

# 野村外国債券インデックス Aコース (野村SMA・EW向け)

## 運用報告書(全体版)

第6期(決算日2021年12月6日)

作成対象期間(2020年12月8日～2021年12月6日)

### 受益者のみなさまへ

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

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

## 野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

| 決算期            | 基準価額   |             |                  | ベンチマーク<br>FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、円ヘッジ・円ベース) |             | 債<br>組<br>入<br>比<br>率 | 債<br>先<br>物<br>比<br>率 | 純<br>資<br>産<br>額 |
|----------------|--------|-------------|------------------|--|-------------|-----------------------|-----------------------|------------------|
|                | (分配落)  | 税<br>分<br>配 | み<br>金<br>騰<br>落 | 中<br>率                                       | 期<br>騰<br>落 |                       |                       |                  |
|                | 円      | 円           | %                |  | %           | %                     | %                     | 百万円              |
| 2期(2017年12月6日) | 9,636  | 0           | 1.2              | 96.89  | 1.6         | 97.1                  | 24.9                  | 835              |
| 3期(2018年12月6日) | 9,452  | 0           | △1.9             | 95.32  | △1.6        | 98.3                  | —                     | 2,783            |
| 4期(2019年12月6日) | 10,029 | 5           | 6.2              | 101.63                                       | 6.6         | 98.8                  | —                     | 5,072            |
| 5期(2020年12月7日) | 10,504 | 5           | 4.8              | 106.95                                       | 5.2         | 99.6                  | —                     | 13,262           |
| 6期(2021年12月6日) | 10,334 | 5           | △1.6             | 105.61                                       | △1.3        | 98.3                  | —                     | 15,819           |

\*基準価額の騰落率は分配金込み。

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

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

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

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日                | 基準価額        |             | ベンチマーク<br>FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、円ヘッジ・円ベース) |             | 債<br>組<br>入<br>比<br>率 | 債<br>先<br>物<br>比<br>率 |
|--------------------|-------------|-------------|--|-------------|-----------------------|-----------------------|
|                    | 騰<br>落<br>率 | 騰<br>落<br>率 | 騰<br>落<br>率                                  | 騰<br>落<br>率 |                       |                       |
| (期首)<br>2020年12月7日 | 円           | %           |  | %           | %                     | %                     |
|                    | 10,504      | —           | 106.95                                       | —           | 99.6                  | —                     |
| 12月末               | 10,558      | 0.5         | 107.50                                       | 0.5         | 99.4                  | —                     |
| 2021年1月末           | 10,490      | △0.1        | 106.87                                       | △0.1        | 99.2                  | —                     |
| 2月末                | 10,176      | △3.1        | 103.66                                       | △3.1        | 100.3                 | —                     |
| 3月末                | 10,154      | △3.3        | 103.50                                       | △3.2        | 101.0                 | —                     |
| 4月末                | 10,141      | △3.5        | 103.42                                       | △3.3        | 98.7                  | —                     |
| 5月末                | 10,159      | △3.3        | 103.59                                       | △3.1        | 99.6                  | —                     |
| 6月末                | 10,197      | △2.9        | 104.03                                       | △2.7        | 98.2                  | —                     |
| 7月末                | 10,373      | △1.2        | 105.84                                       | △1.0        | 97.6                  | —                     |
| 8月末                | 10,372      | △1.3        | 105.87                                       | △1.0        | 98.9                  | —                     |
| 9月末                | 10,206      | △2.8        | 104.20                                       | △2.6        | 99.5                  | —                     |
| 10月末               | 10,201      | △2.9        | 104.14                                       | △2.6        | 100.8                 | —                     |
| 11月末               | 10,261      | △2.3        | 104.80                                       | △2.0        | 97.2                  | —                     |
| (期末)<br>2021年12月6日 | 10,339      | △1.6        | 105.61                                       | △1.3        | 98.3                  | —                     |

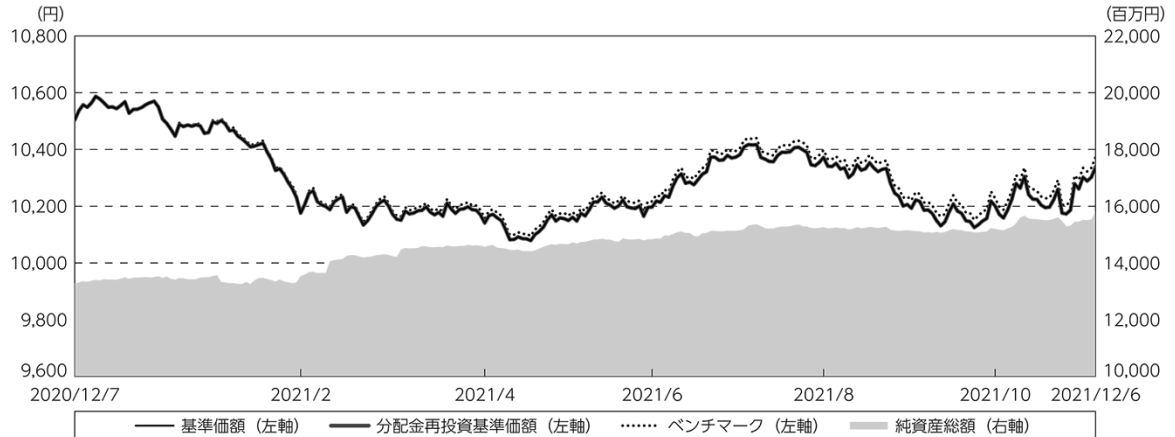
\*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2020年12月7日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）です。ベンチマークは、作成期首（2020年12月7日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

外国債券利回りが米国を中心に上昇（価格は下落）したことがマイナスに影響したため、基準価額は下落しました。

### ○投資環境

当運用期間では、米国の追加経済対策に伴う国債増発懸念や新型コロナウイルスのワクチン普及による景気回復期待、インフレ懸念などを背景としたFRB（米連邦準備制度理事会）による早期の利上げ開始観測などから、外国債券利回りは米国を中心に上昇（価格は下落）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）]

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

### [外国債券為替ヘッジ型マザーファンド]

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

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

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

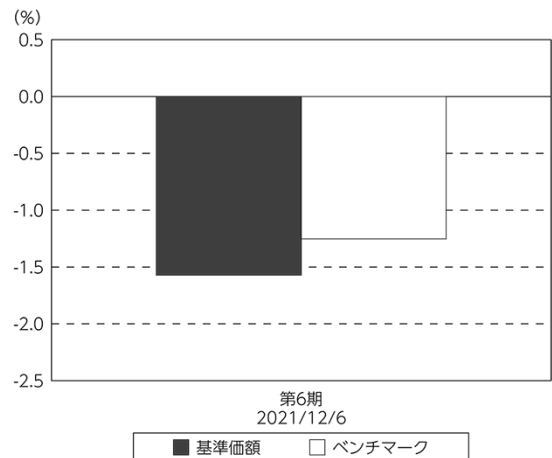
### (マイナス要因)

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

### (その他の要因)

ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なること

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

## ◎分配金

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

## ○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

| 項 目       | 第6期                       |
|-----------|---------------------------|
|           | 2020年12月8日～<br>2021年12月6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 | 859                       |

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

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

## ◎今後の運用方針

### 〔野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）〕

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

### 〔外国債券為替ヘッジ型マザーファンド〕

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

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

（2020年12月8日～2021年12月6日）

| 項 目                   | 当 期     |            | 項 目 の 概 要   |
|-----------------------|---------|------------|---|
|                       | 金 額     | 比 率        |   |
| (a) 信 託 報 酬           | 円<br>34 | %<br>0.329 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率   |
| （ 投 信 会 社 ）           | (25)    | (0.241)    | ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等                            |
| （ 販 売 会 社 ）           | ( 6 )   | (0.055)    | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等                          |
| （ 受 託 会 社 ）           | ( 3 )   | (0.033)    | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等   |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料     | 0       | 0.000      | (b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）   | ( 0 )   | (0.000)    |   |
| (c) そ の 他 費 用         | 1       | 0.011      | (c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  |
| （ 保 管 費 用 ）           | ( 1 )   | (0.009)    | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用                     |
| （ 監 査 費 用 ）           | ( 0 )   | (0.002)    | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用   |
| （ そ の 他 ）             | ( 0 )   | (0.000)    | 信託事務の処理に要するその他の諸費用  |
| 合 計                   | 35      | 0.340      |   |
| 期中の平均基準価額は、10,274円です。 |         |            |   |

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

\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

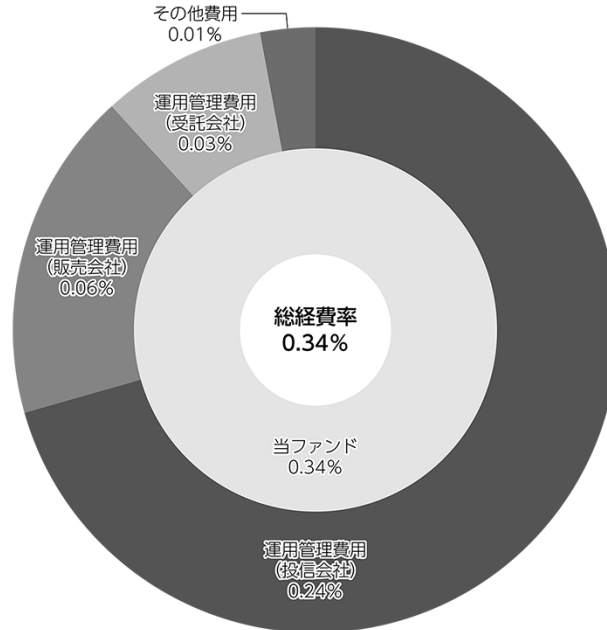
\* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

## （参考情報）

## ○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.34%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

(2020年12月8日～2021年12月6日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄               | 設 定       |           | 解 約       |           |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
|                   | 口 数       | 金 額       | 口 数       | 金 額       |
| 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド | 3,333,100 | 4,086,548 | 1,127,262 | 1,387,272 |

\*単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年12月8日～2021年12月6日)

該当事項はございません。

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

## ○組入資産の明細

(2021年12月6日現在)

## 親投資信託残高

| 銘 柄               | 期首(前期末)    | 当 期 末      |            |
|-------------------|------------|------------|------------|
|                   | 口 数        | 口 数        | 評 価 額      |
| 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド | 10,600,263 | 12,806,101 | 15,818,097 |

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2021年12月6日現在)

| 項 目               | 当 期 末      |       |
|-------------------|------------|-------|
|                   | 評 価 額      | 比 率   |
| 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド | 15,818,097 | 99.8  |
| コール・ローン等、その他      | 37,585     | 0.2   |
| 投資信託財産総額          | 15,855,682 | 100.0 |

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*外国債券為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（91,364,678千円）の投資信託財産総額（96,467,762千円）に対する比率は94.7%です。

\*外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=113.08円、1カナダドル=88.09円、1英ポンド=149.66円、1スウェーデンクローナ=12.34円、1ノルウェークローネ=12.34円、1デンマーククローネ=17.17円、1ユーロ=127.70円、1ズロチ=27.7747円、1シンガポールドル=82.46円、1人民元=17.7336円、1豪ドル=79.37円、1新シェケル=35.6999円、1メキシコペソ=5.3155円。



## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年12月6日現在）

| 項 目                    | 当 期 末           |
|------------------------|-----------------|
|                        | 円               |
| (A) 資産                 | 15,855,682,116  |
| コール・ローン等               | 29,930,900      |
| 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド(評価額) | 15,818,097,084  |
| 未収入金                   | 7,654,132       |
| (B) 負債                 | 36,010,950      |
| 未払収益分配金                | 7,654,131       |
| 未払解約金                  | 3,222,858       |
| 未払信託報酬                 | 24,967,545      |
| 未払利息                   | 19              |
| その他未払費用                | 166,397         |
| (C) 純資産総額(A-B)         | 15,819,671,166  |
| 元本                     | 15,308,263,565  |
| 次期繰越損益金                | 511,407,601     |
| (D) 受益権総口数             | 15,308,263,565口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)        | 10,334円         |

(注) 期首元本額は12,625,404,707円、期中追加設定元本額は4,899,019,035円、期中一部解約元本額は2,216,160,177円、1口当たり純資産額は1.0334円です。

## ○損益の状況（2020年12月8日～2021年12月6日）

| 項 目              | 当 期            |
|------------------|----------------|
|                  | 円              |
| (A) 配当等収益        | △ 5,055        |
| 支払利息             | △ 5,055        |
| (B) 有価証券売買損益     | △106,554,715   |
| 売買益              | 30,004,617     |
| 売買損              | △136,559,332   |
| (C) 信託報酬等        | △ 48,250,867   |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △154,810,637   |
| (E) 前期繰越損益金      | 261,128,125    |
| (F) 追加信託差損益金     | 412,744,244    |
| (配当等相当額)         | ( 821,519,626) |
| (売買損益相当額)        | (△408,775,382) |
| (G) 計(D+E+F)     | 519,061,732    |
| (H) 収益分配金        | △ 7,654,131    |
| 次期繰越損益金(G+H)     | 511,407,601    |
| 追加信託差損益金         | 412,744,244    |
| (配当等相当額)         | ( 832,349,415) |
| (売買損益相当額)        | (△419,605,171) |
| 分配準備積立金          | 483,593,425    |
| 繰越損益金            | △384,930,068   |

\*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（2020年12月8日～2021年12月6日）は以下の通りです。

| 項 目                          | 当 期                       |
|------------------------------|---------------------------|
|                              | 2020年12月8日～<br>2021年12月6日 |
| a. 配当等収益(経費控除後)              | 230,119,431円              |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 0円                        |
| c. 信託約款に定める収益調整金             | 832,349,415円              |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金           | 261,128,125円              |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d)           | 1,323,596,971円            |
| f. 分配対象収益(1万口当たり)            | 864円                      |
| g. 分配金                       | 7,654,131円                |
| h. 分配金(1万口当たり)               | 5円                        |

## ○分配金のお知らせ

---

|                |    |
|----------------|----|
| 1万口当たり分配金（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。

# 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

## 運用報告書

第8期（決算日2021年9月6日）

作成対象期間（2020年9月8日～2021年9月6日）

### 受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

**野村アセットマネジメント**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

## ○最近5期の運用実績

| 決算期           | 基準価額   |      | ベンチマーク                             |      | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純資産額   |
|---------------|--------|------|------------------------------------|------|-------|--------|--------|
|               | 期騰落    | 期中率  | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、円ヘッジ・円ベース) | 期騰落  |       |        |        |
| 4期(2017年9月6日) | 円      | %    |                                    |      | %     | %      | 百万円    |
|               | 11,412 | △2.6 | 114.81                             | △2.5 | 84.6  | —      | 15,515 |
| 5期(2018年9月6日) | 11,174 | △2.1 | 112.61                             | △1.9 | 98.8  | —      | 50,125 |
| 6期(2019年9月6日) | 12,118 | 8.4  | 122.22                             | 8.5  | 99.7  | —      | 59,275 |
| 7期(2020年9月7日) | 12,502 | 3.2  | 126.25                             | 3.3  | 99.2  | —      | 69,653 |
| 8期(2021年9月6日) | 12,332 | △1.4 | 124.58                             | △1.3 | 99.3  | —      | 85,718 |

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

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

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

(出所) FTSE Fixed Income LLC

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

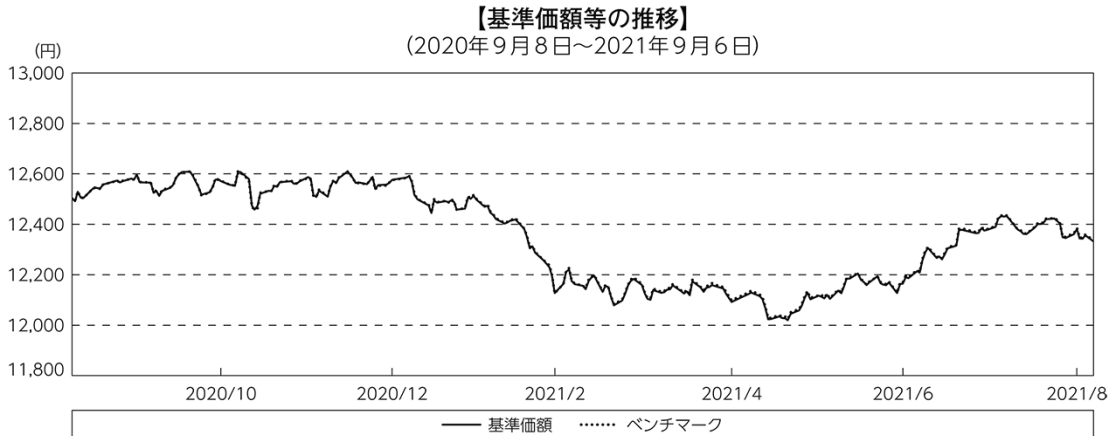
| 年月日               | 基準価額   |      | ベンチマーク                             |      | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|-------------------|--------|------|------------------------------------|------|-------|--------|
|                   | 騰落     | 期中率  | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、円ヘッジ・円ベース) | 騰落   |       |        |
| (期首)<br>2020年9月7日 | 円      | %    |                                    |      | %     | %      |
|                   | 12,502 | —    | 126.25                             | —    | 99.2  | —      |
| 9月末               | 12,596 | 0.8  | 127.21                             | 0.8  | 97.9  | —      |
| 10月末              | 12,571 | 0.6  | 126.96                             | 0.6  | 97.1  | —      |
| 11月末              | 12,587 | 0.7  | 127.07                             | 0.7  | 99.9  | —      |
| 12月末              | 12,576 | 0.6  | 126.99                             | 0.6  | 99.4  | —      |
| 2021年1月末          | 12,498 | △0.0 | 126.24                             | △0.0 | 99.2  | —      |
| 2月末               | 12,127 | △3.0 | 122.45                             | △3.0 | 100.3 | —      |
| 3月末               | 12,104 | △3.2 | 122.26                             | △3.2 | 101.0 | —      |
| 4月末               | 12,092 | △3.3 | 122.17                             | △3.2 | 98.7  | —      |
| 5月末               | 12,117 | △3.1 | 122.37                             | △3.1 | 99.6  | —      |
| 6月末               | 12,165 | △2.7 | 122.89                             | △2.7 | 98.2  | —      |
| 7月末               | 12,378 | △1.0 | 125.03                             | △1.0 | 97.7  | —      |
| 8月末               | 12,381 | △1.0 | 125.06                             | △0.9 | 98.9  | —      |
| (期末)<br>2021年9月6日 | 円      | %    |                                    |      | %     | %      |
|                   | 12,332 | △1.4 | 124.58                             | △1.3 | 99.3  | —      |

\*騰落率は期首比です。

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



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

### ○基準価額の主な変動要因

外国債券利回りが米国を中心に上昇（価格は下落）したため、基準価額は下落しました。

### ○当ファンドのポートフォリオ

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

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

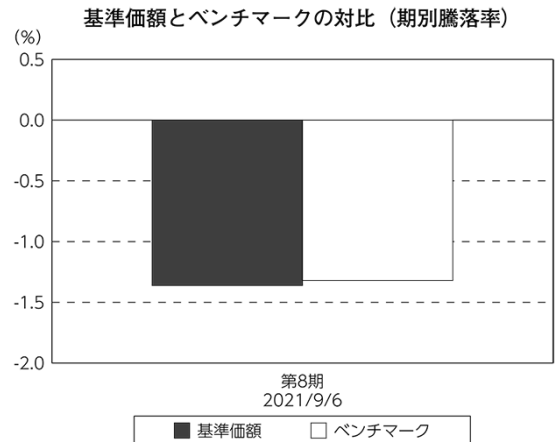
今期の基準価額の騰落率は-1.4%となり、ベンチマークの-1.3%を0.1ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

### (マイナス要因)

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

### (その他の要因)

ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なること



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

## ◎今後の運用方針

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

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年9月8日～2021年9月6日)

| 項 目                                       | 当 期             |                             | 項 目 の 概 要  |
|---|-----------------|-----------------------------|--|
|   | 金 額             | 比 率                         |  |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料<br>(先物・オプション)           | 円<br>0<br>(0)   | %<br>0.000<br>(0.000)       | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料                                   |
| (b) そ の 他 費 用<br>( 保 管 費 用 )<br>( そ の 他 ) | 1<br>(1)<br>(0) | 0.009<br>(0.009)<br>(0.000) | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>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<br>信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計                                       | 1               | 0.009                       |  |
| 期中の平均基準価額は、12,349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

(2020年9月8日～2021年9月6日)

## 公社債

|         |        |       | 買付額                  | 売付額                  |
|---------|--------|-------|----------------------|----------------------|
| 外       | アメリカ   | 国債証券  | 千米ドル<br>175,302      | 千米ドル<br>90,146       |
|         | カナダ    | 国債証券  | 千カナダドル<br>6,591      | 千カナダドル<br>2,744      |
|         | イギリス   | 国債証券  | 千英ポンド<br>11,839      | 千英ポンド<br>7,400       |
|         | スウェーデン | 国債証券  | 千スウェーデンクローナ<br>7,541 | 千スウェーデンクローナ<br>3,621 |
|         | デンマーク  | 国債証券  | 千デンマーククローネ<br>8,272  | 千デンマーククローネ<br>1,551  |
|         | ユーロ    |       | 千ユーロ                 | 千ユーロ                 |
|         | ドイツ    | 国債証券  | 16,413               | 9,817                |
|         | イタリア   | 国債証券  | 24,817               | 18,489               |
|         | フランス   | 国債証券  | 29,262               | 16,842               |
|         | オランダ   | 国債証券  | 2,889                | 503                  |
|         | スペイン   | 国債証券  | 15,867               | 9,530                |
|         | ベルギー   | 国債証券  | 4,159                | 3,186                |
|         | オーストリア | 国債証券  | 4,516                | 2,329                |
|         | フィンランド | 国債証券  | 1,587                | 301                  |
|         | アイルランド | 国債証券  | 696                  | 1,325                |
|         | 国      | ポーランド | 国債証券                 | 千ズロチ<br>20,177       |
| シンガポール  |        | 国債証券  | 千シンガポールドル<br>1,673   | 千シンガポールドル<br>1,039   |
| オーストラリア |        | 国債証券  | 千豪ドル<br>5,779        | 千豪ドル<br>6,595        |
| イスラエル   |        | 国債証券  | 千新シェケル<br>4,684      | 千新シェケル<br>-          |
| メキシコ    |        | 国債証券  | 千メキシコペソ<br>25,781    | 千メキシコペソ<br>18,028    |

\*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

\*単位未満は切り捨て。

## 先物取引の種類別取引状況

| 種類別 |        | 買建           |              | 売建       |          |
|-----|--------|--------------|--------------|----------|----------|
|     |        | 新規買付額        | 決済額          | 新規売付額    | 決済額      |
| 外国  | 債券先物取引 | 百万円<br>4,660 | 百万円<br>4,658 | 百万円<br>- | 百万円<br>- |

\*単位未満は切り捨て。

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

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年9月8日～2021年9月6日)

該当事項はございません。

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



## ○組入資産の明細

(2021年9月6日現在)

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分     | 当 期 末                 |                       |            |      |                 |           |      |      |
|---------|-----------------------|-----------------------|------------|------|-----------------|-----------|------|------|
|         | 額面金額                  | 評 価 額                 |            | 組入比率 | うちBB格以下<br>組入比率 | 残存期間別組入比率 |      |      |
|         |                       | 外貨建金額                 | 邦貨換算金額     |      |                 | 5年以上      | 2年以上 | 2年未満 |
|         | 千米ドル                  | 千米ドル                  | 千円         | %    | %               | %         | %    | %    |
| アメリカ    | 330,270               | 353,477               | 38,822,450 | 45.3 | —               | 20.2      | 18.2 | 6.9  |
| カナダ     | 千カナダドル<br>17,050      | 千カナダドル<br>19,009      | 1,664,690  | 1.9  | —               | 1.0       | 0.8  | 0.2  |
| イギリス    | 千英ポンド<br>27,830       | 千英ポンド<br>35,718       | 5,433,781  | 6.3  | —               | 5.1       | 0.9  | 0.3  |
| スウェーデン  | 千スウェーデンクローナ<br>19,050 | 千スウェーデンクローナ<br>20,494 | 262,941    | 0.3  | —               | 0.3       | 0.1  | —    |
| ノルウェー   | 千ノルウェークローネ<br>11,600  | 千ノルウェークローネ<br>11,980  | 151,556    | 0.2  | —               | 0.1       | 0.1  | 0.0  |
| デンマーク   | 千デンマーククローネ<br>19,650  | 千デンマーククローネ<br>24,349  | 427,098    | 0.5  | —               | 0.4       | 0.1  | —    |
| ユーロ     | 千ユーロ                  | 千ユーロ                  |            |      |                 |           |      |      |
| ドイツ     | 37,310                | 45,778                | 5,970,873  | 7.0  | —               | 4.7       | 1.7  | 0.5  |
| イタリア    | 54,660                | 64,410                | 8,401,041  | 9.8  | —               | 5.6       | 3.3  | 0.8  |
| フランス    | 55,070                | 64,996                | 8,477,520  | 9.9  | —               | 6.5       | 3.2  | 0.2  |
| オランダ    | 10,040                | 12,560                | 1,638,293  | 1.9  | —               | 1.4       | 0.3  | 0.2  |
| スペイン    | 35,860                | 42,072                | 5,487,504  | 6.4  | —               | 4.1       | 1.5  | 0.8  |
| ベルギー    | 12,640                | 15,089                | 1,968,098  | 2.3  | —               | 1.8       | 0.4  | 0.1  |
| オーストリア  | 7,720                 | 9,177                 | 1,197,010  | 1.4  | —               | 1.0       | 0.3  | 0.1  |
| フィンランド  | 3,760                 | 4,207                 | 548,728    | 0.6  | —               | 0.4       | 0.2  | 0.1  |
| アイルランド  | 5,330                 | 5,831                 | 760,620    | 0.9  | —               | 0.5       | 0.2  | 0.2  |
| ポーランド   | 千ズロチ<br>16,700        | 千ズロチ<br>16,865        | 488,040    | 0.6  | —               | 0.2       | 0.1  | 0.3  |
| シンガポール  | 千シンガポールドル<br>8,040    | 千シンガポールドル<br>8,768    | 717,624    | 0.8  | —               | 0.5       | 0.2  | 0.1  |
| オーストラリア | 千豪ドル<br>18,660        | 千豪ドル<br>20,756        | 1,694,569  | 2.0  | —               | 1.4       | 0.4  | 0.2  |
| イスラエル   | 千新シェケル<br>10,400      | 千新シェケル<br>11,676      | 400,194    | 0.5  | —               | 0.2       | 0.2  | —    |
| メキシコ    | 千メキシコペソ<br>108,500    | 千メキシコペソ<br>114,768    | 632,786    | 0.7  | —               | 0.4       | 0.3  | —    |
| 合 計     | —                     | —                     | 85,145,425 | 99.3 | —               | 55.8      | 32.4 | 11.1 |

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

\* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄   | 銘柄               | 当期末   |       |       |         | 償還年月日      |
|------|------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
|      |                  | 利率    | 額面金額  | 評価額   |         |            |
|      |                  |       |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |            |
|      |                  | %     | 千米ドル  | 千米ドル  | 千円      |            |
| アメリカ | 国債証券             |       |       |       |         |            |
|      | US TREASURY BOND | 6.25  | 70    | 78    | 8,589   | 2023/8/15  |
|      | US TREASURY BOND | 2.375 | 500   | 528   | 58,098  | 2024/8/15  |
|      | US TREASURY BOND | 6.0   | 610   | 752   | 82,625  | 2026/2/15  |
|      | US TREASURY BOND | 6.125 | 1,800 | 2,360 | 259,257 | 2027/11/15 |
|      | US TREASURY BOND | 5.5   | 2,280 | 2,960 | 325,125 | 2028/8/15  |
|      | US TREASURY BOND | 5.25  | 20    | 25    | 2,832   | 2028/11/15 |
|      | US TREASURY BOND | 2.875 | 510   | 600   | 65,938  | 2043/5/15  |
|      | US TREASURY BOND | 3.75  | 3,450 | 4,632 | 508,735 | 2043/11/15 |
|      | US TREASURY N/B  | 1.75  | 3,000 | 3,051 | 335,191 | 2022/9/30  |
|      | US TREASURY N/B  | 1.875 | 700   | 713   | 78,319  | 2022/9/30  |
|      | US TREASURY N/B  | 1.875 | 1,500 | 1,530 | 168,072 | 2022/10/31 |
|      | US TREASURY N/B  | 2.0   | 2,800 | 2,860 | 314,130 | 2022/10/31 |
|      | US TREASURY N/B  | 1.625 | 2,150 | 2,188 | 240,322 | 2022/11/15 |
|      | US TREASURY N/B  | 2.125 | 2,260 | 2,318 | 254,634 | 2022/12/31 |
|      | US TREASURY N/B  | 1.5   | 1,400 | 1,425 | 156,608 | 2023/1/15  |
|      | US TREASURY N/B  | 1.75  | 1,000 | 1,022 | 112,279 | 2023/1/31  |
|      | US TREASURY N/B  | 2.375 | 700   | 721   | 79,262  | 2023/1/31  |
|      | US TREASURY N/B  | 2.0   | 4,110 | 4,219 | 463,373 | 2023/2/15  |
|      | US TREASURY N/B  | 2.625 | 1,000 | 1,036 | 113,819 | 2023/2/28  |
|      | US TREASURY N/B  | 0.5   | 2,500 | 2,512 | 275,980 | 2023/3/15  |
|      | US TREASURY N/B  | 1.5   | 2,100 | 2,143 | 235,372 | 2023/3/31  |
|      | US TREASURY N/B  | 1.75  | 1,500 | 1,539 | 169,069 | 2023/5/15  |
|      | US TREASURY N/B  | 0.125 | 1,000 | 999   | 109,744 | 2023/5/15  |
|      | US TREASURY N/B  | 1.625 | 2,000 | 2,050 | 225,220 | 2023/5/31  |
|      | US TREASURY N/B  | 0.25  | 1,500 | 1,501 | 164,905 | 2023/6/15  |
|      | US TREASURY N/B  | 1.375 | 5,000 | 5,109 | 561,226 | 2023/6/30  |
|      | US TREASURY N/B  | 0.125 | 1,000 | 998   | 109,696 | 2023/6/30  |
|      | US TREASURY N/B  | 1.25  | 3,500 | 3,570 | 392,123 | 2023/7/31  |
|      | US TREASURY N/B  | 2.5   | 2,200 | 2,297 | 252,338 | 2023/8/15  |
|      | US TREASURY N/B  | 0.125 | 3,100 | 3,094 | 339,887 | 2023/8/15  |
|      | US TREASURY N/B  | 1.375 | 3,000 | 3,068 | 337,057 | 2023/8/31  |
|      | US TREASURY N/B  | 2.75  | 3,500 | 3,675 | 403,655 | 2023/8/31  |
|      | US TREASURY N/B  | 0.125 | 4,000 | 3,992 | 438,444 | 2023/9/15  |
|      | US TREASURY N/B  | 1.375 | 5,000 | 5,117 | 562,063 | 2023/9/30  |
|      | US TREASURY N/B  | 0.125 | 4,000 | 3,990 | 438,273 | 2023/10/15 |
|      | US TREASURY N/B  | 1.625 | 1,700 | 1,750 | 192,232 | 2023/10/31 |
|      | US TREASURY N/B  | 2.75  | 2,500 | 2,635 | 289,483 | 2023/11/15 |
|      | US TREASURY N/B  | 2.125 | 3,000 | 3,123 | 343,107 | 2023/11/30 |
|      | US TREASURY N/B  | 2.875 | 3,500 | 3,701 | 406,553 | 2023/11/30 |
|      | US TREASURY N/B  | 2.25  | 2,000 | 2,091 | 229,656 | 2023/12/31 |
|      | US TREASURY N/B  | 2.25  | 500   | 523   | 57,499  | 2024/1/31  |
|      | US TREASURY N/B  | 2.75  | 400   | 423   | 46,549  | 2024/2/15  |
|      | US TREASURY N/B  | 2.375 | 4,000 | 4,204 | 461,766 | 2024/2/29  |
|      | US TREASURY N/B  | 2.125 | 2,000 | 2,091 | 229,742 | 2024/3/31  |
|      | US TREASURY N/B  | 2.0   | 2,000 | 2,088 | 229,330 | 2024/4/30  |

| 銘柄   | 銘柄              | 当 期 末 |       |       |         | 償還年月日      |
|------|-----------------|-------|-------|-------|---------|------------|
|      |                 | 利 率   | 額面金額  | 評 価 額 |         |            |
|      |                 |       |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |            |
|      |                 | %     | 千米ドル  | 千米ドル  | 千円      |            |
| アメリカ | 国債証券            |       |       |       |         |            |
|      | US TREASURY N/B | 2.5   | 1,500 | 1,585 | 174,147 | 2024/5/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.0   | 2,000 | 2,089 | 229,484 | 2024/5/31  |
|      | US TREASURY N/B | 2.0   | 4,000 | 4,180 | 459,175 | 2024/6/30  |
|      | US TREASURY N/B | 1.75  | 2,000 | 2,077 | 228,128 | 2024/6/30  |
|      | US TREASURY N/B | 0.375 | 3,000 | 2,999 | 329,387 | 2024/7/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.125 | 3,000 | 3,150 | 346,003 | 2024/7/31  |
|      | US TREASURY N/B | 1.875 | 2,000 | 2,087 | 229,235 | 2024/8/31  |
|      | US TREASURY N/B | 1.25  | 3,000 | 3,074 | 337,701 | 2024/8/31  |
|      | US TREASURY N/B | 2.125 | 2,000 | 2,103 | 231,003 | 2024/9/30  |
|      | US TREASURY N/B | 2.25  | 2,000 | 2,112 | 231,972 | 2024/10/31 |
|      | US TREASURY N/B | 2.125 | 2,400 | 2,526 | 277,492 | 2024/11/30 |
|      | US TREASURY N/B | 2.25  | 800   | 846   | 92,916  | 2024/12/31 |
|      | US TREASURY N/B | 1.75  | 2,000 | 2,083 | 228,841 | 2024/12/31 |
|      | US TREASURY N/B | 2.0   | 2,000 | 2,101 | 230,857 | 2025/2/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.625 | 2,500 | 2,683 | 294,749 | 2025/3/31  |
|      | US TREASURY N/B | 2.875 | 4,000 | 4,333 | 475,941 | 2025/4/30  |
|      | US TREASURY N/B | 0.375 | 500   | 496   | 54,548  | 2025/4/30  |
|      | US TREASURY N/B | 2.125 | 800   | 845   | 92,826  | 2025/5/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.875 | 2,000 | 2,169 | 238,288 | 2025/5/31  |
|      | US TREASURY N/B | 2.75  | 4,000 | 4,324 | 474,946 | 2025/6/30  |
|      | US TREASURY N/B | 2.875 | 2,000 | 2,173 | 238,742 | 2025/7/31  |
|      | US TREASURY N/B | 0.25  | 2,000 | 1,972 | 216,596 | 2025/7/31  |
|      | US TREASURY N/B | 2.0   | 2,780 | 2,929 | 321,774 | 2025/8/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.75  | 600   | 650   | 71,398  | 2025/8/31  |
|      | US TREASURY N/B | 3.0   | 3,000 | 3,283 | 360,649 | 2025/9/30  |
|      | US TREASURY N/B | 0.25  | 4,000 | 3,936 | 432,301 | 2025/9/30  |
|      | US TREASURY N/B | 0.25  | 4,000 | 3,933 | 432,026 | 2025/10/31 |
|      | US TREASURY N/B | 2.25  | 1,640 | 1,747 | 191,948 | 2025/11/15 |
|      | US TREASURY N/B | 2.625 | 2,500 | 2,708 | 297,431 | 2026/1/31  |
|      | US TREASURY N/B | 0.375 | 3,500 | 3,448 | 378,744 | 2026/1/31  |
|      | US TREASURY N/B | 1.625 | 2,200 | 2,287 | 251,243 | 2026/2/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.5   | 3,500 | 3,777 | 414,887 | 2026/2/28  |
|      | US TREASURY N/B | 2.25  | 3,000 | 3,205 | 352,103 | 2026/3/31  |
|      | US TREASURY N/B | 1.625 | 4,200 | 4,372 | 480,205 | 2026/5/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.125 | 3,500 | 3,724 | 409,045 | 2026/5/31  |
|      | US TREASURY N/B | 1.875 | 3,000 | 3,156 | 346,710 | 2026/6/30  |
|      | US TREASURY N/B | 1.875 | 2,500 | 2,632 | 289,086 | 2026/7/31  |
|      | US TREASURY N/B | 1.5   | 2,700 | 2,794 | 306,931 | 2026/8/15  |
|      | US TREASURY N/B | 1.375 | 4,000 | 4,114 | 451,864 | 2026/8/31  |
|      | US TREASURY N/B | 1.625 | 4,000 | 4,163 | 457,304 | 2026/9/30  |
|      | US TREASURY N/B | 2.0   | 2,600 | 2,757 | 302,847 | 2026/11/15 |
|      | US TREASURY N/B | 2.25  | 1,500 | 1,612 | 177,062 | 2027/2/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.375 | 3,800 | 4,113 | 451,801 | 2027/5/15  |
|      | US TREASURY N/B | 0.5   | 2,000 | 1,954 | 214,623 | 2027/5/31  |
|      | US TREASURY N/B | 0.5   | 1,500 | 1,464 | 160,858 | 2027/6/30  |
|      | US TREASURY N/B | 2.25  | 3,200 | 3,445 | 378,446 | 2027/8/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.25  | 600   | 646   | 70,976  | 2027/11/15 |

| 銘柄   | 銘柄              | 当 期 末 |       |       |         | 償還年月日      |
|------|-----------------|-------|-------|-------|---------|------------|
|      |                 | 利 率   | 額面金額  | 評 価 額 |         |            |
|      |                 |       |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |            |
|      |                 | %     | 千米ドル  | 千米ドル  | 千円      |            |
| アメリカ | 国債証券            |       |       |       |         |            |
|      | US TREASURY N/B | 2.75  | 3,200 | 3,549 | 389,882 | 2028/2/15  |
|      | US TREASURY N/B | 1.25  | 4,000 | 4,053 | 445,154 | 2028/4/30  |
|      | US TREASURY N/B | 2.875 | 2,500 | 2,796 | 307,148 | 2028/5/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.875 | 3,100 | 3,473 | 381,529 | 2028/8/15  |
|      | US TREASURY N/B | 3.125 | 5,000 | 5,701 | 626,224 | 2028/11/15 |
|      | US TREASURY N/B | 2.625 | 5,400 | 5,979 | 656,699 | 2029/2/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.375 | 3,200 | 3,489 | 383,210 | 2029/5/15  |
|      | US TREASURY N/B | 1.625 | 3,500 | 3,620 | 397,648 | 2029/8/15  |
|      | US TREASURY N/B | 1.75  | 1,700 | 1,776 | 195,069 | 2029/11/15 |
|      | US TREASURY N/B | 1.5   | 4,000 | 4,091 | 449,359 | 2030/2/15  |
|      | US TREASURY N/B | 6.25  | 500   | 708   | 77,867  | 2030/5/15  |
|      | US TREASURY N/B | 0.625 | 3,300 | 3,131 | 343,934 | 2030/5/15  |
|      | US TREASURY N/B | 0.625 | 5,500 | 5,203 | 571,525 | 2030/8/15  |
|      | US TREASURY N/B | 0.875 | 2,500 | 2,413 | 265,061 | 2030/11/15 |
|      | US TREASURY N/B | 5.375 | 500   | 684   | 75,186  | 2031/2/15  |
|      | US TREASURY N/B | 1.125 | 4,500 | 4,436 | 487,246 | 2031/2/15  |
|      | US TREASURY N/B | 1.625 | 400   | 411   | 45,236  | 2031/5/15  |
|      | US TREASURY N/B | 5.0   | 340   | 504   | 55,380  | 2037/5/15  |
|      | US TREASURY N/B | 4.5   | 1,760 | 2,507 | 275,347 | 2038/5/15  |
|      | US TREASURY N/B | 3.5   | 400   | 511   | 56,154  | 2039/2/15  |
|      | US TREASURY N/B | 4.25  | 800   | 1,117 | 122,769 | 2039/5/15  |
|      | US TREASURY N/B | 4.625 | 1,150 | 1,684 | 184,967 | 2040/2/15  |
|      | US TREASURY N/B | 3.875 | 340   | 456   | 50,184  | 2040/8/15  |
|      | US TREASURY N/B | 1.125 | 1,200 | 1,062 | 116,742 | 2040/8/15  |
|      | US TREASURY N/B | 4.25  | 2,800 | 3,945 | 433,296 | 2040/11/15 |
|      | US TREASURY N/B | 4.75  | 300   | 449   | 49,369  | 2041/2/15  |
|      | US TREASURY N/B | 3.125 | 500   | 610   | 67,017  | 2041/11/15 |
|      | US TREASURY N/B | 2.75  | 500   | 577   | 63,386  | 2042/11/15 |
|      | US TREASURY N/B | 3.125 | 800   | 978   | 107,420 | 2043/2/15  |
|      | US TREASURY N/B | 3.625 | 1,500 | 1,974 | 216,845 | 2043/8/15  |
|      | US TREASURY N/B | 3.625 | 700   | 924   | 101,539 | 2044/2/15  |
|      | US TREASURY N/B | 3.125 | 2,500 | 3,073 | 337,544 | 2044/8/15  |
|      | US TREASURY N/B | 3.0   | 1,600 | 1,929 | 211,958 | 2044/11/15 |
|      | US TREASURY N/B | 2.5   | 1,700 | 1,888 | 207,373 | 2045/2/15  |
|      | US TREASURY N/B | 3.0   | 2,540 | 3,072 | 337,431 | 2045/5/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.875 | 2,760 | 3,272 | 359,458 | 2045/8/15  |
|      | US TREASURY N/B | 3.0   | 3,020 | 3,662 | 402,247 | 2045/11/15 |
|      | US TREASURY N/B | 2.5   | 2,530 | 2,815 | 309,184 | 2046/2/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.5   | 3,400 | 3,787 | 415,986 | 2046/5/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.25  | 4,030 | 4,286 | 470,796 | 2046/8/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.875 | 2,300 | 2,741 | 301,117 | 2046/11/15 |
|      | US TREASURY N/B | 3.0   | 1,000 | 1,220 | 134,014 | 2047/5/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.75  | 3,520 | 4,112 | 451,674 | 2047/8/15  |
|      | US TREASURY N/B | 2.75  | 2,600 | 3,039 | 333,846 | 2047/11/15 |
|      | US TREASURY N/B | 3.0   | 1,400 | 1,712 | 188,040 | 2048/2/15  |
|      | US TREASURY N/B | 3.125 | 1,800 | 2,254 | 247,557 | 2048/5/15  |
|      | US TREASURY N/B | 3.0   | 900   | 1,103 | 121,164 | 2048/8/15  |

| 銘    | 柄    | 当 期 末               |        |        |        | 償還年月日      |            |
|------|------|---------------------|--------|--------|--------|------------|------------|
|      |      | 利 率                 | 額面金額   | 評 価 額  |        |            |            |
|      |      |                     |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額 |            |            |
| アメリカ |      | %                   | 千米ドル   | 千米ドル   | 千円     |            |            |
|      | 国債証券 | US TREASURY N/B     | 2.875  | 500    | 601    | 66,084     | 2049/5/15  |
|      |      | US TREASURY N/B     | 2.25   | 1,300  | 1,387  | 152,360    | 2049/8/15  |
|      |      | US TREASURY N/B     | 2.375  | 1,400  | 1,534  | 168,579    | 2049/11/15 |
|      |      | US TREASURY N/B     | 1.25   | 2,900  | 2,450  | 269,138    | 2050/5/15  |
|      |      | US TREASURY N/B     | 1.375  | 2,700  | 2,352  | 258,361    | 2050/8/15  |
|      |      | US TREASURY N/B     | 1.625  | 1,900  | 1,761  | 193,458    | 2050/11/15 |
|      |      | US TREASURY N/B     | 1.875  | 400    | 393    | 43,200     | 2051/2/15  |
| 小    | 計    |                     |        |        |        | 38,822,450 |            |
| カナダ  |      |                     | 千カナダドル | 千カナダドル |        |            |            |
|      | 国債証券 | CANADIAN GOVERNMENT | 1.75   | 1,000  | 1,021  | 89,454     | 2023/3/1   |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5    | 1,000  | 1,020  | 89,337     | 2023/6/1   |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0    | 150    | 154    | 13,549     | 2023/9/1   |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25   | 600    | 626    | 54,840     | 2024/3/1   |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 2.5    | 1,060  | 1,117  | 97,839     | 2024/6/1   |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5    | 3,000  | 3,083  | 270,018    | 2024/9/1   |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25   | 1,000  | 1,021  | 89,480     | 2025/3/1   |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 0.25   | 600    | 585    | 51,314     | 2026/3/1   |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5    | 1,000  | 1,033  | 90,487     | 2026/6/1   |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0    | 1,000  | 1,006  | 88,156     | 2027/6/1   |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0    | 400    | 427    | 37,401     | 2028/6/1   |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75   | 1,020  | 1,376  | 120,500    | 2029/6/1   |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25   | 1,700  | 1,854  | 162,395    | 2029/6/1   |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75   | 600    | 884    | 77,456     | 2033/6/1   |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 5.0    | 400    | 598    | 52,447     | 2037/6/1   |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 4.0    | 780    | 1,099  | 96,257     | 2041/6/1   |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75   | 1,540  | 1,886  | 165,196    | 2048/12/1  |
|      |      | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0    | 200    | 211    | 18,555     | 2051/12/1  |
| 小    | 計    |                     |        |        |        | 1,664,690  |            |
| イギリス |      |                     | 千英ポンド  | 千英ポンド  |        |            |            |
|      | 国債証券 | UK TREASURY         | 0.125  | 600    | 600    | 91,304     | 2023/1/31  |
|      |      | UK TREASURY         | 0.75   | 1,100  | 1,113  | 169,375    | 2023/7/22  |
|      |      | UK TREASURY         | 2.25   | 950    | 990    | 150,707    | 2023/9/7   |
|      |      | UK TREASURY         | 1.0    | 500    | 511    | 77,752     | 2024/4/22  |
|      |      | UK TREASURY         | 2.75   | 1,200  | 1,292  | 196,633    | 2024/9/7   |
|      |      | UK TREASURY         | 0.625  | 1,000  | 1,015  | 154,445    | 2025/6/7   |
|      |      | UK TREASURY         | 1.5    | 1,370  | 1,450  | 220,653    | 2026/7/22  |
|      |      | UK TREASURY         | 1.25   | 1,000  | 1,050  | 159,864    | 2027/7/22  |
|      |      | UK TREASURY         | 4.25   | 300    | 371    | 56,482     | 2027/12/7  |
|      |      | UK TREASURY         | 1.625  | 900    | 973    | 148,152    | 2028/10/22 |
|      |      | UK TREASURY         | 6.0    | 90     | 125    | 19,074     | 2028/12/7  |
|      |      | UK TREASURY         | 0.875  | 1,200  | 1,230  | 187,216    | 2029/10/22 |
|      |      | UK TREASURY         | 0.375  | 1,700  | 1,660  | 252,610    | 2030/10/22 |
|      |      | UK TREASURY         | 4.75   | 600    | 822    | 125,169    | 2030/12/7  |
|      |      | UK TREASURY         | 4.25   | 600    | 818    | 124,511    | 2032/6/7   |
|      |      | UK TREASURY         | 4.5    | 200    | 290    | 44,163     | 2034/9/7   |
|      |      | UK TREASURY         | 4.25   | 1,160  | 1,688  | 256,879    | 2036/3/7   |
|      |      | UK TREASURY         | 1.75   | 1,170  | 1,304  | 198,443    | 2037/9/7   |

| 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                | 4.25  | 400         | 615         | 93,588    | 2039/9/7   |
|        |      | UK TREASURY                | 1.25  | 700         | 724         | 110,292   | 2041/10/22 |
|        |      | UK TREASURY                | 4.5   | 850         | 1,411       | 214,735   | 2042/12/7  |
|        |      | UK TREASURY                | 3.5   | 1,000       | 1,503       | 228,730   | 2045/1/22  |
|        |      | UK TREASURY                | 4.25  | 2,180       | 3,713       | 564,914   | 2046/12/7  |
|        |      | UK TREASURY                | 1.5   | 1,400       | 1,535       | 233,639   | 2047/7/22  |
|        |      | UK TREASURY                | 1.75  | 1,150       | 1,337       | 203,411   | 2049/1/22  |
|        |      | UK TREASURY                | 4.25  | 1,240       | 2,208       | 336,017   | 2049/12/7  |
|        |      | UK TREASURY                | 3.75  | 860         | 1,473       | 224,101   | 2052/7/22  |
|        |      | UK TREASURY                | 1.625 | 300         | 348         | 53,041    | 2054/10/22 |
|        |      | UK TREASURY                | 4.0   | 200         | 393         | 59,848    | 2060/1/22  |
|        |      | UK TREASURY                | 3.5   | 530         | 1,044       | 158,953   | 2068/7/22  |
|        |      | UK TSY 0 5/8% 2050         | 0.625 | 500         | 445         | 67,784    | 2050/10/22 |
|        |      | UK TSY 3 1/4% 2044         | 3.25  | 100         | 143         | 21,823    | 2044/1/22  |
|        |      | UNITED KINGDOM(GOVERNMENT) | 4.25  | 780         | 1,508       | 229,459   | 2055/12/7  |
| 小      | 計    |                            |       |             |             | 5,433,781 |            |
| 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         | 1.5   | 3,000       | 3,118       | 40,010    | 2023/11/13 |
|        |      | SWEDISH GOVERNMENT         | 2.5   | 250         | 274         | 3,527     | 2025/5/12  |
|        |      | SWEDISH GOVERNMENT         | 1.0   | 2,700       | 2,853       | 36,610    | 2026/11/12 |
|        |      | SWEDISH GOVERNMENT         | 0.75  | 4,000       | 4,197       | 53,847    | 2028/5/12  |
|        |      | SWEDISH GOVERNMENT         | 0.75  | 3,500       | 3,679       | 47,204    | 2029/11/12 |
|        |      | SWEDISH GOVERNMENT         | 0.125 | 4,000       | 3,964       | 50,868    | 2031/5/12  |
|        |      | SWEDISH GOVERNMENT         | 3.5   | 1,600       | 2,406       | 30,873    | 2039/3/30  |
| 小      | 計    |                            |       |             |             | 262,941   |            |
| ノルウェー  |      |                            |       | 千ノルウェークローネ  | 千ノルウェークローネ  |           |            |
|        | 国債証券 | NORWEGIAN GOVERNMENT       | 2.0   | 1,900       | 1,944       | 24,601    | 2023/5/24  |
|        |      | NORWEGIAN GOVERNMENT       | 3.0   | 2,750       | 2,895       | 36,634    | 2024/3/14  |
|        |      | NORWEGIAN GOVERNMENT       | 1.5   | 1,700       | 1,735       | 21,948    | 2026/2/19  |
|        |      | NORWEGIAN GOVERNMENT       | 1.75  | 1,750       | 1,807       | 22,862    | 2027/2/17  |
|        |      | NORWEGIAN GOVERNMENT       | 2.0   | 1,500       | 1,580       | 19,994    | 2028/4/26  |
|        |      | NORWEGIAN GOVERNMENT       | 1.375 | 2,000       | 2,016       | 25,514    | 2030/8/19  |
| 小      | 計    |                            |       |             |             | 151,556   |            |
| デンマーク  |      |                            |       | 千デンマーククローネ  | 千デンマーククローネ  |           |            |
|        | 国債証券 | KINGDOM OF DENMARK         | 1.5   | 1,650       | 1,722       | 30,208    | 2023/11/15 |
|        |      | KINGDOM OF DENMARK         | 1.75  | 3,400       | 3,721       | 65,271    | 2025/11/15 |
|        |      | KINGDOM OF DENMARK         | 0.5   | 2,300       | 2,421       | 42,472    | 2027/11/15 |
|        |      | KINGDOM OF DENMARK         | 0.5   | 6,400       | 6,781       | 118,946   | 2029/11/15 |
|        |      | KINGDOM OF DENMARK         | 4.5   | 4,900       | 8,745       | 153,396   | 2039/11/15 |
|        |      | KINGDOM OF DENMARK         | 0.25  | 1,000       | 958         | 16,803    | 2052/11/15 |
| 小      | 計    |                            |       |             |             | 427,098   |            |
| ユーロ    |      |                            |       | 千ユーロ        | 千ユーロ        |           |            |
| ドイツ    | 国債証券 | BUNDESobligation           | —     | 1,000       | 1,007       | 131,448   | 2022/10/7  |
|        |      | BUNDESobligation           | —     | 1,100       | 1,117       | 145,785   | 2023/10/13 |
|        |      | BUNDESobligation           | —     | 1,000       | 1,019       | 132,982   | 2024/4/5   |
|        |      | BUNDESobligation           | —     | 1,500       | 1,540       | 200,892   | 2025/4/11  |
|        |      | BUNDESobligation           | —     | 1,000       | 1,033       | 134,734   | 2026/4/10  |

| 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        |         |            |
| ドイツ                      | 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5   | 1,310   | 1,359     | 177,371 | 2023/5/15  |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.0   | 700     | 737       | 96,239  | 2023/8/15  |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25  | 400     | 466       | 60,784  | 2024/1/4   |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.75  | 610     | 647       | 84,494  | 2024/2/15  |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5   | 700     | 742       | 96,904  | 2024/5/15  |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0   | 440     | 463       | 60,396  | 2024/8/15  |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5   | 1,000   | 1,043     | 136,135 | 2025/2/15  |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0   | 2,000   | 2,139     | 279,010 | 2025/8/15  |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5   | 900     | 949       | 123,846 | 2026/2/15  |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 300     | 310       | 40,505  | 2026/8/15  |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.25  | 2,270   | 2,386     | 311,270 | 2027/2/15  |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.5   | 2,300   | 3,284     | 428,393 | 2027/7/4   |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5   | 850     | 909       | 118,583 | 2027/8/15  |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5   | 1,000   | 1,073     | 140,033 | 2028/2/15  |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75  | 1,000   | 1,375     | 179,449 | 2028/7/4   |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 1,400   | 1,458     | 190,285 | 2029/8/15  |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25  | 500     | 790       | 103,135 | 2030/1/4   |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 1,500   | 1,562     | 203,846 | 2030/2/15  |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 2,000   | 2,081     | 271,536 | 2030/8/15  |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.5   | 1,100   | 1,731     | 225,839 | 2031/1/4   |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75  | 1,400   | 2,332     | 304,226 | 2034/7/4   |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 100     | 102       | 13,337  | 2035/5/15  |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.0   | 1,400   | 2,317     | 302,304 | 2037/1/4   |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.25  | 1,310   | 2,353     | 306,953 | 2039/7/4   |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75  | 60      | 115       | 15,113  | 2040/7/4   |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25  | 750     | 1,273     | 166,146 | 2042/7/4   |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5   | 1,100   | 1,737     | 226,595 | 2044/7/4   |
|                          |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5   | 1,410   | 2,275     | 296,795 | 2046/8/15  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.25 | 600                      | 785   | 102,391 | 2048/8/15 |         |            |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —    | 1,300                    | 1,250 | 163,102 | 2050/8/15 |         |            |
| イタリア                     | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.5   | 200     | 213       | 27,891  | 2022/11/1  |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.05  | 1,800   | 1,813     | 236,494 | 2023/1/15  |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.95  | 2,100   | 2,145     | 279,849 | 2023/3/15  |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5   | 1,150   | 1,245     | 162,417 | 2023/5/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.45  | 2,500   | 2,647     | 345,313 | 2023/10/1  |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.65  | 1,000   | 1,022     | 133,416 | 2023/10/15 |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 9.0   | 180     | 216       | 28,245  | 2023/11/1  |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5   | 2,200   | 2,466     | 321,723 | 2024/3/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75  | 1,500   | 1,681     | 219,298 | 2024/9/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.45  | 700     | 738       | 96,267  | 2024/11/15 |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5   | 1,500   | 1,633     | 213,096 | 2024/12/1  |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.35  | 2,000   | 2,038     | 265,920 | 2025/2/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0   | 1,350   | 1,596     | 208,285 | 2025/3/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.45  | 500     | 530       | 69,127  | 2025/5/15  |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.5   | 800     | 850       | 110,886 | 2025/6/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.85  | 1,000   | 1,076     | 140,381 | 2025/7/1   |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.0  | 1,530                    | 1,666 | 217,338 | 2025/12/1 |         |            |

| 銘柄                       |      |                          | 当 期 末 |         |          |         | 償還年月日      |
|--------------------------|------|--------------------------|-------|---------|----------|---------|------------|
|                          |      |                          | 利 率   | 額面金額    | 評 価 額    |         |            |
|                          |      |                          |       |         | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |
| ユーロ                      |      |                          | %     | 千ユーロ    | 千ユーロ     | 千円      |            |
| イタリア                     | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.5   | 2,000   | 2,049    | 267,290 | 2026/2/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5   | 1,000   | 1,205    | 157,207 | 2026/3/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.6   | 550     | 592      | 77,224  | 2026/6/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.25  | 1,100   | 1,168    | 152,454 | 2026/12/1  |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.2   | 1,500   | 1,678    | 218,868 | 2027/6/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.5   | 400     | 553      | 72,206  | 2027/11/1  |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.0   | 800     | 889      | 115,999 | 2028/2/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.5   | 600     | 607      | 79,181  | 2028/7/15  |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75  | 2,040   | 2,659    | 346,884 | 2028/9/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.25  | 1,000   | 1,386    | 180,828 | 2029/11/1  |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5   | 800     | 999      | 130,356 | 2030/3/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.35  | 1,000   | 1,069    | 139,468 | 2030/4/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.95  | 3,100   | 3,201    | 417,554 | 2030/8/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.65  | 1,700   | 1,858    | 242,377 | 2030/12/1  |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.0   | 700     | 1,053    | 137,371 | 2031/5/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.65  | 500     | 545      | 71,103  | 2032/3/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.75  | 1,000   | 1,535    | 200,288 | 2033/2/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.45  | 1,070   | 1,257    | 164,052 | 2033/9/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0   | 1,610   | 2,395    | 312,384 | 2034/8/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.35  | 800     | 1,031    | 134,499 | 2035/3/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.45  | 300     | 314      | 40,987  | 2036/3/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.25  | 100     | 115      | 15,038  | 2036/9/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0   | 1,580   | 2,201    | 287,171 | 2037/2/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.95  | 400     | 504      | 65,809  | 2038/9/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0   | 350     | 555      | 72,515  | 2039/8/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0   | 300     | 482      | 62,895  | 2040/9/1   |
|                          |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.8   | 800     | 851      | 111,022 | 2041/3/1   |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 2,180                    | 3,537 | 461,365 | 2044/9/1 |         |            |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.25 | 860                      | 1,149 | 149,914 | 2046/9/1 |         |            |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.7  | 500                      | 612   | 79,914  | 2047/3/1 |         |            |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.45 | 800                      | 1,116 | 145,559 | 2048/3/1 |         |            |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.85 | 900                      | 1,338 | 174,636 | 2049/9/1 |         |            |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.7  | 300                      | 299   | 39,074  | 2051/9/1 |         |            |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.8  | 10                       | 12    | 1,574   | 2067/3/1 |         |            |
| フランス                     | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 500     | 505      | 65,883  | 2023/2/25  |
|                          |      | FRANCE (GOVT OF)         | 1.75  | 300     | 312      | 40,783  | 2023/5/25  |
|                          |      | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 2,000   | 2,034    | 265,333 | 2024/3/25  |
|                          |      | FRANCE (GOVT OF)         | 2.25  | 2,010   | 2,171    | 283,243 | 2024/5/25  |
|                          |      | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 3,100   | 3,169    | 413,343 | 2025/3/25  |
|                          |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.5   | 600     | 625      | 81,568  | 2025/5/25  |
|                          |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.5   | 1,100   | 1,155    | 150,672 | 2026/5/25  |
|                          |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.25  | 1,050   | 1,092    | 142,447 | 2026/11/25 |
|                          |      | FRANCE (GOVT OF)         | 1.0   | 800     | 867      | 113,206 | 2027/5/25  |
|                          |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.75  | 2,300   | 2,476    | 322,989 | 2028/5/25  |
|                          |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.75  | 1,000   | 1,078    | 140,719 | 2028/11/25 |
|                          |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.5   | 1,500   | 1,590    | 207,452 | 2029/5/25  |
|                          |      | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 3,700   | 3,766    | 491,316 | 2029/11/25 |



| 銘柄                      |      |                          | 当 期 末 |         |            |         | 償還年月日      |
|-------------------------|------|--------------------------|-------|---------|------------|---------|------------|
|                         |      |                          | 利 率   | 額面金額    | 評 価 額      |         |            |
|                         |      |                          |       |         | 外貨建金額      | 邦貨換算金額  |            |
| ユーロ                     |      |                          | %     | 千ユーロ    | 千ユーロ       | 千円      |            |
| フランス                    | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF)         | 2.5   | 2,720   | 3,367      | 439,163 | 2030/5/25  |
|                         |      | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 1,500   | 1,517      | 197,864 | 2030/11/25 |
|                         |      | FRANCE (GOVT OF)         | 1.25  | 1,200   | 1,365      | 178,112 | 2034/5/25  |
|                         |      | FRANCE (GOVT OF)         | 1.25  | 1,550   | 1,771      | 231,076 | 2036/5/25  |
|                         |      | FRANCE (GOVT OF)         | 1.75  | 1,260   | 1,564      | 204,086 | 2039/6/25  |
|                         |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.5   | 700     | 704        | 91,847  | 2040/5/25  |
|                         |      | FRANCE (GOVT OF)         | 2.0   | 1,510   | 2,000      | 260,953 | 2048/5/25  |
|                         |      | FRANCE (GOVT OF)         | 1.5   | 600     | 719        | 93,904  | 2050/5/25  |
|                         |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.75  | 2,400   | 2,378      | 310,207 | 2052/5/25  |
|                         |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 2.25  | 610     | 630        | 82,238  | 2022/10/25 |
|                         |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 4.25  | 1,800   | 1,991      | 259,800 | 2023/10/25 |
|                         |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 1.75  | 2,100   | 2,264      | 295,361 | 2024/11/25 |
|                         |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 6.0   | 1,100   | 1,404      | 183,157 | 2025/10/25 |
|                         |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 1.0   | 2,100   | 2,242      | 292,514 | 2025/11/25 |
|                         |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | —     | 1,000   | 1,025      | 133,714 | 2026/2/25  |
|                         |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 3.5   | 2,410   | 2,870      | 374,453 | 2026/4/25  |
|                         |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 2.75  | 900     | 1,079      | 140,758 | 2027/10/25 |
|                         |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 5.5   | 1,200   | 1,740      | 226,965 | 2029/4/25  |
|                         |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 1.5   | 1,640   | 1,895      | 247,265 | 2031/5/25  |
|                         |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 5.75  | 300     | 493        | 64,341  | 2032/10/25 |
|                         |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 4.75  | 2,290   | 3,717      | 484,859 | 2035/4/25  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0  | 400                      | 645   | 84,173  | 2038/10/25 |         |            |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.5  | 720                      | 1,270 | 165,745 | 2041/4/25  |         |            |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.25 | 1,800                    | 2,873 | 374,773 | 2045/5/25  |         |            |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0  | 400                      | 779   | 101,667 | 2055/4/25  |         |            |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0  | 900                      | 1,836 | 239,549 | 2060/4/25  |         |            |
| オランダ                    | 国債証券 | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 3.75  | 630     | 668        | 87,199  | 2023/1/15  |
|                         |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 7.5   | 300     | 333        | 43,546  | 2023/1/15  |
|                         |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 1.75  | 300     | 314        | 40,963  | 2023/7/15  |
|                         |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 2.0   | 1,000   | 1,080      | 140,981 | 2024/7/15  |
|                         |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 0.25  | 700     | 725        | 94,686  | 2025/7/15  |
|                         |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 0.5   | 400     | 422        | 55,161  | 2026/7/15  |
|                         |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 0.75  | 1,100   | 1,186      | 154,797 | 2027/7/15  |
|                         |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 5.5   | 1,100   | 1,529      | 199,513 | 2028/1/15  |
|                         |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | —     | 1,000   | 1,028      | 134,195 | 2030/7/15  |
|                         |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 2.5   | 1,150   | 1,507      | 196,645 | 2033/1/15  |
|                         |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 4.0   | 400     | 650        | 84,862  | 2037/1/15  |
|                         |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | —     | 300     | 297        | 38,866  | 2038/1/15  |
|                         |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 3.75  | 610     | 1,068      | 139,343 | 2042/1/15  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 2.75 | 1,050                    | 1,744 | 227,528 | 2047/1/15  |         |            |
| スペイン                    | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.45  | 3,400   | 3,435      | 448,118 | 2022/10/31 |
|                         |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.4   | 900     | 976        | 127,357 | 2023/1/31  |
|                         |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | —     | 600     | 606        | 79,064  | 2023/4/30  |
|                         |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.35  | 300     | 305        | 39,845  | 2023/7/30  |
|                         |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.4   | 1,940   | 2,150      | 280,537 | 2023/10/31 |
|                         |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.8   | 1,920   | 2,143      | 279,587 | 2024/4/30  |
|                         |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.75  | 1,400   | 1,546      | 201,710 | 2024/10/31 |

| 銘柄                 |      |                          | 当 期 末 |         |           |         |            |
|--------------------|------|--------------------------|-------|---------|-----------|---------|------------|
|                    |      |                          | 利 率   | 額面金額    | 評 価 額     |         | 償還年月日      |
|                    |      |                          |       |         | 外貨建金額     | 邦貨換算金額  |            |
| ユーロ                |      |                          | %     | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円      |            |
| スペイン               | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.6   | 800     | 861       | 112,363 | 2025/4/30  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.65  | 1,000   | 1,202     | 156,777 | 2025/7/30  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.15  | 700     | 776       | 101,233 | 2025/10/31 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.95  | 720     | 798       | 104,126 | 2026/4/30  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.9   | 400     | 523       | 68,313  | 2026/7/30  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.3   | 1,000   | 1,084     | 141,514 | 2026/10/31 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.5   | 1,500   | 1,650     | 215,336 | 2027/4/30  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.8   | 800     | 847       | 110,547 | 2027/7/30  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.45  | 1,300   | 1,432     | 186,904 | 2027/10/31 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4   | 1,600   | 1,761     | 229,787 | 2028/4/30  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4   | 900     | 994       | 129,665 | 2028/7/30  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15  | 330     | 454       | 59,251  | 2028/10/31 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.6   | 800     | 835       | 108,956 | 2029/10/31 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.5   | 2,000   | 2,065     | 269,430 | 2030/4/30  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.95  | 1,000   | 1,160     | 151,375 | 2030/7/30  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.25  | 600     | 658       | 85,911  | 2030/10/31 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.35  | 2,100   | 2,556     | 333,476 | 2033/7/30  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.85  | 400     | 465       | 60,735  | 2035/7/30  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.9   | 400     | 685       | 89,362  | 2040/7/30  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.2   | 500     | 521       | 67,995  | 2040/10/31 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.7   | 1,000   | 1,689     | 220,362 | 2041/7/30  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15  | 900     | 1,667     | 217,541 | 2044/10/31 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.9   | 950     | 1,324     | 172,733 | 2046/10/31 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.7   | 600     | 813       | 106,051 | 2048/10/31 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.0   | 1,200   | 1,126     | 146,935 | 2050/10/31 |
|                    |      | SPANISH GOVERNMENT       | 6.0   | 90      | 130       | 17,032  | 2029/1/31  |
| SPANISH GOVERNMENT | 5.75 | 1,100                    | 1,739 | 226,945 | 2032/7/30 |         |            |
| SPANISH GOVERNMENT | 4.2  | 710                      | 1,078 | 140,613 | 2037/1/31 |         |            |
| ベルギー               | 国債証券 | BELGIUM KINGDOM          | 4.25  | 700     | 736       | 96,112  | 2022/9/28  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 2.25  | 200     | 210       | 27,478  | 2023/6/22  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.2   | 600     | 611       | 79,803  | 2023/10/22 |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 2.6   | 230     | 251       | 32,791  | 2024/6/22  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.5   | 300     | 311       | 40,603  | 2024/10/22 |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 1.0   | 1,100   | 1,184     | 154,463 | 2026/6/22  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.8   | 950     | 1,023     | 133,484 | 2027/6/22  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | —     | 1,000   | 1,029     | 134,260 | 2027/10/22 |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.8   | 300     | 325       | 42,405  | 2028/6/22  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.9   | 1,400   | 1,532     | 199,942 | 2029/6/22  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 1.0   | 1,200   | 1,333     | 173,898 | 2031/6/22  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 4.0   | 550     | 788       | 102,909 | 2032/3/28  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 1.45  | 500     | 589       | 76,917  | 2037/6/22  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 1.9   | 720     | 903       | 117,831 | 2038/6/22  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 4.25  | 300     | 512       | 66,844  | 2041/3/28  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 3.75  | 650     | 1,106     | 144,265 | 2045/6/22  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 1.6   | 500     | 608       | 79,399  | 2047/6/22  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 1.7   | 700     | 873       | 113,943 | 2050/6/22  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 2.15  | 370     | 542       | 70,694  | 2066/6/22  |

| 銘柄                  |       |                        | 当 期 末 |           |           |            |            |
|---------------------|-------|------------------------|-------|-----------|-----------|------------|------------|
|                     |       |                        | 利 率   | 額面金額      | 評 価 額     |            | 償還年月日      |
|                     |       |                        |       |           | 外貨建金額     | 邦貨換算金額     |            |
| ユーロ                 |       |                        | %     | 千ユーロ      | 千ユーロ      | 千円         |            |
| ベルギー                | 国債証券  | BELGIUM KINGDOM GOVT   | 5.0   | 370       | 613       | 80,047     | 2035/3/28  |
| オーストリア              | 国債証券  | REPUBLIC OF AUSTRIA    | —     | 700       | 705       | 91,978     | 2022/9/20  |
|                     |       | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 1.75  | 120       | 126       | 16,495     | 2023/10/20 |
|                     |       | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 1.65  | 1,500     | 1,613     | 210,422    | 2024/10/21 |
|                     |       | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 0.75  | 300       | 320       | 41,819     | 2026/10/20 |
|                     |       | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 0.5   | 400       | 423       | 55,266     | 2027/4/20  |
|                     |       | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 0.75  | 700       | 754       | 98,472     | 2028/2/20  |
|                     |       | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 0.5   | 1,500     | 1,592     | 207,755    | 2029/2/20  |
|                     |       | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 2.4   | 530       | 689       | 89,963     | 2034/5/23  |
|                     |       | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 4.15  | 230       | 372       | 48,616     | 2037/3/15  |
|                     |       | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 3.15  | 400       | 650       | 84,815     | 2044/6/20  |
|                     |       | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 1.5   | 400       | 503       | 65,689     | 2047/2/20  |
|                     |       | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 0.75  | 400       | 428       | 55,913     | 2051/3/20  |
|                     |       | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 3.8   | 330       | 710       | 92,664     | 2062/1/26  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.5   | 210                    | 284   | 37,135    | 2086/11/2 |            |            |
| フィンランド              | 国債証券  | FINNISH GOVERNMENT     | 1.625 | 300       | 307       | 40,075     | 2022/9/15  |
|                     |       | FINNISH GOVERNMENT     | 1.5   | 150       | 155       | 20,277     | 2023/4/15  |
|                     |       | FINNISH GOVERNMENT     | 2.0   | 200       | 214       | 27,960     | 2024/4/15  |
|                     |       | FINNISH GOVERNMENT     | 0.5   | 810       | 852       | 111,193    | 2026/4/15  |
|                     |       | FINNISH GOVERNMENT     | 2.75  | 740       | 905       | 118,123    | 2028/7/4   |
|                     |       | FINNISH GOVERNMENT     | —     | 300       | 306       | 39,941     | 2030/9/15  |
|                     |       | FINNISH GOVERNMENT     | 1.125 | 500       | 572       | 74,614     | 2034/4/15  |
|                     |       | FINNISH GOVERNMENT     | 0.125 | 400       | 400       | 52,296     | 2036/4/15  |
|                     |       | FINNISH GOVERNMENT     | 2.625 | 160       | 239       | 31,212     | 2042/7/4   |
| FINNISH GOVERNMENT  | 1.375 | 200                    | 253   | 33,033    | 2047/4/15 |            |            |
| アイルランド              | 国債証券  | IRISH GOVERNMENT       | 0.9   | 800       | 867       | 113,155    | 2028/5/15  |
|                     |       | IRISH TSY 0.2% 2030    | 0.2   | 1,100     | 1,129     | 147,348    | 2030/10/18 |
|                     |       | IRISH TSY 1% 2026      | 1.0   | 650       | 697       | 90,922     | 2026/5/15  |
|                     |       | IRISH TSY 1.5% 2050    | 1.5   | 200       | 238       | 31,063     | 2050/5/15  |
|                     |       | IRISH TSY 1.7% 2037    | 1.7   | 550       | 665       | 86,766     | 2037/5/15  |
|                     |       | IRISH TSY 2% 2045      | 2.0   | 450       | 589       | 76,894     | 2045/2/18  |
|                     |       | IRISH TSY 2022         | —     | 1,000     | 1,007     | 131,357    | 2022/10/18 |
|                     |       | IRISH TSY 3.4% 2024    | 3.4   | 500       | 551       | 71,941     | 2024/3/18  |
| REPUBLIC OF IRELAND | 3.9   | 80                     | 85    | 11,171    | 2023/3/20 |            |            |
| 小 計                 |       |                        |       |           |           | 34,449,689 |            |
| ポーランド               |       |                        |       | 千ズロチ      | 千ズロチ      |            |            |
|                     | 国債証券  | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5   | 8,700     | 8,960     | 259,296    | 2023/1/25  |
|                     |       | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.25  | 3,000     | 3,129     | 90,568     | 2024/10/25 |
|                     |       | POLAND GOVERNMENT BOND | 1.25  | 5,000     | 4,775     | 138,175    | 2030/10/25 |
| 小 計                 |       |                        |       |           |           | 488,040    |            |
| シンガポール              |       |                        |       | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル |            |            |
|                     | 国債証券  | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2.75  | 1,400     | 1,460     | 119,502    | 2023/7/1   |
|                     |       | SINGAPORE GOVERNMENT   | 3.0   | 400       | 429       | 35,187     | 2024/9/1   |
|                     |       | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2.375 | 400       | 426       | 34,883     | 2025/6/1   |
|                     |       | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2.125 | 700       | 743       | 60,883     | 2026/6/1   |
|                     |       | SINGAPORE GOVERNMENT   | 3.5   | 730       | 829       | 67,868     | 2027/3/1   |
|                     |       | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2.625 | 300       | 329       | 26,982     | 2028/5/1   |

| 銘       | 柄    | 当 期 末                   |           |           |        | 償還年月日     |            |
|---------|------|-------------------------|-----------|-----------|--------|-----------|------------|
|         |      | 利 率                     | 額面金額      | 評 価 額     |        |           |            |
|         |      |                         |           | 外貨建金額     | 邦貨換算金額 |           |            |
| 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    | 2.875     | 400       | 450    | 36,837    | 2029/7/1   |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT    | 2.875     | 1,210     | 1,368  | 111,988   | 2030/9/1   |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT    | 2.25      | 900       | 969    | 79,371    | 2036/8/1   |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT    | 2.375     | 700       | 767    | 62,844    | 2039/7/1   |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT    | 2.75      | 500       | 587    | 48,101    | 2046/3/1   |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT    | 1.875     | 400       | 405    | 33,171    | 2050/3/1   |
| 小       | 計    |                         |           |           |        | 717,624   |            |
| オーストラリア |      |                         | 千豪ドル      | 千豪ドル      |        |           |            |
|         | 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 2.25      | 1,200     | 1,232  | 100,593   | 2022/11/21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 5.5       | 800       | 871    | 71,121    | 2023/4/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 2.75      | 1,000     | 1,071  | 87,477    | 2024/4/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 0.25      | 1,100     | 1,098  | 89,716    | 2024/11/21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 3.25      | 1,340     | 1,478  | 120,707   | 2025/4/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 4.25      | 520       | 607    | 49,605    | 2026/4/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 4.75      | 820       | 1,002  | 81,859    | 2027/4/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 2.75      | 900       | 1,006  | 82,154    | 2027/11/21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 2.25      | 820       | 891    | 72,805    | 2028/5/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 2.75      | 900       | 1,014  | 82,863    | 2028/11/21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 3.25      | 1,000     | 1,168  | 95,375    | 2029/4/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 2.75      | 800       | 905    | 73,952    | 2029/11/21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 2.5       | 1,600     | 1,788  | 146,038   | 2030/5/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 1.0       | 200       | 197    | 16,108    | 2030/12/21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 1.5       | 1,200     | 1,235  | 100,839   | 2031/6/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 1.0       | 150       | 146    | 11,947    | 2031/11/21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 1.25      | 500       | 499    | 40,807    | 2032/5/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 4.5       | 1,170     | 1,577  | 128,759   | 2033/4/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 2.75      | 300       | 347    | 28,376    | 2035/6/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 3.75      | 150       | 193    | 15,836    | 2037/4/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 3.25      | 320       | 390    | 31,864    | 2039/6/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 2.75      | 1,100     | 1,255  | 102,479   | 2041/5/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 3.0       | 270       | 318    | 26,014    | 2047/3/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT   | 1.75      | 500       | 456    | 37,264    | 2051/6/21  |
| 小       | 計    |                         |           |           |        | 1,694,569 |            |
| イスラエル   |      |                         | 千新シェケル    | 千新シェケル    |        |           |            |
|         | 国債証券 | ISRAEL FIXED BOND       | 1.5       | 1,500     | 1,546  | 53,010    | 2023/11/30 |
|         |      | ISRAEL FIXED BOND       | 3.75      | 1,500     | 1,638  | 56,139    | 2024/3/31  |
|         |      | ISRAEL FIXED BOND       | 0.5       | 2,500     | 2,523  | 86,485    | 2025/4/30  |
|         |      | ISRAEL FIXED BOND       | 2.0       | 2,000     | 2,159  | 74,007    | 2027/3/31  |
|         |      | ISRAEL FIXED BOND       | 1.0       | 1,000     | 998    | 34,210    | 2030/3/31  |
|         |      | ISRAEL FIXED BOND       | 5.5       | 1,100     | 1,767  | 60,587    | 2042/1/31  |
|         |      | ISRAEL FIXED BOND       | 3.75      | 800       | 1,043  | 35,752    | 2047/3/31  |
| 小       | 計    |                         |           |           |        | 400,194   |            |
| メキシコ    |      |                         | 千メキシコペソ   | 千メキシコペソ   |        |           |            |
|         | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0       | 13,100    | 13,737 | 75,744    | 2024/9/5   |
|         |      | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0      | 11,000    | 12,202 | 67,278    | 2024/12/5  |
|         |      | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.75      | 14,000    | 13,558 | 74,755    | 2026/3/5   |
|         |      | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5       | 20,100    | 20,799 | 114,679   | 2027/6/3   |

| 銘    | 柄    | 当 期 末                    |         |         |        |            |            |
|------|------|--------------------------|---------|---------|--------|------------|------------|
|      |      | 利 率                      | 額面金額    | 評 価 額   |        | 償還年月日      |            |
|      |      |                          |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額 |            |            |
| メキシコ |      | %                        | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | 千円     |            |            |
|      | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 7.75    | 12,400  | 13,074 | 72,085     | 2031/5/29  |
|      |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 7.75    | 3,100   | 3,256  | 17,954     | 2034/11/23 |
|      |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 10.0    | 6,000   | 7,506  | 41,385     | 2036/11/20 |
|      |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 8.5     | 10,200  | 11,261 | 62,089     | 2038/11/18 |
|      |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 7.75    | 5,000   | 5,144  | 28,364     | 2042/11/13 |
|      |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 8.0     | 4,300   | 4,522  | 24,934     | 2047/11/7  |
|      |      | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 8.0     | 9,300   | 9,705  | 53,513     | 2023/12/7  |
| 小    | 計    |                          |         |         |        | 632,786    |            |
| 合    | 計    |                          |         |         |        | 85,145,425 |            |

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

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2021年9月6日現在)

| 項 目          | 当 期 末            |           |
|--------------|------------------|-----------|
|              | 評 価 額            | 比 率       |
| 公社債          | 千円<br>85,145,425 | %<br>98.1 |
| コール・ローン等、その他 | 1,651,150        | 1.9       |
| 投資信託財産総額     | 86,796,575       | 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（85,151,488千円）の投資信託財産総額（86,796,575千円）に対する比率は98.1%です。

\*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=109.83円、1カナダドル=87.57円、1英ポンド=152.13円、1スウェーデンクローナ=12.83円、1ノルウェークローネ=12.65円、1デンマーククローネ=17.54円、1ユーロ=130.43円、1ズロチ=28.9372円、1シンガポールドル=81.84円、1豪ドル=81.64円、1新シェケル=34.2728円、1メキシコペソ=5.5136円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年9月6日現在)

| 項目              | 当期末             |
|-----------------|-----------------|
|                 | 円               |
| (A) 資産          | 172,759,657,418 |
| コール・ローン等        | 961,507,974     |
| 公社債(評価額)        | 85,145,425,312  |
| 未収入金            | 86,203,948,604  |
| 未収利息            | 422,399,606     |
| 前払費用            | 24,251,911      |
| 差入委託証拠金         | 2,124,011       |
| (B) 負債          | 87,041,055,896  |
| 未払金             | 87,036,198,683  |
| 未払解約金           | 4,104,481       |
| 未払利息            | 632             |
| その他未払費用         | 752,100         |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 85,718,601,522  |
| 元本              | 69,507,998,280  |
| 次期繰越損益金         | 16,210,603,242  |
| (D) 受益権総口数      | 69,507,998,280口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,332円         |

(注) 期首元本額は55,714,203,773円、期中追加設定元本額は26,603,112,010円、期中一部解約元本額は12,809,317,503円、1口当たり純資産額は1.2332円です。

## ○損益の状況 (2020年9月8日～2021年9月6日)

| 項目                 | 当期              |
|--------------------|-----------------|
|                    | 円               |
| (A) 配当等収益          | 1,531,599,676   |
| 受取利息               | 1,532,133,328   |
| 支払利息               | △ 533,652       |
| (B) 有価証券売買損益       | △ 2,509,913,115 |
| 売買益                | 8,374,311,843   |
| 売買損                | △10,884,224,958 |
| (C) 先物取引等取引損益      | △ 1,753,635     |
| 取引益                | 1,908,213       |
| 取引損                | △ 3,661,848     |
| (D) 保管費用等          | △ 7,012,938     |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | △ 987,080,012   |
| (F) 前期繰越損益金        | 13,938,897,618  |
| (G) 追加信託差損益金       | 6,306,274,978   |
| (H) 解約差損益金         | △ 3,047,489,342 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 16,210,603,242  |
| 次期繰越損益金(I)         | 16,210,603,242  |

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

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

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

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名                                | 当期末<br>元本額     |
|--------------------------------------|----------------|
|                                      | 円              |
| 野村外国債券インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)        | 33,969,196,969 |
| 野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)        | 12,342,972,136 |
| 野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け) | 8,452,456,658  |
| オルウェザー・ファクターアロケーションオープン投信(適格機関投資家専用) | 6,047,758,615  |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型             | 4,660,804,118  |
| 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型        | 1,556,273,232  |
| 野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型             | 876,355,232    |
| 野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)     | 568,452,306    |
| 多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)        | 471,820,275    |
| 野村国内外マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用)   | 294,994,115    |

| ファンド名                            | 当期末<br>元本額  |
|----------------------------------|-------------|
|                                  | 円           |
| 野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)          | 186,323,900 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型 | 30,562,537  |
| インデックス・ブレンド(タイプIII)              | 14,815,568  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型 | 8,244,243   |
| インデックス・ブレンド(タイプI)                | 7,314,172   |
| インデックス・ブレンド(タイプV)                | 5,424,084   |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型 | 4,469,776   |
| インデックス・ブレンド(タイプII)               | 3,791,671   |
| インデックス・ブレンド(タイプIV)               | 3,114,434   |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型 | 2,854,239   |

## ○お知らせ

該当事項はございません。