

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5期(決算日2020年12月7日)

作成対象期間(2019年12月7日～2020年12月7日)

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型	
信託期間	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

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104
(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○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	込 配	み 金	期 騰	中 落				率
(設定日) 2016年8月25日	円 10,000			円 —		% —	% —	% —	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
4期(2019年12月6日)	10,029			5	6.2	101.63	6.6	98.8	—	5,072
5期(2020年12月7日)	10,504			5	4.8	106.95	5.2	99.6	—	13,262

*基準価額の騰落率は分配金込み。

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

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、設定時を100として再指数化しています。
 *FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。
 FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
 (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	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2019年12月6日	円 10,029	% —	101.63	% —	% 98.8	% —
12月末	10,010	△0.2	101.44	△0.2	99.8	—
2020年1月末	10,190	1.6	103.31	1.7	98.9	—
2月末	10,303	2.7	104.46	2.8	98.3	—
3月末	10,456	4.3	105.94	4.2	97.9	—
4月末	10,443	4.1	106.05	4.3	96.8	—
5月末	10,433	4.0	105.98	4.3	100.0	—
6月末	10,507	4.8	106.79	5.1	99.8	—
7月末	10,608	5.8	107.86	6.1	99.0	—
8月末	10,474	4.4	106.52	4.8	99.7	—
9月末	10,587	5.6	107.69	6.0	97.9	—
10月末	10,564	5.3	107.47	5.7	97.0	—
11月末	10,575	5.4	107.57	5.8	99.9	—
(期末) 2020年12月7日	10,509	4.8	106.95	5.2	99.6	—

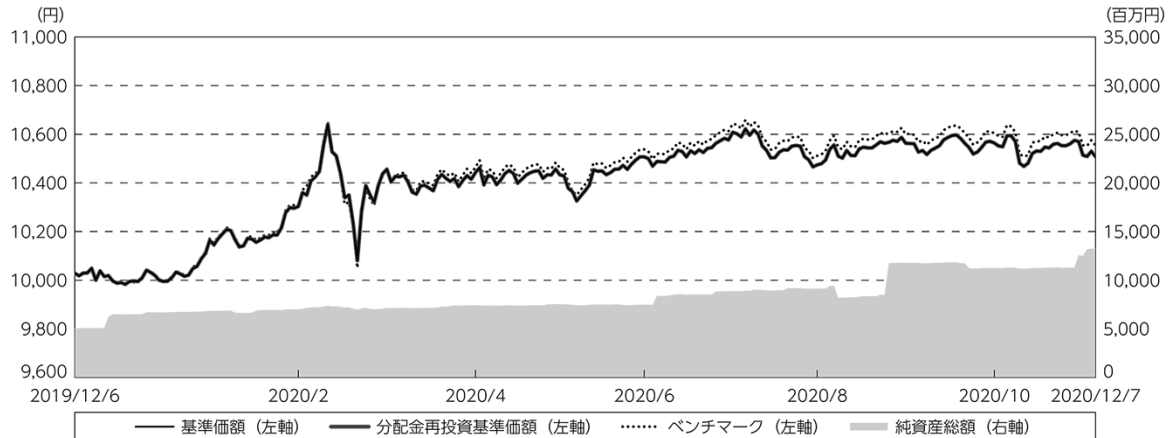
*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2019年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（2019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

外国債券利回りが米国を中心に低下（価格は上昇）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、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の減速懸念から、主要国の中央銀行が政策金利の引き下げや金融緩和姿勢の強化を打ち出したことなどを背景に、外国債券利回りは米国を中心に低下（価格は上昇）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村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+4.8%となり、ベンチマークの+5.2%を0.4ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

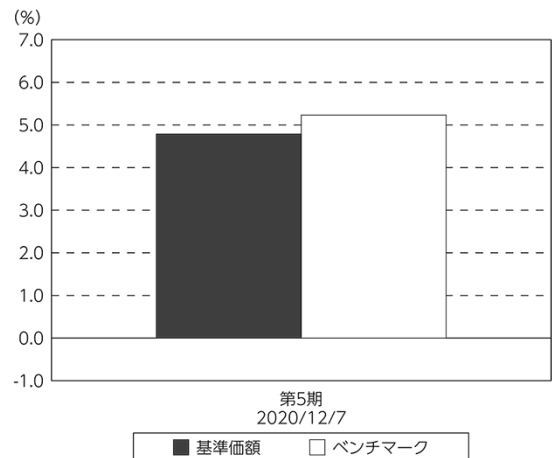
(マイナス要因)

コスト負担（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、分配対象額の範囲内で基準価額水準などを勘案し決定しました。
留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

項 目	第5期
	2019年12月7日～ 2020年12月7日
当期分配金	5
（対基準価額比率）	0.048%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	705

（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、よろしくごお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2019年12月7日～2020年12月7日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 35	% 0.331	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(25)	(0.243)	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 ）	(6)	(0.055)	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)	(0.033)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.000	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	2	0.015	(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 ）	(1)	(0.013)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.002)	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	37	0.346	
期中の平均基準価額は、10,429円です。			

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

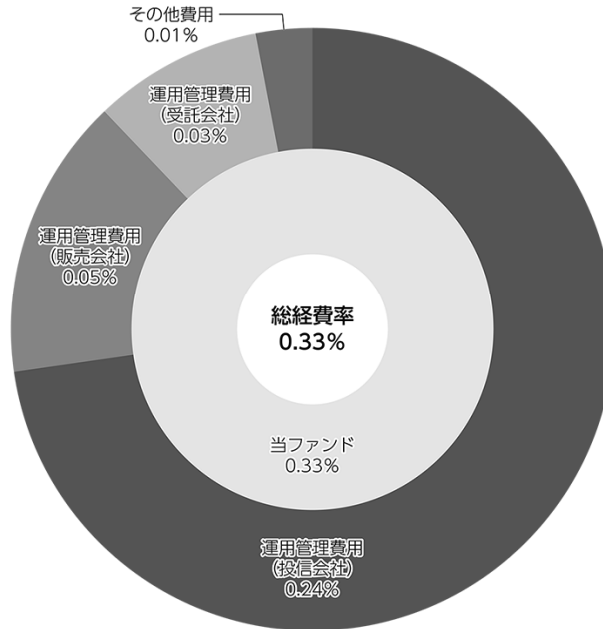
* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

（参考情報）

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.33%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2019年12月7日～2020年12月7日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	千口 8,470,352	千円 10,509,084	千口 2,131,194	千円 2,658,597

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2019年12月7日～2020年12月7日)

該当事項はございません。

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

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2019年12月7日～2020年12月7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 0	百万円 -	当初設定時における取得とその処分

○組入資産の明細

(2020年12月7日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	千口 4,261,106	千口 10,600,263	千円 13,260,930

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

（2020年12月7日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	千円 13,260,930	% 99.8
コール・ローン等、その他	24,056	0.2
投資信託財産総額	13,284,986	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（78,360,731千円）の投資信託財産総額（79,977,633千円）に対する比率は98.0%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=104.08円、1カナダドル=81.45円、1英ポンド=139.74円、1スウェーデンクローナ=12.32円、1ノルウェークローネ=11.83円、1デンマーククローネ=16.96円、1ユーロ=126.25円、1ズロチ=28.26円、1シンガポールドル=78.03円、1豪ドル=77.33円、1新シェケル=31.87円、1メキシコペソ=5.26円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年12月7日現在）

項 目	当 期 末
(A) 資産	13,284,986,541 円
コール・ローン等	17,743,747
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)	13,260,930,092
未収入金	6,312,702
(B) 負債	22,728,503
未払収益分配金	6,312,702
未払解約金	372,444
未払信託報酬	15,937,154
未払利息	16
その他未払費用	106,187
(C) 純資産総額(A-B)	13,262,258,038
元本	12,625,404,707
次期繰越損益金	636,853,331
(D) 受益権総口数	12,625,404,707口
1万円当たり基準価額(C/D)	10,504円

(注) 期首元本額は5,057,877,237円、期中追加設定元本額は10,830,911,059円、期中一部解約元本額は3,263,383,589円、1口当たり純資産額は1.0504円です。

○損益の状況（2019年12月7日～2020年12月7日）

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 4,359
支払利息	△ 4,359
(B) 有価証券売買損益	240,676,706
売買益	349,731,353
売買損	△109,054,647
(C) 信託報酬等	△ 27,662,070
(D) 当期損益金(A+B+C)	213,010,277
(E) 前期繰越損益金	97,316,994
(F) 追加信託差損益金	332,838,762
(配当等相当額)	(571,783,499)
(売買損益相当額)	(△238,944,737)
(G) 計(D+E+F)	643,166,033
(H) 収益分配金	△ 6,312,702
次期繰越損益金(G+H)	636,853,331
追加信託差損益金	332,838,762
(配当等相当額)	(586,973,142)
(売買損益相当額)	(△254,134,380)
分配準備積立金	304,014,569

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

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

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

(注) 分配金の計算過程（2019年12月7日～2020年12月7日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2019年12月7日～ 2020年12月7日
a. 配当等収益(経費控除後)	149,841,434円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	63,168,843円
c. 信託約款に定める収益調整金	586,973,142円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	97,316,994円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	897,300,413円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	710円
g. 分配金	6,312,702円
h. 分配金(1万円当たり)	5円

○分配金のお知らせ

1万円当たり分配金(税込み)	5円
----------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2020年12月7日現在）

<外国債券為替ヘッジ型マザーファンド>

下記は、外国債券為替ヘッジ型マザーファンド全体（62,628,399千口）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	291,750	320,377	33,344,937	42.6	—	18.4	16.5	7.6
カナダ	千カナダドル 15,280	千カナダドル 17,940	1,461,234	1.9	—	1.1	0.5	0.2
イギリス	千英ポンド 28,200	千英ポンド 36,921	5,159,468	6.6	—	5.4	0.9	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 15,050	千スウェーデンクローナ 16,799	206,969	0.3	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 11,600	千ノルウェークローネ 12,339	145,980	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 18,650	千デンマーククローネ 24,313	412,350	0.5	—	0.4	0.1	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	35,560	44,261	5,588,053	7.1	—	4.8	1.8	0.5
イタリア	55,390	65,780	8,304,737	10.6	—	5.7	3.8	1.1
フランス	52,590	62,876	7,938,161	10.1	—	7.3	2.4	0.5
オランダ	8,640	11,283	1,424,501	1.8	—	1.2	0.5	0.1
スペイン	36,750	43,497	5,491,509	7.0	—	4.0	2.2	0.9
ベルギー	14,140	17,069	2,155,007	2.8	—	2.1	0.4	0.2
オーストリア	7,720	9,419	1,189,272	1.5	—	1.0	0.3	0.3
フィンランド	2,860	3,323	419,621	0.5	—	0.4	0.1	0.1
アイルランド	5,130	5,722	722,491	0.9	—	0.7	0.1	0.2
ポーランド	千ズロチ 16,000	千ズロチ 17,041	481,602	0.6	—	0.3	0.1	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 7,440	千シンガポールドル 8,530	665,604	0.8	—	0.6	0.2	—
オーストラリア	千豪ドル 23,030	千豪ドル 26,113	2,019,384	2.6	—	1.9	0.4	0.3
イスラエル	千新シェケル 7,600	千新シェケル 8,990	286,517	0.4	—	0.2	0.1	—
メキシコ	千メキシコペソ 102,600	千メキシコペソ 115,387	606,936	0.8	—	0.5	0.2	0.1
合 計	—	—	78,024,345	99.6	—	56.2	30.8	12.6

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

* 組入比率は、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	銘柄	当期期末				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	8,477	2023/8/15
	US TREASURY BOND	2.375	500	538	56,060	2024/8/15
	US TREASURY BOND	6.0	610	783	81,563	2026/2/15
	US TREASURY BOND	6.125	1,800	2,468	256,968	2027/11/15
	US TREASURY BOND	5.5	2,280	3,091	321,785	2028/8/15
	US TREASURY BOND	5.25	20	26	2,801	2028/11/15
	US TREASURY BOND	5.25	80	108	11,277	2029/2/15
	US TREASURY BOND	2.875	510	636	66,228	2043/5/15
	US TREASURY BOND	3.75	3,450	4,903	510,336	2043/11/15
	US TREASURY N/B	2.875	1,600	1,641	170,853	2021/11/15
	US TREASURY N/B	1.875	1,500	1,525	158,815	2021/11/30
	US TREASURY N/B	1.75	1,000	1,016	105,755	2021/11/30
	US TREASURY N/B	2.0	1,000	1,020	106,169	2021/12/31
	US TREASURY N/B	2.5	1,000	1,026	106,820	2022/1/15
	US TREASURY N/B	1.375	1,000	1,014	105,580	2022/1/31
	US TREASURY N/B	2.0	600	613	63,850	2022/2/15
	US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,529	159,217	2022/2/28
	US TREASURY N/B	1.75	1,400	1,429	148,819	2022/3/31
	US TREASURY N/B	1.75	3,000	3,067	319,240	2022/4/30
	US TREASURY N/B	1.875	3,500	3,589	373,586	2022/5/31
	US TREASURY N/B	1.75	3,400	3,481	362,304	2022/5/31
	US TREASURY N/B	2.125	2,700	2,783	289,709	2022/6/30
	US TREASURY N/B	1.75	2,200	2,255	234,736	2022/6/30
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	2,051	213,485	2022/7/15
	US TREASURY N/B	2.0	3,000	3,091	321,777	2022/7/31
	US TREASURY N/B	1.875	1,000	1,028	107,064	2022/7/31
	US TREASURY N/B	1.625	2,700	2,767	288,030	2022/8/15
	US TREASURY N/B	1.875	3,600	3,707	385,840	2022/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	4,000	4,103	427,085	2022/8/31
	US TREASURY N/B	1.75	3,000	3,087	321,314	2022/9/30
	US TREASURY N/B	1.875	700	721	75,144	2022/9/30
	US TREASURY N/B	0.125	4,000	3,998	416,173	2022/9/30
	US TREASURY N/B	1.875	1,500	1,548	161,218	2022/10/31
	US TREASURY N/B	2.0	2,800	2,898	301,623	2022/10/31
	US TREASURY N/B	1.625	2,150	2,211	230,126	2022/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,260	2,351	244,739	2022/12/31
	US TREASURY N/B	1.5	700	719	74,902	2023/1/15
	US TREASURY N/B	1.75	1,000	1,034	107,633	2023/1/31
	US TREASURY N/B	2.375	700	733	76,310	2023/1/31
	US TREASURY N/B	2.0	4,110	4,274	444,879	2023/2/15
	US TREASURY N/B	2.625	1,000	1,054	109,763	2023/2/28
	US TREASURY N/B	1.5	1,100	1,133	118,003	2023/3/31
	US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,557	162,096	2023/5/15
	US TREASURY N/B	0.125	1,000	998	103,945	2023/5/15
	US TREASURY N/B	1.625	2,000	2,071	215,608	2023/5/31

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		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	1.375	2,500	2,576	268,148	2023/6/30
	US TREASURY N/B	1.25	3,500	3,598	374,553	2023/7/31
	US TREASURY N/B	2.5	1,200	1,274	132,653	2023/8/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,000	3,097	322,338	2023/8/31
	US TREASURY N/B	2.75	2,500	2,674	278,312	2023/8/31
	US TREASURY N/B	0.125	4,000	3,991	415,425	2023/9/15
	US TREASURY N/B	1.375	5,000	5,164	537,516	2023/9/30
	US TREASURY N/B	0.125	4,000	3,990	415,360	2023/10/15
	US TREASURY N/B	1.625	700	728	75,867	2023/10/31
	US TREASURY N/B	2.75	1,000	1,074	111,837	2023/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	3,000	3,171	330,047	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	2,158	224,650	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	2,125	221,186	2023/12/31
	US TREASURY N/B	2.25	500	532	55,373	2024/1/31
	US TREASURY N/B	2.75	400	432	45,001	2024/2/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	2,124	221,088	2024/3/31
	US TREASURY N/B	2.0	500	529	55,125	2024/4/30
	US TREASURY N/B	2.5	1,500	1,614	168,085	2024/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	4,000	4,246	441,949	2024/6/30
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	2,105	219,137	2024/6/30
	US TREASURY N/B	2.125	3,000	3,201	333,243	2024/7/31
	US TREASURY N/B	1.875	2,000	2,118	220,486	2024/8/31
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	2,138	222,568	2024/9/30
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	2,150	223,869	2024/10/31
	US TREASURY N/B	2.25	4,000	4,305	448,064	2024/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	3,000	3,215	334,682	2024/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	800	862	89,775	2024/12/31
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	2,115	220,161	2024/12/31
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	2,138	222,584	2025/2/15
	US TREASURY N/B	2.625	4,500	4,938	513,988	2025/3/31
	US TREASURY N/B	2.875	4,000	4,439	462,050	2025/4/30
	US TREASURY N/B	0.375	500	500	52,080	2025/4/30
	US TREASURY N/B	2.125	800	861	89,684	2025/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	2,221	231,203	2025/5/31
	US TREASURY N/B	2.75	4,000	4,429	461,041	2025/6/30
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	2,228	231,952	2025/7/31
	US TREASURY N/B	0.25	2,000	1,987	206,810	2025/7/31
	US TREASURY N/B	2.0	2,780	2,988	311,088	2025/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	600	665	69,278	2025/8/31
	US TREASURY N/B	3.0	3,000	3,371	350,855	2025/9/30
	US TREASURY N/B	0.25	4,000	3,970	413,197	2025/9/30
	US TREASURY N/B	0.25	4,000	3,968	413,002	2025/10/31
	US TREASURY N/B	2.25	1,640	1,787	186,013	2025/11/15
	US TREASURY N/B	2.625	3,000	3,333	346,976	2026/1/31
	US TREASURY N/B	1.625	4,000	4,242	441,559	2026/2/15
	US TREASURY N/B	1.625	4,200	4,457	463,978	2026/5/15
	US TREASURY N/B	1.5	800	844	87,869	2026/8/15

銘柄		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券					
	US TREASURY N/B	2.0	2,600	2,819	293,482	2026/11/15
	US TREASURY N/B	2.25	1,500	1,652	171,963	2027/2/15
	US TREASURY N/B	2.375	1,800	2,000	208,244	2027/5/15
	US TREASURY N/B	0.5	1,500	1,486	154,680	2027/6/30
	US TREASURY N/B	2.25	3,200	3,534	367,896	2027/8/15
	US TREASURY N/B	2.25	600	663	69,073	2027/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	4,200	4,800	499,666	2028/2/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,500	2,887	300,490	2028/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	3,100	3,588	373,490	2028/8/15
	US TREASURY N/B	3.125	5,000	5,899	613,990	2028/11/15
	US TREASURY N/B	2.625	5,400	6,173	642,516	2029/2/15
	US TREASURY N/B	2.375	4,000	4,501	468,490	2029/5/15
	US TREASURY N/B	1.625	2,000	2,129	221,609	2029/8/15
	US TREASURY N/B	1.5	2,500	2,632	273,941	2030/2/15
	US TREASURY N/B	6.25	500	744	77,442	2030/5/15
	US TREASURY N/B	0.625	1,800	1,750	182,162	2030/5/15
	US TREASURY N/B	0.625	3,500	3,393	353,152	2030/8/15
	US TREASURY N/B	5.0	340	529	55,090	2037/5/15
	US TREASURY N/B	4.5	1,760	2,639	274,685	2038/5/15
	US TREASURY N/B	3.5	400	538	56,060	2039/2/15
	US TREASURY N/B	4.25	1,300	1,912	199,013	2039/5/15
	US TREASURY N/B	4.625	1,150	1,777	185,036	2040/2/15
	US TREASURY N/B	3.875	340	482	50,245	2040/8/15
	US TREASURY N/B	1.125	1,200	1,120	116,660	2040/8/15
	US TREASURY N/B	4.25	1,500	2,233	232,460	2040/11/15
	US TREASURY N/B	4.75	300	475	49,438	2041/2/15
	US TREASURY N/B	3.125	500	646	67,269	2041/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	500	611	63,618	2042/11/15
	US TREASURY N/B	3.125	800	1,036	107,846	2043/2/15
	US TREASURY N/B	3.625	700	978	101,821	2044/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	500	637	66,334	2044/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	2,400	2,816	293,115	2045/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	2,540	3,244	337,641	2045/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,760	3,457	359,839	2045/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	3,020	3,866	402,380	2045/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	2,530	2,972	309,362	2046/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	3,400	3,995	415,827	2046/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	3,530	3,960	412,179	2046/8/15
	US TREASURY N/B	2.875	3,600	4,524	470,935	2046/11/15
	US TREASURY N/B	3.0	1,000	1,287	134,043	2047/5/15
	US TREASURY N/B	2.75	2,820	3,478	362,020	2047/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	2,600	3,208	333,989	2047/11/15
	US TREASURY N/B	3.0	2,100	2,710	282,106	2048/2/15
	US TREASURY N/B	3.125	1,000	1,320	137,458	2048/5/15
	US TREASURY N/B	3.0	400	517	53,835	2048/8/15
	US TREASURY N/B	2.875	500	634	66,017	2049/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	600	674	70,185	2049/8/15

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	1.25	2,700	2,397	249,555	2050/5/15
		US TREASURY N/B	1.375	2,800	2,566	267,108	2050/8/15
小 計						33,344,937	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	0.5	2,000	2,007	163,515	2022/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.75	1,000	1,033	84,142	2023/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,000	1,030	83,914	2023/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	150	156	12,786	2023/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	600	637	51,897	2024/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	1,060	1,139	92,776	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	1,000	1,035	84,321	2025/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,000	1,053	85,785	2026/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	8.0	330	485	39,546	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	1,000	1,026	83,641	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	400	439	35,820	2028/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	1,020	1,441	117,438	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	1,000	1,126	91,765	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	600	940	76,611	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	400	638	52,002	2037/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	780	1,180	96,116	2041/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,740	2,333	190,043	2048/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	200	234	19,108	2051/12/1
小 計						1,461,234	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UK TREASURY	4.0	320	336	46,982	2022/3/7
		UK TREASURY	0.5	400	403	56,397	2022/7/22
		UK TREASURY	1.75	1,200	1,237	172,985	2022/9/7
		UK TREASURY	0.125	600	601	84,071	2023/1/31
		UK TREASURY	0.75	900	918	128,388	2023/7/22
		UK TREASURY	2.25	550	584	81,688	2023/9/7
		UK TREASURY	1.0	500	517	72,294	2024/4/22
		UK TREASURY	2.75	1,200	1,324	185,082	2024/9/7
		UK TREASURY	0.625	900	924	129,211	2025/6/7
		UK TREASURY	1.5	1,370	1,481	207,060	2026/7/22
		UK TREASURY	1.25	1,000	1,073	149,974	2027/7/22
		UK TREASURY	4.25	300	385	53,917	2027/12/7
		UK TREASURY	1.625	900	1,000	139,770	2028/10/22
		UK TREASURY	6.0	90	131	18,311	2028/12/7
		UK TREASURY	0.875	1,400	1,471	205,613	2029/10/22
		UK TREASURY	0.375	1,000	1,001	139,893	2030/10/22
		UK TREASURY	4.75	600	859	120,099	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	600	854	119,416	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	200	303	42,403	2034/9/7
		UK TREASURY	4.25	1,160	1,762	246,321	2036/3/7
		UK TREASURY	1.75	670	774	108,236	2037/9/7
		UK TREASURY	4.25	400	641	89,706	2039/9/7
		UK TREASURY	1.25	700	750	104,935	2041/10/22

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	4.5	850	1,469	205,400	2042/12/7
		UK TREASURY	3.5	1,000	1,561	218,253	2045/1/22
		UK TREASURY	4.25	2,180	3,865	540,108	2046/12/7
		UK TREASURY	1.5	1,700	1,933	270,157	2047/7/22
		UK TREASURY	1.75	1,350	1,630	227,846	2049/1/22
		UK TREASURY	4.25	1,140	2,112	295,188	2049/12/7
		UK TREASURY	3.75	860	1,535	214,526	2052/7/22
		UK TREASURY	1.625	500	604	84,496	2054/10/22
		UK TREASURY	4.0	200	408	57,026	2060/1/22
		UK TREASURY	3.5	380	775	108,355	2068/7/22
		UK TSY 0 5/8% 2050	0.625	400	369	51,625	2050/10/22
		UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	100	149	20,836	2044/1/22
		UNITED KINGDOM(GOVERNEM	4.25	580	1,165	162,882	2055/12/7
小	計					5,159,468	
スウェーデン				千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	3.5	3,500	3,701	45,597	2022/6/1
		SWEDISH GOVERNMENT	1.5	3,000	3,164	38,983	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT	2.5	250	280	3,460	2025/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	1.0	2,700	2,896	35,683	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT	0.75	4,000	4,263	52,532	2028/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	1,600	2,492	30,711	2039/3/30
小	計					206,969	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,900	1,979	23,422	2023/5/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	2,750	2,984	35,309	2024/3/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	1,700	1,781	21,071	2026/2/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	1,750	1,864	22,060	2027/2/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,500	1,636	19,358	2028/4/26
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.375	2,000	2,092	24,757	2030/8/19
小	計					145,980	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	1.5	1,650	1,752	29,727	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	3,400	3,801	64,479	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	2,300	2,463	41,777	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	6,400	6,945	117,791	2029/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	4,900	9,349	158,573	2039/11/15
小	計					412,350	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESBLIGATION	—	1,000	1,013	128,012	2022/10/7
		BUNDESBLIGATION	—	1,100	1,124	141,998	2023/10/13
		BUNDESBLIGATION	—	1,000	1,025	129,518	2024/4/5
		BUNDESBLIGATION	—	1,500	1,550	195,721	2025/4/11
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	850	875	110,509	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	1,300	1,352	170,693	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,310	1,383	174,617	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	700	752	95,061	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	400	487	61,592	2024/1/4

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		
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	610	659	83,304	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	700	755	95,379	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	440	469	59,249	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,000	1,054	133,094	2025/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	2,000	2,168	273,773	2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	900	959	121,170	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	300	312	39,497	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	2,270	2,409	304,178	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	2,300	3,425	432,440	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	850	920	116,174	2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,000	1,086	137,221	2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,000	1,424	179,811	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	400	421	53,220	2029/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,500	1,581	199,669	2030/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,300	1,370	173,000	2030/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	1,100	1,794	226,492	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	700	1,211	152,961	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	500	525	66,309	2035/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	1,400	2,416	305,029	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	1,310	2,460	310,622	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	60	121	15,334	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	750	1,339	169,101	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,300	2,163	273,103	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	610	1,041	131,468	2046/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	1,200	1,671	211,081	2048/8/15		
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	900	931	117,635	2050/8/15		
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.15	1,000	1,027	129,668	2021/12/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2	700	715	90,268	2022/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	1,030	1,055	133,213	2022/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.0	1,500	1,535	193,823	2022/7/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9	500	511	64,562	2022/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	1,900	1,963	247,941	2022/9/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	200	222	28,087	2022/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.05	1,800	1,817	229,397	2023/1/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	2,100	2,163	273,078	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,150	1,285	162,269	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	2,500	2,695	340,275	2023/10/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	1,000	1,027	129,671	2023/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	180	228	28,892	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	2,200	2,539	320,634	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	1,500	1,719	217,099	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	700	744	93,969	2024/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	2,500	2,763	348,860	2024/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	2,000	2,039	257,423	2025/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,350	1,642	207,371	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	500	533	67,373	2025/5/15
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	800	856	108,119	2025/6/1		

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	1.85	1,000	1,087	137,284	2025/7/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	330	362	45,816	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,000	1,232	155,615	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6	550	596	75,256	2026/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.25	1,100	1,172	148,054	2026/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2	3,200	3,608	455,550	2027/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	400	568	71,826	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	800	895	113,109	2028/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	2,040	2,718	343,236	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	1,000	1,416	178,871	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	400	508	64,135	2030/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	300	322	40,768	2030/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	2,500	2,594	327,492	2030/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	500	551	69,588	2030/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	700	1,077	135,982	2031/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	500	551	69,563	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	1,000	1,575	198,957	2033/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,070	1,278	161,429	2033/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,110	1,695	214,032	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.25	500	589	74,437	2036/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	1,580	2,262	285,688	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	400	517	65,392	2038/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	150	246	31,133	2039/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	300	497	62,834	2040/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8	800	874	110,393	2041/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	2,480	4,183	528,105	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	860	1,204	152,113	2046/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7	300	384	48,533	2047/3/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.45	800	1,165	147,177	2048/3/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.85	600	940	118,692	2049/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	10	13	1,663	2067/3/1		
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	1,500	1,523	192,329	2023/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	300	318	40,193	2023/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,800	2,865	361,807	2024/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	2,010	2,218	280,092	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,000	2,057	259,754	2025/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	400	421	53,173	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	700	743	93,831	2026/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	250	262	33,153	2026/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	800	881	111,320	2027/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	2,300	2,517	317,800	2028/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,000	1,098	138,698	2028/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,000	1,079	136,304	2029/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	4,000	4,138	522,463	2029/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	1,720	2,194	277,071	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,500	1,546	195,266	2030/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	1,200	1,424	179,810	2034/5/25

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 (GOVT OF)	1.25	1,850	2,223	280,672	2036/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	960	1,262	159,434	2039/6/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	800	858	108,358	2040/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	1,010	1,463	184,762	2048/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.5	1,300	1,720	217,203	2050/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,900	2,099	265,092	2052/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.0	1,320	1,388	175,242	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	—	900	909	114,833	2022/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.25	610	644	81,366	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	1,800	2,061	260,223	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.75	600	659	83,201	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6.0	1,100	1,464	184,906	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	1,000	1,082	136,709	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	—	4,000	4,127	521,121	2026/2/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	910	1,115	140,892	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.75	1,900	2,340	295,514	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	1,200	1,810	228,629	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.5	640	761	96,196	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.75	300	517	65,350	2032/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.75	1,490	2,547	321,628	2035/4/25
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	400	686	86,670	2038/10/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.5	720	1,359	171,575	2041/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	1,800	3,094	390,681	2045/5/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	600	1,384	174,823	2060/4/25		
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	—	500	503	63,625	2022/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	630	690	87,120	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	300	352	44,537	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	300	319	40,361	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	1,000	1,099	138,820	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	700	731	92,320	2025/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	400	426	53,886	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	600	866	109,352	2028/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	1,000	1,045	132,013	2030/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	1,150	1,566	197,745	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	400	684	86,355	2037/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	610	1,133	143,153	2042/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	1,050	1,863	235,208	2047/1/15		
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	1,490	1,600	202,071	2022/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4	300	304	38,405	2022/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.45	3,400	3,465	437,513	2022/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	900	1,016	128,288	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	2,100	2,128	268,730	2023/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.35	300	307	38,777	2023/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	1,940	2,220	280,361	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	1,920	2,205	278,408	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	1,400	1,578	199,296	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	2,000	2,038	257,398	2025/1/31

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	1.6	800	872	110,203	2025/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	1,000	1,239	156,453	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	720	811	102,394	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	1,000	1,097	138,506	2026/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5	1,000	1,116	140,926	2027/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8	800	855	108,009	2027/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	300	334	42,281	2027/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	2,300	2,567	324,126	2028/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,600	1,791	226,118	2028/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	330	468	59,119	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5	1,300	1,358	171,467	2030/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,000	1,183	149,473	2030/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.25	600	669	84,567	2030/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	1,500	1,885	238,063	2033/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.85	400	482	60,921	2035/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2	500	551	69,565	2040/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	1,000	1,783	225,220	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	900	1,767	223,156	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	1,150	1,712	216,249	2046/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	600	875	110,511	2048/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0	600	615	77,660	2050/10/31		
SPANISH GOVERNMENT	6.0	90	134	17,026	2029/1/31		
SPANISH GOVERNMENT	5.75	1,100	1,806	228,088	2032/7/30		
SPANISH GOVERNMENT	4.2	410	650	82,145	2037/1/31		
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.0	500	530	67,037	2022/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	700	762	96,302	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	1,200	1,291	163,061	2023/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.2	600	615	77,742	2023/10/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	230	257	32,472	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.5	300	314	39,649	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	2,100	2,290	289,213	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	950	1,035	130,789	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	—	1,000	1,037	130,922	2027/10/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	300	329	41,656	2028/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.9	1,400	1,560	197,065	2029/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,200	1,365	172,368	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	550	819	103,444	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.45	200	247	31,225	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	420	555	70,149	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	300	544	68,741	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	750	1,369	172,888	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	500	661	83,500	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.7	400	549	69,324	2050/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	170	286	36,157	2066/6/22
BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	370	643	81,294	2035/3/28		
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	800	847	106,999	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	700	709	89,529	2022/9/20

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				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	1.75	120	128	16,230	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	1,500	1,638	206,921	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	300	324	40,975	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	400	428	54,101	2027/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	700	766	96,756	2028/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	700	726	91,673	2030/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	530	720	90,926	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	230	392	49,600	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	400	699	88,347	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	200	274	34,655	2047/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	800	947	119,683	2051/3/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	330	798	100,780	2062/1/26
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	10	16	2,089	2086/11/2
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	—	300	303	38,257	2022/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.625	300	312	39,481	2022/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	150	158	19,949	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.0	200	218	27,578	2024/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	310	329	41,603	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	740	928	117,225	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	—	300	311	39,302	2030/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	200	236	29,830	2034/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	160	253	32,036	2042/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	1.375	200	272	34,355	2047/4/15
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	0.9	800	879	111,073	2028/5/15
		IRISH TSY 0.2% 2030	0.2	1,100	1,150	145,217	2030/10/18
		IRISH TSY 1% 2026	1.0	650	705	89,127	2026/5/15
		IRISH TSY 1.5% 2050	1.5	200	263	33,267	2050/5/15
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	550	699	88,347	2037/5/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	250	354	44,761	2045/2/18
		IRISH TSY 2022	—	1,000	1,013	127,914	2022/10/18
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	500	567	71,613	2024/3/18
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	80	88	11,168	2023/3/20
小 計						33,233,358	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	6,000	6,186	174,828	2022/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	0.75	3,000	3,033	85,725	2025/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	7,000	7,821	221,048	2028/4/25
小 計						481,602	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	1,400	1,486	116,025	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	400	438	34,223	2024/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	400	434	33,865	2025/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	700	758	59,154	2026/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	730	854	66,702	2027/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	300	339	26,498	2028/5/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	400	466	36,361	2029/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	1,210	1,433	111,874	2030/9/1

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					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	700	813	63,502	2036/8/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	700	840	65,602	2039/7/1
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	500	663	51,792	2046/3/1
小計					665,604	
オーストラリア			千豪ドル	千豪ドル		
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0	1,200	1,224	94,676	2021/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	120	130	10,121	2022/7/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	1,200	1,250	96,676	2022/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	800	901	69,721	2023/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,000	1,088	84,165	2024/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.25	1,000	1,001	77,469	2024/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,340	1,514	117,115	2025/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	520	627	48,495	2026/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	820	1,037	80,266	2027/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	900	1,032	79,813	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	2,820	3,129	241,971	2028/5/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,700	1,964	151,888	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,000	1,198	92,680	2029/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	800	923	71,397	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5	1,600	1,827	141,312	2030/5/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	1,200	1,201	92,887	2030/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.25	1,000	1,015	78,506	2032/5/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	1,170	1,622	125,435	2033/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	300	354	27,444	2035/6/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	150	198	15,376	2037/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,020	1,263	97,704	2039/6/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,100	1,282	99,203	2041/5/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	270	323	25,052	2047/3/21
小計					2,019,384	
イスラエル			千新シェケル	千新シェケル		
国債証券	ISRAEL FIXED BOND	1.5	1,500	1,556	49,598	2023/11/30
	ISRAEL FIXED BOND	3.75	1,500	1,673	53,324	2024/3/31
	ISRAEL FIXED BOND	2.0	2,000	2,186	69,683	2027/3/31
	ISRAEL FIXED BOND	1.0	1,000	1,015	32,350	2030/3/31
	ISRAEL FIXED BOND	5.5	1,100	1,865	59,463	2042/1/31
	ISRAEL FIXED BOND	3.75	500	693	22,097	2047/3/31
小計					286,517	
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	7.25	2,800	2,879	15,147	2021/12/9
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	15,000	15,460	81,323	2022/6/9
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	11,000	13,111	68,965	2024/12/5
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	14,000	14,496	76,249	2026/3/5
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	20,100	22,603	118,896	2027/6/3
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	10,000	11,573	60,873	2031/5/29
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	3,100	3,578	18,822	2034/11/23
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	6,000	8,198	43,124	2036/11/20
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	7,000	8,405	44,215	2038/11/18

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			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	4,300	4,888	25,712	2047/11/7
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	9,300	10,190	53,604	2023/12/7
小 計						606,936	
合 計						78,024,345	

* 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7期（決算日2020年9月7日）

作成対象期間（2019年9月7日～2020年9月7日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	騰落	中率	騰落	中率			
	円	%	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	%	%	%	百万円
3期(2016年9月6日)	11,711	5.6	117.74	5.7	99.2	—	4,324
4期(2017年9月6日)	11,412	△2.6	114.81	△2.5	84.6	—	15,515
5期(2018年9月6日)	11,174	△2.1	112.61	△1.9	98.8	—	50,125
6期(2019年9月6日)	12,118	8.4	122.22	8.5	99.7	—	59,275
7期(2020年9月7日)	12,502	3.2	126.25	3.3	99.2	—	69,653

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

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

(出所) FTSE Fixed Income LLC

○当期中の基準価額と市況等の推移

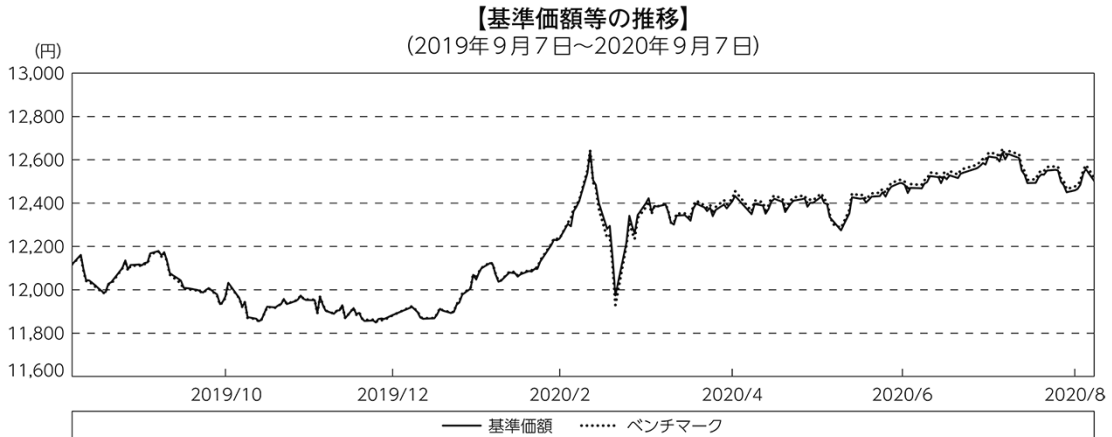
年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
	騰落	中率	騰落	中率		
(期首) 2019年9月6日	円	%	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	%	%	%
9月末	12,118	—	122.22	—	99.7	—
10月末	12,116	△0.0	122.15	△0.1	99.9	—
11月末	11,967	△1.2	120.64	△1.3	100.9	—
12月末	11,953	△1.4	120.57	△1.3	99.2	—
2020年1月末	11,883	△1.9	119.83	△2.0	99.8	—
2月末	12,100	△0.1	122.04	△0.1	98.9	—
3月末	12,237	1.0	123.40	1.0	98.3	—
4月末	12,422	2.5	125.14	2.4	97.9	—
5月末	12,409	2.4	125.27	2.5	96.9	—
6月末	12,401	2.3	125.19	2.4	100.0	—
7月末	12,492	3.1	126.15	3.2	99.8	—
8月末	12,615	4.1	127.41	4.3	99.1	—
(期末) 2020年9月7日	12,459	2.8	125.83	3.0	99.7	—
	12,502	3.2	126.25	3.3	99.2	—

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



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

○基準価額の主な変動要因

外国債券利回りが米国を中心に低下（価格は上昇）したため、基準価額は上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

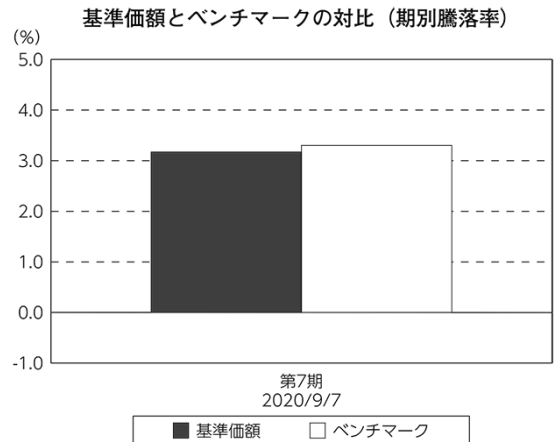
今期の基準価額の騰落率は+3.2%となり、ベンチマークの+3.3%を0.1ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

(マイナス要因)

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

(その他の要因)

ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なること



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

◎今後の運用方針

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

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年9月7日～2020年9月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	2 (2) (0)	0.014 (0.014) (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	2	0.014	
期中の平均基準価額は、12,254円です。			

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2019年9月7日～2020年9月7日)

公社債

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

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国 債券先物取引	百万円 6,520	百万円 6,531	百万円 —	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

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

○利害関係人との取引状況等

(2019年9月7日～2020年9月7日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2020年9月7日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	249,650	280,737	29,859,228	42.9	—	18.8	15.4	8.7
カナダ	千カナダドル 13,430	千カナダドル 16,087	1,308,374	1.9	—	1.1	0.6	0.2
イギリス	千英ポンド 24,400	千英ポンド 33,092	4,663,730	6.7	—	5.3	1.3	0.2
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 15,050	千スウェーデンクローナ 16,874	205,530	0.3	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 11,600	千ノルウェークローネ 12,505	148,939	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 14,150	千デンマーククローネ 18,467	312,474	0.4	—	0.4	0.0	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	32,760	40,317	5,074,784	7.3	—	4.4	2.3	0.5
イタリア	50,250	57,508	7,238,537	10.4	—	5.2	3.7	1.5
フランス	44,990	54,381	6,844,959	9.8	—	7.6	1.7	0.5
オランダ	8,240	10,523	1,324,601	1.9	—	1.2	0.6	0.1
スペイン	30,550	36,338	4,573,879	6.6	—	3.8	2.3	0.4
ベルギー	11,880	14,511	1,826,560	2.6	—	2.1	0.4	0.2
オーストリア	5,920	7,353	925,639	1.3	—	1.0	0.2	0.2
フィンランド	2,560	3,002	377,955	0.5	—	0.4	0.1	0.1
アイルランド	6,030	6,569	826,920	1.2	—	0.6	0.3	0.2
ポーランド	千ズロチ 13,000	千ズロチ 13,978	394,884	0.6	—	0.3	—	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 7,570	千シンガポールドル 8,528	664,530	1.0	—	0.6	0.2	0.1
オーストラリア	千豪ドル 19,330	千豪ドル 22,491	1,743,055	2.5	—	1.8	0.5	0.2
イスラエル	千新シェケル 6,200	千新シェケル 7,348	231,997	0.3	—	0.2	0.1	—
メキシコ	千メキシコペソ 102,600	千メキシコペソ 114,602	566,135	0.8	—	0.5	0.2	0.1
合 計	—	—	69,112,720	99.2	—	55.7	30.0	13.6

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

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

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

銘柄		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券					
	US TREASURY N/B	2.625	1,000	1,060	112,824	2023/2/28
	US TREASURY N/B	1.5	1,100	1,137	120,962	2023/3/31
	US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,563	166,270	2023/5/15
	US TREASURY N/B	1.625	2,000	2,079	221,145	2023/5/31
	US TREASURY N/B	1.375	2,500	2,583	274,832	2023/6/30
	US TREASURY N/B	1.25	3,500	3,607	383,718	2023/7/31
	US TREASURY N/B	2.5	1,200	1,281	136,277	2023/8/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,000	3,105	330,347	2023/8/31
	US TREASURY N/B	2.75	2,500	2,690	286,133	2023/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	700	731	77,802	2023/10/31
	US TREASURY N/B	2.75	1,000	1,081	114,985	2023/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	3,000	3,186	338,872	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	2,172	231,017	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	2,135	227,128	2023/12/31
	US TREASURY N/B	2.25	500	534	56,852	2024/1/31
	US TREASURY N/B	2.75	400	435	46,279	2024/2/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	2,136	227,228	2024/3/31
	US TREASURY N/B	2.0	500	532	56,620	2024/4/30
	US TREASURY N/B	2.5	1,500	1,625	172,888	2024/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	4,000	4,268	453,990	2024/6/30
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	2,115	224,984	2024/6/30
	US TREASURY N/B	2.125	3,000	3,219	342,387	2024/7/31
	US TREASURY N/B	1.875	2,000	2,129	226,530	2024/8/31
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	2,152	228,890	2024/9/30
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	2,165	230,269	2024/10/31
	US TREASURY N/B	2.25	4,000	4,331	460,671	2024/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	3,000	3,235	344,157	2024/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	800	868	92,320	2024/12/31
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	2,127	226,247	2024/12/31
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	2,153	229,072	2025/2/15
	US TREASURY N/B	2.625	4,500	4,979	529,622	2025/3/31
	US TREASURY N/B	2.875	4,000	4,478	476,293	2025/4/30
	US TREASURY N/B	2.125	800	868	92,340	2025/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	2,242	238,512	2025/5/31
	US TREASURY N/B	2.75	4,000	4,470	475,429	2025/6/30
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	2,250	239,409	2025/7/31
	US TREASURY N/B	2.0	2,780	3,009	320,120	2025/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	600	672	71,493	2025/8/31
	US TREASURY N/B	2.25	1,640	1,801	191,628	2025/11/15
	US TREASURY N/B	2.625	3,000	3,365	357,942	2026/1/31
	US TREASURY N/B	1.625	4,000	4,273	454,489	2026/2/15
	US TREASURY N/B	1.625	4,200	4,494	478,051	2026/5/15
	US TREASURY N/B	1.5	3,800	4,044	430,217	2026/8/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,600	2,850	303,174	2026/11/15
	US TREASURY N/B	2.25	1,500	1,672	177,837	2027/2/15
	US TREASURY N/B	2.375	1,800	2,026	215,513	2027/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	3,200	3,584	381,220	2027/8/15

銘	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円		
	国債証券	US TREASURY N/B	2.25	600	673	71,653	2027/11/15
		US TREASURY N/B	2.75	4,200	4,879	518,988	2028/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	2,500	2,936	312,370	2028/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	3,100	3,653	388,626	2028/8/15
		US TREASURY N/B	3.125	1,000	1,202	127,889	2028/11/15
		US TREASURY N/B	2.625	3,400	3,962	421,489	2029/2/15
		US TREASURY N/B	2.375	500	573	61,028	2029/5/15
		US TREASURY N/B	1.625	2,000	2,170	230,884	2029/8/15
		US TREASURY N/B	1.5	1,500	1,612	171,542	2030/2/15
		US TREASURY N/B	6.25	500	762	81,124	2030/5/15
		US TREASURY N/B	0.625	1,800	1,786	189,997	2030/5/15
		US TREASURY N/B	0.625	1,500	1,486	158,056	2030/8/15
		US TREASURY N/B	5.0	340	549	58,472	2037/5/15
		US TREASURY N/B	4.5	1,760	2,741	291,568	2038/5/15
		US TREASURY N/B	3.5	400	559	59,501	2039/2/15
		US TREASURY N/B	4.25	1,300	1,986	211,301	2039/5/15
		US TREASURY N/B	4.625	1,150	1,844	196,161	2040/2/15
		US TREASURY N/B	3.875	340	501	53,331	2040/8/15
		US TREASURY N/B	4.75	300	492	52,433	2041/2/15
		US TREASURY N/B	3.125	500	672	71,560	2041/11/15
		US TREASURY N/B	2.75	500	637	67,829	2042/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	800	1,079	114,842	2043/2/15
		US TREASURY N/B	3.625	700	1,018	108,380	2044/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	500	665	70,779	2044/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	2,400	2,942	312,997	2045/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,540	3,387	360,318	2045/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	2,760	3,611	384,165	2045/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	3,020	4,040	429,790	2045/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	2,530	3,109	330,771	2046/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	3,400	4,183	444,938	2046/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	3,530	4,151	441,506	2046/8/15
		US TREASURY N/B	2.875	3,600	4,739	504,106	2046/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	1,000	1,349	143,577	2047/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	2,820	3,646	387,830	2047/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	2,600	3,365	358,006	2047/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,100	2,844	302,490	2048/2/15
		US TREASURY N/B	3.125	1,000	1,385	147,408	2048/5/15
		US TREASURY N/B	3.0	400	543	57,836	2048/8/15
		US TREASURY N/B	2.25	600	712	75,736	2049/8/15
小	計					29,859,228	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	0.5	2,000	2,008	163,388	2022/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.75	1,000	1,037	84,345	2023/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,000	1,033	84,078	2023/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	600	640	52,102	2024/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	1,060	1,146	93,229	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	1,000	1,040	84,642	2025/3/1

銘柄	当期末					償還年月日	
	利率	額面金額	評価額		千円		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,000	1,063	86,526	2026/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	8.0	330	495	40,298	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	400	446	36,289	2028/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	1,020	1,472	119,775	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	1,000	1,147	93,296	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	600	964	78,472	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	400	656	53,420	2037/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	780	1,221	99,305	2041/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,040	1,463	119,019	2048/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	200	248	20,184	2051/12/1
小計						1,308,374	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UK TREASURY	4.0	320	339	47,850	2022/3/7
		UK TREASURY	0.5	400	404	56,980	2022/7/22
		UK TREASURY	1.75	1,500	1,555	219,193	2022/9/7
		UK TREASURY	0.125	400	401	56,620	2023/1/31
		UK TREASURY	0.75	900	922	129,969	2023/7/22
		UK TREASURY	2.25	550	588	82,963	2023/9/7
		UK TREASURY	1.0	500	519	73,270	2024/4/22
		UK TREASURY	2.75	1,200	1,336	188,361	2024/9/7
		UK TREASURY	0.625	900	928	130,900	2025/6/7
		UK TREASURY	1.5	1,370	1,492	210,396	2026/7/22
		UK TREASURY	4.25	300	390	55,068	2027/12/7
		UK TREASURY	1.625	900	1,009	142,299	2028/10/22
		UK TREASURY	6.0	90	132	18,731	2028/12/7
		UK TREASURY	0.875	1,400	1,484	209,278	2029/10/22
		UK TREASURY	4.75	600	873	123,048	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	600	866	122,169	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	200	308	43,414	2034/9/7
		UK TREASURY	4.25	1,160	1,789	252,264	2036/3/7
		UK TREASURY	1.75	670	785	110,739	2037/9/7
		UK TREASURY	4.5	850	1,499	211,262	2042/12/7
		UK TREASURY	3.5	1,000	1,595	224,783	2045/1/22
		UK TREASURY	4.25	2,180	3,951	556,818	2046/12/7
		UK TREASURY	1.5	1,700	1,980	279,111	2047/7/22
		UK TREASURY	1.75	1,650	2,041	287,691	2049/1/22
		UK TREASURY	4.25	1,140	2,161	304,611	2049/12/7
		UK TREASURY	3.75	860	1,576	222,122	2052/7/22
		UK TREASURY	3.5	380	804	113,393	2068/7/22
		UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	100	152	21,439	2044/1/22
		UNITED KINGDOM (GOVERNMENT)	4.25	580	1,198	168,971	2055/12/7
小計						4,663,730	
スウェーデン				千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	3.5	3,500	3,733	45,479	2022/6/1
		SWEDISH GOVERNMENT	1.5	3,000	3,176	38,695	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT	2.5	250	282	3,444	2025/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	1.0	2,700	2,905	35,389	2026/11/12

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

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	60	120	15,202	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	750	1,324	166,756	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,300	2,132	268,388	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	610	1,026	129,160	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	1,200	1,642	206,794	2048/8/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	710	744	93,719	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.3	1,000	1,027	129,362	2021/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	1,750	1,761	221,704	2021/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.15	1,000	1,029	129,638	2021/12/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2	700	714	89,885	2022/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	1,030	1,055	132,848	2022/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.0	1,500	1,532	192,875	2022/7/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9	500	509	64,102	2022/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	1,900	1,957	246,392	2022/9/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	200	223	28,147	2022/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.05	500	500	63,010	2023/1/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	3,400	3,481	438,186	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,150	1,285	161,849	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,500	1,608	202,398	2023/10/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	180	230	28,986	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	2,200	2,528	318,257	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	1,500	1,704	214,539	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	700	734	92,417	2024/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,000	1,090	137,210	2024/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	2,000	1,999	251,689	2025/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,350	1,626	204,753	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	500	524	65,993	2025/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	800	840	105,733	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	330	355	44,747	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6	550	581	73,243	2026/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.25	1,100	1,142	143,773	2026/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2	3,200	3,516	442,579	2027/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	400	557	70,190	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	800	869	109,416	2028/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	2,040	2,652	333,884	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	1,000	1,376	173,222	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	400	491	61,817	2030/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	300	309	38,995	2030/4/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	2,500	2,485	312,786	2030/8/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	700	1,041	131,070	2031/5/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	500	526	66,308	2032/3/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,070	1,218	153,347	2033/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,110	1,616	203,454	2034/8/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.25	500	556	69,983	2036/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	1,580	2,137	269,077	2037/2/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	400	486	61,213	2038/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	150	231	29,136	2039/8/1		

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	300	465	58,650	2040/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	2,480	3,868	486,872	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	860	1,099	138,427	2046/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7	300	350	44,059	2047/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.85	600	850	107,090	2049/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	10	11	1,484	2067/3/1
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	700	706	88,929	2022/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	300	319	40,231	2023/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	800	817	102,901	2024/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	2,010	2,226	280,300	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,000	2,053	258,467	2025/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	400	420	52,960	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	700	740	93,263	2026/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	250	261	32,920	2026/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	800	878	110,621	2027/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	2,300	2,503	315,074	2028/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,000	1,090	137,306	2028/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,000	1,070	134,780	2029/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,500	2,559	322,160	2029/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	1,720	2,182	274,712	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	1,200	1,405	176,967	2034/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	1,850	2,180	274,448	2036/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	960	1,237	155,751	2039/6/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	1,010	1,424	179,242	2048/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.5	700	898	113,074	2050/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,500	1,597	201,042	2052/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.0	1,320	1,398	176,025	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	—	900	909	114,539	2022/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.25	610	647	81,448	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.25	1,800	2,078	261,581	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.75	600	660	83,140	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	6.0	1,100	1,477	185,947	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.0	1,000	1,082	136,235	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	—	4,000	4,113	517,766	2026/2/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.5	910	1,120	140,977	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.75	1,900	2,338	294,397	2027/10/25
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5.5	1,200	1,813	228,233	2029/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.5	640	755	95,086	2031/5/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5.75	300	515	64,916	2032/10/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.75	1,490	2,527	318,168	2035/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	400	676	85,143	2038/10/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.5	720	1,337	168,291	2041/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	1,800	3,026	380,909	2045/5/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	600	1,326	166,991	2060/4/25		
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	—	500	504	63,495	2022/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	630	696	87,664	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	300	358	45,090	2023/1/15

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

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	2.6	230	258	32,528	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.5	300	313	39,517	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	2,100	2,286	287,831	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	950	1,030	129,750	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	300	327	41,259	2028/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.9	800	885	111,398	2029/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,200	1,349	169,863	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	550	813	102,359	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.45	200	242	30,496	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	420	543	68,465	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	300	534	67,277	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	750	1,339	168,579	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	500	643	80,989	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.7	400	532	67,038	2050/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	170	276	34,761	2066/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	370	636	80,136	2035/3/28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	800	856	107,744	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	700	709	89,339	2022/9/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	120	129	16,254	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	300	324	40,838	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	400	427	53,767	2027/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	700	764	96,184	2028/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	700	720	90,751	2030/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	530	714	89,893	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	230	389	49,050	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	400	686	86,459	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	200	267	33,675	2047/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	500	573	72,195	2051/3/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	330	774	97,503	2062/1/26
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	10	15	1,981	2086/11/2
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	—	300	303	38,160	2022/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.625	300	313	39,520	2022/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	150	158	19,951	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.0	200	219	27,609	2024/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	310	328	41,384	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	740	927	116,777	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	200	234	29,509	2034/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	160	249	31,463	2042/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	1.375	200	266	33,578	2047/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	—	—	—	—	—
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	0.9	800	875	110,192	2028/5/15
		IRISH TSY 0.2% 2030	0.2	800	826	104,056	2030/10/18
		IRISH TSY 0.8% 2022	0.8	1,300	1,327	167,107	2022/3/15
		IRISH TSY 1% 2026	1.0	650	704	88,735	2026/5/15
		IRISH TSY 1.5% 2050	1.5	100	127	16,079	2050/5/15
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	550	687	86,567	2037/5/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	250	346	43,598	2045/2/18
		IRISH TSY 2022	—	1,000	1,012	127,467	2022/10/18

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
アイルランド	国債証券	IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	500	571	71,881	2024/3/18
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	80	89	11,233	2023/3/20
小 計						29,013,839	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	6,000	6,216	175,629	2022/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	7,000	7,761	219,255	2028/4/25
小 計						394,884	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	1.25	1,030	1,041	81,148	2021/10/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	1,400	1,495	116,505	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	400	436	33,977	2025/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	700	761	59,332	2026/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	730	860	67,063	2027/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	300	340	26,562	2028/5/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	400	467	36,450	2029/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	1,210	1,432	111,653	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	700	805	62,726	2036/8/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	200	234	18,265	2039/7/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	500	652	50,842	2046/3/1		
小 計						664,530	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0	1,200	1,227	95,168	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	120	132	10,240	2022/7/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	1,200	1,251	97,022	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	800	909	70,471	2023/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,000	1,088	84,370	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,340	1,515	117,471	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	520	628	48,685	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	820	1,040	80,666	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	900	1,031	79,947	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	2,820	3,135	242,983	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,700	1,966	152,387	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,000	1,202	93,199	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	800	931	72,192	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5	1,600	1,839	142,525	2030/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	1,170	1,648	127,739	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	300	362	28,100	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	150	203	15,806	2037/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,020	1,308	101,444	2039/6/21		
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	600	723	56,100	2041/5/21		
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	270	342	26,528	2047/3/21		
小 計						1,743,055	
イスラエル				千新シェケル	千新シェケル		
	国債証券	ISRAEL FIXED BOND	1.5	1,500	1,561	49,309	2023/11/30
		ISRAEL FIXED BOND	3.75	1,500	1,685	53,215	2024/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	2.0	1,000	1,098	34,664	2027/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	1.0	1,000	1,028	32,474	2030/3/31

銘	柄	当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
イスラエル	国債証券		%	千新シェケル	千新シェケル	千円	
		ISRAEL FIXED BOND	5.5	700	1,242	39,212	2042/1/31
		ISRAEL FIXED BOND	3.75	500	732	23,119	2047/3/31
小 計						231,997	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.25	2,800	2,893	14,294	2021/12/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	15,000	15,499	76,569	2022/6/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	11,000	13,126	64,845	2024/12/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	14,000	14,387	71,072	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	20,100	22,385	110,585	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	10,000	11,371	56,173	2031/5/29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	3,100	3,510	17,341	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	6,000	8,077	39,904	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	7,000	8,310	41,051	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	4,300	4,813	23,778	2047/11/7
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	9,300	10,226	50,517	2023/12/7
小 計						566,135	
合 計						69,112,720	

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

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2020年9月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 69,112,720	% 96.4
コール・ローン等、その他	2,615,232	3.6
投資信託財産総額	71,727,952	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産（70,643,934千円）の投資信託財産総額（71,727,952千円）に対する比率は98.5%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=106.36円、1カナダドル=81.33円、1英ポンド=140.93円、1スウェーデンクローナ=12.18円、1ノルウェークローネ=11.91円、1デンマーククローネ=16.92円、1ユーロ=125.87円、1ズロチ=28.25円、1シンガポールドル=77.92円、1豪ドル=77.50円、1新シェケル=31.57円、1メキシコペソ=4.94円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年9月7日現在)

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

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

○損益の状況 (2019年9月7日～2020年9月7日)

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

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	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)	28,682,992,731
野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース (野村投資一任口座向け)	7,848,253,832
野村外国債券インデックス Aコース (野村SMA・EW向け)	6,560,772,015
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信(適格機関投資家専用)	6,047,758,615
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	4,101,982,437
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,360,054,096
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	872,159,669
野村国内外マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用)	131,720,238
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	35,551,865
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	22,353,287
インデックス・ブレンド(タイプⅢ)	14,859,101
インデックス・ブレンド(タイプⅠ)	12,034,458
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	6,161,690
インデックス・ブレンド(タイプⅡ)	6,003,178
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	3,654,082
インデックス・ブレンド(タイプⅤ)	3,006,369
インデックス・ブレンド(タイプⅣ)	2,888,348
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	1,997,762

○お知らせ

該当事項はございません。

<お申し込み時の留意点>

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

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

(2020年12月7日現在)

年 月	日
2020年12月	24、25、28
2021年1月	15、18
2月	12、15
3月	－
4月	1、2、5
5月	28、31
6月	－
7月	2、5
8月	27、30
9月	3、6
10月	8、11
11月	10、11、24、25
12月	23、24、27、28

※2021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。