

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)

運用報告書(全体版)

第2期(決算日2018年2月19日) 第3期(決算日2018年3月19日) 第4期(決算日2018年4月17日)
第5期(決算日2018年5月17日) 第6期(決算日2018年6月18日) 第7期(決算日2018年7月17日)

作成対象期間(2018年1月18日～2018年7月17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	2017年12月15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 (野村投資一任口座向け)	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 (野村投資一任口座向け)	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等に関し、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。
	マザーファンド	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・配当等収益等の水準及び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 (分配落)	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 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		税 分	込 配	み 金	期 騰 落	中 率			
(設定日)	円			円		%			百万円
2017年12月15日	10,000			—		—	—	—	1
1期(2018年1月17日)	9,893			0	△1.1	99.02	97.7	—	1,144
2期(2018年2月19日)	9,788			0	△1.1	98.01	95.6	—	7,062
3期(2018年3月19日)	9,846			3	0.6	98.67	97.7	—	9,998
4期(2018年4月17日)	9,865			3	0.2	98.94	98.9	—	12,384
5期(2018年5月17日)	9,755			3	△1.1	97.88	97.7	—	14,421
6期(2018年6月18日)	9,806			3	0.6	98.43	99.1	—	17,568
7期(2018年7月17日)	9,841			3	0.4	98.85	100.3	—	21,080

* 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。
※名称変更しております（旧名称はシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース））。
（出所） FTSE Fixed Income LLC

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	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 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
			騰 落 率		騰 落 率		
第 2 期	(期 首) 2018年 1 月 17 日	円 9,893	% －	99.02	% －	% 97.7	% －
	1 月末	9,827	△0.7	98.39	△0.6	96.0	－
	(期 末) 2018年 2 月 19 日	9,788	△1.1	98.01	△1.0	95.6	－
第 3 期	(期 首) 2018年 2 月 19 日	9,788	－	98.01	－	95.6	－
	2 月末	9,787	△0.0	98.04	0.0	95.6	－
	(期 末) 2018年 3 月 19 日	9,849	0.6	98.67	0.7	97.7	－
第 4 期	(期 首) 2018年 3 月 19 日	9,846	－	98.67	－	97.7	－
	3 月末	9,914	0.7	99.39	0.7	97.9	－
	(期 末) 2018年 4 月 17 日	9,868	0.2	98.94	0.3	98.9	－
第 5 期	(期 首) 2018年 4 月 17 日	9,865	－	98.94	－	98.9	－
	4 月末	9,816	△0.5	98.45	△0.5	99.3	－
	(期 末) 2018年 5 月 17 日	9,758	△1.1	97.88	△1.1	97.7	－
第 6 期	(期 首) 2018年 5 月 17 日	9,755	－	97.88	－	97.7	－
	5 月末	9,801	0.5	98.37	0.5	95.9	－
	(期 末) 2018年 6 月 18 日	9,809	0.6	98.43	0.6	99.1	－
第 7 期	(期 首) 2018年 6 月 18 日	9,806	－	98.43	－	99.1	－
	6 月末	9,829	0.2	98.69	0.3	98.5	－
	(期 末) 2018年 7 月 17 日	9,844	0.4	98.85	0.4	100.3	－

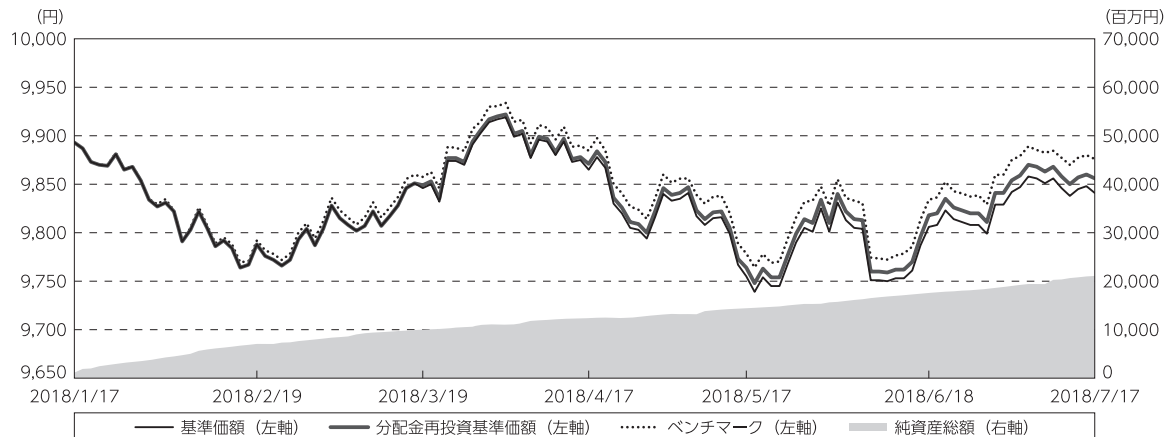
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 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

○作成期間中の基準価額等の推移



第2期首：9,893円

第7期末：9,841円（既払分配金（税込み）：15円）

騰落率：△ 0.4%（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1月17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1月17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、第2期首9,893円から第7期末9,841円（分配落ち後）となりました。この間、分配金として1万口当たり合計15円の分配金をお支払いしましたので、分配金を考慮した値下がり額は37円となりました。

外国債券のリターンは利金収入などからプラスとなったものの、対円で為替ヘッジを行なったことによるコストなどがマイナスに影響したため、基準価額は下落しました。

○投資環境

当運用期間では、米国における継続的な政策金利の引き上げ、イタリアにおける政局不安定化や将来の財政悪化懸念などを背景に、外国債券利回りは米国やユーロ周縁国を中心に上昇（価格は下落）しましたが、利金収入などから債券リターンはプラスとなりました。

○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（野村投資一任口座向け）】

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。当運用期間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。債券組入比率は当運用期間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

当運用期間の基準価額の騰落率※は－0.4％となり、ベンチマークの－0.2％を0.2ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

※基準価額の騰落率は、分配金（税込み）を再投資して算出しております。

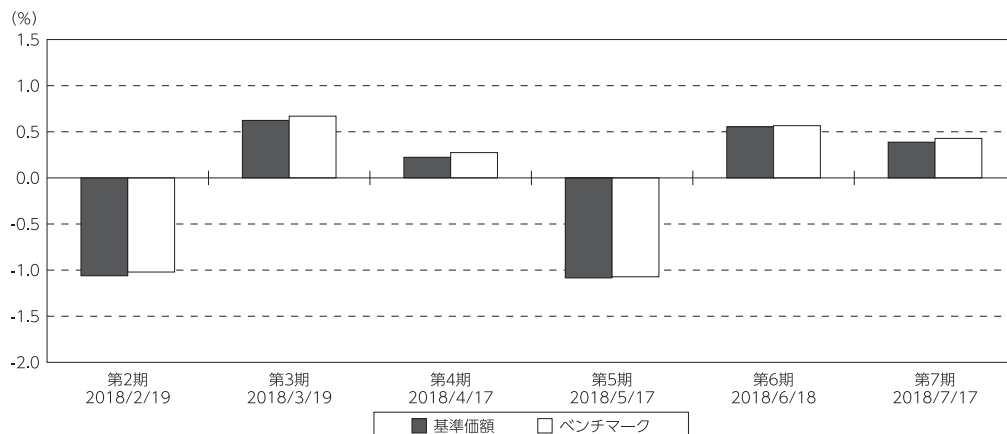
（マイナス要因）

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、利子・配当等収益等の水準及び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2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期
	2018年1月18日～ 2018年2月19日	2018年2月20日～ 2018年3月19日	2018年3月20日～ 2018年4月17日	2018年4月18日～ 2018年5月17日	2018年5月18日～ 2018年6月18日	2018年6月19日～ 2018年7月17日
当期分配金	—	3	3	3	3	3
（対基準価額比率）	—%	0.030%	0.030%	0.031%	0.031%	0.030%
当期の収益	—	3	3	3	3	3
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	20	34	48	60	77	89

（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四捨五入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（野村投資一任口座向け）〕

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 1 月18日～2018年 7 月17日)

項 目	第 2 期～第 7 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 16	% 0.161	(a)信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(12)	(0.118)	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)	(3)	(0.027)	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)	(2)	(0.016)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	1	0.014	(b)その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.013)	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)	(0.001)	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	17	0.175	
作成期間の平均基準価額は、9,829円です。			

* 作成期間の費用（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）を作成期間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 1 月18日～2018年 7 月17日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第 2 期～第 7 期			
	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 17,820,534	千円 19,945,137	千口 68,762	千円 77,031

* 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2018年1月18日～2018年7月17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1月18日～2018年7月17日)

第2期首残高 (元本)	設定元本	解約元本	第7期末残高 (元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 －	百万円 0	百万円 0	当初設定時における取得とその処分

○組入資産の明細

(2018年7月17日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第1期末	第7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 1,016,292	千口 18,768,064	千円 21,078,413

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2018年7月17日現在)

項 目	第7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 21,078,413	% 99.9
コール・ローン等、その他	24,534	0.1
投資信託財産総額	21,102,947	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、第7期末における外貨建て純資産（43,770,267千円）の投資信託財産総額（44,577,122千円）に対する比率は98.2%です。

*外貨建て資産は、第7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＝112.44円、1カナダドル＝85.60円、1英ポンド＝148.81円、1スイスフラン＝112.78円、1スウェーデンクローナ＝12.76円、1ノルウェークローネ＝13.90円、1デンマーククローネ＝17.66円、1ユーロ＝131.68円、1ズロチ＝30.59円、1シンガポールドル＝82.54円、1豪ドル＝83.35円、1メキシコペソ＝5.97円、1ランド＝8.51円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第 2 期末	第 3 期末	第 4 期末	第 5 期末	第 6 期末	第 7 期末
	2018年 2月19日現在	2018年 3月19日現在	2018年 4月17日現在	2018年 5月17日現在	2018年 6月18日現在	2018年 7月17日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	7,071,813,688	10,003,791,328	12,401,416,420	14,434,888,287	17,596,613,394	21,102,947,851
コール・ローン等	10,171,325	3,136,096	13,975,404	10,791,869	24,988,245	18,107,761
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)	7,061,642,363	9,997,608,593	12,382,419,065	14,419,661,322	17,566,250,545	21,078,413,759
未収入金	—	3,046,639	5,021,951	4,435,096	5,374,604	6,426,331
(B) 負債	9,467,869	5,184,184	16,502,869	13,783,979	28,612,676	22,429,819
未払収益分配金	—	3,046,639	3,766,463	4,435,096	5,374,604	6,426,331
未払解約金	8,170,962	—	9,838,527	5,823,584	18,710,761	11,032,799
未払信託報酬	1,288,317	2,123,394	2,878,676	3,501,943	4,497,295	4,937,746
未払利息	12	5	23	18	44	36
その他未払費用	8,578	14,146	19,180	23,338	29,972	32,907
(C) 純資産総額(A－B)	7,062,345,819	9,998,607,144	12,384,913,551	14,421,104,308	17,568,000,718	21,080,518,032
元本	7,215,544,453	10,155,464,368	12,554,877,065	14,783,654,535	17,915,347,517	21,421,104,037
次期繰越損益金	△ 153,198,634	△ 156,857,224	△ 169,963,514	△ 362,550,227	△ 347,346,799	△ 340,586,005
(D) 受益権総口数	7,215,544,453口	10,155,464,368口	12,554,877,065口	14,783,654,535口	17,915,347,517口	21,421,104,037口
1万口当たり基準価額(C／D)	9,788円	9,846円	9,865円	9,755円	9,806円	9,841円

(注) 第2期首元本額は1,156,402,488円、第2～7期中追加設定元本額は21,055,523,631円、第2～7期中一部解約元本額は790,822,082円、1口当たり純資産額は、第2期0.9788円、第3期0.9846円、第4期0.9865円、第5期0.9755円、第6期0.9806円、第7期0.9841円です。

○損益の状況

項 目	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期
	2018年1月18日～ 2018年2月19日	2018年2月20日～ 2018年3月19日	2018年3月20日～ 2018年4月17日	2018年4月18日～ 2018年5月17日	2018年5月18日～ 2018年6月18日	2018年6月19日～ 2018年7月17日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 130	△ 219	△ 392	△ 1,011	△ 1,370	△ 1,385
支払利息	△ 130	△ 219	△ 392	△ 1,011	△ 1,370	△ 1,385
(B) 有価証券売買損益	△ 40,065,879	59,387,900	20,703,600	△142,229,733	92,970,429	75,594,940
売買益	210,401	59,748,440	22,036,117	856,818	94,292,866	78,832,282
売買損	△ 40,276,280	△ 360,540	△ 1,332,517	△143,086,551	△ 1,322,437	△ 3,237,342
(C) 信託報酬等	△ 1,296,895	△ 2,137,540	△ 2,897,856	△ 3,525,281	△ 4,527,267	△ 4,970,653
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 41,362,904	57,250,141	17,805,352	△145,756,025	88,441,792	70,622,902
(E) 前期繰越損益金	363,765	△ 40,855,366	13,301,261	27,043,770	△121,507,261	△ 37,910,597
(F) 追加信託差損益金	△112,199,495	△170,205,360	△197,303,664	△239,402,876	△308,906,726	△366,871,979
(配当等相当額)	(1,773,927)	(14,704,459)	(28,993,655)	(45,233,164)	(68,450,608)	(101,898,015)
(売買損益相当額)	(△113,973,422)	(△184,909,819)	(△226,297,319)	(△284,636,040)	(△377,357,334)	(△468,769,994)
(G) 計 (D + E + F)	△153,198,634	△153,810,585	△166,197,051	△358,115,131	△341,972,195	△334,159,674
(H) 収益分配金	0	△ 3,046,639	△ 3,766,463	△ 4,435,096	△ 5,374,604	△ 6,426,331
次期繰越損益金 (G + H)	△153,198,634	△156,857,224	△169,963,514	△362,550,227	△347,346,799	△340,586,005
追加信託差損益金	△112,199,495	△170,205,360	△197,303,664	△239,402,876	△308,906,726	△366,871,979
(配当等相当額)	(8,698,009)	(20,671,221)	(33,824,053)	(48,844,643)	(74,128,562)	(107,241,678)
(売買損益相当額)	(△120,897,504)	(△190,876,581)	(△231,127,717)	(△288,247,519)	(△383,035,288)	(△474,113,657)
分配準備積立金	5,992,528	14,284,034	27,340,150	41,241,518	64,149,271	85,484,563
繰越損益金	△ 46,991,667	△ 935,898	—	△164,388,869	△102,589,344	△ 59,198,589

* 損益の状況の中で (B) 有価証券売買損益は各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1月18日～2018年7月17日) は以下の通りです。

項 目	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期
	2018年1月18日～ 2018年2月19日	2018年2月20日～ 2018年3月19日	2018年3月20日～ 2018年4月17日	2018年4月18日～ 2018年5月17日	2018年5月18日～ 2018年6月18日	2018年6月19日～ 2018年7月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	5,628,763円	11,351,583円	15,194,086円	18,632,844円	28,676,900円	28,349,400円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円	0円	1,679,476円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	8,698,009円	20,671,221円	33,824,053円	48,844,643円	74,128,562円	107,241,678円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	363,765円	5,979,090円	14,233,051円	27,043,770円	40,846,975円	63,561,494円
e. 分配対象収益 (a+b+c+d)	14,690,537円	38,001,894円	64,930,666円	94,521,257円	143,652,437円	199,152,572円
f. 分配対象収益 (1万口当たり)	20円	37円	51円	63円	80円	92円
g. 分配金	0円	3,046,639円	3,766,463円	4,435,096円	5,374,604円	6,426,331円
h. 分配金 (1万口当たり)	0円	3円	3円	3円	3円	3円

○分配金のお知らせ

	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期
1 万口当たり分配金（税込み）	0円	3円	3円	3円	3円	3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

投資信託約款に記載されているインデックスの名称を「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）」から「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）」に変更する所要の約款変更を行いました。 ＜変更適用日：2018年4月13日＞

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2018年7月17日現在）

<外国債券為替ヘッジ型マザーファンド>

下記は、外国債券為替ヘッジ型マザーファンド全体(38,643,420千口)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	第7期末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千米ドル 172,290	千米ドル 170,967	千円 19,223,620	% 44.3	% —	% 17.8	% 19.4	% 7.1
カナダ	千カナダドル 9,480	千カナダドル 9,993	855,463	2.0	—	0.9	0.6	0.5
イギリス	千英ポンド 16,910	千英ポンド 20,779	3,092,259	7.1	—	5.4	1.6	0.1
スイス	千スイスフラン 380	千スイスフラン 450	50,800	0.1	—	0.0	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 9,550	千スウェーデンクローナ 10,912	139,241	0.3	—	0.2	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 5,750	千ノルウェークローネ 5,945	82,638	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 10,750	千デンマーククローネ 13,424	237,080	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	19,730	22,441	2,955,077	6.8	—	4.1	2.1	0.7
イタリア	30,750	31,152	4,102,148	9.5	—	4.8	3.4	1.2
フランス	30,720	34,714	4,571,253	10.5	—	6.2	3.4	0.9
オランダ	5,790	6,634	873,587	2.0	—	1.2	0.7	0.2
スペイン	18,670	20,788	2,737,459	6.3	—	4.0	1.8	0.5
ベルギー	7,280	8,261	1,087,900	2.5	—	1.8	0.5	0.2
オーストリア	4,420	5,074	668,216	1.5	—	1.1	0.2	0.3
フィンランド	2,400	2,546	335,344	0.8	—	0.4	0.4	0.0
アイルランド	3,530	3,854	507,581	1.2	—	0.7	0.3	0.2
ポーランド	千ズロチ 8,870	千ズロチ 8,897	272,167	0.6	—	0.3	0.3	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 3,920	千シンガポールドル 3,966	327,395	0.8	—	0.4	0.3	—
オーストラリア	千豪ドル 9,900	千豪ドル 10,346	862,395	2.0	—	1.2	0.6	0.1
メキシコ	千メキシコペソ 56,900	千メキシコペソ 55,767	332,933	0.8	—	0.6	0.1	0.1
南アフリカ	千ランド 28,200	千ランド 26,420	224,842	0.5	—	0.5	0.0	—
合 計	—	—	43,539,407	100.3	—	52.1	36.2	12.1

* 邦貨換算金額は、第7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			第7期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY BOND	6.25	70	81	9,170	2023/8/15
		US TREASURY BOND	6.0	210	255	28,703	2026/2/15
		US TREASURY BOND	6.5	2,680	3,406	383,006	2026/11/15
		US TREASURY BOND	5.5	280	344	38,694	2028/8/15
		US TREASURY BOND	5.25	20	24	2,724	2028/11/15
		US TREASURY BOND	5.25	80	97	10,934	2029/2/15
		US TREASURY BOND	2.875	910	896	100,761	2043/5/15
		US TREASURY BOND	3.75	3,450	3,930	441,953	2043/11/15
		US TREASURY N/B	1.625	3,660	3,634	408,636	2019/6/30
		US TREASURY N/B	0.875	200	196	22,135	2019/7/31
		US TREASURY N/B	3.625	970	982	110,442	2019/8/15
		US TREASURY N/B	0.75	3,600	3,536	397,589	2019/8/15
		US TREASURY N/B	1.25	4,400	4,341	488,203	2019/8/31
		US TREASURY N/B	3.375	430	434	48,881	2019/11/15
		US TREASURY N/B	1.0	3,520	3,448	387,702	2019/11/30
		US TREASURY N/B	1.375	1,500	1,474	165,754	2020/1/15
		US TREASURY N/B	3.625	2,140	2,174	244,522	2020/2/15
		US TREASURY N/B	1.375	1,500	1,472	165,543	2020/2/15
		US TREASURY N/B	1.125	1,130	1,101	123,811	2020/4/30
		US TREASURY N/B	1.375	1,200	1,174	132,060	2020/4/30
		US TREASURY N/B	3.5	1,380	1,401	157,634	2020/5/15
		US TREASURY N/B	1.5	1,150	1,126	126,679	2020/5/31
		US TREASURY N/B	1.625	1,050	1,030	115,866	2020/6/30
		US TREASURY N/B	1.5	3,600	3,518	395,628	2020/8/15
		US TREASURY N/B	2.125	2,800	2,770	311,560	2020/8/31
		US TREASURY N/B	1.375	4,000	3,895	437,971	2020/9/15
		US TREASURY N/B	1.375	3,400	3,304	371,573	2020/10/31
		US TREASURY N/B	2.375	3,400	3,378	379,846	2020/12/31
		US TREASURY N/B	3.625	3,700	3,788	425,941	2021/2/15
		US TREASURY N/B	2.0	3,580	3,520	395,868	2021/2/28
		US TREASURY N/B	2.375	4,000	3,969	446,298	2021/4/15
		US TREASURY N/B	1.375	3,700	3,572	401,694	2021/4/30
		US TREASURY N/B	2.0	3,000	2,944	331,113	2021/5/31
		US TREASURY N/B	2.125	3,500	3,445	387,452	2021/6/30
		US TREASURY N/B	2.125	3,650	3,589	403,640	2021/8/15
		US TREASURY N/B	2.0	200	195	21,949	2022/2/15
		US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,450	163,112	2022/2/28
		US TREASURY N/B	1.75	200	193	21,727	2022/3/31
		US TREASURY N/B	1.75	2,400	2,314	260,221	2022/5/31
		US TREASURY N/B	2.125	2,700	2,639	296,780	2022/6/30
		US TREASURY N/B	1.75	1,200	1,156	130,015	2022/6/30
		US TREASURY N/B	1.625	3,300	3,160	355,369	2022/8/15
		US TREASURY N/B	1.875	3,100	2,997	336,990	2022/8/31
		US TREASURY N/B	1.875	700	676	76,027	2022/9/30
		US TREASURY N/B	1.875	500	482	54,274	2022/10/31
		US TREASURY N/B	1.625	2,150	2,052	230,829	2022/11/15

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）

銘 柄			第 7 期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	2. 125	2, 260	2, 201	247, 543	2022/12/31
		US TREASURY N/B	2. 0	3, 110	3, 011	338, 596	2023/ 2 /15
		US TREASURY N/B	2. 625	1, 000	995	111, 886	2023/ 2 /28
		US TREASURY N/B	1. 5	2, 200	2, 079	233, 840	2023/ 3 /31
		US TREASURY N/B	1. 625	6, 500	6, 166	693, 403	2023/ 5 /31
		US TREASURY N/B	1. 375	1, 500	1, 404	157, 907	2023/ 6 /30
		US TREASURY N/B	2. 5	4, 700	4, 641	521, 944	2023/ 8 /15
		US TREASURY N/B	1. 625	700	660	74, 274	2023/10/31
		US TREASURY N/B	2. 75	3, 400	3, 392	381, 489	2024/ 2 /15
		US TREASURY N/B	2. 0	3, 500	3, 350	376, 753	2024/ 4 /30
		US TREASURY N/B	2. 25	400	386	43, 496	2024/11/15
		US TREASURY N/B	2. 0	1, 000	950	106, 897	2025/ 2 /15
		US TREASURY N/B	2. 0	3, 280	3, 106	349, 296	2025/ 8 /15
		US TREASURY N/B	2. 25	3, 340	3, 211	361, 114	2025/11/15
		US TREASURY N/B	1. 625	3, 400	3, 119	350, 786	2026/ 2 /15
		US TREASURY N/B	1. 625	3, 400	3, 110	349, 741	2026/ 5 /15
		US TREASURY N/B	1. 5	1, 500	1, 354	152, 294	2026/ 8 /15
		US TREASURY N/B	2. 0	3, 000	2, 810	316, 053	2026/11/15
		US TREASURY N/B	2. 25	3, 800	3, 615	406, 542	2027/ 8 /15
		US TREASURY N/B	2. 75	1, 500	1, 485	167, 078	2028/ 2 /15
		US TREASURY N/B	5. 0	1, 840	2, 402	270, 104	2037/ 5 /15
		US TREASURY N/B	4. 5	1, 560	1, 935	217, 668	2038/ 5 /15
		US TREASURY N/B	4. 25	800	965	108, 567	2039/ 5 /15
		US TREASURY N/B	4. 625	1, 450	1, 841	207, 109	2040/ 2 /15
		US TREASURY N/B	3. 875	1, 640	1, 889	212, 436	2040/ 8 /15
		US TREASURY N/B	2. 5	700	640	71, 974	2045/ 2 /15
		US TREASURY N/B	3. 0	2, 540	2, 558	287, 627	2045/ 5 /15
		US TREASURY N/B	2. 875	2, 560	2, 516	282, 899	2045/ 8 /15
		US TREASURY N/B	3. 0	2, 620	2, 636	296, 457	2045/11/15
		US TREASURY N/B	2. 5	630	574	64, 611	2046/ 2 /15
US TREASURY N/B	2. 5	200	182	20, 499	2046/ 5 /15		
US TREASURY N/B	2. 25	930	803	90, 313	2046/ 8 /15		
US TREASURY N/B	2. 875	1, 900	1, 866	209, 830	2046/11/15		
US TREASURY N/B	2. 75	2, 620	2, 508	282, 095	2047/ 8 /15		
US TREASURY N/B	3. 0	1, 000	1, 006	113, 177	2048/ 2 /15		
小 計						19, 223, 620	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	0. 75	980	969	82, 995	2019/ 8 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1. 5	1, 400	1, 390	119, 051	2020/ 3 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0. 75	1, 070	1, 036	88, 714	2021/ 3 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0. 5	1, 300	1, 231	105, 404	2022/ 3 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1. 5	800	778	66, 675	2023/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	2. 5	760	776	66, 495	2024/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	8. 0	330	485	41, 594	2027/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1. 0	400	363	31, 129	2027/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	2. 0	500	493	42, 267	2028/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	5. 75	120	161	13, 827	2029/ 6 / 1

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）

銘 柄			第7期末						
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日		
					外貨建金額	邦貨換算金額			
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円			
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	5.75	200	290	24,846	2033/6/1		
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	200	286	24,492	2037/6/1		
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	680	897	76,859	2041/6/1		
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	740	830	71,109	2048/12/1		
小 計						855,463			
イギリス				千英ポンド	千英ポンド				
	国債証券	UK TREASURY	1.75	300	303	45,100	2019/7/22		
		UK TREASURY	3.75	60	62	9,238	2019/9/7		
		UK TREASURY	2.0	1,480	1,516	225,707	2020/7/22		
		UK TREASURY	1.5	1,000	1,017	151,448	2021/1/22		
		UK TREASURY	4.0	1,220	1,358	202,092	2022/3/7		
		UK TREASURY	1.75	700	723	107,651	2022/9/7		
		UK TREASURY	0.75	600	591	88,010	2023/7/22		
		UK TREASURY	2.25	250	265	39,473	2023/9/7		
		UK TREASURY	2.75	1,000	1,097	163,289	2024/9/7		
		UK TREASURY	1.5	1,370	1,396	207,806	2026/7/22		
		UK TREASURY	1.625	700	712	105,979	2028/10/22		
		UK TREASURY	6.0	90	130	19,380	2028/12/7		
		UK TREASURY	4.75	400	546	81,333	2030/12/7		
		UK TREASURY	4.25	1,060	1,477	219,792	2036/3/7		
		UK TREASURY	1.75	650	652	97,142	2037/9/7		
		UK TREASURY	4.5	1,250	1,931	287,352	2042/12/7		
		UK TREASURY	4.25	1,580	2,458	365,775	2046/12/7		
		UK TREASURY	1.5	900	850	126,495	2047/7/22		
		UK TREASURY	4.25	840	1,353	201,438	2049/12/7		
		UK TREASURY	3.75	900	1,380	205,406	2052/7/22		
		UK TREASURY	3.5	130	215	32,014	2068/7/22		
		UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	4.25	430	741	110,328	2055/12/7		
		小 計						3,092,259	
		スイス				千スイスフラン	千スイスフラン		
	国債証券	SWITZERLAND GOVERNMENT	2.0	180	193	21,845	2021/4/28		
		SWITZERLAND GOVERNMENT	4.0	120	144	16,330	2023/2/11		
		SWITZERLAND GOVERNMENT	4.0	80	111	12,624	2028/4/8		
小 計						50,800			
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	680	8,678	2020/12/1		
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	3,500	4,019	51,285	2022/6/1		
		SWEDISH GOVERNMENT	1.5	1,100	1,194	15,241	2023/11/13		
		SWEDISH GOVERNMENT	2.5	250	290	3,708	2025/5/12		
		SWEDISH GOVERNMENT	1.0	2,000	2,117	27,017	2026/11/12		
		SWEDISH GOVERNMENT	0.75	1,000	1,028	13,117	2028/5/12		
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	1,100	1,582	20,193	2039/3/30		
小 計						139,241			
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	1,127	15,677	2021/5/25		
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,900	1,959	27,233	2023/5/24		
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	750	814	11,321	2024/3/14		

野村外国債券インデックス Aコース（野村投資－任口座向け）

銘 柄			第7期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ノルウェー			%	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ	千円	
	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	1,700	1,691	23,507	2026/2/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	350	352	4,898	2027/2/17
小 計						82,638	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	4.0	450	477	8,441	2019/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.25	1,550	1,579	27,895	2020/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	3.0	1,500	1,670	29,507	2021/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.5	1,650	1,795	31,714	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	1,400	1,570	27,732	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	1,300	1,319	23,296	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	2,900	5,010	88,491	2039/11/15
小 計						237,080	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESOBLIGATION	0.25	1,200	1,213	159,826	2019/10/11
		BUNDESOBLIGATION	—	1,200	1,218	160,481	2021/4/9
		BUNDESOBLIGATION	—	1,200	1,219	160,605	2021/10/8
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.5	350	364	47,948	2019/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0	300	321	42,353	2020/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	750	796	104,912	2020/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	850	923	121,607	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	1,100	1,195	157,430	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,310	1,424	187,567	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	700	780	102,814	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	610	676	89,044	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	440	469	61,883	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,200	1,239	163,211	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,100	1,088	143,335	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	1,770	1,779	234,266	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	750	766	100,987	2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	500	508	67,023	2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	500	804	105,970	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	900	1,458	192,108	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	310	515	67,863	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	30	53	7,071	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	1,150	1,735	228,593	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	500	677	89,206	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	510	698	91,981	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	100	105	13,894	2048/8/15
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	400	403	53,087	2019/9/13
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	1,500	1,520	200,198	2019/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.05	1,700	1,713	225,644	2019/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	170	179	23,689	2020/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	500	497	65,470	2020/6/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	360	384	50,614	2020/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	1,800	1,794	236,289	2020/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	170	182	23,984	2021/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.45	2,500	2,460	323,965	2021/6/1

野村外国債券インデックス Aコース（野村投資－任口座向け）

銘 柄			第 7 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	4. 75	10	11	1, 459	2021/ 9 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0. 35	450	438	57, 750	2021/11/ 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1. 35	530	528	69, 629	2022/ 4 /15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1. 45	2, 200	2, 191	288, 631	2022/ 9 /15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0. 95	3, 200	3, 099	408, 102	2023/ 3 /15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4. 5	150	168	22, 251	2023/ 5 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0. 65	900	848	111, 733	2023/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9. 0	180	244	32, 180	2023/11/ 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4. 5	200	226	29, 812	2024/ 3 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5. 0	350	411	54, 204	2025/ 3 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2. 0	230	225	29, 744	2025/12/ 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1. 6	2, 050	1, 946	256, 257	2026/ 6 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1. 25	2, 600	2, 390	314, 738	2026/12/ 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2. 2	1, 600	1, 563	205, 926	2027/ 6 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4. 75	1, 040	1, 228	161, 816	2028/ 9 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1. 65	600	522	68, 815	2032/ 3 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2. 45	770	724	95, 421	2033/ 9 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5. 0	1, 110	1, 387	182, 676	2034/ 8 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2. 25	500	449	59, 130	2036/ 9 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4. 0	1, 080	1, 218	160, 503	2037/ 2 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5. 0	150	188	24, 798	2039/ 8 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4. 75	1, 180	1, 448	190, 700	2044/ 9 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3. 25	960	948	124, 870	2046/ 9 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2. 8	10	8	1, 132	2067/ 3 / 1
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0. 5	500	507	66, 790	2019/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	900	909	119, 722	2020/ 5 /25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2, 200	2, 226	293, 201	2021/ 5 /25
		FRANCE (GOVT OF)	1. 75	2, 400	2, 622	345, 343	2023/ 5 /25
		FRANCE (GOVT OF)	2. 25	1, 310	1, 482	195, 236	2024/ 5 /25
		FRANCE (GOVT OF)	0. 5	900	913	120, 311	2026/ 5 /25
		FRANCE (GOVT OF)	0. 25	2, 450	2, 422	318, 983	2026/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	0. 75	1, 100	1, 116	146, 987	2028/ 5 /25
		FRANCE (GOVT OF)	2. 5	1, 020	1, 220	160, 724	2030/ 5 /25
		FRANCE (GOVT OF)	1. 25	1, 050	1, 064	140, 144	2036/ 5 /25
		FRANCE (GOVT OF)	1. 75	550	596	78, 531	2039/ 6 /25
		FRANCE (GOVT OF)	2. 0	1, 210	1, 342	176, 797	2048/ 5 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	8. 5	200	223	29, 389	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3. 5	1, 200	1, 286	169, 379	2020/ 4 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	0. 25	1, 900	1, 933	254, 657	2020/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3. 75	1, 140	1, 273	167, 678	2021/ 4 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3. 0	1, 320	1, 486	195, 755	2022/ 4 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2. 25	1, 610	1, 783	234, 797	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1. 75	1, 100	1, 216	160, 196	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3. 5	1, 410	1, 765	232, 420	2026/ 4 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2. 75	1, 300	1, 567	206, 413	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5. 5	200	301	39, 698	2029/ 4 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1. 5	840	905	119, 256	2031/ 5 /25

野村外国債券インデックス Aコース（野村投資－任口座向け）

銘 柄			第7期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.75	1,190	1,872	246,607	2035/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.5	720	1,180	155,497	2041/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	700	981	129,299	2045/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	300	512	67,430	2060/4/25
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	100	104	13,777	2019/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	400	405	53,404	2020/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	500	556	73,343	2021/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.25	650	718	94,652	2022/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	530	627	82,609	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	300	329	43,388	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	1,200	1,225	161,381	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,000	1,034	136,238	2027/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	350	438	57,720	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	610	977	128,773	2042/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	150	214	28,297	2047/1/15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,470	1,510	198,850	2020/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.15	1,000	1,029	135,601	2020/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.85	420	468	61,736	2020/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.05	1,500	1,508	198,594	2021/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	730	749	98,704	2021/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	1,490	1,800	237,150	2022/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.45	200	202	26,691	2022/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	200	247	32,548	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	840	1,015	133,738	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	1,120	1,329	175,016	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	400	452	59,631	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	500	633	83,364	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,620	1,740	229,219	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	1,000	1,020	134,321	2026/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,900	1,939	255,435	2027/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	30	41	5,399	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	800	833	109,752	2030/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	900	956	125,978	2033/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	800	1,160	152,779	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	200	310	40,927	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	1,050	1,155	152,136	2046/10/31
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	90	131	17,250	2029/1/31
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	410	551	72,630	2037/1/31
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.0	600	625	82,376	2019/9/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	300	328	43,231	2020/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	340	391	51,498	2021/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	700	833	109,781	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	0.2	200	202	26,665	2023/10/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	230	264	34,829	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.5	700	715	94,256	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	800	838	110,429	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	950	971	127,954	2027/6/22

野村外国債券インデックス Aコース（野村投資－任口座向け）

銘 柄			第 7 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	1. 0	500	503	66, 346	2031/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	4. 0	250	348	45, 860	2032/ 3 /28
		BELGIUM KINGDOM	1. 45	400	408	53, 768	2037/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	1. 9	220	240	31, 696	2038/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	3. 75	550	818	107, 791	2045/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	2. 15	170	185	24, 409	2066/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5. 0	370	584	77, 004	2035/ 3 /28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	0. 25	200	202	26, 601	2019/10/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3. 9	700	761	100, 328	2020/ 7 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3. 65	500	575	75, 742	2022/ 4 /20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1. 75	920	1, 009	132, 981	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0. 75	700	721	95, 042	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0. 5	500	502	66, 123	2027/ 4 /20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2. 4	130	157	20, 774	2034/ 5 /23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4. 15	130	198	26, 191	2037/ 3 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3. 15	300	427	56, 347	2044/ 6 /20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1. 5	100	103	13, 689	2047/ 2 /20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3. 8	230	403	53, 161	2062/ 1 /26
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1. 5	10	9	1, 231	2086/11/ 2
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	3. 375	50	53	7, 040	2020/ 4 /15
		FINNISH GOVERNMENT	0. 375	790	806	106, 151	2020/ 9 /15
		FINNISH GOVERNMENT	—	300	303	39, 957	2022/ 4 /15
		FINNISH GOVERNMENT	1. 5	150	162	21, 337	2023/ 4 /15
		FINNISH GOVERNMENT	2. 0	200	223	29, 383	2024/ 4 /15
		FINNISH GOVERNMENT	0. 5	310	315	41, 504	2026/ 4 /15
		FINNISH GOVERNMENT	2. 75	240	292	38, 471	2028/ 7 / 4
		FINNISH GOVERNMENT	1. 125	300	310	40, 889	2034/ 4 /15
		FINNISH GOVERNMENT	2. 625	60	80	10, 607	2042/ 7 / 4
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	5. 9	200	215	28, 428	2019/10/18
		IRISH GOVERNMENT	4. 5	300	326	42, 992	2020/ 4 /18
		IRISH GOVERNMENT	0. 9	300	301	39, 733	2028/ 5 /15
		IRISH TSY 0. 8% 2022	0. 8	800	829	109, 279	2022/ 3 /15
		IRISH TSY 1% 2026	1. 0	350	362	47, 750	2026/ 5 /15
		IRISH TSY 1. 7% 2037	1. 7	350	365	48, 091	2037/ 5 /15
		IRISH TSY 2% 2045	2. 0	50	53	7, 076	2045/ 2 /18
		IRISH TSY 3. 4% 2024	3. 4	1, 100	1, 304	171, 724	2024/ 3 /18
		REPUBLIC OF IRELAND	3. 9	80	94	12, 503	2023/ 3 /20
小 計						17, 838, 569	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5. 5	160	168	5, 148	2019/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1. 5	900	900	27, 533	2020/ 4 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2. 0	400	402	12, 298	2021/ 4 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1. 75	1, 650	1, 642	50, 241	2021/ 7 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5. 75	150	168	5, 140	2021/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2. 25	160	160	4, 910	2022/ 4 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2. 5	1, 500	1, 513	46, 297	2023/ 1 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	4. 0	1, 400	1, 502	45, 975	2023/10/25

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）

銘 柄			第 7 期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ポーランド			%	千ズロチ	千ズロチ	千円	
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2. 5	1, 000	965	29, 519	2026/ 7 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2. 5	1, 550	1, 474	45, 100	2027/ 7 /25
小 計						272, 167	
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	930	911	75, 219	2021/10/ 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2. 75	900	926	76, 494	2023/ 7 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3. 5	380	413	34, 156	2027/ 3 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2. 875	400	415	34, 293	2029/ 7 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2. 875	610	630	52, 061	2030/ 9 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2. 25	500	468	38, 702	2036/ 8 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2. 75	200	199	16, 468	2046/ 3 / 1
小 計						327, 395	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2. 75	680	686	57, 216	2019/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4. 5	70	72	6, 082	2020/ 4 /15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1. 75	820	814	67, 895	2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2. 0	900	896	74, 725	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5. 75	120	136	11, 361	2022/ 7 /15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2. 25	500	500	41, 695	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5. 5	800	916	76, 381	2023/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2. 75	400	407	33, 981	2024/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3. 25	340	356	29, 713	2025/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4. 25	1, 120	1, 252	104, 423	2026/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4. 75	120	140	11, 689	2027/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2. 75	1, 000	1, 010	84, 207	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2. 25	1, 120	1, 080	90, 038	2028/ 5 /21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2. 75	300	301	25, 140	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4. 5	670	807	67, 293	2033/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3. 75	150	167	13, 950	2037/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3. 25	520	536	44, 707	2039/ 6 /21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3. 0	270	262	21, 892	2047/ 3 /21
小 計						862, 395	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	5. 0	900	868	5, 182	2019/12/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8. 0	3, 000	3, 020	18, 032	2020/ 6 /11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6. 5	9, 200	8, 914	53, 220	2021/ 6 /10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5. 75	14, 000	12, 394	73, 996	2026/ 3 / 5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7. 5	10, 100	9, 934	59, 308	2027/ 6 / 3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7. 75	3, 100	3, 059	18, 264	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10. 0	3, 000	3, 600	21, 494	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8. 5	5, 000	5, 280	31, 521	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8. 0	1, 300	1, 307	7, 803	2047/11/ 7
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8. 0	7, 300	7, 388	44, 108	2023/12/ 7
小 計						332, 933	
南アフリカ				千ランド	千ランド		
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6. 75	800	781	6, 650	2021/ 3 /31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7. 75	500	492	4, 193	2023/ 2 /28

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）

銘 柄			第 7 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	
南アフリカ			%	千ランド	千ランド	千円	
国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10. 5	2, 900	3, 208	27, 304	2026/12/21	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8. 0	5, 650	5, 220	44, 428	2030/ 1 /31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7. 0	2, 800	2, 345	19, 958	2031/ 2 /28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8. 875	3, 500	3, 339	28, 421	2035/ 2 /28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8. 5	4, 800	4, 387	37, 339	2037/ 1 /31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8. 75	7, 250	6, 644	56, 546	2048/ 2 /28	
小 計					224, 842		
合 計					43, 539, 407		

* 邦貨換算金額は、第7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4期（決算日2017年9月6日）

作成対象期間（2016年9月7日～2017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	シティ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/>

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	期 騰 落	中 率		
(設定日)	円	%		%	%	%	百万円
2013年 9 月 12 日	10,000	—	100.00	—	—	—	299
1 期(2014年 9 月 8 日)	10,758	7.6	107.83	7.8	98.1	—	543
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

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

* シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス（為替ヘッジを行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。

* シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。

(出所) Citigroup Index LLC

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落	率	シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	騰 落 率		
(期 首)	円	%		%	%	%
2016年 9 月 6 日	11,711	—	117.74	—	99.2	—
9 月 末	11,726	0.1	117.88	0.1	97.2	—
10 月 末	11,477	△2.0	115.38	△2.0	98.5	—
11 月 末	11,259	△3.9	113.15	△3.9	103.4	—
12 月 末	11,259	△3.9	113.21	△3.8	99.4	—
2017年 1 月 末	11,124	△5.0	111.88	△5.0	96.1	—
2 月 末	11,239	△4.0	113.02	△4.0	97.4	—
3 月 末	11,215	△4.2	112.79	△4.2	98.4	—
4 月 末	11,271	△3.8	113.39	△3.7	97.9	—
5 月 末	11,333	△3.2	113.99	△3.2	97.1	—
6 月 末	11,292	△3.6	113.55	△3.6	100.1	—
7 月 末	11,278	△3.7	113.46	△3.6	97.3	—
8 月 末	11,380	△2.8	114.48	△2.8	98.6	—
(期 末)						
2017年 9 月 6 日	11,412	△2.6	114.81	△2.5	84.6	—

* 騰落率は期首比です。

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、シティ世界国債インデックス（除く日本、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11,711円から期末11,412円へと下落し、値下がり額は299円となりました。

外国債券利回りが長期債を中心に上昇（価格は下落）したことがマイナスに影響し、基準価額は下落しました。

○当ファンドのポートフォリオ

シティ世界国債インデックス（除く日本、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

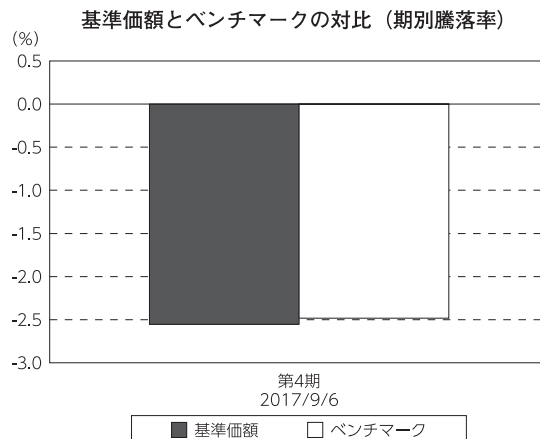
今期の基準価額の騰落率は－2.6%となり、ベンチマークの－2.5%を0.1ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

(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、シティ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、シティ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

(2016年 9 月 7 日～2017年 9 月 6 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 1 (1)	% 0.005 (0.005)	(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)	5 (5) (0)	0.046 (0.046) (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	6	0.051	
期中の平均基準価額は、11,321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

(2016年9月7日～2017年9月6日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	国債証券	千米ドル 115,260	千米ドル 79,756
	カナダ	国債証券	千カナダドル 6,404	千カナダドル 4,337
	イギリス	国債証券	千英ポンド 14,569	千英ポンド 10,752
	スイス	国債証券	千スイスフラン 240	千スイスフラン 165
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 6,765	千スウェーデンクローナ 2,956
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 4,852	千ノルウェークローネ 2,435
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 8,254	千デンマーククローネ 5,452
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	18,129	13,031
	イタリア	国債証券	20,776	14,466
	フランス	国債証券	24,050	16,711
	オランダ	国債証券	5,129	3,661
	スペイン	国債証券	13,256	9,806
	ベルギー	国債証券	6,439	4,427
	オーストリア	国債証券	4,056	2,989
	フィンランド	国債証券	1,657	875
	アイルランド	国債証券	1,507	945
	ポーランド	国債証券	千ズロチ 3,682	千ズロチ 1,834
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 2,575	千シンガポールドル 1,617
	オーストラリア	国債証券	千豪ドル 6,890	千豪ドル 4,461
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 32,435	千メキシコペソ 20,347
	南アフリカ	国債証券	千ランド 13,211	千ランド 7,997

*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 19,951	百万円 19,951	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

(2016年9月7日～2017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

(2017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	51,450	52,696	5,724,994	36.9	—	14.0	16.4	6.5
カナダ	千カナダドル	千カナダドル						
	2,680	2,969	260,570	1.7	—	0.9	0.5	0.3
イギリス	千英ポンド	千英ポンド						
	5,050	6,250	885,108	5.7	—	4.1	1.5	0.2
スイス	千スイスフラン	千スイスフラン						
	130	160	18,221	0.1	—	0.1	0.1	—
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						
	4,150	4,724	64,448	0.4	—	0.2	0.2	—
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						
	2,750	2,942	41,159	0.3	—	0.1	0.1	—
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						
	3,300	4,092	71,287	0.5	—	0.4	0.1	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	5,930	6,906	894,568	5.8	—	3.2	2.0	0.6
イタリア	9,980	10,601	1,373,157	8.9	—	5.0	2.5	1.4
フランス	8,980	10,220	1,323,746	8.5	—	5.4	2.9	0.2
オランダ	1,870	2,128	275,728	1.8	—	0.9	0.8	0.1
スペイン	5,390	6,022	779,986	5.0	—	2.9	1.7	0.4
ベルギー	2,310	2,703	350,191	2.3	—	1.8	0.5	—
オーストリア	1,200	1,376	178,247	1.1	—	0.9	0.0	0.2
フィンランド	870	915	118,602	0.8	—	0.3	0.3	0.1
アイルランド	700	811	105,157	0.7	—	0.4	0.2	0.1
ポーランド	千ズロチ	千ズロチ						
	2,580	2,651	81,127	0.5	—	0.2	0.3	—
シンガポール	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
	1,290	1,346	108,211	0.7	—	0.3	0.3	0.1
オーストラリア	千豪ドル	千豪ドル						
	3,190	3,349	291,533	1.9	—	1.1	0.7	—
メキシコ	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
	17,800	18,316	111,364	0.7	—	0.4	0.3	—
南アフリカ	千ランド	千ランド						
	9,950	8,865	74,555	0.5	—	0.4	0.0	—
合 計	—	—	13,131,971	84.6	—	43.1	31.6	10.0

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

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄			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	87	9, 532	2023/ 8 /15
		US TREASURY BOND	2. 375	440	453	49, 317	2024/ 8 /15
		US TREASURY BOND	6. 0	210	276	29, 984	2026/ 2 /15
		US TREASURY BOND	6. 5	80	110	11, 966	2026/11/15
		US TREASURY BOND	5. 5	80	106	11, 572	2028/ 8 /15
		US TREASURY BOND	5. 25	20	26	2, 851	2028/11/15
		US TREASURY BOND	5. 25	140	184	20, 030	2029/ 2 /15
		US TREASURY BOND	2. 875	360	374	40, 729	2043/ 5 /15
		US TREASURY BOND	3. 75	100	121	13, 147	2043/11/15
		US TREASURY N/B	1. 375	350	350	38, 080	2018/ 9 /30
		US TREASURY N/B	1. 25	100	99	10, 862	2018/11/30
		US TREASURY N/B	1. 25	400	399	43, 454	2018/12/15
		US TREASURY N/B	1. 375	200	200	21, 761	2018/12/31
		US TREASURY N/B	1. 125	750	748	81, 355	2019/ 1 /15
		US TREASURY N/B	1. 25	2, 090	2, 089	227, 048	2019/ 1 /31
		US TREASURY N/B	0. 75	1, 400	1, 390	151, 020	2019/ 2 /15
		US TREASURY N/B	1. 375	250	250	27, 192	2019/ 2 /28
		US TREASURY N/B	0. 875	700	695	75, 563	2019/ 4 /15
		US TREASURY N/B	0. 875	800	794	86, 338	2019/ 5 /15
		US TREASURY N/B	1. 5	1, 500	1, 505	163, 583	2019/ 5 /31
		US TREASURY N/B	1. 625	460	462	50, 278	2019/ 6 /30
		US TREASURY N/B	0. 875	200	198	21, 565	2019/ 7 /31
		US TREASURY N/B	3. 625	70	73	7, 946	2019/ 8 /15
		US TREASURY N/B	0. 875	400	396	43, 097	2019/ 9 /15
		US TREASURY N/B	1. 0	500	497	54, 003	2019/ 9 /30
		US TREASURY N/B	1. 75	300	302	32, 887	2019/ 9 /30
		US TREASURY N/B	1. 25	150	149	16, 277	2019/10/31
		US TREASURY N/B	3. 375	330	344	37, 458	2019/11/15
		US TREASURY N/B	1. 0	320	317	34, 535	2019/11/30
		US TREASURY N/B	1. 375	600	600	65, 262	2020/ 1 /15
		US TREASURY N/B	3. 625	140	147	16, 047	2020/ 2 /15
		US TREASURY N/B	1. 375	1, 700	1, 701	184, 897	2020/ 2 /15
		US TREASURY N/B	1. 5	400	401	43, 624	2020/ 4 /15
		US TREASURY N/B	1. 125	130	129	14, 042	2020/ 4 /30
		US TREASURY N/B	1. 375	400	400	43, 483	2020/ 4 /30
		US TREASURY N/B	3. 5	80	84	9, 184	2020/ 5 /15
		US TREASURY N/B	1. 5	150	150	16, 352	2020/ 5 /31
		US TREASURY N/B	1. 5	1, 000	1, 003	109, 034	2020/ 6 /15
		US TREASURY N/B	1. 625	1, 050	1, 057	114, 847	2020/ 6 /30
		US TREASURY N/B	1. 625	100	100	10, 937	2020/ 7 /31
US TREASURY N/B	2. 625	940	973	105, 731	2020/ 8 /15		
US TREASURY N/B	2. 125	300	306	33, 279	2020/ 8 /31		
US TREASURY N/B	1. 375	1, 100	1, 099	119, 419	2020/ 8 /31		
US TREASURY N/B	2. 625	40	41	4, 505	2020/11/15		
US TREASURY N/B	2. 375	100	102	11, 187	2020/12/31		

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	300	306	33,304	2021/ 1 /31
		US TREASURY N/B	1.375	800	797	86,640	2021/ 1 /31
		US TREASURY N/B	3.625	200	214	23,301	2021/ 2 /15
		US TREASURY N/B	2.0	180	183	19,900	2021/ 2 /28
		US TREASURY N/B	2.25	350	359	39,025	2021/ 3 /31
		US TREASURY N/B	3.125	150	158	17,244	2021/ 5 /15
		US TREASURY N/B	2.0	130	132	14,371	2021/ 5 /31
		US TREASURY N/B	2.125	350	357	38,867	2021/ 6 /30
		US TREASURY N/B	2.25	300	308	33,465	2021/ 7 /31
		US TREASURY N/B	2.125	350	357	38,867	2021/ 8 /15
		US TREASURY N/B	2.0	600	610	66,311	2021/ 8 /31
		US TREASURY N/B	2.0	1,300	1,322	143,703	2021/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	900	920	99,953	2021/12/31
		US TREASURY N/B	2.0	1,000	1,017	110,549	2022/ 2 /15
		US TREASURY N/B	1.75	800	805	87,455	2022/ 2 /28
		US TREASURY N/B	1.75	1,720	1,729	187,926	2022/ 5 /15
		US TREASURY N/B	1.75	1,000	1,005	109,217	2022/ 5 /31
		US TREASURY N/B	2.125	1,500	1,532	166,524	2022/ 6 /30
		US TREASURY N/B	1.875	1,000	1,010	109,726	2022/ 8 /31
		US TREASURY N/B	1.625	350	348	37,909	2022/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	260	265	28,826	2022/12/31
		US TREASURY N/B	2.0	210	212	23,126	2023/ 2 /15
		US TREASURY N/B	1.5	350	345	37,569	2023/ 2 /28
		US TREASURY N/B	1.75	230	229	24,983	2023/ 5 /15
		US TREASURY N/B	1.625	100	99	10,785	2023/ 5 /31
		US TREASURY N/B	2.5	200	208	22,607	2023/ 8 /15
		US TREASURY N/B	1.375	600	585	63,620	2023/ 9 /30
		US TREASURY N/B	2.75	400	422	45,849	2024/ 2 /15
		US TREASURY N/B	2.5	300	311	33,893	2024/ 5 /15
		US TREASURY N/B	2.25	550	562	61,101	2024/11/15
		US TREASURY N/B	2.0	1,400	1,405	152,642	2025/ 2 /15
		US TREASURY N/B	2.125	1,330	1,345	146,195	2025/ 5 /15
		US TREASURY N/B	2.0	1,680	1,682	182,771	2025/ 8 /15
		US TREASURY N/B	2.25	540	550	59,788	2025/11/15
		US TREASURY N/B	1.5	1,400	1,337	145,334	2026/ 8 /15
		US TREASURY N/B	2.375	350	359	39,019	2027/ 5 /15
		US TREASURY N/B	5.375	120	164	17,890	2031/ 2 /15
		US TREASURY N/B	5.0	560	788	85,625	2037/ 5 /15
		US TREASURY N/B	4.5	160	212	23,122	2038/ 5 /15
		US TREASURY N/B	4.625	100	135	14,735	2040/ 2 /15
US TREASURY N/B	4.375	200	262	28,538	2040/ 5 /15		
US TREASURY N/B	3.875	540	662	71,952	2040/ 8 /15		
US TREASURY N/B	3.125	650	710	77,181	2041/11/15		
US TREASURY N/B	2.75	360	367	39,950	2042/ 8 /15		
US TREASURY N/B	3.625	780	925	100,594	2044/ 2 /15		
US TREASURY N/B	3.125	360	392	42,645	2044/ 8 /15		
US TREASURY N/B	2.5	190	183	19,914	2045/ 2 /15		

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	3.0	440	468	50,863	2045/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	160	166	18,050	2045/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	420	446	48,530	2045/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	730	702	76,308	2046/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	550	528	57,455	2046/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	950	864	93,967	2046/8/15
小 計						5,724,994	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	1.25	10	9	877	2018/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.75	40	40	3,534	2019/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	200	198	17,389	2019/5/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	200	197	17,356	2019/8/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	460	461	40,497	2020/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	220	214	18,846	2021/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	300	291	25,603	2021/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	50	49	4,359	2023/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	360	378	33,201	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	40	41	3,637	2025/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	8.0	90	139	12,206	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	200	278	24,442	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	70	103	9,126	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	220	288	25,357	2041/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5	220	275	24,134	2045/12/1
小 計						260,570	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UK TREASURY	4.5	100	106	15,084	2019/3/7
		UK TREASURY	1.75	60	61	8,746	2019/7/22
		UK TREASURY	3.75	60	64	9,111	2019/9/7
		UK TREASURY	2.0	80	84	11,915	2020/7/22
		UK TREASURY	3.75	110	121	17,246	2020/9/7
		UK TREASURY	1.5	500	521	73,805	2021/1/22
		UK TREASURY	8.0	100	129	18,284	2021/6/7
		UK TREASURY	4.0	120	139	19,797	2022/3/7
		UK TREASURY	0.5	550	552	78,173	2022/7/22
		UK TREASURY	2.75	200	228	32,356	2024/9/7
		UK TREASURY	2.0	250	273	38,746	2025/9/7
		UK TREASURY	1.5	70	73	10,406	2026/7/22
		UK TREASURY	1.25	220	223	31,678	2027/7/22
		UK TREASURY	6.0	90	137	19,402	2028/12/7
		UK TREASURY	4.75	80	113	16,124	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	70	96	13,677	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	160	231	32,801	2034/9/7
		UK TREASURY	4.25	470	671	95,096	2036/3/7
		UK TREASURY	1.75	350	355	50,282	2037/9/7
		UK TREASURY	4.5	200	315	44,660	2042/12/7
		UK TREASURY	4.25	200	317	44,949	2046/12/7
		UK TREASURY	4.25	80	131	18,667	2049/12/7

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	
イギリス			%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
	国債証券	UK TREASURY	3.75	200	314	44,474	2052/ 7 /22
		UK TREASURY	1.75	150	158	22,431	2057/ 7 /22
		UK TREASURY	2.5	240	320	45,371	2065/ 7 /22
		UK TREASURY	3.5	80	136	19,296	2068/ 7 /22
		UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	200	264	37,475	2044/ 1 /22
		UNITED KINGDOM(GOVERNMENT	4.25	60	106	15,041	2055/12/ 7
小 計						885,108	
スイス				千スイスフラン	千スイスフラン		
	国債証券	SWITZERLAND GOVERNMENT	2.0	80	88	10,035	2021/ 4 /28
		SWITZERLAND GOVERNMENT	4.0	50	71	8,186	2028/ 4 / 8
小 計						18,221	
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	950	1,115	15,220	2020/12/ 1
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	1,100	1,285	17,535	2022/ 6 / 1
		SWEDISH GOVERNMENT	2.5	700	809	11,047	2025/ 5 /12
		SWEDISH GOVERNMENT	1.0	1,200	1,242	16,941	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	200	271	3,702	2039/ 3 /30
		小 計					
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	1,250	1,381	19,327	2021/ 5 /25
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	300	333	4,669	2024/ 3 /14
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	500	515	7,217	2025/ 3 /13
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	200	201	2,817	2026/ 2 /19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	500	509	7,127	2027/ 2 /17
小 計						41,159	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	4.0	450	495	8,639	2019/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	3.0	400	456	7,959	2021/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.5	650	715	12,455	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	500	564	9,825	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	500	499	8,700	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	800	1,360	23,706	2039/11/15
小 計						71,287	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESobligATION	1.0	100	102	13,295	2019/ 2 /22
		BUNDESobligATION	0.25	500	510	66,155	2019/10/11
		BUNDESobligATION	—	600	612	79,393	2022/ 4 / 8
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.5	450	485	62,893	2019/ 7 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0	200	221	28,655	2020/ 7 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	200	217	28,222	2020/ 9 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	650	721	93,475	2022/ 1 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	100	109	14,201	2022/ 9 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	160	176	22,859	2023/ 5 /15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	110	123	16,054	2024/ 2 /15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	190	204	26,549	2024/ 8 /15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	200	215	27,921	2025/ 8 /15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	490	506	65,592	2026/ 2 /15

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	560	550	71,351	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	70	69	9,053	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	160	234	30,365	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	180	294	38,160	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	100	163	21,206	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	210	348	45,191	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	200	357	46,249	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	270	402	52,076	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	130	174	22,562	2046/8/15
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	100	100	13,080	2018/12/14
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	150	157	20,336	2018/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	180	191	24,779	2019/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	160	171	22,178	2019/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.1	900	904	117,176	2019/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	200	206	26,726	2019/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.05	300	307	39,835	2019/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	270	298	38,652	2020/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	60	66	8,668	2020/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	300	304	39,446	2020/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	170	190	24,691	2021/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	210	236	30,590	2021/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.45	700	703	91,062	2021/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	10	11	1,515	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	830	855	110,812	2022/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	900	900	116,591	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	250	297	38,583	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	100	97	12,577	2023/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	180	263	34,140	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	100	124	16,113	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	580	575	74,573	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	180	183	23,817	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	270	328	42,586	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6	420	413	53,571	2026/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.25	100	94	12,286	2026/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2	100	101	13,205	2027/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	190	238	30,827	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	190	250	32,446	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	380	428	55,502	2030/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	80	72	9,443	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	170	167	21,712	2033/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	230	303	39,366	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.25	480	447	58,010	2036/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	120	142	18,434	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	50	66	8,634	2039/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	150	193	25,083	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	140	143	18,535	2046/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7	90	82	10,656	2047/3/1

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	90	77	9,980	2067/3/1
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.5	400	409	53,078	2019/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	350	355	46,007	2020/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	360	412	53,453	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	200	203	26,345	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	450	437	56,665	2026/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	300	310	40,153	2027/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	120	142	18,423	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	330	322	41,831	2036/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	150	158	20,471	2039/6/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	250	264	34,312	2048/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.25	200	211	27,341	2018/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	8.5	200	239	30,988	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.5	200	221	28,690	2020/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	0.25	700	716	92,817	2020/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.75	490	565	73,247	2021/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	150	172	22,372	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.0	720	830	107,623	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.25	310	349	45,228	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	8.5	400	596	77,196	2023/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.75	300	333	43,249	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.0	650	683	88,464	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.5	110	138	17,971	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5.5	200	304	39,434	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.5	810	857	111,038	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.75	240	374	48,484	2035/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	150	222	28,770	2038/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	190	304	39,466	2055/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	50	81	10,618	2060/4/25
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	100	108	14,095	2019/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	300	306	39,730	2020/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	400	407	52,731	2022/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.25	200	225	29,193	2022/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	30	36	4,730	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	130	147	19,151	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	40	40	5,216	2025/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	330	335	43,416	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	20	24	3,235	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	270	426	55,218	2042/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	50	69	9,008	2047/1/15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	430	452	58,564	2019/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.3	200	219	28,474	2019/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	370	384	49,839	2020/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0	350	389	50,412	2020/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.85	20	23	2,998	2020/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5	150	180	23,350	2021/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	130	133	17,334	2021/7/30

銘			柄	当 期 末				
				利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	90	112	14,594	2022/ 1 /31	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4	600	605	78,450	2022/ 4 /30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	140	172	22,310	2023/10/31	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	320	382	49,603	2024/ 4 /30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	370	418	54,180	2024/10/31	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	520	550	71,365	2026/ 4 /30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	60	83	10,811	2026/ 7 /30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	290	290	37,588	2026/10/31	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	110	148	19,276	2028/10/31	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	490	496	64,342	2030/ 7 /30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	50	70	9,172	2040/ 7 /30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	140	194	25,150	2041/ 7 /30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	70	103	13,360	2044/10/31	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	170	174	22,594	2046/10/31	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	30	32	4,203	2066/ 7 /30	
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	90	131	16,972	2029/ 1 /31	
		SPANISH GOVERNMENT	5.75	60	89	11,561	2032/ 7 /30	
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	140	181	23,472	2037/ 1 /31	
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.0	400	429	55,641	2019/ 9 /28	
		BELGIUM KINGDOM	4.25	140	166	21,614	2021/ 9 /28	
		BELGIUM KINGDOM	4.25	150	184	23,904	2022/ 9 /28	
		BELGIUM KINGDOM	2.25	200	227	29,480	2023/ 6 /22	
		BELGIUM KINGDOM	2.6	230	268	34,809	2024/ 6 /22	
		BELGIUM KINGDOM	0.8	100	103	13,432	2025/ 6 /22	
		BELGIUM KINGDOM	1.0	200	209	27,073	2026/ 6 /22	
		BELGIUM KINGDOM	0.8	100	101	13,141	2027/ 6 /22	
		BELGIUM KINGDOM	4.0	120	168	21,848	2032/ 3 /28	
		BELGIUM KINGDOM	1.9	210	228	29,601	2038/ 6 /22	
		BELGIUM KINGDOM	1.6	120	116	15,128	2047/ 6 /22	
		BELGIUM KINGDOM	2.15	60	63	8,267	2066/ 6 /22	
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	150	224	29,133	2028/ 3 /28	
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	130	209	27,114	2035/ 3 /28	
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.95	260	272	35,234	2019/ 6 /18	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5	40	46	6,011	2021/ 9 /15	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	100	119	15,442	2022/11/22	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	70	77	10,090	2023/10/20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	110	122	15,825	2024/10/21	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	130	139	18,122	2025/10/20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	50	51	6,656	2026/10/20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	100	99	12,929	2027/ 4 /20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	130	157	20,429	2034/ 5 /23	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	50	76	9,927	2037/ 3 /15	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	90	126	16,347	2044/ 6 /20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	30	50	6,595	2062/ 1 /26	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	40	35	4,635	2086/11/ 2	
		フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	1.125	120	122	15,839
FINNISH GOVERNMENT	3.375			50	55	7,151	2020/ 4 /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	0.375	250	256	33,280	2020/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	—	100	101	13,147	2022/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	—	100	100	13,002	2023/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	140	142	18,398	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	90	110	14,334	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	20	26	3,448	2042/7/4
アイルランド	国債証券	IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	4.4	70	76	9,875	2019/6/18
		IRISH GOVERNMENT	4.5	140	158	20,514	2020/4/18
		IRISH GOVERNMENT	5.4	120	164	21,257	2025/3/13
		IRISH TSY 0.8% 2022	0.8	100	104	13,545	2022/3/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	70	73	9,497	2045/2/18
		IRISH TSY 2.4% 2030	2.4	120	137	17,872	2030/5/15
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	80	97	12,594	2023/3/20
小 計						5,399,386	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	460	496	15,188	2019/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.0	580	575	17,614	2021/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	200	226	6,943	2021/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	160	158	4,845	2022/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	640	685	20,979	2023/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	140	132	4,063	2026/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	400	375	11,493	2027/7/25
小 計						81,127	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.5	170	173	13,946	2019/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	200	205	16,506	2021/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.75	300	302	24,334	2022/4/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	200	215	17,289	2024/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	50	51	4,129	2025/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	310	333	26,785	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	60	64	5,219	2046/3/1
小 計						108,211	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	400	407	35,441	2019/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	70	74	6,486	2020/4/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	320	317	27,605	2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0	400	397	34,578	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	120	139	12,142	2022/7/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	200	233	20,323	2023/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	210	214	18,666	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	240	252	21,953	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	170	192	16,725	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	120	141	12,320	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	360	362	31,543	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	310	324	28,275	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	100	119	10,361	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	100	108	9,418	2037/4/21

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	3.25	20	19	1,731	2039/ 6 /21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	50	45	3,959	2047/ 3 /21
小 計						291,533	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	1,000	964	5,862	2019/12/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	1,000	1,033	6,283	2020/ 6 /11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	1,500	1,490	9,062	2021/ 6 /10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	3,600	3,568	21,694	2022/ 6 / 9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	1,800	1,674	10,183	2026/ 3 / 5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	2,900	3,039	18,481	2027/ 6 / 3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	2,700	2,874	17,475	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	700	907	5,515	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	2,000	2,125	12,922	2042/11/13
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	600	638	3,884	2023/12/ 7
小 計						111,364	
南アフリカ				千ランド	千ランド		
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	700	687	5,784	2021/ 3 /31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	1,150	1,151	9,681	2023/ 2 /28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	1,200	1,355	11,401	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	1,150	1,063	8,942	2030/ 1 /31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	800	669	5,629	2031/ 2 /28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	2,100	1,513	12,725	2036/ 3 /31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0	1,000	934	7,855	2040/ 1 /31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5	950	675	5,677	2041/ 2 /28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	500	452	3,807	2044/ 1 /31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	400	362	3,049	2048/ 2 /28
小 計						74,555	
合 計						13,131,971	

* 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

(2017年 9 月 6 日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	13,131,971	83.6
コール・ローン等、その他	2,573,679	16.4
投資信託財産総額	15,705,650	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（15,309,498千円）の投資信託財産総額（15,705,650千円）に対する比率は97.5%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＝108.64円、1 カナダドル＝87.76円、1 英ポンド＝141.61円、1 スイスフラン＝113.87円、1 スウェーデンクローナ＝13.64円、1 ノルウェークローネ＝13.99円、1 デンマーククローネ＝17.42円、1 ユーロ＝129.52円、1 ズロチ＝30.60円、1 シンガポールドル＝80.34円、1 豪ドル＝87.03円、1 メキシコペソ＝6.08円、1 ランド＝8.41円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	30,999,856,542
コール・ローン等	132,707,363
公社債(評価額)	13,131,971,559
未収入金	17,610,394,930
未収利息	57,132,326
前払費用	32,703,540
差入委託証拠金	34,946,824
(B) 負債	15,484,549,551
前受収益	2,021
未払金	15,483,661,451
未払解約金	272,419
未払利息	60
その他未払費用	613,600
(C) 純資産総額(A－B)	15,515,306,991
元本	13,595,536,846
次期繰越損益金	1,919,770,145
(D) 受益権総口数	13,595,536,846口
1万口当たり基準価額(C／D)	11,412円

(注) 期首元本額は3,692,547,438円、期中追加設定元本額は24,136,012,695円、期中一部解約元本額は14,233,023,287円、1口当たり純資産額は1.1412円です。

○損益の状況 (2016年9月7日～2017年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	262,660,396
受取利息	262,847,019
支払利息	△ 186,623
(B) 有価証券売買損益	△ 417,381,113
売買益	2,497,570,351
売買損	△2,914,951,464
(C) 先物取引等取引損益	363,963
取引益	21,533,129
取引損	△ 21,169,166
(D) 保管費用等	△ 5,532,123
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	△ 159,888,877
(F) 前期繰越損益金	631,967,310
(G) 追加信託差損益金	3,224,913,576
(H) 解約差損益金	△1,777,221,864
(I) 計(E＋F＋G＋H)	1,919,770,145
次期繰越損益金(I)	1,919,770,145

* 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
	元本額
	円
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)	10,996,850,960
野村外国債券インデックス Aコース (野村SMA・EW向け)	792,822,847
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	729,654,998
ファンドラップ (ウエルス・スクエア) 債券・安定型	570,435,122
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	479,097,754
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	10,401,345
インデックス・ブレンド (タイプⅢ)	4,909,151
インデックス・ブレンド (タイプⅠ)	3,325,827
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	2,680,047
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	1,717,592
インデックス・ブレンド (タイプⅡ)	1,320,937
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	1,133,211
インデックス・ブレンド (タイプⅣ)	738,981
インデックス・ブレンド (タイプⅤ)	448,074

○お知らせ

- ①スワップ取引に係る評価の方法につき、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価する汎用的な記載に変更する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2017年3月31日＞

- ②外国為替予約取引に係る担保授受に関する規定を追加する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2017年3月31日＞

＜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。

(2018年7月17日現在)

年 月	日
2018年 7 月	－
8 月	24、27、31
9 月	3
10月	－
11月	9、12、21、22
12月	21、25、26

※ 2018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留意下さい。また、諸事情等による申込不可日の変更は、販売会社に連絡いたしますので、お問い合わせ下さい。

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