

野村外国債券インデックス Bコース (野村SMA・EW向け)

運用報告書(全体版)

第6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 | 2015年4月1日以降、無期限とします。 | |
| 運用方針 | 外国債券マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、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、ヘッジなし・円ベース)の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。実質組入外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 | |
| 主な投資対象 | 野村外国債券インデックス B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 B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 | 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/>

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 基準価額 | | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 債先物比率 | 純資産額 |
|----------------|---------------|----------|----------|-----------|-----------|-----------|-------|-------|--------|
| | | 税込 分配 | み金 騰落 | 期中 騰落率 | 期中 騰落率 | 期中 騰落率 | | | |
| | 円 | | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 2期(2016年12月6日) | 9,293 | | 0 | △7.9 | 94.08 | △7.0 | 99.1 | — | 5,165 |
| 3期(2017年12月6日) | 9,863 | | 0 | 6.1 | 99.82 | 6.1 | 99.1 | — | 4,515 |
| 4期(2018年12月6日) | 9,600 | | 0 | △2.7 | 97.22 | △2.6 | 99.1 | — | 9,782 |
| 5期(2019年12月6日) | 9,932 | | 0 | 3.5 | 100.62 | 3.5 | 99.1 | — | 12,864 |
| 6期(2020年12月7日) | 10,450 | | 5 | 5.3 | 106.50 | 5.8 | 99.1 | — | 20,298 |

* 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、「債組入比率」、「債先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

* ベンチマーク（＝FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））は、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとに、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、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。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 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 債先物比率 |
|------------|--------|------|-----|--------|-----|-------|-------|
| | | 騰落 | 騰落率 | 騰落 | 騰落率 | | |
| (期首) | 円 | | % | | % | % | % |
| 2019年12月6日 | 9,932 | | — | 100.62 | — | 99.1 | — |
| 12月末 | 10,032 | | 1.0 | 101.66 | 1.0 | 99.0 | — |
| 2020年1月末 | 10,111 | | 1.8 | 102.21 | 1.6 | 98.9 | — |
| 2月末 | 10,227 | | 3.0 | 104.24 | 3.6 | 98.8 | — |
| 3月末 | 10,235 | | 3.1 | 103.34 | 2.7 | 98.5 | — |
| 4月末 | 10,039 | | 1.1 | 101.68 | 1.1 | 98.8 | — |
| 5月末 | 10,183 | | 2.5 | 103.44 | 2.8 | 99.1 | — |
| 6月末 | 10,344 | | 4.1 | 105.11 | 4.5 | 99.0 | — |
| 7月末 | 10,446 | | 5.2 | 106.25 | 5.6 | 98.9 | — |
| 8月末 | 10,432 | | 5.0 | 105.93 | 5.3 | 99.0 | — |
| 9月末 | 10,480 | | 5.5 | 106.41 | 5.8 | 98.6 | — |
| 10月末 | 10,321 | | 3.9 | 104.94 | 4.3 | 98.8 | — |
| 11月末 | 10,427 | | 5.0 | 106.05 | 5.4 | 99.1 | — |
| (期末) | | | | | | | |
| 2020年12月7日 | 10,455 | | 5.3 | 106.50 | 5.8 | 99.1 | — |

* 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、「債組入比率」、「債先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債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、ヘッジなし・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

米ドルや英ポンドなどが対円で下落(円高)したことはマイナスに影響しましたが、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。

為替市場は、ユーロなど政策金利の引き下げ余地が相対的に小さい通貨は対円で上昇(円安)しましたが、米ドルや英ポンドなどは内外金利差の縮小などを背景に対円で下落(円高)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 Bコース (野村SMA・EW向け)]

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

[外国債券マザーファンド]

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

当運用期間の基準価額の騰落率は+5.3%となり、ベンチマークの+5.8%を0.5ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

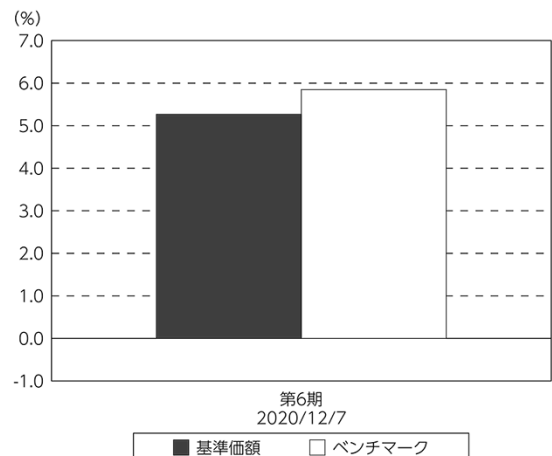
(マイナス要因)

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

(その他の要因)

ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なること

基準価額とベンチマークの対比(期別騰落率)



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

◎分配金

- (1) 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。
 (2) 留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目 | 第6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 | 1,255 |

(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 B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、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える運用を行ってまいります。

[外国債券マザーファンド]

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

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 34 | % 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) そ の 他 費 用 | 2 | 0.020 | (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 ） | (1) | (0.010) | 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 ） | (1) | (0.008) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 36 | 0.351 | |
| 期中の平均基準価額は、10,273円です。 | | | |

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

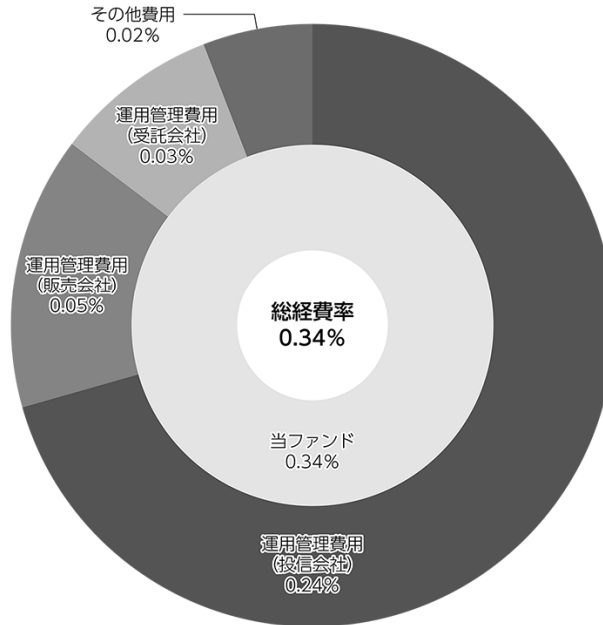
* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

(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0.34%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 |
| 外国債券マザーファンド | 千口 3,645,472 | 千円 8,910,975 | 千口 926,240 | 千円 2,249,968 |

*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)

利害関係人との取引状況

<野村外国債券インデックス Bコース（野村SMA・EW向け）>
該当事項はございません。

<外国債券マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | |
|--------|---------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
| | | | $\frac{B}{A}$ | | | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 87,026 | 百万円 548 | % 0.6 | 百万円 149,676 | 百万円 741 | % 0.5 |

平均保有割合 2.8%

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

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

○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 — | 百万円 0 | 当初設定時における取得 |

○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 |
| 外国債券マザーファンド | 千口 5,502,359 | 千口 8,221,591 | 千円 20,296,642 |

*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 |
| 外国債券マザーファンド | 千円 20,296,642 | % 99.7 |
| コール・ローン等、その他 | 53,667 | 0.3 |
| 投資信託財産総額 | 20,350,309 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（581,267,813千円）の投資信託財産総額（761,396,162千円）に対する比率は76.3%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=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リンギ=25.48円、1豪ドル=77.33円、1新シッケル=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 |
|------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 20,350,309,758 |
| コール・ローン等 | 43,954,582 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 20,296,642,602 |
| 未収入金 | 9,712,574 |
| (B) 負債 | 51,638,515 |
| 未払収益分配金 | 9,712,573 |
| 未払解約金 | 12,030,818 |
| 未払信託報酬 | 29,697,165 |
| 未払利息 | 41 |
| その他未払費用 | 197,918 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 20,298,671,243 |
| 元本 | 19,425,147,625 |
| 次期繰越損益金 | 873,523,618 |
| (D) 受益権総口数 | 19,425,147,625口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,450円 |

(注) 期首元本額は12,952,887,705円、期中追加設定元本額は9,112,332,957円、期中一部解約元本額は2,640,073,037円、1口当たり純資産額は1.0450円です。

○損益の状況（2019年12月7日～2020年12月7日）

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 6,167 |
| 支払利息 | △ 6,167 |
| (B) 有価証券売買損益 | 702,775,308 |
| 売買益 | 780,948,896 |
| 売買損 | △ 78,173,588 |
| (C) 信託報酬等 | △ 53,500,862 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 649,268,279 |
| (E) 前期繰越損益金 | 302,532,569 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 68,564,657 |
| (配当等相当額) | (1,475,822,043) |
| (売買損益相当額) | (△1,544,386,700) |
| (G) 計(D+E+F) | 883,236,191 |
| (H) 収益分配金 | △ 9,712,573 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 873,523,618 |
| 追加信託差損益金 | △ 68,564,657 |
| (配当等相当額) | (1,497,159,210) |
| (売買損益相当額) | (△1,565,723,867) |
| 分配準備積立金 | 942,088,275 |

*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) | 409,395,187円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 109,558,091円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 1,497,159,210円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 432,847,570円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 2,448,960,058円 |
| f. 分配対象収益(1万円当たり) | 1,260円 |
| g. 分配金 | 9,712,573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）

＜外国債券マザーファンド＞

下記は、外国債券マザーファンド全体(235,523,774千口)の内容です。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|---------|------------------------|------------------------|-------------------|-----------|-----------------|-----------|-----------|----------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| アメリカ | 千米ドル 2,115,160 | 千米ドル 2,389,088 | 千円 248,656,330 | % 42.8 | % — | % 20.2 | % 16.3 | % 6.3 |
| カナダ | 千カナダドル 115,340 | 千カナダドル 141,681 | 11,539,988 | 2.0 | — | 1.0 | 0.5 | 0.4 |
| イギリス | 千英ポンド 195,250 | 千英ポンド 272,670 | 38,102,926 | 6.6 | — | 5.3 | 1.1 | 0.1 |
| スウェーデン | 千スウェーデンクローナ 136,600 | 千スウェーデンクローナ 154,777 | 1,906,855 | 0.3 | — | 0.2 | 0.1 | 0.1 |
| ノルウェー | 千ノルウェークローネ 99,000 | 千ノルウェークローネ 106,254 | 1,256,993 | 0.2 | — | 0.1 | 0.1 | — |
| デンマーク | 千デンマーククローネ 135,270 | 千デンマーククローネ 176,336 | 2,990,664 | 0.5 | — | 0.3 | 0.2 | 0.0 |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ドイツ | 229,200 | 319,472 | 40,333,431 | 6.9 | — | 5.2 | 1.7 | 0.0 |
| イタリア | 354,900 | 464,570 | 58,652,035 | 10.1 | — | 6.3 | 2.0 | 1.8 |
| フランス | 345,520 | 463,300 | 58,491,652 | 10.1 | — | 7.3 | 2.1 | 0.6 |
| オランダ | 57,300 | 77,755 | 9,816,623 | 1.7 | — | 1.3 | 0.3 | 0.0 |
| スペイン | 229,750 | 308,401 | 38,935,713 | 6.7 | — | 4.4 | 1.7 | 0.6 |
| ベルギー | 87,200 | 116,676 | 14,730,359 | 2.5 | — | 2.1 | 0.4 | 0.0 |
| オーストリア | 50,000 | 66,049 | 8,338,703 | 1.4 | — | 1.3 | 0.1 | 0.0 |
| フィンランド | 18,900 | 21,587 | 2,725,467 | 0.5 | — | 0.3 | 0.1 | 0.0 |
| アイルランド | 52,380 | 60,305 | 7,613,595 | 1.3 | — | 0.7 | 0.4 | 0.2 |
| ポーランド | 千ズロチ 119,700 | 千ズロチ 129,126 | 3,649,120 | 0.6 | — | 0.3 | 0.2 | 0.2 |
| シンガポール | 千シンガポールドル 28,470 | 千シンガポールドル 32,580 | 2,542,225 | 0.4 | — | 0.3 | 0.1 | 0.0 |
| マレーシア | 千リンギ 102,780 | 千リンギ 111,910 | 2,851,476 | 0.5 | — | 0.3 | 0.1 | 0.0 |
| オーストラリア | 千豪ドル 173,750 | 千豪ドル 201,571 | 15,587,555 | 2.7 | — | 2.0 | 0.4 | 0.3 |
| イスラエル | 千新シェケル 66,900 | 千新シェケル 78,247 | 2,493,756 | 0.4 | — | 0.2 | 0.1 | 0.1 |
| メキシコ | 千メキシコペソ 835,900 | 千メキシコペソ 943,033 | 4,960,357 | 0.9 | — | 0.5 | 0.2 | 0.1 |
| 合 計 | — | — | 576,175,833 | 99.1 | — | 59.6 | 28.5 | 11.0 |

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

* 組入比率は、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 | 38,800 | 45,145 | 4,698,787 | 2023/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 2.375 | 45,100 | 48,584 | 5,056,693 | 2024/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 6.0 | 73,500 | 94,424 | 9,827,705 | 2026/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 6.125 | 12,000 | 16,459 | 1,713,124 | 2027/11/15 |
| | US TREASURY BOND | 5.5 | 46,200 | 62,647 | 6,520,395 | 2028/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 5.25 | 48,000 | 64,605 | 6,724,088 | 2028/11/15 |
| | US TREASURY BOND | 5.25 | 28,200 | 38,193 | 3,975,166 | 2029/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 4.375 | 100 | 147 | 15,358 | 2038/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 2.875 | 2,900 | 3,618 | 376,594 | 2043/5/15 |
| | US TREASURY BOND | 3.75 | 6,600 | 9,380 | 976,296 | 2043/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 1,000 | 1,017 | 105,877 | 2021/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 3,700 | 3,759 | 391,293 | 2021/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 12,400 | 12,667 | 1,318,470 | 2021/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 6,700 | 6,834 | 711,337 | 2021/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 81,500 | 83,645 | 8,705,848 | 2022/1/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 5,300 | 5,384 | 560,458 | 2022/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 14,000 | 14,281 | 1,486,433 | 2022/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 2,300 | 2,333 | 242,834 | 2022/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 32,800 | 33,536 | 3,490,501 | 2022/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 100 | 102 | 10,700 | 2022/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 6,800 | 6,934 | 721,788 | 2022/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 3,500 | 3,574 | 372,020 | 2022/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 3,900 | 3,983 | 414,569 | 2022/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 500 | 511 | 53,227 | 2022/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 1,300 | 1,337 | 139,167 | 2022/4/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 32,800 | 33,535 | 3,490,368 | 2022/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 26,200 | 26,836 | 2,793,150 | 2022/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 8,300 | 8,492 | 883,874 | 2022/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 200 | 205 | 21,347 | 2022/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 900 | 921 | 95,904 | 2022/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 33,400 | 34,210 | 3,560,598 | 2022/6/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 17,700 | 18,247 | 1,899,209 | 2022/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 100 | 102 | 10,669 | 2022/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 100 | 103 | 10,725 | 2022/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 1,000 | 1,028 | 107,064 | 2022/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 900 | 922 | 96,010 | 2022/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 32,400 | 33,364 | 3,472,567 | 2022/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 100 | 102 | 10,677 | 2022/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 900 | 926 | 96,394 | 2022/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 1,600 | 1,650 | 171,758 | 2022/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 100 | 103 | 10,747 | 2022/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 1,500 | 1,552 | 161,584 | 2022/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 8,100 | 8,330 | 866,989 | 2022/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 100 | 103 | 10,788 | 2022/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 20,000 | 20,809 | 2,165,839 | 2022/12/31 |

野村外国債券インデックス B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 | | |
| | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | | | | | | |
| 国債証券 | US TREASURY N/B | 1.75 | 49,700 | 51,396 | 5,349,377 | 2023/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 100 | 104 | 10,901 | 2023/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 400 | 416 | 43,297 | 2023/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 20,000 | 20,590 | 2,143,072 | 2023/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 14,300 | 15,080 | 1,569,621 | 2023/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 400 | 412 | 42,910 | 2023/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 100 | 105 | 10,969 | 2023/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 15,000 | 15,516 | 1,614,988 | 2023/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 34,800 | 36,132 | 3,760,637 | 2023/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 9,200 | 9,529 | 991,797 | 2023/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 9,100 | 9,680 | 1,007,507 | 2023/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 100 | 106 | 11,057 | 2023/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 4,300 | 4,421 | 460,166 | 2023/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 47,100 | 50,286 | 5,233,830 | 2023/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 6,500 | 6,903 | 718,538 | 2023/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 10,900 | 11,252 | 1,171,165 | 2023/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 1,000 | 1,069 | 111,324 | 2023/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 35,200 | 36,357 | 3,784,114 | 2023/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 1,000 | 1,075 | 111,902 | 2023/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 10,600 | 11,038 | 1,148,843 | 2023/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 1,000 | 1,076 | 112,089 | 2023/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 42,600 | 45,775 | 4,764,265 | 2023/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 9,200 | 9,724 | 1,012,145 | 2023/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 29,300 | 31,621 | 3,291,124 | 2023/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 43,000 | 45,690 | 4,755,504 | 2023/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 800 | 858 | 89,385 | 2023/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 1,300 | 1,393 | 145,018 | 2024/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 800 | 864 | 90,003 | 2024/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 400 | 427 | 44,497 | 2024/2/29 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 1,700 | 1,805 | 187,925 | 2024/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 20,900 | 22,501 | 2,341,986 | 2024/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 17,700 | 18,789 | 1,955,627 | 2024/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 3,800 | 4,055 | 422,107 | 2024/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 42,700 | 45,655 | 4,751,838 | 2024/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 2,400 | 2,581 | 268,643 | 2024/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 34,200 | 36,807 | 3,830,950 | 2024/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 2,300 | 2,465 | 256,589 | 2024/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 16,900 | 18,071 | 1,880,841 | 2025/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 1,900 | 2,092 | 217,805 | 2025/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 32,700 | 35,885 | 3,734,982 | 2025/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 34,500 | 38,289 | 3,985,182 | 2025/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 8,050 | 8,670 | 902,449 | 2025/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 4,100 | 4,540 | 472,567 | 2025/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 5,200 | 5,794 | 603,075 | 2025/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 27,000 | 29,029 | 3,021,360 | 2025/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 700 | 776 | 80,824 | 2025/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 29,200 | 32,811 | 3,414,991 | 2025/9/30 |

| 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 | 3.0 | 100 | 112 | 11,712 | 2025/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 50,600 | 55,142 | 5,739,193 | 2025/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 10,000 | 11,210 | 1,166,753 | 2025/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 10,000 | 11,098 | 1,155,125 | 2025/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 15,000 | 16,668 | 1,734,883 | 2026/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 2,000 | 2,121 | 220,779 | 2026/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 8,600 | 9,470 | 985,645 | 2026/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 1,800 | 1,910 | 198,848 | 2026/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 21,100 | 22,267 | 2,317,559 | 2026/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 12,000 | 12,569 | 1,308,187 | 2026/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 10,000 | 10,625 | 1,105,931 | 2026/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 5,600 | 5,950 | 619,321 | 2026/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 13,000 | 14,098 | 1,467,414 | 2026/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 30,000 | 31,865 | 3,316,574 | 2026/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 100 | 107 | 11,138 | 2026/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 11,300 | 12,446 | 1,295,460 | 2027/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 0.5 | 17,000 | 16,869 | 1,755,813 | 2027/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 38,000 | 42,239 | 4,396,274 | 2027/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 8,700 | 9,610 | 1,000,219 | 2027/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 1,000 | 1,106 | 115,122 | 2027/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 500 | 571 | 59,484 | 2028/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 30,600 | 35,338 | 3,678,001 | 2028/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 9,900 | 11,460 | 1,192,759 | 2028/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 1,200 | 1,415 | 147,357 | 2028/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 1,700 | 1,789 | 186,280 | 2030/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 6.25 | 2,600 | 3,869 | 402,698 | 2030/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 0.625 | 17,700 | 17,210 | 1,791,267 | 2030/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 5.375 | 38,700 | 55,471 | 5,773,422 | 2031/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 15,100 | 22,027 | 2,292,583 | 2036/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 5.0 | 200 | 311 | 32,406 | 2037/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 100 | 149 | 15,607 | 2038/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.5 | 100 | 134 | 14,015 | 2039/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 100 | 147 | 15,308 | 2039/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 100 | 151 | 15,786 | 2039/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 100 | 149 | 15,600 | 2039/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.625 | 100 | 154 | 16,090 | 2040/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 100 | 150 | 15,668 | 2040/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.875 | 200 | 283 | 29,556 | 2040/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 100 | 148 | 15,497 | 2040/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.75 | 100 | 158 | 16,479 | 2041/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 100 | 151 | 15,803 | 2041/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.75 | 100 | 140 | 14,631 | 2041/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 300 | 387 | 40,361 | 2041/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 100 | 129 | 13,483 | 2042/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 100 | 127 | 13,226 | 2042/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 200 | 244 | 25,481 | 2042/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 600 | 733 | 76,342 | 2042/11/15 |

野村外国債券インデックス B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 | | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 国債証券 | US TREASURY N/B | 3.125 | 290 | 375 | 39,094 | 2043/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 100 | 139 | 14,519 | 2043/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 13,700 | 19,146 | 1,992,801 | 2044/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.375 | 15,200 | 20,503 | 2,133,991 | 2044/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 25,000 | 32,515 | 3,384,226 | 2044/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 37,100 | 47,290 | 4,922,037 | 2044/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 39,900 | 46,820 | 4,873,041 | 2045/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 23,400 | 29,886 | 3,110,554 | 2045/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 17,500 | 21,921 | 2,281,588 | 2045/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 3,700 | 4,736 | 492,983 | 2045/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 51,500 | 60,504 | 6,297,303 | 2046/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 28,200 | 33,137 | 3,448,920 | 2046/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 34,500 | 38,704 | 4,028,383 | 2046/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 14,200 | 17,847 | 1,857,580 | 2046/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 2,000 | 2,573 | 267,859 | 2047/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 1,700 | 2,189 | 227,874 | 2047/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 11,400 | 14,061 | 1,463,488 | 2047/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 9,300 | 11,478 | 1,194,654 | 2047/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 9,500 | 12,261 | 1,276,195 | 2048/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 5,100 | 6,735 | 701,039 | 2048/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 10,500 | 13,577 | 1,413,178 | 2048/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 2,470 | 3,202 | 333,297 | 2049/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 100 | 126 | 13,203 | 2049/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 11,250 | 12,643 | 1,315,981 | 2049/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 300 | 346 | 36,022 | 2049/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 2,200 | 1,953 | 203,341 | 2050/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 10,600 | 9,715 | 1,011,195 | 2050/8/15 |
| 小 計 | | | | | 248,656,330 | |
| カナダ | | | 千カナダドル | 千カナダドル | | |
| 国債証券 | CANADA GOVERNMENT | 2.75 | 18,650 | 19,351 | 1,576,188 | 2022/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.5 | 300 | 301 | 24,527 | 2022/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.25 | 300 | 300 | 24,443 | 2022/8/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0 | 12,000 | 12,159 | 990,350 | 2022/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.75 | 300 | 309 | 25,242 | 2023/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 4,460 | 4,594 | 374,259 | 2023/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0 | 1,100 | 1,151 | 93,765 | 2023/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25 | 500 | 530 | 43,247 | 2024/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.5 | 6,800 | 7,307 | 595,172 | 2024/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 17,000 | 17,599 | 1,433,472 | 2025/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25 | 3,700 | 3,998 | 325,664 | 2025/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 300 | 315 | 25,735 | 2026/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 8.0 | 6,700 | 9,857 | 802,905 | 2027/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0 | 200 | 205 | 16,728 | 2027/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0 | 100 | 109 | 8,955 | 2028/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75 | 11,380 | 16,086 | 1,310,248 | 2029/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25 | 1,000 | 1,126 | 91,765 | 2029/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75 | 10,200 | 15,990 | 1,302,387 | 2033/6/1 |

野村外国債券インデックス B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 | |
| カナダ | | % | 千カナダドル | 千カナダドル | 千円 | |
| 国債証券 | CANADIAN GOVERNMENT | 5.0 | 3,800 | 6,065 | 494,024 | 2037/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4.0 | 4,800 | 7,261 | 591,483 | 2041/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.5 | 9,950 | 14,698 | 1,197,204 | 2045/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,300 | 1,743 | 141,986 | 2048/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0 | 400 | 469 | 38,216 | 2051/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75 | 100 | 147 | 12,013 | 2064/12/1 |
| 小 計 | | | | | 11,539,988 | |
| イギリス | | | 千英ポンド | 千英ポンド | | |
| 国債証券 | UK TREASURY | 4.0 | 5,350 | 5,621 | 785,483 | 2022/3/7 |
| | UK TREASURY | 1.75 | 400 | 412 | 57,661 | 2022/9/7 |
| | UK TREASURY | 0.125 | 1,400 | 1,403 | 196,166 | 2023/1/31 |
| | UK TREASURY | 0.75 | 14,600 | 14,904 | 2,082,749 | 2023/7/22 |
| | UK TREASURY | 2.25 | 2,300 | 2,444 | 341,608 | 2023/9/7 |
| | UK TREASURY | 1.0 | 1,600 | 1,655 | 231,342 | 2024/4/22 |
| | UK TREASURY | 2.75 | 7,450 | 8,222 | 1,149,052 | 2024/9/7 |
| | UK TREASURY | 5.0 | 13,450 | 16,312 | 2,279,533 | 2025/3/7 |
| | UK TREASURY | 0.625 | 200 | 205 | 28,713 | 2025/6/7 |
| | UK TREASURY | 2.0 | 200 | 218 | 30,581 | 2025/9/7 |
| | UK TREASURY | 1.5 | 160 | 173 | 24,182 | 2026/7/22 |
| | UK TREASURY | 1.25 | 400 | 429 | 59,989 | 2027/7/22 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 12,630 | 16,243 | 2,269,915 | 2027/12/7 |
| | UK TREASURY | 1.625 | 200 | 222 | 31,060 | 2028/10/22 |
| | UK TREASURY | 6.0 | 7,900 | 11,502 | 1,607,334 | 2028/12/7 |
| | UK TREASURY | 4.75 | 6,000 | 8,594 | 1,200,996 | 2030/12/7 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 5,550 | 7,904 | 1,104,601 | 2032/6/7 |
| | UK TREASURY | 4.5 | 12,100 | 18,358 | 2,565,431 | 2034/9/7 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 2,350 | 3,571 | 499,013 | 2036/3/7 |
| | UK TREASURY | 4.75 | 100 | 167 | 23,418 | 2038/12/7 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 600 | 962 | 134,560 | 2039/9/7 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 500 | 816 | 114,069 | 2040/12/7 |
| | UK TREASURY | 1.25 | 400 | 429 | 59,962 | 2041/10/22 |
| | UK TREASURY | 4.5 | 570 | 985 | 137,739 | 2042/12/7 |
| | UK TREASURY | 3.5 | 18,440 | 28,800 | 4,024,587 | 2045/1/22 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 6,300 | 11,169 | 1,560,864 | 2046/12/7 |
| | UK TREASURY | 1.5 | 8,200 | 9,325 | 1,303,113 | 2047/7/22 |
| | UK TREASURY | 1.75 | 16,100 | 19,445 | 2,717,280 | 2049/1/22 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 5,350 | 9,913 | 1,385,315 | 2049/12/7 |
| | UK TREASURY | 3.75 | 6,750 | 12,049 | 1,683,779 | 2052/7/22 |
| | UK TREASURY | 1.625 | 1,000 | 1,209 | 168,993 | 2054/10/22 |
| | UK TREASURY | 1.75 | 700 | 891 | 124,508 | 2057/7/22 |
| | UK TREASURY | 4.0 | 750 | 1,530 | 213,848 | 2060/1/22 |
| | UK TREASURY | 2.5 | 100 | 160 | 22,479 | 2065/7/22 |
| | UK TREASURY | 3.5 | 200 | 408 | 57,029 | 2068/7/22 |
| | UK TSY 3 1/4% 2044 | 3.25 | 27,450 | 40,931 | 5,719,725 | 2044/1/22 |
| | UNITED KINGDOM(GOVERNMENT) | 4.25 | 7,500 | 15,072 | 2,106,233 | 2055/12/7 |
| 小 計 | | | | | 38,102,926 | |

野村外国債券インデックス B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 | | |
| スウェーデン | | % | 千スウェーデンクローナ | 千スウェーデンクローナ | 千円 | | |
| 国債証券 | SWEDISH GOVERNMENT | 3.5 | 36,050 | 38,121 | 469,656 | 2022/6/1 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 1.5 | 7,900 | 8,332 | 102,657 | 2023/11/13 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 2.5 | 29,350 | 32,979 | 406,302 | 2025/5/12 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 1.0 | 12,000 | 12,872 | 158,595 | 2026/11/12 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 0.75 | 16,800 | 17,908 | 220,636 | 2028/5/12 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 0.75 | 18,900 | 20,257 | 249,572 | 2029/11/12 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 3.5 | 15,600 | 24,304 | 299,436 | 2039/3/30 | |
| 小 計 | | | | | 1,906,855 | | |
| 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 | 10,300 | 10,733 | 126,976 | 2023/5/24 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.0 | 37,800 | 41,026 | 485,340 | 2024/3/14 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.75 | 4,700 | 4,952 | 58,591 | 2025/3/13 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.5 | 4,700 | 4,924 | 58,257 | 2026/2/19 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.75 | 9,600 | 10,229 | 121,018 | 2027/2/17 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 2.0 | 7,200 | 7,854 | 92,922 | 2028/4/26 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.75 | 22,000 | 23,707 | 280,463 | 2029/9/6 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.375 | 2,700 | 2,825 | 33,422 | 2030/8/19 | |
| 小 計 | | | | | 1,256,993 | | |
| 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 | 400 | 406 | 6,891 | 2022/11/15 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 1.5 | 27,770 | 29,500 | 500,321 | 2023/11/15 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 1.75 | 29,300 | 32,763 | 555,664 | 2025/11/15 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.5 | 15,700 | 16,814 | 285,177 | 2027/11/15 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.5 | 26,300 | 28,540 | 484,051 | 2029/11/15 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 4.5 | 35,800 | 68,311 | 1,158,557 | 2039/11/15 | |
| 小 計 | | | | | 2,990,664 | | |
| ユーロ | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | | |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESobligation | — | 750 | 760 | 96,009 | 2022/10/7 |
| | | BUNDESobligation | — | 1,000 | 1,018 | 128,550 | 2023/4/14 |
| | | BUNDESobligation | — | 2,000 | 2,059 | 260,032 | 2024/10/18 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.75 | 400 | 416 | 52,521 | 2022/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 300 | 311 | 39,379 | 2022/9/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 390 | 409 | 51,715 | 2023/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 9,200 | 9,713 | 1,226,323 | 2023/5/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.0 | 2,580 | 2,775 | 350,369 | 2023/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25 | 23,900 | 29,149 | 3,680,171 | 2024/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.75 | 1,700 | 1,838 | 232,159 | 2024/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 10,800 | 11,656 | 1,471,571 | 2024/5/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0 | 8,100 | 8,639 | 1,090,731 | 2024/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5 | 2,700 | 2,846 | 359,353 | 2025/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0 | 9,100 | 9,866 | 1,245,667 | 2025/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5 | 20,800 | 22,181 | 2,800,392 | 2026/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | — | 1,000 | 1,042 | 131,659 | 2026/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.25 | 700 | 742 | 93,799 | 2027/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.5 | 20,200 | 30,082 | 3,797,959 | 2027/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5 | 200 | 216 | 27,335 | 2027/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.625 | 18,200 | 26,589 | 3,356,897 | 2028/1/4 |

| 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 | 0.5 | 600 | 652 | 82,332 | 2028/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 7,300 | 10,397 | 1,312,624 | 2028/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25 | 18,600 | 30,567 | 3,859,207 | 2030/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.5 | 6,400 | 10,437 | 1,317,775 | 2031/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 9,400 | 16,269 | 2,054,050 | 2034/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.0 | 13,200 | 22,780 | 2,875,992 | 2037/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.25 | 3,800 | 7,136 | 901,041 | 2039/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 5,300 | 10,729 | 1,354,588 | 2040/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25 | 1,130 | 2,018 | 254,779 | 2042/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 5,800 | 9,651 | 1,218,460 | 2044/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 11,600 | 19,802 | 2,500,062 | 2046/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.25 | 11,850 | 16,510 | 2,084,433 | 2048/8/15 |
| | | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN | — | 200 | 201 | 25,481 | 2022/3/11 |
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.15 | 2,600 | 2,670 | 337,139 | 2021/12/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 16,500 | 17,610 | 2,223,277 | 2022/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.2 | 10,200 | 10,418 | 1,315,346 | 2022/4/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.35 | 1,900 | 1,946 | 245,732 | 2022/4/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9 | 400 | 409 | 51,650 | 2022/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.5 | 8,200 | 9,042 | 1,141,673 | 2022/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.45 | 3,100 | 3,204 | 404,536 | 2022/9/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.5 | 31,800 | 35,373 | 4,465,847 | 2022/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.05 | 1,900 | 1,917 | 242,141 | 2023/1/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.95 | 100 | 103 | 13,003 | 2023/3/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 1,100 | 1,229 | 155,214 | 2023/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 500 | 568 | 71,747 | 2023/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 9.0 | 18,700 | 23,775 | 3,001,616 | 2023/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 14,700 | 16,969 | 2,142,422 | 2024/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.85 | 300 | 321 | 40,575 | 2024/5/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 5,800 | 6,649 | 839,451 | 2024/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.45 | 4,700 | 4,997 | 630,935 | 2024/11/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5 | 1,000 | 1,105 | 139,544 | 2024/12/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 16,800 | 20,440 | 2,580,620 | 2025/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.45 | 800 | 853 | 107,797 | 2025/5/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.5 | 3,000 | 3,211 | 405,446 | 2025/6/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5 | 7,000 | 7,868 | 993,335 | 2025/11/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.0 | 3,000 | 3,299 | 416,511 | 2025/12/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 11,900 | 14,667 | 1,851,827 | 2026/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.1 | 2,000 | 2,226 | 281,057 | 2026/7/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 7.25 | 18,100 | 25,676 | 3,241,678 | 2026/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.5 | 22,500 | 32,001 | 4,040,220 | 2027/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 5,800 | 7,729 | 975,869 | 2028/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.25 | 29,900 | 42,362 | 5,348,242 | 2029/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.0 | 16,000 | 24,619 | 3,108,174 | 2031/5/1 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.65 | 500 | 551 | 69,563 | 2032/3/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.75 | 10,900 | 17,177 | 2,168,635 | 2033/2/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.45 | 1,400 | 1,673 | 211,216 | 2033/9/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 17,900 | 27,338 | 3,451,507 | 2034/8/1 | | |

野村外国債券インデックス B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 | 3.35 | 8,000 | 10,588 | 1,336,836 | 2035/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0 | 2,700 | 3,866 | 488,201 | 2037/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.95 | 500 | 647 | 81,740 | 2038/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 5,000 | 8,220 | 1,037,775 | 2039/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.1 | 200 | 264 | 33,405 | 2040/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 10,200 | 16,921 | 2,136,377 | 2040/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 8,800 | 14,842 | 1,873,923 | 2044/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.25 | 5,500 | 7,705 | 972,819 | 2046/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.45 | 2,800 | 4,080 | 515,120 | 2048/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.85 | 7,000 | 10,968 | 1,384,747 | 2049/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.45 | 11,000 | 13,556 | 1,711,495 | 2050/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.8 | 2,200 | 2,899 | 366,031 | 2067/3/1 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF) | — | 500 | 504 | 63,670 | 2022/2/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | — | 4,200 | 4,265 | 538,521 | 2023/2/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | — | 2,600 | 2,642 | 333,600 | 2023/3/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.75 | 1,570 | 1,666 | 210,344 | 2023/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | — | 100 | 102 | 12,921 | 2024/3/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.25 | 10,100 | 11,147 | 1,407,430 | 2024/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | — | 1,800 | 1,851 | 233,779 | 2025/3/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.5 | 11,000 | 11,582 | 1,462,257 | 2025/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.5 | 1,800 | 1,911 | 241,279 | 2026/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.25 | 13,300 | 13,970 | 1,763,757 | 2026/11/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.0 | 7,700 | 8,486 | 1,071,462 | 2027/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.75 | 4,300 | 4,706 | 594,149 | 2028/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.75 | 11,600 | 12,743 | 1,608,902 | 2028/11/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.5 | 2,000 | 2,159 | 272,608 | 2029/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.5 | 8,500 | 10,845 | 1,369,247 | 2030/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.25 | 10,100 | 11,987 | 1,513,407 | 2034/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.25 | 100 | 120 | 15,171 | 2036/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.75 | 100 | 131 | 16,607 | 2039/6/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.0 | 10,400 | 15,069 | 1,902,501 | 2048/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.5 | 2,000 | 2,646 | 334,158 | 2050/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.75 | 500 | 552 | 69,761 | 2052/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.0 | 700 | 736 | 92,931 | 2022/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | — | 700 | 707 | 89,314 | 2022/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 2.25 | 24,800 | 26,202 | 3,308,011 | 2022/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8.5 | 10,900 | 13,345 | 1,684,927 | 2023/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.25 | 25,600 | 29,314 | 3,700,963 | 2023/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.75 | 3,000 | 3,295 | 416,008 | 2024/11/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 6.0 | 9,500 | 12,648 | 1,596,921 | 2025/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.0 | 6,000 | 6,497 | 820,258 | 2025/11/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.5 | 34,100 | 41,818 | 5,279,590 | 2026/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 2.75 | 3,000 | 3,695 | 466,601 | 2027/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5.5 | 27,000 | 40,745 | 5,144,165 | 2029/4/25 |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.5 | 13,500 | 16,072 | 2,029,147 | 2031/5/25 | | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5.75 | 20,100 | 34,680 | 4,378,461 | 2032/10/25 | | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.75 | 15,400 | 26,330 | 3,324,212 | 2035/4/25 | | |

野村外国債券インデックス B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 | |
| フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.0 | 300 | 514 | 65,002 | 2038/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.5 | 5,900 | 11,136 | 1,405,966 | 2041/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 3.25 | 28,550 | 49,082 | 6,196,640 | 2045/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.0 | 5,800 | 12,611 | 1,592,204 | 2055/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.0 | 6,400 | 14,770 | 1,864,783 | 2060/4/25 |
| オランダ | 国債証券 | NETHERLANDS GOVERNMENT | — | 600 | 604 | 76,351 | 2022/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.25 | 100 | 104 | 13,233 | 2022/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.75 | 200 | 219 | 27,657 | 2023/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 7.5 | 3,500 | 4,115 | 519,600 | 2023/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 1.75 | 400 | 426 | 53,815 | 2023/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | — | 100 | 102 | 12,915 | 2024/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.0 | 8,700 | 9,566 | 1,207,735 | 2024/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.25 | 1,500 | 1,566 | 197,830 | 2025/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5 | 1,900 | 2,027 | 255,958 | 2026/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.75 | 2,500 | 2,730 | 344,690 | 2027/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 5.5 | 12,300 | 17,756 | 2,241,730 | 2028/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.75 | 1,000 | 1,103 | 139,367 | 2028/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.25 | 2,400 | 2,564 | 323,767 | 2029/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5 | 9,500 | 12,939 | 1,633,548 | 2033/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0 | 3,700 | 6,327 | 798,790 | 2037/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5 | 500 | 569 | 71,959 | 2040/1/15 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.75 | 1,500 | 2,788 | 352,016 | 2042/1/15 | | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.75 | 6,900 | 12,242 | 1,545,652 | 2047/1/15 | | |
| スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.85 | 14,650 | 15,737 | 1,986,811 | 2022/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.4 | 4,650 | 4,715 | 595,281 | 2022/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.45 | 5,700 | 5,809 | 733,477 | 2022/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.4 | 15,100 | 17,048 | 2,152,404 | 2023/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.35 | 4,200 | 4,300 | 542,879 | 2023/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.4 | 5,300 | 6,066 | 765,936 | 2023/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.8 | 14,600 | 17,074 | 2,155,618 | 2024/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.8 | 6,900 | 7,924 | 1,000,530 | 2024/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.75 | 450 | 507 | 64,059 | 2024/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.6 | 900 | 982 | 123,978 | 2025/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.65 | 15,100 | 18,712 | 2,362,446 | 2025/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.15 | 5,000 | 5,636 | 711,642 | 2025/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.95 | 4,000 | 4,505 | 568,859 | 2026/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.9 | 22,400 | 30,389 | 3,836,642 | 2026/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.45 | 7,600 | 8,484 | 1,071,137 | 2027/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4 | 2,000 | 2,232 | 281,848 | 2028/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4 | 5,000 | 5,597 | 706,621 | 2028/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15 | 9,300 | 13,196 | 1,666,083 | 2028/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.95 | 2,000 | 2,367 | 298,946 | 2030/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.35 | 5,400 | 6,788 | 857,027 | 2033/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.85 | 1,000 | 1,206 | 152,304 | 2035/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.9 | 1,500 | 2,702 | 341,195 | 2040/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.7 | 5,700 | 10,168 | 1,283,755 | 2041/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15 | 10,000 | 19,639 | 2,479,520 | 2044/10/31 |

野村外国債券インデックス B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 | 2.9 | 3,200 | 4,766 | 601,737 | 2046/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.7 | 8,800 | 12,838 | 1,620,839 | 2048/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.45 | 3,000 | 5,400 | 681,870 | 2066/7/30 |
| | | SPANISH GOVERNMENT | 6.0 | 16,000 | 23,975 | 3,026,957 | 2029/1/31 |
| | | SPANISH GOVERNMENT | 5.75 | 27,800 | 45,658 | 5,764,413 | 2032/7/30 |
| | | SPANISH GOVERNMENT | 4.2 | 2,500 | 3,967 | 500,885 | 2037/1/31 |
| ベルギー | 国債証券 | BELGIUM KINGDOM | 4.0 | 800 | 849 | 107,260 | 2022/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 600 | 653 | 82,544 | 2022/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 2.25 | 9,100 | 9,794 | 1,236,551 | 2023/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.2 | 2,900 | 2,976 | 375,754 | 2023/10/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 2.6 | 4,000 | 4,473 | 564,741 | 2024/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.5 | 1,000 | 1,046 | 132,163 | 2024/10/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.8 | 1,700 | 1,815 | 229,159 | 2025/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.5 | 6,700 | 8,553 | 1,079,913 | 2026/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.0 | 3,300 | 3,599 | 454,477 | 2026/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.8 | 2,000 | 2,180 | 275,345 | 2027/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.8 | 1,000 | 1,099 | 138,855 | 2028/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.9 | 6,500 | 7,247 | 914,949 | 2029/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.0 | 4,300 | 4,892 | 617,652 | 2031/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.0 | 3,100 | 4,618 | 583,050 | 2032/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.25 | 100 | 118 | 14,955 | 2033/4/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.45 | 500 | 618 | 78,064 | 2037/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.9 | 100 | 132 | 16,702 | 2038/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 1,600 | 2,903 | 366,620 | 2041/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.75 | 4,000 | 7,303 | 922,069 | 2045/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.6 | 5,200 | 6,878 | 868,402 | 2047/6/22 |
| BELGIUM KINGDOM | 1.7 | 4,000 | 5,491 | 693,243 | 2050/6/22 | | |
| BELGIUM KINGDOM | 2.25 | 1,200 | 1,941 | 245,105 | 2057/6/22 | | |
| BELGIUM KINGDOM | 2.15 | 1,000 | 1,684 | 212,692 | 2066/6/22 | | |
| BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.5 | 11,500 | 16,659 | 2,103,206 | 2028/3/28 | | |
| BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.0 | 11,000 | 19,143 | 2,416,876 | 2035/3/28 | | |
| オーストリア | 国債証券 | REPUBLIC OF AUSTRIA | — | 100 | 101 | 12,789 | 2022/9/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.4 | 200 | 216 | 27,295 | 2022/11/22 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | — | 900 | 916 | 115,715 | 2023/7/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.75 | 150 | 160 | 20,288 | 2023/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | — | 1,300 | 1,332 | 168,236 | 2024/7/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.65 | 700 | 764 | 96,563 | 2024/10/21 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.2 | 1,300 | 1,420 | 179,388 | 2025/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.85 | 5,400 | 7,002 | 884,025 | 2026/3/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.75 | 2,000 | 2,163 | 273,168 | 2026/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 6.25 | 7,600 | 11,112 | 1,402,894 | 2027/7/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.5 | 9,600 | 10,376 | 1,310,050 | 2029/2/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.4 | 6,800 | 9,240 | 1,166,606 | 2034/5/23 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.15 | 400 | 683 | 86,261 | 2037/3/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.15 | 3,200 | 5,598 | 706,783 | 2044/6/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.5 | 7,100 | 9,744 | 1,230,274 | 2047/2/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.75 | 2,000 | 2,369 | 299,208 | 2051/3/20 |

野村外国債券インデックス B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 | 450 | 1,088 | 137,427 | 2062/1/26 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.1 | 800 | 1,756 | 221,724 | 2117/9/20 |
| フィンランド | 国債証券 | FINNISH GOVERNMENT | — | 500 | 505 | 63,762 | 2022/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.625 | 100 | 104 | 13,160 | 2022/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.5 | 100 | 105 | 13,299 | 2023/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | — | 400 | 408 | 51,537 | 2023/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 2.0 | 700 | 764 | 96,523 | 2024/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 4.0 | 3,600 | 4,386 | 553,785 | 2025/7/4 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.875 | 100 | 107 | 13,583 | 2025/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.5 | 2,000 | 2,125 | 268,406 | 2026/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 2.75 | 3,300 | 4,140 | 522,763 | 2028/7/4 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.5 | 2,400 | 2,605 | 328,921 | 2029/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.75 | 800 | 893 | 112,834 | 2031/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.125 | 200 | 236 | 29,830 | 2034/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.125 | 4,000 | 4,161 | 525,431 | 2036/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 2.625 | 400 | 634 | 80,091 | 2042/7/4 |
| FINNISH GOVERNMENT | 1.375 | 300 | 408 | 51,533 | 2047/4/15 | | |
| アイルランド | 国債証券 | IRISH GOVERNMENT | 5.4 | 4,630 | 5,834 | 736,663 | 2025/3/13 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 0.9 | 6,500 | 7,148 | 902,471 | 2028/5/15 |
| | | IRISH TSY 0.8% 2022 | 0.8 | 1,200 | 1,222 | 154,402 | 2022/3/15 |
| | | IRISH TSY 1% 2026 | 1.0 | 4,600 | 4,996 | 630,748 | 2026/5/15 |
| | | IRISH TSY 1.10% 2029 | 1.1 | 600 | 674 | 85,197 | 2029/5/15 |
| | | IRISH TSY 1.3% 2033 | 1.3 | 2,400 | 2,833 | 357,737 | 2033/5/15 |
| | | IRISH TSY 1.35% 2031 | 1.35 | 2,000 | 2,332 | 294,461 | 2031/3/18 |
| | | IRISH TSY 1.5% 2050 | 1.5 | 1,500 | 1,976 | 249,509 | 2050/5/15 |
| | | IRISH TSY 1.7% 2037 | 1.7 | 3,100 | 3,944 | 497,956 | 2037/5/15 |
| | | IRISH TSY 2% 2045 | 2.0 | 1,600 | 2,269 | 286,473 | 2045/2/18 |
| | | IRISH TSY 2.4% 2030 | 2.4 | 5,500 | 6,923 | 874,111 | 2030/5/15 |
| | | IRISH TSY 2022 | — | 8,200 | 8,308 | 1,048,900 | 2022/10/18 |
| | | IRISH TSY 3.4% 2024 | 3.4 | 6,100 | 6,920 | 873,690 | 2024/3/18 |
| | | REPUBLIC OF IRELAND | 3.9 | 4,450 | 4,920 | 621,271 | 2023/3/20 |
| 小 計 | | | | | | 239,637,582 | |
| ポーランド | | | | 千ズロチ | 千ズロチ | | |
| | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.25 | 38,300 | 39,490 | 1,115,987 | 2022/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5 | 33,100 | 35,665 | 1,007,895 | 2024/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.75 | 48,300 | 53,971 | 1,525,236 | 2028/4/25 |
| 小 計 | | | | | | 3,649,120 | |
| 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 | 1.75 | 400 | 407 | 31,823 | 2022/4/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.125 | 3,100 | 3,252 | 253,796 | 2022/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.75 | 300 | 309 | 24,137 | 2023/2/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 4,100 | 4,354 | 339,790 | 2023/7/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.0 | 1,450 | 1,525 | 119,026 | 2024/2/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.0 | 1,900 | 2,083 | 162,563 | 2024/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.375 | 1,100 | 1,193 | 93,128 | 2025/6/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.125 | 700 | 758 | 59,154 | 2026/6/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.5 | 3,900 | 4,566 | 356,355 | 2027/3/1 |

野村外国債券インデックス B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 | |
| 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 | 2.625 | 500 | 566 | 44,164 | 2028/5/1 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.875 | 300 | 349 | 27,271 | 2029/7/1 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.875 | 2,850 | 3,376 | 263,506 | 2030/9/1 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.375 | 1,200 | 1,534 | 119,713 | 2033/9/1 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.25 | 1,920 | 2,232 | 174,177 | 2036/8/1 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 2,750 | 3,555 | 277,455 | 2042/4/1 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 1,000 | 1,327 | 103,584 | 2046/3/1 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.875 | 1,000 | 1,186 | 92,574 | 2050/3/1 | |
| 小 計 | | | | | | 2,542,225 | |
| マレーシア | | | | 千リンギ | 千リンギ | | |
| 国債証券 | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.882 | 1,100 | 1,129 | 28,780 | 2022/3/10 | |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.059 | 400 | 428 | 10,926 | 2024/9/30 | |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.642 | 2,600 | 2,938 | 74,862 | 2033/11/7 | |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.828 | 2,700 | 2,861 | 72,899 | 2034/7/5 | |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.762 | 400 | 462 | 11,781 | 2037/4/7 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.62 | 500 | 509 | 12,979 | 2021/11/30 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.418 | 5,000 | 5,140 | 130,980 | 2022/8/15 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.795 | 500 | 517 | 13,197 | 2022/9/30 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.48 | 13,500 | 13,974 | 356,072 | 2023/3/15 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.757 | 3,500 | 3,649 | 92,991 | 2023/4/20 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.8 | 2,200 | 2,307 | 58,792 | 2023/8/17 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.181 | 5,800 | 6,222 | 158,559 | 2024/7/15 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.955 | 600 | 648 | 16,525 | 2025/9/15 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.392 | 15,600 | 17,234 | 439,124 | 2026/4/15 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.892 | 4,600 | 4,997 | 127,326 | 2027/3/15 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.502 | 7,000 | 7,417 | 188,991 | 2027/5/31 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.733 | 2,200 | 2,367 | 60,328 | 2028/6/15 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.885 | 280 | 303 | 7,727 | 2029/8/15 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.498 | 12,700 | 14,395 | 366,809 | 2030/4/15 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.232 | 4,400 | 4,925 | 125,504 | 2031/6/30 | |
| MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.844 | 800 | 843 | 21,487 | 2033/4/15 | | |
| MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.254 | 2,300 | 2,512 | 64,006 | 2035/5/31 | | |
| MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.935 | 9,700 | 11,223 | 285,965 | 2043/9/30 | | |
| MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.736 | 4,100 | 4,555 | 116,085 | 2046/3/15 | | |
| MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.921 | 300 | 344 | 8,769 | 2048/7/6 | | |
| 小 計 | | | | | | 2,851,476 | |
| オーストラリア | | | | 千豪ドル | 千豪ドル | | |
| 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.0 | 7,100 | 7,243 | 560,170 | 2021/12/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.75 | 13,340 | 14,549 | 1,125,146 | 2022/7/15 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.25 | 80 | 83 | 6,445 | 2022/11/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.5 | 6,700 | 7,550 | 583,917 | 2023/4/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 7,200 | 7,836 | 605,994 | 2024/4/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 15,200 | 17,179 | 1,328,478 | 2025/4/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.25 | 12,780 | 15,412 | 1,191,863 | 2026/4/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.75 | 12,100 | 15,316 | 1,184,418 | 2027/4/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 3,200 | 3,669 | 283,780 | 2027/11/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.25 | 14,000 | 15,534 | 1,201,275 | 2028/5/21 | |

野村外国債券インデックス B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 | | |
| オーストラリア | | % | 千豪ドル | 千豪ドル | 千円 | |
| 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 2,100 | 2,426 | 187,627 | 2028/11/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 10,100 | 12,104 | 936,075 | 2029/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 13,300 | 15,349 | 1,186,979 | 2029/11/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.5 | 22,200 | 25,355 | 1,960,704 | 2030/5/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.0 | 5,700 | 5,705 | 441,217 | 2030/12/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.5 | 7,700 | 10,675 | 825,517 | 2033/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,300 | 1,537 | 118,925 | 2035/6/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.75 | 10,250 | 13,587 | 1,050,729 | 2037/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 700 | 867 | 67,052 | 2039/6/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 400 | 466 | 36,074 | 2041/5/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.0 | 5,300 | 6,359 | 491,777 | 2047/3/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.75 | 3,000 | 2,759 | 213,384 | 2051/6/21 |
| 小 計 | | | | | 15,587,555 | |
| イスラエル | | | 千新シェケル | 千新シェケル | | |
| 国債証券 | ISRAEL FIXED BOND | 5.5 | 2,600 | 2,761 | 88,023 | 2022/1/31 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 0.75 | 9,800 | 9,903 | 315,636 | 2022/7/31 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 1.25 | 5,000 | 5,110 | 162,857 | 2022/11/30 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 4.25 | 5,000 | 5,469 | 174,316 | 2023/3/31 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 1.5 | 5,000 | 5,187 | 165,327 | 2023/11/30 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 3.75 | 5,000 | 5,577 | 177,748 | 2024/3/31 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 1.75 | 5,000 | 5,327 | 169,795 | 2025/8/31 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 6.25 | 6,500 | 8,699 | 277,254 | 2026/10/30 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 2.0 | 5,000 | 5,466 | 174,208 | 2027/3/31 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 2.25 | 5,000 | 5,603 | 178,568 | 2028/9/28 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 1.0 | 2,000 | 2,030 | 64,700 | 2030/3/31 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 5.5 | 6,000 | 10,177 | 324,344 | 2042/1/31 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 3.75 | 5,000 | 6,933 | 220,972 | 2047/3/31 |
| 小 計 | | | | | 2,493,756 | |
| 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 | 92,900 | 95,547 | 502,581 | 2021/12/9 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.5 | 44,400 | 45,764 | 240,718 | 2022/6/9 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.75 | 300 | 314 | 1,655 | 2023/3/9 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0 | 87,300 | 97,280 | 511,693 | 2024/9/5 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 40,000 | 47,677 | 250,784 | 2024/12/5 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.75 | 51,300 | 53,118 | 279,401 | 2026/3/5 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5 | 112,300 | 126,289 | 664,281 | 2027/6/3 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 45,300 | 54,552 | 286,943 | 2029/5/31 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 68,100 | 78,812 | 414,551 | 2031/5/29 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 10,000 | 11,543 | 60,716 | 2034/11/23 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 56,300 | 76,930 | 404,651 | 2036/11/20 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 25,800 | 30,981 | 162,964 | 2038/11/18 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 61,200 | 68,279 | 359,150 | 2042/11/13 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0 | 43,000 | 48,883 | 257,128 | 2047/11/7 |
| | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 8.0 | 97,700 | 107,059 | 563,133 | 2023/12/7 |
| 小 計 | | | | | 4,960,357 | |
| 合 計 | | | | | 576,175,833 | |

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

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

外国債券マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日2020年5月11日）

作成対象期間（2019年5月11日～2020年5月11日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|------|--------|------|-------|--------|---------|
| | 円 | 騰落率 | 円 | 騰落率 | | | |
| 15期(2016年5月10日) | 21,725 | △6.6 | 220.26 | △6.8 | 99.0 | — | 632,898 |
| 16期(2017年5月10日) | 22,009 | 1.3 | 223.71 | 1.6 | 99.0 | — | 664,754 |
| 17期(2018年5月10日) | 22,325 | 1.4 | 226.02 | 1.0 | 99.0 | — | 616,573 |
| 18期(2019年5月10日) | 22,598 | 1.2 | 228.62 | 1.1 | 99.0 | — | 605,827 |
| 19期(2020年5月11日) | 23,625 | 4.5 | 238.73 | 4.4 | 98.9 | — | 564,663 |

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

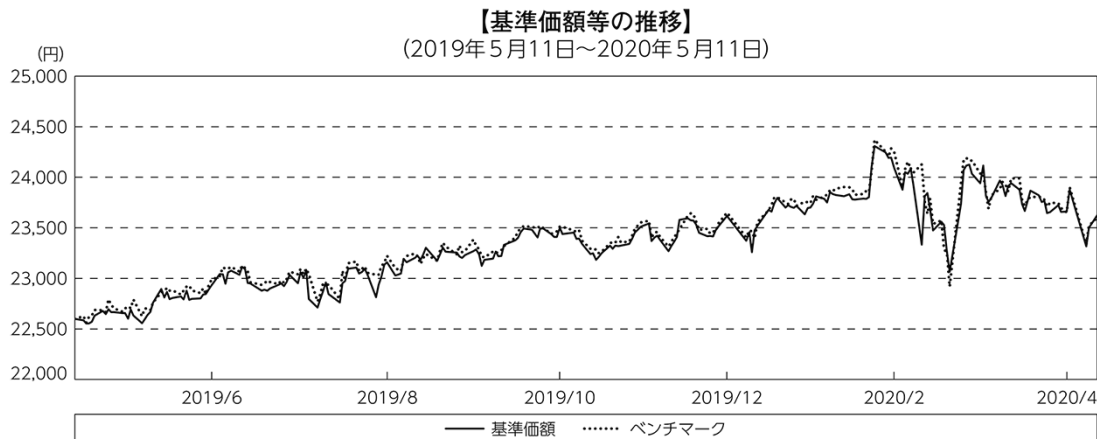
| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|--------------------|--------|-----|--------|-----|-------|--------|
| | 円 | 騰落率 | 円 | 騰落率 | | |
| (期首) 2019年5月10日 | 22,598 | — | 228.62 | — | 99.0 | — |
| 5月末 | 22,633 | 0.2 | 230.56 | 0.9 | 98.8 | — |
| 6月末 | 22,930 | 1.5 | 232.54 | 1.7 | 99.1 | — |
| 7月末 | 23,004 | 1.8 | 233.12 | 2.0 | 99.0 | — |
| 8月末 | 23,160 | 2.5 | 234.94 | 2.8 | 99.2 | — |
| 9月末 | 23,270 | 3.0 | 236.55 | 3.5 | 99.1 | — |
| 10月末 | 23,500 | 4.0 | 237.86 | 4.0 | 99.0 | — |
| 11月末 | 23,510 | 4.0 | 238.28 | 4.2 | 99.2 | — |
| 12月末 | 23,618 | 4.5 | 239.25 | 4.7 | 99.0 | — |
| 2020年1月末 | 23,811 | 5.4 | 240.53 | 5.2 | 98.9 | — |
| 2月末 | 24,091 | 6.6 | 245.31 | 7.3 | 98.8 | — |
| 3月末 | 24,116 | 6.7 | 243.18 | 6.4 | 98.5 | — |
| 4月末 | 23,661 | 4.7 | 239.28 | 4.7 | 98.8 | — |
| (期末) 2020年5月11日 | 23,625 | 4.5 | 238.73 | 4.4 | 98.9 | — |

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



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

○基準価額の主な変動要因

主要通貨が対円で下落（円高）したことはマイナスに影響しましたが、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。

為替市場は、新型コロナウイルスの感染拡大による世界景気の減速懸念を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことや内外長期金利差縮小などを背景に、主要通貨は対円で下落（円高）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

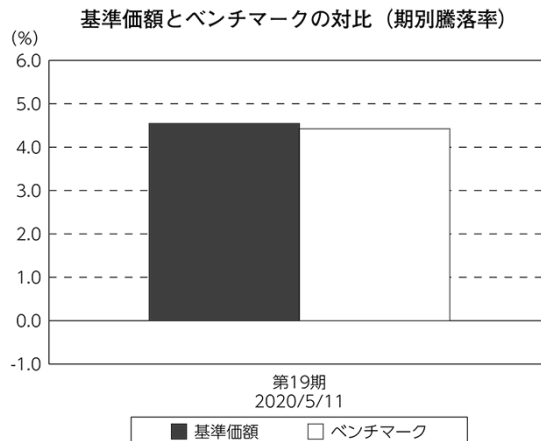
当運用期間の基準価額の騰落率は+4.5%となり、ベンチマークの+4.4%を0.1ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです

（マイナス要因）

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

（その他の要因）

ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なること



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

◎今後の運用方針

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

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5月11日～2020年5月11日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-----|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 | % | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保 管 費 用) | (2) | (0.010) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (そ の 他) | (1) | (0.003) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 3 | 0.014 | |
| 期中の平均基準価額は、23,442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5月11日～2020年5月11日)

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|---|--------|------|-----------------------|-----------------------|
| 外 | アメリカ | 国債証券 | 千米ドル 959,762 | 千米ドル 1,365,556 |
| | カナダ | 国債証券 | 千カナダドル 63,239 | 千カナダドル 71,933 |
| | イギリス | 国債証券 | 千英ポンド 82,647 | 千英ポンド 109,068 |
| | スウェーデン | 国債証券 | 千スウェーデンクローナ 11,477 | 千スウェーデンクローナ 46,143 |
| | ノルウェー | 国債証券 | 千ノルウェークローネ 16,323 | 千ノルウェークローネ 6,545 |
| | デンマーク | 国債証券 | 千デンマーククローネ 30,988 | 千デンマーククローネ 37,425 |
| 国 | ユーロ | | 千ユーロ | 千ユーロ |
| | ドイツ | 国債証券 | 119,181 | 104,445 |
| | イタリア | 国債証券 | 93,145 | 79,272 |
| | フランス | 国債証券 | 104,604 | 121,403 |
| | オランダ | 国債証券 | 25,180 | 33,002 |
| | スペイン | 国債証券 | 55,298 | 62,199 |

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|---------|-----------|-----------|
| 外国 | ユーロ | | 千ユーロ |
| | ベルギー | 国債証券 | 27,745 |
| | オーストリア | 国債証券 | 29,649 |
| | フィンランド | 国債証券 | 8,989 |
| | アイルランド | 国債証券 | 14,124 |
| | ポーランド | 国債証券 | 千ズロチ |
| | | | 202,225 |
| | シンガポール | 国債証券 | 千シンガポールドル |
| | | | 7,842 |
| | マレーシア | 国債証券 | 千リンギ |
| | | | 10,594 |
| | オーストラリア | 国債証券 | 千豪ドル |
| | | | 28,634 |
| 国内 | イスラエル | 国債証券 | 千新シェケル |
| | | | 73,083 |
| | メキシコ | 国債証券 | 千メキシコペソ |
| | | | 195,362 |
| | 南アフリカ | 国債証券 | 千ランド |
| | | 66,322 | |
| | | 千ユーロ | 40,250 |
| | | 千ズロチ | 34,208 |
| | | 千リンギ | 17,756 |
| | | 千豪ドル | 12,595 |
| | | 千シンガポールドル | 202,670 |
| | | 千リンギ | 6,446 |
| | | 千豪ドル | 18,952 |
| | | 千新シェケル | 29,248 |
| | | 千メキシコペソ | — |
| | | 千ランド | 193,677 |
| | | | 465,650 |

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月11日～2020年5月11日)

利害関係人との取引状況

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|---------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 為替直物取引 | 百万円 85,089 | 百万円 60 | % 0.1 | 百万円 153,760 | 百万円 598 | % 0.4 |

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

(2020年5月11日現在)

○組入資産の明細

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|---------|------------------------|------------------------|-------------------|-----------|-----------------|-----------|-----------|----------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| アメリカ | 千米ドル 2,126,950 | 千米ドル 2,437,268 | 千円 260,665,884 | % 46.2 | % — | % 21.2 | % 15.1 | % 9.8 |
| カナダ | 千カナダドル 116,290 | 千カナダドル 142,546 | 10,939,051 | 1.9 | — | 1.0 | 0.6 | 0.4 |
| イギリス | 千英ポンド 194,290 | 千英ポンド 286,143 | 38,014,149 | 6.7 | — | 5.6 | 1.1 | 0.0 |
| スウェーデン | 千スウェーデンクローナ 129,800 | 千スウェーデンクローナ 147,275 | 1,608,244 | 0.3 | — | 0.2 | 0.1 | — |
| ノルウェー | 千ノルウェークローネ 121,700 | 千ノルウェークローネ 133,149 | 1,390,080 | 0.2 | — | 0.1 | 0.1 | 0.0 |
| デンマーク | 千デンマーククローネ 140,570 | 千デンマーククローネ 183,151 | 2,848,012 | 0.5 | — | 0.4 | 0.1 | 0.0 |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ドイツ | 218,070 | 304,169 | 35,283,643 | 6.2 | — | 4.7 | 1.4 | 0.2 |
| イタリア | 386,250 | 460,218 | 53,385,370 | 9.5 | — | 5.3 | 2.5 | 1.6 |
| フランス | 354,370 | 463,352 | 53,748,894 | 9.5 | — | 7.3 | 1.8 | 0.4 |
| オランダ | 54,050 | 71,738 | 8,321,625 | 1.5 | — | 1.2 | 0.2 | 0.0 |
| スペイン | 256,750 | 323,955 | 37,578,841 | 6.7 | — | 4.3 | 1.2 | 1.2 |
| ベルギー | 85,400 | 112,907 | 13,097,321 | 2.3 | — | 1.9 | 0.4 | 0.0 |
| オーストリア | 49,900 | 63,919 | 7,414,659 | 1.3 | — | 1.2 | 0.1 | 0.1 |
| フィンランド | 16,900 | 19,298 | 2,238,592 | 0.4 | — | 0.4 | 0.0 | 0.0 |
| アイルランド | 41,580 | 46,972 | 5,448,814 | 1.0 | — | 0.5 | 0.4 | 0.0 |
| ポーランド | 千ズロチ 121,600 | 千ズロチ 129,394 | 3,299,550 | 0.6 | — | 0.3 | 0.0 | 0.2 |
| シンガポール | 千シンガポールドル 30,330 | 千シンガポールドル 34,287 | 2,594,561 | 0.5 | — | 0.3 | 0.1 | 0.1 |
| マレーシア | 千リンギ 94,780 | 千リンギ 103,313 | 2,549,773 | 0.5 | — | 0.3 | 0.1 | 0.0 |
| オーストラリア | 千豪ドル 138,300 | 千豪ドル 163,458 | 11,422,475 | 2.0 | — | 1.4 | 0.4 | 0.2 |
| イスラエル | 千新シェケル 61,500 | 千新シェケル 72,402 | 2,203,927 | 0.4 | — | 0.2 | 0.1 | 0.0 |
| メキシコ | 千メキシコペソ 870,100 | 千メキシコペソ 961,590 | 4,356,003 | 0.8 | — | 0.4 | 0.2 | 0.1 |
| 合 計 | — | — | 558,409,476 | 98.9 | — | 58.1 | 26.3 | 14.5 |

* 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、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 柄 | 当期末 | | | | 償還年月日 |
|------|------------------|-------|--------|--------|------------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 国債証券 | | | | | |
| | US TREASURY BOND | 8.0 | 36,200 | 40,525 | 4,334,214 | 2021/11/15 |
| | US TREASURY BOND | 6.25 | 38,800 | 46,438 | 4,966,624 | 2023/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 2.375 | 45,100 | 49,070 | 5,248,133 | 2024/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 6.0 | 72,200 | 95,270 | 10,189,142 | 2026/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 6.125 | 10,800 | 15,267 | 1,632,875 | 2027/11/15 |
| | US TREASURY BOND | 5.5 | 46,200 | 64,542 | 6,902,856 | 2028/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 5.25 | 49,300 | 68,376 | 7,312,897 | 2028/11/15 |
| | US TREASURY BOND | 5.25 | 27,500 | 38,424 | 4,109,532 | 2029/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 4.375 | 100 | 155 | 16,639 | 2038/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 2.875 | 17,500 | 22,847 | 2,443,494 | 2043/5/15 |
| | US TREASURY BOND | 3.75 | 2,000 | 2,978 | 318,577 | 2043/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 34,400 | 35,438 | 3,790,170 | 2021/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 1,000 | 1,025 | 109,644 | 2021/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 6,300 | 6,423 | 687,023 | 2021/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 900 | 924 | 98,898 | 2021/6/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 34,000 | 34,770 | 3,718,684 | 2021/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.125 | 1,600 | 1,618 | 173,065 | 2021/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 28,300 | 28,785 | 3,078,587 | 2021/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 3,500 | 3,602 | 385,335 | 2021/7/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 11,400 | 11,694 | 1,250,758 | 2021/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.125 | 4,300 | 4,352 | 465,453 | 2021/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 26,100 | 26,741 | 2,859,980 | 2021/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 12,200 | 12,495 | 1,336,441 | 2021/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 17,900 | 18,389 | 1,966,751 | 2021/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.125 | 9,650 | 9,779 | 1,045,935 | 2021/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 30,400 | 31,212 | 3,338,149 | 2021/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 1,900 | 1,931 | 206,554 | 2021/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 7,500 | 7,709 | 824,496 | 2021/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 1,000 | 1,026 | 109,803 | 2021/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 3,700 | 3,791 | 405,484 | 2021/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 12,400 | 12,799 | 1,368,866 | 2021/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 6,700 | 6,899 | 737,949 | 2021/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 80,000 | 83,134 | 8,891,220 | 2022/1/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 6,400 | 6,546 | 700,148 | 2022/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 14,000 | 14,411 | 1,541,283 | 2022/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 2,300 | 2,347 | 251,068 | 2022/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 32,800 | 33,864 | 3,621,831 | 2022/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 6,800 | 6,994 | 748,055 | 2022/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 3,500 | 3,608 | 385,876 | 2022/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 3,900 | 4,017 | 429,618 | 2022/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 500 | 516 | 55,212 | 2022/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 1,300 | 1,352 | 144,601 | 2022/4/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 32,800 | 33,830 | 3,618,131 | 2022/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 25,300 | 26,149 | 2,796,734 | 2022/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 8,800 | 9,080 | 971,196 | 2022/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 200 | 207 | 22,141 | 2022/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 900 | 929 | 99,383 | 2022/5/31 |

| 銘柄 | 当 | 期 末 | | | | |
|------|-----------------|-------|--------|--------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | | | | | | |
| 国債証券 | US TREASURY N/B | 2.125 | 17,600 | 18,338 | 1,961,289 | 2022/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 100 | 103 | 11,056 | 2022/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 100 | 104 | 11,129 | 2022/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 1,000 | 1,037 | 111,002 | 2022/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 900 | 929 | 99,356 | 2022/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 19,100 | 19,850 | 2,123,018 | 2022/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 900 | 933 | 99,849 | 2022/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 1,500 | 1,567 | 167,606 | 2022/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 7,600 | 7,874 | 842,125 | 2022/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 10,200 | 10,718 | 1,146,371 | 2022/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 47,900 | 49,917 | 5,338,626 | 2023/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 400 | 419 | 44,905 | 2023/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 20,000 | 20,731 | 2,217,207 | 2023/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 14,300 | 15,270 | 1,633,215 | 2023/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 400 | 415 | 44,390 | 2023/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 15,000 | 15,628 | 1,671,427 | 2023/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 34,800 | 36,406 | 3,893,704 | 2023/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 9,200 | 9,594 | 1,026,141 | 2023/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 4,800 | 4,957 | 530,204 | 2023/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 41,100 | 44,429 | 4,751,760 | 2023/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 6,500 | 6,979 | 746,444 | 2023/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 10,900 | 11,307 | 1,209,288 | 2023/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 35,200 | 36,542 | 3,908,166 | 2023/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 11,800 | 12,361 | 1,322,054 | 2023/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 42,600 | 46,334 | 4,955,437 | 2023/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 9,200 | 9,811 | 1,049,356 | 2023/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 30,000 | 32,793 | 3,507,291 | 2023/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 43,000 | 46,114 | 4,931,906 | 2023/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 1,300 | 1,408 | 150,592 | 2024/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 800 | 874 | 93,541 | 2024/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 1,700 | 1,822 | 194,882 | 2024/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 20,100 | 21,876 | 2,339,640 | 2024/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 17,700 | 18,950 | 2,026,709 | 2024/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 3,800 | 4,090 | 437,525 | 2024/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 42,700 | 46,095 | 4,929,965 | 2024/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 3,600 | 3,909 | 418,167 | 2024/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 34,200 | 37,171 | 3,975,451 | 2024/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 2,300 | 2,488 | 266,144 | 2024/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 16,900 | 18,238 | 1,950,639 | 2025/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 3,400 | 3,792 | 405,561 | 2025/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 32,700 | 36,330 | 3,885,515 | 2025/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 30,000 | 33,742 | 3,608,810 | 2025/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 6,500 | 7,074 | 756,600 | 2025/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 4,100 | 4,599 | 491,902 | 2025/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 27,000 | 29,286 | 3,132,197 | 2025/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 19,200 | 21,878 | 2,339,958 | 2025/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 50,300 | 55,349 | 5,919,644 | 2025/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 2,000 | 2,136 | 228,488 | 2026/2/15 |

| 銘柄 | 当 | 期 | 末 | | | | |
|------|-----------------|-------|--------|--------|-----------|------------|-------|
| | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| 国債証券 | US TREASURY N/B | 2.375 | 8,600 | 9,577 | 1,024,321 | 2026/4/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 1,800 | 1,925 | 205,955 | 2026/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 21,100 | 22,435 | 2,399,448 | 2026/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 12,000 | 12,666 | 1,354,688 | 2026/8/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 5,600 | 6,003 | 642,060 | 2026/10/31 | |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 13,000 | 14,252 | 1,524,279 | 2026/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 30,000 | 32,177 | 3,441,366 | 2026/11/30 | |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 11,300 | 12,605 | 1,348,177 | 2027/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 38,000 | 42,856 | 4,583,542 | 2027/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 8,400 | 9,429 | 1,008,431 | 2027/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 500 | 582 | 62,344 | 2028/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 1,800 | 2,122 | 227,041 | 2028/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 1,200 | 1,449 | 155,040 | 2028/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 2,000 | 2,154 | 230,427 | 2030/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 6.25 | 3,900 | 6,019 | 643,775 | 2030/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 5.375 | 36,700 | 54,654 | 5,845,280 | 2031/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 2,200 | 3,372 | 360,637 | 2036/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 5.0 | 200 | 328 | 35,122 | 2037/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 100 | 157 | 16,889 | 2038/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 3.5 | 100 | 142 | 15,192 | 2039/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 100 | 155 | 16,578 | 2039/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 100 | 159 | 17,095 | 2039/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 100 | 157 | 16,861 | 2039/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.625 | 100 | 162 | 17,378 | 2040/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 100 | 158 | 16,929 | 2040/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 3.875 | 200 | 298 | 31,884 | 2040/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 100 | 156 | 16,713 | 2040/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.75 | 100 | 165 | 17,728 | 2041/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 100 | 159 | 17,009 | 2041/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 3.75 | 100 | 147 | 15,750 | 2041/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 300 | 405 | 43,397 | 2041/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 100 | 135 | 14,513 | 2042/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 100 | 133 | 14,233 | 2042/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 200 | 255 | 27,364 | 2042/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 800 | 1,023 | 109,470 | 2042/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 2,600 | 3,524 | 376,893 | 2043/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 100 | 146 | 15,620 | 2043/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 7,400 | 10,846 | 1,160,063 | 2044/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 3.375 | 15,200 | 21,524 | 2,301,994 | 2044/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 23,000 | 31,395 | 3,357,695 | 2044/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 36,900 | 49,474 | 5,291,332 | 2044/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 39,400 | 48,671 | 5,205,396 | 2045/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 21,900 | 29,455 | 3,150,265 | 2045/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 17,500 | 23,114 | 2,472,080 | 2045/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 3,700 | 5,000 | 534,756 | 2045/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 51,500 | 63,962 | 6,840,799 | 2046/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 28,200 | 35,056 | 3,749,252 | 2046/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 31,500 | 37,462 | 4,006,651 | 2046/8/15 | |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|------|---------------------|-------|--------|--------|-------------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 国債証券 | US TREASURY N/B | 2.875 | 14,200 | 18,935 | 2,025,196 | 2046/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 1,700 | 2,323 | 248,482 | 2047/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 11,400 | 14,929 | 1,596,714 | 2047/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 9,300 | 12,197 | 1,304,525 | 2047/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 9,500 | 13,033 | 1,393,978 | 2048/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 6,100 | 8,570 | 916,614 | 2048/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 10,500 | 14,465 | 1,547,117 | 2048/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 3,400 | 4,705 | 503,286 | 2049/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 100 | 135 | 14,509 | 2049/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 3,000 | 3,621 | 387,326 | 2049/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 1,000 | 1,239 | 132,584 | 2049/11/15 |
| 小計 | | | | | 260,665,884 | |
| カナダ | | | 千カナダドル | 千カナダドル | | |
| 国債証券 | CANADA GOVERNMENT | 2.75 | 5,500 | 5,784 | 443,899 | 2022/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.25 | 11,750 | 12,129 | 930,819 | 2021/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 12,200 | 12,389 | 950,739 | 2021/8/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.75 | 1,000 | 1,006 | 77,253 | 2021/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.5 | 300 | 301 | 23,133 | 2022/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0 | 6,700 | 6,816 | 523,109 | 2022/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.75 | 300 | 312 | 24,007 | 2023/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 4,460 | 4,632 | 355,495 | 2023/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0 | 1,100 | 1,163 | 89,260 | 2023/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25 | 500 | 537 | 41,212 | 2024/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.5 | 6,800 | 7,401 | 568,019 | 2024/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 17,000 | 17,725 | 1,360,285 | 2025/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25 | 3,700 | 4,050 | 310,863 | 2025/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 300 | 320 | 24,564 | 2026/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 8.0 | 7,250 | 11,063 | 849,029 | 2027/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0 | 200 | 207 | 15,929 | 2027/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0 | 100 | 112 | 8,595 | 2028/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75 | 10,080 | 14,776 | 1,133,962 | 2029/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75 | 4,200 | 6,806 | 522,332 | 2033/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.0 | 3,800 | 6,234 | 478,409 | 2037/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4.0 | 7,100 | 10,979 | 842,534 | 2041/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.5 | 9,950 | 15,097 | 1,158,584 | 2045/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,300 | 1,804 | 138,463 | 2048/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0 | 600 | 737 | 56,591 | 2051/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75 | 100 | 155 | 11,953 | 2064/12/1 |
| 小計 | | | | | 10,939,051 | |
| イギリス | | | 千英ポンド | 千英ポンド | | |
| 国債証券 | UK TREASURY | 8.0 | 40 | 43 | 5,766 | 2021/6/7 |
| | UK TREASURY | 3.75 | 470 | 493 | 65,506 | 2021/9/7 |
| | UK TREASURY | 4.0 | 350 | 375 | 49,900 | 2022/3/7 |
| | UK TREASURY | 0.5 | 300 | 303 | 40,298 | 2022/7/22 |
| | UK TREASURY | 1.75 | 400 | 416 | 55,307 | 2022/9/7 |
| | UK TREASURY | 0.125 | 6,000 | 6,008 | 798,215 | 2023/1/31 |
| | UK TREASURY | 0.75 | 14,000 | 14,327 | 1,903,359 | 2023/7/22 |
| | UK TREASURY | 2.25 | 4,800 | 5,157 | 685,128 | 2023/9/7 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | | |
|--------|------|----------------------------|-------|-------------|-------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| イギリス | | % | 千英ポンド | 千英ポンド | 千円 | | |
| | 国債証券 | UK TREASURY | 1.0 | 1,600 | 1,660 | 220,650 | 2024/4/22 |
| | | UK TREASURY | 2.75 | 7,450 | 8,321 | 1,105,550 | 2024/9/7 |
| | | UK TREASURY | 5.0 | 9,950 | 12,313 | 1,635,891 | 2025/3/7 |
| | | UK TREASURY | 0.625 | 200 | 205 | 27,309 | 2025/6/7 |
| | | UK TREASURY | 2.0 | 200 | 221 | 29,402 | 2025/9/7 |
| | | UK TREASURY | 1.5 | 160 | 174 | 23,164 | 2026/7/22 |
| | | UK TREASURY | 1.25 | 400 | 433 | 57,545 | 2027/7/22 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 9,630 | 12,609 | 1,675,108 | 2027/12/7 |
| | | UK TREASURY | 1.625 | 200 | 225 | 29,909 | 2028/10/22 |
| | | UK TREASURY | 6.0 | 6,900 | 10,336 | 1,373,255 | 2028/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.75 | 6,000 | 8,830 | 1,173,083 | 2030/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 5,550 | 8,109 | 1,077,379 | 2032/6/7 |
| | | UK TREASURY | 4.5 | 15,700 | 24,629 | 3,271,967 | 2034/9/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 2,600 | 4,105 | 545,436 | 2036/3/7 |
| | | UK TREASURY | 4.75 | 100 | 175 | 23,336 | 2038/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 600 | 1,012 | 134,470 | 2039/9/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 500 | 861 | 114,504 | 2040/12/7 |
| | | UK TREASURY | 1.25 | 400 | 455 | 60,448 | 2041/10/22 |
| | | UK TREASURY | 4.5 | 1,200 | 2,205 | 293,053 | 2042/12/7 |
| | | UK TREASURY | 3.5 | 18,440 | 30,879 | 4,102,382 | 2045/1/22 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 6,300 | 12,030 | 1,598,188 | 2046/12/7 |
| | | UK TREASURY | 1.5 | 9,100 | 11,285 | 1,499,321 | 2047/7/22 |
| | | UK TREASURY | 1.75 | 16,100 | 21,221 | 2,819,225 | 2049/1/22 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 5,350 | 10,756 | 1,429,048 | 2049/12/7 |
| | | UK TREASURY | 3.75 | 6,750 | 13,267 | 1,762,614 | 2052/7/22 |
| | | UK TREASURY | 1.625 | 1,000 | 1,357 | 180,350 | 2054/10/22 |
| | | UK TREASURY | 1.75 | 1,100 | 1,585 | 210,589 | 2057/7/22 |
| | | UK TREASURY | 2.5 | 100 | 185 | 24,617 | 2065/7/22 |
| | | UK TREASURY | 3.5 | 650 | 1,529 | 203,176 | 2068/7/22 |
| | | UK TSY 3 1/4% 2044 | 3.25 | 26,900 | 42,852 | 5,692,912 | 2044/1/22 |
| | | UNITED KINGDOM(GOVERNMENT) | 4.25 | 6,800 | 15,180 | 2,016,768 | 2055/12/7 |
| 小 | 計 | | | | | 38,014,149 | |
| 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 | 36,050 | 38,914 | 424,942 | 2022/6/1 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 1.5 | 7,900 | 8,416 | 91,908 | 2023/11/13 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 2.5 | 32,250 | 36,826 | 402,142 | 2025/5/12 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 1.0 | 12,000 | 12,988 | 141,833 | 2026/11/12 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 0.75 | 16,800 | 18,063 | 197,252 | 2028/5/12 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 0.75 | 14,300 | 15,446 | 168,671 | 2029/11/12 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 3.5 | 10,500 | 16,620 | 181,491 | 2039/3/30 |
| 小 | 計 | | | | | 1,608,244 | |
| 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 | 23,600 | 24,511 | 255,901 | 2021/5/25 |
| | | NORWEGIAN GOVERNMENT | 2.0 | 13,300 | 14,141 | 147,633 | 2023/5/24 |
| | | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.0 | 38,900 | 43,412 | 453,225 | 2024/3/14 |
| | | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.75 | 4,700 | 5,087 | 53,108 | 2025/3/13 |
| | | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.5 | 4,700 | 5,076 | 53,003 | 2026/2/19 |
| | | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.75 | 9,600 | 10,592 | 110,587 | 2027/2/17 |

| 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 | 国債証券 | NORWEGIAN GOVERNMENT | 2.0 | 7,200 | 8,159 | 85,187 | 2028/4/26 |
| | | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.75 | 17,000 | 19,210 | 200,552 | 2029/9/6 |
| | | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.375 | 2,700 | 2,957 | 30,881 | 2030/8/19 |
| | | 小 計 | | | | 1,390,080 | |
| デンマーク | 国債証券 | KINGDOM OF DENMARK | 3.0 | 14,400 | 15,185 | 236,139 | 2021/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 0.25 | 400 | 408 | 6,350 | 2022/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 1.5 | 18,570 | 19,951 | 310,239 | 2023/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 1.75 | 32,000 | 35,972 | 559,377 | 2025/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 0.5 | 15,700 | 16,819 | 261,540 | 2027/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 0.5 | 21,400 | 23,019 | 357,960 | 2029/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 4.5 | 38,100 | 71,794 | 1,116,403 | 2039/11/15 |
| | | 小 計 | | | | 2,848,012 | |
| ユーロ | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | | |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESobligation | — | 100 | 101 | 11,716 | 2021/10/8 |
| | | BUNDESobligation | — | 700 | 710 | 82,430 | 2022/4/8 |
| | | BUNDESobligation | — | 750 | 764 | 88,653 | 2022/10/7 |
| | | BUNDESobligation | — | 1,000 | 1,023 | 118,763 | 2023/4/14 |
| | | BUNDESobligation | — | 2,000 | 2,069 | 240,115 | 2024/10/18 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25 | 350 | 365 | 42,427 | 2021/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.25 | 400 | 415 | 48,198 | 2021/9/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.75 | 4,000 | 4,220 | 489,580 | 2022/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 700 | 737 | 85,535 | 2022/9/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 390 | 415 | 48,176 | 2023/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 9,200 | 9,847 | 1,142,298 | 2023/5/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.0 | 2,580 | 2,819 | 327,068 | 2023/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25 | 23,900 | 30,127 | 3,494,748 | 2024/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.75 | 1,700 | 1,866 | 216,507 | 2024/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 800 | 874 | 101,498 | 2024/5/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0 | 8,100 | 8,730 | 1,012,691 | 2024/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5 | 2,700 | 2,867 | 332,668 | 2025/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0 | 9,100 | 9,962 | 1,155,681 | 2025/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5 | 20,800 | 22,325 | 2,589,778 | 2026/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | — | 1,000 | 1,046 | 121,360 | 2026/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.25 | 700 | 746 | 86,564 | 2027/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.5 | 21,500 | 32,774 | 3,801,828 | 2027/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5 | 1,000 | 1,087 | 126,190 | 2027/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.625 | 8,200 | 12,223 | 1,417,896 | 2028/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5 | 1,400 | 1,528 | 177,337 | 2028/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 7,300 | 10,557 | 1,224,684 | 2028/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25 | 19,500 | 32,656 | 3,788,126 | 2030/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.5 | 6,200 | 10,283 | 1,192,843 | 2031/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 8,600 | 15,068 | 1,747,911 | 2034/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.0 | 8,400 | 14,618 | 1,695,717 | 2037/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.25 | 4,500 | 8,494 | 985,400 | 2039/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 5,400 | 10,990 | 1,274,884 | 2040/7/4 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25 | 1,900 | 3,384 | 392,582 | 2042/7/4 | | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 5,800 | 9,612 | 1,115,028 | 2044/7/4 | | |

| 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 | 2.5 | 10,200 | 17,365 | 2,014,409 | 2046/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.25 | 10,900 | 15,100 | 1,751,623 | 2048/8/15 |
| | | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN | — | 2,300 | 2,327 | 269,985 | 2021/12/10 |
| | | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN | — | 4,000 | 4,057 | 470,726 | 2022/3/11 |
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 12,200 | 12,608 | 1,462,609 | 2021/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.45 | 5,100 | 5,106 | 592,369 | 2021/6/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 8,000 | 8,330 | 966,363 | 2021/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 16,500 | 17,424 | 2,021,298 | 2021/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.3 | 5,900 | 6,050 | 701,852 | 2021/10/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.35 | 1,050 | 1,047 | 121,514 | 2021/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.15 | 2,600 | 2,665 | 309,200 | 2021/12/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 18,900 | 20,398 | 2,366,257 | 2022/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.2 | 6,200 | 6,268 | 727,096 | 2022/4/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.35 | 400 | 405 | 47,047 | 2022/4/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9 | 400 | 401 | 46,627 | 2022/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.5 | 8,200 | 9,099 | 1,055,546 | 2022/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.45 | 3,100 | 3,155 | 366,058 | 2022/9/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.5 | 31,100 | 34,716 | 4,027,163 | 2022/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.05 | 1,900 | 1,866 | 216,465 | 2023/1/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.95 | 100 | 100 | 11,659 | 2023/3/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 1,100 | 1,219 | 141,404 | 2023/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 500 | 560 | 65,070 | 2023/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 9.0 | 18,700 | 23,878 | 2,769,851 | 2023/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 14,700 | 16,600 | 1,925,682 | 2024/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.85 | 300 | 309 | 35,854 | 2024/5/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 5,800 | 6,422 | 744,991 | 2024/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.45 | 4,700 | 4,761 | 552,287 | 2024/11/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5 | 1,000 | 1,056 | 122,554 | 2024/12/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 16,800 | 19,745 | 2,290,522 | 2025/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.45 | 800 | 805 | 93,440 | 2025/5/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.5 | 3,000 | 3,032 | 351,821 | 2025/6/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5 | 7,000 | 7,420 | 860,720 | 2025/11/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.0 | 3,000 | 3,106 | 360,319 | 2025/12/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 11,500 | 13,483 | 1,564,115 | 2026/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.1 | 2,000 | 2,065 | 239,540 | 2026/7/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 7.25 | 18,100 | 24,538 | 2,846,427 | 2026/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.5 | 17,500 | 23,451 | 2,720,403 | 2027/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 5,800 | 7,169 | 831,715 | 2028/9/1 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.25 | 29,200 | 37,945 | 4,401,666 | 2029/11/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.0 | 16,000 | 22,398 | 2,598,214 | 2031/5/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.65 | 500 | 485 | 56,260 | 2032/3/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.75 | 10,900 | 15,345 | 1,780,022 | 2033/2/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.45 | 1,400 | 1,463 | 169,805 | 2033/9/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 15,400 | 20,713 | 2,402,708 | 2034/8/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.35 | 8,000 | 9,182 | 1,065,158 | 2035/3/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0 | 700 | 863 | 100,160 | 2037/2/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.95 | 500 | 541 | 62,854 | 2038/9/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 5,000 | 6,994 | 811,362 | 2039/8/1 | | |

| 銘柄 | | 当期末 | | | | | |
|---------------------------|------|---------------------------|--------|-----------|------------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| ユーロ | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.1 | 200 | 220 | 25,598 | 2040/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 11,700 | 16,367 | 1,898,587 | 2040/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 8,800 | 12,191 | 1,414,216 | 2044/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.25 | 3,500 | 3,928 | 455,694 | 2046/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.45 | 2,800 | 3,244 | 376,345 | 2048/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.85 | 7,000 | 8,644 | 1,002,738 | 2049/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.45 | 9,000 | 8,692 | 1,008,295 | 2050/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.8 | 1,700 | 1,722 | 199,831 | 2067/3/1 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF) | — | 800 | 804 | 93,273 | 2021/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | — | 6,000 | 6,063 | 703,339 | 2022/2/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | — | 2,600 | 2,642 | 306,576 | 2023/3/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.75 | 1,570 | 1,682 | 195,222 | 2023/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | — | 100 | 102 | 11,837 | 2024/3/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.25 | 9,600 | 10,691 | 1,240,160 | 2024/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | — | 1,800 | 1,839 | 213,382 | 2025/3/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.5 | 11,000 | 11,534 | 1,338,039 | 2025/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.5 | 1,800 | 1,892 | 219,573 | 2026/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.25 | 13,300 | 13,774 | 1,597,826 | 2026/11/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.0 | 1,700 | 1,849 | 214,572 | 2027/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.75 | 2,000 | 2,148 | 249,245 | 2028/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.75 | 11,600 | 12,478 | 1,447,504 | 2028/11/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.5 | 9,500 | 11,911 | 1,381,701 | 2030/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.25 | 10,500 | 11,953 | 1,386,576 | 2034/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.25 | 100 | 114 | 13,262 | 2036/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.75 | 100 | 124 | 14,389 | 2039/6/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.0 | 10,600 | 14,170 | 1,643,794 | 2048/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.75 | 500 | 501 | 58,149 | 2052/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 3.25 | 4,100 | 4,327 | 501,978 | 2021/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 3.0 | 8,500 | 9,098 | 1,055,457 | 2022/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | — | 5,100 | 5,163 | 598,917 | 2022/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 2.25 | 17,600 | 18,842 | 2,185,680 | 2022/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 8.5 | 10,900 | 13,836 | 1,604,992 | 2023/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.25 | 27,000 | 31,553 | 3,660,211 | 2023/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 1.75 | 3,000 | 3,309 | 383,851 | 2024/11/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 6.0 | 19,800 | 26,796 | 3,108,411 | 2025/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 1.0 | 6,000 | 6,466 | 750,114 | 2025/11/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 3.5 | 34,100 | 41,954 | 4,866,772 | 2026/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 2.75 | 4,500 | 5,510 | 639,241 | 2027/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 5.5 | 27,000 | 40,646 | 4,714,969 | 2029/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 1.5 | 13,500 | 15,676 | 1,818,511 | 2031/5/25 |
| FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 5.75 | 20,100 | 34,124 | 3,958,408 | 2032/10/25 | | |
| FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.75 | 10,300 | 17,089 | 1,982,364 | 2035/4/25 | | |
| FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.0 | 300 | 491 | 56,996 | 2038/10/25 | | |
| FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.5 | 8,100 | 14,557 | 1,688,727 | 2041/4/25 | | |
| FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 3.25 | 29,700 | 47,936 | 5,560,690 | 2045/5/25 | | |
| FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.0 | 4,900 | 9,803 | 1,137,262 | 2055/4/25 | | |
| FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.0 | 4,700 | 9,887 | 1,146,907 | 2060/4/25 | | |
| オランダ | 国債証券 | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.25 | 50 | 52 | 6,061 | 2021/7/15 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|--------------------------|------|--------------------------|--------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| オランダ | 国債証券 | NETHERLANDS GOVERNMENT | — | 1,500 | 1,517 | 176,000 | 2022/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.25 | 100 | 106 | 12,355 | 2022/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.75 | 200 | 224 | 25,999 | 2023/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 7.5 | 200 | 244 | 28,373 | 2023/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 1.75 | 400 | 431 | 50,033 | 2023/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | — | 100 | 102 | 11,886 | 2024/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.0 | 8,700 | 9,677 | 1,122,610 | 2024/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.25 | 1,500 | 1,567 | 181,795 | 2025/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5 | 4,000 | 4,260 | 494,252 | 2026/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.75 | 2,500 | 2,721 | 315,674 | 2027/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 5.5 | 12,300 | 17,966 | 2,084,118 | 2028/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.75 | 1,000 | 1,096 | 127,182 | 2028/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.25 | 3,400 | 3,583 | 415,697 | 2029/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5 | 7,500 | 10,093 | 1,170,865 | 2033/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0 | 2,200 | 3,708 | 430,184 | 2037/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5 | 500 | 551 | 63,942 | 2040/1/15 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.75 | 2,400 | 4,365 | 506,395 | 2042/1/15 | | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.75 | 5,500 | 9,467 | 1,098,195 | 2047/1/15 | | |
| スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.5 | 19,400 | 20,465 | 2,374,000 | 2021/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.75 | 5,100 | 5,161 | 598,752 | 2021/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.05 | 10,700 | 10,741 | 1,246,019 | 2021/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.85 | 14,550 | 16,065 | 1,863,577 | 2022/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.4 | 4,350 | 4,400 | 510,503 | 2022/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.45 | 3,000 | 3,042 | 352,872 | 2022/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.4 | 15,100 | 17,369 | 2,014,804 | 2023/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.35 | 4,200 | 4,251 | 493,121 | 2023/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.4 | 5,300 | 6,114 | 709,275 | 2023/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.8 | 14,600 | 17,194 | 1,994,559 | 2024/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.8 | 6,900 | 7,910 | 917,578 | 2024/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.75 | 450 | 502 | 58,303 | 2024/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.6 | 900 | 959 | 111,284 | 2025/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.65 | 15,100 | 18,551 | 2,152,029 | 2025/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.15 | 5,000 | 5,509 | 639,078 | 2025/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.95 | 4,000 | 4,378 | 507,915 | 2026/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.9 | 22,400 | 29,962 | 3,475,671 | 2026/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.45 | 3,100 | 3,293 | 382,039 | 2027/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4 | 2,000 | 2,123 | 246,372 | 2028/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4 | 5,000 | 5,293 | 614,046 | 2028/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15 | 9,300 | 12,704 | 1,473,748 | 2028/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.95 | 2,000 | 2,224 | 258,014 | 2030/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.35 | 6,400 | 7,450 | 864,227 | 2033/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.9 | 1,500 | 2,444 | 283,580 | 2040/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.7 | 5,700 | 9,185 | 1,065,533 | 2041/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15 | 9,100 | 15,929 | 1,847,859 | 2044/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.9 | 3,200 | 4,150 | 481,400 | 2046/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.7 | 8,800 | 11,092 | 1,286,691 | 2048/10/31 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.45 | 1,700 | 2,613 | 303,189 | 2066/7/30 | | |
| SPANISH GOVERNMENT | 6.0 | 16,000 | 23,177 | 2,688,615 | 2029/1/31 | | |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|----------------------|------|---------------------|--------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| スペイン | 国債証券 | SPANISH GOVERNMENT | 5.75 | 31,400 | 48,962 | 5,679,594 | 2032/7/30 |
| | | SPANISH GOVERNMENT | 4.2 | 500 | 729 | 84,580 | 2037/1/31 |
| ベルギー | 国債証券 | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 700 | 746 | 86,575 | 2021/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.0 | 800 | 869 | 100,890 | 2022/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 600 | 669 | 77,645 | 2022/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 2.25 | 9,700 | 10,555 | 1,224,395 | 2023/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.2 | 2,900 | 2,970 | 344,574 | 2023/10/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 2.6 | 4,000 | 4,506 | 522,742 | 2024/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.5 | 1,000 | 1,041 | 120,792 | 2024/10/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.8 | 3,000 | 3,179 | 368,875 | 2025/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.5 | 6,000 | 7,708 | 894,211 | 2026/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.0 | 3,300 | 3,557 | 412,715 | 2026/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.8 | 2,000 | 2,140 | 248,345 | 2027/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.8 | 1,000 | 1,074 | 124,685 | 2028/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.9 | 3,000 | 3,256 | 377,744 | 2029/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.0 | 1,500 | 1,649 | 191,389 | 2031/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.0 | 3,500 | 5,083 | 589,721 | 2032/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.25 | 100 | 113 | 13,145 | 2033/4/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.45 | 500 | 581 | 67,412 | 2037/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.9 | 100 | 124 | 14,407 | 2038/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 3,400 | 5,829 | 676,242 | 2041/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.75 | 4,400 | 7,552 | 876,048 | 2045/6/22 |
| BELGIUM KINGDOM | 1.6 | 5,200 | 6,347 | 736,339 | 2047/6/22 | | |
| BELGIUM KINGDOM | 1.7 | 4,000 | 5,013 | 581,615 | 2050/6/22 | | |
| BELGIUM KINGDOM | 2.25 | 1,200 | 1,750 | 203,070 | 2057/6/22 | | |
| BELGIUM KINGDOM | 2.15 | 1,000 | 1,491 | 173,008 | 2066/6/22 | | |
| BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.5 | 11,500 | 16,653 | 1,931,810 | 2028/3/28 | | |
| BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.0 | 11,000 | 18,438 | 2,138,914 | 2035/3/28 | | |
| オーストリア | 国債証券 | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.5 | 700 | 739 | 85,748 | 2021/9/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.65 | 3,200 | 3,469 | 402,455 | 2022/4/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | — | 100 | 101 | 11,781 | 2022/9/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.4 | 200 | 220 | 25,601 | 2022/11/22 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | — | 900 | 916 | 106,341 | 2023/7/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.75 | 150 | 162 | 18,827 | 2023/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | — | 1,300 | 1,328 | 154,087 | 2024/7/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.65 | 700 | 768 | 89,136 | 2024/10/21 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.2 | 1,300 | 1,417 | 164,393 | 2025/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.85 | 5,400 | 7,076 | 820,834 | 2026/3/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.75 | 2,000 | 2,144 | 248,784 | 2026/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 6.25 | 7,600 | 11,179 | 1,296,842 | 2027/7/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.5 | 7,600 | 8,041 | 932,820 | 2029/2/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.4 | 4,800 | 6,345 | 736,085 | 2034/5/23 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.15 | 400 | 667 | 77,425 | 2037/3/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.15 | 3,200 | 5,385 | 624,718 | 2044/6/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.5 | 7,100 | 9,215 | 1,068,950 | 2047/2/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.75 | 2,000 | 2,195 | 254,627 | 2051/3/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.8 | 450 | 1,019 | 118,245 | 2062/1/26 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.1 | 800 | 1,525 | 176,951 | 2117/9/20 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|----------------------|------|------------------------|-------|------------------|-----------|-------------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| フィンランド | 国債証券 | FINNISH GOVERNMENT | — | 500 | 506 | 58,717 | 2022/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.625 | 100 | 105 | 12,222 | 2022/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.5 | 100 | 106 | 12,328 | 2023/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | — | 400 | 408 | 47,335 | 2023/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 2.0 | 700 | 771 | 89,441 | 2024/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 4.0 | 3,600 | 4,441 | 515,172 | 2025/7/4 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.875 | 100 | 107 | 12,428 | 2025/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.5 | 2,000 | 2,109 | 244,654 | 2026/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 2.75 | 3,300 | 4,107 | 476,514 | 2028/7/4 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.5 | 2,400 | 2,543 | 295,010 | 2029/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.75 | 800 | 873 | 101,284 | 2031/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.125 | 200 | 229 | 26,585 | 2034/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.125 | 2,000 | 1,996 | 231,610 | 2036/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 2.625 | 400 | 608 | 70,619 | 2042/7/4 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.375 | 300 | 385 | 44,667 | 2047/4/15 |
| | | アイルランド | 国債証券 | IRISH GOVERNMENT | 5.4 | 2,430 | 3,094 |
| IRISH GOVERNMENT | 0.9 | | | 4,000 | 4,275 | 495,938 | 2028/5/15 |
| IRISH TSY 0.8% 2022 | 0.8 | | | 1,200 | 1,227 | 142,432 | 2022/3/15 |
| IRISH TSY 1% 2026 | 1.0 | | | 4,600 | 4,911 | 569,701 | 2026/5/15 |
| IRISH TSY 1.10% 2029 | 1.1 | | | 600 | 652 | 75,725 | 2029/5/15 |
| IRISH TSY 1.3% 2033 | 1.3 | | | 2,400 | 2,679 | 310,765 | 2033/5/15 |
| IRISH TSY 1.35% 2031 | 1.35 | | | 2,000 | 2,234 | 259,179 | 2031/3/18 |
| IRISH TSY 1.5% 2050 | 1.5 | | | 1,500 | 1,744 | 202,322 | 2050/5/15 |
| IRISH TSY 1.7% 2037 | 1.7 | | | 700 | 827 | 95,947 | 2037/5/15 |
| IRISH TSY 2% 2045 | 2.0 | | | 3,100 | 3,989 | 462,749 | 2045/2/18 |
| IRISH TSY 2.4% 2030 | 2.4 | | | 3,700 | 4,511 | 523,355 | 2030/5/15 |
| IRISH TSY 2022 | — | | | 4,800 | 4,848 | 562,443 | 2022/10/18 |
| IRISH TSY 3.4% 2024 | 3.4 | | | 6,100 | 6,978 | 809,521 | 2024/3/18 |
| REPUBLIC OF IRELAND | 3.9 | | | 4,450 | 4,998 | 579,771 | 2023/3/20 |
| 小 計 | | | | | | 216,517,762 | |
| ポーランド | | | | 千ズロチ | 千ズロチ | | |
| | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 1.75 | 46,300 | 47,004 | 1,198,613 | 2021/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5 | 4,800 | 5,118 | 130,530 | 2024/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.25 | 28,500 | 31,673 | 807,666 | 2025/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5 | 25,000 | 26,833 | 684,263 | 2026/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5 | 2,000 | 2,150 | 54,834 | 2027/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.75 | 15,000 | 16,613 | 423,641 | 2029/10/25 |
| 小 計 | | | | | | 3,299,550 | |
| 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 | 2.25 | 480 | 489 | 37,055 | 2021/6/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.25 | 2,400 | 2,429 | 183,859 | 2021/10/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.75 | 2,300 | 2,358 | 178,461 | 2022/4/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.125 | 2,400 | 2,548 | 192,867 | 2022/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.75 | 300 | 310 | 23,500 | 2023/2/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 3,600 | 3,853 | 291,617 | 2023/7/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.0 | 700 | 738 | 55,898 | 2024/2/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.0 | 1,900 | 2,098 | 158,826 | 2024/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.375 | 1,100 | 1,197 | 90,603 | 2025/6/1 |

| 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 | | |
| 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 | 2.125 | 700 | 761 | 57,630 | 2026/6/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.5 | 3,900 | 4,617 | 349,413 | 2027/3/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.625 | 500 | 571 | 43,226 | 2028/5/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.875 | 300 | 352 | 26,658 | 2029/7/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.875 | 2,400 | 2,851 | 215,750 | 2030/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.375 | 1,200 | 1,541 | 116,634 | 2033/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.25 | 2,100 | 2,429 | 183,855 | 2036/8/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 2,050 | 2,646 | 200,264 | 2042/4/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 1,000 | 1,327 | 100,414 | 2046/3/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.875 | 1,000 | 1,163 | 88,024 | 2050/3/1 |
| 小 計 | | | | | | 2,594,561 | |
| マレーシア | | | 千リンギ | 千リンギ | | | |
| | 国債証券 | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.882 | 1,100 | 1,132 | 27,950 | 2022/3/10 |
| | | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.059 | 400 | 426 | 10,523 | 2024/9/30 |
| | | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.642 | 2,600 | 3,017 | 74,466 | 2033/11/7 |
| | | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.762 | 400 | 471 | 11,630 | 2037/4/7 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.16 | 400 | 409 | 10,103 | 2021/7/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.048 | 6,200 | 6,358 | 156,931 | 2021/9/30 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.62 | 500 | 510 | 12,607 | 2021/11/30 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.418 | 4,600 | 4,718 | 116,454 | 2022/8/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.795 | 500 | 517 | 12,776 | 2022/9/30 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.48 | 13,500 | 13,943 | 344,117 | 2023/3/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.757 | 3,500 | 3,641 | 89,883 | 2023/4/20 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.8 | 2,200 | 2,298 | 56,736 | 2023/8/17 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.181 | 5,800 | 6,195 | 152,912 | 2024/7/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.955 | 600 | 643 | 15,890 | 2025/9/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.392 | 9,600 | 10,527 | 259,820 | 2026/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.892 | 4,600 | 4,952 | 122,218 | 2027/3/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.502 | 7,000 | 7,372 | 181,941 | 2027/5/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.733 | 2,200 | 2,344 | 57,858 | 2028/6/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 5.248 | 2,700 | 3,176 | 78,407 | 2028/9/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.885 | 280 | 304 | 7,518 | 2029/8/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.498 | 5,700 | 6,443 | 159,030 | 2030/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.232 | 4,400 | 4,909 | 121,170 | 2031/6/30 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.127 | 400 | 442 | 10,917 | 2032/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.844 | 800 | 859 | 21,217 | 2033/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.254 | 900 | 996 | 24,597 | 2035/5/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.893 | 2,800 | 3,359 | 82,917 | 2038/6/8 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.935 | 9,700 | 11,672 | 288,069 | 2043/9/30 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.736 | 1,100 | 1,298 | 32,051 | 2046/3/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.921 | 300 | 366 | 9,050 | 2048/7/6 |
| 小 計 | | | | | | 2,549,773 | |
| オーストラリア | | | 千豪ドル | 千豪ドル | | | |
| | 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.75 | 5,700 | 6,016 | 420,445 | 2021/5/15 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.0 | 7,500 | 7,713 | 539,025 | 2021/12/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.75 | 3,040 | 3,403 | 237,863 | 2022/7/15 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.25 | 80 | 84 | 5,871 | 2022/11/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.5 | 5,400 | 6,234 | 435,664 | 2023/4/21 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | | |
|---------|------|-------------------------|---------|---------|---------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| オーストラリア | | % | 千豪ドル | 千豪ドル | 千円 | | |
| | 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 7,200 | 7,887 | 551,210 | 2024/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 15,200 | 17,334 | 1,211,323 | 2025/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.25 | 12,780 | 15,591 | 1,089,510 | 2026/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.75 | 12,100 | 15,509 | 1,083,828 | 2027/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 3,200 | 3,686 | 257,617 | 2027/11/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.25 | 17,800 | 19,847 | 1,386,908 | 2028/5/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 2,100 | 2,440 | 170,530 | 2028/11/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 10,100 | 12,214 | 853,526 | 2029/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 13,300 | 15,547 | 1,086,473 | 2029/11/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.5 | 2,000 | 2,307 | 161,257 | 2030/5/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.5 | 7,700 | 10,912 | 762,581 | 2033/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,800 | 2,169 | 151,619 | 2035/6/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.75 | 4,000 | 5,411 | 378,163 | 2037/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 700 | 890 | 62,255 | 2039/6/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,300 | 1,561 | 109,139 | 2041/5/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.0 | 5,300 | 6,692 | 467,658 | 2047/3/21 |
| 小 | 計 | | | | | 11,422,475 | |
| イスラエル | | | 千新シェケル | 千新シェケル | | | |
| | 国債証券 | ISRAEL FIXED BOND | 5.5 | 4,500 | 4,919 | 149,764 | 2022/1/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 0.75 | 5,000 | 5,063 | 154,147 | 2022/7/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 1.25 | 5,000 | 5,133 | 156,268 | 2022/11/30 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 4.25 | 5,000 | 5,575 | 169,722 | 2023/3/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 1.5 | 5,000 | 5,210 | 158,593 | 2023/11/30 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 3.75 | 5,000 | 5,655 | 172,166 | 2024/3/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 1.75 | 5,000 | 5,325 | 162,096 | 2025/8/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 6.25 | 5,000 | 6,786 | 206,581 | 2026/10/30 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 2.0 | 5,000 | 5,450 | 165,913 | 2027/3/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 2.25 | 5,000 | 5,594 | 170,308 | 2028/9/28 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 1.0 | 2,000 | 2,024 | 61,624 | 2030/3/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 5.5 | 5,000 | 8,590 | 261,484 | 2042/1/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 3.75 | 5,000 | 7,071 | 215,254 | 2047/3/31 |
| 小 | 計 | | | | | 2,203,927 | |
| 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 | 6.5 | 95,300 | 96,711 | 438,100 | 2021/6/10 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.25 | 84,700 | 87,557 | 396,636 | 2021/12/9 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.5 | 44,400 | 45,707 | 207,055 | 2022/6/9 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.75 | 300 | 314 | 1,424 | 2023/3/9 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0 | 53,300 | 59,344 | 268,831 | 2024/9/5 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 40,000 | 47,979 | 217,345 | 2024/12/5 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.75 | 51,300 | 52,417 | 237,450 | 2026/3/5 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5 | 112,300 | 124,897 | 565,787 | 2027/6/3 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 45,300 | 53,420 | 241,994 | 2029/5/31 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 68,500 | 77,140 | 349,446 | 2031/5/29 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 10,000 | 11,306 | 51,216 | 2034/11/23 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 56,300 | 75,177 | 340,556 | 2036/11/20 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 11,800 | 13,819 | 62,602 | 2038/11/18 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 66,500 | 72,305 | 327,543 | 2042/11/13 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0 | 43,000 | 48,040 | 217,625 | 2047/11/7 |

| 銘 柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|-------------------------------|-------|---------|---------|-------------|-----------|
| | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| メキシコ | % | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | 千円 | |
| 国債証券 MEXICAN FIXED RATE BONDS | 8.0 | 87,100 | 95,449 | 432,385 | 2023/12/7 |
| 小 計 | | | | 4,356,003 | |
| 合 計 | | | | 558,409,476 | |

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

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2020年5月11日現在)

| 区 分 | 当 期 末 |
|----------------|----------------------|
| | 数 量 |
| 貸付有価証券<債券>券面総額 | 米ドル 1,154,028,000 |
| 貸付有価証券<債券>券面総額 | ユーロ 16,600,000 |
| 貸付有価証券<債券>券面総額 | 豪ドル 27,100,000 |

○投資信託財産の構成

(2020年5月11日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------|-------------------------|
| | 評 価 額 比 率 |
| 公社債 | 千円 558,409,476 76.7% |
| コール・ローン等、その他 | 169,403,992 23.3% |
| 投資信託財産総額 | 727,813,468 100.0% |

*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（564,686,472千円）の投資信託財産総額（727,813,468千円）に対する比率は77.6%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=106.95円、1カナダドル=76.74円、1英ポンド=132.85円、1スウェーデンクローナ=10.92円、1ノルウェークローネ=10.44円、1デンマーククローネ=15.55円、1ユーロ=116.00円、1ズロチ=25.50円、1シンガポールドル=75.67円、1リンギ=24.68円、1豪ドル=69.88円、1新シェケル=30.44円、1メキシコペソ=4.53円、1ランド=5.83円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月11日現在)

| 項目 | 当期末 | 円 |
|-----------------|------------------|---|
| (A) 資産 | 729,549,346,520 | |
| コール・ローン等 | 7,952,791,636 | |
| 公社債(評価額) | 558,409,476,994 | |
| 未収入金 | 2,587,032,330 | |
| 未収利息 | 4,594,710,138 | |
| 前払費用 | 459,504,024 | |
| その他未収収益 | 15,452,860 | |
| 受入担保代用有価証券 | 155,530,378,538 | |
| (B) 負債 | 164,886,261,127 | |
| 未払金 | 1,744,348,986 | |
| 未払解約金 | 7,600,292,063 | |
| 未払利息 | 5,485 | |
| 受入担保金 | 155,530,378,538 | |
| その他未払費用 | 11,236,055 | |
| (C) 純資産総額(A-B) | 564,663,085,393 | |
| 元本 | 239,006,740,496 | |
| 次期繰越損益金 | 325,656,344,897 | |
| (D) 受益権総口数 | 239,006,740,496口 | |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 23,625円 | |

(注) 期首元本額は268,084,419,000円、期中追加設定元本額は33,092,232,394円、期中一部解約元本額は62,169,910,898円、1口当たり純資産額は2.3625円です。

(注) 2020年5月11日現在、有価証券の貸付などに係る受入担保代用有価証券として担保に受け入れている資産は以下の通りです。
・有価証券 155,530,378,537円

○損益の状況 (2019年5月11日～2020年5月11日)

| 項目 | 当期 | 円 |
|------------------|------------------|---|
| (A) 配当等収益 | 16,507,705,850 | |
| 受取利息 | 16,444,664,276 | |
| その他収益金 | 64,333,611 | |
| 支払利息 | △ 1,292,037 | |
| (B) 有価証券売買損益 | 10,989,677,354 | |
| 売買益 | 42,322,261,855 | |
| 売買損 | △ 31,332,584,501 | |
| (C) 保管費用等 | △ 82,371,970 | |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 27,415,011,234 | |
| (E) 前期繰越損益金 | 337,743,397,144 | |
| (F) 追加信託差損益金 | 44,217,348,963 | |
| (G) 解約差損益金 | △ 83,719,412,444 | |
| (H) 計(D+E+F+G) | 325,656,344,897 | |
| 次期繰越損益金(H) | 325,656,344,897 | |

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名 | 当期末元本額 | 円 |
|--|-----------------|---|
| 野村外国債券インデックス Bコース(野村投資一任口座向け) | 102,686,407,275 | |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 23,127,565,619 | |
| 野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け) | 16,118,719,507 | |
| のむらっぴ・ファンド(普通型) | 11,330,020,953 | |
| マイ・ロード | 8,732,790,392 | |
| 野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け) | 7,313,848,903 | |
| 野村外国債券インデックス Bコース(野村SMA・EW向け) | 6,268,102,023 | |
| 野村DC外国債券インデックスファンド | 6,012,148,045 | |
| のむらっぴ・ファンド(保守型) | 5,649,317,080 | |
| マイバランス50(確定拠出年金向け) | 5,530,137,578 | |
| マイバランス30(確定拠出年金向け) | 4,969,011,331 | |
| マイバランス70(確定拠出年金向け) | 3,871,221,089 | |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 3,527,503,854 | |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 3,337,502,044 | |
| 野村DC運用戦略ファンド | 2,944,954,434 | |
| NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジなし) 連動型上場投信 | 2,423,390,560 | |
| のむらっぴ・ファンド(積極型) | 2,267,517,840 | |

| ファンド名 | 当期末元本額 | 円 |
|------------------------------------|---------------|---|
| ノムラFOfs用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用) | 1,988,901,353 | |
| マイバランスDC30 | 1,727,999,247 | |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用) | 1,655,570,027 | |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券 | 1,602,137,819 | |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 1,521,677,602 | |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 1,404,525,492 | |
| グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用) | 1,364,895,324 | |
| グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 1,215,579,071 | |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | 1,189,269,436 | |
| マイバランスDC50 | 1,104,260,061 | |
| 野村インデックスファンド・外国債券 | 822,665,833 | |
| 野村6資産均等バランス | 780,497,633 | |
| 野村外国債券インデックス(野村SMA向け) | 753,468,107 | |
| ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) | 695,976,449 | |
| マイバランスDC70 | 677,624,248 | |
| 野村外国債券バッシブファンド(確定拠出年金向け) | 575,181,053 | |
| のむらっぴ・ファンド(やや保守型) | 474,917,230 | |

| ファンド名 | 当期末 |
|-------------------------------------|-------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| のむらっぴ・ファンド (やや積極型) | 327,819,456 |
| グローバル・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用) | 325,036,964 |
| 野村外国債券インデックスファンド | 302,722,100 |
| 野村DC運用戦略ファンド (マイルド) | 301,710,390 |
| ネクストコア | 199,230,377 |
| マイターゲット2030 (確定拠出年金向け) | 194,349,584 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用) | 177,170,939 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス25VA (適格機関投資家専用) | 165,087,446 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 139,895,334 |
| マイターゲット2050 (確定拠出年金向け) | 134,621,908 |
| 野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用) | 102,337,977 |
| マイターゲット2040 (確定拠出年金向け) | 92,201,365 |
| バランスセレクト50 | 81,769,911 |
| バランスセレクト30 | 81,630,740 |
| 世界6資産分散ファンド | 78,161,936 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用) | 77,383,072 |
| バランスセレクト70 | 67,707,889 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 54,106,972 |
| マイターゲット2035 (確定拠出年金向け) | 50,849,809 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 44,722,632 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 42,849,078 |
| マイターゲット2045 (確定拠出年金向け) | 32,048,381 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 29,290,609 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 29,279,193 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 26,005,469 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) インカムコース | 22,257,309 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA (適格機関投資家専用) | 16,010,887 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA (適格機関投資家専用) | 15,998,722 |

| ファンド名 | 当期末 |
|--|------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| マイターゲット2060 (確定拠出年金向け) | 15,478,601 |
| マイターゲット2055 (確定拠出年金向け) | 13,197,003 |
| 野村外国債券インデックスファンドVA (適格機関投資家専用) | 9,135,215 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 安定コース | 8,810,074 |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型 (適格機関投資家専用) | 8,546,080 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 8,422,485 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 成長コース | 7,877,418 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 6,720,865 |
| バランスセレクト50 (確定拠出年金向け) | 6,048,480 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型 | 5,628,330 |
| バランスセレクト70 (確定拠出年金向け) | 5,256,339 |
| インデックス・ブレンド (タイプIII) | 5,095,015 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2030 | 3,445,395 |
| バランスセレクト30 (確定拠出年金向け) | 3,357,237 |
| インデックス・ブレンド (タイプV) | 3,145,615 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型 (適格機関投資家専用) | 2,729,205 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 2,366,982 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2040 | 2,161,268 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型 | 2,048,108 |
| インデックス・ブレンド (タイプI) | 2,026,660 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型 | 1,471,130 |
| インデックス・ブレンド (タイプIV) | 1,352,642 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2050 | 1,317,745 |
| インデックス・ブレンド (タイプII) | 1,276,241 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型 | 1,028,642 |
| 野村PFRs用・ターゲット・リターン・8資産バランス (2%コース向け) (適格機関投資家専用) | 525,844 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2060 | 455,561 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型 (適格機関投資家専用) | 255,355 |

〇お知らせ

有価証券の貸付に係る事務処理費用を信託財産中から支弁することを明確化するための所要の約款変更を行いました。
 <変更適用日：2019年7月31日>