

# 野村外国債券インデックス Aコース (野村SMA・EW向け)

## 運用報告書(全体版)

第3期(決算日2018年12月6日)

作成対象期間(2017年12月7日～2018年12月6日)

### 受益者のみなさまへ

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

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型	
信託期間	2016年8月25日以降、無期限とします。	
運用方針	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主として外国の公社債に実質的に投資し、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。為替ヘッジはマザーファンドにおいて行うため、当ファンドにおいては原則として行いません。	
主な投資対象	野村外国債券インデックス Aコース (野村SMA・EW向け)	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資する場合があります。
	マザーファンド	外国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村外国債券インデックス Aコース (野村SMA・EW向け)	株式への直接投資は行いません。株式への投資は、転換社債を転換したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。
	マザーファンド	株式への投資は行いません。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

## 野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104

(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 分 配	み 金 騰 落	中 率	中 率			
(設定日) 2016年8月25日	円 10,000	円 —	% —	100.00	% —	% —	% —	百万円 1
1期(2016年12月6日)	9,518	0	△4.8	95.36	△4.6	98.0	—	123
2期(2017年12月6日)	9,636	0	1.2	96.89	1.6	97.1	24.9	835
3期(2018年12月6日)	9,452	0	△1.9	95.32	△1.6	98.3	—	2,783

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

\*FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)<sup>※</sup>は、設定時を100として再指数化しています。  
\*FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。  
FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。  
※名称変更しております (旧名称はシティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース))。  
(出所) FTSE Fixed Income LLC

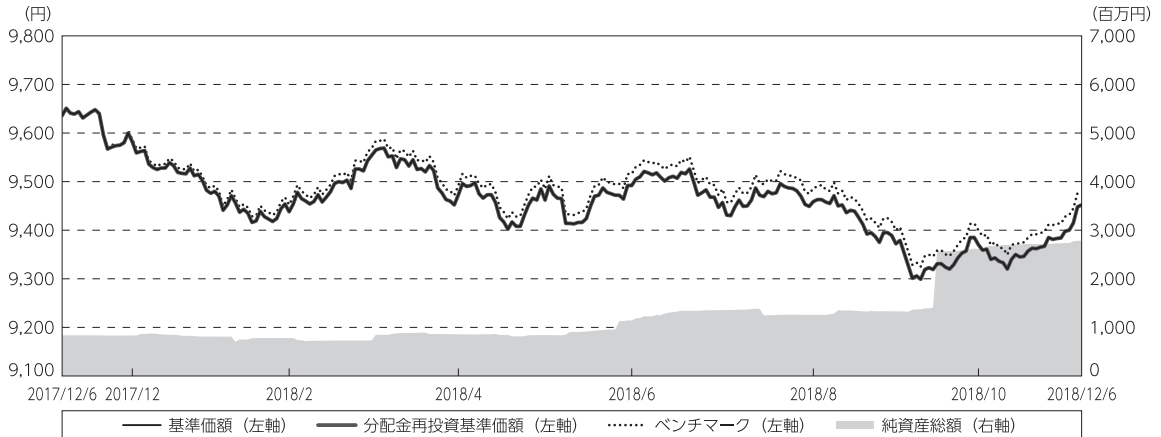
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額		ベンチマーク FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落	率	騰 落	率		
(期首) 2017年12月6日	円 9,636	% —	96.89	% —	% 97.1	% 24.9
12月末	9,582	△0.6	96.40	△0.5	98.6	—
2018年1月末	9,476	△1.7	95.39	△1.6	96.0	—
2月末	9,438	△2.1	95.05	△1.9	95.6	—
3月末	9,565	△0.7	96.36	△0.5	97.9	—
4月末	9,473	△1.7	95.45	△1.5	99.3	—
5月末	9,462	△1.8	95.37	△1.6	95.9	—
6月末	9,492	△1.5	95.68	△1.2	98.5	—
7月末	9,447	△2.0	95.25	△1.7	98.6	—
8月末	9,459	△1.8	95.39	△1.6	97.6	—
9月末	9,395	△2.5	94.77	△2.2	100.9	—
10月末	9,370	△2.8	94.52	△2.5	96.4	—
11月末	9,398	△2.5	94.80	△2.2	99.7	—
(期末) 2018年12月6日	9,452	△1.9	95.32	△1.6	98.3	—

\*騰落率は期首比です。  
\*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。  
\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



期首：9,636円

期末：9,452円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率：△ 1.9%（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（2017年12月6日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）です。ベンチマークは、作成期首（2017年12月6日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首9,636円から期末9,452円に184円の値下がりとなりました。

外国債券利回りが上昇（価格は下落）したことや、対円で為替ヘッジを行なったことによるコストなどがマイナスに影響したため、基準価額は下落しました。

### ○投資環境

当運用期間では、米国における継続的な政策金利の引き上げや、イタリアにおける予算案への懸念などを背景に、外国債券利回りは米国やユーロ周縁国を中心に上昇（価格は下落）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）]

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

### [外国債券為替ヘッジ型マザーファンド]

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指すため、地域構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（地域構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、外貨建て資産については概ねベンチマークと同様に為替ヘッジを行いました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は-1.9%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。

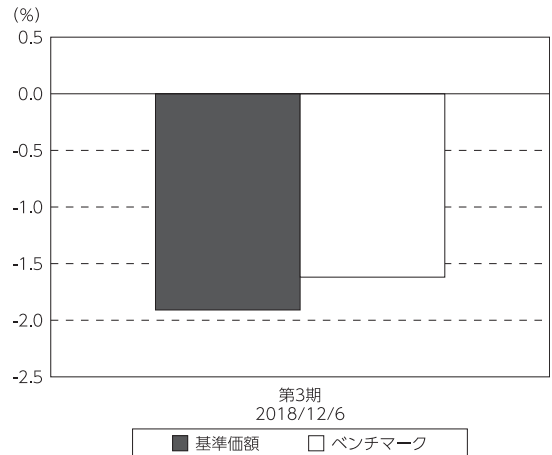
### (マイナス要因)

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

### (その他の要因)

ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なること

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

## ◎分配金

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

## ○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

項 目	第3期
	2017年12月7日～ 2018年12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	277

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ◎今後の運用方針

### 〔野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）〕

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

### 〔外国債券為替ヘッジ型マザーファンド〕

引き続き、外国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

（2017年12月7日～2018年12月6日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 31	% 0.324	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(22)	(0.238)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	( 5)	(0.054)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	( 3)	(0.032)	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) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.000	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	3	0.027	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	( 2)	(0.024)	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	34	0.351	
期中の平均基準価額は、9,463円です。			

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

\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

## ○売買及び取引の状況

(2017年12月7日～2018年12月6日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	千口 2,212,944	千円 2,455,972	千口 458,502	千円 512,798

\*単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2017年12月7日～2018年12月6日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2017年12月7日～2018年12月6日)

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

## ○組入資産の明細

(2018年12月6日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	千口 735,193	千口 2,489,636	千円 2,783,164

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2018年12月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	千円 2,783,164	% 99.9
コール・ローン等、その他	2,956	0.1
投資信託財産総額	2,786,120	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*外国債券為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（54,279,344千円）の投資信託財産総額（55,154,561千円）に対する比率は98.4%です。

\*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=112.94円、1カナダドル=84.40円、1英ポンド=143.65円、1スウェーデンクローナ=12.58円、1ノルウェークローネ=13.27円、1デンマーククローネ=17.17円、1ユーロ=128.15円、1ズロチ=29.94円、1シンガポールドル=82.54円、1豪ドル=81.93円、1メキシコペソ=5.50円、1ランド=8.14円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年12月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,786,120,251
コール・ローン等	2,903,249
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)	2,783,164,351
未収入金	52,651
(B) 負債	2,677,848
未払解約金	1,598
未払信託報酬	2,658,586
未払利息	5
その他未払費用	17,659
(C) 純資産総額(A-B)	2,783,442,403
元本	2,944,697,040
次期繰越損益金	△ 161,254,637
(D) 受益権総口数	2,944,697,040口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,452円

(注) 期首元本額は867,309,581円、期中追加設定元本額は2,707,155,047円、期中一部解約元本額は629,767,588円、1口当たり純資産額は0.9452円です。

## ○損益の状況 (2017年12月7日～2018年12月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 921
支払利息	△ 921
(B) 有価証券売買損益	11,676,140
売買益	19,100,113
売買損	△ 7,423,973
(C) 信託報酬等	△ 4,007,290
(D) 当期損益金(A+B+C)	7,667,929
(E) 前期繰越損益金	2,448,782
(F) 追加信託差損益金	△171,371,348
(配当等相当額)	( 49,054,956)
(売買損益相当額)	(△220,426,304)
(G) 計(D+E+F)	△161,254,637
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△161,254,637
追加信託差損益金	△171,371,348
(配当等相当額)	( 53,472,048)
(売買損益相当額)	(△224,843,396)
分配準備積立金	28,285,110
繰越損益金	△ 18,168,399

\*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（2017年12月7日～2018年12月6日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2017年12月7日～ 2018年12月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	21,994,227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	53,472,048円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	6,290,883円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	81,757,158円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	277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

投資信託約款に記載されているインデックスの名称を「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）」から「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）」に変更する所要の約款変更を行いました。  
 <変更適用日：2018年2月23日>

## ○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2018年12月6日現在）

## &lt;外国債券為替ヘッジ型マザーファンド&gt;

下記は、外国債券為替ヘッジ型マザーファンド全体(49,007,958千口)の内容です。

## 外国公社債

## (A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区分	額面金額	当 期		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		評 価 額				5年以上	2年以上	2年未満
		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	222,630	218,502	24,677,673	45.0	—	17.9	19.5	7.7
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	11,640	12,347	1,042,149	1.9	—	1.0	0.7	0.3
	千英ポンド	千英ポンド						
イギリス	21,450	25,197	3,619,655	6.6	—	4.9	1.3	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	12,150	13,570	170,721	0.3	—	0.1	0.2	0.0
	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	7,650	7,831	103,919	0.2	—	0.1	0.1	—
	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	14,300	17,943	308,089	0.6	—	0.4	0.1	0.0
	千ユーロ	千ユーロ						
ユーロ								
ドイツ	25,210	28,437	3,644,239	6.7	—	3.6	2.4	0.7
イタリア	37,650	37,518	4,808,053	8.8	—	4.3	3.1	1.3
フランス	38,970	43,263	5,544,228	10.1	—	6.3	2.9	0.9
オランダ	7,590	8,781	1,125,300	2.1	—	1.1	0.8	0.2
スペイン	23,170	25,345	3,248,042	5.9	—	3.5	1.6	0.8
ベルギー	9,750	10,855	1,391,179	2.5	—	1.7	0.5	0.3
オーストリア	5,120	5,832	747,478	1.4	—	0.8	0.4	0.2
フィンランド	2,200	2,434	311,985	0.6	—	0.4	0.1	0.1
アイルランド	3,830	4,099	525,307	1.0	—	0.7	0.2	0.1
	千ズロチ	千ズロチ						
ポーランド	12,010	12,085	361,836	0.7	—	0.2	0.4	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	5,470	5,574	460,089	0.8	—	0.4	0.4	0.1
	千豪ドル	千豪ドル						
オーストラリア	12,820	13,413	1,098,964	2.0	—	1.3	0.5	0.2
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	74,900	68,117	374,643	0.7	—	0.4	0.2	0.0
	千ランド	千ランド						
南アフリカ	39,200	36,512	297,214	0.5	—	0.5	0.1	—
合 計	—	—	53,860,773	98.3	—	49.4	35.3	13.5

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

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

\* 金額の単位未満は切り捨て。

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

## (B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY BOND	6.25	70	80	9,100	2023/8/15
	US TREASURY BOND	6.0	210	253	28,581	2026/2/15
	US TREASURY BOND	6.5	2,680	3,371	380,737	2026/11/15
	US TREASURY BOND	5.5	1,280	1,556	175,824	2028/8/15
	US TREASURY BOND	5.25	20	23	2,708	2028/11/15
	US TREASURY BOND	5.25	80	96	10,870	2029/2/15
	US TREASURY BOND	2.875	2,110	2,004	226,388	2043/5/15
	US TREASURY BOND	3.75	3,750	4,126	466,042	2043/11/15
	US TREASURY N/B	1.0	1,520	1,494	168,765	2019/11/30
	US TREASURY N/B	1.375	3,000	2,954	333,711	2020/1/15
	US TREASURY N/B	3.625	2,140	2,160	244,032	2020/2/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,000	2,951	333,287	2020/2/15
	US TREASURY N/B	2.25	2,400	2,383	269,192	2020/3/31
	US TREASURY N/B	1.125	2,430	2,375	268,237	2020/4/30
	US TREASURY N/B	1.375	4,100	4,020	454,118	2020/4/30
	US TREASURY N/B	3.5	1,380	1,393	157,421	2020/5/15
	US TREASURY N/B	1.5	1,000	981	110,897	2020/5/15
	US TREASURY N/B	1.5	1,150	1,128	127,440	2020/5/31
	US TREASURY N/B	1.625	1,050	1,031	116,465	2020/6/30
	US TREASURY N/B	1.5	1,500	1,469	165,955	2020/7/15
	US TREASURY N/B	1.5	3,600	3,523	397,944	2020/8/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,800	2,767	312,600	2020/8/31
	US TREASURY N/B	1.375	4,000	3,903	440,818	2020/9/15
	US TREASURY N/B	1.375	1,400	1,362	153,922	2020/10/31
	US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,470	166,048	2020/11/15
	US TREASURY N/B	2.375	3,400	3,371	380,771	2020/12/31
	US TREASURY N/B	3.625	3,700	3,764	425,174	2021/2/15
	US TREASURY N/B	2.0	3,580	3,517	397,312	2021/2/28
	US TREASURY N/B	2.375	4,000	3,960	447,330	2021/4/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,700	3,577	404,084	2021/4/30
	US TREASURY N/B	2.0	3,000	2,942	332,281	2021/5/31
	US TREASURY N/B	2.625	2,000	1,991	224,874	2021/6/15
	US TREASURY N/B	2.125	3,500	3,441	388,712	2021/6/30
	US TREASURY N/B	2.625	2,000	1,990	224,847	2021/7/15
	US TREASURY N/B	1.125	2,900	2,775	313,516	2021/7/31
	US TREASURY N/B	2.125	4,150	4,076	460,407	2021/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,500	1,497	169,145	2021/8/15
	US TREASURY N/B	1.125	4,000	3,824	431,907	2021/8/31
	US TREASURY N/B	2.125	1,500	1,472	166,299	2021/9/30
	US TREASURY N/B	2.875	1,300	1,302	147,085	2021/10/15
	US TREASURY N/B	2.0	700	684	77,291	2021/10/31
	US TREASURY N/B	1.25	1,500	1,435	162,097	2021/10/31
	US TREASURY N/B	2.0	600	585	66,112	2022/2/15
	US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,451	163,910	2022/2/28
	US TREASURY N/B	1.75	200	193	21,836	2022/3/31

## 野村外国債券インデックス Aコース (野村SMA・EW向け)

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額		債還年月日	
			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	1.75	2,400	2,316	261,590	2022/5/31
	US TREASURY N/B	2.125	2,700	2,637	297,933	2022/6/30
	US TREASURY N/B	1.75	1,200	1,157	130,715	2022/6/30
	US TREASURY N/B	1.625	300	287	32,481	2022/8/15
	US TREASURY N/B	1.875	3,100	2,997	338,530	2022/8/31
	US TREASURY N/B	1.875	700	676	76,405	2022/9/30
	US TREASURY N/B	1.875	1,500	1,448	163,560	2022/10/31
	US TREASURY N/B	1.625	2,150	2,055	232,159	2022/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,260	2,200	248,514	2022/12/31
	US TREASURY N/B	2.0	3,110	3,010	340,020	2023/2/15
	US TREASURY N/B	2.625	1,000	992	112,132	2023/2/28
	US TREASURY N/B	1.5	2,600	2,462	278,090	2023/3/31
	US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,433	161,938	2023/5/15
	US TREASURY N/B	1.625	6,000	5,700	643,863	2023/5/31
	US TREASURY N/B	1.375	2,500	2,346	265,056	2023/6/30
	US TREASURY N/B	1.25	3,500	3,263	368,561	2023/7/31
	US TREASURY N/B	2.5	4,700	4,636	523,685	2023/8/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,000	2,809	317,352	2023/8/31
	US TREASURY N/B	2.75	2,500	2,495	281,798	2023/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	700	662	74,790	2023/10/31
	US TREASURY N/B	2.75	1,000	997	112,666	2023/11/15
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	1,946	219,862	2023/12/31
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	1,945	219,765	2024/1/31
	US TREASURY N/B	2.75	3,400	3,388	382,751	2024/2/15
	US TREASURY N/B	2.0	3,500	3,357	379,200	2024/4/30
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	1,925	217,471	2024/9/30
	US TREASURY N/B	2.25	400	387	43,744	2024/11/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	1,904	215,124	2025/2/15
	US TREASURY N/B	2.125	300	287	32,455	2025/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,780	2,637	297,833	2025/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	600	596	67,366	2025/8/31
	US TREASURY N/B	2.25	2,640	2,540	286,910	2025/11/15
	US TREASURY N/B	1.625	1,100	1,012	114,353	2026/2/15
	US TREASURY N/B	1.625	4,200	3,854	435,288	2026/5/15
	US TREASURY N/B	1.5	3,800	3,443	388,903	2026/8/15
	US TREASURY N/B	2.0	3,000	2,813	317,802	2026/11/15
	US TREASURY N/B	2.25	2,700	2,575	290,882	2027/2/15
	US TREASURY N/B	2.375	500	481	54,330	2027/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	3,800	3,611	407,881	2027/8/15
	US TREASURY N/B	2.25	4,300	4,079	460,714	2027/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	2,000	1,974	222,950	2028/2/15
	US TREASURY N/B	5.0	340	435	49,205	2037/5/15
	US TREASURY N/B	4.5	2,360	2,866	323,760	2038/5/15
	US TREASURY N/B	4.25	1,800	2,120	239,471	2039/5/15
	US TREASURY N/B	4.625	2,150	2,659	300,320	2040/2/15
	US TREASURY N/B	3.875	2,340	2,620	295,931	2040/8/15
	US TREASURY N/B	2.5	700	615	69,540	2045/2/15

## 野村外国債券インデックス Aコース (野村SMA・EW向け)

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY N/B	3.0	2,540	2,463	278,194	2045/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,760	2,611	294,886	2045/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	3,020	2,926	330,553	2045/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	1,130	990	111,848	2046/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	2,000	1,751	197,786	2046/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	2,530	2,097	236,872	2046/8/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,600	2,455	277,310	2046/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,920	1,765	199,361	2047/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	2,100	2,028	229,076	2048/2/15
小 計					24,677,673	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,640	1,630	137,600	2020/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	0.75	2,570	2,496	210,739	2021/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5	1,300	1,236	104,354	2022/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	800	780	65,890	2023/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.5	1,060	1,082	91,381	2024/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	600	575	48,537	2026/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	8.0	330	480	40,530	2027/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0	500	494	41,759	2028/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	5.75	420	561	47,368	2029/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	5.75	200	288	24,324	2033/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	5.0	400	566	47,847	2037/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0	680	886	74,813	2041/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,140	1,267	107,001	2048/12/1
小 計					1,042,149	
イギリス			千英ポンド	千英ポンド		
国債証券	UK TREASURY	2.0	1,480	1,509	216,909	2020/7/22
	UK TREASURY	1.5	1,600	1,625	233,448	2021/1/22
	UK TREASURY	4.0	1,420	1,565	224,948	2022/3/7
	UK TREASURY	1.75	700	723	103,947	2022/9/7
	UK TREASURY	0.75	800	794	114,112	2023/7/22
	UK TREASURY	2.25	250	265	38,163	2023/9/7
	UK TREASURY	2.75	1,200	1,319	189,523	2024/9/7
	UK TREASURY	1.5	1,670	1,719	246,960	2026/7/22
	UK TREASURY	1.625	1,000	1,028	147,787	2028/10/22
	UK TREASURY	6.0	90	129	18,666	2028/12/7
	UK TREASURY	4.75	600	820	117,830	2030/12/7
	UK TREASURY	4.5	200	278	40,018	2034/9/7
	UK TREASURY	4.25	1,160	1,593	228,888	2036/3/7
	UK TREASURY	1.75	1,050	1,038	149,173	2037/9/7
	UK TREASURY	4.5	1,250	1,879	270,008	2042/12/7
	UK TREASURY	3.5	400	527	75,824	2045/1/22
	UK TREASURY	4.25	1,480	2,222	319,285	2046/12/7
	UK TREASURY	1.5	2,300	2,085	299,635	2047/7/22
	UK TREASURY	1.75	400	383	55,109	2049/1/22
	UK TREASURY	4.25	840	1,300	186,803	2049/12/7
	UK TREASURY	3.75	950	1,395	200,402	2052/7/22

## 野村外国債券インデックス Aコース (野村SMA・EW向け)

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
	国債証券	UK TREASURY	3.5	130	201	28,936	2068/7/22
		UNITED KINGDOM(GOVERNEM	4.25	480	788	113,274	2055/12/7
小 計						3,619,655	
スウェーデン				千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	5.0	600	665	8,370	2020/12/1
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	3,500	3,955	49,756	2022/6/1
		SWEDISH GOVERNMENT	1.5	3,000	3,228	40,620	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT	2.5	250	287	3,614	2025/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	1.0	2,700	2,845	35,800	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT	0.75	1,000	1,025	12,895	2028/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	1,100	1,563	19,663	2039/3/30
小 計						170,721	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.75	1,050	1,116	14,815	2021/5/25
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,900	1,951	25,893	2023/5/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	750	807	10,721	2024/3/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	1,700	1,682	22,330	2026/2/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	750	749	9,945	2027/2/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,500	1,523	20,213	2028/4/26
小 計						103,919	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	0.25	1,550	1,576	27,068	2020/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	3.0	1,500	1,653	28,394	2021/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.5	1,650	1,792	30,783	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	3,400	3,812	65,462	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	2,300	2,352	40,395	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	3,900	6,755	115,984	2039/11/15
小 計						308,089	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESobligation	—	2,200	2,230	285,896	2021/4/9
		BUNDESobligation	—	1,700	1,726	221,284	2021/10/8
		BUNDESobligation	—	1,000	1,015	130,195	2023/4/14
		BUNDESobligation	—	600	608	77,975	2023/10/13
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0	300	317	40,680	2020/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	750	788	101,057	2020/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	850	916	117,480	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	1,300	1,404	179,950	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,310	1,419	181,897	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	700	777	99,619	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	610	674	86,403	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	440	470	60,267	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	900	934	119,721	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,100	1,097	140,611	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	1,770	1,793	229,787	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,850	1,906	244,296	2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,000	1,026	131,515	2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	700	1,123	143,989	2031/1/4

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	4.75	700	1,136	145,692	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	300	470	60,286	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	310	518	66,430	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	60	107	13,839	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	1,350	2,059	263,947	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	500	687	88,096	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	710	989	126,857	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	200	216	27,788	2048/8/15
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	1,000	1,008	129,223	2020/3/13
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	1,000	1,010	129,445	2020/6/12
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.05	1,700	1,712	219,512	2019/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	170	178	22,816	2020/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	1,500	1,497	191,963	2020/6/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	460	486	62,368	2020/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	1,800	1,800	230,739	2020/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	170	180	23,154	2021/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.45	2,500	2,469	316,498	2021/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	710	776	99,539	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	1,450	1,418	181,738	2021/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2	700	693	88,924	2022/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	530	527	67,593	2022/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9	500	487	62,428	2022/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	900	892	114,414	2022/9/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	3,200	3,084	395,276	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	150	166	21,309	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	500	508	65,217	2023/10/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	2,000	1,878	240,716	2023/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	180	237	30,471	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	200	222	28,464	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	700	664	85,174	2024/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	350	400	51,384	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	330	318	40,813	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6	1,050	979	125,515	2026/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.25	3,100	2,800	358,849	2026/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2	2,900	2,766	354,465	2027/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	300	279	35,838	2028/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,240	1,427	182,948	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	700	892	114,418	2031/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	900	752	96,385	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	770	692	88,699	2033/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,110	1,315	168,604	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.25	500	427	54,777	2036/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	1,080	1,155	148,076	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	400	365	46,841	2038/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	150	178	22,832	2039/8/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,380	1,598	204,859	2044/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	1,360	1,274	163,356	2046/9/1		

## 野村外国債券インデックス Aコース (野村SMA・EW向け)

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2. 8	10	8	1,061	2067/3/1
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	900	907	116,313	2020/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	3,000	3,033	388,698	2021/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1. 75	3,900	4,234	542,683	2023/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2. 25	1,710	1,921	246,287	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0. 5	400	408	52,380	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0. 5	1,300	1,318	168,914	2026/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0. 25	3,250	3,214	411,878	2026/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	0. 75	2,300	2,329	298,491	2028/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2. 5	1,020	1,209	155,000	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1. 25	2,150	2,159	276,762	2036/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1. 75	600	645	82,705	2039/6/25
		FRANCE (GOVT OF)	2. 0	1,510	1,649	211,415	2048/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3. 5	200	211	27,077	2020/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2. 5	900	952	122,011	2020/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	0. 25	1,900	1,929	247,222	2020/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3. 75	1,140	1,255	160,860	2021/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3. 25	1,000	1,106	141,792	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3. 0	1,320	1,470	188,384	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2. 25	1,210	1,328	170,233	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1. 75	1,600	1,759	225,542	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3. 5	910	1,126	144,382	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2. 75	1,400	1,675	214,735	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5. 5	400	596	76,377	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1. 5	1,640	1,755	224,909	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4. 75	1,190	1,845	236,511	2035/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4. 5	920	1,478	189,471	2041/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3. 25	900	1,241	159,159	2045/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4. 0	300	499	64,024	2060/4/25
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	0. 25	400	404	51,806	2020/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3. 5	500	533	68,387	2020/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3. 25	500	550	70,482	2021/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2. 25	650	712	91,327	2022/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3. 75	530	620	79,486	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1. 75	1,300	1,421	182,167	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0. 5	800	819	105,052	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0. 75	1,000	1,037	132,952	2027/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2. 5	850	1,058	135,689	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3. 75	610	977	125,231	2042/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2. 75	450	645	82,715	2047/1/15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1. 4	1,470	1,500	192,255	2020/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1. 15	1,400	1,432	183,612	2020/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 85	420	460	58,985	2020/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0. 05	1,500	1,505	192,923	2021/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0. 75	730	746	95,619	2021/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5. 85	1,490	1,762	225,857	2022/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0. 45	800	808	103,545	2022/10/31



野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	200	242	31,061	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.35	500	498	63,902	2023/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	1,140	1,355	173,762	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	1,120	1,305	167,303	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	400	446	57,278	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	500	621	79,649	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,620	1,722	220,733	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	1,000	1,011	129,682	2026/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5	1,300	1,324	169,726	2027/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,100	1,111	142,416	2027/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	900	900	115,428	2028/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	600	595	76,290	2028/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	30	40	5,139	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	800	822	105,454	2030/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	900	941	120,698	2033/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	800	1,128	144,637	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	600	904	115,911	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	1,150	1,226	157,129	2046/10/31
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	90	128	16,446	2029/1/31
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	610	800	102,589	2037/1/31
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.75	1,300	1,402	179,695	2020/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	340	385	49,341	2021/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	500	572	73,400	2022/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	700	821	105,304	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	0.2	400	404	51,839	2023/10/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	230	261	33,562	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.5	700	713	91,456	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	800	832	106,719	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	950	965	123,695	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,200	1,195	153,168	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	550	750	96,221	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.45	200	199	25,622	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	420	449	57,664	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	3.75	550	795	101,896	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	370	358	45,882	2047/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.15	170	174	22,372	2066/6/22		
BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	370	572	73,338	2035/3/28		
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9	700	751	96,255	2020/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	500	568	72,866	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	920	1,005	128,848	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	700	722	92,530	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	1,000	1,006	128,918	2027/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	200	204	26,142	2028/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	130	156	20,058	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	130	196	25,200	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	500	708	90,764	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	100	103	13,269	2047/2/20

## 野村外国債券インデックス Aコース (野村SMA・EW向け)

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	230	401	51,427	2062/1/26
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	10	9	1,196	2086/11/2
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	3.375	50	52	6,750	2020/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.375	190	193	24,751	2020/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	—	300	303	38,891	2022/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	150	161	20,654	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.0	200	221	28,426	2024/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	310	315	40,437	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	440	532	68,205	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	300	308	39,596	2034/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	260	345	44,270	2042/7/4
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	4.5	300	320	41,076	2020/4/18
		IRISH GOVERNMENT	0.9	800	800	102,537	2028/5/15
		IRISH TSY 0.8% 2022	0.8	800	826	105,872	2022/3/15
		IRISH TSY 1% 2026	1.0	350	360	46,230	2026/5/15
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	350	358	45,951	2037/5/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	50	52	6,746	2045/2/18
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	1,100	1,286	164,896	2024/3/18
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	80	93	11,994	2023/3/20
小 計						21,345,816	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	POLAND GOVERNMENT BOND	1.5	2,900	2,905	86,999	2020/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.0	400	403	12,068	2021/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	1,650	1,650	49,430	2021/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	150	166	4,982	2021/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	1,160	1,172	35,112	2022/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	1,500	1,516	45,399	2023/1/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	1,400	1,504	45,040	2023/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	1,000	980	29,341	2026/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	1,850	1,785	53,461	2027/7/25
小 計						361,836	
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	SINGAPORE GOVERNMENT	3.25	400	408	33,695	2020/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.25	1,030	1,008	83,256	2021/10/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	1,400	1,441	118,965	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	400	405	33,432	2025/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	730	801	66,159	2027/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	610	639	52,791	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	700	667	55,107	2036/8/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	200	202	16,682	2046/3/1
		小 計					
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	70	72	5,929	2020/4/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	1,420	1,414	115,878	2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0	1,100	1,100	90,157	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	120	135	11,098	2022/7/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	1,100	1,107	90,699	2022/11/21

野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額		千円	
			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	5.5	800	912	74,788	2023/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	400	410	33,633	2024/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	340	358	29,412	2025/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	1,120	1,259	103,204	2026/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	820	963	78,950	2027/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	900	919	75,368	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	2,420	2,364	193,710	2028/5/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	300	305	25,053	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	670	816	66,904	2033/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	150	169	13,898	2037/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	520	544	44,627	2039/6/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	300	289	23,748	2041/5/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	270	267	21,899	2047/3/21
小計					1,098,964	
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	900	869	4,780	2019/12/11
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	3,000	2,976	16,371	2020/6/11
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	9,200	8,744	48,092	2021/6/10
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	15,000	13,928	76,607	2022/6/9
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	14,000	11,532	63,426	2026/3/5
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	10,100	9,123	50,180	2027/6/3
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	3,100	2,660	14,633	2034/11/23
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	3,000	3,121	17,166	2036/11/20
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	5,000	4,522	24,871	2038/11/18
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	4,300	3,623	19,929	2047/11/7
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	7,300	7,015	38,582	2023/12/7
小計					374,643	
南アフリカ			千ランド	千ランド		
国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	800	792	6,453	2021/3/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	4,500	4,420	35,981	2023/2/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	5,900	6,411	52,187	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	5,650	5,095	41,480	2030/1/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	2,800	2,287	18,618	2031/2/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.875	3,500	3,248	26,444	2035/2/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	8,800	7,795	63,458	2037/1/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	7,250	6,460	52,588	2048/2/28
小計					297,214	
合計					53,860,773	

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

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

# 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

## 運用報告書

第5期（決算日2018年9月6日）

作成対象期間（2017年9月7日～2018年9月6日）

### 受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行います。
主な投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は行いません。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

## ○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	騰落	中率	騰落	中率			
(設定日)	円	%	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	%	%	%	百万円
2013年9月12日	10,000	—	100.00	—	—	—	299
1期(2014年9月8日)	10,758	7.6	107.83	7.8	98.1	—	543
2期(2015年9月7日)	11,088	3.1	111.34	3.3	96.0	—	1,354
3期(2016年9月6日)	11,711	5.6	117.74	5.7	99.2	—	4,324
4期(2017年9月6日)	11,412	△2.6	114.81	△2.5	84.6	—	15,515
5期(2018年9月6日)	11,174	△2.1	112.61	△1.9	98.8	—	50,125

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

\*FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

(出所) FTSE Fixed Income LLC

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

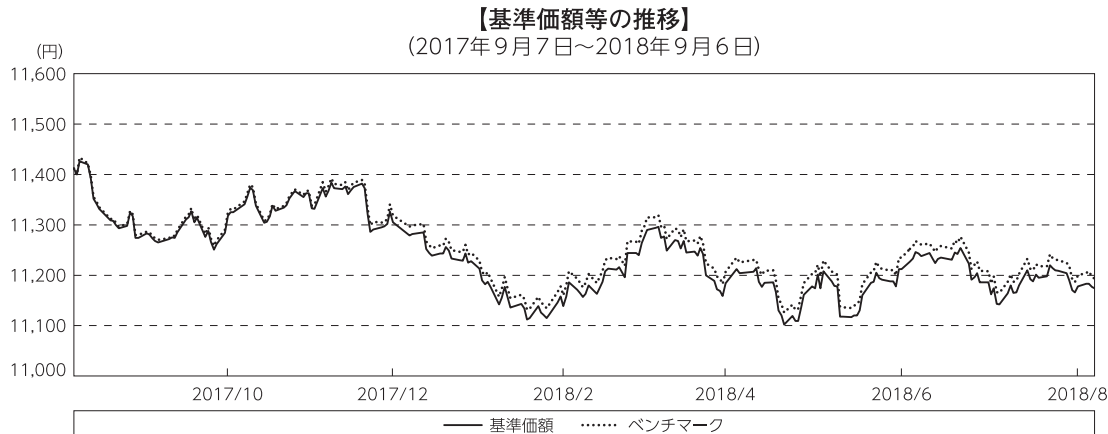
年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
	騰落	中率	騰落	中率		
(期首)	円	%	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	%	%	%
2017年9月6日	11,412	—	114.81	—	84.6	—
9月末	11,274	△1.2	113.49	△1.2	98.7	—
10月末	11,318	△0.8	113.94	△0.8	97.7	—
11月末	11,333	△0.7	114.07	△0.6	96.8	—
12月末	11,305	△0.9	113.87	△0.8	98.6	—
2018年1月末	11,182	△2.0	112.68	△1.9	96.0	—
2月末	11,139	△2.4	112.28	△2.2	95.6	—
3月末	11,290	△1.1	113.83	△0.9	97.9	—
4月末	11,184	△2.0	112.75	△1.8	99.3	—
5月末	11,174	△2.1	112.67	△1.9	96.0	—
6月末	11,212	△1.8	113.03	△1.6	98.5	—
7月末	11,162	△2.2	112.52	△2.0	98.6	—
8月末	11,178	△2.1	112.68	△1.9	97.6	—
(期末)						
2018年9月6日	11,174	△2.1	112.61	△1.9	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、円ヘッジ・円ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首11,412円から期末11,174円へと下落し、値下がり額は238円となりました。

外国債券利回りが米国やユーロ周縁国を中心に上昇（価格は下落）したことや、対円で為替ヘッジを行なったことによるコストなどがマイナスに影響したため、基準価額は下落しました。

### ○当ファンドのポートフォリオ

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指すため、地域構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（地域構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、外貨建て資産については概ねベンチマークと同様に為替ヘッジを行いました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

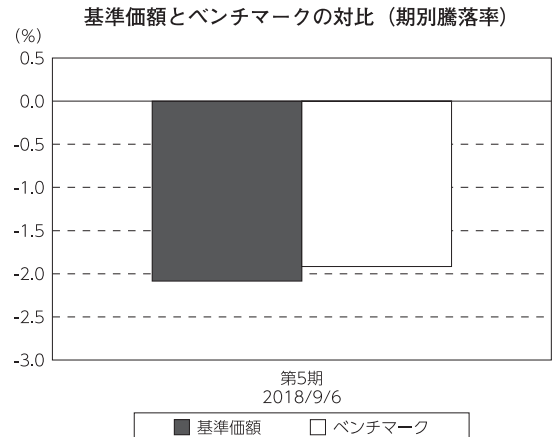
今期の基準価額の騰落率は-2.1%となり、ベンチマークの-1.9%を0.2ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

### (マイナス要因)

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

### (その他の要因)

ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なること



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

## ◎今後の運用方針

引き続き、外国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年9月7日～2018年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.001 (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 ) ( そ の 他 )	4 (4) (0)	0.033 (0.033) (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	4	0.034	
期中の平均基準価額は、11,229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。





## 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	債券先物取引	百万円 11,673	百万円 11,642	百万円 -	百万円 -

\*単位未満は切り捨て。

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

## ○利害関係人との取引状況等

(2017年9月7日～2018年9月6日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ○組入資産の明細

(2018年9月6日現在)

## 外国公社債

## (A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	202,360	199,207	22,163,807	44.2	—	16.4	20.6	7.2
カナダ	千カナダドル 10,940	千カナダドル 11,447	966,652	1.9	—	0.9	0.7	0.3
イギリス	千英ポンド 19,060	千英ポンド 22,961	3,300,685	6.6	—	5.0	1.1	0.5
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 12,150	千スウェーデンクローナ 13,592	167,056	0.3	—	0.2	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 7,250	千ノルウェークローネ 7,441	98,606	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 12,150	千デンマーククローネ 15,077	261,899	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	23,310	26,299	3,404,934	6.8	—	3.6	2.2	1.0
イタリア	36,350	35,843	4,640,693	9.3	—	4.7	3.3	1.2
フランス	35,870	39,750	5,146,543	10.3	—	6.1	3.4	0.8
オランダ	7,490	8,574	1,110,143	2.2	—	1.1	0.9	0.2
スペイン	21,570	23,587	3,053,914	6.1	—	3.9	1.4	0.8
ベルギー	8,780	9,882	1,279,494	2.6	—	1.8	0.5	0.2
オーストリア	5,120	5,823	753,935	1.5	—	1.1	0.1	0.2
フィンランド	2,400	2,535	328,227	0.7	—	0.3	0.3	0.0
アイルランド	3,530	3,827	495,554	1.0	—	0.6	0.2	0.1
ポーランド	千ズロチ 8,870	千ズロチ 8,871	265,608	0.5	—	0.2	0.2	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 4,920	千シンガポールドル 4,989	403,742	0.8	—	0.4	0.4	0.1
オーストラリア	千豪ドル 12,100	千豪ドル 12,699	1,016,624	2.0	—	1.3	0.6	0.1
メキシコ	千メキシコペソ 74,900	千メキシコペソ 72,314	415,808	0.8	—	0.5	0.3	0.0
南アフリカ	千ランド 35,200	千ランド 32,118	231,572	0.5	—	0.4	0.0	—
合 計	—	—	49,505,506	98.8	—	49.3	36.6	12.9

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

\*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。

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

## (B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券					
	US TREASURY BOND	6.25	70	81	9,040	2023/8/15
	US TREASURY BOND	6.0	210	254	28,300	2026/2/15
	US TREASURY BOND	6.5	2,680	3,392	377,473	2026/11/15
	US TREASURY BOND	5.5	280	342	38,123	2028/8/15
	US TREASURY BOND	5.25	20	24	2,683	2028/11/15
	US TREASURY BOND	5.25	80	96	10,772	2029/2/15
	US TREASURY BOND	2.875	910	879	97,908	2043/5/15
	US TREASURY BOND	3.75	3,750	4,195	466,835	2043/11/15
	US TREASURY N/B	1.25	4,400	4,347	483,673	2019/8/31
	US TREASURY N/B	3.375	430	434	48,303	2019/11/15
	US TREASURY N/B	1.0	3,520	3,454	384,322	2019/11/30
	US TREASURY N/B	1.375	1,500	1,476	164,249	2020/1/15
	US TREASURY N/B	3.625	2,140	2,170	241,537	2020/2/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,000	2,949	328,108	2020/2/15
	US TREASURY N/B	2.25	400	397	44,255	2020/3/31
	US TREASURY N/B	1.125	1,130	1,102	122,718	2020/4/30
	US TREASURY N/B	1.375	5,100	4,998	556,077	2020/4/30
	US TREASURY N/B	3.5	1,380	1,399	155,733	2020/5/15
	US TREASURY N/B	1.5	1,150	1,128	125,514	2020/5/31
	US TREASURY N/B	1.625	1,050	1,031	114,723	2020/6/30
	US TREASURY N/B	1.5	1,500	1,469	163,441	2020/7/15
	US TREASURY N/B	1.5	3,600	3,522	391,915	2020/8/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,800	2,772	308,412	2020/8/31
	US TREASURY N/B	1.375	4,000	3,900	433,931	2020/9/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,400	3,308	368,117	2020/10/31
	US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,470	163,636	2020/11/15
	US TREASURY N/B	2.375	3,400	3,376	375,712	2020/12/31
	US TREASURY N/B	3.625	3,700	3,780	420,618	2021/2/15
	US TREASURY N/B	2.0	3,580	3,520	391,682	2021/2/28
	US TREASURY N/B	2.375	4,000	3,966	441,337	2021/4/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,700	3,575	397,768	2021/4/30
	US TREASURY N/B	2.0	3,000	2,944	327,586	2021/5/31
	US TREASURY N/B	2.625	2,000	1,995	221,989	2021/6/15
	US TREASURY N/B	2.125	3,500	3,444	383,234	2021/6/30
	US TREASURY N/B	1.125	2,900	2,771	308,411	2021/7/31
	US TREASURY N/B	2.125	4,150	4,080	453,991	2021/8/15
	US TREASURY N/B	1.125	3,000	2,863	318,603	2021/8/31
	US TREASURY N/B	2.0	600	585	65,139	2022/2/15
	US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,451	161,439	2022/2/28
	US TREASURY N/B	1.75	200	193	21,504	2022/3/31
	US TREASURY N/B	1.75	2,400	2,315	257,573	2022/5/31
	US TREASURY N/B	2.125	2,700	2,639	293,619	2022/6/30
	US TREASURY N/B	1.75	1,200	1,156	128,682	2022/6/30
	US TREASURY N/B	1.625	3,300	3,161	351,711	2022/8/15
	US TREASURY N/B	1.875	3,100	2,996	333,427	2022/8/31
	US TREASURY N/B	1.875	700	676	75,241	2022/9/30

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額		千円	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY N/B	1.875	1,500	1,447	161,087	2022/10/31
	US TREASURY N/B	1.625	2,150	2,053	228,472	2022/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,260	2,200	244,866	2022/12/31
	US TREASURY N/B	2.0	3,110	3,010	334,989	2023/2/15
	US TREASURY N/B	2.625	1,000	994	110,625	2023/2/28
	US TREASURY N/B	1.5	2,200	2,080	231,519	2023/3/31
	US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,432	159,406	2023/5/15
	US TREASURY N/B	1.625	6,500	6,172	686,804	2023/5/31
	US TREASURY N/B	1.375	2,500	2,343	260,743	2023/6/30
	US TREASURY N/B	1.25	3,500	3,257	362,425	2023/7/31
	US TREASURY N/B	2.5	4,700	4,640	516,303	2023/8/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,000	2,805	312,084	2023/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	700	661	73,574	2023/10/31
	US TREASURY N/B	2.75	3,400	3,392	377,486	2024/2/15
	US TREASURY N/B	2.0	3,500	3,352	373,042	2024/4/30
	US TREASURY N/B	2.25	400	386	43,043	2024/11/15
	US TREASURY N/B	2.0	1,000	950	105,792	2025/2/15
	US TREASURY N/B	2.0	3,280	3,105	345,488	2025/8/15
	US TREASURY N/B	2.25	3,340	3,210	357,179	2025/11/15
	US TREASURY N/B	1.625	3,900	3,580	398,319	2026/2/15
	US TREASURY N/B	1.625	3,400	3,111	346,129	2026/5/15
	US TREASURY N/B	1.5	3,500	3,161	351,716	2026/8/15
	US TREASURY N/B	2.0	3,000	2,808	312,501	2026/11/15
	US TREASURY N/B	2.25	1,300	1,238	137,801	2027/2/15
	US TREASURY N/B	2.25	3,800	3,607	401,351	2027/8/15
	US TREASURY N/B	2.25	1,500	1,421	158,180	2027/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,800	1,776	197,686	2028/2/15
	US TREASURY N/B	5.0	1,840	2,374	264,214	2037/5/15
	US TREASURY N/B	4.5	1,860	2,277	253,376	2038/5/15
	US TREASURY N/B	4.25	1,200	1,428	158,941	2039/5/15
	US TREASURY N/B	4.625	1,650	2,066	229,875	2040/2/15
	US TREASURY N/B	3.875	2,040	2,314	257,487	2040/8/15
	US TREASURY N/B	2.5	700	627	69,807	2045/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	2,540	2,508	279,089	2045/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,760	2,659	295,922	2045/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	2,820	2,782	309,635	2045/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	1,130	1,009	112,355	2046/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	1,500	1,339	149,053	2046/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	930	786	87,554	2046/8/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	1,925	214,262	2046/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	3,020	2,832	315,162	2047/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	2,000	1,971	219,356	2048/2/15
小計					22,163,807	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,940	1,925	162,624	2020/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	0.75	2,070	2,004	169,258	2021/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5	1,300	1,230	103,928	2022/3/1

銘	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	800	776	65,600	2023/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	1,060	1,078	91,089	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	8.0	330	480	40,551	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	700	632	53,373	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	500	489	41,348	2028/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	120	159	13,491	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	200	286	24,217	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	400	565	47,727	2037/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	680	886	74,878	2041/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	840	930	78,561	2048/12/1
小	計					966,652	
イギリス			千英ポンド	千英ポンド			
	国債証券	UK TREASURY	3.75	60	61	8,883	2019/9/7
		UK TREASURY	2.0	1,480	1,514	217,664	2020/7/22
		UK TREASURY	1.5	1,000	1,016	146,107	2021/1/22
		UK TREASURY	4.0	1,220	1,351	194,319	2022/3/7
		UK TREASURY	1.75	700	721	103,778	2022/9/7
		UK TREASURY	0.75	800	788	113,325	2023/7/22
		UK TREASURY	2.25	250	264	38,042	2023/9/7
		UK TREASURY	2.75	1,200	1,312	188,706	2024/9/7
		UK TREASURY	1.5	1,370	1,393	200,249	2026/7/22
		UK TREASURY	1.625	900	913	131,315	2028/10/22
		UK TREASURY	6.0	90	129	18,595	2028/12/7
		UK TREASURY	4.75	600	814	117,136	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	1,160	1,598	229,748	2036/3/7
		UK TREASURY	1.75	850	842	121,173	2037/9/7
		UK TREASURY	4.5	1,250	1,903	273,664	2042/12/7
		UK TREASURY	4.25	1,880	2,877	413,590	2046/12/7
		UK TREASURY	1.5	1,900	1,761	253,159	2047/7/22
		UK TREASURY	4.25	840	1,328	190,966	2049/12/7
		UK TREASURY	3.75	900	1,350	194,114	2052/7/22
		UK TREASURY	3.5	130	208	30,012	2068/7/22
		UNITED KINGDOM (GOVERNMENT)	4.25	480	807	116,133	2055/12/7
小	計					3,300,685	
スウェーデン			千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ			
	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	5.0	600	674	8,292	2020/12/1
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	3,500	3,985	48,985	2022/6/1
		SWEDISH GOVERNMENT	1.5	3,000	3,233	39,738	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT	2.5	250	288	3,541	2025/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	1.0	2,700	2,838	34,889	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT	0.75	1,000	1,020	12,538	2028/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	1,100	1,551	19,070	2039/3/30
小	計					167,056	
ノルウェー			千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ			
	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.75	1,050	1,122	14,866	2021/5/25
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,900	1,950	25,842	2023/5/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	750	809	10,721	2024/3/14

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			%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	1,700	1,679	22,256	2026/2/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	350	351	4,652	2027/2/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,500	1,529	20,266	2028/4/26
小 計						98,606	
デンマーク				千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	4.0	450	475	8,251	2019/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.25	1,550	1,577	27,397	2020/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	3.0	1,500	1,662	28,870	2021/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.5	1,650	1,790	31,096	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	1,400	1,566	27,216	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	2,300	2,333	40,530	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	3,300	5,672	98,537	2039/11/15
小 計						261,899	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESOBLIGATION	0.25	1,200	1,211	156,846	2019/10/11
		BUNDESOBLIGATION	—	1,200	1,217	157,585	2021/4/9
		BUNDESOBLIGATION	—	1,700	1,725	223,400	2021/10/8
		BUNDESOBLIGATION	—	1,000	1,012	131,088	2023/4/14
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0	300	319	41,400	2020/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	750	792	102,612	2020/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	850	919	119,106	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	1,300	1,407	182,230	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,310	1,420	183,869	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	700	778	100,761	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	610	673	87,167	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	440	468	60,638	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,400	1,442	186,722	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,100	1,086	140,663	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	1,770	1,775	229,853	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,050	1,071	138,671	2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	500	507	65,749	2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	700	1,119	144,887	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	900	1,449	187,712	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	310	512	66,311	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	60	106	13,801	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	1,350	2,022	261,902	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	500	672	87,066	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	710	965	124,990	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	200	209	27,130	2048/8/15
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	400	402	52,114	2019/9/13
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	1,000	1,009	130,646	2020/3/13
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.05	1,700	1,705	220,781	2019/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	170	178	23,059	2020/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	2,500	2,469	319,777	2020/6/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	460	484	62,752	2020/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	1,800	1,780	230,459	2020/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	170	179	23,245	2021/3/1

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
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	0.45	2,500	2,433	315,065	2021/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	710	772	99,957	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	450	432	56,044	2021/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2	700	682	88,408	2022/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	530	519	67,274	2022/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9	500	479	62,093	2022/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	2,200	2,151	278,491	2022/9/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	3,200	3,040	393,630	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	150	164	21,329	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	1,700	1,570	203,371	2023/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	180	238	30,815	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	200	220	28,584	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	350	400	51,812	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	330	315	40,892	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6	2,050	1,896	245,560	2026/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.25	3,100	2,775	359,294	2026/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2	2,500	2,374	307,361	2027/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,040	1,194	154,657	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	600	506	65,555	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	770	700	90,659	2033/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,110	1,336	173,014	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.25	900	776	100,547	2036/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	1,080	1,175	152,174	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	150	181	23,440	2039/8/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,180	1,398	181,053	2044/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	1,360	1,300	168,437	2046/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	10	8	1,088	2067/3/1		
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.5	500	506	65,580	2019/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	900	907	117,547	2020/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	3,000	3,031	392,527	2021/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	3,400	3,696	478,621	2023/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	1,310	1,473	190,783	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	400	407	52,747	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,300	1,313	169,998	2026/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	2,850	2,805	363,290	2026/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,800	1,815	235,042	2028/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	1,020	1,209	156,545	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	2,150	2,153	278,750	2036/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	600	643	83,317	2039/6/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	1,410	1,536	198,948	2048/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	8.5	200	220	28,535	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.5	1,200	1,278	165,584	2020/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	0.25	1,900	1,930	249,916	2020/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.75	1,140	1,265	163,831	2021/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.0	1,320	1,477	191,304	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.25	1,610	1,772	229,542	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.75	1,100	1,209	156,653	2024/11/25



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	
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	3.5	1,410	1,749	226,511	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.75	1,400	1,675	216,875	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5.5	200	298	38,638	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.5	840	897	116,137	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.75	1,190	1,850	239,622	2035/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.5	720	1,158	149,980	2041/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	700	966	125,155	2045/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	300	498	64,553	2060/4/25
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	400	404	52,409	2020/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5	500	538	69,663	2020/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	500	553	71,669	2021/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.25	650	714	92,570	2022/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	530	623	80,712	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	1,300	1,421	184,005	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	1,200	1,222	158,253	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,000	1,031	133,532	2027/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	350	433	56,178	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	200	307	39,820	2037/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	610	969	125,482	2042/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	250	354	45,843	2047/1/15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,470	1,506	195,045	2020/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.15	1,400	1,438	186,186	2020/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.85	420	465	60,288	2020/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.05	1,500	1,505	194,977	2021/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	730	747	96,773	2021/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	1,490	1,784	231,071	2022/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.45	200	201	26,139	2022/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	200	244	31,691	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.35	500	498	64,489	2023/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	840	1,006	130,322	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	1,120	1,317	170,585	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	400	449	58,180	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	500	626	81,096	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,620	1,726	223,535	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	1,000	1,012	131,061	2026/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5	500	509	66,023	2027/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,900	1,922	248,936	2027/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	600	600	77,793	2028/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	600	598	77,503	2028/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	30	40	5,245	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	800	824	106,717	2030/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	900	945	122,349	2033/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	800	1,139	147,500	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	300	456	59,151	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	1,250	1,345	174,164	2046/10/31
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	90	129	16,748	2029/1/31
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	410	543	70,334	2037/1/31

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.0	600	622	80,590	2019/9/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	300	326	42,241	2020/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	340	388	50,264	2021/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	500	576	74,686	2022/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	700	827	107,087	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	0.2	200	201	26,145	2023/10/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	230	262	34,021	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.5	700	712	92,274	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	800	833	107,956	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	950	965	125,035	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	800	800	103,616	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	550	758	98,222	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.45	600	606	78,520	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	220	238	30,850	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	3.75	550	805	104,335	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	200	196	25,407	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	2.15	170	179	23,238	2066/6/22
		5.0	370	579	75,001	2035/3/28	
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.25	200	201	26,108	2019/10/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9	700	757	98,016	2020/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	500	571	73,940	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	920	1,004	130,077	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	700	719	93,130	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	1,000	1,000	129,547	2027/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	130	156	20,236	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	130	196	25,461	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	500	705	91,328	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	100	102	13,300	2047/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	230	398	51,605	2062/1/26
		1.5	10	9	1,182	2086/11/2	
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	3.375	50	53	6,881	2020/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.375	790	804	104,153	2020/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	—	300	302	39,216	2022/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	150	161	20,900	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.0	200	222	28,748	2024/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	310	313	40,626	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	240	290	37,566	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	300	307	39,866	2034/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	60	79	10,267	2042/7/4
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	5.9	200	214	27,745	2019/10/18
		IRISH GOVERNMENT	4.5	300	324	41,971	2020/4/18
		IRISH GOVERNMENT	0.9	300	300	38,872	2028/5/15
		IRISH TSY 0.8% 2022	0.8	800	827	107,097	2022/3/15
		IRISH TSY 1% 2026	1.0	350	360	46,732	2026/5/15
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	350	359	46,596	2037/5/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	50	52	6,852	2045/2/18
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	1,100	1,293	167,496	2024/3/18

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	アイルランド 国債証券 REPUBLIC OF IRELAND	3.9	80	94	12,188	2023/3/20
小 計					20,213,441	
ポーランド			千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券 POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	160	167	5,014	2019/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	1.5	900	899	26,932	2020/4/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.0	400	402	12,044	2021/4/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	1,650	1,647	49,312	2021/7/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	150	167	5,019	2021/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	160	160	4,802	2022/4/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	1,500	1,504	45,031	2023/1/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	1,400	1,495	44,764	2023/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	1,000	960	28,742	2026/7/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	1,550	1,467	43,945	2027/7/25
小 計					265,608	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券 SINGAPORE GOVERNMENT	3.25	400	410	33,225	2020/9/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.25	930	910	73,667	2021/10/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	1,400	1,439	116,512	2023/7/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	380	413	33,461	2027/3/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	500	519	42,037	2029/7/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	610	630	50,990	2030/9/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	500	466	37,778	2036/8/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	200	198	16,068	2046/3/1
小 計					403,742	
オーストラリア			千豪ドル	千豪ドル		
	国債証券 AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	680	685	54,897	2019/10/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	70	72	5,825	2020/4/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	820	815	65,289	2020/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0	900	898	71,942	2021/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	120	136	10,907	2022/7/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	1,100	1,105	88,468	2022/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	800	917	73,406	2023/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	400	409	32,804	2024/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	340	358	28,673	2025/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	1,120	1,259	100,809	2026/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	820	962	77,043	2027/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,000	1,017	81,418	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	2,020	1,965	157,351	2028/5/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	300	304	24,380	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	670	813	65,132	2033/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	150	168	13,518	2037/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	520	542	43,453	2039/6/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	270	266	21,302	2047/3/21
小 計					1,016,624	
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券 MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	900	867	4,990	2019/12/11
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	3,000	3,002	17,262	2020/6/11

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		
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	6.5	9,200	8,865	50,979	2021/6/10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	15,000	14,284	82,135	2022/6/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	14,000	12,240	70,380	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	10,100	9,762	56,133	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	3,100	3,006	17,286	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	3,000	3,543	20,377	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	5,000	5,194	29,868	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	4,300	4,243	24,401	2047/11/7
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	7,300	7,303	41,994	2023/12/7
小	計					415,808	
南アフリカ				千ランド	千ランド		
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	800	774	5,586	2021/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	500	483	3,487	2023/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	5,900	6,328	45,629	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	5,650	5,027	36,245	2030/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	2,800	2,262	16,311	2031/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.875	3,500	3,203	23,096	2035/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	8,800	7,698	55,504	2037/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	7,250	6,339	45,710	2048/2/28
小	計					231,572	
合	計					49,505,506	

\* 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

(2018年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	49,505,506	94.3
コール・ローン等、その他	2,995,178	5.7
投資信託財産総額	52,500,684	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（49,533,085千円）の投資信託財産総額（52,500,684千円）に対する比率は94.3%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=111.26円、1カナダドル=84.44円、1英ポンド=143.75円、1スウェーデンクローナ=12.29円、1ノルウェークローネ=13.25円、1デンマーククローネ=17.37円、1ユーロ=129.47円、1ズロチ=29.94円、1シンガポールドル=80.92円、1豪ドル=80.05円、1メキシコペソ=5.75円、1ランド=7.21円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	102,906,119,181
コール・ローン等	1,845,652,156
公社債(評価額)	49,505,506,654
未収入金	51,280,672,428
未収利息	222,409,673
前払費用	51,585,605
差入委託証拠金	292,665
(B) 負債	52,780,408,302
未払金	52,775,723,111
未払解約金	3,966,000
未払利息	1,191
その他未払費用	718,000
(C) 純資産総額(A-B)	50,125,710,879
元本	44,861,179,119
次期繰越損益金	5,264,531,760
(D) 受益権総口数	44,861,179,119口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,174円

(注) 期首元本額は13,595,536,846円、期中追加設定元本額は67,100,028,795円、期中一部解約元本額は35,834,386,522円、1口当たり純資産額は1.1174円です。

## ○損益の状況 (2017年9月7日～2018年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	586,270,557
受取利息	586,700,331
その他収益金	43,549
支払利息	△ 473,323
(B) 有価証券売買損益	△ 893,611,443
売買益	3,420,854,499
売買損	△4,314,465,942
(C) 先物取引等取引損益	△ 30,135,574
取引益	5,684,812
取引損	△ 35,820,386
(D) 保管費用等	△ 9,832,968
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 347,309,428
(F) 前期繰越損益金	1,919,770,145
(G) 追加信託差損益金	8,390,892,972
(H) 解約差損益金	△4,698,821,929
(I) 計(E+F+G+H)	5,264,531,760
次期繰越損益金(I)	5,264,531,760

\* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村外国債券インデックス Aコース (野村投資一任口座向け)	23,046,173,290
野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	9,245,451,562
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	8,631,388,880
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	1,169,312,355
野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	1,136,676,078
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	820,887,544
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	747,389,689
インデックス・ブレンド(タイプⅢ)	15,451,669
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	15,096,815
インデックス・ブレンド(タイプⅠ)	10,344,981
インデックス・ブレンド(タイプⅡ)	6,856,651
インデックス・ブレンド(タイプⅤ)	6,027,895
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	3,803,344
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	2,573,802
インデックス・ブレンド(タイプⅣ)	2,078,944
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	1,665,620

## ○お知らせ

---

投資信託約款に記載されているインデックスの名称を「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）」から「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）」に変更する所要の約款変更を行いました。 <変更適用日：2018年2月23日>

### <お申し込み時の留意点>

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

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

(2018年12月6日現在)

年 月	日
2018年12月	21、25、26
2019年1月	18、21
2月	15、18
3月	—
4月	18、19、22
5月	24、27
6月	—
7月	3、4
8月	23、26、30
9月	2
10月	—
11月	8、11、27、28
12月	24、25、26

※2019年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情等により突然変更される場合があります。

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

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