

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7期(決算日2022年12月6日)

作成対象期間(2021年12月7日～2022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のもの等に関し、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 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 分 配	み 金 騰 落	中 率	期 騰 落			
	円	円	%		%	%	%	百万円
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
7期(2022年12月6日)	8,705	0	△15.8	89.33	△15.4	97.9	—	10,536

*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。

<p>*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。</p> <p>*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。</p> <p>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。</p> <p>(出所) FTSE Fixed Income LLC</p>
--

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落	率	騰 落	率		
	円	%		%	%	%
(期首) 2021年12月6日	10,334	—	105.61	—	98.3	—
12月末	10,163	△ 1.7	103.86	△ 1.7	100.1	—
2022年1月末	10,034	△ 2.9	102.58	△ 2.9	98.4	—
2月末	9,820	△ 5.0	100.41	△ 4.9	99.0	—
3月末	9,549	△ 7.6	97.75	△ 7.4	105.1	—
4月末	9,336	△ 9.7	95.61	△ 9.5	101.1	—
5月末	9,239	△10.6	94.61	△10.4	98.7	—
6月末	8,981	△13.1	92.05	△12.8	101.4	—
7月末	9,241	△10.6	94.80	△10.2	96.3	—
8月末	8,921	△13.7	91.47	△13.4	101.2	—
9月末	8,543	△17.3	87.64	△17.0	101.8	—
10月末	8,526	△17.5	87.47	△17.2	101.9	—
11月末	8,645	△16.3	88.74	△16.0	94.2	—
(期末) 2022年12月6日	8,705	△15.8	89.33	△15.4	97.9	—

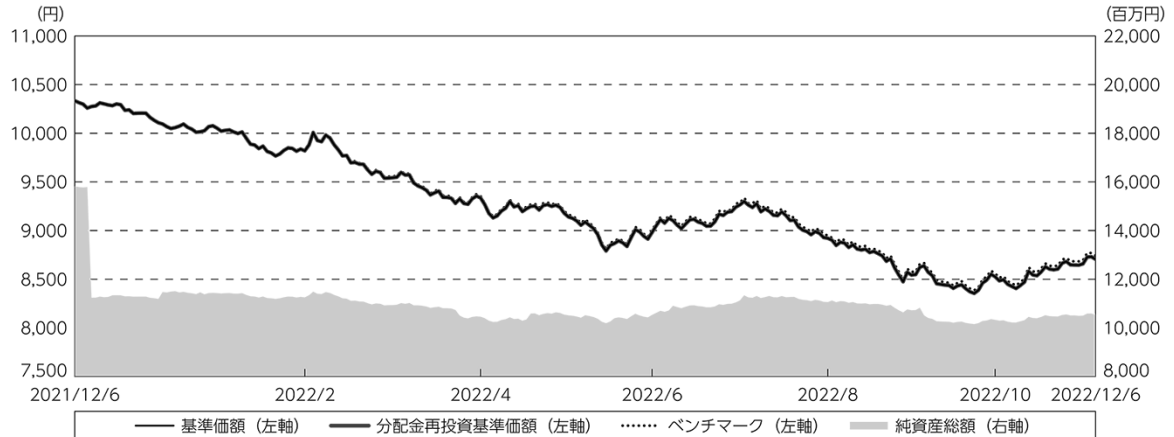
*騰落率は期首比です。

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

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期首：10,334円

期末：8,705円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率：△ 15.8%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2021年12月6日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）です。ベンチマークは、作成期首（2021年12月6日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

外国債券利回りが米国を中心に上昇（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、インフレ懸念などを背景とした米欧中銀による積極的な金融引き締めが意識されたことなどから、外国債券利回りは幅広い国で上昇（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-15.8%となり、ベンチマークの-15.4%を0.4ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

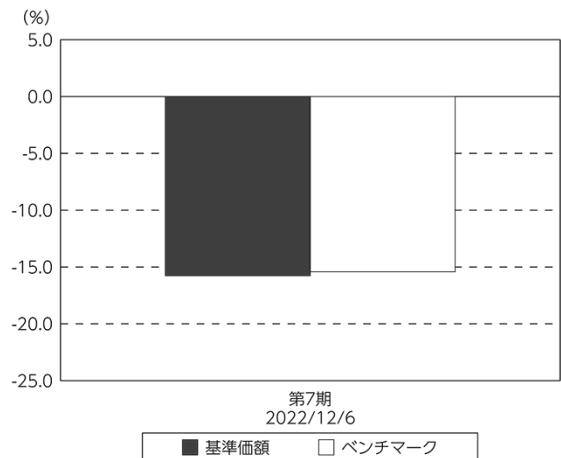
(マイナス要因)

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

(その他の要因)

ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なること

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

◎分配金

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

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

項 目	第7期
	2021年12月7日～ 2022年12月6日
当期分配金	—
（対基準価額比率）	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,027

（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

（2021年12月7日～2022年12月6日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 31	% 0.330	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(22)	(0.242)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(5)	(0.055)	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	1	0.012	(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 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	32	0.342	
期中の平均基準価額は、9,249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。

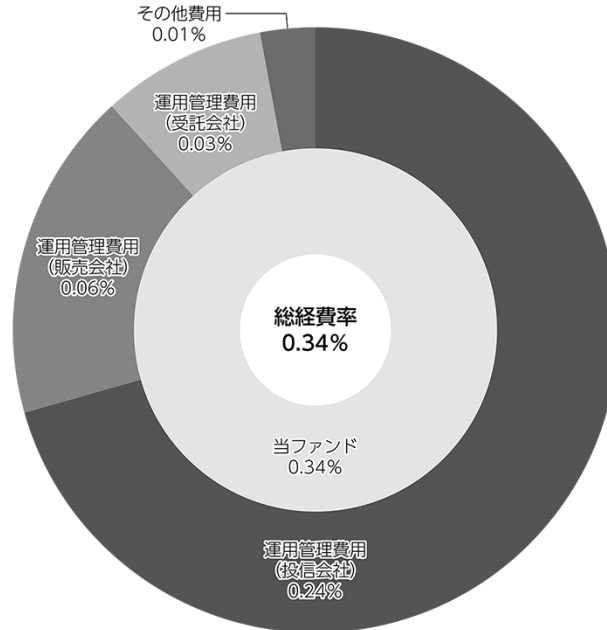
* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 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

(2021年12月7日～2022年12月6日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	千口 2,203,664	千円 2,484,297	千口 4,912,306	千円 5,863,633

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2021年12月7日～2022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

(2022年12月6日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	千口 12,806,101	千口 10,097,460	千円 10,535,689

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年12月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	千円 10,535,689	% 99.5
コール・ローン等、その他	57,273	0.5
投資信託財産総額	10,592,962	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（82,726,258千円）の投資信託財産総額（95,095,737千円）に対する比率は87.0%です。

*外貨建資産は、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=136.55円、1カナダドル=100.49円、1英ポンド=166.70円、1スウェーデンクローナ=13.13円、1ノルウェークローネ=13.74円、1デンマーククローネ=19.29円、1ユーロ=143.47円、1ズロチ=30.467円、1シンガポールドル=100.77円、1人民元=19.6032円、1豪ドル=91.58円、1ニュージーランドドル=86.44円、1新シェケル=40.0655円、1メキシコペソ=6.919円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年12月6日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	10,592,962,857	
コール・ローン等	34,870,859	
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)	10,535,689,851	
未収入金	22,402,147	
(B) 負債	56,216,999	
未払解約金	38,378,578	
未払信託報酬	17,720,286	
未払利息	60	
その他未払費用	118,075	
(C) 純資産総額(A-B)	10,536,745,858	
元本	12,103,605,765	
次期繰越損益金	△ 1,566,859,907	
(D) 受益権総口数	12,103,605,765口	
1万口当たり基準価額(C/D)	8,705円	

(注) 期首元本額は15,308,263,565円、期中追加設定元本額は3,041,327,459円、期中一部解約元本額は6,245,985,259円、1口当たり純資産額は0.8705円です。

○損益の状況（2021年12月7日～2022年12月6日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	△ 3,038	
支払利息	△ 3,038	
(B) 有価証券売買損益	△1,672,734,386	
売買益	212,258,814	
売買損	△1,884,993,200	
(C) 信託報酬等	△ 36,274,185	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△1,709,011,609	
(E) 前期繰越損益金	65,233,976	
(F) 追加信託差損益金	76,917,726	
(配当等相当額)	(746,340,825)	
(売買損益相当額)	(△ 669,423,099)	
(G) 計(D+E+F)	△1,566,859,907	
(H) 収益分配金	0	
次期繰越損益金(G+H)	△1,566,859,907	
追加信託差損益金	76,917,726	
(配当等相当額)	(751,726,884)	
(売買損益相当額)	(△ 674,809,158)	
分配準備積立金	492,459,525	
繰越損益金	△2,136,237,158	

*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（2021年12月7日～2022年12月6日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2021年12月7日～ 2022年12月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	192,132,456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	751,726,884円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	300,327,069円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,244,186,409円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,027円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○分配金のお知らせ

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

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

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

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

○お知らせ

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9期（決算日2022年9月6日）

作成対象期間（2021年9月7日～2022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せん。外貨建資産については、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	株式への投資は行いません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。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 (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	期騰落			
5期(2018年9月6日)	円	%			%	%	百万円
	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
9期(2022年9月6日)	10,625	△13.8	107.48	△13.7	99.7	—	80,566

*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	債券率
	騰落	期中率	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	騰落			
(期首) 2021年9月6日	円	%			%	%	%
	12,332	—	124.58	—	99.3	—	—
9月末	12,186	△ 1.2	123.09	△ 1.2	99.5	—	—
10月末	12,183	△ 1.2	123.02	△ 1.3	100.8	—	—
11月末	12,258	△ 0.6	123.80	△ 0.6	97.2	—	—
12月末	12,145	△ 1.5	122.69	△ 1.5	100.1	—	—
2022年1月末	11,994	△ 2.7	121.17	△ 2.7	98.4	—	—
2月末	11,741	△ 4.8	118.62	△ 4.8	99.0	—	—
3月末	11,420	△ 7.4	115.47	△ 7.3	105.1	—	—
4月末	11,168	△ 9.4	112.95	△ 9.3	101.1	—	—
5月末	11,055	△10.4	111.76	△10.3	98.7	—	—
6月末	10,749	△12.8	108.74	△12.7	101.4	—	—
7月末	11,063	△10.3	111.99	△10.1	96.3	—	—
8月末	10,683	△13.4	108.05	△13.3	101.2	—	—
(期末) 2022年9月6日	円	%			%	%	%
	10,625	△13.8	107.48	△13.7	99.7	—	—

*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

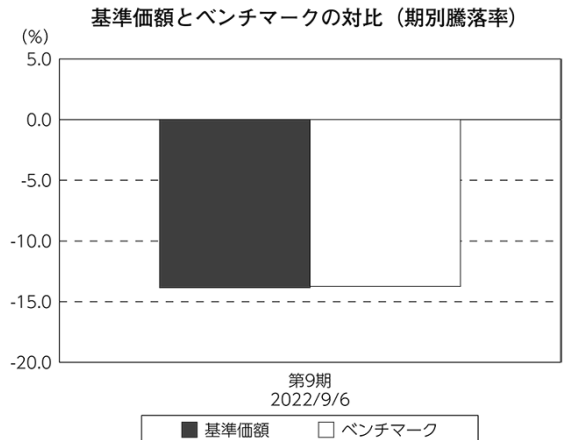
今期の基準価額の騰落率は-13.8%となり、ベンチマークの-13.7%を0.1ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

(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

(2021年9月7日～2022年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	1 (1) (0)	0.009 (0.009) (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	1	0.009	
期中の平均基準価額は、11,553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

(2021年9月7日～2022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 155,747	千米ドル 164,900	
	カナダ	国債証券 千カナダドル 5,056	千カナダドル 5,820	
	イギリス	国債証券 千英ポンド 10,160	千英ポンド 14,957	
	スウェーデン	国債証券 千スウェーデンクローナ -	千スウェーデンクローナ 3,035	
	ノルウェー	国債証券 千ノルウェークローネ 4,922	千ノルウェークローネ 1,902	
	デンマーク	国債証券 千デンマーククローネ 1,777	千デンマーククローネ 7,192	
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	
	ドイツ	国債証券 15,174	20,705	
	イタリア	国債証券 19,817	28,109	
	フランス	国債証券 27,798	33,950	
	オランダ	国債証券 4,241	5,151	
	スペイン	国債証券 17,165	22,155	
	ベルギー	国債証券 5,172	7,125	
	オーストリア	国債証券 3,560	4,003	
	フィンランド	国債証券 -	458	
	アイルランド	国債証券 1,926	2,959	
	国	ポーランド	国債証券 千ズロチ 23,323	千ズロチ 25,535
		シンガポール	国債証券 千シンガポールドル 1,954	千シンガポールドル 3,048
		中国	国債証券 千人民元 113,348	千人民元 -
オーストラリア		国債証券 千豪ドル 2,161	千豪ドル 6,860	
イスラエル		国債証券 千新シエケル -	千新シエケル 2,035	
メキシコ		国債証券 千メキシコペソ 20,492	千メキシコペソ 14,794	

*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 1,057	百万円 1,056	百万円 -	百万円 -

*単位未満は切り捨て。

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

○利害関係人との取引状況等

(2021年9月7日～2022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

(2022年9月6日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	321,300	298,106	41,815,432	51.9	—	22.8	19.3	9.8
カナダ	千カナダドル	千カナダドル						
	16,550	15,808	1,692,928	2.1	—	1.1	0.5	0.5
イギリス	千英ポンド	千英ポンド						
	24,080	22,662	3,683,633	4.6	—	3.4	0.9	0.3
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						
	16,050	15,330	199,757	0.2	—	0.2	0.0	0.0
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						
	14,700	13,552	191,768	0.2	—	0.1	0.1	0.0
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						
	14,650	15,144	284,558	0.4	—	0.3	0.0	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	33,000	33,604	4,695,267	5.8	—	3.5	1.6	0.8
イタリア	47,410	45,297	6,328,948	7.9	—	4.4	2.4	1.0
フランス	48,960	48,034	6,711,412	8.3	—	5.3	2.3	0.7
オランダ	9,810	9,493	1,326,463	1.6	—	0.9	0.5	0.2
スペイン	31,320	30,768	4,298,962	5.3	—	3.0	1.9	0.5
ベルギー	10,640	10,284	1,436,887	1.8	—	1.3	0.3	0.1
オーストリア	7,420	6,915	966,186	1.2	—	0.8	0.4	0.1
フィンランド	3,310	3,099	433,021	0.5	—	0.4	0.1	0.0
アイルランド	4,250	3,886	542,961	0.7	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	千ズロチ	千ズロチ						
	13,900	12,005	355,971	0.4	—	0.2	0.2	—
シンガポール	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
	7,040	6,575	658,562	0.8	—	0.5	0.2	0.0
中国	千人民元	千人民元						
	113,000	114,652	2,319,482	2.9	—	1.2	1.2	0.5
オーストラリア	千豪ドル	千豪ドル						
	14,060	13,125	1,257,257	1.6	—	1.2	0.4	0.0
イスラエル	千新シェケル	千新シェケル						
	8,300	8,460	348,838	0.4	—	0.2	0.1	0.2
メキシコ	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
	115,600	108,684	764,791	0.9	—	0.4	0.5	0.1
合 計	—	—	80,313,097	99.7	—	51.5	33.1	15.1

* 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	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券					
	US TREASURY BOND	2.375	1,500	1,471	206,381	2024/8/15
	US TREASURY BOND	6.0	610	660	92,643	2026/2/15
	US TREASURY BOND	6.125	1,800	2,034	285,427	2027/11/15
	US TREASURY BOND	5.25	20	22	3,102	2028/11/15
	US TREASURY BOND	2.875	510	450	63,148	2043/5/15
	US TREASURY BOND	3.75	250	253	35,563	2043/11/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,000	2,940	412,533	2023/8/31
	US TREASURY N/B	2.75	3,500	3,476	487,646	2023/8/31
	US TREASURY N/B	0.125	2,500	2,417	339,052	2023/9/15
	US TREASURY N/B	1.375	1,000	978	137,256	2023/9/30
	US TREASURY N/B	0.125	500	482	67,643	2023/10/15
	US TREASURY N/B	1.625	1,700	1,666	233,736	2023/10/31
	US TREASURY N/B	2.75	2,500	2,481	348,086	2023/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	500	492	69,074	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.875	1,500	1,490	209,098	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	1,970	276,408	2023/12/31
	US TREASURY N/B	2.625	700	693	97,239	2023/12/31
	US TREASURY N/B	0.125	1,000	956	134,209	2024/1/15
	US TREASURY N/B	2.25	500	492	69,030	2024/1/31
	US TREASURY N/B	2.75	400	396	55,585	2024/2/15
	US TREASURY N/B	2.125	1,500	1,472	206,529	2024/2/29
	US TREASURY N/B	2.375	300	295	41,458	2024/2/29
	US TREASURY N/B	1.5	1,000	972	136,431	2024/2/29
	US TREASURY N/B	0.25	2,500	2,383	334,285	2024/3/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	1,961	275,126	2024/3/31
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	1,964	275,553	2024/3/31
	US TREASURY N/B	0.375	1,000	952	133,637	2024/4/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	1,955	274,337	2024/4/30
	US TREASURY N/B	2.5	2,500	2,463	345,599	2024/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	1,953	274,041	2024/5/31
	US TREASURY N/B	2.0	800	780	109,493	2024/6/30
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	1,942	272,490	2024/6/30
	US TREASURY N/B	3.0	1,500	1,489	208,884	2024/6/30
	US TREASURY N/B	0.375	3,000	2,838	398,175	2024/7/15
	US TREASURY N/B	2.125	3,000	2,930	411,111	2024/7/31
	US TREASURY N/B	1.75	3,000	2,910	408,226	2024/7/31
	US TREASURY N/B	0.375	2,000	1,887	264,732	2024/8/15
	US TREASURY N/B	1.875	2,000	1,942	272,458	2024/8/31
	US TREASURY N/B	1.25	1,000	959	134,563	2024/8/31
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	1,950	273,581	2024/9/30
	US TREASURY N/B	1.5	1,500	1,443	202,531	2024/9/30
	US TREASURY N/B	0.625	1,500	1,416	198,660	2024/10/15
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	1,953	273,997	2024/10/31
	US TREASURY N/B	1.5	1,000	961	134,840	2024/10/31
	US TREASURY N/B	2.25	1,500	1,464	205,416	2024/11/15

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	2.125	2,400	2,334	327,455	2024/11/30
	US TREASURY N/B	1.5	3,000	2,878	403,829	2024/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	800	779	109,358	2024/12/31
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	1,927	270,337	2024/12/31
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	1,934	271,334	2025/2/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,500	1,476	207,092	2025/2/28
	US TREASURY N/B	1.125	1,000	945	132,692	2025/2/28
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	1,920	269,329	2025/3/15
	US TREASURY N/B	2.625	2,500	2,451	343,935	2025/3/31
	US TREASURY N/B	0.375	500	461	64,748	2025/4/30
	US TREASURY N/B	2.125	2,300	2,223	311,883	2025/5/15
	US TREASURY N/B	2.75	2,000	1,964	275,597	2025/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	3,100	3,054	428,501	2025/5/31
	US TREASURY N/B	0.25	2,000	1,834	257,373	2025/5/31
	US TREASURY N/B	2.875	1,500	1,477	207,281	2025/6/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,500	1,473	206,624	2025/6/30
	US TREASURY N/B	0.25	700	640	89,892	2025/6/30
	US TREASURY N/B	3.0	2,000	1,976	277,219	2025/7/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	1,969	276,299	2025/7/31
	US TREASURY N/B	0.25	2,000	1,825	256,014	2025/7/31
	US TREASURY N/B	2.0	2,780	2,669	374,413	2025/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	600	588	82,541	2025/8/31
	US TREASURY N/B	3.0	3,000	2,962	415,566	2025/9/30
	US TREASURY N/B	0.25	1,500	1,362	191,082	2025/9/30
	US TREASURY N/B	0.25	1,000	905	127,010	2025/10/31
	US TREASURY N/B	2.25	1,640	1,580	221,766	2025/11/15
	US TREASURY N/B	2.625	2,500	2,436	341,798	2026/1/31
	US TREASURY N/B	0.375	500	451	63,269	2026/1/31
	US TREASURY N/B	1.625	2,200	2,071	290,500	2026/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	2,500	2,424	340,099	2026/2/28
	US TREASURY N/B	2.25	500	480	67,444	2026/3/31
	US TREASURY N/B	1.625	700	657	92,171	2026/5/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,500	2,388	335,100	2026/5/31
	US TREASURY N/B	1.875	1,000	946	132,818	2026/6/30
	US TREASURY N/B	1.875	2,500	2,363	331,579	2026/7/31
	US TREASURY N/B	1.5	2,700	2,512	352,365	2026/8/15
	US TREASURY N/B	1.375	500	462	64,932	2026/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	4,000	3,738	524,368	2026/9/30
	US TREASURY N/B	0.875	3,500	3,168	444,458	2026/9/30
	US TREASURY N/B	2.0	2,600	2,459	345,042	2026/11/15
	US TREASURY N/B	1.625	3,000	2,797	392,405	2026/11/30
	US TREASURY N/B	1.75	1,200	1,123	157,652	2026/12/31
	US TREASURY N/B	1.25	2,500	2,288	321,073	2026/12/31
	US TREASURY N/B	1.5	2,000	1,848	259,357	2027/1/31
	US TREASURY N/B	2.25	1,000	954	133,831	2027/2/15
	US TREASURY N/B	1.125	2,000	1,817	254,962	2027/2/28
	US TREASURY N/B	1.875	1,100	1,033	144,966	2027/2/28

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	2,000	1,929	270,611	2027/3/31
		US TREASURY N/B	0.5	2,000	1,757	246,535	2027/4/30
		US TREASURY N/B	2.75	2,000	1,949	273,482	2027/4/30
		US TREASURY N/B	2.375	3,800	3,638	510,414	2027/5/15
		US TREASURY N/B	0.5	2,000	1,753	246,009	2027/5/31
		US TREASURY N/B	2.625	1,500	1,454	204,084	2027/5/31
		US TREASURY N/B	0.5	1,500	1,312	184,120	2027/6/30
		US TREASURY N/B	3.25	200	199	27,957	2027/6/30
		US TREASURY N/B	2.25	3,200	3,044	426,981	2027/8/15
		US TREASURY N/B	0.5	1,500	1,300	182,452	2027/10/31
		US TREASURY N/B	2.25	1,600	1,517	212,921	2027/11/15
		US TREASURY N/B	0.75	1,500	1,309	183,709	2028/1/31
		US TREASURY N/B	2.75	2,700	2,620	367,544	2028/2/15
		US TREASURY N/B	1.125	2,000	1,781	249,844	2028/2/29
		US TREASURY N/B	1.25	4,000	3,571	501,004	2028/4/30
		US TREASURY N/B	2.875	3,500	3,414	478,997	2028/5/15
		US TREASURY N/B	1.0	1,000	875	122,834	2028/7/31
		US TREASURY N/B	2.875	3,100	3,021	423,779	2028/8/15
		US TREASURY N/B	1.25	2,000	1,771	248,540	2028/9/30
		US TREASURY N/B	1.375	1,500	1,337	187,605	2028/10/31
		US TREASURY N/B	3.125	5,000	4,942	693,240	2028/11/15
		US TREASURY N/B	1.5	1,000	897	125,848	2028/11/30
		US TREASURY N/B	1.375	2,500	2,226	312,251	2028/12/31
		US TREASURY N/B	1.75	1,000	909	127,640	2029/1/31
		US TREASURY N/B	2.625	3,400	3,262	457,692	2029/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	2,500	2,432	341,223	2029/4/30
		US TREASURY N/B	2.375	2,500	2,359	330,976	2029/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	1,500	1,448	203,188	2029/5/31
		US TREASURY N/B	1.625	2,700	2,429	340,826	2029/8/15
		US TREASURY N/B	1.75	200	181	25,469	2029/11/15
		US TREASURY N/B	1.5	2,000	1,774	248,847	2030/2/15
		US TREASURY N/B	6.25	500	601	84,408	2030/5/15
		US TREASURY N/B	0.625	1,700	1,401	196,598	2030/5/15
		US TREASURY N/B	0.625	4,300	3,526	494,639	2030/8/15
		US TREASURY N/B	0.875	3,500	2,922	409,977	2030/11/15
		US TREASURY N/B	5.375	500	578	81,197	2031/2/15
		US TREASURY N/B	1.125	3,100	2,633	369,373	2031/2/15
		US TREASURY N/B	1.625	2,600	2,293	321,764	2031/5/15
		US TREASURY N/B	1.25	3,700	3,144	441,068	2031/8/15
		US TREASURY N/B	1.375	2,400	2,052	287,965	2031/11/15
		US TREASURY N/B	1.875	3,200	2,857	400,751	2032/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	2,900	2,821	395,787	2032/5/15
		US TREASURY N/B	5.0	340	410	57,558	2037/5/15
		US TREASURY N/B	4.5	1,760	2,023	283,829	2038/5/15
		US TREASURY N/B	3.5	400	407	57,155	2039/2/15
		US TREASURY N/B	4.25	800	892	125,190	2039/5/15
		US TREASURY N/B	4.5	400	459	64,418	2039/8/15

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	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券					
	US TREASURY N/B	4.375	500	565	79,252	2039/11/15
	US TREASURY N/B	4.625	1,150	1,337	187,649	2040/2/15
	US TREASURY N/B	1.125	1,000	675	94,715	2040/5/15
	US TREASURY N/B	3.875	340	357	50,117	2040/8/15
	US TREASURY N/B	1.125	1,200	802	112,592	2040/8/15
	US TREASURY N/B	4.25	1,600	1,764	247,471	2040/11/15
	US TREASURY N/B	1.375	1,200	836	117,392	2040/11/15
	US TREASURY N/B	4.75	300	352	49,471	2041/2/15
	US TREASURY N/B	3.75	400	409	57,427	2041/8/15
	US TREASURY N/B	3.125	500	466	65,428	2041/11/15
	US TREASURY N/B	3.125	1,200	1,117	156,778	2042/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	400	364	51,093	2042/5/15
	US TREASURY N/B	3.25	500	473	66,420	2042/5/15
	US TREASURY N/B	2.75	500	435	61,039	2042/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	500	434	60,918	2042/11/15
	US TREASURY N/B	3.125	800	736	103,317	2043/2/15
	US TREASURY N/B	3.625	300	298	41,890	2043/8/15
	US TREASURY N/B	3.625	700	695	97,536	2044/2/15
	US TREASURY N/B	3.125	1,700	1,556	218,301	2044/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	1,600	1,432	200,936	2044/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	300	245	34,434	2045/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	2,540	2,271	318,597	2045/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,760	2,414	338,661	2045/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	920	823	115,488	2045/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	2,530	2,061	289,229	2046/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	3,400	2,770	388,613	2046/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	4,030	3,120	437,656	2046/8/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,300	2,015	282,671	2046/11/15
	US TREASURY N/B	3.0	500	448	62,891	2047/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	1,000	898	125,969	2047/5/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,520	1,305	183,061	2047/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,300	1,117	156,807	2047/11/15
	US TREASURY N/B	3.0	1,400	1,266	177,645	2048/2/15
	US TREASURY N/B	3.125	1,400	1,301	182,539	2048/5/15
	US TREASURY N/B	3.0	900	818	114,841	2048/8/15
	US TREASURY N/B	3.375	300	293	41,170	2048/11/15
	US TREASURY N/B	3.0	2,500	2,296	322,073	2049/2/15
	US TREASURY N/B	2.875	500	449	62,989	2049/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	1,300	1,027	144,157	2049/8/15
	US TREASURY N/B	2.375	1,000	813	114,057	2049/11/15
	US TREASURY N/B	2.0	600	447	62,805	2050/2/15
	US TREASURY N/B	1.25	2,500	1,522	213,582	2050/5/15
	US TREASURY N/B	1.375	1,600	1,008	141,392	2050/8/15
	US TREASURY N/B	1.625	1,600	1,078	151,333	2050/11/15
	US TREASURY N/B	1.875	1,000	719	100,884	2051/2/15
	US TREASURY N/B	2.375	2,200	1,786	250,563	2051/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	300	222	31,172	2051/8/15

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	1.875	1,600	1,148	161,100	2051/11/15
		US TREASURY N/B	2.25	1,500	1,181	165,792	2052/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	1,700	1,545	216,755	2052/5/15
小 計						41,815,432	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル			
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	2.0	150	147	15,798	2023/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	600	588	63,016	2024/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	260	255	27,353	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	3,000	2,883	308,827	2024/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	1,000	946	101,351	2025/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	200	190	20,361	2025/4/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.25	600	539	57,755	2026/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,000	937	100,437	2026/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	1,000	906	97,061	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	400	376	40,331	2028/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	1,020	1,184	126,894	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	700	665	71,223	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	800	698	74,843	2030/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	600	526	56,419	2031/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	500	436	46,719	2031/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	900	818	87,622	2032/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	600	742	79,482	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	400	487	52,169	2037/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	180	202	21,676	2041/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,040	984	105,440	2048/12/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0	800	639	68,499	2051/12/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	1.75	500	371	39,733	2053/12/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	2.75	300	279	29,908	2064/12/1	
小 計						1,692,928	
イギリス			千英ポンド	千英ポンド			
	国債証券	UK TREASURY	2.25	950	941	152,982	2023/9/7
		UK TREASURY	1.0	500	482	78,484	2024/4/22
		UK TREASURY	2.75	400	396	64,494	2024/9/7
		UK TREASURY	0.25	600	559	90,887	2025/1/31
		UK TREASURY	0.625	300	281	45,780	2025/6/7
		UK TREASURY	2.0	1,000	972	158,062	2025/9/7
		UK TREASURY	1.5	670	635	103,246	2026/7/22
		UK TREASURY	0.375	800	719	116,997	2026/10/22
		UK TREASURY	1.25	1,000	925	150,430	2027/7/22
		UK TREASURY	4.25	300	318	51,811	2027/12/7
		UK TREASURY	1.625	400	373	60,653	2028/10/22
		UK TREASURY	6.0	90	105	17,220	2028/12/7
		UK TREASURY	0.875	800	699	113,702	2029/10/22
		UK TREASURY	0.375	700	575	93,566	2030/10/22
		UK TREASURY	4.75	600	684	111,253	2030/12/7
		UK TREASURY	0.25	600	475	77,217	2031/7/31
		UK TREASURY	1.0	100	83	13,618	2032/1/31

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
国債証券	UK TREASURY	4.25	600	667	108,414	2032/6/7
	UK TREASURY	0.875	300	239	38,874	2033/7/31
	UK TREASURY	4.5	500	567	92,320	2034/9/7
	UK TREASURY	0.625	800	578	94,006	2035/7/31
	UK TREASURY	4.25	460	511	83,217	2036/3/7
	UK TREASURY	1.75	770	631	102,591	2037/9/7
	UK TREASURY	4.75	500	594	96,691	2038/12/7
	UK TREASURY	1.125	300	217	35,417	2039/1/31
	UK TREASURY	4.25	100	112	18,293	2039/9/7
	UK TREASURY	1.25	200	142	23,164	2041/10/22
	UK TREASURY	4.5	350	412	66,992	2042/12/7
	UK TREASURY	3.5	600	616	100,283	2045/1/22
	UK TREASURY	4.25	1,580	1,827	297,009	2046/12/7
	UK TREASURY	1.5	700	490	79,791	2047/7/22
	UK TREASURY	1.75	350	258	42,042	2049/1/22
	UK TREASURY	4.25	1,240	1,463	237,920	2049/12/7
	UK TREASURY	1.25	500	317	51,609	2051/7/31
	UK TREASURY	3.75	110	121	19,804	2052/7/22
	UK TREASURY	1.5	300	201	32,775	2053/7/31
	UK TREASURY	1.625	300	208	33,838	2054/10/22
	UK TREASURY	1.75	500	357	58,181	2057/7/22
	UK TREASURY	4.0	200	241	39,261	2060/1/22
	UK TREASURY	2.5	200	177	28,790	2065/7/22
	UK TREASURY	3.5	530	598	97,305	2068/7/22
	UK TSY 0 1/2% 2061	0.5	400	172	27,986	2061/10/22
	UK TSY 0 5/8% 2050	0.625	500	263	42,890	2050/10/22
	UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	300	296	48,255	2044/1/22
	UNITED KINGDOM GILT	0.875	300	182	29,739	2046/1/31
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	4.25	780	958	155,753	2055/12/7
小 計					3,683,633	
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	2,976	38,783	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT	2.5	250	250	3,266	2025/5/12
	SWEDISH GOVERNMENT	1.0	2,700	2,572	33,514	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	0.75	1,000	929	12,110	2028/5/12
	SWEDISH GOVERNMENT	0.75	3,500	3,203	41,743	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	0.125	4,000	3,422	44,594	2031/5/12
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5	1,600	1,975	25,743	2039/3/30
小 計					199,757	
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	3.0	2,750	2,738	38,748	2024/3/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	2,000	1,923	27,220	2025/3/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	1,700	1,596	22,596	2026/2/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	1,750	1,636	23,157	2027/2/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,500	1,399	19,805	2028/4/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.375	2,000	1,734	24,536	2030/8/19

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			
ノルウェー		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円		
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.25	3,000	2,523	35,704	2031/9/17	
小計					191,768		
デンマーク			千デンマーククロネ	千デンマーククロネ			
国債証券	KINGDOM OF DENMARK	1.5	1,650	1,661	31,220	2023/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	1.75	1,400	1,412	26,534	2025/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	0.5	2,300	2,167	40,719	2027/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	0.5	2,100	1,918	36,041	2029/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	—	2,000	1,681	31,591	2031/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	4.5	4,200	5,695	107,017	2039/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	0.25	1,000	608	11,432	2052/11/15	
小計					284,558		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	BUNDESobligation	—	100	99	13,887	2023/10/13
		BUNDESobligation	—	1,000	987	137,997	2024/4/5
		BUNDESobligation	—	1,500	1,459	203,955	2025/4/11
		BUNDESobligation	—	1,000	959	134,093	2026/4/10
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	400	428	59,937	2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	610	618	86,482	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	700	707	98,837	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	440	440	61,540	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	200	197	27,569	2025/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	500	498	69,671	2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	900	880	123,041	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	300	286	40,016	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	2,270	2,175	303,922	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	1,400	1,734	242,332	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	850	818	114,353	2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,000	956	133,572	2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,000	1,186	165,781	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	1,000	931	130,193	2029/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	400	363	50,842	2029/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	500	668	93,397	2030/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	200	180	25,225	2030/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	894	124,919	2030/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	894	124,939	2030/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	1,100	1,449	202,492	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	877	122,635	2031/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	878	122,720	2031/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	500	434	60,646	2032/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,400	1,881	262,827	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	100	81	11,323	2035/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	900	714	99,884	2036/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	1,000	1,292	180,538	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	500	449	62,807	2038/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	710	971	135,791	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	60	87	12,264	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	650	821	114,765	2042/7/4

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	
			千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	800	916	128,071	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	910	1,055	147,473	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	1,200	1,091	152,435	2048/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,100	687	95,989	2050/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	600	361	50,444	2052/8/15
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	1,200	1,185	165,643	2024/3/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	1,000	988	138,120	2023/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	180	194	27,174	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	2,200	2,280	318,578	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	—	1,000	959	134,068	2024/8/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	1,500	1,545	215,988	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	1,200	1,181	165,014	2024/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	500	503	70,279	2024/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	—	1,500	1,423	198,828	2024/12/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	500	476	66,611	2025/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,350	1,436	200,693	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	500	485	67,792	2025/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	800	779	108,963	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.85	1,000	981	137,135	2025/7/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	200	199	27,835	2025/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	330	323	45,222	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.5	1,200	1,115	155,819	2026/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,000	1,062	148,382	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	—	1,500	1,359	189,879	2026/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6	550	528	73,779	2026/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.25	1,100	1,032	144,255	2026/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.1	600	551	77,049	2027/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2	500	482	67,456	2027/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	1,500	1,355	189,355	2027/9/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	400	467	65,372	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	1,800	1,702	237,890	2028/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.25	1,000	852	119,153	2028/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.5	600	513	71,693	2028/7/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	240	259	36,248	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	500	487	68,113	2028/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	1,000	962	134,452	2029/6/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.0	1,000	977	136,576	2029/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	1,000	1,122	156,835	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	800	804	112,413	2030/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	700	600	83,935	2030/4/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	200	164	22,950	2030/8/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	200	172	24,061	2030/12/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	700	824	115,144	2031/5/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	600	469	65,560	2031/12/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	500	417	58,368	2032/3/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	600	529	73,981	2032/12/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	1,500	1,740	243,238	2033/2/1		

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	2.45	1,070	928	129,736	2033/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,610	1,770	247,421	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.35	800	749	104,711	2035/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	300	222	31,139	2036/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.25	100	82	11,457	2036/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	780	785	109,755	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	400	361	50,561	2038/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	700	611	85,422	2038/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	350	393	54,970	2039/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.1	500	442	61,819	2040/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	300	335	46,933	2040/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8	800	569	79,528	2041/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	580	638	89,181	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	500	312	43,641	2045/4/30
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	460	408	57,034	2046/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7	500	398	55,608	2047/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.45	400	363	50,740	2048/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.85	300	287	40,201	2049/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	500	368	51,493	2050/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.7	400	248	34,650	2051/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.15	700	471	65,861	2052/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	310	234	32,801	2067/3/1		
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	2,500	2,467	344,820	2024/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	500	492	68,784	2024/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	510	519	72,646	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,000	966	135,097	2025/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,400	1,352	189,000	2025/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	600	586	81,899	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,100	1,061	148,294	2026/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	1,050	994	139,003	2026/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,200	2,050	286,481	2027/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	1,000	972	135,863	2027/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,300	1,233	172,373	2028/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,300	1,232	172,238	2028/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	2,000	1,884	263,343	2028/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,500	1,380	192,910	2029/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,800	1,581	221,024	2029/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	1,220	1,281	179,105	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,500	1,283	179,292	2030/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	500	415	58,070	2031/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	800	653	91,253	2032/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	1,000	983	137,371	2032/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	800	710	99,263	2034/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	1,550	1,334	186,506	2036/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	500	416	58,137	2038/5/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	560	506	70,832	2039/6/25		
FRANCE (GOVT OF)	0.5	300	213	29,786	2040/5/25		

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)	0.5	600	397	55,547	2044/6/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	610	542	75,836	2048/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.5	1,100	875	122,354	2050/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	500	310	43,313	2052/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	900	545	76,248	2053/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	300	235	32,837	2066/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	300	311	43,544	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.75	1,100	1,111	155,340	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6.0	1,100	1,264	176,715	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	600	592	82,717	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	—	1,000	951	132,984	2026/2/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	1,410	1,509	210,903	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.75	900	949	132,626	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	1,200	1,478	206,608	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.5	2,340	2,265	316,570	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.75	300	398	55,645	2032/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.75	2,290	2,879	402,369	2035/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	400	479	67,001	2038/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.5	720	927	129,588	2041/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	1,200	1,335	186,654	2045/5/25
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	700	905	126,458	2055/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	900	1,189	166,141	2060/4/25		
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	1,000	1,018	142,249	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	700	680	95,053	2025/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	1,000	955	133,523	2026/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	400	386	53,982	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,100	1,047	146,406	2027/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,000	953	133,160	2028/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	1,100	964	134,712	2030/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	200	174	24,423	2032/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	550	580	81,065	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	400	495	69,171	2037/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	300	218	30,579	2038/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	300	232	32,494	2040/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	610	772	107,912	2042/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	650	738	103,233	2047/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	500	275	38,495	2052/1/15		
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	1,920	1,998	279,202	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	400	391	54,671	2024/5/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.25	600	587	82,070	2024/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	1,400	1,440	201,275	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,000	964	134,711	2025/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	800	801	111,921	2025/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	700	668	93,454	2025/5/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	1,000	1,088	152,016	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.15	700	711	99,466	2025/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,000	940	131,462	2026/1/31

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	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	20	20	2,811	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	400	462	64,642	2026/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	1,000	980	136,989	2026/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,500	1,376	192,383	2027/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5	500	490	68,501	2027/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8	800	755	105,555	2027/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	500	485	67,879	2027/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,400	1,254	175,313	2028/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,000	964	134,697	2028/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	900	865	120,963	2028/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	330	385	53,911	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,000	953	133,264	2029/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.6	800	712	99,535	2029/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5	500	436	60,924	2030/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	300	290	40,605	2030/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.25	600	549	76,781	2030/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.7	800	668	93,377	2032/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.55	200	196	27,426	2032/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	1,300	1,244	173,825	2033/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.85	1,100	976	136,469	2035/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	400	500	69,994	2040/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2	500	365	51,061	2040/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	700	861	120,344	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0	100	68	9,618	2042/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	500	660	92,353	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	950	909	127,052	2046/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	700	639	89,394	2048/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0	600	356	49,796	2050/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9	300	218	30,573	2052/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	200	198	27,690	2066/7/30
SPANISH GOVERNMENT	6.0	90	110	15,461	2029/1/31		
SPANISH GOVERNMENT	5.75	1,100	1,401	195,818	2032/7/30		
SPANISH GOVERNMENT	4.2	710	813	113,690	2037/1/31		
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	0.2	600	595	83,165	2023/10/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	230	236	32,974	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.5	300	295	41,291	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	1,200	1,182	165,284	2025/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	100	98	13,733	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	150	144	20,185	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	—	1,000	918	128,268	2027/10/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	300	285	39,864	2028/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.9	400	376	52,662	2029/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.1	300	261	36,508	2030/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	700	644	90,000	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	—	1,000	827	115,618	2031/10/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	550	639	89,378	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.45	500	431	60,279	2037/6/22

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	1.9	120	109	15,278	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	300	366	51,186	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	650	762	106,558	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	500	400	55,993	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.7	400	320	44,804	2050/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.4	300	215	30,109	2053/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	370	319	44,627	2066/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	670	852	119,112	2035/3/28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	120	121	16,922	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	200	195	27,356	2024/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	500	504	70,491	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	1,100	1,096	153,149	2025/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	300	291	40,680	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	400	380	53,194	2027/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	700	662	92,600	2028/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	1,000	915	127,920	2029/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	500	420	58,788	2031/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	530	534	74,691	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.25	100	74	10,405	2036/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	230	279	39,039	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	300	190	26,679	2040/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	200	225	31,510	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	200	165	23,179	2047/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	200	131	18,303	2051/3/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	330	432	60,443	2062/1/26
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7	300	150	21,044	2071/4/20		
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	210	141	19,784	2086/11/2		
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	2.0	200	203	28,408	2024/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	810	783	109,486	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	740	782	109,383	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	—	300	257	35,955	2030/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	500	443	61,952	2034/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.125	400	299	41,789	2036/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	160	164	22,971	2042/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	1.375	200	165	23,074	2047/4/15
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	0.9	200	190	26,662	2028/5/15
		IRISH GOVERNMENT	0.35	400	333	46,598	2032/10/18
		IRISH TSY 0.2%	0.2	200	187	26,141	2027/5/15
		IRISH TSY 0.2% 2030	0.2	1,100	956	133,606	2030/10/18
		IRISH TSY 1% 2026	1.0	650	639	89,332	2026/5/15
		IRISH TSY 1.5% 2050	1.5	200	155	21,725	2050/5/15
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	550	500	69,934	2037/5/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	450	405	56,629	2045/2/18
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	500	517	72,330	2024/3/18
小 計						26,740,112	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	6,200	5,676	168,316	2024/10/25

銘柄		当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
ポーランド		%	千ズロチ	千ズロチ	千円		
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	3,800	3,170	93,997	2028/4/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	3,900	3,158	93,656	2029/10/25	
小 計					355,971		
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル			
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	400	401	40,215	2024/9/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	400	395	39,611	2025/6/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	700	681	68,289	2026/6/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	730	746	74,776	2027/3/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	300	294	29,507	2028/5/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	400	397	39,763	2029/7/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	310	306	30,739	2030/9/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.625	900	800	80,165	2031/7/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	900	819	82,069	2036/8/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	700	635	63,675	2039/7/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	500	472	47,275	2046/3/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	400	312	31,310	2050/3/1	
SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	400	311	31,164	2051/10/1		
小 計					658,562		
中国			千人民元	千人民元			
国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.47	20,000	20,171	408,085	2024/9/2	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.26	18,000	18,059	365,361	2025/2/24	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.24	9,000	9,024	182,576	2025/5/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.69	6,000	6,081	123,038	2026/8/12	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.37	13,000	12,994	262,885	2027/1/20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.91	9,000	9,174	185,602	2028/10/14	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.75	14,000	14,131	285,896	2029/6/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.02	4,000	4,104	83,039	2031/5/27	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.89	4,000	4,063	82,204	2031/11/18	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.75	4,000	4,022	81,382	2032/2/17	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.72	3,000	3,339	67,555	2051/4/12	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.53	2,000	2,162	43,752	2051/10/18	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.32	7,000	7,320	148,101	2052/4/15	
	小 計					2,319,482	
オーストラリア			千豪ドル	千豪ドル			
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	400	397	38,122	2024/4/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.25	300	281	26,976	2024/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,340	1,340	128,384	2025/4/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	520	536	51,377	2026/4/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	820	868	83,183	2027/4/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	300	290	27,844	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	820	768	73,662	2028/5/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	900	864	82,814	2028/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	500	492	47,211	2029/4/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	800	758	72,693	2029/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5	800	743	71,180	2030/5/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	200	162	15,608	2030/12/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.5	500	420	40,298	2031/6/21	

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	1.0	150	119	11,402	2031/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.25	500	402	38,582	2032/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	800	670	64,257	2032/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	1,170	1,255	120,258	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	500	468	44,855	2033/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	800	715	68,568	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	150	148	14,182	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	320	291	27,936	2039/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	700	587	56,275	2041/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	270	227	21,813	2047/3/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	500	310	29,766	2051/6/21
小	計					1,257,257	
イスラエル				千新シエケル	千新シエケル		
	国債証券	ISRAEL FIXED BOND	1.5	1,500	1,481	61,104	2023/11/30
		ISRAEL FIXED BOND	3.75	1,500	1,525	62,902	2024/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	0.5	400	377	15,549	2025/4/30
		ISRAEL FIXED BOND	2.0	2,000	1,922	79,270	2027/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	1.0	1,000	869	35,840	2030/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	5.5	1,100	1,445	59,580	2042/1/31
		ISRAEL FIXED BOND	3.75	800	838	34,590	2047/3/31
小	計					348,838	
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	12,699	89,363	2024/9/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	11,000	11,086	78,014	2024/12/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	3,200	2,882	20,284	2025/3/6
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	14,000	12,532	88,187	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.5	15,000	13,033	91,716	2027/3/4
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	4,700	4,426	31,150	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	16,700	15,469	108,852	2031/5/29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	3,100	2,820	19,849	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	6,000	6,530	45,956	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	10,200	9,780	68,824	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	5,000	4,429	31,171	2042/11/13
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	4,300	3,914	27,542	2047/11/7
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	9,300	9,077	63,879	2023/12/7
小	計					764,791	
合	計					80,313,097	

* 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

(2022年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円	%
	80,313,097	96.0
コール・ローン等、その他	3,302,958	4.0
投資信託財産総額	83,616,055	100.0

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 当期末における外貨建純資産（82,377,094千円）の投資信託財産総額（83,616,055千円）に対する比率は98.5%です。

* 外貨建資産は、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=140.27円、1カナダドル=107.09円、1英ポンド=162.54円、1スウェーデンクローナ=13.03円、1ノルウェークローネ=14.15円、1デンマーククローネ=18.79円、1ユーロ=139.72円、1ズロチ=29.6513円、1シンガポールドル=100.16円、1人民元=20.2305円、1豪ドル=95.79円、1新シエケル=41.2315円、1メキシコペソ=7.0368円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年9月6日現在)

項目	当期末	円
(A) 資産	165,759,520,120	
コール・ローン等	1,171,587,374	
公社債(評価額)	80,313,097,403	
未収入金	83,804,726,447	
未収利息	422,400,674	
前払費用	47,448,816	
差入委託証拠金	259,406	
(B) 負債	85,193,479,056	
未払金	85,178,402,522	
未払解約金	14,255,625	
未払利息	1,009	
その他未払費用	819,900	
(C) 純資産総額(A-B)	80,566,041,064	
元本	75,825,824,813	
次期繰越損益金	4,740,216,251	
(D) 受益権総口数	75,825,824,813口	
1万口当たり基準価額(C/D)	10,625円	

(注) 期首元本額は69,507,998,280円、期中追加設定元本額は29,919,073,643円、期中一部解約元本額は23,601,247,110円、1口当たり純資産額は1.0625円です。

○損益の状況 (2021年9月7日～2022年9月6日)

項目	当期	円
(A) 配当等収益	1,860,926,034	
受取利息	1,861,197,920	
その他収益金	995	
支払利息	△ 272,881	
(B) 有価証券売買損益	△14,409,354,485	
売買益	19,825,324,282	
売買損	△34,234,678,767	
(C) 先物取引等取引損益	△ 615,708	
取引益	160,957	
取引損	△ 776,665	
(D) 保管費用等	△ 7,700,551	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△12,556,744,710	
(F) 前期繰越損益金	16,210,603,242	
(G) 追加信託差損益金	4,459,054,029	
(H) 解約差損益金	△ 3,372,696,310	
(I) 計(E+F+G+H)	4,740,216,251	
次期繰越損益金(I)	4,740,216,251	

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額	円
野村外国債券インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	45,565,102,638	
野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	10,432,731,724	
野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	9,123,988,347	
オールウェザー・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	
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	1,950,369,029	
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	889,032,550	
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	727,714,628	
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	599,858,365	
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	168,747,669	
野村国内外マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用)	164,404,240	

ファンド名	当期末 元本額	円
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)	87,617,457	
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	39,905,389	
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	12,091,048	
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	5,867,127	
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	3,945,914	
インデックス・ブレンド(タイプIII)	2,677,783	
インデックス・ブレンド(タイプV)	2,173,236	
インデックス・ブレンド(タイプI)	729,960	
インデックス・ブレンド(タイプIV)	657,286	
インデックス・ブレンド(タイプII)	451,808	

○お知らせ

該当事項はございません。