野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

運用報告書(全体版)

第62期（決算日2023年２月17日）　第63期（決算日2023年３月17日）　第64期（決算日2023年４月17日）
第65期（決算日2023年５月17日）　第66期（決算日2023年６月19日）　第67期（決算日2023年７月18日）

作成対象期間（2023年１月18日～2023年７月18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	外国債券マザーファンドおよび新興国債券マザーファンド（以下「各マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、主として外国（新興国を含みます。）の公社債に実質的に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の月次リターンを、各指数構成国のGDP合計の割合※で合成して算出した指数を対象指数とし、対象指数の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。 ※各指数構成国のGDP合計の割合は、原則として年１回見直しを行ないます。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。	
主な投資対象	野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	各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。また、各マザーファンド受益証券に代えて、各マザーファンドの対象指数に連動する投資成果を目指して運用を行なう上場投資信託証券に投資する場合があります。
	外国債券マザーファンド	外国の公社債を主要投資対象とします。
	新興国債券マザーファンド	新興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（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	株式への直接投資は行ないません。株式への投資は、転換社債を転換したもの等に限り、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。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	外国債券マザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	新興国債券マザーファンド	外貨建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ないます。	

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30期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
38期(2021年2月17日)	9,769	21	1.1	107.12	0.8	98.9	－	18,940
39期(2021年3月17日)	9,802	21	0.6	107.90	0.7	98.9	－	18,871
40期(2021年4月19日)	9,765	21	△0.2	108.05	0.1	98.8	－	18,757
41期(2021年5月17日)	9,809	21	0.7	108.63	0.5	98.9	－	18,566
42期(2021年6月17日)	9,966	21	1.8	110.44	1.7	98.9	－	18,863
43期(2021年7月19日)	9,905	21	△0.4	110.44	0.0	98.9	－	18,838
44期(2021年8月17日)	9,879	21	△0.1	110.15	△0.3	98.9	－	18,929
45期(2021年9月17日)	9,862	21	0.0	110.11	△0.0	99.0	－	19,078
46期(2021年10月18日)	10,031	21	1.9	112.32	2.0	98.8	－	19,515
47期(2021年11月17日)	9,970	21	△0.4	111.84	△0.4	98.9	－	19,814
48期(2021年12月17日)	9,932	21	△0.2	111.64	△0.2	98.9	－	19,940
49期(2022年1月17日)	9,761	21	△1.5	109.72	△1.7	98.8	－	19,855
50期(2022年2月17日)	9,568	21	△1.8	108.13	△1.5	98.8	－	19,500
51期(2022年3月17日)	9,457	21	△0.9	106.86	△1.2	98.8	－	19,492
52期(2022年4月18日)	9,659	21	2.4	109.04	2.0	98.6	－	20,153
53期(2022年5月17日)	9,545	21	△1.0	108.28	△0.7	98.7	－	20,261
54期(2022年6月17日)	9,441	21	△0.9	107.15	△1.0	98.9	－	20,676
55期(2022年7月19日)	9,799	21	4.0	112.24	4.8	98.6	－	22,087
56期(2022年8月17日)	9,752	21	△0.3	111.94	△0.3	98.6	－	21,897
57期(2022年9月20日)	9,846	21	1.2	113.23	1.2	98.6	－	22,540
58期(2022年10月17日)	9,628	21	△2.0	110.89	△2.1	98.5	－	22,576
59期(2022年11月17日)	9,612	24	0.1	111.14	0.2	98.5	－	22,480
60期(2022年12月19日)	9,545	24	△0.4	110.98	△0.1	98.6	－	22,796
61期(2023年1月17日)	9,094	24	△4.5	105.83	△4.6	98.4	－	22,114
62期(2023年2月17日)	9,253	24	2.0	107.87	1.9	98.5	－	23,607
63期(2023年3月17日)	9,268	24	0.4	108.07	0.2	98.7	－	24,047
64期(2023年4月17日)	9,401	24	1.7	110.07	1.9	98.5	－	24,606
65期(2023年5月17日)	9,513	24	1.4	111.90	1.7	98.5	－	25,095
66期(2023年6月19日)	9,870	24	4.0	116.08	3.7	98.7	－	26,512
67期(2023年7月18日)	9,757	24	△0.9	115.49	△0.5	98.5	－	26,847

＊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。

＊ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とJP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の月次リターンを、各指数構成国のGDP合計の割合※で合成した指数を当社で算出し、設定時を100としています。
※各指数構成国のGDP合計の割合は、原則として年１回見直しを行ないます。

マザーファンド名	対象指数
外国債券マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
新興国債券マザーファンド	JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値をもとにしています。
なお、当社での指数の円換算にあたっては、営業日当日の対顧客電信売買相場仲値を用いています。

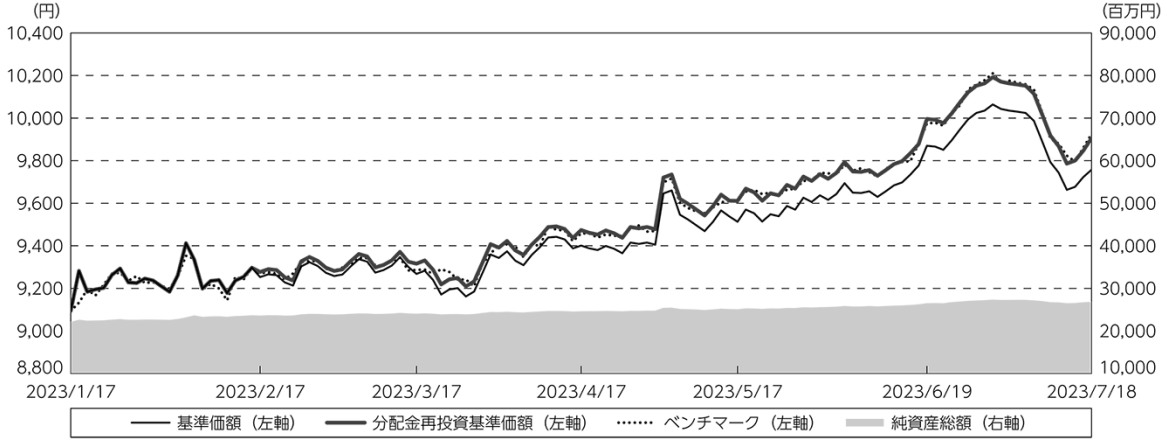
○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
			騰落率		騰落率		
	（期首）	円	%		%	%	%
	2023年１月17日	9,094	－	105.83	－	98.4	－
第62期	１月末	9,237	1.6	107.40	1.5	98.4	－
	（期末）						
	2023年２月17日	9,277	2.0	107.87	1.9	98.5	－
	（期首）						
	2023年２月17日	9,253	－	107.87	－	98.5	－
第63期	２月末	9,323	0.8	108.54	0.6	98.7	－
	（期末）						
	2023年３月17日	9,292	0.4	108.07	0.2	98.7	－
	（期首）						
	2023年３月17日	9,268	－	108.07	－	98.7	－
第64期	３月末	9,359	1.0	108.97	0.8	98.5	－
	（期末）						
	2023年４月17日	9,425	1.7	110.07	1.9	98.5	－
	（期首）						
	2023年４月17日	9,401	－	110.07	－	98.5	－
第65期	４月末	9,405	0.0	110.20	0.1	98.4	－
	（期末）						
	2023年５月17日	9,537	1.4	111.90	1.7	98.5	－
	（期首）						
	2023年５月17日	9,513	－	111.90	－	98.5	－
第66期	５月末	9,637	1.3	113.37	1.3	98.8	－
	（期末）						
	2023年６月19日	9,894	4.0	116.08	3.7	98.7	－
	（期首）						
	2023年６月19日	9,870	－	116.08	－	98.7	－
第67期	６月末	10,043	1.8	118.28	1.9	98.5	－
	（期末）						
	2023年７月18日	9,781	△0.9	115.49	△0.5	98.5	－

＊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62期首：9,094円
第67期末：9,757円（既払分配金（税込み）：144円）
騰　落　率：　8.9%（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（2023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、ヘッジなし・円ベース）とJP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の月次リターンを、各指数構成国のGDP合計の割合で合成して算出した指数です。ベンチマークは、作成期首（2023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

外国債券利回りや新興国債券（米ドル建て）利回りが上昇（価格は下落）したことはマイナスに影響しましたが、主要通貨が対円で上昇（円安）したことがプラスに寄与したため、基準価額は上昇しました。

○投資環境

【先進国債券市場】

当運用期間では、インフレの長期化懸念に伴うFRB（米連邦準備制度理事会）やECB（欧州中央銀行）による政策金利の引き上げ実施、金融引き締め期間の長期化観測などを背景に、外国債券利回りは米欧を中心に幅広い国で上昇（価格は下落）しました。

【新興国債券市場】

米国景気の底堅さなどを背景に投資家のリスク選好姿勢が強まり、新興国債券（米ドル建て）の対米国国債スプレッド（利回り格差）は小幅に縮小しましたが、米国国債利回りが上昇した結果、新興国債券利回りは上昇しました。利金収入などから新興国債券のリターンはプラスとなりました。

【為替市場】

為替市場は、内外金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け)]

対象指数の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指すため、各マザーファンド受益証券に投資しました。各マザーファンドへの投資配分比率は、対象指数における先進国（除く日本）および新興国の割合をもとに決定しました。当運用期間を通じて、各マザーファンドの組入比率の合計は、高位を維持しました。

[外国債券マザーファンド]

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

[新興国債券マザーファンド]

JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、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、ポートフォリオの特性値（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リバランス（投資比率の再調整）を行ないました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行なっておりません。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当運用期間の基準価額の騰落率は＋8.9%となり、ベンチマークの＋9.1%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。

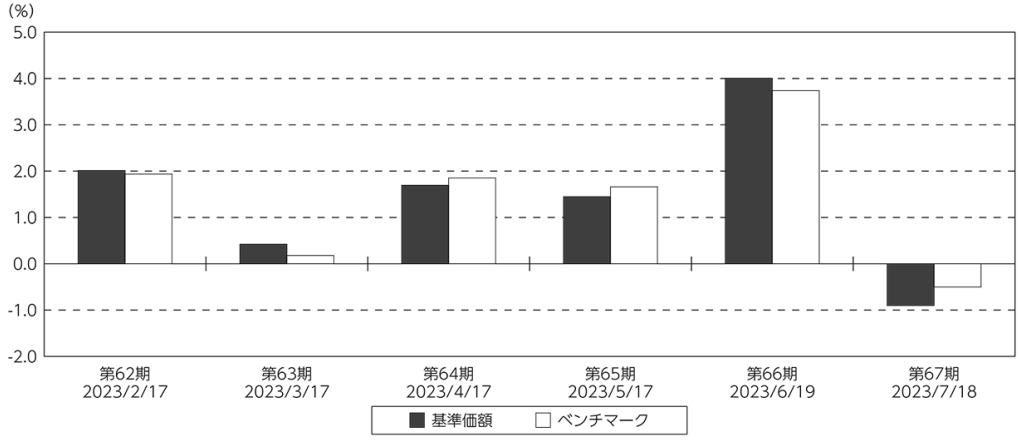
（マイナス要因）

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為替レートや債券時価が異なること

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とJP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の月次リターンを、各指数構成国のGDP合計の割合で合成して算出した指数です。

◎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ないます。

○分配原資の内訳

（単位：円、１万口当たり・税込み）

項　　目	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期
	2023年１月18日～2023年２月17日	2023年２月18日～2023年３月17日	2023年３月18日～2023年４月17日	2023年４月18日～2023年５月17日	2023年５月18日～2023年６月19日	2023年６月20日～2023年７月18日
当期分配金	24	24	24	24	24	24
（対基準価額比率）	0.259％	0.258％	0.255％	0.252％	0.243％	0.245％
当期の収益	24	24	24	24	24	24
当期の収益以外	－	－	－	－	－	－
翌期繰越分配対象額	647	650	655	660	671	676

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

[野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）]

引き続き、各マザーファンド受益証券への投資配分比率は、対象指数における先進国（除く日本）および新興国の割合をもとに決定し、各マザーファンドに投資することで、対象指数の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行なってまいります。

[外国債券マザーファンド]

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

[新興国債券マザーファンド]

引き続き、新興国債券（米ドル建て）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、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える運用を行なってまいります。

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。

＊FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行なっておりません。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。

＊本書に含まれるJPモルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含みますが、これに限られません。）（以下、「本インデックス」といいます。）に関する情報（以下、「当情報」といいます。）は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行なうものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できると思われるものですが、その完全性及び正確性を保証するものではありません。当情報の内容については、今後予告なく変更されることがあります。当情報に含まれる実績は過去のものであって将来の運用成果を示すものではなく、将来の運用成績は変化します。JPモルガン、その関係会社又はそれらの従業員は、本インデックスの発行体のデータに係る金融商品について自己のポジション（ロング若しくはショート）を有し、取引を行ない、又はそのマーケット・メイカーとして行為している可能性があるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイサー又は貸主となっている可能性があります。
ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー（以下、「JPMSL」又は「インデックス・スポンサー」といいます。）は、本インデックスにおいて参照する証券、金融関連商品又は取引（以下「該当商品」といいます。）を、賛助し、支持し、又はその他の方法で勧誘するものではありません。インデックス・スポンサーは、証券や金融関連商品一般に投資すること若しくは個別の該当商品に投資することの有用性について、又は金融市場における投資機会を追跡記録し、若しくは目的を達成するための本インデックスの有用性について、明示黙示を問わず、何らの表明又は保証をするものではありません。インデックス・スポンサーは、該当商品の管理、マーケティング又は取引に関連して、何らの責任又は義務を負いません。本インデックスは、信頼できると思われる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性並びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。
本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。
JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド（英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員）及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。
当情報に関して追加で必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、index.research@jpmorgan.com宛にお願いします。
当情報に関する追加の情報については、www.morganmarkets.comもご覧ください。
当情報の著作権は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属します。

○１万口当たりの費用明細

（2023年１月18日～2023年７月18日）

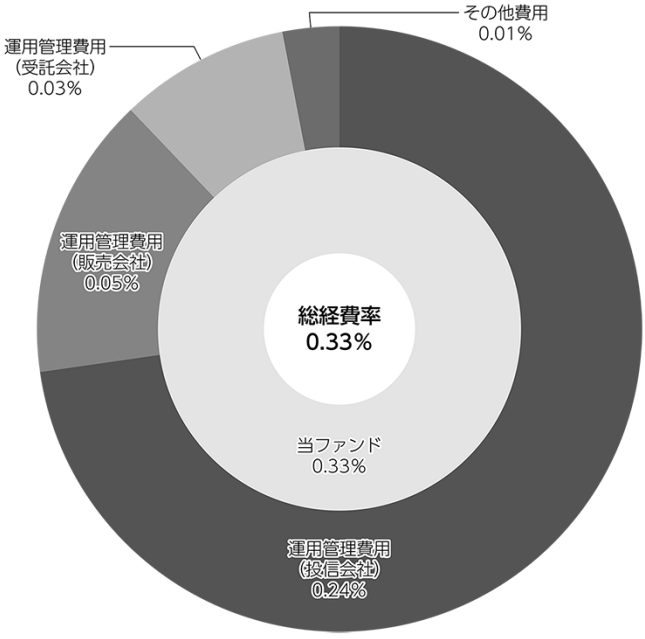
項目	第62期～第67期 金額	第62期～第67期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	16	0.165	(a)信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(11)	(0.121)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（販売会社）	(3)	(0.027)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（受託会社）	(2)	(0.016)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) その他費用	1	0.007	(b)その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（保管費用）	(0)	(0.002)	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)	(0.003)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	17	0.172	
作成期間の平均基準価額は、9,500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。

（参考情報）

◯総経費率

当作成期中の運用・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。）を作成期中の平均受益権口数に作成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0.33%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、売買委託手数料およ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）当ファンドのその他費用には、外貨建資産の保管等に要する費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用、信託事務の処理に要するその他の諸費用等が含まれます。
（注）当ファンドのその他費用には、有価証券の貸付に係る事務の処理に要する費用が含まれる場合があります。
（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

（2023年１月18日～2023年７月18日）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第62期～第67期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国債券マザーファンド	897,624	2,309,067	236,205	620,339
新興国債券マザーファンド	529,544	1,051,485	65,505	128,357

＊単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

（2023年１月18日～2023年７月18日）

利害関係人との取引状況

＜野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）＞

該当事項はございません。

＜外国債券マザーファンド＞

区分	第62期～第67期					
	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	57,700	124	0.2	42,955	123	0.3

平均保有割合　2.6%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

＜新興国債券マザーファンド＞

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

○組入資産の明細

（2023年７月18日現在）

親投資信託残高

銘柄	第61期末	第67期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
外国債券マザーファンド	6,768,494	7,429,912	19,848,269
新興国債券マザーファンド	2,938,488	3,402,527	6,985,389

＊口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

（2023年７月18日現在）

項目	第67期末	
	評価額	比率
	千円	%
外国債券マザーファンド	19,848,269	73.7
新興国債券マザーファンド	6,985,389	25.9
コール・ローン等、その他	109,628	0.4
投資信託財産総額	26,943,286	100.0

＊金額の単位未満は切り捨て。

＊外国債券マザーファンドにおいて、第67期末における外貨建純資産（730,310,579千円）の投資信託財産総額（944,264,690千円）に対する比率は77.3%です。

＊新興国債券マザーファンドにおいて、第67期末における外貨建純資産（33,467,998千円）の投資信託財産総額（34,142,050千円）に対する比率は98.0%です。

＊外貨建資産は、第67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＝138.88円、１カナダドル＝105.25円、１英ポンド＝181.70円、１スウェーデンクローナ＝13.56円、１ノルウェークローネ＝13.80円、１デンマーククローネ＝20.96円、１ユーロ＝156.17円、１ズロチ＝35.1666円、１シンガポールドル＝105.09円、１リンギ＝30.583円、１人民元＝19.3523円、１豪ドル＝94.66円、１ニュージーランドドル＝87.91円、１新シェケル＝38.2747円、１メキシコペソ＝8.3042円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項　　目	第62期末	第63期末	第64期末	第65期末	第66期末	第67期末
	2023年２月17日現在	2023年３月17日現在	2023年４月17日現在	2023年５月17日現在	2023年６月19日現在	2023年７月18日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	**23,685,118,842**	**24,138,412,544**	**24,734,987,852**	**25,192,300,718**	**26,610,460,939**	**26,943,286,552**
コール・ローン等	46,329,432	43,346,609	72,813,077	36,947,990	80,793,773	88,823,600
外国債券マザーファンド(評価額)	17,734,100,313	18,142,319,236	18,431,989,101	18,851,819,207	19,855,588,761	19,848,269,024
新興国債券マザーファンド(評価額)	5,861,566,150	5,892,773,854	6,163,245,931	6,231,615,503	6,645,083,612	6,985,389,394
未収入金	43,122,947	59,972,845	66,939,743	71,918,018	28,994,793	20,804,534
(B) 負債	**77,396,793**	**90,717,765**	**128,705,342**	**96,755,943**	**98,233,493**	**95,578,680**
未払収益分配金	61,231,129	62,275,368	62,817,088	63,314,608	64,465,507	66,041,313
未払解約金	9,705,693	22,361,619	59,037,139	26,618,812	26,069,990	22,428,218
未払信託報酬	6,417,190	6,040,484	6,805,730	6,777,313	7,646,897	7,061,973
未払利息	11	33	24	37	131	106
その他未払費用	42,770	40,261	45,361	45,173	50,968	47,070
(C) 純資産総額(A－B)	**23,607,722,049**	**24,047,694,779**	**24,606,282,510**	**25,095,544,775**	**26,512,227,446**	**26,847,707,872**
元本	25,512,970,763	25,948,070,191	26,173,786,716	26,381,086,824	26,860,628,271	27,517,213,960
次期繰越損益金	△ 1,905,248,714	△ 1,900,375,412	△ 1,567,504,206	△ 1,285,542,049	△ 348,400,825	△ 669,506,088
(D) 受益権総口数	**25,512,970,763口**	**25,948,070,191口**	**26,173,786,716口**	**26,381,086,824口**	**26,860,628,271口**	**27,517,213,960口**
１万口当たり基準価額(C／D)	**9,253円**	**9,268円**	**9,401円**	**9,513円**	**9,870円**	**9,757円**

（注）第62期首元本額は24,316,842,155円、第62～67期中追加設定元本額は4,550,510,004円、第62～67期中一部解約元本額は1,350,138,199円、１口当たり純資産額は、第62期0.9253円、第63期0.9268円、第64期0.9401円、第65期0.9513円、第66期0.9870円、第67期0.9757円です。

○損益の状況

項目	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期
	2023年１月18日～2023年２月17日	2023年２月18日～2023年３月17日	2023年３月18日～2023年４月17日	2023年４月18日～2023年５月17日	2023年５月18日～2023年６月19日	2023年６月20日～2023年７月18日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	**Δ 555**	**Δ 388**	**Δ 480**	**Δ 1,813**	**Δ 2,721**	**Δ 1,756**
受取利息	－	－	4	－	－	－
支払利息	Δ 555	Δ 388	Δ 484	Δ 1,813	Δ 2,721	Δ 1,756
(B) 有価証券売買損益	**441,717,318**	**104,055,543**	**417,941,957**	**361,416,257**	**1,023,554,105**	**Δ 241,793,637**
売買益	445,107,643	154,496,110	419,955,595	365,344,886	1,027,276,553	3,549,513
売買損	Δ 3,390,325	Δ 50,440,567	Δ 2,013,638	Δ 3,928,629	Δ 3,722,448	Δ 245,343,150
(C) 信託報酬等	**Δ 6,459,960**	**Δ 6,080,745**	**Δ 6,851,091**	**Δ 6,822,486**	**Δ 7,697,865**	**Δ 7,109,043**
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	**435,256,803**	**97,974,410**	**411,090,386**	**354,591,958**	**1,015,853,519**	**Δ 248,904,436**
(E) 前期繰越損益金	**Δ1,306,069,628**	**Δ 926,755,849**	**Δ 885,007,262**	**Δ 529,670,019**	**Δ 235,194,402**	**711,134,135**
(F) 追加信託差損益金	**Δ 973,204,760**	**Δ1,009,318,605**	**Δ1,030,770,242**	**Δ1,047,149,380**	**Δ1,064,594,435**	**Δ1,065,694,474**
（配当等相当額）	（ 857,649,186）	（ 891,931,078）	（ 914,368,661）	（ 939,224,192）	（ 981,389,158）	（ 1,033,316,378）
（売買損益相当額）	（Δ1,830,853,946）	（Δ1,901,249,683）	（Δ1,945,138,903）	（Δ1,986,373,572）	（Δ2,045,983,593）	（Δ2,099,010,852）
(G) 計（D＋E＋F）	**Δ1,844,017,585**	**Δ1,838,100,044**	**Δ1,504,687,118**	**Δ1,222,227,441**	**Δ 283,935,318**	**Δ 603,464,775**
(H) 収益分配金	**Δ 61,231,129**	**Δ 62,275,368**	**Δ 62,817,088**	**Δ 63,314,608**	**Δ 64,465,507**	**Δ 66,041,313**
次期繰越損益金（G＋H）	**Δ1,905,248,714**	**Δ1,900,375,412**	**Δ1,567,504,206**	**Δ1,285,542,049**	**Δ 348,400,825**	**Δ 669,506,088**
追加信託差損益金	Δ 973,204,760	Δ1,009,318,605	Δ1,030,770,242	Δ1,047,149,380	Δ1,064,594,435	Δ1,065,694,474
（配当等相当額）	（ 859,399,015）	（ 894,480,573）	（ 915,634,148）	（ 940,072,939）	（ 983,201,473）	（ 1,035,576,619）
（売買損益相当額）	（Δ1,832,603,775）	（Δ1,903,799,178）	（Δ1,946,404,390）	（Δ1,987,222,319）	（Δ2,047,795,908）	（Δ2,101,271,093）
分配準備積立金	792,705,701	792,497,483	801,223,421	802,534,573	819,651,047	825,707,749
繰越損益金	Δ1,724,749,655	Δ1,683,554,290	Δ1,337,957,385	Δ1,040,927,242	Δ 103,457,437	Δ 429,519,363

＊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（2023年１月18日～2023年７月18日）は以下の通りです。

項目	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期
	2023年１月18日～2023年２月17日	2023年２月18日～2023年３月17日	2023年３月18日～2023年４月17日	2023年４月18日～2023年５月17日	2023年５月18日～2023年６月19日	2023年６月20日～2023年７月18日
a. 配当等収益(経費控除後)	73,264,933円	66,255,745円	76,566,383円	74,243,594円	90,880,608円	77,920,204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	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	859,399,015円	894,480,573円	915,634,148円	940,072,939円	983,201,473円	1,035,576,619円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	780,671,897円	788,517,106円	787,474,126円	791,605,587円	793,235,946円	813,828,858円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	1,713,335,845円	1,749,253,424円	1,779,674,657円	1,805,922,120円	1,867,318,027円	1,927,325,681円
f. 分配対象収益(１万口当たり)	671円	674円	679円	684円	695円	700円
g. 分配金	61,231,129円	62,275,368円	62,817,088円	63,314,608円	64,465,507円	66,041,313円
h. 分配金(１万口当たり)	24円	24円	24円	24円	24円	24円

○分配金のお知らせ

	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期
１万口当たり分配金（税込み）	24円	24円	24円	24円	24円	24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。

外国債券マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日2023年５月10日）

作成対象期間（2022年５月11日～2023年５月10日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。
主な投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

野村アセットマネジメント
東京都江東区豊洲二丁目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		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
18期(2019年５月10日)	22,598	1.2	228.62	1.1	99.0	－	605,827
19期(2020年５月11日)	23,625	4.5	238.73	4.4	98.9	－	564,663
20期(2021年５月10日)	25,182	6.6	254.51	6.6	99.0	－	577,343
21期(2022年５月10日)	25,485	1.2	259.16	1.8	98.9	－	640,565
22期(2023年５月10日)	25,939	1.8	262.45	1.3	98.8	－	714,829

＊債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

＊ベンチマーク（＝FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））は、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。
＊FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行なっておりません。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

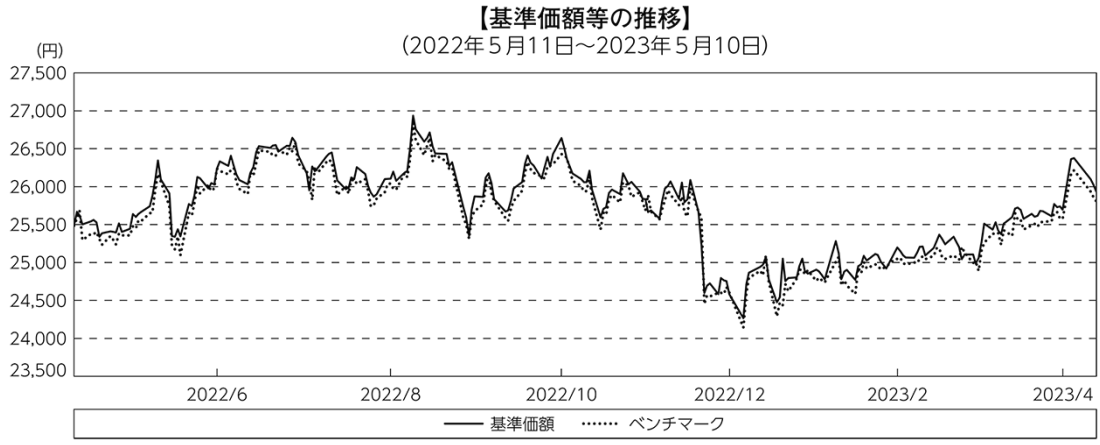
○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
（期首）	円	%		%	%	%
2022年５月10日	25,485	－	259.16	－	98.9	－
５月末	25,639	0.6	259.08	△0.0	99.1	－
６月末	26,235	2.9	266.84	3.0	98.6	－
７月末	26,412	3.6	267.49	3.2	98.8	－
８月末	26,105	2.4	264.81	2.2	99.0	－
９月末	25,872	1.5	261.12	0.8	98.7	－
10月末	26,641	4.5	268.74	3.7	98.2	－
11月末	25,835	1.4	261.23	0.8	99.0	－
12月末	24,580	△3.6	250.17	△3.5	98.7	－
2023年１月末	24,885	△2.4	252.18	△2.7	98.7	－
２月末	25,198	△1.1	254.71	△1.7	98.9	－
３月末	25,513	0.1	256.87	△0.9	98.7	－
４月末	25,697	0.8	260.08	0.4	98.4	－
（期末）						
2023年５月10日	25,939	1.8	262.45	1.3	98.8	－

＊騰落率は期首比です。
＊債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



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

○基準価額の主な変動要因

外国債券利回りが上昇（価格は下落）したことはマイナスに影響しましたが、主要通貨が対円で上昇（円安）したことがプラスに寄与したため、基準価額は上昇しました。

○投資環境

当運用期間では、インフレの長期化懸念に伴うFRB（米連邦準備制度理事会）やECB（欧州中央銀行）による政策金利の引き上げ実施、金融引き締め期間の長期化観測などを背景に、外国債券利回りは米欧を中心に幅広い国で上昇（価格は下落）しました。

為替市場は、日銀が緩和的な金融政策を継続する姿勢を示す一方で、米欧中銀については金融引き締め期間の長期化が観測され、内外金利差の拡大が市場で意識されたことなどから、米ドルは対円で上昇（円安）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

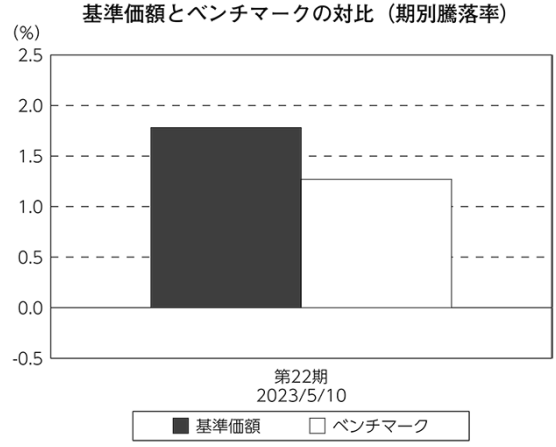
当運用期間の基準価額の騰落率は＋1.8%となり、ベンチマークの＋1.3%を0.5ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

（その他の要因）

ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なること



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

◎今後の運用方針

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

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

（2022年５月11日～2023年５月10日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	4	0.016	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.004)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（その他）	(3)	(0.012)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	4	0.016	
期中の平均基準価額は、25,717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

（2022年５月11日～2023年５月10日）

公社債

			買付額	売付額
外国	アメリカ	国債証券	千米ドル 1,929,651	千米ドル 1,693,287
	カナダ	国債証券	千カナダドル 38,341	千カナダドル 21,603
	イギリス	国債証券	千英ポンド 166,828	千英ポンド 130,152
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 9,124	千スウェーデンクローナ 24,756
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 21,866	千ノルウェークローネ 51,361
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 5,456	千デンマーククローネ 17,487
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	156,044	109,765
	イタリア	国債証券	269,796	238,748
	フランス	国債証券	244,134	231,844
	オランダ	国債証券	31,492	24,432
	スペイン	国債証券	214,273	205,009

			買付額	売付額
外国	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ベルギー	国債証券	28,056	10,609
	オーストリア	国債証券	11,714	3,170
	フィンランド	国債証券	2,360	4,286
	アイルランド	国債証券	21,671	49,754
	ポーランド	国債証券	千ズロチ 63,479	千ズロチ 56,009
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 6,894	千シンガポールドル 4,487
	マレーシア	国債証券	千リンギ 19,333	千リンギ 2,219
	中国	国債証券	千人民元 1,325,990	千人民元 39,039
	オーストラリア	国債証券	千豪ドル 24,600	千豪ドル 9,140
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランドドル 20,026	千ニュージーランドドル －
	イスラエル	国債証券	千新シェケル 7,457	千新シェケル 14,574
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 226,646	千メキシコペソ 124,265

＊金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）
＊単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

（2022年５月11日～2023年５月10日）

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	138,817	421	0.3	76,304	55	0.1

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第１項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

○組入資産の明細

（2023年５月10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	2,739,730	2,576,043	348,152,252	48.7	－	24.7	15.3	8.7
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	143,970	144,448	14,587,813	2.0	－	1.1	0.3	0.6
	千英ポンド	千英ポンド						
イギリス	237,020	199,841	34,103,034	4.8	－	3.7	0.7	0.4
	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ						
スウェーデン	114,150	111,855	1,483,205	0.2	－	0.1	0.1	－
	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノルウェー	95,900	90,103	1,152,425	0.2	－	0.1	0.0	0.0
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	114,550	114,108	2,271,898	0.3	－	0.2	0.1	－
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	266,530	287,283	42,584,093	6.0	－	3.8	1.4	0.7
イタリア	409,050	412,745	61,181,281	8.6	－	4.5	2.9	1.2
フランス	345,340	352,545	52,257,810	7.3	－	4.9	2.4	0.0
オランダ	61,100	62,225	9,223,672	1.3	－	0.8	0.4	0.0
スペイン	260,200	275,555	40,845,627	5.7	－	3.9	1.6	0.2
ベルギー	104,880	102,217	15,151,747	2.1	－	1.2	0.5	0.4
オーストリア	63,000	59,520	8,822,668	1.2	－	0.7	0.5	0.1
フィンランド	17,600	14,923	2,212,045	0.3	－	0.3	0.1	－
アイルランド	26,930	23,735	3,518,310	0.5	－	0.5	0.0	0.0
	千ズロチ	千ズロチ						
ポーランド	115,900	103,948	3,385,193	0.5	－	0.0	0.2	0.2
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	31,860	31,922	3,252,284	0.5	－	0.3	0.2	0.0
	千リンギ	千リンギ						
マレーシア	125,230	130,355	3,960,880	0.6	－	0.4	0.1	0.1
	千人民元	千人民元						
中国	1,860,100	1,869,998	36,516,401	5.1	－	2.3	2.0	0.9
	千豪ドル	千豪ドル						
オーストラリア	126,280	122,641	11,209,420	1.6	－	1.1	0.4	0.1
	千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル						
ニュージーランド	22,400	20,147	1,725,195	0.2	－	0.1	0.0	0.0
	千新シェケル	千新シェケル						
イスラエル	58,000	55,745	2,054,656	0.3	－	0.1	0.1	0.0
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	899,200	850,038	6,472,361	0.9	－	0.4	0.3	0.2
合　　計	－	－	706,124,283	98.8	－	55.4	29.6	13.8

＊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				
			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	2.375	63,000	61,335	8,289,448	2024/8/15
		US TREASURY BOND	6.0	74,200	78,515	10,611,406	2026/2/15
		US TREASURY BOND	6.125	48,200	53,362	7,211,964	2027/11/15
		US TREASURY BOND	5.25	88,750	96,227	13,005,197	2028/11/15
		US TREASURY BOND	4.375	100	108	14,663	2038/2/15
		US TREASURY BOND	2.875	100	85	11,496	2043/5/15
		US TREASURY BOND	3.75	200	194	26,312	2043/11/15
		US TREASURY N/B	2.0	2,700	2,629	355,371	2024/4/30
		US TREASURY N/B	2.25	700	683	92,314	2024/4/30
		US TREASURY N/B	2.5	3,800	3,717	502,359	2024/4/30
		US TREASURY N/B	2.5	89,100	87,123	11,774,794	2024/5/15
		US TREASURY N/B	0.25	100	95	12,914	2024/5/15
		US TREASURY N/B	2.0	18,400	17,885	2,417,235	2024/5/31
		US TREASURY N/B	2.5	300	293	39,620	2024/5/31
		US TREASURY N/B	0.25	100	95	12,878	2024/6/15
		US TREASURY N/B	2.0	34,100	33,096	4,473,056	2024/6/30
		US TREASURY N/B	1.75	4,450	4,307	582,129	2024/6/30
		US TREASURY N/B	3.0	27,800	27,283	3,687,309	2024/6/30
		US TREASURY N/B	0.375	100	95	12,864	2024/7/15
		US TREASURY N/B	2.125	4,300	4,174	564,210	2024/7/31
		US TREASURY N/B	1.75	1,200	1,159	156,728	2024/7/31
		US TREASURY N/B	3.0	22,000	21,583	2,916,969	2024/7/31
		US TREASURY N/B	0.375	100	94	12,828	2024/8/15
		US TREASURY N/B	1.875	5,050	4,881	659,712	2024/8/31
		US TREASURY N/B	1.25	10,000	9,591	1,296,304	2024/8/31
		US TREASURY N/B	3.25	15,400	15,154	2,048,179	2024/8/31
		US TREASURY N/B	0.375	100	94	12,799	2024/9/15
		US TREASURY N/B	2.125	100	96	13,101	2024/9/30
		US TREASURY N/B	1.5	2,100	2,018	272,739	2024/9/30
		US TREASURY N/B	0.625	100	94	12,811	2024/10/15
		US TREASURY N/B	2.25	300	290	39,323	2024/10/31
		US TREASURY N/B	1.5	500	479	64,824	2024/10/31
		US TREASURY N/B	4.375	33,000	32,994	4,459,165	2024/10/31
		US TREASURY N/B	2.25	150	145	19,651	2024/11/15
		US TREASURY N/B	0.75	5,500	5,212	704,416	2024/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	1,150	1,112	150,380	2024/11/30
		US TREASURY N/B	1.5	2,400	2,299	310,790	2024/11/30
		US TREASURY N/B	4.5	8,800	8,820	1,192,084	2024/11/30
		US TREASURY N/B	1.0	200	189	25,666	2024/12/15
		US TREASURY N/B	2.25	1,900	1,839	248,630	2024/12/31
		US TREASURY N/B	1.75	100	96	12,979	2024/12/31
		US TREASURY N/B	1.125	7,000	6,647	898,451	2025/1/15
		US TREASURY N/B	2.5	3,700	3,595	485,971	2025/1/31
		US TREASURY N/B	1.375	300	285	38,652	2025/1/31
		US TREASURY N/B	4.125	3,400	3,394	458,747	2025/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	25,100	24,176	3,267,506	2025/2/15
		US TREASURY N/B	1.5	13,200	12,597	1,702,516	2025/2/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	2.75	2,700	2,635	356,131	2025/2/28
		US TREASURY N/B	1.125	300	284	38,429	2025/2/28
		US TREASURY N/B	1.75	100	95	12,946	2025/3/15
		US TREASURY N/B	2.625	6,700	6,523	881,611	2025/3/31
		US TREASURY N/B	0.5	100	93	12,646	2025/3/31
		US TREASURY N/B	2.625	100	97	13,150	2025/4/15
		US TREASURY N/B	2.875	48,800	47,697	6,446,280	2025/4/30
		US TREASURY N/B	0.375	100	93	12,580	2025/4/30
		US TREASURY N/B	2.125	11,150	10,736	1,451,001	2025/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	14,100	13,750	1,858,421	2025/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	1,000	977	132,074	2025/5/31
		US TREASURY N/B	0.25	6,100	5,650	763,630	2025/5/31
		US TREASURY N/B	2.875	100	97	13,213	2025/6/15
		US TREASURY N/B	2.75	4,200	4,093	553,295	2025/6/30
		US TREASURY N/B	0.25	200	185	25,013	2025/6/30
		US TREASURY N/B	3.0	300	293	39,723	2025/7/15
		US TREASURY N/B	2.875	5,200	5,082	686,898	2025/7/31
		US TREASURY N/B	0.25	100	92	12,463	2025/7/31
		US TREASURY N/B	2.0	36,750	35,219	4,759,943	2025/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	50,700	49,413	6,678,259	2025/8/31
		US TREASURY N/B	0.25	200	183	24,864	2025/8/31
		US TREASURY N/B	3.0	48,500	47,513	6,421,502	2025/9/30
		US TREASURY N/B	0.25	200	183	24,850	2025/9/30
		US TREASURY N/B	4.25	450	453	61,318	2025/10/15
		US TREASURY N/B	3.0	12,100	11,852	1,601,873	2025/10/31
		US TREASURY N/B	0.25	200	183	24,755	2025/10/31
		US TREASURY N/B	2.25	51,300	49,342	6,668,595	2025/11/15
		US TREASURY N/B	4.5	18,500	18,783	2,538,609	2025/11/15
		US TREASURY N/B	2.875	13,200	12,891	1,742,272	2025/11/30
		US TREASURY N/B	0.375	40,200	36,847	4,979,923	2025/11/30
		US TREASURY N/B	2.625	25,020	24,277	3,281,066	2025/12/31
		US TREASURY N/B	0.375	200	183	24,758	2025/12/31
		US TREASURY N/B	2.625	18,100	17,556	2,372,732	2026/1/31
		US TREASURY N/B	0.375	100	91	12,332	2026/1/31
		US TREASURY N/B	1.625	2,000	1,887	255,153	2026/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	1,000	966	130,612	2026/2/28
		US TREASURY N/B	0.5	8,500	7,767	1,049,782	2026/2/28
		US TREASURY N/B	4.625	200	204	27,678	2026/3/15
		US TREASURY N/B	2.25	100	95	12,972	2026/3/31
		US TREASURY N/B	0.75	200	184	24,869	2026/3/31
		US TREASURY N/B	2.375	100	96	13,006	2026/4/30
		US TREASURY N/B	0.75	300	275	37,175	2026/4/30
		US TREASURY N/B	1.625	1,800	1,693	228,821	2026/5/15
		US TREASURY N/B	2.125	300	286	38,695	2026/5/31
		US TREASURY N/B	0.75	100	91	12,365	2026/5/31
		US TREASURY N/B	1.875	100	94	12,790	2026/6/30
		US TREASURY N/B	0.875	300	275	37,209	2026/6/30
		US TREASURY N/B	1.875	7,800	7,371	996,272	2026/7/31

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	0.625	100	90	12,268	2026/7/31
		US TREASURY N/B	1.5	33,300	31,071	4,199,260	2026/8/15
		US TREASURY N/B	1.375	7,300	6,778	916,126	2026/8/31
		US TREASURY N/B	0.75	100	90	12,290	2026/8/31
		US TREASURY N/B	1.625	100	93	12,644	2026/9/30
		US TREASURY N/B	0.875	300	273	36,980	2026/9/30
		US TREASURY N/B	1.625	5,600	5,233	707,364	2026/10/31
		US TREASURY N/B	1.125	300	275	37,222	2026/10/31
		US TREASURY N/B	2.0	13,300	12,579	1,700,142	2026/11/15
		US TREASURY N/B	1.625	100	93	12,615	2026/11/30
		US TREASURY N/B	1.25	500	460	62,219	2026/11/30
		US TREASURY N/B	1.75	100	93	12,656	2026/12/31
		US TREASURY N/B	1.25	54,200	49,822	6,733,539	2026/12/31
		US TREASURY N/B	1.5	200	185	25,040	2027/1/31
		US TREASURY N/B	2.25	24,050	22,899	3,094,886	2027/2/15
		US TREASURY N/B	1.125	100	91	12,339	2027/2/28
		US TREASURY N/B	1.875	2,100	1,970	266,309	2027/2/28
		US TREASURY N/B	0.625	100	89	12,070	2027/3/31
		US TREASURY N/B	2.5	100	96	12,974	2027/3/31
		US TREASURY N/B	0.5	37,000	32,784	4,430,858	2027/4/30
		US TREASURY N/B	2.75	350	338	45,809	2027/4/30
		US TREASURY N/B	2.375	17,500	16,709	2,258,278	2027/5/15
		US TREASURY N/B	0.5	200	176	23,891	2027/5/31
		US TREASURY N/B	2.625	100	96	13,020	2027/5/31
		US TREASURY N/B	0.5	300	264	35,756	2027/6/30
		US TREASURY N/B	3.25	300	296	40,009	2027/6/30
		US TREASURY N/B	0.375	100	87	11,828	2027/7/31
		US TREASURY N/B	2.75	1,400	1,354	183,042	2027/7/31
		US TREASURY N/B	2.25	18,400	17,448	2,358,196	2027/8/15
		US TREASURY N/B	0.5	100	87	11,866	2027/8/31
		US TREASURY N/B	3.125	100	98	13,275	2027/8/31
		US TREASURY N/B	0.375	100	87	11,772	2027/9/30
		US TREASURY N/B	0.5	300	262	35,433	2027/10/31
		US TREASURY N/B	2.25	1,000	945	127,803	2027/11/15
		US TREASURY N/B	0.625	300	263	35,582	2027/11/30
		US TREASURY N/B	0.625	500	437	59,172	2027/12/31
		US TREASURY N/B	0.75	500	439	59,413	2028/1/31
		US TREASURY N/B	2.75	52,800	50,968	6,888,392	2028/2/15
		US TREASURY N/B	1.125	60,100	53,727	7,261,242	2028/2/29
		US TREASURY N/B	1.25	1,500	1,346	181,977	2028/3/31
		US TREASURY N/B	1.25	100	89	12,111	2028/4/30
		US TREASURY N/B	2.875	53,600	51,956	7,021,908	2028/5/15
		US TREASURY N/B	1.25	500	447	60,461	2028/5/31
		US TREASURY N/B	1.25	16,400	14,645	1,979,402	2028/6/30
		US TREASURY N/B	1.0	100	87	11,886	2028/7/31
		US TREASURY N/B	2.875	16,150	15,639	2,113,611	2028/8/15
		US TREASURY N/B	1.125	10,100	8,924	1,206,118	2028/8/31
		US TREASURY N/B	1.25	100	88	11,996	2028/9/30

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	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	300	267	36,181	2028/10/31
		US TREASURY N/B	3.125	66,200	64,790	8,756,457	2028/11/15
		US TREASURY N/B	1.5	100	89	12,124	2028/11/30
		US TREASURY N/B	1.375	100	89	12,036	2028/12/31
		US TREASURY N/B	1.75	2,200	1,996	269,786	2029/1/31
		US TREASURY N/B	2.625	37,350	35,556	4,805,515	2029/2/15
		US TREASURY N/B	1.875	18,000	16,433	2,220,978	2029/2/28
		US TREASURY N/B	2.375	8,100	7,596	1,026,680	2029/3/31
		US TREASURY N/B	2.875	100	96	13,024	2029/4/30
		US TREASURY N/B	2.375	28,900	27,081	3,660,041	2029/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	2,100	2,009	271,542	2029/5/31
		US TREASURY N/B	3.25	3,300	3,244	438,538	2029/6/30
		US TREASURY N/B	2.625	100	94	12,825	2029/7/31
		US TREASURY N/B	1.625	300	268	36,322	2029/8/15
		US TREASURY N/B	3.125	41,000	40,027	5,409,763	2029/8/31
		US TREASURY N/B	1.75	100	90	12,186	2029/11/15
		US TREASURY N/B	1.5	200	176	23,805	2030/2/15
		US TREASURY N/B	4.0	50,000	51,421	6,949,666	2030/2/28
		US TREASURY N/B	3.625	50,000	50,351	6,805,013	2030/3/31
		US TREASURY N/B	6.25	86,200	100,845	13,629,279	2030/5/15
		US TREASURY N/B	0.625	400	329	44,492	2030/5/15
		US TREASURY N/B	0.625	100	81	11,060	2030/8/15
		US TREASURY N/B	0.875	100	83	11,242	2030/11/15
		US TREASURY N/B	5.375	82,500	93,115	12,584,549	2031/2/15
		US TREASURY N/B	1.125	100	84	11,433	2031/2/15
		US TREASURY N/B	1.625	100	87	11,792	2031/5/15
		US TREASURY N/B	1.25	100	84	11,371	2031/8/15
		US TREASURY N/B	1.375	150	126	17,143	2031/11/15
		US TREASURY N/B	1.875	500	439	59,340	2032/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	26,200	24,907	3,366,303	2032/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	800	751	101,548	2032/8/15
		US TREASURY N/B	4.125	84,500	88,526	11,964,417	2032/11/15
		US TREASURY N/B	3.5	9,500	9,478	1,281,016	2033/2/15
		US TREASURY N/B	4.5	100	110	14,923	2036/2/15
		US TREASURY N/B	5.0	6,850	7,922	1,070,665	2037/5/15
		US TREASURY N/B	4.5	14,100	15,481	2,092,380	2038/5/15
		US TREASURY N/B	3.5	100	97	13,214	2039/2/15
		US TREASURY N/B	4.25	1,100	1,173	158,589	2039/5/15
		US TREASURY N/B	4.5	100	109	14,832	2039/8/15
		US TREASURY N/B	4.375	22,100	23,847	3,222,960	2039/11/15
		US TREASURY N/B	4.625	100	111	15,025	2040/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	100	107	14,570	2040/5/15
		US TREASURY N/B	1.125	6,400	4,200	567,663	2040/5/15
		US TREASURY N/B	3.875	100	101	13,667	2040/8/15
		US TREASURY N/B	1.125	4,100	2,667	360,510	2040/8/15
		US TREASURY N/B	4.25	3,400	3,602	486,847	2040/11/15
		US TREASURY N/B	1.375	100	67	9,156	2040/11/15
		US TREASURY N/B	4.75	100	112	15,202	2041/2/15

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	200	147	19,886	2041/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	100	107	14,502	2041/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	5,600	4,374	591,236	2041/5/15
		US TREASURY N/B	3.75	7,500	7,376	996,876	2041/8/15
		US TREASURY N/B	1.75	13,300	9,474	1,280,469	2041/8/15
		US TREASURY N/B	3.125	1,400	1,256	169,856	2041/11/15
		US TREASURY N/B	2.0	9,300	6,906	933,391	2041/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	100	89	12,101	2042/2/15
		US TREASURY N/B	2.375	600	474	64,081	2042/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	100	87	11,833	2042/5/15
		US TREASURY N/B	3.25	500	454	61,414	2042/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	200	167	22,670	2042/8/15
		US TREASURY N/B	3.375	100	92	12,488	2042/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	100	83	11,302	2042/11/15
		US TREASURY N/B	4.0	1,000	1,011	136,670	2042/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	1,190	1,055	142,622	2043/2/15
		US TREASURY N/B	3.625	100	95	12,928	2043/8/15
		US TREASURY N/B	3.625	100	95	12,871	2044/2/15
		US TREASURY N/B	3.375	8,000	7,322	989,678	2044/5/15
		US TREASURY N/B	3.125	39,450	34,614	4,678,121	2044/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	44,800	38,412	5,191,448	2044/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	47,200	36,969	4,996,364	2045/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	22,900	19,570	2,644,960	2045/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	17,500	14,609	1,974,417	2045/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	3,200	2,729	368,891	2045/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	49,700	38,612	5,218,496	2046/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	28,200	21,891	2,958,615	2046/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	36,500	26,893	3,634,600	2046/8/15
		US TREASURY N/B	2.875	14,200	11,814	1,596,700	2046/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,000	1,699	229,670	2047/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,000	1,698	229,575	2047/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	11,400	9,238	1,248,636	2047/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	6,300	5,106	690,202	2047/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	100	84	11,480	2048/2/15
		US TREASURY N/B	3.125	100	86	11,751	2048/5/15
		US TREASURY N/B	3.0	500	424	57,430	2048/8/15
		US TREASURY N/B	3.375	2,100	1,913	258,570	2048/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	470	400	54,114	2049/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	100	83	11,250	2049/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	250	182	24,654	2049/8/15
		US TREASURY N/B	2.375	300	224	30,394	2049/11/15
		US TREASURY N/B	2.0	1,000	686	92,762	2050/2/15
		US TREASURY N/B	1.25	47,900	26,861	3,630,320	2050/5/15
		US TREASURY N/B	1.375	52,200	30,220	4,084,360	2050/8/15
		US TREASURY N/B	1.625	32,600	20,178	2,727,176	2050/11/15
		US TREASURY N/B	1.875	25,800	17,026	2,301,197	2051/2/15
		US TREASURY N/B	2.375	45,850	34,059	4,603,174	2051/5/15
		US TREASURY N/B	2.0	1,400	950	128,426	2051/8/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	100	65	8,873	2051/11/15
		US TREASURY N/B	2.25	100	72	9,735	2052/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	100	82	11,191	2052/5/15
		US TREASURY N/B	3.0	200	170	22,975	2052/8/15
小計						348,152,252	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	2.5	5,500	5,403	545,655	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.0	1,250	1,231	124,399	2024/11/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.75	1,600	1,596	161,222	2025/2/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	34,500	32,983	3,330,991	2025/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	100	95	9,677	2025/4/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	4,500	4,374	441,754	2025/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.5	2,100	1,954	197,395	2025/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.0	1,600	1,577	159,293	2025/10/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.25	350	320	32,333	2026/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	300	284	28,711	2026/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	13,800	12,818	1,294,541	2026/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	100	93	9,394	2027/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	200	184	18,618	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	300	295	29,820	2027/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5	800	815	82,308	2028/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	250	238	24,124	2028/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	15,430	17,831	1,800,782	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	100	96	9,738	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	300	288	29,144	2029/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	2,000	1,788	180,576	2030/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	5,950	5,342	539,528	2031/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	100	89	9,013	2031/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	100	92	9,348	2032/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	900	866	87,494	2032/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	16,900	20,962	2,117,024	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	5,040	6,124	618,497	2037/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	500	558	56,422	2041/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5	9,400	9,948	1,004,698	2045/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	600	561	56,683	2048/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	15,600	12,341	1,246,384	2051/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.75	1,100	810	81,881	2053/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	2,700	2,478	250,350	2064/12/1
小計						14,587,813	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UK TREASURY	2.75	3,350	3,285	560,665	2024/9/7
		UK TREASURY	0.25	12,800	11,958	2,040,670	2025/1/31
		UK TREASURY	5.0	120	121	20,796	2025/3/7
		UK TREASURY	0.625	200	187	31,966	2025/6/7
		UK TREASURY	2.0	100	95	16,338	2025/9/7
		UK TREASURY	1.5	100	93	15,903	2026/7/22
		UK TREASURY	0.375	100	88	15,159	2026/10/22
		UK TREASURY	4.25	100	102	17,430	2027/12/7

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
	国債証券	UK TREASURY	1.625	200	180	30,741	2028/10/22
		UK TREASURY	6.0	7,330	8,167	1,393,857	2028/12/7
		UK TREASURY	0.5	9,800	8,152	1,391,244	2029/1/31
		UK TREASURY	0.875	200	168	28,727	2029/10/22
		UK TREASURY	4.75	100	106	18,252	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	160	166	28,378	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	16,700	17,622	3,007,337	2034/9/7
		UK TREASURY	4.25	15,430	15,870	2,708,331	2036/3/7
		UK TREASURY	1.75	100	75	12,802	2037/9/7
		UK TREASURY	3.75	27,750	26,673	4,551,798	2038/1/29
		UK TREASURY	4.75	4,250	4,573	780,483	2038/12/7
		UK TREASURY	4.25	19,500	19,755	3,371,327	2039/9/7
		UK TREASURY	4.25	500	505	86,257	2040/12/7
		UK TREASURY	4.5	320	333	56,922	2042/12/7
		UK TREASURY	3.5	10,440	9,337	1,593,488	2045/1/22
		UK TREASURY	4.25	7,500	7,498	1,279,534	2046/12/7
		UK TREASURY	1.5	3,000	1,765	301,320	2047/7/22
		UK TREASURY	1.75	100	61	10,504	2049/1/22
		UK TREASURY	4.25	100	100	17,093	2049/12/7
		UK TREASURY	1.25	7,450	3,852	657,411	2051/7/31
		UK TREASURY	3.75	100	92	15,759	2052/7/22
		UK TREASURY	1.625	1,800	1,002	171,093	2054/10/22
		UK TREASURY	1.75	700	398	68,016	2057/7/22
		UK TREASURY	4.0	100	97	16,706	2060/1/22
		UK TREASURY	2.5	100	68	11,772	2065/7/22
		UK TREASURY	3.5	200	177	30,323	2068/7/22
		UK TSY 0 1/2% 2061	0.5	6,600	2,115	360,975	2061/10/22
		UK TSY 0 5/8% 2050	0.625	30,100	12,789	2,182,582	2050/10/22
		UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	7,000	6,056	1,033,562	2044/1/22
		UNITED KINGDOM GILT	3.5	8,500	8,361	1,426,817	2025/10/22
		UNITED KINGDOM GILT	4.125	20,850	20,927	3,571,321	2027/1/29
		UNITED KINGDOM GILT	0.875	13,000	6,680	1,139,972	2046/1/31
		UNITED KINGDOM(GOVERNMEN	4.25	170	172	29,384	2055/12/7
小計						34,103,034	
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	2.5	41,350	40,998	543,640	2025/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	1.0	16,000	15,167	201,121	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT	0.75	18,300	16,888	223,943	2028/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	0.75	4,100	3,712	49,232	2029/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT	0.125	13,100	11,008	145,973	2031/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	21,300	24,079	319,293	2039/3/30
小計						1,483,205	
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	1.75	22,300	21,636	276,732	2025/3/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	8,600	8,203	104,923	2026/2/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	1,700	1,614	20,650	2027/2/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	9,400	8,914	114,022	2028/4/26
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	28,000	25,819	330,228	2029/9/6

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ノルウェー			%	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ	千円	
	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.375	7,400	6,552	83,809	2030/8/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.125	13,000	11,946	152,791	2032/5/18
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	5,500	5,415	69,266	2033/8/15
小計						1,152,425	
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	1.75	25,200	24,595	489,690	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	6,500	5,954	118,550	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	37,250	32,763	652,316	2029/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	38,100	46,937	934,518	2039/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.25	7,500	3,858	76,822	2052/11/15
小計						2,271,898	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESOBLIGATION	—	100	96	14,247	2024/10/18
		BUNDESOBLIGATION	—	200	186	27,642	2026/4/10
		BUNDESOBLIGATION	—	150	138	20,528	2026/10/9
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	600	591	87,742	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	100	97	14,496	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	100	96	14,285	2025/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	7,700	7,438	1,102,598	2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	100	94	14,057	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	100	92	13,734	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	100	92	13,738	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	31,300	36,428	5,399,843	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	200	185	27,535	2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	19,300	22,133	3,280,781	2028/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	600	552	81,959	2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	10,700	11,989	1,777,213	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	100	90	13,359	2028/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	100	89	13,239	2029/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.1	100	98	14,671	2029/11/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	19,550	24,326	3,605,881	2030/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	37,100	45,405	6,730,468	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	17,800	21,898	3,245,957	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	16,700	19,602	2,905,650	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	33,600	27,232	4,036,618	2038/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	7,700	9,437	1,398,979	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	2,800	3,657	542,100	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	2,730	3,021	447,898	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	700	698	103,553	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	100	100	14,876	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	200	155	23,008	2048/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	3,500	1,725	255,744	2052/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.8	17,900	15,193	2,252,188	2053/8/15
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.2	10,800	10,708	1,587,260	2024/12/12
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.5	23,700	23,627	3,502,230	2025/3/13
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.75	1,200	1,181	175,204	2024/5/30
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.75	1,900	1,865	276,499	2024/7/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	3,300	3,321	492,289	2024/9/1

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	100	97	14,428	2024/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	100	98	14,649	2024/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	100	95	14,098	2025/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	35,100	36,129	5,355,421	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4	13,000	12,999	1,926,974	2025/3/28
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	100	96	14,274	2025/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	100	96	14,293	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.85	100	97	14,393	2025/7/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2	300	286	42,405	2025/8/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	250	245	36,331	2025/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	3,000	2,901	430,104	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	32,350	32,430	4,807,228	2026/1/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.5	100	92	13,714	2026/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	35,500	36,579	5,422,134	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8	9,800	9,890	1,466,082	2026/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6	800	758	112,393	2026/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1	100	96	14,236	2026/7/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7.25	600	674	99,992	2026/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.25	100	92	13,755	2026/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.1	100	91	13,540	2027/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2	200	190	28,208	2027/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.05	200	188	27,956	2027/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	3,750	4,211	624,233	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.65	100	96	14,255	2027/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	200	186	27,624	2028/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4	52,350	51,795	7,677,586	2028/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	15,000	15,768	2,337,290	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	100	95	14,173	2028/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.0	800	765	113,473	2029/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	550	596	88,382	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.85	45,000	45,063	6,679,688	2029/12/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	100	97	14,523	2030/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	100	84	12,580	2030/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	20,600	23,438	3,474,315	2031/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	150	123	18,285	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	100	76	11,323	2032/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	100	87	12,898	2032/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	20,150	22,592	3,348,838	2033/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.4	5,500	5,580	827,249	2033/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,400	1,191	176,601	2033/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	31,300	33,027	4,895,704	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.35	15,700	14,164	2,099,609	2035/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	800	771	114,374	2035/4/30
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.25	100	78	11,606	2036/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	300	286	42,427	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	500	431	63,931	2038/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	100	82	12,297	2038/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	5,000	5,250	778,207	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	3.1	200	166	24,638	2040/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	12,100	12,701	1,882,724	2040/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	8,800	8,922	1,322,555	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	3,400	2,768	410,392	2046/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.45	2,800	2,335	346,229	2048/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.85	8,800	7,753	1,149,327	2049/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	400	268	39,814	2050/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	6,100	5,862	868,939	2053/10/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	8,100	5,427	804,563	2067/3/1
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2.25	100	100	14,842	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	100	95	14,108	2025/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	100	95	14,085	2025/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	150	143	21,259	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	500	469	69,540	2026/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	45,500	45,234	6,705,178	2026/9/24
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	100	92	13,643	2026/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	8,000	7,506	1,112,755	2027/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	5,500	5,037	746,697	2028/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	100	91	13,522	2028/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	100	90	13,399	2028/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	100	88	13,063	2029/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	100	99	14,784	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	2,100	1,756	260,345	2034/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	100	79	11,848	2036/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	100	82	12,228	2039/6/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	400	309	45,804	2048/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.5	200	134	19,960	2050/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	100	52	7,763	2052/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	41,500	21,142	3,134,015	2053/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	2,000	1,313	194,704	2066/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.75	1,000	992	147,147	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6.0	39,250	42,656	6,323,032	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	100	95	14,222	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	—	100	92	13,777	2026/2/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	100	102	15,173	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.75	12,900	12,963	1,921,632	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	51,150	58,998	8,745,303	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.5	100	91	13,524	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.75	32,050	39,653	5,877,877	2032/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.75	44,050	51,425	7,622,770	2035/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	10,300	11,242	1,666,435	2038/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.5	14,350	16,675	2,471,807	2041/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	24,450	24,079	3,569,349	2045/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	7,650	8,504	1,260,669	2055/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	840	954	141,534	2060/4/25
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	100	99	14,694	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	7,800	7,415	1,099,270	2025/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	100	93	13,898	2026/7/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	100	93	13,800	2027/7/15
			NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	12,300	13,887	2,058,607	2028/1/15
			NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	100	91	13,561	2028/7/15
			NETHERLANDS GOVERNMENT	—	100	86	12,855	2029/1/15
			NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	100	87	12,910	2029/7/15
			NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	11,750	11,596	1,718,999	2033/1/15
			NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	11,650	13,161	1,950,971	2037/1/15
			NETHERLANDS GOVERNMENT	—	4,000	2,647	392,388	2038/1/15
			NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	500	346	51,291	2040/1/15
			NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	5,300	5,972	885,273	2042/1/15
			NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	3,800	3,782	560,695	2047/1/15
			NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	3,400	2,863	424,453	2054/1/15
	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	600	604	89,560	2024/4/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	9,300	9,269	1,374,050	2024/10/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	100	97	14,454	2025/4/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	24,300	22,889	3,392,854	2025/5/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	2,450	2,541	376,670	2025/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.15	100	98	14,581	2025/10/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	100	92	13,742	2026/1/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	100	97	14,430	2026/4/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.8	28,100	27,966	4,145,410	2026/5/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	20,050	21,850	3,238,850	2026/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	100	94	14,056	2026/10/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5	100	94	14,035	2027/4/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8	100	91	13,547	2027/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	300	281	41,723	2027/10/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	100	87	12,910	2028/1/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	100	92	13,751	2028/4/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	6,250	5,770	855,287	2028/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	34,150	37,698	5,588,001	2028/10/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	100	91	13,554	2029/4/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8	500	434	64,472	2029/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	4,200	3,877	574,785	2030/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.55	7,200	6,727	997,271	2032/10/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	5,400	4,897	726,000	2033/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.85	100	83	12,311	2035/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.85	100	68	10,137	2037/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	1,900	2,154	319,329	2040/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	11,200	12,410	1,839,554	2041/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	500	464	68,897	2043/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	13,000	15,288	2,266,265	2044/10/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	100	84	12,556	2046/10/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	100	80	11,862	2048/10/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	13,700	12,040	1,784,695	2066/7/30
			SPANISH GOVERNMENT	6.0	34,500	39,815	5,901,917	2029/1/31
			SPANISH GOVERNMENT	5.75	27,950	33,333	4,940,975	2032/7/30
			SPANISH GOVERNMENT	4.2	13,250	13,985	2,073,117	2037/1/31
	ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	2.6	9,830	9,784	1,450,398	2024/6/22

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	0.5	9,400	9,113	1,350,864	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	600	577	85,557	2025/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.5	9,600	10,091	1,495,844	2026/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.0	100	95	14,224	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	100	92	13,778	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	1,000	914	135,519	2028/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.9	6,500	5,861	868,829	2029/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	11,400	9,885	1,465,266	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	7,500	8,111	1,202,313	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.25	100	85	12,672	2033/4/22
		BELGIUM KINGDOM	1.45	2,800	2,229	330,431	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	100	83	12,352	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.4	1,000	615	91,268	2040/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	4,100	4,561	676,089	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	4,000	4,186	620,560	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	5,550	3,874	574,260	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.7	3,400	2,350	348,482	2050/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.25	3,600	2,735	405,499	2057/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	2,200	1,589	235,596	2066/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	11,500	13,013	1,928,918	2028/3/28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	10,500	12,366	1,833,019	2035/3/28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	—	1,300	1,257	186,339	2024/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	700	688	102,086	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	900	853	126,533	2025/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	4,600	4,443	658,586	2025/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	7,900	8,381	1,242,449	2026/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	1,878	278,456	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	7,600	8,650	1,282,229	2027/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	11,600	10,223	1,515,453	2029/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	10,350	9,732	1,442,711	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	1,200	1,325	196,498	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	2,400	2,370	351,369	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	7,000	5,026	745,107	2047/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	1,116	165,498	2051/3/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	2,650	2,998	444,451	2062/1/26
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1	800	572	84,897	2117/9/20
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	4.0	600	616	91,388	2025/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.875	100	96	14,245	2025/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,000	1,884	279,401	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	3,300	3,318	491,870	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,400	2,090	309,922	2029/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.75	1,300	1,107	164,135	2031/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	2,000	1,648	244,426	2034/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.125	4,500	3,072	455,420	2036/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	400	370	54,845	2042/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	1.375	1,000	717	106,388	2047/4/15
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	5.4	730	765	113,409	2025/3/13
		IRISH GOVERNMENT	0.9	200	184	27,347	2028/5/15

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	
アイルランド	国債証券	IRISH TSY 1% 2026	1.0	100	95	14,148	2026/5/15
		IRISH TSY 1.10% 2029	1.1	600	551	81,720	2029/5/15
		IRISH TSY 1.3% 2033	1.3	9,100	7,882	1,168,421	2033/5/15
		IRISH TSY 1.35% 2031	1.35	1,100	997	147,836	2031/3/18
		IRISH TSY 1.5% 2050	1.5	2,900	1,967	291,678	2050/5/15
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	3,100	2,606	386,417	2037/5/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	1,600	1,277	189,318	2045/2/18
		IRISH TSY 2.4% 2030	2.4	7,500	7,407	1,098,010	2030/5/15
小計						235,797,259	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	37,900	36,153	1,177,367	2024/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	0.75	8,300	7,555	246,052	2025/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	56,800	49,659	1,617,220	2028/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	7.5	2,200	2,363	76,982	2028/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	3,300	2,780	90,557	2029/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.25	7,400	5,435	177,013	2030/10/25
小計						3,385,193	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	2,300	2,288	233,152	2024/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	1,100	1,084	110,440	2025/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	3,000	2,930	298,518	2026/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.25	500	473	48,229	2026/11/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	5,850	5,998	611,076	2027/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	500	498	50,786	2028/5/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	300	303	30,869	2029/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	5,260	5,309	540,979	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	2,980	3,148	320,755	2033/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	3,220	3,089	314,767	2036/8/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	1,950	2,046	208,481	2042/4/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	1,900	2,006	204,412	2046/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	3,000	2,746	279,813	2050/3/1
小計						3,252,284	
マレーシア				千リンギ	千リンギ		
	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4.059	400	404	12,292	2024/9/30
		MALAYSIA GOVERNMENT	3.882	1,000	1,012	30,768	2025/3/14
		MALAYSIA GOVERNMENT	4.642	2,600	2,792	84,851	2033/11/7
		MALAYSIA GOVERNMENT	3.828	3,300	3,291	100,020	2034/7/5
		MALAYSIA GOVERNMENT	4.762	5,600	6,056	184,021	2037/4/7
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.478	2,500	2,506	76,173	2024/6/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	7,800	7,885	239,604	2024/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.955	2,900	2,942	89,399	2025/9/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	16,600	17,076	518,872	2026/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.892	4,600	4,664	141,719	2027/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.502	9,200	9,186	279,121	2027/5/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	2,200	2,225	67,622	2028/6/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.885	280	283	8,615	2029/8/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	15,400	16,202	492,324	2030/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.232	5,400	5,553	168,742	2031/6/30

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	
マレーシア			%	千リンギ	千リンギ	千円	
	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	10,200	10,205	310,103	2033/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.254	11,100	11,375	345,637	2035/5/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.935	13,350	14,884	452,274	2043/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.736	10,500	11,462	348,296	2046/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.921	300	342	10,419	2048/7/6
小計						3,960,880	
中国				千人民元	千人民元		
	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.47	141,900	142,277	2,778,329	2024/9/2
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.29	27,300	27,313	533,364	2024/12/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.26	142,100	142,011	2,773,137	2025/2/24
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.35	8,500	8,509	166,174	2025/3/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.24	49,900	49,785	972,181	2025/5/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.18	73,500	73,173	1,428,898	2025/8/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.28	156,500	156,163	3,049,483	2025/11/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.46	54,000	54,097	1,056,383	2026/2/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.69	89,500	90,148	1,760,377	2026/8/12
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.37	33,000	32,831	641,121	2027/1/20
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.48	84,800	84,626	1,652,537	2027/4/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.5	54,000	53,892	1,052,376	2027/7/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.44	31,500	31,337	611,940	2027/10/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.64	95,900	96,177	1,878,099	2028/1/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.91	70,000	70,940	1,385,288	2028/10/14
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.8	60,000	60,429	1,180,027	2029/3/24
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.75	74,000	74,255	1,450,020	2029/6/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.62	93,500	93,004	1,816,144	2029/9/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.79	49,200	49,449	965,626	2029/12/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	3.02	33,000	33,686	657,818	2031/5/27
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.89	20,000	20,184	394,160	2031/11/18
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.75	20,000	19,969	389,951	2032/2/17
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.76	31,500	31,476	614,650	2032/5/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.69	66,300	65,854	1,285,966	2032/8/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.8	49,400	49,546	967,518	2032/11/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.88	51,000	51,658	1,008,770	2033/2/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	3.72	15,000	16,602	324,214	2051/4/12
		CHINA GOVERNMENT BOND	3.53	36,000	38,632	754,403	2051/10/18
		CHINA GOVERNMENT BOND	3.32	87,700	90,782	1,772,756	2052/4/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	3.12	61,100	61,179	1,194,676	2052/10/25
小計						36,516,401	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	7,850	7,854	717,871	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	16,880	17,425	1,592,715	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	7,250	7,687	702,634	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	3,200	3,149	287,838	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	300	293	26,823	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,700	1,702	155,644	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	9,300	9,015	824,051	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5	22,200	21,089	1,927,588	2030/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	5,700	4,804	439,146	2030/12/21

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	1.5	3,300	2,862	261,643	2031/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	300	246	22,547	2031/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.25	600	499	45,616	2032/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	2,500	2,158	197,256	2032/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	17,000	18,497	1,690,675	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	300	287	26,285	2033/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	4,050	3,723	340,311	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	10,450	10,504	960,115	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,550	1,440	131,682	2039/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	2,250	1,918	175,375	2041/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	6,600	5,608	512,633	2047/3/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	3,000	1,870	170,963	2051/6/21
小計						11,209,420	
ニュージーランド				千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル		
	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.75	4,300	4,140	354,585	2025/4/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.5	4,000	4,045	346,424	2027/4/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.0	3,000	2,824	241,847	2029/4/20
		NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.5	4,000	3,784	324,037	2033/4/14
		NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.75	3,500	2,901	248,438	2037/4/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.75	2,600	1,720	147,352	2041/5/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.75	1,000	730	62,509	2051/5/15
小計						1,725,195	
イスラエル				千新シェケル	千新シェケル		
	国債証券	ISRAEL FIXED BOND	0.4	1,900	1,798	66,277	2024/10/31
		ISRAEL FIXED BOND	0.5	700	653	24,078	2025/4/30
		ISRAEL FIXED BOND	1.75	14,300	13,588	500,832	2025/8/31
		ISRAEL FIXED BOND	6.25	6,500	7,012	258,455	2026/10/30
		ISRAEL FIXED BOND	2.0	5,000	4,687	172,755	2027/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	2.25	6,300	5,860	216,024	2028/9/28
		ISRAEL FIXED BOND	1.0	4,500	3,784	139,490	2030/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	1.5	5,900	4,381	161,501	2037/5/31
		ISRAEL FIXED BOND	5.5	7,200	8,604	317,148	2042/1/31
		ISRAEL FIXED BOND	3.75	5,700	5,374	198,092	2047/3/31
小計						2,054,656	
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	8.0	78,500	75,781	577,012	2024/9/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	51,500	50,965	388,061	2024/12/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	94,000	85,812	653,394	2025/3/6
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	118,000	107,150	815,865	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.5	27,000	23,902	181,994	2027/3/4
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	110,800	105,122	800,424	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	77,300	76,356	581,391	2029/5/31
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	106,600	100,373	764,263	2031/5/29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	400	370	2,821	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	53,300	58,499	445,430	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	59,600	57,093	434,723	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	68,200	60,009	456,927	2042/11/13

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	54,000	48,600	370,050	2047/11/7
小計						6,472,361	
合計						706,124,283	

＊邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
＊額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○有価証券の貸付及び借入の状況

（2023年５月10日現在）

区分	当期末
	数量
貸付有価証券＜債券＞券面総額	米ドル 644,906,000
貸付有価証券＜債券＞券面総額	カナダドル 4,000,000
貸付有価証券＜債券＞券面総額	ノルウェークローネ 4,000,000
貸付有価証券＜債券＞券面総額	ユーロ 347,299,000
貸付有価証券＜債券＞券面総額	ズロチ 25,769,000
貸付有価証券＜債券＞券面総額	豪ドル 10,500,000
貸付有価証券＜債券＞券面総額	ニュージーランドドル 3,400,000
貸付有価証券＜債券＞券面総額	メキシコペソ 6,730,000

○投資信託財産の構成

（2023年５月10日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	706,124,283	80.7
コール・ローン等、その他	168,624,653	19.3
投資信託財産総額	874,748,936	100.0

＊金額の単位未満は切り捨て。
＊当期末における外貨建純資産（714,086,252千円）の投資信託財産総額（874,748,936千円）に対する比率は81.6％です。
＊外貨建資産は、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＝135.15円、１カナダドル＝100.99円、１英ポンド＝170.65円、１スウェーデンクローナ＝13.26円、１ノルウェークローネ＝12.79円、１デンマーククローネ＝19.91円、１ユーロ＝148.23円、１ズロチ＝32.566円、１シンガポールドル＝101.88円、１リンギ＝30.3853円、１人民元＝19.5275円、１豪ドル＝91.40円、１ニュージーランドドル＝85.63円、１新シェケル＝36.8581円、１メキシコペソ＝7.6142円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年５月10日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	875,422,198,240
コール・ローン等	4,409,575,953
公社債(評価額)	706,124,283,352
未収入金	708,746,648
未収利息	6,443,871,991
前払費用	2,010,960,274
その他未収収益	18,404,631
受入担保代用有価証券	155,706,355,391
(B) 負債	160,592,826,375
未払金	4,364,463,417
未払解約金	512,882,392
未払利息	2,064
受入担保金	155,706,355,391
その他未払費用	9,123,111
(C) 純資産総額(A－B)	714,829,371,865
元本	275,585,073,380
次期繰越損益金	439,244,298,485
(D) 受益権総口数	275,585,073,380口
１万口当たり基準価額(C／D)	25,939円

(注) 期首元本額は251,351,016,828円、期中追加設定元本額は54,342,500,129円、期中一部解約元本額は30,108,443,577円、１口当たり純資産額は2.5939円です。

(注) 2023年５月10日現在、有価証券の貸付などに係る受入担保代用有価証券として担保に受け入れている資産は以下の通りです。
・有価証券　155,706,355,390円

○損益の状況 (2022年５月11日～2023年５月10日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	22,559,732,761
受取利息	22,292,832,249
その他収益金	268,443,622
支払利息	△ 1,543,110
(B) 有価証券売買損益	△ 10,746,416,179
売買益	39,271,163,062
売買損	△ 50,017,579,241
(C) 保管費用等	△ 110,457,034
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	11,702,859,548
(E) 前期繰越損益金	389,214,423,299
(F) 追加信託差損益金	85,429,075,353
(G) 解約差損益金	△ 47,102,059,715
(H) 計(D＋E＋F＋G)	439,244,298,485
次期繰越損益金(H)	439,244,298,485

＊損益の状況の中で**(B)有価証券売買損益**は期末の評価換えによるものを含みます。

＊損益の状況の中で**(F)追加信託差損益金**とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

＊損益の状況の中で**(G)解約差損益金**とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村外国債券インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	75,552,886,410
のむラップ・ファンド (普通型)	27,849,844,361
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	24,016,890,219
野村世界６資産分散投信 (分配コース)	23,117,178,913
NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス (除く日本・為替ヘッジなし) 連動型上場投信	12,124,394,438
野村DC外国債券インデックスファンド	9,841,509,719
のむラップ・ファンド (積極型)	8,327,122,794
ファンドラップ (ウエルス・スクエア) 外国債券	8,237,294,062
野村外国債券インデックス　Bコース(野村SMA・EW向け)	8,234,248,955
マイ・ロード	7,668,985,679
野村外国債券 (含む新興国) インデックス Bコース (野村投資一任口座向け)	7,240,735,132
マイバランス50 (確定拠出年金向け)	7,134,710,046
のむラップ・ファンド (保守型)	6,196,136,484
マイバランス70 (確定拠出年金向け)	5,774,314,492
マイバランス30 (確定拠出年金向け)	5,489,406,567
野村世界６資産分散投信 (安定コース)	3,552,378,284
野村DC運用戦略ファンド	3,380,806,281

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村６資産均等バランス	3,332,169,758
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,551,691,383
マイバランスDC30	2,339,740,110
野村世界６資産分散投信 (成長コース)	2,315,482,591
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用)	1,958,865,680
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	1,870,167,317
マイバランスDC50	1,818,604,536
のむラップ・ファンド (やや積極型)	1,398,700,246
マイバランスDC70	1,383,015,306
野村世界６資産分散投信 (配分変更コース)	1,226,860,841
野村インデックスファンド・外国債券	1,044,919,335
マイターゲット2030 (確定拠出年金向け)	964,192,736
のむラップ・ファンド (やや保守型)	957,786,657
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	947,789,131
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	937,689,579
ノムラ外国債券インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	894,278,826
野村外国債券パッシブファンド (確定拠出年金向け)	624,859,930

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	406,617,499
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	405,205,624
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	398,441,520
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	397,897,777
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	358,921,025
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	344,790,082
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	337,493,824
みらいバランス・株式10（富士通企業年金基金DC向け）	279,099,898
野村外国債券インデックスファンド	261,113,906
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	182,821,661
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	172,478,084
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	164,116,691
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	140,993,698
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	131,101,540
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	112,869,752
ネクストコア	90,952,529
バランスセレクト70	82,947,320
バランスセレクト50	82,230,109
バランスセレクト30	79,262,729
世界6資産分散ファンド	73,994,071
野村資産設計ファンド2040	64,715,748
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	62,186,053
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	61,669,590
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	60,839,499
野村資産設計ファンド2030	51,461,719
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	50,223,732
野村DCバランスファンド（年金運用戦略タイプ）	49,805,580
野村資産設計ファンド2035	41,214,731
野村資産設計ファンド2025	39,046,229
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	30,075,093

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	25,720,298
野村資産設計ファンド2020	23,546,154
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）2030	23,511,133
野村資産設計ファンド2015	21,532,024
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	20,859,850
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）2040	17,158,894
野村資産設計ファンド2045	12,419,221
野村資産設計ファンド2050	11,045,992
インデックス・ブレンド（タイプＶ）	9,663,123
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	9,526,478
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）2050	8,694,906
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	8,244,098
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	7,966,731
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	7,130,958
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	6,307,778
野村外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	6,169,122
野村資産設計ファンド2060	5,928,237
野村TOPs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	5,581,439
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）2060	4,552,920
野村ターゲットデートファンド2016　2026-2028年目標型	4,457,658
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	4,370,072
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	3,763,786
インデックス・ブレンド（タイプＩ）	3,647,577
野村ターゲットデートファンド2016　2029-2031年目標型	3,020,497
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	2,848,300
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	2,235,351
野村ターゲットデートファンド2016　2032-2034年目標型	1,913,625
野村ターゲットデートファンド2016　2035-2037年目標型	1,607,818
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	1,333,126
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	72,103

○お知らせ

該当事項はございません。

新興国債券マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日2023年５月10日）

作成対象期間（2022年５月11日～2023年５月10日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、一部ローンに投資する場合があります。外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建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		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
11期(2019年５月10日)	18,539	5.7	194.17	5.8	98.4	－	19,915
12期(2020年５月11日)	18,255	△ 1.5	188.37	△ 3.0	97.9	－	20,577
13期(2021年５月10日)	20,286	11.1	209.94	11.5	98.4	－	22,196
14期(2022年５月10日)	18,593	△ 8.3	190.84	△ 9.1	98.0	－	21,184
15期(2023年５月10日)	19,483	4.8	200.74	5.2	98.5	－	30,723

＊債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

＊ベンチマーク（＝JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース））は、JP Morgan Emerging Market Bond Index（EMBI）Plus（US$ベース）をもとに、当社が円換算したものです。なお指数の算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。
＊JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（JP Morgan Emerging Market Bond Index（EMBI）Plus）は、J.P. Morgan Securities LLCが公表している、エマージング諸国が発行する米ドル建てのブレディ債、ローン、ユーロボンドを対象としたインデックスであり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。
（出所）J.P. Morgan Securities LLC、ブルームバーグ

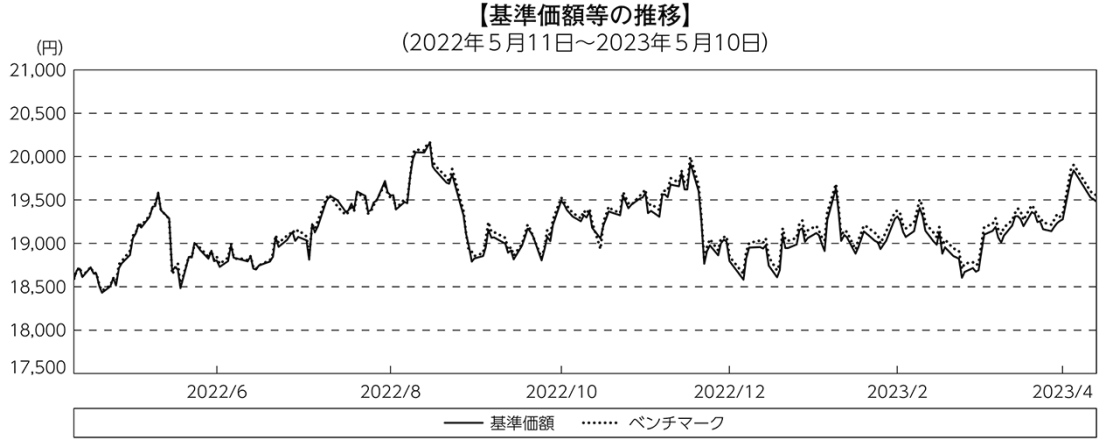
○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
（期首）	円	%		%	%	%
2022年５月10日	18,593	－	190.84	－	98.0	－
５月末	19,062	2.5	195.93	2.7	98.1	－
６月末	18,805	1.1	193.44	1.4	97.6	－
７月末	19,073	2.6	196.60	3.0	97.5	－
８月末	19,553	5.2	200.40	5.0	98.0	－
９月末	18,827	1.3	193.51	1.4	97.6	－
10月末	19,492	4.8	200.43	5.0	97.6	－
11月末	19,583	5.3	201.40	5.5	97.7	－
12月末	18,795	1.1	193.44	1.4	97.5	－
2023年１月末	19,094	2.7	196.48	3.0	97.5	－
２月末	19,309	3.9	198.91	4.2	98.2	－
３月末	19,101	2.7	196.97	3.2	98.2	－
４月末	19,277	3.7	198.48	4.0	98.7	－
（期末）						
2023年５月10日	19,483	4.8	200.74	5.2	98.5	－

＊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、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）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

新興国債券（米ドル建て）利回りが上昇（価格は下落）したことはマイナスに影響しましたが、利金収入などから債券リターンがプラスとなったことや、米ドルが対円で上昇（円安）したことがプラスに寄与したため、基準価額は上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、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、ポートフォリオの特性値（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リバランス（投資比率の再調整）を行ないました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行なっておりません。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当運用期間の基準価額の騰落率は＋4.8%となり、ベンチマークであるJP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の＋5.2%を0.4ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

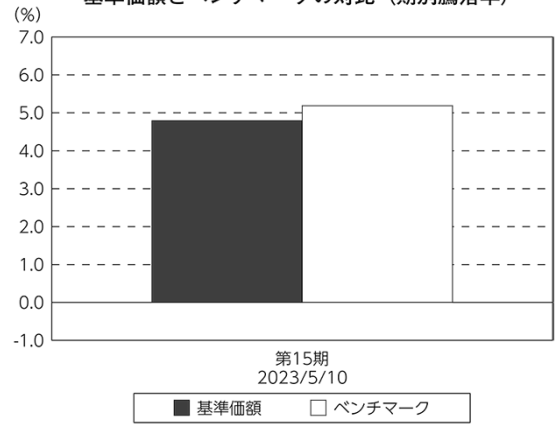
（マイナス要因）

コスト負担（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）ベンチマークは、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）です。

◎今後の運用方針

引き続き、新興国債券（米ドル建て）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、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える運用を行なってまいります。

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。

＊本書に含まれるJPモルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含みますが、これに限られません。）（以下、「本インデックス」といいます。）に関する情報（以下、「当情報」といいます。）は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行なうものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できると思われるものですが、その完全性及び正確性を保証するものではありません。当情報の内容については、今後予告なく変更されることがあります。当情報に含まれる実績は過去のものであって将来の運用成果を示すものではなく、将来の運用成績は変化します。JPモルガン、その関係会社又はそれらの従業員は、本インデックスの発行体のデータに係る金融商品について自己のポジション（ロング若しくはショート）を有し、取引を行ない、又はそのマーケット・メイカーとして行為している可能性があるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイザー又は貸主となっている可能性があります。
ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー（以下、「JPMSL」又は「インデックス・スポンサー」といいます。）は、本インデックスにおいて参照する証券、金融関連商品又は取引（以下「該当商品」といいます。）を、賛助し、支持し、又はその他の方法で勧誘するものではありません。インデックス・スポンサーは、証券や金融関連商品一般に投資すること若しくは個別の該当商品に投資することの有用性について、又は金融市場における投資機会を追跡記録し、若しくは目的を達成するための本インデックスの有用性について、明示黙示を問わず、何らの表明又は保証をするものではありません。インデックス・スポンサーは、該当商品の管理、マーケティング又は取引に関連して、何らの責任又は義務を負いません。本インデックスは、信頼できると思われる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性並びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。
本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド（英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員）及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。
当情報に関して追加で必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、index.research@jpmorgan.com宛にお願いします。当情報に関する追加の情報については、www.morganmarkets.comもご覧ください。
当情報の著作権は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属します。

○１万口当たりの費用明細

（2022年５月11日～2023年５月10日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	2	0.013	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.005)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（その他）	(1)	(0.007)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	2	0.013	
期中の平均基準価額は、19,164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

（2022年５月11日～2023年５月10日）

公社債

			買付額	売付額
外国	アメリカ	国債証券	千米ドル 226,547	千米ドル 153,204

＊金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）
＊単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

（2022年５月11日～2023年５月10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

（2023年５月10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	287,364	223,951	30,267,004	98.5	38.5	83.1	10.1	5.4
合計	287,364	223,951	30,267,004	98.5	38.5	83.1	10.1	5.4

＊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。
＊S&Pグローバル・レーティング、ムーディーズ・インベスターズ・サービスによる格付けを採用しています。

（B）外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

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	ABU DHABI GOVT INT'L	2.125	2,100	2,028	274,106	2024/9/30
		ABU DHABI GOVT INT'L	2.5	1,200	1,160	156,895	2025/4/16
		ABU DHABI GOVT INT'L	1.625	1,200	1,075	145,378	2028/6/2
		ABU DHABI GOVT INT'L	2.5	1,600	1,476	199,524	2029/9/30
		ABU DHABI GOVT INT'L	3.125	2,400	2,289	309,468	2030/4/16
		ABU DHABI GOVT INT'L	1.7	400	341	46,204	2031/3/2
		ABU DHABI GOVT INT'L	1.875	400	342	46,263	2031/9/15
		ABU DHABI GOVT INT'L	3.125	1,800	1,349	182,440	2049/9/30
		ABU DHABI GOVT INT'L	3.875	3,300	2,818	380,896	2050/4/16
		ABU DHABI GOVT INT'L	2.7	800	496	67,079	2070/9/2
		ARAB REPUBLIC OF EGYPT	7.6003	2,100	1,270	171,679	2029/3/1
		ARAB REPUBLIC OF EGYPT	7.625	2,200	1,218	164,646	2032/5/29
		ARAB REPUBLIC OF EGYPT	8.7002	1,400	732	99,051	2049/3/1
		ARAB REPUBLIC OF EGYPT	8.875	3,200	1,663	224,838	2050/5/29
		CHINA GOVT INTL BOND	1.95	1,400	1,355	183,147	2024/12/3
		CHINA GOVT INTL BOND	0.55	2,400	2,203	297,823	2025/10/21
		CHINA GOVT INTL BOND	1.25	1,600	1,461	197,567	2026/10/26
		CHINA GOVT INTL BOND	2.125	1,400	1,289	174,307	2029/12/3
		CHINA GOVT INTL BOND	1.2	1,500	1,265	171,049	2030/10/21
		DOMINICAN REPUBLIC	5.5	1,800	1,714	231,726	2029/2/22
		DOMINICAN REPUBLIC	4.5	1,700	1,506	203,610	2030/1/30
		DOMINICAN REPUBLIC	4.875	1,500	1,295	175,152	2032/9/23
		DOMINICAN REPUBLIC	6.0	2,600	2,424	327,729	2033/2/22
		DOMINICAN REPUBLIC	5.3	900	712	96,289	2041/1/21
		DOMINICAN REPUBLIC	6.4	2,300	1,932	261,132	2049/6/5
		DOMINICAN REPUBLIC	5.875	2,000	1,522	205,700	2060/1/30

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	EGYPT TASKEEK COMPANY	10.875	1,000	825	111,575	2026/2/28
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	2.875	1,500	1,439	194,509	2025/6/6
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.5	1,500	1,427	192,862	2029/5/30
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	3.875	3,700	3,304	446,620	2030/6/12
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	3.75	1,000	864	116,776	2031/9/12
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	6.0	2,200	2,152	290,923	2033/10/20
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.75	3,400	2,490	336,602	2050/1/14
		HUNGARY	6.125	1,000	1,041	140,793	2028/5/22
		HUNGARY	5.25	1,700	1,695	229,146	2029/6/16
		HUNGARY	2.125	1,400	1,098	148,421	2031/9/22
		HUNGARY	6.25	2,200	2,293	309,966	2032/9/22
		HUNGARY	3.125	1,800	1,121	151,575	2051/9/21
		MEXICO GLOBAL	3.75	1,700	1,113	150,461	2071/4/19
		OMAN GOV INTERNTL BOND	6.0	3,300	3,375	456,262	2029/8/1
		OMAN GOV INTERNTL BOND	6.25	2,300	2,380	321,697	2031/1/25
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN	4.4	1,000	1,006	136,049	2027/6/6
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN	4.7	1,500	1,529	206,706	2032/6/6
		REPUBLIC OF ARGENTINA	1.0	3,975	1,020	137,883	2029/7/9
		REPUBLIC OF ARGENTINA	0.5	4,165	1,093	147,821	2030/7/9
		REPUBLIC OF ARGENTINA	1.5	10,237	2,467	333,500	2035/7/9
		REPUBLIC OF ARGENTINA	3.875	6,286	1,891	255,585	2038/1/9
		REPUBLIC OF ARGENTINA	3.5	3,800	1,035	139,922	2041/7/9
		REPUBLIC OF ARGENTINA	1.5	1,000	245	33,237	2046/7/9
		REPUBLIC OF CHILE	2.75	1,200	1,137	153,730	2027/1/31
		REPUBLIC OF CHILE	2.45	1,400	1,230	166,369	2031/1/31
		REPUBLIC OF CHILE	2.55	1,100	955	129,199	2032/1/27
		REPUBLIC OF CHILE	2.55	1,100	918	124,113	2033/7/27
		REPUBLIC OF CHILE	3.5	1,800	1,617	218,594	2034/1/31
		REPUBLIC OF CHILE	3.1	1,200	914	123,620	2041/5/7
		REPUBLIC OF CHILE	4.34	2,700	2,422	327,428	2042/3/7
		REPUBLIC OF CHILE	3.5	1,600	1,204	162,818	2050/1/25
		REPUBLIC OF CHILE	3.5	1,700	1,265	171,097	2053/4/15
		REPUBLIC OF CHILE	3.1	1,200	782	105,813	2061/1/22
		REPUBLIC OF COLOMBIA	4.5	1,900	1,657	223,996	2029/3/15
		REPUBLIC OF COLOMBIA	3.0	1,800	1,383	186,961	2030/1/30
		REPUBLIC OF COLOMBIA	3.125	2,100	1,565	211,585	2031/4/15
		REPUBLIC OF COLOMBIA	3.25	1,600	1,160	156,782	2032/4/22
		REPUBLIC OF COLOMBIA	8.0	1,700	1,695	229,085	2033/4/20
		REPUBLIC OF COLOMBIA	7.5	1,200	1,149	155,335	2034/2/2
		REPUBLIC OF COLOMBIA	5.2	2,600	1,739	235,037	2049/5/15
		REPUBLIC OF COLOMBIA	4.125	1,500	875	118,364	2051/5/15
		REPUBLIC OF ECUADOR	5.5	3,400	1,886	254,907	2030/7/31
		REPUBLIC OF ECUADOR	2.5	7,500	3,000	405,500	2035/7/31
		REPUBLIC OF ECUADOR	1.5	2,600	936	126,500	2040/7/31
		REPUBLIC OF INDONESIA	3.85	1,600	1,540	208,190	2030/10/15
		REPUBLIC OF INDONESIA	4.2	2,300	2,008	271,444	2050/10/15
		REPUBLIC OF INDONESIA	3.05	800	594	80,409	2051/3/12

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	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	REPUBLIC OF NIGERIA	7.375	1,300	880	119,033	2033/9/28
		REPUBLIC OF PANAMA	3.16	1,200	1,055	142,639	2030/1/23
		REPUBLIC OF PANAMA	2.252	1,500	1,151	155,594	2032/9/29
		REPUBLIC OF PANAMA	6.4	2,400	2,510	339,298	2035/2/14
		REPUBLIC OF PANAMA	4.5	3,200	2,374	320,978	2056/4/1
		REPUBLIC OF PANAMA	3.87	1,200	781	105,676	2060/7/23
		REPUBLIC OF PANAMA	4.5	1,900	1,365	184,486	2063/1/19
		REPUBLIC OF PERU	2.783	3,000	2,580	348,801	2031/1/23
		REPUBLIC OF PERU	3.0	2,200	1,823	246,440	2034/1/15
		REPUBLIC OF PERU	3.55	1,800	1,324	178,960	2051/3/10
		REPUBLIC OF PERU	2.78	1,500	891	120,496	2060/12/1
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	3.75	1,600	1,551	209,718	2029/1/14
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	2.65	900	622	84,065	2045/12/10
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	3.2	2,300	1,732	234,179	2046/7/6
		REPUBLIC OF POLAND	5.5	1,500	1,577	213,176	2027/11/16
		REPUBLIC OF POLAND	5.75	1,200	1,305	176,398	2032/11/16
		REPUBLIC OF POLAND	4.875	2,200	2,244	303,321	2033/10/4
		REPUBLIC OF POLAND	5.5	2,300	2,375	321,065	2053/4/4
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.85	1,700	1,520	205,488	2029/9/30
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.75	2,000	1,415	191,283	2049/9/30
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.3	2,200	1,849	250,015	2052/4/20
		REPUBLIC OF SRI LANKA	—	600	203	27,545	2027/5/11
		REPUBLIC OF TURKEY	6.35	2,100	2,046	276,648	2024/8/10
		REPUBLIC OF TURKEY	5.6	1,500	1,434	193,861	2024/11/14
		REPUBLIC OF TURKEY	4.25	1,500	1,383	187,001	2025/3/13
		REPUBLIC OF TURKEY	6.375	2,800	2,643	357,232	2025/10/14
		REPUBLIC OF TURKEY	4.75	2,000	1,807	244,302	2026/1/26
		REPUBLIC OF TURKEY	8.6	1,400	1,388	187,673	2027/9/24
		REPUBLIC OF TURKEY	9.875	3,300	3,385	457,524	2028/1/15
		REPUBLIC OF TURKEY	9.375	400	401	54,315	2029/3/14
		REPUBLIC OF TURKEY	7.625	1,300	1,228	166,017	2029/4/26
		REPUBLIC OF TURKEY	5.25	1,000	824	111,451	2030/3/13
		REPUBLIC OF TURKEY	9.125	1,200	1,191	161,095	2030/7/13
		REPUBLIC OF TURKEY	5.95	1,100	922	124,677	2031/1/15
		REPUBLIC OF TURKEY	5.875	600	499	67,531	2031/6/26
		REPUBLIC OF TURKEY	9.375	2,100	2,112	285,483	2033/1/19
		REPUBLIC OF TURKEY	6.5	500	422	57,097	2033/9/20
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4.375	2,000	2,009	271,644	2031/1/23
		ROMANIA	7.125	1,500	1,610	217,672	2033/1/17
		ROMANIA	4.0	1,500	1,043	141,091	2051/2/14
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	2.9	2,100	2,034	274,997	2025/10/22
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	4.75	1,700	1,736	234,677	2028/1/18
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	4.375	4,100	4,131	558,377	2029/4/16
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	3.25	2,800	2,615	353,434	2030/10/22
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	5.5	2,400	2,594	350,623	2032/10/25
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	2.25	1,200	997	134,799	2033/2/2
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	4.875	500	514	69,584	2033/7/18

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	SAUDI INTERNATIONAL BOND	5.25	1,300	1,275	172,382	2050/1/16
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	5.0	2,700	2,528	341,699	2053/1/18
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	3.75	900	689	93,242	2055/1/21
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	4.5	1,800	1,581	213,712	2060/4/22
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	3.45	900	642	86,797	2061/2/2
		STATE OF QATAR	3.375	1,400	1,381	186,674	2024/3/14
		STATE OF QATAR	3.4	1,400	1,373	185,692	2025/4/16
		STATE OF QATAR	4.0	3,500	3,513	474,843	2029/3/14
		STATE OF QATAR	3.75	1,800	1,775	240,010	2030/4/16
		STATE OF QATAR	4.817	4,200	4,113	555,908	2049/3/14
		STATE OF QATAR	4.4	3,700	3,424	462,800	2050/4/16
		UAE INT'L GOVT BOND	4.05	1,800	1,803	243,761	2032/7/7
		UAE INT'L GOVT BOND	3.25	1,000	744	100,633	2061/10/19
		UKRAINE GOVERNMENT	—	2,000	357	48,326	2028/11/1
		UKRAINE GOVERNMENT	—	1,200	203	27,460	2029/5/21
		UKRAINE GOVERNMENT	—	2,100	346	46,810	2033/3/15
		UNITED MEXICAN STATES	4.5	1,800	1,769	239,133	2029/4/22
		UNITED MEXICAN STATES	3.25	1,100	990	133,816	2030/4/16
		UNITED MEXICAN STATES	2.659	1,600	1,342	181,498	2031/5/24
		UNITED MEXICAN STATES	4.75	1,000	965	130,484	2032/4/27
		UNITED MEXICAN STATES	4.875	2,200	2,115	285,871	2033/5/19
		UNITED MEXICAN STATES	3.5	1,300	1,102	149,036	2034/2/12
		UNITED MEXICAN STATES	6.35	1,500	1,591	215,094	2035/2/9
		UNITED MEXICAN STATES	4.28	1,700	1,386	187,376	2041/8/14
		UNITED MEXICAN STATES	4.5	400	320	43,261	2050/1/31
		UNITED MEXICAN STATES	5.0	2,500	2,127	287,476	2051/4/27
		UNITED MEXICAN STATES	4.4	2,200	1,691	228,572	2052/2/12
		UNITED MEXICAN STATES	6.338	300	299	40,529	2053/5/4
		UNITED MEXICAN STATES	3.771	1,300	866	117,111	2061/5/24
合計						30,267,004	

＊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

（2023年５月10日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	30,267,004	98.3
コール・ローン等、その他	509,815	1.7
投資信託財産総額	30,776,819	100.0

＊金額の単位未満は切り捨て。
＊当期末における外貨建純資産（30,661,762千円）の投資信託財産総額（30,776,819千円）に対する比率は99.6%です。
＊外貨建資産は、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＝135.15円、１ユーロ＝148.23円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年５月10日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	30,822,691,069
コール・ローン等	124,989,078
公社債(評価額)	30,267,004,052
未収入金	45,937,400
未収利息	331,173,773
前払費用	53,586,766
(B) 負債	99,475,609
未払金	86,579,096
未払解約金	12,780,992
未払利息	121
その他未払費用	115,400
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	30,723,215,460
元本	15,769,488,089
次期繰越損益金	14,953,727,371
(D) 受益権総口数	15,769,488,089口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	19,483円

(注) 期首元本額は11,393,726,957円、期中追加設定元本額は11,617,235,118円、期中一部解約元本額は7,241,473,986円、１口当たり純資産額は1.9483円です。

○損益の状況 (2022年５月11日～2023年５月10日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	1,414,889,323
受取利息	1,414,894,851
その他収益金	49,386
支払利息	△ 54,914
(B) 有価証券売買損益	△ 173,352,877
売買益	1,506,111,336
売買損	△ 1,679,464,213
(C) 保管費用等	△ 3,599,247
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	1,237,937,199
(E) 前期繰越損益金	9,790,397,683
(F) 追加信託差損益金	10,518,939,541
(G) 解約差損益金	△ 6,593,547,052
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	14,953,727,371
次期繰越損益金(Ｈ)	14,953,727,371

＊損益の状況の中で**(B)有価証券売買損益**は期末の評価換えによるものを含みます。
＊損益の状況の中で**(F)追加信託差損益金**とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
＊損益の状況の中で**(G)解約差損益金**とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村新興国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	6,421,426,002
野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	3,203,165,523
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)	1,732,782,619
NEXT FUNDS 新興国債券・J.P.モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(為替ヘッジなし)連動型上場投信	1,274,022,973
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	1,063,526,437
野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型	490,828,703
野村DC運用戦略ファンド	410,408,126
新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用)	403,850,406
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	361,064,318
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	165,207,991

ファンド名	当期末 元本額
	円
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)	160,785,574
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	35,103,135
インデックス・ブレンド(タイプⅢ)	12,734,694
ネクストコア	11,375,571
インデックス・ブレンド(タイプⅤ)	9,012,001
インデックス・ブレンド(タイプⅣ)	3,841,919
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	3,168,844
インデックス・ブレンド(タイプⅠ)	2,843,861
インデックス・ブレンド(タイプⅡ)	2,175,790
ノムラ新興国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	2,163,602

○お知らせ

該当事項はございません。