

# 野村インデックスファンド・ 外国債券

## 愛称：Funds-i 外国債券

### 運用報告書(全体版)

第7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。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	2010年11月26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（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とし、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。実質組入外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主な投資対象	野村インデックス ファンド・外国債券 マザーファンド	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資する場合があります。
		外国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村インデックス ファンド・外国債券	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。 外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、利子・配当等収益等を中心として基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

### 野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋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/>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 分 配	み 金 騰 落	期 騰 落	中 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
3期(2013年9月6日)	12,793	0	26.9	130.11	27.9	98.1	—	315
4期(2014年9月8日)	14,464	0	13.1	147.78	13.6	98.8	—	635
5期(2015年9月7日)	15,483	0	7.0	159.21	7.7	99.0	—	1,167
6期(2016年9月6日)	14,136	0	△8.7	146.04	△8.3	99.1	—	1,303
7期(2017年9月6日)	14,962	0	5.8	156.11	6.9	99.1	—	1,529

\*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 (=シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)) は、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日  
前日の指数値をもとに、設定時を100として指数化しています。

(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 シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
	円	%		%	%	%
(期首) 2016年9月6日	14,136	—	146.04	—	99.1	—
9月末	13,816	△2.3	143.96	△1.4	99.0	—
10月末	13,831	△2.2	143.80	△1.5	98.9	—
11月末	14,377	1.7	149.51	2.4	99.1	—
12月末	14,818	4.8	153.38	5.0	99.0	—
2017年1月末	14,457	2.3	150.06	2.8	98.8	—
2月末	14,374	1.7	149.02	2.0	99.0	—
3月末	14,371	1.7	148.53	1.7	99.0	—
4月末	14,452	2.2	150.11	2.8	99.0	—
5月末	14,662	3.7	152.57	4.5	99.0	—
6月末	14,935	5.7	156.15	6.9	99.0	—
7月末	14,916	5.5	156.13	6.9	98.9	—
8月末	15,125	7.0	157.32	7.7	98.6	—
(期末) 2017年9月6日	14,962	5.8	156.11	6.9	99.1	—

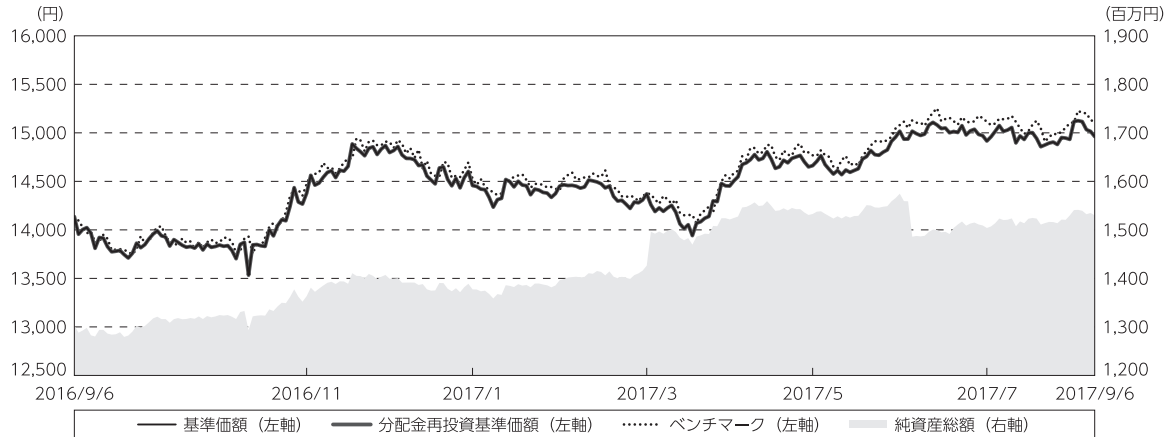
\*騰落率は期首比です。

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

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



期首：14,136円

期末：14,962円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 5.8% (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。作成年首(2016年9月6日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)です。ベンチマークは、作成年首(2016年9月6日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首14,136円から期末14,962円へと上昇し、値上がり額は826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)したことはマイナスに影響しましたが、内外長期金利差の拡大やフランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景に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

米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、同氏の拡張的な財政政策方針による景気加速や財政赤字拡大への警戒感が高まったこと、FRB（米連邦準備制度理事会）による政策金利の引き上げ、ユーロ圏の景況感回復やECB（欧州中央銀行）による金融緩和姿勢の後退懸念などを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に上昇（価格は下落）しました。

為替市場は、内外長期金利差の拡大やフランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景に、主要通貨が対円で上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [野村インデックスファンド・外国債券]

シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きを概ね捉えるために、外国債券マザーファンドへ投資しました。マザーファンドの組入比率は期を通じて高位に維持しました。

### [外国債券マザーファンド]

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

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+5.8%となり、ベンチマークの+6.9%を1.1ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

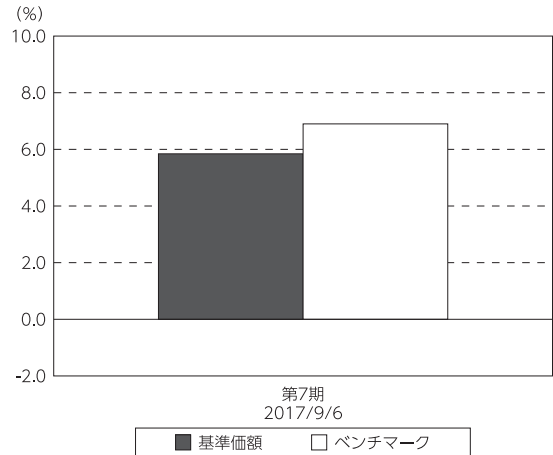
### (マイナス要因)

コスト負担（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、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。

## ◎分配金

- (1) 収益分配金は、基準価額水準等を勘案し見送らせていただきました。
- (2) 留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第7期
	2016年9月7日～ 2017年9月6日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,961

(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

### 【野村インデックスファンド・外国債券】

引き続き、主要投資対象である〔外国債券マザーファンド〕を高位に組入れ、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きを概ね捉える運用を行ってまいります。

### 【外国債券マザーファンド】

引き続き、外国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きを概ね捉える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。

シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・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（為替ヘッジを行なわない円ベースの指数）です。  
シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・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。

## ○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) 信 託 報 酬	円 86	% 0.594	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	(41)	(0.281)	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 )	(41)	(0.281)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
( 受 託 会 社 )	( 5 )	(0.032)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	2	0.013	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
( 保 管 費 用 )	( 2 )	(0.011)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
( 監 査 費 用 )	( 0 )	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
( そ の 他 )	( 0 )	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	88	0.607	
期中の平均基準価額は、14,511円です。			

\*期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

\*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2016年9月7日～2017年9月6日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券マザーファンド	千口 172,645	千円 371,831	千口 109,131	千円 238,838

\*単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2016年9月7日～2017年9月6日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;野村インデックスファンド・外国債券&gt;

該当事項はございません。

&lt;外国債券マザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A			売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 53,397	百万円 1,588	% 3.0	百万円 83,564	百万円 2,769	% 3.3

平均保有割合 0.2%

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

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

## ○組入資産の明細

(2017年9月6日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数		口 数	評 価 額
外国債券マザーファンド	千口 619,197		千口 682,710	千円 1,529,817

\*口数・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
外国債券マザーファンド	千円 1,529,817	% 99.6
コール・ローン等、その他	6,188	0.4
投資信託財産総額	1,536,005	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産(651,519,469千円)の投資信託財産総額(658,115,875千円)に対する比率は99.0%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リンギ=25.57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	1,536,005,256
コール・ローン等	6,187,292
外国債券マザーファンド(評価額)	1,529,817,964
(B) 負債	6,033,846
未払解約金	1,512,199
未払信託報酬	4,505,314
未払利息	9
その他未払費用	16,324
(C) 純資産総額(A-B)	1,529,971,410
元本	1,022,603,915
次期繰越損益金	507,367,495
(D) 受益権総口数	1,022,603,915口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,962円

(注) 期首元本額は921,954,662円、期中追加設定元本額は430,343,334円、期中一部解約元本額は329,694,081円、1口当たり純資産額は1.4962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	△ 1,621
支払利息	△ 1,621
(B) 有価証券売買損益	80,012,727
売買益	96,132,608
売買損	△ 16,119,881
(C) 信託報酬等	△ 8,524,689
(D) 当期損益金(A+B+C)	71,486,417
(E) 前期繰越損益金	△ 63,393,636
(F) 追加信託差損益金	499,274,714
(配当等相当額)	( 242,219,802)
(売買損益相当額)	( 257,054,912)
(G) 計(D+E+F)	507,367,495
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	507,367,495
追加信託差損益金	499,274,714
(配当等相当額)	( 243,741,119)
(売買損益相当額)	( 255,533,595)
分配準備積立金	81,737,472
繰越損益金	△ 73,644,691

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

\*損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

(注) 分配金の計算過程(2016年9月7日～2017年9月6日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年9月7日～ 2017年9月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	37,324,408円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	425,630,023円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	44,413,064円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	507,367,495円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,961円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

## ○分配金のお知らせ

---

1 万口当たり分配金 (税込み)	0円
------------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合

分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

---

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＞

## ○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2017年9月6日現在)

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

下記は、外国債券マザーファンド全体(290,863,517千口)の内容です。

## 外国公社債

## (A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区分	当 期 末								
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	千円			5年以上	2年以上	2年未満	
アメリカ	千米ドル 2,435,520	千米ドル 2,558,922	千円 278,001,332	% 42.7	% —	% 18.2	% 16.6	% 7.9	
カナダ	千カナダドル 145,430	千カナダドル 159,107	13,963,272	2.1	—	1.0	0.6	0.6	
イギリス	千英ポンド 241,630	千英ポンド 317,882	45,015,292	6.9	—	5.2	1.5	0.2	
スイス	千スイスフラン 8,250	千スイスフラン 10,264	1,168,864	0.2	—	0.1	0.1	—	
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 200,150	千スウェーデンクローナ 230,390	3,142,530	0.5	—	0.3	0.2	—	
ノルウェー	千ノルウェークローネ 128,300	千ノルウェークローネ 138,924	1,943,557	0.3	—	0.2	0.1	0.1	
デンマーク	千デンマーククローネ 187,970	千デンマーククローネ 236,396	4,118,027	0.6	—	0.4	0.2	0.0	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ							
ドイツ	259,250	329,639	42,694,952	6.6	—	4.3	1.9	0.3	
イタリア	424,330	512,180	66,337,654	10.2	—	6.1	2.9	1.1	
フランス	397,500	504,051	65,284,797	10.0	—	6.8	2.5	0.6	
オランダ	84,000	104,262	13,504,115	2.1	—	1.5	0.4	0.2	
スペイン	251,800	313,427	40,595,112	6.2	—	4.0	1.7	0.5	
ベルギー	100,000	130,345	16,882,367	2.6	—	2.0	0.5	0.1	
オーストリア	61,200	76,819	9,949,681	1.5	—	1.1	0.3	0.1	
フィンランド	22,100	25,120	3,253,575	0.5	—	0.4	0.1	0.0	
アイルランド	45,630	52,618	6,815,209	1.0	—	0.5	0.3	0.2	
ポーランド	千ズロチ 128,100	千ズロチ 136,295	4,170,655	0.6	—	0.3	0.3	0.1	
シンガポール	千シンガポールドル 29,780	千シンガポールドル 31,661	2,543,669	0.4	—	0.2	0.1	0.1	
マレーシア	千リンギ 108,200	千リンギ 108,815	2,782,408	0.4	—	0.2	0.2	0.0	
オーストラリア	千豪ドル 153,690	千豪ドル 165,346	14,390,146	2.2	—	1.3	0.7	0.2	
メキシコ	千メキシコペソ 891,900	千メキシコペソ 939,858	5,714,339	0.9	—	0.5	0.3	0.1	
南アフリカ	千ランド 465,300	千ランド 429,743	3,614,142	0.6	—	0.5	0.1	0.0	
合 計	—	—	645,885,706	99.1	—	55.0	31.7	12.4	

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

\* 金額の単位未満は切り捨て。

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

## (B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当期末					償還年月日
		利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円		
	国債証券						
	US TREASURY BOND	8.125	21,390	24,197	2,628,809	2019/8/15	
	US TREASURY BOND	8.75	12,700	15,382	1,671,141	2020/8/15	
	US TREASURY BOND	8.0	21,100	26,618	2,891,884	2021/11/15	
	US TREASURY BOND	6.25	13,800	17,297	1,879,193	2023/8/15	
	US TREASURY BOND	2.375	50,100	51,689	5,615,504	2024/8/15	
	US TREASURY BOND	6.0	39,200	51,520	5,597,180	2026/2/15	
	US TREASURY BOND	6.5	18,800	25,885	2,812,173	2026/11/15	
	US TREASURY BOND	6.125	23,700	32,548	3,536,081	2027/11/15	
	US TREASURY BOND	5.5	17,000	22,636	2,459,236	2028/8/15	
	US TREASURY BOND	5.25	5,000	6,560	712,780	2028/11/15	
	US TREASURY BOND	5.25	800	1,053	114,459	2029/2/15	
	US TREASURY BOND	4.375	100	130	14,221	2038/2/15	
	US TREASURY BOND	2.875	25,300	26,347	2,862,400	2043/5/15	
	US TREASURY BOND	3.75	16,000	19,362	2,103,541	2043/11/15	
	US TREASURY N/B	1.5	8,800	8,822	958,496	2018/8/31	
	US TREASURY N/B	1.0	800	798	86,708	2018/9/15	
	US TREASURY N/B	1.375	27,400	27,440	2,981,154	2018/9/30	
	US TREASURY N/B	0.75	10,000	9,948	1,080,840	2018/9/30	
	US TREASURY N/B	0.875	2,400	2,390	259,676	2018/10/15	
	US TREASURY N/B	1.75	9,900	9,956	1,081,711	2018/10/31	
	US TREASURY N/B	1.25	21,400	21,401	2,325,077	2018/10/31	
	US TREASURY N/B	0.75	700	696	75,614	2018/10/31	
	US TREASURY N/B	3.75	40,900	42,096	4,573,379	2018/11/15	
	US TREASURY N/B	1.25	7,300	7,300	793,102	2018/11/15	
	US TREASURY N/B	1.375	500	500	54,394	2018/11/30	
	US TREASURY N/B	1.25	6,000	5,999	651,738	2018/11/30	
	US TREASURY N/B	1.25	700	699	76,045	2018/12/15	
	US TREASURY N/B	1.375	6,500	6,509	707,235	2018/12/31	
	US TREASURY N/B	1.5	5,500	5,518	599,480	2018/12/31	
	US TREASURY N/B	1.125	5,100	5,092	553,219	2019/1/15	
	US TREASURY N/B	1.25	8,100	8,099	879,949	2019/1/31	
	US TREASURY N/B	1.5	3,500	3,511	381,517	2019/1/31	
	US TREASURY N/B	1.125	1,000	998	108,457	2019/1/31	
	US TREASURY N/B	2.75	37,500	38,299	4,160,890	2019/2/15	
	US TREASURY N/B	0.75	200	198	21,574	2019/2/15	
	US TREASURY N/B	1.375	17,100	17,120	1,859,993	2019/2/28	
	US TREASURY N/B	1.5	16,200	16,256	1,766,155	2019/2/28	
	US TREASURY N/B	1.0	10,800	10,754	1,168,407	2019/3/15	
	US TREASURY N/B	1.5	4,000	4,015	436,189	2019/3/31	
	US TREASURY N/B	1.625	25,500	25,643	2,785,903	2019/3/31	
	US TREASURY N/B	1.25	14,300	14,296	1,553,127	2019/3/31	
	US TREASURY N/B	0.875	3,500	3,477	377,818	2019/4/15	
	US TREASURY N/B	1.25	5,000	4,998	543,009	2019/4/30	
	US TREASURY N/B	1.625	5,600	5,634	612,138	2019/4/30	
	US TREASURY N/B	3.125	27,600	28,437	3,089,471	2019/5/15	
	US TREASURY N/B	0.875	3,600	3,576	388,522	2019/5/15	
	US TREASURY N/B	1.125	1,400	1,396	151,721	2019/5/31	
	US TREASURY N/B	1.5	10,600	10,640	1,155,992	2019/5/31	
	US TREASURY N/B	1.25	2,100	2,099	228,063	2019/5/31	

銘柄	当	期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY N/B	0.875	900	893	97,092	2019/6/15
	US TREASURY N/B	1.0	1,400	1,393	151,353	2019/6/30
	US TREASURY N/B	1.625	7,900	7,948	863,485	2019/6/30
	US TREASURY N/B	1.25	1,900	1,898	206,295	2019/6/30
	US TREASURY N/B	0.75	10,500	10,397	1,129,535	2019/7/15
	US TREASURY N/B	1.625	14,500	14,591	1,585,248	2019/7/31
	US TREASURY N/B	3.625	32,400	33,856	3,678,195	2019/8/15
	US TREASURY N/B	0.75	10,000	9,897	1,075,238	2019/8/15
	US TREASURY N/B	1.0	3,000	2,983	324,073	2019/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	11,750	11,825	1,284,747	2019/8/31
	US TREASURY N/B	1.0	3,000	2,982	324,023	2019/9/30
	US TREASURY N/B	1.75	18,500	18,667	2,028,054	2019/9/30
	US TREASURY N/B	3.375	49,300	51,510	5,596,132	2019/11/15
	US TREASURY N/B	1.0	8,800	8,741	949,720	2019/11/30
	US TREASURY N/B	1.5	1,800	1,807	196,361	2019/11/30
	US TREASURY N/B	1.125	12,000	11,949	1,298,231	2019/12/31
	US TREASURY N/B	1.625	3,800	3,826	415,670	2019/12/31
	US TREASURY N/B	1.375	2,000	2,002	217,543	2020/1/31
	US TREASURY N/B	1.25	5,400	5,390	585,601	2020/1/31
	US TREASURY N/B	3.625	51,800	54,653	5,937,506	2020/2/15
	US TREASURY N/B	1.25	2,700	2,694	292,720	2020/2/29
	US TREASURY N/B	1.375	5,000	5,004	543,666	2020/2/29
	US TREASURY N/B	1.625	5,000	5,035	547,040	2020/3/15
	US TREASURY N/B	1.125	4,000	3,978	432,183	2020/3/31
	US TREASURY N/B	1.375	21,300	21,318	2,316,020	2020/3/31
	US TREASURY N/B	1.375	1,100	1,100	119,578	2020/4/30
	US TREASURY N/B	3.5	47,200	49,877	5,418,650	2020/5/15
	US TREASURY N/B	1.5	5,200	5,217	566,869	2020/5/31
	US TREASURY N/B	1.875	16,600	16,831	1,828,573	2020/6/30
	US TREASURY N/B	1.625	12,400	12,484	1,356,292	2020/6/30
	US TREASURY N/B	2.0	13,400	13,634	1,481,252	2020/7/31
	US TREASURY N/B	2.625	42,180	43,671	4,744,431	2020/8/15
	US TREASURY N/B	2.125	37,600	38,393	4,171,028	2020/8/31
	US TREASURY N/B	2.0	6,000	6,105	663,247	2020/9/30
	US TREASURY N/B	1.75	1,600	1,616	175,562	2020/10/31
	US TREASURY N/B	2.625	52,600	54,539	5,925,184	2020/11/15
	US TREASURY N/B	2.375	6,800	7,002	760,741	2020/12/31
	US TREASURY N/B	2.125	5,300	5,415	588,387	2021/1/31
	US TREASURY N/B	1.375	7,000	6,978	758,103	2021/1/31
	US TREASURY N/B	3.625	45,800	49,116	5,336,062	2021/2/15
	US TREASURY N/B	2.0	5,000	5,088	552,790	2021/2/28
	US TREASURY N/B	1.125	10,000	9,879	1,073,329	2021/2/28
	US TREASURY N/B	2.25	1,800	1,847	200,700	2021/3/31
	US TREASURY N/B	2.25	10,900	11,189	1,215,630	2021/4/30
	US TREASURY N/B	3.125	38,400	40,634	4,414,586	2021/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	22,500	22,895	2,487,367	2021/5/31
	US TREASURY N/B	2.125	34,000	34,754	3,775,715	2021/6/30
	US TREASURY N/B	2.25	9,700	9,959	1,082,046	2021/7/31
	US TREASURY N/B	2.125	25,300	25,861	2,809,576	2021/8/15
	US TREASURY N/B	2.0	7,300	7,426	806,795	2021/8/31

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	16,000	16,355	1,776,807	2021/9/30
	US TREASURY N/B	2.0	10,000	10,171	1,105,072	2021/10/31
	US TREASURY N/B	2.0	26,000	26,455	2,874,071	2021/11/15
	US TREASURY N/B	1.875	8,000	8,101	880,187	2021/11/30
	US TREASURY N/B	2.125	12,400	12,676	1,377,130	2021/12/31
	US TREASURY N/B	1.5	8,000	7,965	865,385	2022/1/31
	US TREASURY N/B	1.875	10,000	10,114	1,098,876	2022/1/31
	US TREASURY N/B	2.0	33,700	34,292	3,725,524	2022/2/15
	US TREASURY N/B	1.75	7,300	7,345	798,028	2022/2/28
	US TREASURY N/B	1.75	9,900	9,957	1,081,753	2022/3/31
	US TREASURY N/B	1.75	35,000	35,185	3,822,600	2022/4/30
	US TREASURY N/B	1.875	19,500	19,710	2,141,319	2022/4/30
	US TREASURY N/B	1.75	23,900	24,036	2,611,304	2022/5/15
	US TREASURY N/B	2.125	27,600	28,203	3,064,055	2022/6/30
	US TREASURY N/B	1.625	20,300	20,282	2,203,496	2022/8/15
	US TREASURY N/B	1.625	12,800	12,761	1,386,409	2022/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	13,000	13,267	1,441,338	2022/12/31
	US TREASURY N/B	1.75	22,000	22,030	2,393,440	2023/1/31
	US TREASURY N/B	2.0	17,000	17,232	1,872,130	2023/2/15
	US TREASURY N/B	1.5	25,000	24,701	2,683,535	2023/2/28
	US TREASURY N/B	1.5	11,000	10,859	1,179,821	2023/3/31
	US TREASURY N/B	1.75	42,200	42,193	4,583,891	2023/5/15
	US TREASURY N/B	1.625	30,400	30,179	3,278,659	2023/5/31
	US TREASURY N/B	1.25	20,000	19,410	2,108,804	2023/7/31
	US TREASURY N/B	2.5	19,400	20,185	2,192,908	2023/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	16,800	17,742	1,927,531	2023/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	26,800	28,276	3,071,914	2024/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	25,100	26,102	2,835,725	2024/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	34,200	34,972	3,799,376	2024/11/15
	US TREASURY N/B	2.0	44,700	44,860	4,873,659	2025/2/15
	US TREASURY N/B	2.125	6,500	6,576	714,490	2025/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	14,500	14,520	1,577,495	2025/8/15
	US TREASURY N/B	2.25	50,300	51,262	5,569,187	2025/11/15
	US TREASURY N/B	1.625	2,000	1,938	210,642	2026/2/15
	US TREASURY N/B	1.625	800	774	84,107	2026/5/15
	US TREASURY N/B	1.5	12,000	11,466	1,245,727	2026/8/15
	US TREASURY N/B	2.25	21,900	22,240	2,416,205	2027/2/15
	US TREASURY N/B	5.375	2,100	2,881	313,091	2031/2/15
	US TREASURY N/B	4.5	100	133	14,451	2038/5/15
	US TREASURY N/B	3.5	100	116	12,645	2039/2/15
	US TREASURY N/B	4.25	200	257	28,010	2039/5/15
	US TREASURY N/B	4.5	200	266	28,949	2039/8/15
	US TREASURY N/B	4.375	3,200	4,197	455,962	2039/11/15
	US TREASURY N/B	4.625	8,000	10,851	1,178,879	2040/2/15
	US TREASURY N/B	4.375	5,900	7,749	841,881	2040/5/15
	US TREASURY N/B	3.875	7,200	8,830	959,365	2040/8/15
	US TREASURY N/B	4.25	7,800	10,094	1,096,710	2040/11/15
	US TREASURY N/B	4.75	7,000	9,696	1,053,383	2041/2/15
	US TREASURY N/B	4.375	6,700	8,838	960,186	2041/5/15
	US TREASURY N/B	3.125	6,500	7,104	771,810	2041/11/15

銘	柄	当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円		
	国債証券						
		US TREASURY N/B	3.125	3,200	3,496	379,859	2042/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	4,500	4,810	522,643	2042/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	9,300	9,499	1,032,058	2042/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	17,600	17,949	1,950,006	2042/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	24,200	26,366	2,864,473	2043/2/15
		US TREASURY N/B	3.625	15,400	18,242	1,981,917	2043/8/15
		US TREASURY N/B	3.625	12,200	14,482	1,573,404	2044/2/15
		US TREASURY N/B	3.375	18,900	21,532	2,339,313	2044/5/15
		US TREASURY N/B	3.125	30,600	33,365	3,624,877	2044/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	36,900	39,312	4,270,954	2044/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	27,600	26,627	2,892,814	2045/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	21,700	23,090	2,508,514	2045/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	2,000	2,076	225,631	2045/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	15,100	16,060	1,744,787	2045/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	12,500	12,027	1,306,650	2046/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	9,700	9,327	1,013,302	2046/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	1,300	1,183	128,587	2046/8/15
		US TREASURY N/B	2.875	11,000	11,413	1,239,947	2046/11/15
小	計					278,001,332	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル			
	国債証券	CANADA GOVERNMENT	2.75	4,600	4,857	426,311	2022/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	8,800	8,799	772,226	2018/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.5	10,000	9,911	869,868	2018/11/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.5	100	98	8,680	2019/2/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.75	4,500	4,530	397,589	2019/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	300	297	26,083	2019/5/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.75	10,000	10,411	913,730	2019/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.75	8,700	8,767	769,475	2019/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	6,300	6,319	554,635	2020/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5	7,800	8,238	723,039	2020/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	2,800	2,745	240,965	2020/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	8,200	8,004	702,447	2021/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.25	10,050	10,705	939,537	2021/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	300	291	25,603	2021/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.5	2,800	2,676	234,906	2022/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	700	681	59,773	2022/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	4,600	4,570	401,092	2023/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	5,700	5,990	525,683	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	6,600	6,838	600,189	2025/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	3,000	2,925	256,724	2026/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	8.0	3,400	5,254	461,149	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	3,300	3,047	267,438	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	1,300	1,309	114,926	2028/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	5,680	7,909	694,173	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	3,400	5,050	443,267	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	5,300	7,649	671,323	2037/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	3,900	5,122	449,515	2041/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5	9,500	11,875	1,042,191	2045/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	3,300	3,648	320,190	2048/12/1

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		
カナダ	%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	2.75	500	575	50,531	2064/12/1
小計					13,963,272	
イギリス		千英ポンド	千英ポンド			
国債証券	UK TREASURY	1.75	8,800	9,059	1,282,867	2019/7/22
	UK TREASURY	3.75	1,700	1,823	258,166	2019/9/7
	UK TREASURY	4.75	1,700	1,896	268,554	2020/3/7
	UK TREASURY	2.0	19,490	20,499	2,902,945	2020/7/22
	UK TREASURY	3.75	7,400	8,193	1,160,218	2020/9/7
	UK TREASURY	1.5	3,300	3,439	487,113	2021/1/22
	UK TREASURY	8.0	9,340	12,059	1,707,815	2021/6/7
	UK TREASURY	3.75	8,670	9,882	1,399,497	2021/9/7
	UK TREASURY	4.0	4,850	5,650	800,159	2022/3/7
	UK TREASURY	0.5	6,100	6,122	867,017	2022/7/22
	UK TREASURY	1.75	8,700	9,275	1,313,528	2022/9/7
	UK TREASURY	2.25	5,100	5,612	794,764	2023/9/7
	UK TREASURY	2.75	10,250	11,710	1,658,254	2024/9/7
	UK TREASURY	5.0	11,850	15,568	2,204,592	2025/3/7
	UK TREASURY	4.25	10,030	13,180	1,866,479	2027/12/7
	UK TREASURY	6.0	5,350	8,144	1,153,390	2028/12/7
	UK TREASURY	4.75	5,700	8,112	1,148,855	2030/12/7
	UK TREASURY	4.25	5,750	7,933	1,123,512	2032/6/7
	UK TREASURY	4.5	6,600	9,554	1,353,058	2034/9/7
	UK TREASURY	4.25	3,800	5,429	768,862	2036/3/7
	UK TREASURY	4.75	4,400	6,863	971,948	2038/12/7
	UK TREASURY	4.25	4,200	6,196	877,452	2039/9/7
	UK TREASURY	4.25	5,300	7,920	1,121,671	2040/12/7
	UK TREASURY	4.5	6,100	9,619	1,362,159	2042/12/7
	UK TREASURY	3.5	20,000	27,764	3,931,660	2045/1/22
	UK TREASURY	4.25	5,950	9,443	1,337,257	2046/12/7
	UK TREASURY	1.5	1,000	957	135,549	2047/7/22
	UK TREASURY	4.25	5,350	8,815	1,248,395	2049/12/7
	UK TREASURY	3.75	8,750	13,740	1,945,739	2052/7/22
	UK TREASURY	1.75	1,100	1,161	164,494	2057/7/22
	UK TREASURY	2.5	500	667	94,524	2065/7/22
	UK TREASURY	3.5	6,200	10,560	1,495,466	2068/7/22
	UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	20,300	26,860	3,803,780	2044/1/22
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	4.25	8,000	14,162	2,005,537	2055/12/7
小計					45,015,292	
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	4,750	5,232	595,836	2021/4/28
	SWITZERLAND GOVERNMENT	4.0	3,500	5,032	573,028	2028/4/8
小計					1,168,864	
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	39,700	46,631	636,055	2020/12/1
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5	53,400	62,411	851,289	2022/6/1
	SWEDISH GOVERNMENT	1.5	28,300	30,550	416,713	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT	2.5	35,650	41,250	562,658	2025/5/12
	SWEDISH GOVERNMENT	1.0	12,000	12,420	169,419	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	0.75	14,100	14,052	191,676	2028/5/12



銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
		外貨建金額			邦貨換算金額		
スウェーデン			%	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ	千円	
	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	3.5	17,000	23,073	314,717	2039/3/30
小 計						3,142,530	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	4.5	24,800	26,450	370,041	2019/5/22
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.75	27,600	30,503	426,744	2021/5/25
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	14,300	14,993	209,759	2023/5/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	44,900	49,955	698,880	2024/3/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	4,700	4,849	67,843	2025/3/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	4,700	4,733	66,219	2026/2/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	7,300	7,438	104,067	2027/2/17
小 計						1,943,557	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	0.25	2,500	2,527	44,029	2018/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.0	34,300	37,803	658,541	2019/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	3.0	37,100	42,379	738,247	2021/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.5	31,370	34,507	601,111	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	31,400	35,422	617,057	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	5,000	4,994	87,004	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	46,300	78,762	1,372,036	2039/11/15
小 計						4,118,027	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDES OBLIGATION	0.25	5,000	5,107	661,555	2019/10/11
		BUNDES OBLIGATION	—	3,600	3,668	475,163	2020/4/17
		BUNDES OBLIGATION	0.25	3,000	3,087	399,886	2020/10/16
		BUNDES OBLIGATION	—	1,600	1,635	211,844	2021/4/9
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.5	13,850	14,945	1,935,727	2019/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	6,700	7,332	949,650	2020/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0	4,100	4,535	587,443	2020/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	13,300	14,490	1,876,807	2020/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	13,300	14,714	1,905,764	2021/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	7,000	8,043	1,041,792	2021/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	8,400	9,358	1,212,083	2021/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	11,500	12,768	1,653,799	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	6,500	7,195	931,935	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,000	5,482	710,061	2022/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,200	5,722	741,204	2023/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,200	5,736	742,948	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	14,000	15,897	2,059,015	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	14,100	19,899	2,577,397	2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	5,700	6,423	831,920	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,500	1,668	216,072	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	10,300	11,112	1,439,246	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	4,700	4,893	633,805	2025/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	4,100	4,419	572,383	2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,300	1,343	174,019	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	2,300	2,296	297,461	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	19,400	31,182	4,038,769	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	6,000	9,243	1,197,262	2028/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	3,400	4,982	645,275	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	6,500	10,996	1,424,309	2030/1/4

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	5,300	8,675	1,123,618	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	5,800	9,496	1,229,986	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	5,000	7,831	1,014,351	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	7,000	11,630	1,506,375	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	8,200	14,640	1,896,210	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	3,900	5,807	752,221	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	6,500	8,635	1,118,425	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	11,000	14,740	1,909,153	2046/8/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	8,000	8,374	1,084,621	2018/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	16,300	17,324	2,243,926	2019/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	2,800	2,996	388,118	2019/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.1	6,300	6,332	820,235	2019/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	7,900	8,254	1,069,129	2019/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	1,800	1,857	240,542	2019/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	11,430	12,424	1,609,209	2019/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.05	400	410	53,113	2019/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	6,100	6,760	875,557	2020/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	29,200	32,274	4,180,226	2020/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	16,200	18,071	2,340,568	2020/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	2,000	2,030	262,977	2020/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	11,400	12,783	1,655,750	2021/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	10,000	11,247	1,456,711	2021/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	8,000	9,036	1,170,446	2021/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	13,400	15,683	2,031,308	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	4,550	4,530	586,839	2021/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	16,800	20,049	2,596,762	2022/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	10,400	12,798	1,657,628	2022/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	20,700	25,550	3,309,237	2022/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	4,000	4,000	518,183	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	6,700	7,983	1,034,025	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	9,300	11,267	1,459,415	2023/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	11,700	17,133	2,219,128	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	15,900	19,048	2,467,122	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.85	3,000	3,093	400,605	2024/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	2,300	2,653	343,712	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	14,900	18,536	2,400,904	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	3,000	2,978	385,727	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	3,000	3,064	396,952	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	10,500	12,786	1,656,159	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7.25	7,200	10,491	1,358,809	2026/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	19,050	26,877	3,481,192	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	6,300	7,892	1,022,173	2028/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	20,700	27,292	3,534,982	2029/11/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	18,300	25,982	3,365,232	2031/5/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	500	455	59,022	2032/3/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	6,400	9,027	1,169,202	2033/2/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,400	11,100	1,437,749	2034/8/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	6,700	7,946	1,029,278	2037/2/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,000	10,666	1,381,512	2039/8/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	15,600	20,613	2,669,904	2040/9/1		

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ							
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	11,600	14,976	1,939,789	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	6,100	6,235	807,611	2046/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	1,500	1,284	166,342	2067/3/1
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1.0	11,300	11,617	1,504,687	2019/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	10,300	10,552	1,366,775	2019/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,800	2,840	367,903	2020/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,100	1,116	144,596	2020/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	7,000	7,119	922,102	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	12,000	14,224	1,842,305	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	600	587	76,056	2036/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.0	6,000	6,118	792,414	2018/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	—	1,300	1,311	169,891	2019/2/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.25	11,500	12,420	1,608,638	2019/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	8.5	4,000	4,785	619,765	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.75	11,500	12,585	1,630,019	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.5	14,800	16,391	2,123,063	2020/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.5	27,300	29,904	3,873,220	2020/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	0.25	2,000	2,047	265,192	2020/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.75	11,800	13,618	1,763,928	2021/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	15,100	17,388	2,252,165	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.0	14,500	16,734	2,167,408	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.25	20,100	22,641	2,932,540	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	8.5	8,200	12,218	1,582,529	2023/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.25	31,300	39,572	5,125,441	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.75	3,000	3,339	432,496	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	6.0	19,800	28,957	3,750,575	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.0	6,000	6,304	816,597	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.5	33,100	41,752	5,407,763	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.75	9,200	11,063	1,432,998	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5.5	24,500	37,296	4,830,670	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.5	1,000	1,058	137,083	2031/5/25
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5.75	19,600	32,437	4,201,324	2032/10/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.75	6,600	10,294	1,333,332	2035/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	8,800	13,031	1,687,860	2038/10/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.5	16,900	27,060	3,504,878	2041/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	15,200	20,607	2,669,090	2045/5/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	5,500	8,820	1,142,447	2055/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	3,800	6,230	807,028	2060/4/25		
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	1.25	3,400	3,493	452,422	2019/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	6,500	7,073	916,218	2019/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	2,000	2,045	264,870	2020/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5	4,800	5,374	696,050	2020/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	7,900	9,066	1,174,233	2021/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	400	407	52,731	2022/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.25	1,500	1,690	218,953	2022/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	5,900	7,182	930,267	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	4,300	6,099	789,958	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	1,400	1,558	201,877	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	13,500	15,354	1,988,766	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	4,000	4,063	526,265	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		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ	オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	2,000	2,054	266,058	2027/7/15
			NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	7,300	11,045	1,430,629	2028/1/15
			NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	4,400	5,495	711,833	2033/1/15
			NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	4,000	6,209	804,223	2037/1/15
			NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	6,200	9,789	1,267,969	2042/1/15
			NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	4,500	6,259	810,783	2047/1/15
ユーロ	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.75	4,100	4,298	556,684	2018/10/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.25	7,200	7,261	940,569	2019/1/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	2,600	2,734	354,110	2019/4/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6	12,000	13,131	1,700,773	2019/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.3	13,900	15,279	1,979,010	2019/10/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0	25,250	28,079	3,636,907	2020/4/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.85	10,600	12,270	1,589,221	2020/10/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.05	400	401	52,033	2021/1/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5	9,900	11,898	1,541,146	2021/4/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	5,900	6,073	786,701	2021/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	10,350	12,958	1,678,362	2022/1/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	17,000	21,559	2,792,327	2023/1/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	8,000	9,843	1,274,911	2023/10/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	13,900	17,531	2,270,703	2024/1/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	6,700	8,018	1,038,563	2024/4/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	900	940	121,836	2025/4/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	15,600	19,873	2,574,031	2025/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	6,000	6,357	823,442	2026/4/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	18,400	25,599	3,315,675	2026/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	9,300	12,582	1,629,737	2028/10/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	5,400	7,648	990,641	2040/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	8,400	11,650	1,509,033	2041/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	7,800	11,494	1,488,713	2044/10/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	1,000	1,081	140,124	2066/7/30
SPANISH GOVERNMENT	6.0	17,500	25,480	3,300,183	2029/1/31			
SPANISH GOVERNMENT	5.75	8,500	12,645	1,637,838	2032/7/30			
SPANISH GOVERNMENT	4.2	5,200	6,731	871,827	2037/1/31			
ユーロ	ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.0	7,600	8,162	1,057,194	2019/9/28
			BELGIUM KINGDOM	3.75	5,800	6,570	850,954	2020/9/28
			BELGIUM KINGDOM	4.25	5,200	6,198	802,816	2021/9/28
			BELGIUM KINGDOM	4.0	4,800	5,763	746,506	2022/3/28
			BELGIUM KINGDOM	4.25	6,400	7,874	1,019,913	2022/9/28
			BELGIUM KINGDOM	2.25	5,000	5,690	737,011	2023/6/22
			BELGIUM KINGDOM	2.6	7,000	8,179	1,059,408	2024/6/22
			BELGIUM KINGDOM	4.5	8,400	11,336	1,468,313	2026/3/28
			BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	1,045	135,367	2026/6/22
			BELGIUM KINGDOM	0.8	2,000	2,029	262,828	2027/6/22
			BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	995	128,876	2031/6/22
			BELGIUM KINGDOM	4.0	3,500	4,919	637,233	2032/3/28
			BELGIUM KINGDOM	1.9	2,000	2,176	281,921	2038/6/22
			BELGIUM KINGDOM	4.25	6,400	9,944	1,287,982	2041/3/28
			BELGIUM KINGDOM	3.75	5,500	8,113	1,050,813	2045/6/22
			BELGIUM KINGDOM	1.6	1,000	973	126,066	2047/6/22
			BELGIUM KINGDOM	2.15	1,300	1,383	179,138	2066/6/22

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	
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM GOVT	4.0	3,200	3,431	444,452	2019/3/28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	11,900	17,844	2,311,230	2028/3/28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	11,000	17,714	2,294,334	2035/3/28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.35	2,500	2,690	348,518	2019/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.95	2,500	2,615	338,791	2019/6/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.25	2,400	2,445	316,754	2019/10/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9	5,600	6,318	818,405	2020/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5	4,400	5,105	661,241	2021/9/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	3,000	3,558	460,890	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	5,000	5,961	772,133	2022/11/22
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	2,000	2,011	260,516	2023/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	2,550	2,838	367,580	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	3,300	3,665	474,773	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	1,300	1,399	181,223	2025/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	5,400	7,497	971,128	2026/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	2,055	266,241	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	6,100	9,549	1,236,826	2027/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	1,000	1,213	157,146	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	6,200	9,504	1,231,014	2037/3/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	5,800	8,134	1,053,520	2044/6/20		
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	150	254	32,975	2062/1/26		
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	1.125	100	101	13,199	2018/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	4.375	1,300	1,420	184,046	2019/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	3.375	1,200	1,325	171,634	2020/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.375	2,300	2,363	306,177	2020/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	3.5	2,000	2,289	296,531	2021/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.625	3,200	3,504	453,840	2022/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	1,200	1,311	169,919	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	4.0	2,000	2,594	335,974	2025/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.875	1,000	1,050	136,075	2025/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,000	2,029	262,835	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	3,500	4,303	557,438	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.75	700	694	89,983	2031/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	1,600	2,130	275,919	2042/7/4
アイルランド	国債証券	IRELAND (REPUBLIC OF) 4.4	4.4	3,600	3,921	507,877	2019/6/18
		IRISH GOVERNMENT	4.5	6,550	6,915	895,694	2018/10/18
		IRISH GOVERNMENT	5.9	3,400	3,863	500,438	2019/10/18
		IRISH GOVERNMENT	4.5	6,180	6,991	905,578	2020/4/18
		IRISH GOVERNMENT	5.0	3,500	4,099	530,955	2020/10/18
		IRISH GOVERNMENT	5.4	3,500	4,787	620,014	2025/3/13
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	800	815	105,656	2037/5/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	2,500	2,618	339,206	2045/2/18
		IRISH TSY 2.4% 2030	2.4	4,600	5,289	685,101	2030/5/15
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	6,600	7,967	1,031,970	2024/3/18
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	4,400	5,348	692,715	2023/3/20
		小 計					265,317,466
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	—	5,300	5,213	159,536	2018/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	6,300	6,483	198,389	2019/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	7,500	8,092	247,630	2019/10/25

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		
ポーランド			%	千ズロチ	千ズロチ	千円	
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND		1.5	6,300	6,233	190,736	2020/4/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		5.25	30,700	33,671	1,030,355	2020/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		5.75	11,100	12,592	385,344	2021/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		5.75	10,000	11,502	351,961	2022/9/23
	POLAND GOVERNMENT BOND		4.0	12,500	13,390	409,753	2023/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		3.25	23,000	23,389	715,729	2025/7/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		2.5	9,500	9,011	275,758	2026/7/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		2.5	2,200	2,065	63,213	2027/7/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		5.75	3,700	4,648	142,246	2029/4/25
小 計						4,170,655	
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		4.0	1,050	1,078	86,659	2018/9/1
	SINGAPORE GOVERNMENT		2.5	4,950	5,054	406,097	2019/6/1
	SINGAPORE GOVERNMENT		3.25	4,000	4,218	338,906	2020/9/1
	SINGAPORE GOVERNMENT		2.25	2,980	3,061	245,949	2021/6/1
	SINGAPORE GOVERNMENT		3.125	1,400	1,500	120,551	2022/9/1
	SINGAPORE GOVERNMENT		2.75	3,000	3,172	254,854	2023/7/1
	SINGAPORE GOVERNMENT		3.0	2,300	2,474	198,825	2024/9/1
	SINGAPORE GOVERNMENT		3.5	3,900	4,389	352,670	2027/3/1
	SINGAPORE GOVERNMENT		2.875	2,400	2,581	207,373	2030/9/1
	SINGAPORE GOVERNMENT		3.375	500	570	45,846	2033/9/1
	SINGAPORE GOVERNMENT		2.75	3,300	3,559	285,934	2042/4/1
小 計						2,543,669	
マレーシア				千リンギ	千リンギ		
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT		4.059	400	405	10,358	2024/9/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT		3.58	2,800	2,815	71,982	2018/9/28
	MALAYSIAN GOVERNMENT		3.759	900	907	23,203	2019/3/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		3.654	3,400	3,421	87,500	2019/10/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT		4.378	11,900	12,158	310,881	2019/11/29
	MALAYSIAN GOVERNMENT		3.492	6,600	6,611	169,048	2020/3/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT		3.889	2,400	2,429	62,114	2020/7/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT		4.16	6,000	6,137	156,927	2021/7/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		4.048	8,700	8,862	226,608	2021/9/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT		3.418	4,600	4,537	116,034	2022/8/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		3.48	11,000	10,828	276,882	2023/3/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		4.181	5,800	5,897	150,797	2024/7/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		3.955	600	600	15,364	2025/9/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		4.392	8,800	9,035	231,033	2026/4/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		3.502	7,000	6,680	170,818	2027/5/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT		3.733	1,800	1,728	44,185	2028/6/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		5.248	2,700	2,928	74,878	2028/9/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		4.498	5,700	5,791	148,080	2030/4/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		4.232	4,400	4,348	111,179	2031/6/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT		4.127	4,700	4,566	116,776	2032/4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT		3.844	400	378	9,679	2033/4/15	
MALAYSIAN GOVERNMENT		4.935	7,600	7,746	198,072	2043/9/30	
小 計						2,782,408	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT		3.25	60	61	5,313	2018/10/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		5.25	12,900	13,578	1,181,753	2019/3/15

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		
オーストラリア		%	千豪ドル	千豪ドル	千円	
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	5,200	5,294	460,740	2019/10/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	13,100	13,948	1,213,907	2020/4/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	10,700	10,606	923,043	2020/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	10,200	11,522	1,002,838	2021/5/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0	400	397	34,578	2021/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	8,400	9,766	849,957	2022/7/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	8,100	9,457	823,090	2023/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	7,200	7,353	639,994	2024/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	17,600	18,498	1,609,936	2025/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	12,780	14,447	1,257,391	2026/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	10,950	12,918	1,124,263	2027/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	800	805	70,096	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	9,000	8,637	751,704	2028/5/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	10,100	10,585	921,239	2029/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	5,000	5,952	518,072	2033/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,800	1,710	148,851	2035/6/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	5,400	5,843	508,574	2037/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	3,800	3,779	328,961	2039/6/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	200	181	15,837	2047/3/21
小計					14,390,146	
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	8.5	65,200	66,574	404,770	2018/12/13
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	107,000	103,167	627,256	2019/12/11
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	70,700	73,068	444,258	2020/6/11
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	126,000	125,203	761,238	2021/6/10
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	48,400	47,971	291,664	2022/6/9
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	41,700	49,497	300,942	2024/12/5
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	8,000	7,443	45,259	2026/3/5
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	93,100	97,583	593,306	2027/6/3
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	49,600	55,919	339,990	2029/5/31
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	46,500	49,505	300,996	2031/5/29
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	10,000	10,645	64,722	2034/11/23
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	46,000	59,614	362,454	2036/11/20
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	30,500	34,863	211,967	2038/11/18
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	64,200	68,227	414,821	2042/11/13
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	2,000	2,188	13,306	2047/11/7
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	83,000	88,385	537,383	2023/12/7
小計					5,714,339	
南アフリカ			千ランド	千ランド		
国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	9,200	9,324	78,422	2018/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.25	25,300	25,369	213,360	2020/1/15
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	26,100	25,645	215,676	2021/3/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	25,200	25,227	212,161	2023/2/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	71,300	80,552	677,444	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	28,000	25,888	217,722	2030/1/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	30,000	25,101	211,099	2031/2/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.25	46,400	42,667	358,831	2032/3/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	47,100	33,937	285,412	2036/3/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	32,000	28,883	242,907	2037/1/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0	4,800	4,483	37,707	2040/1/31

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
		外貨建金額			邦貨換算金額		
南アフリカ			%	千ランド	千ランド	千円	
国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		6.5	30,600	21,746	182,889	2041/2/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		8.75	39,100	35,405	297,756	2044/1/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		8.75	50,200	45,511	382,750	2048/2/28
小 計						3,614,142	
合 計						645,885,706	

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

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。



# 外国債券マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日2017年5月10日）

作成対象期間（2016年5月11日～2017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	シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主な投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
12期(2013年5月10日)	19,680	33.8	196.85	32.3	98.1	—	309,517
13期(2014年5月12日)	20,704	5.2	209.27	6.3	98.6	—	293,247
14期(2015年5月11日)	23,251	12.3	236.29	12.9	98.9	—	526,058
15期(2016年5月10日)	21,725	△6.6	220.26	△6.8	99.0	—	632,898
16期(2017年5月10日)	22,009	1.3	223.71	1.6	99.0	—	664,754

\*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 (=シティ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もとにしています。  
 \*シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・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 (為替ヘッジを行わない円ベースの指数) です。シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・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

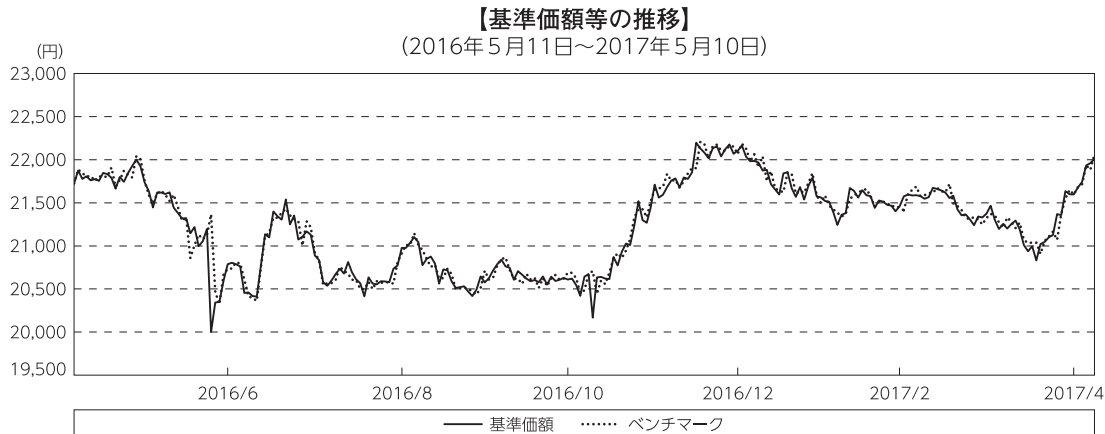
年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) 2016年5月10日	21,725	—	220.26	—	99.0	—
5月末	22,003	1.3	223.46	1.5	99.0	—
6月末	20,789	△4.3	210.22	△4.6	99.0	—
7月末	21,130	△2.7	215.10	△2.3	98.9	—
8月末	20,978	△3.4	212.03	△3.7	99.0	—
9月末	20,577	△5.3	210.00	△4.7	99.0	—
10月末	20,610	△5.1	209.77	△4.8	99.0	—
11月末	21,435	△1.3	218.09	△1.0	99.1	—
12月末	22,103	1.7	223.73	1.6	99.0	—
2017年1月末	21,576	△0.7	218.90	△0.6	98.9	—
2月末	21,462	△1.2	217.38	△1.3	99.0	—
3月末	21,467	△1.2	216.67	△1.6	99.0	—
4月末	21,598	△0.6	218.98	△0.6	99.0	—
(期末) 2017年5月10日	22,009	1.3	223.71	1.6	99.0	—

\*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、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

基準価額は、期首21,725円から期末22,009円へと上昇し、値上がり額は284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）したことはマイナスに影響しましたが、内外長期金利差の拡大などを背景に主要通貨が概ね対円で上昇（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、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、同氏の拡張的な財政政策方針による景気加速や財政赤字拡大、インフレ率上昇への警戒感が高まったことに加え、2016年12月や2017年3月に米国の政策金利が引き上げられたこと、ユーロ圏の景況感回復などからECB（欧州中央銀行）の量的緩和政策の終了が前倒しになるとの警戒感が強まったことなどを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に上昇（価格は下落）しました。

為替市場は、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨が概ね対円で上昇（円安）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、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

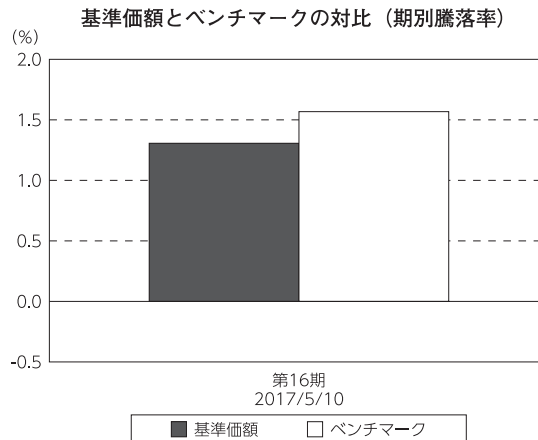
今期の基準価額の騰落率は+1.3%となり、ベンチマークの+1.6%を0.3ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

### （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為替レートや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、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、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きを概ね捉える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5月11日～2017年5月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
( 保 管 費 用 )	(2)	(0.011)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
( そ の 他 )	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	2	0.011	
期中の平均基準価額は、21,310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5月11日～2017年5月10日)

## 公社債

			買 付 額	売 付 額
外	アメリカ	国債証券	千米ドル 875,907	千米ドル 663,493
	カナダ	国債証券	千カナダドル 54,140	千カナダドル 39,082
	イギリス	国債証券	千英ポンド 77,511	千英ポンド 76,763
	スイス	国債証券	千スイスフラン 110	千スイスフラン 4,752
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 31,328	千スウェーデンクローナ 33,919
	国	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 29,418
デンマーク		国債証券	千デンマーククローネ 53,780	千デンマーククローネ 63,569
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ
ドイツ		国債証券	121,678	58,188
イタリア		国債証券	117,739	145,876
	フランス	国債証券	120,159	35,977

			買付額	売付額
外	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	オランダ	国債証券	26,941	17,592
	スペイン	国債証券	92,244	128,149
	ベルギー	国債証券	27,370	18,103
	オーストリア	国債証券	14,861	6,610
	フィンランド	国債証券	8,806	2,097
	アイルランド	国債証券	13,346	12,631
	ポーランド	国債証券	千ズロチ 39,693	千ズロチ 23,267
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 5,760	千シンガポールドル 2,049
	国	マレーシア	国債証券	千リンギ 19,633
オーストラリア		国債証券	千豪ドル 56,350	千豪ドル 27,304
メキシコ		国債証券	千メキシコペソ 221,884	千メキシコペソ 152,346
南アフリカ		国債証券	千ランド 60,487	千ランド 22,936

\*金額は受け渡し代金。(経過利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

(2016年5月11日～2017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		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 80,883	百万円 2,947	% 3.6	百万円 58,257	百万円 4,384	% 7.5

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。

(2017年5月10日現在)

## ○組入資産の明細

## 外国公社債

## (A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 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	2,480,300	2,561,758	291,681,873	43.9	—	18.4	17.7	7.7
カナダ	千カナダドル 148,180	千カナダドル 165,818	13,771,222	2.1	—	0.9	0.7	0.4
イギリス	千英ポンド 256,410	千英ポンド 328,542	48,456,687	7.3	—	5.3	1.8	0.2
スイス	千スイスフラン 8,600	千スイスフラン 10,719	1,212,332	0.2	—	0.1	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 195,700	千スウェーデンクローナ 228,802	2,935,536	0.4	—	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 130,800	千ノルウェークローネ 141,409	1,855,291	0.3	—	0.2	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 191,500	千デンマーククローネ 239,451	3,989,260	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	268,700	338,808	42,032,643	6.3	—	4.2	2.0	0.0
イタリア	433,880	516,485	64,075,205	9.6	—	5.8	2.7	1.1
フランス	425,300	528,147	65,521,961	9.9	—	6.3	2.6	1.0
オランダ	96,970	118,139	14,656,379	2.2	—	1.5	0.5	0.3
スペイン	254,300	313,107	38,844,080	5.8	—	3.6	1.7	0.6
ベルギー	102,100	132,549	16,444,084	2.5	—	1.9	0.5	0.1
オーストリア	63,200	77,961	9,671,942	1.5	—	1.0	0.4	0.1
フィンランド	28,500	32,000	3,970,030	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	43,000	49,616	6,155,386	0.9	—	0.5	0.3	0.1
ポーランド	千ズロチ 136,700	千ズロチ 144,005	4,219,347	0.6	—	0.3	0.3	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 29,930	千シンガポールドル 31,612	2,552,046	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マレーシア	千リンギ 107,200	千リンギ 107,449	2,815,170	0.4	—	0.2	0.2	0.0
オーストラリア	千豪ドル 153,750	千豪ドル 165,638	13,863,902	2.1	—	1.3	0.5	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 953,500	千メキシコペソ 981,391	5,839,278	0.9	—	0.5	0.2	0.2
南アフリカ	千ランド 462,800	千ランド 422,977	3,536,092	0.5	—	0.4	0.1	0.0
合 計	—	—	658,099,760	99.0	—	53.7	33.0	12.3

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

\*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。

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

## (B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当期				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券					
	US TREASURY BOND	8.125	19,300	22,183	2,525,834	2019/8/15
	US TREASURY BOND	8.75	12,700	15,567	1,772,506	2020/8/15
	US TREASURY BOND	8.0	21,100	26,675	3,037,217	2021/11/15
	US TREASURY BOND	6.25	13,800	17,154	1,953,159	2023/8/15
	US TREASURY BOND	2.375	50,100	50,522	5,752,516	2024/8/15
	US TREASURY BOND	6.0	39,200	50,586	5,759,764	2026/2/15
	US TREASURY BOND	6.5	18,800	25,384	2,890,268	2026/11/15
	US TREASURY BOND	6.125	23,700	31,802	3,621,025	2027/11/15
	US TREASURY BOND	5.5	12,000	15,549	1,770,451	2028/8/15
	US TREASURY BOND	5.25	5,000	6,373	725,679	2028/11/15
	US TREASURY BOND	5.25	800	1,023	116,485	2029/2/15
	US TREASURY BOND	4.375	100	124	14,172	2038/2/15
	US TREASURY BOND	2.875	25,300	24,588	2,799,639	2043/5/15
	US TREASURY BOND	3.75	16,000	18,155	2,067,128	2043/11/15
	US TREASURY N/B	2.625	8,500	8,616	981,079	2018/4/30
	US TREASURY N/B	0.625	500	497	56,618	2018/4/30
	US TREASURY N/B	3.875	400	410	46,764	2018/5/15
	US TREASURY N/B	1.0	600	598	68,174	2018/5/15
	US TREASURY N/B	2.375	600	607	69,143	2018/5/31
	US TREASURY N/B	1.0	4,900	4,889	556,693	2018/5/31
	US TREASURY N/B	1.125	21,400	21,379	2,434,224	2018/6/15
	US TREASURY N/B	2.375	31,200	31,603	3,598,363	2018/6/30
	US TREASURY N/B	1.375	8,500	8,513	969,397	2018/6/30
	US TREASURY N/B	0.875	1,000	995	113,379	2018/7/15
	US TREASURY N/B	2.25	8,800	8,911	1,014,688	2018/7/31
	US TREASURY N/B	1.375	18,400	18,428	2,098,297	2018/7/31
	US TREASURY N/B	0.75	17,700	17,594	2,003,277	2018/7/31
	US TREASURY N/B	4.0	4,800	4,967	565,549	2018/8/15
	US TREASURY N/B	1.0	19,600	19,539	2,224,769	2018/8/15
	US TREASURY N/B	1.5	28,800	28,887	3,289,158	2018/8/31
	US TREASURY N/B	1.0	800	797	90,757	2018/9/15
	US TREASURY N/B	1.375	27,400	27,436	3,123,907	2018/9/30
	US TREASURY N/B	0.75	10,000	9,927	1,130,371	2018/9/30
	US TREASURY N/B	0.875	2,400	2,386	271,694	2018/10/15
	US TREASURY N/B	1.75	9,900	9,967	1,134,919	2018/10/31
	US TREASURY N/B	1.25	21,400	21,389	2,435,461	2018/10/31
	US TREASURY N/B	0.75	700	694	79,069	2018/10/31
	US TREASURY N/B	3.75	35,700	37,006	4,213,579	2018/11/15
	US TREASURY N/B	1.25	1,700	1,699	193,478	2018/11/15
	US TREASURY N/B	1.375	500	500	56,990	2018/11/30
	US TREASURY N/B	1.25	6,000	5,994	682,546	2018/11/30
	US TREASURY N/B	1.25	700	699	79,649	2018/12/15
	US TREASURY N/B	1.375	6,500	6,506	740,812	2018/12/31
	US TREASURY N/B	1.5	5,500	5,515	628,040	2018/12/31
	US TREASURY N/B	1.125	5,100	5,083	578,848	2019/1/15



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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ						
国債証券	US TREASURY N/B	1.25	7,500	7,490	852,815	2019/1/31
	US TREASURY N/B	1.5	3,500	3,510	399,661	2019/1/31
	US TREASURY N/B	1.125	1,000	996	113,481	2019/1/31
	US TREASURY N/B	2.75	37,500	38,430	4,375,659	2019/2/15
	US TREASURY N/B	0.75	900	890	101,445	2019/2/15
	US TREASURY N/B	1.375	16,100	16,111	1,834,434	2019/2/28
	US TREASURY N/B	1.5	16,200	16,246	1,849,863	2019/2/28
	US TREASURY N/B	1.0	10,800	10,733	1,222,146	2019/3/15
	US TREASURY N/B	1.5	4,000	4,012	456,809	2019/3/31
	US TREASURY N/B	1.625	25,500	25,633	2,918,627	2019/3/31
	US TREASURY N/B	1.25	2,000	1,996	227,301	2019/3/31
	US TREASURY N/B	0.875	3,500	3,468	394,914	2019/4/15
	US TREASURY N/B	1.25	5,000	4,990	568,165	2019/4/30
	US TREASURY N/B	1.625	5,600	5,629	641,003	2019/4/30
	US TREASURY N/B	3.125	27,600	28,569	3,252,892	2019/5/15
	US TREASURY N/B	0.875	1,300	1,287	146,589	2019/5/15
	US TREASURY N/B	1.125	1,400	1,393	158,638	2019/5/31
	US TREASURY N/B	1.5	10,600	10,629	1,210,263	2019/5/31
	US TREASURY N/B	0.875	500	494	56,336	2019/6/15
	US TREASURY N/B	1.0	1,400	1,389	158,152	2019/6/30
	US TREASURY N/B	1.625	7,900	7,939	903,991	2019/6/30
	US TREASURY N/B	0.75	5,500	5,423	617,545	2019/7/15
	US TREASURY N/B	1.625	14,500	14,571	1,659,095	2019/7/31
	US TREASURY N/B	3.625	26,100	27,385	3,118,127	2019/8/15
	US TREASURY N/B	1.0	3,000	2,971	338,364	2019/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	8,800	8,842	1,006,782	2019/8/31
	US TREASURY N/B	1.0	3,000	2,969	338,110	2019/9/30
	US TREASURY N/B	1.75	17,700	17,834	2,030,594	2019/9/30
	US TREASURY N/B	3.375	49,300	51,639	5,879,710	2019/11/15
	US TREASURY N/B	1.0	8,800	8,699	990,539	2019/11/30
	US TREASURY N/B	1.5	1,800	1,801	205,148	2019/11/30
	US TREASURY N/B	1.125	12,000	11,891	1,353,937	2019/12/31
	US TREASURY N/B	1.625	3,800	3,814	434,324	2019/12/31
	US TREASURY N/B	1.375	2,000	1,993	227,008	2020/1/31
	US TREASURY N/B	1.25	5,400	5,364	610,809	2020/1/31
	US TREASURY N/B	3.625	51,800	54,744	6,233,163	2020/2/15
	US TREASURY N/B	1.25	2,700	2,680	305,152	2020/2/29
	US TREASURY N/B	1.625	5,000	5,012	570,745	2020/3/15
	US TREASURY N/B	1.125	4,000	3,953	450,156	2020/3/31
	US TREASURY N/B	1.375	21,300	21,201	2,414,039	2020/3/31
	US TREASURY N/B	1.375	3,200	3,182	362,359	2020/4/30
	US TREASURY N/B	3.5	47,700	50,412	5,740,017	2020/5/15
	US TREASURY N/B	1.5	6,500	6,483	738,181	2020/5/31
	US TREASURY N/B	1.875	16,600	16,741	1,906,171	2020/6/30
	US TREASURY N/B	1.625	13,200	13,207	1,503,773	2020/6/30
	US TREASURY N/B	2.0	14,000	14,164	1,612,720	2020/7/31
	US TREASURY N/B	2.625	42,500	43,844	4,992,160	2020/8/15

銘柄	当	期	末	評 価 額		償還年月日		
				利 率	額面金額		外貨建金額	邦貨換算金額
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円			
国債証券	US TREASURY N/B	2.125	37,600	38,175	4,346,690	2020/8/31		
	US TREASURY N/B	2.0	6,000	6,066	690,738	2020/9/30		
	US TREASURY N/B	1.75	1,600	1,603	182,531	2020/10/31		
	US TREASURY N/B	2.625	52,600	54,270	6,179,234	2020/11/15		
	US TREASURY N/B	2.375	6,800	6,957	792,212	2020/12/31		
	US TREASURY N/B	2.125	5,300	5,374	611,896	2021/1/31		
	US TREASURY N/B	1.375	7,000	6,905	786,310	2021/1/31		
	US TREASURY N/B	3.625	45,800	48,973	5,576,156	2021/2/15		
	US TREASURY N/B	2.0	5,000	5,046	574,592	2021/2/28		
	US TREASURY N/B	1.125	10,000	9,764	1,111,825	2021/2/28		
	US TREASURY N/B	2.25	1,800	1,831	208,566	2021/3/31		
	US TREASURY N/B	2.25	12,900	13,124	1,494,383	2021/4/30		
	US TREASURY N/B	3.125	38,400	40,373	4,596,983	2021/5/15		
	US TREASURY N/B	2.0	22,500	22,674	2,581,664	2021/5/31		
	US TREASURY N/B	2.125	34,000	34,406	3,917,513	2021/6/30		
	US TREASURY N/B	2.25	9,700	9,859	1,122,561	2021/7/31		
	US TREASURY N/B	2.125	26,800	27,122	3,088,160	2021/8/15		
	US TREASURY N/B	2.0	7,300	7,342	835,983	2021/8/31		
	US TREASURY N/B	2.125	16,000	16,170	1,841,116	2021/9/30		
	US TREASURY N/B	2.0	10,000	10,049	1,144,203	2021/10/31		
	US TREASURY N/B	2.0	26,000	26,142	2,976,549	2021/11/15		
	US TREASURY N/B	1.875	8,000	7,995	910,310	2021/11/30		
	US TREASURY N/B	2.125	12,400	12,522	1,425,761	2021/12/31		
	US TREASURY N/B	1.5	5,000	4,906	558,625	2022/1/31		
	US TREASURY N/B	2.0	33,700	33,864	3,855,817	2022/2/15		
	US TREASURY N/B	1.75	27,300	27,073	3,082,636	2022/2/28		
	US TREASURY N/B	1.75	9,900	9,812	1,117,262	2022/3/31		
	US TREASURY N/B	1.75	30,000	29,718	3,383,776	2022/4/30		
	US TREASURY N/B	1.75	23,900	23,675	2,695,635	2022/5/15		
	US TREASURY N/B	2.125	27,000	27,204	3,097,516	2022/6/30		
	US TREASURY N/B	1.625	18,500	18,160	2,067,737	2022/8/15		
	US TREASURY N/B	1.625	12,800	12,528	1,426,438	2022/11/15		
	US TREASURY N/B	2.125	13,000	13,049	1,485,846	2022/12/31		
	US TREASURY N/B	1.75	22,000	21,620	2,461,670	2023/1/31		
	US TREASURY N/B	2.0	17,000	16,932	1,927,907	2023/2/15		
	US TREASURY N/B	1.5	25,000	24,205	2,755,990	2023/2/28		
	US TREASURY N/B	1.5	11,000	10,637	1,211,167	2023/3/31		
	US TREASURY N/B	1.75	42,200	41,359	4,709,169	2023/5/15		
	US TREASURY N/B	1.625	30,400	29,549	3,364,534	2023/5/31		
	US TREASURY N/B	2.5	19,400	19,818	2,256,513	2023/8/15		
	US TREASURY N/B	2.75	16,800	17,399	1,981,142	2023/11/15		
	US TREASURY N/B	2.75	26,800	27,740	3,158,486	2024/2/15		
	US TREASURY N/B	2.5	29,100	29,631	3,373,897	2024/5/15		
	US TREASURY N/B	2.25	23,100	23,060	2,625,645	2024/11/15		
	US TREASURY N/B	2.0	44,700	43,746	4,980,991	2025/2/15		
	US TREASURY N/B	2.125	26,500	26,119	2,973,916	2025/5/15		
	US TREASURY N/B	2.0	16,000	15,590	1,775,077	2025/8/15		

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY N/B	2.25	50,300	49,879	5,679,282	2025/11/15
	US TREASURY N/B	1.625	3,400	3,198	364,138	2026/2/15
	US TREASURY N/B	5.375	2,100	2,794	318,235	2031/2/15
	US TREASURY N/B	4.5	100	126	14,406	2038/5/15
	US TREASURY N/B	3.5	100	109	12,497	2039/2/15
	US TREASURY N/B	4.25	800	974	110,977	2039/5/15
	US TREASURY N/B	4.5	2,500	3,148	358,503	2039/8/15
	US TREASURY N/B	4.375	4,200	5,200	592,160	2039/11/15
	US TREASURY N/B	4.625	8,000	10,251	1,167,207	2040/2/15
	US TREASURY N/B	4.375	8,000	9,910	1,128,423	2040/5/15
	US TREASURY N/B	3.875	7,200	8,304	945,514	2040/8/15
	US TREASURY N/B	4.25	7,800	9,503	1,082,104	2040/11/15
	US TREASURY N/B	4.75	7,000	9,153	1,042,228	2041/2/15
	US TREASURY N/B	4.375	7,000	8,693	989,861	2041/5/15
	US TREASURY N/B	3.125	6,500	6,642	756,337	2041/11/15
	US TREASURY N/B	3.125	3,200	3,266	371,866	2042/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	4,500	4,486	510,888	2042/5/15
	US TREASURY N/B	2.75	9,300	8,848	1,007,524	2042/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	17,600	16,735	1,905,461	2042/11/15
	US TREASURY N/B	3.125	25,200	25,654	2,921,053	2043/2/15
	US TREASURY N/B	3.625	15,400	17,100	1,947,007	2043/8/15
	US TREASURY N/B	3.625	23,200	25,788	2,936,250	2044/2/15
	US TREASURY N/B	3.375	18,900	20,121	2,290,990	2044/5/15
	US TREASURY N/B	3.125	30,600	31,123	3,543,726	2044/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	36,900	36,629	4,170,579	2044/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	26,000	23,308	2,653,916	2045/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	21,700	21,528	2,451,265	2045/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	1,934	220,301	2045/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	15,100	14,972	1,704,779	2045/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	9,500	8,493	967,080	2046/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	3,700	3,306	376,454	2046/5/15
小 計					291,681,873	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	CANADA GOVERNMENT	2.75	4,600	4,975	413,230	2022/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	4.25	5,000	5,189	430,996	2018/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5	3,000	2,993	248,646	2018/8/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.25	9,500	9,571	794,923	2018/9/1
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5	10,000	9,973	828,332	2018/11/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.75	4,500	4,585	380,822	2019/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	3.75	10,000	10,617	881,758	2019/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.75	8,700	8,900	739,211	2019/9/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	4,700	4,792	398,024	2020/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5	7,800	8,428	699,969	2020/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	0.75	2,800	2,789	231,693	2020/9/1
	CANADIAN GOVERNMENT	0.75	8,200	8,142	676,215	2021/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	3.25	10,500	11,452	951,169	2021/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5	2,800	2,728	226,586	2022/3/1

銘柄	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	
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	4,600	4,679	388,593	2023/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	5,700	6,155	511,189	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	8,500	9,046	751,280	2025/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	8.0	3,700	5,891	489,280	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	1,000	943	78,336	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	5,680	8,097	672,518	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	3,400	5,128	425,921	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	5,300	7,728	641,839	2037/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	6,400	8,474	703,838	2041/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5	9,500	11,942	991,836	2045/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,800	2,008	166,845	2048/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	500	579	48,159	2064/12/1
小		計				13,771,222	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UK TREASURY	1.25	150	152	22,422	2018/7/22
		UK TREASURY	4.5	7,100	7,666	1,130,743	2019/3/7
		UK TREASURY	1.75	19,600	20,287	2,992,271	2019/7/22
		UK TREASURY	3.75	2,000	2,167	319,728	2019/9/7
		UK TREASURY	4.75	2,300	2,596	383,021	2020/3/7
		UK TREASURY	2.0	17,490	18,462	2,723,025	2020/7/22
		UK TREASURY	3.75	7,000	7,820	1,153,430	2020/9/7
		UK TREASURY	1.5	2,200	2,293	338,333	2021/1/22
		UK TREASURY	8.0	9,340	12,253	1,807,216	2021/6/7
		UK TREASURY	3.75	8,900	10,194	1,503,521	2021/9/7
		UK TREASURY	4.0	4,850	5,676	837,289	2022/3/7
		UK TREASURY	0.5	4,000	3,980	587,010	2022/7/22
		UK TREASURY	1.75	8,700	9,240	1,362,847	2022/9/7
		UK TREASURY	2.25	5,100	5,587	824,034	2023/9/7
		UK TREASURY	2.75	11,200	12,712	1,874,892	2024/9/7
		UK TREASURY	5.0	12,450	16,315	2,406,406	2025/3/7
		UK TREASURY	4.25	9,530	12,411	1,830,627	2027/12/7
		UK TREASURY	6.0	5,350	8,077	1,191,419	2028/12/7
		UK TREASURY	4.75	5,700	8,010	1,181,509	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	5,750	7,789	1,148,877	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	6,600	9,355	1,379,842	2034/9/7
		UK TREASURY	4.25	3,400	4,748	700,397	2036/3/7
		UK TREASURY	4.75	4,400	6,699	988,035	2038/12/7
		UK TREASURY	4.25	4,200	6,036	890,346	2039/9/7
		UK TREASURY	4.25	5,700	8,293	1,223,208	2040/12/7
		UK TREASURY	4.5	6,100	9,366	1,381,472	2042/12/7
		UK TREASURY	3.5	20,000	26,952	3,975,150	2045/1/22
		UK TREASURY	4.25	5,950	9,171	1,352,767	2046/12/7
		UK TREASURY	4.25	5,350	8,544	1,260,226	2049/12/7
		UK TREASURY	3.75	8,750	13,284	1,959,294	2052/7/22
		UK TREASURY	1.75	900	910	134,254	2057/7/22
		UK TREASURY	2.5	2,600	3,298	486,436	2065/7/22
		UK TREASURY	3.5	6,200	10,058	1,483,584	2068/7/22

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					
イギリス			%	千英ポンド	千英ポンド	千円			
	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044 UNITED KINGDOM(GOVERNEM	3.25 4.25	21,050 6,500	27,009 11,115	3,983,595 1,639,447	2044/1/22 2055/12/7		
小計						48,456,687			
スイス				千スイスフラン	千スイスフラン				
	国債証券	SWITZERLAND GOVERNMENT SWITZERLAND GOVERNMENT	2.0 4.0	5,000 3,600	5,538 5,181	626,347 585,984	2021/4/28 2028/4/8		
小計						1,212,332			
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 SWEDISH GOVERNMENT SWEDISH GOVERNMENT SWEDISH GOVERNMENT SWEDISH GOVERNMENT SWEDISH GOVERNMENT SWEDISH GOVERNMENT	4.25 5.0 3.5 1.5 2.5 1.0 3.5	2,300 45,500 53,400 26,600 41,700 9,900 16,300	2,507 54,113 62,803 28,761 48,405 10,225 21,986	32,167 694,271 805,771 369,005 621,040 131,196 282,081	2019/3/12 2020/12/1 2022/6/1 2023/11/13 2025/5/12 2026/11/12 2039/3/30		
	小計					2,935,536			
	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 NORWEGIAN GOVERNMENT NORWEGIAN GOVERNMENT NORWEGIAN GOVERNMENT NORWEGIAN GOVERNMENT NORWEGIAN GOVERNMENT NORWEGIAN GOVERNMENT	4.5 3.75 2.0 3.0 1.75 1.5 1.75	27,300 27,600 14,300 44,900 4,700 4,700 7,300	29,420 30,623 14,893 49,654 4,797 4,664 7,354	385,995 401,781 195,402 651,472 62,941 61,204 96,494	2019/5/22 2021/5/25 2023/5/24 2024/3/14 2025/3/13 2026/2/19 2027/2/17	
		小計					1,855,291		
		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 KINGDOM OF DENMARK KINGDOM OF DENMARK KINGDOM OF DENMARK KINGDOM OF DENMARK KINGDOM OF DENMARK KINGDOM OF DENMARK	0.25 4.0 3.0 1.5 1.75 0.5 4.5	2,500 34,100 41,100 30,100 31,400 4,000 48,300	2,530 37,970 47,043 32,843 34,985 3,923 80,154	42,157 632,586 783,737 547,164 582,864 65,369 1,335,380	2018/11/15 2019/11/15 2021/11/15 2023/11/15 2025/11/15 2027/11/15 2039/11/15
小計							3,989,260		
ユーロ						千ユーロ	千ユーロ		
			ドイツ	国債証券	BUNDES OBLIGATION	0.5	1,800	1,841	228,504
	BUNDES OBLIGATION				0.25	10,000	10,222	1,268,153	2019/10/11
	BUNDES OBLIGATION				—	3,600	3,665	454,780	2020/4/17
	BUNDES OBLIGATION	0.25			3,000	3,081	382,310	2020/10/16	
	BUNDES OBLIGATION	—			1,600	1,630	202,241	2021/4/9	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.5			17,700	19,303	2,394,763	2019/7/4	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25			6,700	7,402	918,403	2020/1/4	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0			4,100	4,568	566,748	2020/7/4	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25			13,300	14,552	1,805,361	2020/9/4	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5			13,300	14,779	1,833,576	2021/1/4	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25			7,000	8,088	1,003,441	2021/7/4	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25			8,400	9,379	1,163,665	2021/9/4	

銘柄		当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
ユーロ		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	11,500	12,779	1,585,452	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	7,500	8,287	1,028,147	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,000	5,468	678,471	2022/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,200	5,705	707,778	2023/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,200	5,717	709,313	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	14,000	15,859	1,967,509	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	14,100	20,007	2,482,145	2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	5,700	6,393	793,137	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,500	1,658	205,718	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	6,300	6,742	836,460	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	9,700	9,991	1,239,555	2025/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	3,200	3,415	423,757	2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	2,000	2,041	253,320	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	600	589	73,141	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	19,400	31,111	3,859,655	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	6,000	9,216	1,143,418	2028/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	3,400	4,961	615,471	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	6,500	10,988	1,363,218	2030/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	5,300	8,642	1,072,142	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	5,800	9,435	1,170,521	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	5,400	8,353	1,036,344	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	8,000	13,118	1,627,420	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	8,200	14,442	1,791,718	2040/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	5,900	8,629	1,070,563	2042/7/4		
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	4,300	5,595	694,141	2044/7/4		
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	8,500	11,141	1,382,167	2046/8/15		
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	2,700	2,807	348,347	2018/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	20,400	21,576	2,676,827	2018/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	8,000	8,444	1,047,651	2018/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	15,300	16,422	2,037,363	2019/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	2,800	3,026	375,508	2019/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.1	500	501	62,180	2019/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	5,800	6,081	754,446	2019/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	800	824	102,314	2019/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	11,080	12,127	1,504,483	2019/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	6,100	6,799	843,491	2020/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	29,200	32,432	4,023,568	2020/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	16,200	18,098	2,245,317	2020/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	2,000	2,016	250,154	2020/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	11,400	12,790	1,586,753	2021/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	9,000	10,107	1,253,986	2021/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	8,000	9,016	1,118,624	2021/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	12,800	14,965	1,856,652	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	5,400	5,300	657,537	2021/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	16,800	19,966	2,477,081	2022/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	9,600	11,763	1,459,421	2022/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	20,700	25,427	3,154,582	2022/11/1		

銘柄		当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
ユーロ		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	4,000	3,930	487,605	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	6,700	7,912	981,622	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	9,300	11,174	1,386,355	2023/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	11,700	17,104	2,121,950	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	15,900	18,825	2,335,503	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.85	3,000	3,029	375,864	2024/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	2,300	2,609	323,715	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	14,900	18,289	2,269,055	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	3,000	2,915	361,650	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	3,000	2,997	371,882	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	8,500	10,169	1,261,615	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7.25	7,200	10,366	1,286,075	2026/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	18,200	25,314	3,140,501	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	6,300	7,728	958,839	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	20,700	26,769	3,320,991	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	18,300	25,554	3,170,244	2031/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	3,000	2,677	332,133	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	6,400	8,843	1,097,127	2033/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,400	10,830	1,343,584	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	6,700	7,745	960,869	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,000	10,380	1,287,742	2039/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	15,600	20,085	2,491,745	2040/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	10,100	12,677	1,572,773	2044/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	8,100	8,056	999,459	2046/9/1		
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1.0	8,000	8,248	1,023,326	2019/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	10,300	10,558	1,309,947	2019/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,800	2,835	351,814	2020/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,100	1,114	138,247	2020/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	7,000	6,986	866,763	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	7,000	8,160	1,012,360	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	600	569	70,669	2036/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.0	200	203	25,214	2018/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.25	10,800	11,559	1,434,055	2018/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.0	26,200	26,816	3,326,869	2018/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	—	2,200	2,220	275,442	2019/2/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.25	11,500	12,583	1,561,152	2019/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	8.5	4,000	4,891	606,778	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.75	11,500	12,710	1,576,827	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.5	14,800	16,540	2,051,955	2020/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.5	27,300	30,019	3,724,167	2020/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	0.25	2,000	2,042	253,355	2020/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.75	11,800	13,684	1,697,694	2021/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	15,100	17,423	2,161,525	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.0	14,500	16,726	2,075,043	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.25	20,100	22,550	2,797,608	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	8.5	8,200	12,308	1,527,036	2023/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.25	31,300	39,472	4,896,949	2023/10/25

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.75	8,000	8,798	1,091,594	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	6.0	19,800	28,753	3,567,166	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.0	6,000	6,192	768,179	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.5	33,100	41,285	5,121,895	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.75	7,200	8,519	1,056,872	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5.5	24,500	36,986	4,588,551	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.5	1,000	1,034	128,331	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5.75	19,600	31,970	3,966,216	2032/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.75	6,600	10,094	1,252,317	2035/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	11,800	16,979	2,106,490	2038/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.5	15,900	24,679	3,061,798	2041/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	15,200	19,817	2,458,572	2045/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	4,500	6,891	854,968	2055/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	3,800	5,918	734,201	2060/4/25
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	7,470	7,880	977,698	2018/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.25	6,300	6,502	806,740	2019/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	7,100	7,816	969,701	2019/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	2,000	2,044	253,642	2020/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5	5,800	6,545	812,045	2020/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	7,900	9,109	1,130,163	2021/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	400	404	50,231	2022/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.25	1,500	1,692	209,946	2022/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	5,900	7,201	893,423	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	4,300	6,166	765,032	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	1,400	1,553	192,722	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	13,500	15,288	1,896,722	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	4,000	4,004	496,736	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	2,000	2,021	250,791	2027/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	7,300	11,011	1,366,064	2028/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	4,400	5,453	676,543	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	5,000	7,676	952,345	2037/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	6,200	9,639	1,195,867	2042/1/15		
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	4,500	6,125	759,961	2047/1/15		
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.25	100	100	12,475	2018/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.1	7,800	8,219	1,019,748	2018/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.75	7,100	7,535	934,833	2018/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.25	2,700	2,723	337,936	2019/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	13,300	14,103	1,749,667	2019/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6	8,900	9,863	1,223,697	2019/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.3	8,800	9,782	1,213,674	2019/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0	27,500	30,869	3,829,717	2020/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.85	10,600	12,404	1,538,848	2020/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5	7,900	9,607	1,191,916	2021/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	5,900	6,048	750,406	2021/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	9,200	11,592	1,438,215	2022/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	17,000	21,602	2,680,062	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	6,000	7,363	913,465	2023/10/31



銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	13,900	17,450	2,164,854	2024/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	6,700	7,982	990,252	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	900	923	114,623	2025/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	14,000	17,632	2,187,463	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	6,000	6,253	775,818	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	18,400	25,401	3,151,277	2026/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	7,800	10,524	1,305,674	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	5,400	7,437	922,713	2040/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	8,400	11,308	1,402,905	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	7,800	11,158	1,384,326	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	1,000	1,044	129,584	2066/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	17,500	25,194	3,125,691	2029/1/31
		SPANISH GOVERNMENT	5.75	8,500	12,435	1,542,748	2032/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	5,200	6,541	811,479	2037/1/31
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	1.25	100	102	12,659	2018/6/22
		BELGIUM KINGDOM	3.0	7,600	8,239	1,022,244	2019/9/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	5,800	6,624	821,839	2020/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	5,200	6,233	773,360	2021/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	4,800	5,789	718,203	2022/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	6,400	7,895	979,458	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	5,000	5,672	703,741	2023/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	10,000	11,610	1,440,336	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.5	8,400	11,293	1,401,112	2026/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	1,032	128,141	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	974	120,884	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	3,500	4,845	601,079	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	6,400	9,741	1,208,472	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	6,500	9,341	1,158,917	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	1,000	939	116,525	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	1,300	1,291	160,211	2066/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	4.0	5,200	5,649	700,875	2019/3/28
BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	11,900	17,798	2,208,122	2028/3/28		
BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	11,000	17,474	2,167,897	2035/3/28		
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.15	2,300	2,357	292,471	2018/10/19
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.35	2,500	2,726	338,218	2019/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.95	2,500	2,632	326,525	2019/6/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.25	2,400	2,445	303,401	2019/10/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9	5,600	6,374	790,783	2020/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5	4,400	5,127	636,095	2021/9/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	3,300	3,923	486,774	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	5,000	5,966	740,203	2022/11/22
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	2,000	1,989	246,842	2023/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	3,900	4,323	536,339	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	3,000	3,309	410,514	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	1,300	1,386	172,002	2025/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	5,400	7,489	929,184	2026/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	2,032	252,208	2026/10/20

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	6,100	9,570	1,187,352	2027/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	1,000	1,203	149,281	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	4,700	7,119	883,235	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	5,800	7,984	990,506	2044/6/20
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	1.125	1,500	1,536	190,572	2018/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	4.375	2,100	2,324	288,353	2019/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	3.375	2,000	2,226	276,182	2020/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.375	2,300	2,359	292,748	2020/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	3.5	2,000	2,302	285,686	2021/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.625	3,200	3,491	433,150	2022/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	4,200	4,571	567,114	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	4.0	2,400	3,111	386,054	2025/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.875	1,000	1,039	128,966	2025/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,000	2,002	248,387	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	3,500	4,276	530,522	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.75	700	684	84,869	2031/4/15
FINNISH GOVERNMENT	2.625	1,600	2,074	257,421	2042/7/4		
アイルランド	国債証券	IRELAND (REPUBLIC OF)	4.4	3,600	3,971	492,693	2019/6/18
		IRISH GOVERNMENT	4.5	5,600	5,998	744,173	2018/10/18
		IRISH GOVERNMENT	5.9	3,400	3,925	487,048	2019/10/18
		IRISH GOVERNMENT	4.5	5,300	6,061	751,937	2020/4/18
		IRISH GOVERNMENT	5.0	3,500	4,143	514,061	2020/10/18
		IRISH GOVERNMENT	5.4	3,500	4,769	591,702	2025/3/13
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	1,000	989	122,726	2037/5/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	2,500	2,495	309,596	2045/2/18
		IRISH TSY 2.4% 2030	2.4	4,600	5,183	643,037	2030/5/15
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	6,600	7,936	984,643	2024/3/18
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	3,400	4,141	513,765	2023/3/20
		小 計					
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND		2.5	8,900	8,983	263,221	2018/7/25
			—	6,200	6,036	176,882	2018/10/25
			3.25	5,800	5,942	174,120	2019/7/25
			5.5	11,100	11,990	351,313	2019/10/25
			1.5	6,300	6,153	180,289	2020/4/25
			5.25	30,700	33,515	981,995	2020/10/25
			5.75	11,100	12,495	366,111	2021/10/25
			5.75	9,400	10,701	313,565	2022/9/23
			4.0	12,500	13,190	386,485	2023/10/25
			3.25	23,000	22,979	673,293	2025/7/25
			2.5	8,000	7,478	219,105	2026/7/25
			5.75	3,700	4,538	132,964	2029/4/25
小 計						4,219,347	
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		4.0	1,600	1,660	134,024	2018/9/1
			2.5	4,950	5,077	409,933	2019/6/1
			3.25	4,000	4,230	341,487	2020/9/1

銘柄		当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		千円	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
シンガポール		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円		
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	2,980	3,054	246,589	2021/6/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	1,400	1,498	120,956	2022/9/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	3,000	3,148	254,178	2023/7/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	2,300	2,456	198,305	2024/9/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	3,900	4,346	350,915	2027/3/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	2,400	2,541	205,200	2030/9/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	500	563	45,450	2033/9/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	2,900	3,034	245,003	2042/4/1	
小 計					2,552,046		
マレーシア			千リンギ	千リンギ			
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4.059	400	405	10,614	2024/9/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.58	5,000	5,019	131,514	2018/9/28	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.759	900	907	23,777	2019/3/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.654	3,400	3,414	89,463	2019/10/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.378	11,900	12,157	318,514	2019/11/29	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.492	6,600	6,590	172,673	2020/3/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.889	2,400	2,421	63,445	2020/7/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.16	6,000	6,109	160,073	2021/7/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.048	8,700	8,834	231,472	2021/9/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.418	4,600	4,524	118,536	2022/8/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	11,000	10,822	283,560	2023/3/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	5,800	5,883	154,144	2024/7/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.955	600	598	15,672	2025/9/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	8,800	8,997	235,732	2026/4/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.502	6,000	5,623	147,331	2027/5/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	1,800	1,708	44,756	2028/6/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5.248	2,700	2,940	77,050	2028/9/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	3,500	3,528	92,435	2030/4/15	
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.232	4,400	4,326	113,354	2031/6/30		
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.127	4,700	4,569	119,725	2032/4/15		
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	400	375	9,834	2033/4/15		
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.935	7,600	7,690	201,487	2043/9/30		
小 計					2,815,170		
オーストラリア			千豪ドル	千豪ドル			
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	6,600	6,749	564,965	2018/10/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.25	13,700	14,573	1,219,813	2019/3/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	4,900	5,011	419,436	2019/10/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	13,100	14,074	1,178,051	2020/4/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	6,800	6,744	564,517	2020/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	10,200	11,651	975,218	2021/5/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0	400	397	33,276	2021/12/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	8,400	9,854	824,818	2022/7/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	8,100	9,527	797,464	2023/4/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	7,900	8,047	673,595	2024/4/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	18,300	19,211	1,608,018	2025/4/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	12,600	14,222	1,190,455	2026/4/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	11,250	13,267	1,110,493	2027/4/21	

銘	柄	当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
オーストラリア		%	千豪ドル	千豪ドル	千円		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	800	800	66,971	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	5,800	5,502	460,555	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	10,100	10,506	879,380	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	3,600	4,235	354,539	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,800	1,675	140,210	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	5,400	5,727	479,389	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	3,800	3,679	308,009	2039/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	200	175	14,721	2047/3/21
小	計					13,863,902	
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	4.75	70,000	68,614	408,253	2018/6/14
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	110,700	113,368	674,545	2018/12/13
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	60,300	57,460	341,889	2019/12/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	70,700	72,492	431,328	2020/6/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	124,300	121,531	723,114	2021/6/10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	48,400	47,053	279,965	2022/6/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	30,700	35,719	212,530	2024/12/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	8,000	7,245	43,113	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	103,100	104,793	623,523	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	47,100	51,498	306,414	2029/5/31
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	44,500	45,760	272,276	2031/5/29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	10,000	10,257	61,034	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	46,000	57,661	343,088	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	30,500	33,630	200,099	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	64,200	65,613	390,397	2042/11/13
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	2,000	2,092	12,449	2047/11/7
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	83,000	86,597	515,253	2023/12/7
小	計					5,839,278	
南アフリカ				千ランド	千ランド		
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	20,100	20,241	169,218	2018/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.25	25,300	25,063	209,527	2020/1/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	26,100	25,197	210,648	2021/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	25,200	24,654	206,108	2023/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	70,000	77,582	648,587	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	27,000	24,505	204,863	2030/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	30,000	24,738	206,809	2031/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.25	46,400	42,126	352,177	2032/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	47,100	33,644	281,267	2036/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	32,000	28,816	240,901	2037/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0	4,800	4,475	37,411	2040/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5	30,600	21,566	180,293	2041/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	32,100	28,925	241,818	2044/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	46,100	41,442	346,459	2048/2/28
小	計					3,536,092	
合	計					658,099,760	

\* 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5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 658,099,760	% 98.5
コール・ローン等、その他	10,157,962	1.5
投資信託財産総額	668,257,722	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（662,230,664千円）の投資信託財産総額（668,257,722千円）に対する比率は99.1%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=113.86円、1カナダドル=83.05円、1英ポンド=147.49円、1スイスフラン=113.10円、1スウェーデンクローナ=12.83円、1ノルウェークローネ=13.12円、1デンマーククローネ=16.66円、1ユーロ=124.06円、1ズロチ=29.30円、1シンガポールドル=80.73円、1リンギ=26.20円、1豪ドル=83.70円、1メキシコペソ=5.95円、1ランド=8.36円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	671,226,552,802
コール・ローン等	3,356,752,811
公社債(評価額)	658,099,760,346
未収入金	3,247,987,864
未収利息	6,265,289,584
前払費用	256,762,197
(B) 負債	6,472,404,827
未払金	5,818,573,835
未払解約金	645,927,677
未払利息	4,115
その他未払費用	7,899,200
(C) 純資産総額(A-B)	664,754,147,975
元本	302,031,601,625
次期繰越損益金	362,722,546,350
(D) 受益権総口数	302,031,601,625口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,009円

(注) 期首元本額は291,325,475,847円、期中追加設定元本額は41,419,676,069円、期中一部解約元本額は30,713,550,291円、1口当たり純資産額は2.2009円です。

## ○損益の状況 (2016年5月11日～2017年5月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	19,591,670,788
受取利息	19,593,036,598
支払利息	△ 1,365,810
(B) 有価証券売買損益	△ 10,359,248,853
売買益	20,672,406,631
売買損	△ 31,031,655,484
(C) 保管費用等	△ 69,320,663
(D) 当期損益金(A+B+C)	9,163,101,272
(E) 前期繰越損益金	341,572,524,818
(F) 追加信託差損益金	46,613,959,629
(G) 解約差損益金	△ 34,627,039,369
(H) 計(D+E+F+G)	362,722,546,350
次期繰越損益金(H)	362,722,546,350

\*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（野村投資一任口座向け）	186,858,504,066
野村世界6資産分散投信（分配コース）	28,123,863,474
野村外国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	12,779,489,266
マイ・ロード	8,396,053,347
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	7,074,282,593
のむらップ・ファンド（普通型）	7,049,506,140
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）	5,771,334,376
のむらップ・ファンド（保守型）	4,923,155,923
野村DC外国債券インデックスファンド	3,259,609,223
マイバランス50（確定拠出年金向け）	2,900,464,411
マイバランス70（確定拠出年金向け）	2,589,009,498
野村外国債券インデックス Bコース（野村SMA・EW向け）	2,465,959,976
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）	2,265,600,667
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）	2,164,169,025
マイバランス30（確定拠出年金向け）	2,130,321,675
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）	1,963,921,785
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,903,770,200
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）	1,854,139,207
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	1,727,512,193
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	1,726,688,217
のむらップ・ファンド（積極型）	1,650,685,398
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,550,992,042
マイバランスDC30	1,241,002,811
野村DC運用戦略ファンド	1,207,900,516
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,073,157,685
マイバランスDC50	765,928,639
野村インデックスファンド・外国債券	704,799,284
ネクストコア	678,789,899
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）	647,553,052
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	540,099,984
野村外国債券バッシブファンド（確定拠出年金向け）	530,972,422
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）	504,205,034
マイバランスDC70	461,341,370
ノムラPOFs用インデックスファンド・外国債券（適格機関投資家専用）	455,477,950
野村外国債券インデックスファンド	294,047,502
のむらップ・ファンド（やや保守型）	289,746,172
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）	237,745,036
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	200,013,315
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）	195,849,097
バランスセレクト50	95,597,698
バランスセレクト30	90,376,727
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	89,259,609
のむらップ・ファンド（やや積極型）	80,942,919
バランスセレクト70	75,084,362
野村資産設計ファンド2040	71,599,738
野村資産設計ファンド2025	50,575,113
野村資産設計ファンド2020	48,213,634
野村資産設計ファンド2030	41,284,644
野村資産設計ファンド2015	39,664,609
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	31,841,681
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	29,700,278
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	29,086,187
野村資産設計ファンド2035	28,505,057
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）	18,611,102
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）	11,603,558

ファンド名	当期末
	元本額
	円
バランスセレクト50 (確定拠出年金向け)	7,306,024
野村資産設計ファンド2045	6,164,098
バランスセレクト70 (確定拠出年金向け)	5,631,680
野村資産設計ファンド2050	5,453,395
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	3,895,239
バランスセレクト30 (確定拠出年金向け)	3,625,898
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)	3,038,940
マイターゲット2040 (確定拠出年金向け)	1,511,427
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)	1,312,663
マイターゲット2030 (確定拠出年金向け)	1,163,075
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	1,093,066
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	888,025
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	793,345
インデックス・ブレンド (タイプIV)	36,599
インデックス・ブレンド (タイプIII)	24,808
インデックス・ブレンド (タイプV)	24,301
インデックス・ブレンド (タイプI)	17,860
インデックス・ブレンド (タイプII)	11,796

## 〇お知らせ

- 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＞