

# 野村インデックスファンド・ 外国債券・為替ヘッジ型

## 愛称：Funds-i 外国債券・為替ヘッジ型

### 運用報告書(全体版)

第7期（決算日2020年9月7日）

作成対象期間（2019年9月7日～2020年9月7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	2013年9月12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。）受益証券を主要投資対象とし、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為替ヘッジを行いません。	
主な投資対象	野村インデックス ファンド・外国債券・ 為替ヘッジ型 マザーファンド	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。
主な投資制限	野村インデックス ファンド・外国債券・ 為替ヘッジ型 マザーファンド	外国の公社債を主要投資対象とします。 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。 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、利子・配当等収益等を中心として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、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			
	円	円	円	%		%	%	百万円
3期(2016年9月6日)	11,505	0	0	5.0	117.74	5.7	99.2	832
4期(2017年9月6日)	11,145	0	0	△3.1	114.81	△2.5	84.6	832
5期(2018年9月6日)	10,848	0	0	△2.7	112.61	△1.9	98.7	917
6期(2019年9月6日)	11,694	0	0	7.8	122.22	8.5	99.7	882
7期(2020年9月7日)	11,991	0	0	2.5	126.25	3.3	99.2	1,090

\*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、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 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) 2019年9月6日	円	%		%	%	%
	11,694	—	122.22	—	99.7	—
9月末	11,688	△0.1	122.15	△0.1	99.9	—
10月末	11,538	△1.3	120.64	△1.3	100.9	—
11月末	11,519	△1.5	120.57	△1.3	99.2	—
12月末	11,446	△2.1	119.83	△2.0	99.8	—
2020年1月末	11,648	△0.4	122.04	△0.1	98.9	—
2月末	11,775	0.7	123.40	1.0	98.3	—
3月末	11,946	2.2	125.14	2.4	97.9	—
4月末	11,928	2.0	125.27	2.5	96.8	—
5月末	11,915	1.9	125.19	2.4	100.0	—
6月末	11,996	2.6	126.15	3.2	99.8	—
7月末	12,107	3.5	127.41	4.3	99.0	—
8月末	11,952	2.2	125.83	3.0	99.7	—
(期末) 2020年9月7日	円	%		%	%	%
	11,991	2.5	126.25	3.3	99.2	—

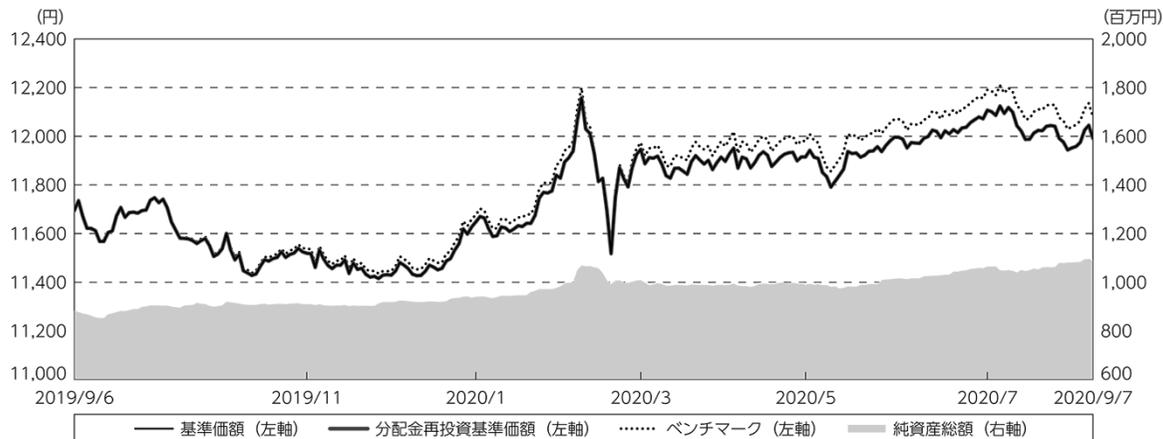
\*騰落率は期首比です。

\*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9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(2019年9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

外国債券利回りが米国を中心に低下(価格は上昇)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、外国債金利回りは米国を中心に低下（価格は上昇）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型]

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+2.5%となり、ベンチマークの+3.3%を0.8ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

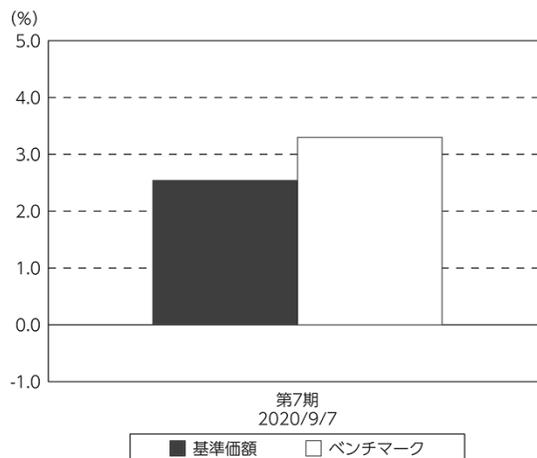
### (マイナス要因)

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見送らせていただきました。  
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7期
	2019年9月7日～ 2020年9月7日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,991

(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

### [野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型]

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

(2019年9月7日～2020年9月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 72	% 0.607	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	(34)	(0.287)	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 )	(34)	(0.287)	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 )	( 4 )	(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) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.000	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	( 0 )	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	2	0.016	(c)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 )	(0.014)	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	74	0.623	
期中の平均基準価額は、11,788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。

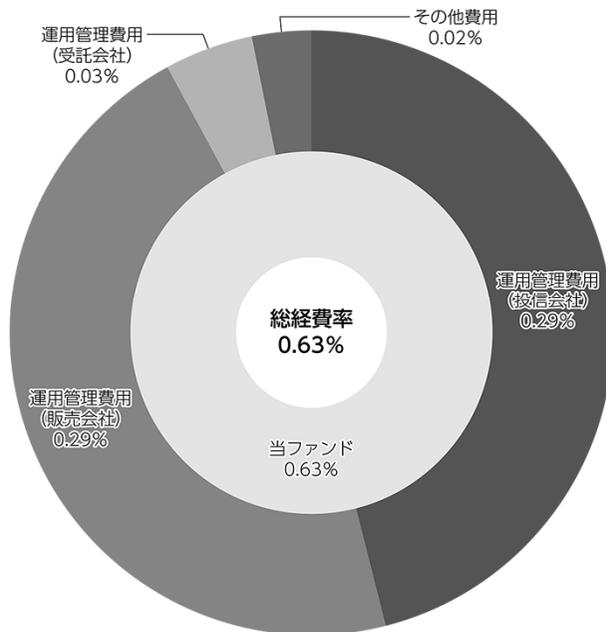
\*売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

\*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0.63%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9月7日～2020年9月7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 325,408	千円 399,948	千口 181,735	千円 222,585

\*単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年9月7日～2020年9月7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

(2020年9月7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 728,486	千口 872,159	千円 1,090,374

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

## ○投資信託財産の構成

(2020年9月7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	千円 1,090,374	% 99.6
コール・ローン等、その他	4,044	0.4
投資信託財産総額	1,094,418	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(70,643,934千円)の投資信託財産総額(71,727,952千円)に対する比率は98.5%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=106.36円、1カナダドル=81.33円、1英ポンド=140.93円、1スウェーデンクローナ=12.18円、1ノルウェークローネ=11.91円、1デンマーククローネ=16.92円、1ユーロ=125.87円、1ズロチ=28.25円、1シンガポールドル=77.92円、1豪ドル=77.50円、1新シェケル=31.57円、1メキシコペソ=4.94円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年9月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,094,418,669
コール・ローン等	3,322,170
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)	1,090,374,018
未収入金	722,481
(B) 負債	3,935,192
未払解約金	811,946
未払信託報酬	3,111,989
未払利息	4
その他未払費用	11,253
(C) 純資産総額(A-B)	1,090,483,477
元本	909,381,999
次期繰越損益金	181,101,478
(D) 受益権総口数	909,381,999口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,991円

(注) 期首元本額は754,971,597円、期中追加設定元本額は527,864,962円、期中一部解約元本額は373,454,560円、1口当たり純資産額は1.1991円です。

## ○損益の状況 (2019年9月7日～2020年9月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,029
支払利息	△ 1,029
(B) 有価証券売買損益	27,079,881
売買益	33,824,439
売買損	△ 6,744,558
(C) 信託報酬等	△ 5,878,415
(D) 当期損益金(A+B+C)	21,200,437
(E) 前期繰越損益金	26,813,543
(F) 追加信託差損益金	133,087,498
(配当等相当額)	( 119,425,964)
(売買損益相当額)	( 13,661,534)
(G) 計(D+E+F)	181,101,478
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	181,101,478
追加信託差損益金	133,087,498
(配当等相当額)	( 120,556,480)
(売買損益相当額)	( 12,531,018)
分配準備積立金	48,013,980

\*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9月7日～2020年9月7日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2019年9月7日～ 2020年9月7日
a. 配当等収益(経費控除後)	15,878,233円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	5,322,204円
c. 信託約款に定める収益調整金	133,087,498円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	26,813,543円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	181,101,478円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,991円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

## ○分配金のお知らせ

---

1万口当たり分配金（税込み）	0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。

# 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

## 運用報告書

第7期（決算日2020年9月7日）

作成対象期間（2019年9月7日～2020年9月7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**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		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
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
7期(2020年9月7日)	12,502	3.2	126.25	3.3	99.2	—	69,653

\*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) 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)	%	%	%
9月末	12,118	—	122.22	—	99.7	—
10月末	12,116	△0.0	122.15	△0.1	99.9	—
11月末	11,967	△1.2	120.64	△1.3	100.9	—
12月末	11,953	△1.4	120.57	△1.3	99.2	—
2020年1月末	11,883	△1.9	119.83	△2.0	99.8	—
2月末	12,100	△0.1	122.04	△0.1	98.9	—
3月末	12,237	1.0	123.40	1.0	98.3	—
4月末	12,422	2.5	125.14	2.4	97.9	—
5月末	12,409	2.4	125.27	2.5	96.9	—
6月末	12,401	2.3	125.19	2.4	100.0	—
7月末	12,492	3.1	126.15	3.2	99.8	—
8月末	12,615	4.1	127.41	4.3	99.1	—
(期末) 2020年9月7日	12,459	2.8	125.83	3.0	99.7	—
	12,502	3.2	126.25	3.3	99.2	—

\*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

外国債券利回りが米国を中心に低下（価格は上昇）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

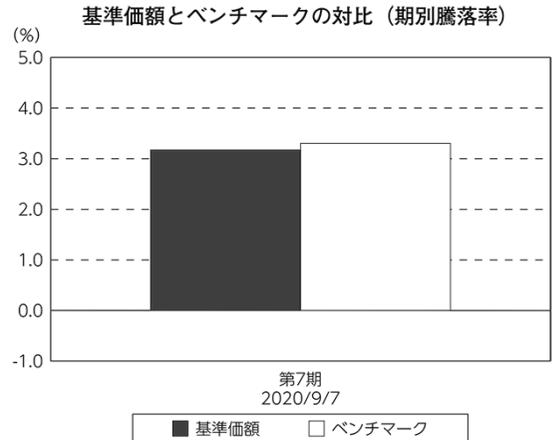
今期の基準価額の騰落率は+3.2%となり、ベンチマークの+3.3%を0.1ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

### (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

(2019年9月7日～2020年9月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 ) ( そ の 他 )	2 (2) (0)	0.014 (0.014) (0.000)	(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 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	2	0.014	
期中の平均基準価額は、12,254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9月7日～2020年9月7日)

## 公社債

		買付額	売付額	
外	アメリカ	千米ドル 107,322	千米ドル 101,588	
	カナダ	千カナダドル 4,402	千カナダドル 2,579	
	イギリス	千英ポンド 9,183	千英ポンド 5,750	
	スウェーデン	千スウェーデンクローナ 774	千スウェーデンクローナ 628	
	ノルウェー	千ノルウェークローネ 5,326	千ノルウェークローネ 1,085	
	デンマーク	千デンマーククローネ 1,512	千デンマーククローネ 1,564	
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	
	ドイツ	国債証券 18,162	7,303	
	イタリア	国債証券 23,353	13,358	
	フランス	国債証券 26,500	20,330	
	オランダ	国債証券 5,431	3,378	
	スペイン	国債証券 13,686	7,119	
	ベルギー	国債証券 6,604	4,378	
	オーストリア	国債証券 1,530	1,473	
	フィンランド	国債証券 269	191	
	アイルランド	国債証券 1,965	—	
	国	ポーランド	千ズロチ 18,355	千ズロチ 18,193
		シンガポール	千シンガポールドル 2,106	千シンガポールドル 405
		オーストラリア	千豪ドル 7,065	千豪ドル 1,433
		イスラエル	千新シェケル 7,353	千新シェケル —
メキシコ		千メキシコペソ 36,981	千メキシコペソ 9,350	
南アフリカ		千ランド 1,403	千ランド 43,676	

\*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。

## 先物取引の種類別取引状況

種類別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国債券先物取引	百万円 6,520	百万円 6,531	百万円 —	百万円 —

\*単位未満は切り捨て。

\*外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年9月7日～2020年9月7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

(2020年9月7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	249,650	280,737	29,859,228	42.9	—	18.8	15.4	8.7
カナダ	千カナダドル 13,430	千カナダドル 16,087	1,308,374	1.9	—	1.1	0.6	0.2
イギリス	千英ポンド 24,400	千英ポンド 33,092	4,663,730	6.7	—	5.3	1.3	0.2
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 15,050	千スウェーデンクローナ 16,874	205,530	0.3	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 11,600	千ノルウェークローネ 12,505	148,939	0.2	—	0.1	0.1	—
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 18,467	312,474	0.4	—	0.4	0.0	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	32,760	40,317	5,074,784	7.3	—	4.4	2.3	0.5
イタリア	50,250	57,508	7,238,537	10.4	—	5.2	3.7	1.5
フランス	44,990	54,381	6,844,959	9.8	—	7.6	1.7	0.5
オランダ	8,240	10,523	1,324,601	1.9	—	1.2	0.6	0.1
スペイン	30,550	36,338	4,573,879	6.6	—	3.8	2.3	0.4
ベルギー	11,880	14,511	1,826,560	2.6	—	2.1	0.4	0.2
オーストリア	5,920	7,353	925,639	1.3	—	1.0	0.2	0.2
フィンランド	2,560	3,002	377,955	0.5	—	0.4	0.1	0.1
アイルランド	6,030	6,569	826,920	1.2	—	0.6	0.3	0.2
ポーランド	千ズロチ 13,000	千ズロチ 13,978	394,884	0.6	—	0.3	—	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 7,570	千シンガポールドル 8,528	664,530	1.0	—	0.6	0.2	0.1
オーストラリア	千豪ドル 19,330	千豪ドル 22,491	1,743,055	2.5	—	1.8	0.5	0.2
イスラエル	千新シェケル 6,200	千新シェケル 7,348	231,997	0.3	—	0.2	0.1	—
メキシコ	千メキシコペソ 102,600	千メキシコペソ 114,602	566,135	0.8	—	0.5	0.2	0.1
合 計	—	—	69,112,720	99.2	—	55.7	30.0	13.6

\*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		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	6.25	70	82	8,771	2023/8/15
		US TREASURY BOND	2.375	500	541	57,642	2024/8/15
		US TREASURY BOND	6.0	610	795	84,594	2026/2/15
		US TREASURY BOND	6.125	1,800	2,518	267,907	2027/11/15
		US TREASURY BOND	5.5	2,280	3,156	335,749	2028/8/15
		US TREASURY BOND	5.25	20	27	2,925	2028/11/15
		US TREASURY BOND	5.25	80	110	11,776	2029/2/15
		US TREASURY BOND	2.875	510	662	70,474	2043/5/15
		US TREASURY BOND	3.75	3,450	5,103	542,758	2043/11/15
		US TREASURY N/B	1.125	3,000	3,028	322,158	2021/8/31
		US TREASURY N/B	2.125	1,500	1,531	162,892	2021/9/30
		US TREASURY N/B	1.125	1,500	1,515	161,203	2021/9/30
		US TREASURY N/B	2.875	2,100	2,162	230,030	2021/10/15
		US TREASURY N/B	2.0	2,600	2,655	282,412	2021/10/31
		US TREASURY N/B	1.25	1,500	1,518	161,559	2021/10/31
		US TREASURY N/B	2.0	1,000	1,021	108,682	2021/11/15
		US TREASURY N/B	2.875	800	825	87,823	2021/11/15
		US TREASURY N/B	1.875	1,500	1,531	162,936	2021/11/30
		US TREASURY N/B	1.75	1,000	1,019	108,470	2021/11/30
		US TREASURY N/B	2.0	3,000	3,072	326,807	2021/12/31
		US TREASURY N/B	2.5	1,000	1,031	109,721	2022/1/15
		US TREASURY N/B	1.375	1,000	1,016	108,167	2022/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	600	615	65,508	2022/2/15
		US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,535	163,279	2022/2/28
		US TREASURY N/B	1.75	1,400	1,434	152,580	2022/3/31
		US TREASURY N/B	1.75	3,000	3,079	327,505	2022/4/30
		US TREASURY N/B	1.875	3,500	3,603	383,311	2022/5/31
		US TREASURY N/B	1.75	3,400	3,494	371,625	2022/5/31
		US TREASURY N/B	2.125	2,700	2,795	297,380	2022/6/30
		US TREASURY N/B	1.75	2,200	2,263	240,792	2022/6/30
		US TREASURY N/B	1.75	2,000	2,058	218,993	2022/7/15
		US TREASURY N/B	2.0	3,000	3,104	330,222	2022/7/31
		US TREASURY N/B	1.875	1,000	1,032	109,816	2022/7/31
		US TREASURY N/B	1.625	2,700	2,776	295,338	2022/8/15
		US TREASURY N/B	1.875	3,100	3,204	340,869	2022/8/31
		US TREASURY N/B	1.625	4,000	4,116	437,837	2022/8/31
		US TREASURY N/B	1.875	700	724	77,075	2022/9/30
		US TREASURY N/B	1.875	1,500	1,555	165,410	2022/10/31
		US TREASURY N/B	2.0	1,000	1,039	110,547	2022/10/31
		US TREASURY N/B	1.625	2,150	2,218	235,989	2022/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,260	2,362	251,246	2022/12/31	
	US TREASURY N/B	1.5	700	722	76,793	2023/1/15	
	US TREASURY N/B	1.75	1,000	1,037	110,381	2023/1/31	
	US TREASURY N/B	2.375	700	736	78,378	2023/1/31	
	US TREASURY N/B	2.0	4,110	4,292	456,571	2023/2/15	

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	2.625	1,000	1,060	112,824	2023/2/28
	US TREASURY N/B	1.5	1,100	1,137	120,962	2023/3/31
	US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,563	166,270	2023/5/15
	US TREASURY N/B	1.625	2,000	2,079	221,145	2023/5/31
	US TREASURY N/B	1.375	2,500	2,583	274,832	2023/6/30
	US TREASURY N/B	1.25	3,500	3,607	383,718	2023/7/31
	US TREASURY N/B	2.5	1,200	1,281	136,277	2023/8/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,000	3,105	330,347	2023/8/31
	US TREASURY N/B	2.75	2,500	2,690	286,133	2023/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	700	731	77,802	2023/10/31
	US TREASURY N/B	2.75	1,000	1,081	114,985	2023/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	3,000	3,186	338,872	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	2,172	231,017	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	2,135	227,128	2023/12/31
	US TREASURY N/B	2.25	500	534	56,852	2024/1/31
	US TREASURY N/B	2.75	400	435	46,279	2024/2/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	2,136	227,228	2024/3/31
	US TREASURY N/B	2.0	500	532	56,620	2024/4/30
	US TREASURY N/B	2.5	1,500	1,625	172,888	2024/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	4,000	4,268	453,990	2024/6/30
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	2,115	224,984	2024/6/30
	US TREASURY N/B	2.125	3,000	3,219	342,387	2024/7/31
	US TREASURY N/B	1.875	2,000	2,129	226,530	2024/8/31
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	2,152	228,890	2024/9/30
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	2,165	230,269	2024/10/31
	US TREASURY N/B	2.25	4,000	4,331	460,671	2024/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	3,000	3,235	344,157	2024/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	800	868	92,320	2024/12/31
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	2,127	226,247	2024/12/31
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	2,153	229,072	2025/2/15
	US TREASURY N/B	2.625	4,500	4,979	529,622	2025/3/31
	US TREASURY N/B	2.875	4,000	4,478	476,293	2025/4/30
	US TREASURY N/B	2.125	800	868	92,340	2025/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	2,242	238,512	2025/5/31
	US TREASURY N/B	2.75	4,000	4,470	475,429	2025/6/30
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	2,250	239,409	2025/7/31
	US TREASURY N/B	2.0	2,780	3,009	320,120	2025/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	600	672	71,493	2025/8/31
	US TREASURY N/B	2.25	1,640	1,801	191,628	2025/11/15
	US TREASURY N/B	2.625	3,000	3,365	357,942	2026/1/31
	US TREASURY N/B	1.625	4,000	4,273	454,489	2026/2/15
	US TREASURY N/B	1.625	4,200	4,494	478,051	2026/5/15
	US TREASURY N/B	1.5	3,800	4,044	430,217	2026/8/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,600	2,850	303,174	2026/11/15
	US TREASURY N/B	2.25	1,500	1,672	177,837	2027/2/15
	US TREASURY N/B	2.375	1,800	2,026	215,513	2027/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	3,200	3,584	381,220	2027/8/15

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	2.25	600	673	71,653	2027/11/15
		US TREASURY N/B	2.75	4,200	4,879	518,988	2028/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	2,500	2,936	312,370	2028/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	3,100	3,653	388,626	2028/8/15
		US TREASURY N/B	3.125	1,000	1,202	127,889	2028/11/15
		US TREASURY N/B	2.625	3,400	3,962	421,489	2029/2/15
		US TREASURY N/B	2.375	500	573	61,028	2029/5/15
		US TREASURY N/B	1.625	2,000	2,170	230,884	2029/8/15
		US TREASURY N/B	1.5	1,500	1,612	171,542	2030/2/15
		US TREASURY N/B	6.25	500	762	81,124	2030/5/15
		US TREASURY N/B	0.625	1,800	1,786	189,997	2030/5/15
		US TREASURY N/B	0.625	1,500	1,486	158,056	2030/8/15
		US TREASURY N/B	5.0	340	549	58,472	2037/5/15
		US TREASURY N/B	4.5	1,760	2,741	291,568	2038/5/15
		US TREASURY N/B	3.5	400	559	59,501	2039/2/15
		US TREASURY N/B	4.25	1,300	1,986	211,301	2039/5/15
		US TREASURY N/B	4.625	1,150	1,844	196,161	2040/2/15
		US TREASURY N/B	3.875	340	501	53,331	2040/8/15
		US TREASURY N/B	4.75	300	492	52,433	2041/2/15
		US TREASURY N/B	3.125	500	672	71,560	2041/11/15
		US TREASURY N/B	2.75	500	637	67,829	2042/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	800	1,079	114,842	2043/2/15
		US TREASURY N/B	3.625	700	1,018	108,380	2044/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	500	665	70,779	2044/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	2,400	2,942	312,997	2045/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,540	3,387	360,318	2045/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	2,760	3,611	384,165	2045/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	3,020	4,040	429,790	2045/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	2,530	3,109	330,771	2046/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	3,400	4,183	444,938	2046/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	3,530	4,151	441,506	2046/8/15
		US TREASURY N/B	2.875	3,600	4,739	504,106	2046/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	1,000	1,349	143,577	2047/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	2,820	3,646	387,830	2047/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	2,600	3,365	358,006	2047/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,100	2,844	302,490	2048/2/15
		US TREASURY N/B	3.125	1,000	1,385	147,408	2048/5/15
		US TREASURY N/B	3.0	400	543	57,836	2048/8/15
		US TREASURY N/B	2.25	600	712	75,736	2049/8/15
小	計					29,859,228	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル			
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	0.5	2,000	2,008	163,388	2022/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.75	1,000	1,037	84,345	2023/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,000	1,033	84,078	2023/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	600	640	52,102	2024/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	1,060	1,146	93,229	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	1,000	1,040	84,642	2025/3/1

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		
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,000	1,063	86,526	2026/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	8.0	330	495	40,298	2027/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0	400	446	36,289	2028/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	5.75	1,020	1,472	119,775	2029/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.25	1,000	1,147	93,296	2029/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	5.75	600	964	78,472	2033/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	5.0	400	656	53,420	2037/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0	780	1,221	99,305	2041/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,040	1,463	119,019	2048/12/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0	200	248	20,184	2051/12/1
小計					1,308,374	
イギリス			千英ポンド	千英ポンド		
国債証券	UK TREASURY	4.0	320	339	47,850	2022/3/7
	UK TREASURY	0.5	400	404	56,980	2022/7/22
	UK TREASURY	1.75	1,500	1,555	219,193	2022/9/7
	UK TREASURY	0.125	400	401	56,620	2023/1/31
	UK TREASURY	0.75	900	922	129,969	2023/7/22
	UK TREASURY	2.25	550	588	82,963	2023/9/7
	UK TREASURY	1.0	500	519	73,270	2024/4/22
	UK TREASURY	2.75	1,200	1,336	188,361	2024/9/7
	UK TREASURY	0.625	900	928	130,900	2025/6/7
	UK TREASURY	1.5	1,370	1,492	210,396	2026/7/22
	UK TREASURY	4.25	300	390	55,068	2027/12/7
	UK TREASURY	1.625	900	1,009	142,299	2028/10/22
	UK TREASURY	6.0	90	132	18,731	2028/12/7
	UK TREASURY	0.875	1,400	1,484	209,278	2029/10/22
	UK TREASURY	4.75	600	873	123,048	2030/12/7
	UK TREASURY	4.25	600	866	122,169	2032/6/7
	UK TREASURY	4.5	200	308	43,414	2034/9/7
	UK TREASURY	4.25	1,160	1,789	252,264	2036/3/7
	UK TREASURY	1.75	670	785	110,739	2037/9/7
	UK TREASURY	4.5	850	1,499	211,262	2042/12/7
	UK TREASURY	3.5	1,000	1,595	224,783	2045/1/22
	UK TREASURY	4.25	2,180	3,951	556,818	2046/12/7
	UK TREASURY	1.5	1,700	1,980	279,111	2047/7/22
	UK TREASURY	1.75	1,650	2,041	287,691	2049/1/22
	UK TREASURY	4.25	1,140	2,161	304,611	2049/12/7
	UK TREASURY	3.75	860	1,576	222,122	2052/7/22
	UK TREASURY	3.5	380	804	113,393	2068/7/22
	UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	100	152	21,439	2044/1/22
	UNITED KINGDOM (GOVERNMENT)	4.25	580	1,198	168,971	2055/12/7
小計					4,663,730	
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	3,500	3,733	45,479	2022/6/1
	SWEDISH GOVERNMENT	1.5	3,000	3,176	38,695	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT	2.5	250	282	3,444	2025/5/12
	SWEDISH GOVERNMENT	1.0	2,700	2,905	35,389	2026/11/12

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
スウェーデン			%	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ	千円	
	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	0.75	4,000	4,275	52,077	2028/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	1,600	2,499	30,445	2039/3/30
小 計						205,530	
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	1,900	1,991	23,717	2023/5/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	2,750	3,014	35,901	2024/3/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	1,700	1,802	21,465	2026/2/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	1,750	1,892	22,545	2027/2/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,500	1,664	19,828	2028/4/26
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.375	2,000	2,139	25,480	2030/8/19
小 計						148,939	
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	1,563	26,460	2021/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.5	1,650	1,763	29,830	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	3,400	3,809	64,460	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	2,300	2,462	41,667	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	1,400	1,511	25,578	2029/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	3,900	7,356	124,477	2039/11/15
小 計						312,474	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESobligation	—	700	705	88,760	2021/10/8
		BUNDESobligation	—	1,000	1,014	127,745	2022/10/7
		BUNDESobligation	—	3,100	3,172	399,269	2023/10/13
		BUNDESobligation	—	1,000	1,026	129,243	2024/4/5
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	850	881	110,914	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	1,300	1,358	171,040	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,310	1,389	174,898	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	700	757	95,285	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	400	494	62,215	2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	610	663	83,475	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	700	758	95,483	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	440	470	59,229	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,000	1,055	132,849	2025/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	2,000	2,172	273,502	2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	900	960	120,867	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	300	312	39,350	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	2,270	2,408	303,168	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	2,300	3,452	434,584	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	850	919	115,773	2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,000	1,086	136,719	2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	400	420	52,890	2029/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,500	1,574	198,207	2030/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	1,100	1,802	226,834	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	700	1,211	152,440	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	500	520	65,534	2035/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	600	1,032	129,957	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	1,310	2,448	308,240	2039/7/4

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	4.75	60	120	15,202	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	750	1,324	166,756	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,300	2,132	268,388	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	610	1,026	129,160	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	1,200	1,642	206,794	2048/8/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	710	744	93,719	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.3	1,000	1,027	129,362	2021/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	1,750	1,761	221,704	2021/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.15	1,000	1,029	129,638	2021/12/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2	700	714	89,885	2022/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	1,030	1,055	132,848	2022/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.0	1,500	1,532	192,875	2022/7/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9	500	509	64,102	2022/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	1,900	1,957	246,392	2022/9/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	200	223	28,147	2022/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.05	500	500	63,010	2023/1/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	3,400	3,481	438,186	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,150	1,285	161,849	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,500	1,608	202,398	2023/10/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	180	230	28,986	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	2,200	2,528	318,257	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	1,500	1,704	214,539	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	700	734	92,417	2024/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,000	1,090	137,210	2024/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	2,000	1,999	251,689	2025/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,350	1,626	204,753	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	500	524	65,993	2025/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	800	840	105,733	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	330	355	44,747	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6	550	581	73,243	2026/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.25	1,100	1,142	143,773	2026/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2	3,200	3,516	442,579	2027/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	400	557	70,190	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	800	869	109,416	2028/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	2,040	2,652	333,884	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	1,000	1,376	173,222	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	400	491	61,817	2030/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	300	309	38,995	2030/4/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	2,500	2,485	312,786	2030/8/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	700	1,041	131,070	2031/5/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	500	526	66,308	2032/3/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,070	1,218	153,347	2033/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,110	1,616	203,454	2034/8/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.25	500	556	69,983	2036/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	1,580	2,137	269,077	2037/2/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	400	486	61,213	2038/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	150	231	29,136	2039/8/1		

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	5.0	300	465	58,650	2040/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	2,480	3,868	486,872	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	860	1,099	138,427	2046/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7	300	350	44,059	2047/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.85	600	850	107,090	2049/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	10	11	1,484	2067/3/1
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	700	706	88,929	2022/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	300	319	40,231	2023/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	800	817	102,901	2024/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	2,010	2,226	280,300	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,000	2,053	258,467	2025/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	400	420	52,960	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	700	740	93,263	2026/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	250	261	32,920	2026/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	800	878	110,621	2027/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	2,300	2,503	315,074	2028/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,000	1,090	137,306	2028/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,000	1,070	134,780	2029/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,500	2,559	322,160	2029/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	1,720	2,182	274,712	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	1,200	1,405	176,967	2034/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	1,850	2,180	274,448	2036/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	960	1,237	155,751	2039/6/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	1,010	1,424	179,242	2048/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.5	700	898	113,074	2050/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,500	1,597	201,042	2052/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.0	1,320	1,398	176,025	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	—	900	909	114,539	2022/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.25	610	647	81,448	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.25	1,800	2,078	261,581	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.75	600	660	83,140	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	6.0	1,100	1,477	185,947	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.0	1,000	1,082	136,235	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	—	4,000	4,113	517,766	2026/2/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.5	910	1,120	140,977	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.75	1,900	2,338	294,397	2027/10/25
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5.5	1,200	1,813	228,233	2029/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.5	640	755	95,086	2031/5/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5.75	300	515	64,916	2032/10/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.75	1,490	2,527	318,168	2035/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	400	676	85,143	2038/10/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.5	720	1,337	168,291	2041/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	1,800	3,026	380,909	2045/5/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	600	1,326	166,991	2060/4/25		
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	—	500	504	63,495	2022/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	630	696	87,664	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	300	358	45,090	2023/1/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	300	321	40,407	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	1,000	1,104	139,027	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	700	730	91,982	2025/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	400	426	53,625	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	600	870	109,620	2028/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	1,000	1,036	130,498	2030/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	1,150	1,553	195,533	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	400	677	85,268	2037/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	610	1,115	140,388	2042/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	650	1,128	142,001	2047/1/15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.05	500	503	63,321	2021/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	1,490	1,622	204,220	2022/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4	300	304	38,299	2022/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.45	1,400	1,427	179,689	2022/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	900	1,026	129,217	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,300	1,314	165,430	2023/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.35	300	306	38,594	2023/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	1,940	2,235	281,323	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	1,920	2,213	278,621	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	1,400	1,579	198,836	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,000	1,011	127,311	2025/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	800	869	109,415	2025/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	500	620	78,080	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	720	805	101,445	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	1,000	1,086	136,791	2026/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5	1,000	1,103	138,859	2027/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	300	330	41,631	2027/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	2,300	2,531	318,596	2028/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,600	1,765	222,195	2028/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	330	464	58,446	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5	800	816	102,799	2030/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,000	1,160	146,088	2030/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.25	600	654	82,432	2030/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	1,500	1,839	231,474	2033/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	1,000	1,727	217,406	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	900	1,701	214,202	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	1,350	1,917	241,299	2046/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	200	276	34,854	2048/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0	600	576	72,577	2050/10/31
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	90	133	16,845	2029/1/31
SPANISH GOVERNMENT	5.75	1,100	1,778	223,857	2032/7/30		
SPANISH GOVERNMENT	4.2	410	633	79,711	2037/1/31		
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.25	340	357	44,993	2021/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	500	536	67,528	2022/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	700	770	96,990	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	200	216	27,232	2023/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.2	600	616	77,561	2023/10/22

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	2.6	230	258	32,528	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.5	300	313	39,517	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	2,100	2,286	287,831	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	950	1,030	129,750	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	300	327	41,259	2028/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.9	800	885	111,398	2029/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,200	1,349	169,863	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	550	813	102,359	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.45	200	242	30,496	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	420	543	68,465	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	300	534	67,277	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	750	1,339	168,579	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	500	643	80,989	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.7	400	532	67,038	2050/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	170	276	34,761	2066/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	370	636	80,136	2035/3/28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	800	856	107,744	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	700	709	89,339	2022/9/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	120	129	16,254	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	300	324	40,838	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	400	427	53,767	2027/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	700	764	96,184	2028/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	700	720	90,751	2030/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	530	714	89,893	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	230	389	49,050	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	400	686	86,459	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	200	267	33,675	2047/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	500	573	72,195	2051/3/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	330	774	97,503	2062/1/26
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	10	15	1,981	2086/11/2
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	—	300	303	38,160	2022/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.625	300	313	39,520	2022/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	150	158	19,951	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.0	200	219	27,609	2024/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	310	328	41,384	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	740	927	116,777	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	200	234	29,509	2034/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	160	249	31,463	2042/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	1.375	200	266	33,578	2047/4/15
		アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	0.9	800	875
IRISH TSY 0.2% 2030	0.2			800	826	104,056	2030/10/18
IRISH TSY 0.8% 2022	0.8			1,300	1,327	167,107	2022/3/15
IRISH TSY 1% 2026	1.0			650	704	88,735	2026/5/15
IRISH TSY 1.5% 2050	1.5			100	127	16,079	2050/5/15
IRISH TSY 1.7% 2037	1.7			550	687	86,567	2037/5/15
IRISH TSY 2% 2045	2.0			250	346	43,598	2045/2/18
IRISH TSY 2022	—			1,000	1,012	127,467	2022/10/18

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	
アイルランド	国債証券	IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	500	571	71,881	2024/3/18
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	80	89	11,233	2023/3/20
小 計						29,013,839	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	6,000	6,216	175,629	2022/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	7,000	7,761	219,255	2028/4/25
小 計						394,884	
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	1,041	81,148	2021/10/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	1,400	1,495	116,505	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	400	436	33,977	2025/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	700	761	59,332	2026/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	730	860	67,063	2027/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	300	340	26,562	2028/5/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	400	467	36,450	2029/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	1,210	1,432	111,653	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	700	805	62,726	2036/8/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	200	234	18,265	2039/7/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	500	652	50,842	2046/3/1		
小 計						664,530	
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	1,227	95,168	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	120	132	10,240	2022/7/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	1,200	1,251	97,022	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	800	909	70,471	2023/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,000	1,088	84,370	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,340	1,515	117,471	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	520	628	48,685	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	820	1,040	80,666	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	900	1,031	79,947	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	2,820	3,135	242,983	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,700	1,966	152,387	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,000	1,202	93,199	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	800	931	72,192	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5	1,600	1,839	142,525	2030/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	1,170	1,648	127,739	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	300	362	28,100	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	150	203	15,806	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,020	1,308	101,444	2039/6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	600	723	56,100	2041/5/21		
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	270	342	26,528	2047/3/21		
小 計						1,743,055	
イスラエル				千新シェケル	千新シェケル		
	国債証券	ISRAEL FIXED BOND	1.5	1,500	1,561	49,309	2023/11/30
		ISRAEL FIXED BOND	3.75	1,500	1,685	53,215	2024/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	2.0	1,000	1,098	34,664	2027/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	1.0	1,000	1,028	32,474	2030/3/31

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		
イスラエル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND	5.5	700	1,242	39,212	2042/1/31
		ISRAEL FIXED BOND	3.75	500	732	23,119	2047/3/31
小 計						231,997	
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ			
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.25	2,800	2,893	14,294	2021/12/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	15,000	15,499	76,569	2022/6/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	11,000	13,126	64,845	2024/12/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	14,000	14,387	71,072	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	20,100	22,385	110,585	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	10,000	11,371	56,173	2031/5/29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	3,100	3,510	17,341	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	6,000	8,077	39,904	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	7,000	8,310	41,051	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	4,300	4,813	23,778	2047/11/7
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	9,300	10,226	50,517	2023/12/7
小 計						566,135	
合 計						69,112,720	

\*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

(2020年9月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 69,112,720	% 96.4
コール・ローン等、その他	2,615,232	3.6
投資信託財産総額	71,727,952	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（70,643,934千円）の投資信託財産総額（71,727,952千円）に対する比率は98.5%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=106.36円、1カナダドル=81.33円、1英ポンド=140.93円、1スウェーデンクローナ=12.18円、1ノルウェークローネ=11.91円、1デンマーククローネ=16.92円、1ユーロ=125.87円、1ズロチ=28.25円、1シンガポールドル=77.92円、1豪ドル=77.50円、1新シェケル=31.57円、1メキシコペソ=4.94円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年9月7日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	142,407,632,160	
コール・ローン等	744,369,051	
公社債(評価額)	69,112,720,074	
未収入金	72,153,013,662	
未収利息	374,040,947	
前払費用	19,597,490	
差入委託証拠金	3,890,936	
(B) 負債	72,754,530,769	
未払金	71,548,993,211	
未払解約金	1,204,521,103	
未払利息	855	
その他未払費用	1,015,600	
(C) 純資産総額(A-B)	69,653,101,391	
元本	55,714,203,773	
次期繰越損益金	13,938,897,618	
(D) 受益権総口数	55,714,203,773口	
1万口当たり基準価額(C/D)	12,502円	

(注) 期首元本額は48,914,123,681円、期中追加設定元本額は19,211,104,913円、期中一部解約元本額は12,411,024,821円、1口当たり純資産額は1.2502円です。

○損益の状況 (2019年9月7日～2020年9月7日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	1,379,521,875	
受取利息	1,379,619,863	
その他収益金	135,946	
支払利息	△ 233,934	
(B) 有価証券売買損益	779,814,174	
売買益	9,201,395,089	
売買損	△ 8,421,580,915	
(C) 先物取引等取引損益	12,163,625	
取引益	20,536,453	
取引損	△ 8,372,828	
(D) 保管費用等	△ 9,214,186	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	2,162,285,488	
(F) 前期繰越損益金	10,361,440,091	
(G) 追加信託差損益金	4,231,411,202	
(H) 解約差損益金	△ 2,816,239,163	
(I) 計(E+F+G+H)	13,938,897,618	
次期繰越損益金(I)	13,938,897,618	

\* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引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(G)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(H)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	円
	元本額	
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)	28,682,992,731	
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)	7,848,253,832	
野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	6,560,772,015	
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信(適格機関投資家専用)	6,047,758,615	
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	4,101,982,437	
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	1,360,054,096	
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	872,159,669	
野村国内外マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用)	131,720,238	
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)	35,551,865	
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	22,353,287	
インデックス・ブレンド(タイプⅢ)	14,859,101	
インデックス・ブレンド(タイプⅠ)	12,034,458	
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	6,161,690	
インデックス・ブレンド(タイプⅡ)	6,003,178	
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	3,654,082	
インデックス・ブレンド(タイプⅤ)	3,006,369	
インデックス・ブレンド(タイプⅣ)	2,888,348	
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	1,997,762	

○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よろしくお願いいたします。

(2020年9月7日現在)

年 月	日
2020年9月	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、諸事情等により突然変更される場合があります。

したがって、お申し込みにあたってはその点についても十分ご注意ください。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。