 千カナダドル 4,553	千カナダドル 3,071
	イギリス	国債証券 千英ポンド 11,833	千英ポンド 8,403
	スウェーデン	国債証券 千スウェーデンクローナ 3,099	千スウェーデンクローナ -
	ノルウェー	国債証券 千ノルウェークローネ 399	千ノルウェークローネ -
	デンマーク	国債証券 千デンマーククローネ 3,271	千デンマーククローネ 469
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 13,767	11,558
	イタリア	国債証券 18,601	12,098
	フランス	国債証券 22,515	16,282
	オランダ	国債証券 3,821	4,226
	スペイン	国債証券 12,090	7,555
	ベルギー	国債証券 4,224	2,639
	オーストリア	国債証券 3,839	2,836
	フィンランド	国債証券 1,345	1,037
	アイルランド	国債証券 3,090	2,554
	国	ポーランド	国債証券 千ズロチ 23,559
シンガポール		国債証券 千シンガポールドル 1,681	千シンガポールドル 509
オーストラリア		国債証券 千豪ドル 5,563	千豪ドル 2,754
メキシコ		国債証券 千メキシコペソ 13,823	千メキシコペソ 9,833
南アフリカ		国債証券 千ランド 13,229	千ランド -

\*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

(2018年9月7日～2019年9月6日)

該当事項はございません。

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す。

## ○組入資産の明細

(2019年9月6日現在)

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	242,860	259,952	27,833,138	47.0	—	20.0	18.0	9.0
カナダ	千カナダドル 12,200	千カナダドル 13,653	1,104,858	1.9	—	0.8	0.7	0.3
イギリス	千英ポンド 21,450	千英ポンド 28,638	3,778,274	6.4	—	5.1	0.9	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 15,150	千スウェーデンクローナ 17,287	191,025	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 7,650	千ノルウェークローネ 8,012	95,108	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 14,300	千デンマーククローネ 19,336	306,092	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	24,210	30,354	3,583,607	6.0	—	3.4	2.2	0.5
イタリア	41,380	47,967	5,663,033	9.6	—	5.3	2.8	1.4
フランス	39,830	49,176	5,805,789	9.8	—	6.4	2.6	0.8
オランダ	6,740	8,737	1,031,510	1.7	—	1.1	0.5	0.1
スペイン	24,900	30,311	3,578,609	6.0	—	3.9	1.6	0.5
ベルギー	10,080	12,421	1,466,517	2.5	—	1.9	0.5	0.1
オーストリア	5,820	7,343	866,918	1.5	—	0.9	0.6	—
フィンランド	2,550	2,979	351,778	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	4,130	4,591	542,082	0.9	—	0.5	0.4	—
ポーランド	千ズロチ 13,100	千ズロチ 13,505	367,488	0.6	—	0.2	0.1	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 6,070	千シンガポールドル 6,450	498,815	0.8	—	0.5	0.3	0.1
オーストラリア	千豪ドル 14,750	千豪ドル 16,930	1,234,411	2.1	—	1.3	0.6	0.2
メキシコ	千メキシコペソ 78,800	千メキシコペソ 81,136	440,572	0.7	—	0.4	0.3	0.1
南アフリカ	千ランド 49,300	千ランド 47,177	339,675	0.6	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	59,079,308	99.7	—	53.2	32.6	13.9

\* 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	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	6.25	70	82	8,868	2023/8/15
	US TREASURY BOND	2.375	2,000	2,087	223,475	2024/8/15
	US TREASURY BOND	6.0	610	778	83,396	2026/2/15
	US TREASURY BOND	6.5	2,680	3,592	384,633	2026/11/15
	US TREASURY BOND	6.125	1,800	2,436	260,917	2027/11/15
	US TREASURY BOND	5.5	2,280	3,031	324,621	2028/8/15
	US TREASURY BOND	5.25	20	26	2,819	2028/11/15
	US TREASURY BOND	5.25	80	105	11,348	2029/2/15
	US TREASURY BOND	2.875	510	593	63,547	2043/5/15
	US TREASURY BOND	3.75	3,450	4,606	493,195	2043/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	1,800	1,806	193,403	2020/8/31
	US TREASURY N/B	1.375	2,000	1,993	213,428	2020/9/15
	US TREASURY N/B	1.375	1,400	1,394	149,289	2020/10/31
	US TREASURY N/B	1.75	1,700	1,700	182,040	2020/11/15
	US TREASURY N/B	2.0	1,000	1,003	107,421	2020/11/30
	US TREASURY N/B	2.5	2,200	2,222	237,937	2020/12/31
	US TREASURY N/B	3.625	2,100	2,158	231,162	2021/2/15
	US TREASURY N/B	2.0	3,580	3,596	385,107	2021/2/28
	US TREASURY N/B	2.375	4,000	4,045	433,148	2021/4/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,700	3,683	394,363	2021/4/30
	US TREASURY N/B	2.0	3,000	3,020	323,355	2021/5/31
	US TREASURY N/B	1.375	1,000	995	106,626	2021/5/31
	US TREASURY N/B	2.625	2,000	2,035	217,929	2021/6/15
	US TREASURY N/B	2.125	3,500	3,532	378,258	2021/6/30
	US TREASURY N/B	2.625	2,000	2,037	218,130	2021/7/15
	US TREASURY N/B	1.125	2,900	2,874	307,786	2021/7/31
	US TREASURY N/B	2.125	6,150	6,214	665,399	2021/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,500	1,533	164,187	2021/8/15
	US TREASURY N/B	1.125	4,000	3,965	424,599	2021/8/31
	US TREASURY N/B	2.125	1,500	1,517	162,436	2021/9/30
	US TREASURY N/B	1.125	1,500	1,486	159,212	2021/9/30
	US TREASURY N/B	2.875	2,100	2,157	230,968	2021/10/15
	US TREASURY N/B	2.0	1,700	1,716	183,739	2021/10/31
	US TREASURY N/B	1.25	1,500	1,490	159,576	2021/10/31
	US TREASURY N/B	2.875	800	822	88,088	2021/11/15
	US TREASURY N/B	1.875	1,500	1,511	161,809	2021/11/30
	US TREASURY N/B	1.75	1,000	1,004	107,546	2021/11/30
	US TREASURY N/B	2.0	1,000	1,010	108,207	2021/12/31
	US TREASURY N/B	2.0	600	607	65,009	2022/2/15
	US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,508	161,558	2022/2/28
	US TREASURY N/B	1.75	3,200	3,221	344,872	2022/3/31
	US TREASURY N/B	1.75	3,000	3,019	323,343	2022/4/30
	US TREASURY N/B	1.75	3,400	3,423	366,512	2022/5/31
	US TREASURY N/B	2.125	2,700	2,748	294,328	2022/6/30
	US TREASURY N/B	1.75	1,200	1,208	129,437	2022/6/30

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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券					
	US TREASURY N/B	2.0	3,000	3,045	326,053	2022/7/31
	US TREASURY N/B	1.875	1,000	1,011	108,249	2022/7/31
	US TREASURY N/B	1.625	300	301	32,266	2022/8/15
	US TREASURY N/B	1.875	3,100	3,136	335,806	2022/8/31
	US TREASURY N/B	1.875	700	708	75,880	2022/9/30
	US TREASURY N/B	1.875	1,500	1,518	162,625	2022/10/31
	US TREASURY N/B	1.625	2,150	2,160	231,333	2022/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,260	2,308	247,176	2022/12/31
	US TREASURY N/B	2.0	110	111	11,990	2023/2/15
	US TREASURY N/B	2.625	1,000	1,039	111,252	2023/2/28
	US TREASURY N/B	1.5	1,100	1,101	117,951	2023/3/31
	US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,515	162,298	2023/5/15
	US TREASURY N/B	1.625	2,000	2,012	215,428	2023/5/31
	US TREASURY N/B	1.375	2,500	2,491	266,775	2023/6/30
	US TREASURY N/B	1.25	3,500	3,471	371,700	2023/7/31
	US TREASURY N/B	2.5	1,200	1,247	133,583	2023/8/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,000	2,990	320,231	2023/8/31
	US TREASURY N/B	2.75	2,500	2,623	280,912	2023/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	700	704	75,464	2023/10/31
	US TREASURY N/B	2.75	1,000	1,051	112,632	2023/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	3,000	3,081	329,967	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	2,115	226,503	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	2,065	221,183	2023/12/31
	US TREASURY N/B	2.25	3,000	3,101	332,050	2024/1/31
	US TREASURY N/B	2.75	3,400	3,589	384,316	2024/2/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	2,059	220,463	2024/3/31
	US TREASURY N/B	2.0	3,500	3,585	383,937	2024/4/30
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	2,071	221,835	2024/4/30
	US TREASURY N/B	2.5	1,500	1,571	168,208	2024/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	4,000	4,101	439,120	2024/6/30
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	2,028	217,151	2024/6/30
	US TREASURY N/B	2.125	3,000	3,094	331,373	2024/7/31
	US TREASURY N/B	1.875	2,000	2,040	218,456	2024/8/31
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	2,065	221,132	2024/9/30
	US TREASURY N/B	2.25	4,000	4,158	445,210	2024/11/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	2,056	220,196	2025/2/15
	US TREASURY N/B	2.125	800	828	88,687	2025/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,780	2,861	306,328	2025/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	600	643	68,859	2025/8/31
	US TREASURY N/B	2.25	1,640	1,712	183,386	2025/11/15
	US TREASURY N/B	1.625	2,000	2,015	215,746	2026/2/15
	US TREASURY N/B	1.625	4,200	4,231	453,066	2026/5/15
	US TREASURY N/B	1.5	3,800	3,797	406,643	2026/8/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	2,067	221,350	2026/11/15
	US TREASURY N/B	2.25	700	736	78,842	2027/2/15
	US TREASURY N/B	2.375	1,800	1,912	204,756	2027/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	3,200	3,372	361,120	2027/8/15

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額		債還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY N/B	2.25	600	632	67,770	2027/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	4,200	4,600	492,625	2028/2/15
	US TREASURY N/B	2.875	1,000	1,107	118,605	2028/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,100	2,330	249,527	2028/8/15
	US TREASURY N/B	3.125	2,000	2,266	242,697	2028/11/15
	US TREASURY N/B	2.625	3,000	3,277	350,947	2029/2/15
	US TREASURY N/B	6.25	500	729	78,102	2030/5/15
	US TREASURY N/B	5.0	340	507	54,287	2037/5/15
	US TREASURY N/B	4.5	2,060	2,938	314,665	2038/5/15
	US TREASURY N/B	3.5	400	507	54,311	2039/2/15
	US TREASURY N/B	4.25	2,300	3,206	343,283	2039/5/15
	US TREASURY N/B	4.625	2,150	3,151	337,459	2040/2/15
	US TREASURY N/B	3.875	2,340	3,134	335,591	2040/8/15
	US TREASURY N/B	4.75	300	449	48,121	2041/2/15
	US TREASURY N/B	3.125	500	603	64,660	2041/11/15
	US TREASURY N/B	3.125	800	968	103,663	2043/2/15
	US TREASURY N/B	3.625	700	918	98,317	2044/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	1,800	1,967	210,673	2045/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	2,540	3,035	324,989	2045/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,760	3,227	345,519	2045/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	3,020	3,615	387,086	2045/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	1,530	1,673	179,162	2046/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	3,400	3,717	398,081	2046/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	2,230	2,323	248,764	2046/8/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,400	2,817	301,676	2046/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	2,020	2,322	248,639	2047/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	3,600	4,338	464,499	2048/2/15
	US TREASURY N/B	3.125	1,500	1,851	198,196	2048/5/15
	US TREASURY N/B	3.0	500	603	64,656	2048/8/15
小計					27,833,138	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	0.75	2,570	2,540	205,585	2021/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5	2,000	1,955	158,269	2022/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.75	1,000	1,013	82,024	2023/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	800	805	65,141	2023/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.5	1,060	1,118	90,542	2024/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,000	1,015	82,186	2026/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	8.0	330	492	39,880	2027/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0	400	424	34,373	2028/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	5.75	620	871	70,549	2029/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	5.75	200	309	25,046	2033/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	5.0	400	619	50,154	2037/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0	780	1,137	92,027	2041/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,040	1,347	109,075	2048/12/1
小計					1,104,858	
イギリス			千英ポンド	千英ポンド		
国債証券	UK TREASURY	1.5	1,600	1,621	213,963	2021/1/22

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		
イギリス		%	千英ポンド	千英ポンド	千円		
	国債証券	UK TREASURY	4.0	920	1,002	132,235	2022/3/7
		UK TREASURY	1.75	1,000	1,039	137,194	2022/9/7
		UK TREASURY	0.75	900	911	120,215	2023/7/22
		UK TREASURY	2.25	550	589	77,833	2023/9/7
		UK TREASURY	1.0	500	513	67,707	2024/4/22
		UK TREASURY	2.75	1,200	1,338	176,585	2024/9/7
		UK TREASURY	1.5	1,370	1,471	194,081	2026/7/22
		UK TREASURY	4.25	300	392	51,794	2027/12/7
		UK TREASURY	1.625	900	987	130,328	2028/10/22
		UK TREASURY	6.0	90	134	17,784	2028/12/7
		UK TREASURY	0.875	300	308	40,651	2029/10/22
		UK TREASURY	4.75	600	870	114,818	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	200	285	37,697	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	200	303	40,019	2034/9/7
		UK TREASURY	4.25	1,160	1,753	231,287	2036/3/7
		UK TREASURY	1.75	470	527	69,646	2037/9/7
		UK TREASURY	4.5	1,550	2,633	347,431	2042/12/7
		UK TREASURY	3.5	400	609	80,345	2045/1/22
		UK TREASURY	4.25	2,080	3,600	475,011	2046/12/7
		UK TREASURY	1.5	1,700	1,849	243,972	2047/7/22
		UK TREASURY	1.75	600	692	91,387	2049/1/22
		UK TREASURY	4.25	840	1,511	199,356	2049/12/7
		UK TREASURY	3.75	860	1,486	196,069	2052/7/22
		UK TREASURY	3.5	280	540	71,335	2068/7/22
		UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	100	145	19,143	2044/1/22
		UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	4.25	780	1,518	200,377	2055/12/7
小	計					3,778,274	
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	5.0	600	642	7,096	2020/12/1
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	3,500	3,898	43,080	2022/6/1
		SWEDISH GOVERNMENT	1.5	3,000	3,269	36,128	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT	2.5	250	293	3,245	2025/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	1.0	2,700	2,982	32,960	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT	0.75	4,000	4,383	48,439	2028/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	1,100	1,816	20,074	2039/3/30
小	計					191,025	
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	1,050	1,096	13,019	2021/5/25
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,900	1,961	23,281	2023/5/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	750	812	9,638	2024/3/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	1,700	1,743	20,689	2026/2/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	750	786	9,329	2027/2/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,500	1,613	19,149	2028/4/26
小	計					95,108	
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	0.25	1,550	1,570	24,862	2020/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	3.0	1,500	1,629	25,791	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	1.5	1,650	1,817	28,775	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	3,400	3,952	62,568	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	2,300	2,532	40,093	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	3,900	7,833	124,000	2039/11/15
小 計						306,092	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESobligation	—	1,700	1,723	203,481	2021/4/9
		BUNDESobligation	—	1,700	1,731	204,461	2021/10/8
		BUNDESobligation	—	1,100	1,141	134,777	2023/10/13
		BUNDESobligation	—	1,000	1,041	122,927	2024/4/5
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	750	772	91,242	2020/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	850	908	107,222	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	1,300	1,399	165,179	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,310	1,428	168,672	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	700	781	92,281	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	400	526	62,126	2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	610	683	80,649	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	700	780	92,087	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	440	481	56,876	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	900	978	115,559	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	300	317	37,436	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	1,270	1,368	161,587	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	1,300	2,058	242,977	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	850	935	110,440	2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,000	1,103	130,302	2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	400	424	50,090	2029/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	1,100	1,884	222,452	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	700	1,256	148,325	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	100	177	20,988	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	510	979	115,666	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	60	124	14,669	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	750	1,351	159,556	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,100	1,827	215,744	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,110	1,891	223,279	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	200	275	32,544	2048/8/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	460	479	56,592	2020/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	1,800	1,820	214,977	2020/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	170	180	21,295	2021/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	700	746	88,177	2021/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.45	3,000	3,037	358,575	2021/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	710	780	92,111	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.3	500	526	62,099	2021/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	1,450	1,467	173,198	2021/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2	700	723	85,418	2022/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	1,030	1,068	126,161	2022/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9	500	513	60,617	2022/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	900	939	110,970	2022/9/15

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	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	200	234	27,659	2022/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	2,400	2,471	291,787	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	150	173	20,527	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,500	1,636	193,182	2023/10/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	1,000	1,020	120,492	2023/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	180	245	28,975	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	2,200	2,612	308,431	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	500	583	68,923	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	700	739	87,327	2024/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	500	555	65,523	2024/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	350	436	51,582	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	330	359	42,485	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6	550	587	69,374	2026/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.25	2,600	2,718	320,891	2026/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2	3,100	3,449	407,305	2027/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	800	882	104,185	2028/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	2,040	2,741	323,668	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.0	500	597	70,523	2029/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	1,000	1,411	166,594	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	700	1,069	126,293	2031/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	100	105	12,456	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,070	1,225	144,679	2033/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,110	1,640	193,621	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.25	500	558	65,883	2036/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	1,080	1,471	173,750	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	400	482	56,933	2038/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	150	231	27,388	2039/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	300	464	54,816	2040/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	2,180	3,384	399,568	2044/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	960	1,229	145,151	2046/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7	300	351	41,488	2047/3/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	10	11	1,362	2067/3/1		
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	3,000	3,041	359,057	2021/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	500	509	60,189	2022/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	3,500	3,834	452,738	2023/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	800	826	97,527	2024/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	3,010	3,437	405,866	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	500	517	61,084	2025/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	400	426	50,353	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	700	750	88,550	2026/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	1,250	1,319	155,774	2026/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	800	892	105,314	2027/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	2,300	2,530	298,784	2028/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,700	1,872	221,119	2028/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	1,020	1,322	156,175	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	1,350	1,597	188,547	2036/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	660	850	100,389	2039/6/25

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2.0	1,810	2,521	297,745	2048/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.75	1,140	1,225	144,639	2021/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	1,000	1,087	128,403	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.0	1,320	1,454	171,667	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	—	100	102	12,071	2022/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.25	610	669	79,007	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	800	969	114,414	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.75	600	677	79,950	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6.0	600	847	100,076	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	910	1,161	137,177	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.75	1,900	2,405	284,048	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	1,200	1,885	222,614	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.5	1,640	1,961	231,599	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.75	300	532	62,924	2032/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.75	1,490	2,580	304,652	2035/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	400	686	81,043	2038/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.5	720	1,358	160,380	2041/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	1,200	2,025	239,148	2045/5/25
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	600	1,293	152,750	2060/4/25		
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	500	538	63,558	2021/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	500	510	60,215	2022/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	230	266	31,501	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	300	385	45,547	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	300	330	39,027	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	1,000	1,138	134,374	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	400	432	51,042	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,000	1,106	130,599	2027/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	600	910	107,489	2028/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	850	1,179	139,267	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	610	1,143	135,018	2042/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	450	795	93,869	2047/1/15		
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.85	420	446	52,679	2020/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.05	1,500	1,512	178,602	2021/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	730	748	88,311	2021/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.05	500	506	59,772	2021/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	1,490	1,719	203,012	2022/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.45	900	925	109,239	2022/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	900	1,079	127,414	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.35	300	308	36,413	2023/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	1,940	2,324	274,445	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	1,120	1,335	157,667	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	1,400	1,617	191,002	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	500	642	75,820	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,120	1,271	150,128	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	1,000	1,095	129,326	2026/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5	1,300	1,446	170,805	2027/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,100	1,230	145,255	2027/10/31

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	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	900	1,001	118,224	2028/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,600	1,780	210,222	2028/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	330	483	57,072	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,000	1,179	139,238	2030/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	900	1,118	132,009	2033/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	1,000	1,751	206,757	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	800	1,531	180,787	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	1,150	1,632	192,733	2046/10/31
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	90	139	16,438	2029/1/31
		SPANISH GOVERNMENT	5.75	500	838	98,957	2032/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	410	646	76,267	2037/1/31
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.75	300	314	37,097	2020/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	340	375	44,327	2021/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	500	561	66,337	2022/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	700	801	94,575	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	200	223	26,332	2023/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.2	400	415	49,089	2023/10/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	230	266	31,435	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.5	700	740	87,401	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	800	881	104,092	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	950	1,040	122,863	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.9	800	890	105,143	2029/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,200	1,357	160,304	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	550	833	98,444	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.45	200	241	28,525	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	420	543	64,212	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	300	540	63,773	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	550	985	116,375	2045/6/22
				BELGIUM KINGDOM	1.6	200	252
		BELGIUM KINGDOM	1.7	200	257	30,373	2050/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	170	248	29,371	2066/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	370	648	76,613	2035/3/28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	800	893	105,479	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	700	716	84,586	2022/9/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	1,120	1,236	146,017	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	300	327	38,652	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	400	433	51,190	2027/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	700	770	90,992	2028/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	530	722	85,340	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	230	395	46,653	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	400	683	80,707	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	300	394	46,532	2047/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	330	754	89,072	2062/1/26
				REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	10	14
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	0.375	190	192	22,691	2020/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	—	300	306	36,150	2022/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.625	300	322	38,020	2022/9/15

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	
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	1.5	150	162	19,167	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.0	200	225	26,623	2024/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	310	332	39,204	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	740	950	112,180	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	200	236	27,931	2034/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	160	252	29,807	2042/7/4
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	0.9	800	869	102,711	2028/5/15
		IRISH TSY 0.8% 2022	0.8	1,300	1,347	159,032	2022/3/15
		IRISH TSY 1% 2026	1.0	650	706	83,456	2026/5/15
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	550	660	77,949	2037/5/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	250	324	38,350	2045/2/18
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	500	589	69,630	2024/3/18
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	80	92	10,951	2023/3/20
小 計						22,889,846	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	—	1,600	1,559	42,431	2021/5/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	4,700	4,723	128,532	2021/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,000	2,066	56,223	2024/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	2,800	3,007	81,825	2025/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	2,000	2,149	58,474	2028/4/25
小 計						367,488	
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	3.25	400	406	31,417	2020/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.25	1,030	1,022	79,052	2021/10/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	1,400	1,459	112,894	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	400	414	32,088	2025/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	730	827	63,976	2027/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	300	322	24,972	2028/5/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	610	681	52,737	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	700	737	57,027	2036/8/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	500	577	44,648	2046/3/1
小 計						498,815	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	1,420	1,435	104,632	2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0	1,200	1,233	89,923	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	120	136	9,958	2022/7/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	1,200	1,253	91,394	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	800	935	68,207	2023/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,000	1,086	79,220	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	340	385	28,112	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	520	628	45,852	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	820	1,051	76,693	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	900	1,028	75,016	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	2,820	3,100	226,043	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,000	1,156	84,318	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	300	348	25,381	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	1,170	1,675	122,162	2033/4/21

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	3.75	150	208	15,185	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	420	546	39,808	2039/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	300	372	27,136	2041/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	270	347	25,363	2047/3/21
小	計					1,234,411	
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	9,200	9,130	49,580	2021/6/10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.25	2,800	2,816	15,292	2021/12/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	15,000	14,859	80,685	2022/6/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	14,000	13,155	71,433	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	10,100	10,427	56,621	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	3,100	3,264	17,724	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	6,000	7,594	41,237	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	5,000	5,599	30,404	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	4,300	4,599	24,975	2047/11/7
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	9,300	9,690	52,616	2023/12/7
小	計					440,572	
南アフリカ			千ランド	千ランド			
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	800	801	5,769	2021/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	4,500	4,568	32,893	2023/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	6,900	7,785	56,052	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	6,650	6,278	45,202	2030/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	2,800	2,394	17,242	2031/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.875	3,500	3,332	23,994	2035/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	8,800	7,976	57,429	2037/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0	6,000	5,605	40,360	2040/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	2,100	1,898	13,665	2044/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	7,250	6,536	47,063	2048/2/28
小	計					339,675	
合	計					59,079,308	

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

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2019年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 59,079,308	% 94.8
コール・ローン等、その他	3,222,282	5.2
投資信託財産総額	62,301,590	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（59,035,565千円）の投資信託財産総額（62,301,590千円）に対する比率は94.8%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=107.07円、1カナダドル=80.92円、1英ポンド=131.93円、1スウェーデンクローナ=11.05円、1ノルウェークローネ=11.87円、1デンマーククローネ=15.83円、1ユーロ=118.06円、1ズロチ=27.21円、1シンガポールドル=77.33円、1豪ドル=72.91円、1メキシコペソ=5.43円、1ランド=7.20円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	122,039,560,495
コール・ローン等	2,273,767,990
公社債(評価額)	59,079,308,478
未収入金	60,349,952,418
未収利息	314,494,899
前払費用	21,763,411
差入委託証拠金	273,299
(B) 負債	62,763,996,723
未払金	62,667,588,285
未払解約金	95,692,199
未払利息	1,239
その他未払費用	715,000
(C) 純資産総額(A-B)	59,275,563,772
元本	48,914,123,681
次期繰越損益金	10,361,440,091
(D) 受益権総口数	48,914,123,681口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,118円

(注) 期首元本額は44,861,179,119円、期中追加設定元本額は21,801,595,426円、期中一部解約元本額は17,748,650,864円、1口当たり純資産額は1.2118円です。

## ○損益の状況 (2018年9月7日～2019年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,170,556,947
受取利息	1,170,842,829
支払利息	△ 285,882
(B) 有価証券売買損益	3,552,875,754
売買益	11,674,469,084
売買損	△ 8,121,593,330
(C) 保管費用等	△ 8,679,124
(D) 当期損益金(A+B+C)	4,714,753,577
(E) 前期繰越損益金	5,264,531,760
(F) 追加信託差損益金	2,818,101,535
(G) 解約差損益金	△ 2,435,946,781
(H) 計(D+E+F+G)	10,361,440,091
次期繰越損益金(H)	10,361,440,091

\* 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 Aコース (野村投資一任口座向け)	31,138,171,459
野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	9,316,909,600
野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	3,501,353,488
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	3,001,008,891
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	937,425,045
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	728,486,830
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	220,401,994
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	17,679,500
インデックス・ブレンド(タイプI)	16,264,826
インデックス・ブレンド(タイプIII)	14,347,908
インデックス・ブレンド(タイプII)	6,037,756
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	4,514,688
インデックス・ブレンド(タイプV)	4,361,107
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	2,801,950
インデックス・ブレンド(タイプIV)	2,609,439
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	1,749,200

○お知らせ

---

該当事項はございません。



### <お申し込み時の留意点>

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

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

(2019年12月6日現在)

年 月	日
2019年12月	24、25、26
2020年1月	17、20
2月	14、17
3月	－
4月	9、10、13
5月	7、8、22、25
6月	－
7月	2、3
8月	28、31
9月	4、7
10月	9、12
11月	10、11、25、26
12月	24、25、28

※2020年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情により突然変更される場合があります。

したがって、お申し込みにあたってはその点についても十分ご注意ください。また、諸事情等による申込不可日の変更は、販売会社に連絡いたしますので、お問い合わせ下さい。

なお、弊社ホームページ (<http://www.nomura-am.co.jp/>) にも掲載いたしております。