



2019年3月期 (2018年9月8日～2019年3月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended March 2019 (September 8, 2018 - March 7, 2019)

2019年4月17日
 April 17, 2019

		上場取引所	東証
		Listed Exchange	TSE
ファンド名	NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジあり)連動型上場投信		
コード番号	(2512)		
連動対象指標	FTSE 世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)		
主要投資資産	親投資信託証券および公社債		
売買単位	10口		
管理会社	野村アセットマネジメント株式会社	URL http://www.nomura-am.co.jp	
代表者名	CEO 兼代表取締役社長	中川 順子	
問合せ先責任者	商品企画部長	増田 真一	TEL(03)-3241-9511

Fund name:	NEXT FUNDS International Bond FTSE World Government Bond Index (ex Japan Yen-Hedged) Exchange Traded Fund		
Code:	2512		
Underlying index:	FTSE World Government Bond Index (ex Japan, JPY Hedge Base)		
Primary invested assets:	Mother fund, Public and corporate bonds		
Trading unit:	10 units		
Management co.:	Nomura Asset Management Co., Ltd.	URL http://www.nomura-am.co.jp	
Representative:	Junko Nakagawa, President & CEO		
Contact person:	Shinichi Masuda, General Manager of Products Planning & Development Dept.		

有価証券報告書提出予定日	2019年6月5日
分配金支払開始日	2019年4月15日
Scheduled date of submission of securities report:	June 5, 2019
Date of commencing dividend payment:	April 15, 2019

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2019年3月期の運用状況 (2018年9月8日～2019年3月7日)

Management Status for Year ended March 2019 (from September 8, 2018 to March 7, 2019)

(1) 資産内訳 (百万円未満切捨て)

Assets (fractions of less than JPY mil. shall be rounded down)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計 (純資産)	
	Primary Invested Assets		Cash/Deposits/Other Assets (excluding liabilities)		Total (Net Assets)	
	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio
	百万円 JPY mil.	%	百万円 JPY mil.	%	百万円 JPY mil.	%
2019年3月期 FY ended Mar. 2019	1,201	(98.8)	14	(1.2)	1,216	(100.0)
2018年9月期 FY ended Sep. 2018	903	(97.9)	19	(2.1)	922	(100.0)

(2) 設定・解約実績

(千口未満切捨て)

Creation and Redemption

(fractions of less than one thousand units shall be rounded down)

	前計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Previous Fiscal Period (①)	設定口数 No. of Units Created (②)	解約口数 No. of Units Redeemed (③)	当計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Fiscal Period (①+②-③)
	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units
2019年3月期 FY ended Mar. 2019	950	300	0	1,250
2018年9月期 FY ended Sep. 2018	550	400	0	950

(3) 基準価額

Net Asset Value

	総資産 Total Assets (①)	負債 Liabilities (②)	純資産 Net Assets (③(①-②))	100口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×100) Net Asset Value per 100 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×100)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2019年3月期 FY ended Mar. 2019	1,236	19	1,216	97,321
2018年9月期 FY ended Sep. 2018	929	7	922	97,122

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2019年3月期 FY ended Mar. 2019	910
2018年9月期 FY ended Sep. 2018	710

2. 会計方針の変更

Change in Accounting Policies

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 Changes accompanying revision to accounting standards, etc. No
- ② ①以外の変更 無
 Changes other than those in ① No

II 財務諸表等 Financial Statements

(1) 【貸借対照表】 Balance Sheet

(単位：円) (Unit : JPY)

	第2期 (2018年9月7日現在) 2nd Fiscal Year As of September 7, 2018	第3期 (2019年3月7日現在) 3rd Fiscal Year As of March 7, 2019
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
預金 Deposits	558,820	3,073,600
コール・ローン Call loans	7,517,259	5,363,944
国債証券 Government bonds	903,259,508	1,201,761,695
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	3,539,085	897,977
未収入金 Accounts receivable - other	5,229,071	12,367,448
未収利息 Accrued interest	4,471,590	8,557,222
前払費用 Prepaid expenses	1,954,133	1,000,147
その他未収収益 Other accrued revenue	-	30,215
差入委託証拠金 Customers' margin	3,398,139	3,315,899
流動資産合計 Total current assets	929,927,605	1,236,368,147
資産合計 Total assets	929,927,605	1,236,368,147
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	4,524	4,470,149
未払金 Accounts payable - other	-	3,118,126
未払収益分配金 Unpaid dividends	6,745,000	11,375,000
未払受託者報酬 Trustee fee payable	68,347	123,264
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	341,633	616,255
未払利息 Accrued interest expenses	12	6

その他未払費用 Other accrued expenses	104,967	150,991
流動負債合計 Total current liabilities	7,264,483	19,853,791
負債合計 Total liabilities	7,264,483	19,853,791
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	950,000,000	1,250,000,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	△27,336,878	△33,485,644
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	66,705	44,075
元本等合計 Total principal and other	922,663,122	1,216,514,356
純資産合計 Total net assets	922,663,122	1,216,514,356
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	929,927,605	1,236,368,147

(2) 【損益及び剰余金計算書】 Statement of Income and Retained Earnings

(単位:円) (Unit:JPY)

	第2期 自 2018年3月8日 至 2018年9月7日 2nd Fiscal Year From March 8, 2018 to September 7, 2018	第3期 自 2018年9月8日 至 2019年3月7日 3rd Fiscal Year From September 8, 2018 to March 7, 2019
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取利息 Interest income	7,416,474	12,593,349
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△1,939,395	14,511,866
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△143,459	△103,440
為替差損益 Foreign exchange gains or losses	△3,797,022	△9,663,462
その他収益 Other revenue	12,431	30,215
営業収益合計 Total operating revenue	1,549,029	17,368,528
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	2,478	2,938
受託者報酬	68,347	123,264

Trustee fee		
委託者報酬 Investment trust management fee	341,633	616,255
その他費用 Other expenses	250,040	528,737
営業費用合計 Total operating expenses	662,498	1,271,194
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	886,531	16,097,334
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	886,531	16,097,334
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	886,531	16,097,334
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△) Distribution of profit loss from partial redemptions	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△) Surplus (deficit) at beginning of period	△13,285,109	△27,336,878
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	8,193,300	10,871,100
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit from additional subscriptions for period	8,193,300	10,871,100
分配金 Dividends	6,745,000	11,375,000
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	△27,336,878	△33,485,644

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>
5. その他	<p>当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年9月8日から2019年3月7日までとなっております。</p>

第2期 2018年9月7日現在	第3期 2019年3月7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 950,000口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,250,000口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 27,336,878円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 33,485,644円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 971.22円 (100口当たり純資産額) (97,122円)	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 973.21円 (100口当たり純資産額) (97,321円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自2018年3月8日 至2018年9月7日	第3期 自2018年9月8日 至2019年3月7日																																																																		
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																																		
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>7,426,427円</td> </tr> <tr> <td>親ファンドの配当等収益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>C</td> <td>45,298円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>D=A+B+C</td> <td>7,471,725円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>E</td> <td>660,020円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>F=D-E</td> <td>6,811,705円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>G</td> <td>6,745,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>H=F-G</td> <td>66,705円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>I</td> <td>950,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>J=G/I×100</td> <td>710円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	7,426,427円	親ファンドの配当等収益額	B	0円	分配準備積立金	C	45,298円	配当等収益合計額	D=A+B+C	7,471,725円	経費	E	660,020円	収益分配可能額	F=D-E	6,811,705円	収益分配金	G	6,745,000円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	66,705円	口数	I	950,000口	100口当たり分配金	J=G/I×100	710円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>12,620,626円</td> </tr> <tr> <td>親ファンドの配当等収益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>C</td> <td>66,705円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>D=A+B+C</td> <td>12,687,331円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>E</td> <td>1,268,256円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>F=D-E</td> <td>11,419,075円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>G</td> <td>11,375,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>H=F-G</td> <td>44,075円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>I</td> <td>1,250,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>J=G/I×100</td> <td>910円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	12,620,626円	親ファンドの配当等収益額	B	0円	分配準備積立金	C	66,705円	配当等収益合計額	D=A+B+C	12,687,331円	経費	E	1,268,256円	収益分配可能額	F=D-E	11,419,075円	収益分配金	G	11,375,000円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	44,075円	口数	I	1,250,000口	100口当たり分配金	J=G/I×100	910円
項目																																																																			
当期配当等収益額	A	7,426,427円																																																																	
親ファンドの配当等収益額	B	0円																																																																	
分配準備積立金	C	45,298円																																																																	
配当等収益合計額	D=A+B+C	7,471,725円																																																																	
経費	E	660,020円																																																																	
収益分配可能額	F=D-E	6,811,705円																																																																	
収益分配金	G	6,745,000円																																																																	
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	66,705円																																																																	
口数	I	950,000口																																																																	
100口当たり分配金	J=G/I×100	710円																																																																	
項目																																																																			
当期配当等収益額	A	12,620,626円																																																																	
親ファンドの配当等収益額	B	0円																																																																	
分配準備積立金	C	66,705円																																																																	
配当等収益合計額	D=A+B+C	12,687,331円																																																																	
経費	E	1,268,256円																																																																	
収益分配可能額	F=D-E	11,419,075円																																																																	
収益分配金	G	11,375,000円																																																																	
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	44,075円																																																																	
口数	I	1,250,000口																																																																	
100口当たり分配金	J=G/I×100	910円																																																																	
2. その他費用 その他費用のうち25,075円は上場に係る費用、154,609円は外貨建資産の保管等に要する費用であります。	2. その他費用 その他費用のうち110,771円は上場に係る費用、280,505円は外貨建資産の保管等に要する費用であります。																																																																		

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

第2期 自2018年3月8日 至2018年9月7日	第3期 自2018年9月8日 至2019年3月7日
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	1. 金融商品に対する取組方針 同左
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

なっております。
 ○市場リスクの管理
 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。
 ○信用リスクの管理
 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。
 ○流動性リスクの管理
 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第2期 2018年9月7日現在	第3期 2019年3月7日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 国債証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の3 デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2. 時価の算定方法 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自 2018年3月8日 至 2018年9月7日	第3期 自 2018年9月8日 至 2019年3月7日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

第2期 自 2018年3月8日 至 2018年9月7日	第3期 自 2018年9月8日 至 2019年3月7日
期首元本額 550,000,000 円	期首元本額 950,000,000 円
期中追加設定元本額 400,000,000 円	期中追加設定元本額 300,000,000 円
期中一部解約元本額 0 円	期中一部解約元本額 0 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2018年3月8日 至 2018年9月7日	第3期 自 2018年9月8日 至 2019年3月7日
	損益に含まれた評価差額 (円)	損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	△1,863,029	14,466,137
合計	△1,863,029	14,466,137

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第2期(2018年9月7日現在)	第3期(2019年3月7日現在)
----	------------------	------------------

	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超				うち1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	921,485,746	—	917,951,185	3,534,561	1,219,209,046	—	1,222,781,218	△3,572,172
米ドル	411,123,427	—	409,587,573	1,535,854	560,162,666	—	564,151,926	△3,989,260
カナダドル	17,404,452	—	17,206,020	198,432	21,183,499	—	20,870,964	312,535
メキシコペソ	6,782,669	—	6,714,600	68,069	7,913,922	—	7,882,160	31,762
ユーロ	375,280,166	—	374,249,898	1,030,268	482,197,185	—	482,616,904	△419,719
英ポンド	64,403,730	—	64,125,670	278,060	85,987,613	—	85,815,574	172,039
スウェーデン クローナ	2,667,099	—	2,670,800	△3,701	3,949,245	—	3,963,300	△14,055
ノルウェー クローネ	1,400,692	—	1,389,660	11,032	2,670,722	—	2,653,280	17,442
デンマーク クローネ	5,214,413	—	5,200,440	13,973	6,798,664	—	6,801,840	△3,176
ズロチ	5,231,695	—	5,183,500	48,195	5,108,547	—	5,132,750	△24,203
豪ドル	18,433,275	—	18,351,984	81,291	26,372,914	—	26,137,560	235,354
シンガポール ドル	8,400,434	—	8,344,960	55,474	9,354,224	—	9,363,960	△9,736
ランド	5,143,694	—	4,926,080	217,614	7,509,845	—	7,391,000	118,845
合計	921,485,746	—	917,951,185	3,534,561	1,219,209,046	—	1,222,781,218	△3,572,172

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

1) 計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

① 計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

② 計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年3月7日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年3月7日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	60,000.00	76,017.18	
		US TREASURY N/B	90,000.00	88,906.63	
		US TREASURY N/B	260,000.00	256,526.54	

	US TREASURY N/B	200,000.00	197,007.80
	US TREASURY N/B	300,000.00	297,210.93
	US TREASURY N/B	200,000.00	194,593.74
	US TREASURY N/B	320,000.00	317,224.99
	US TREASURY N/B	90,000.00	89,173.82
	US TREASURY N/B	100,000.00	98,664.06
	US TREASURY N/B	250,000.00	246,474.60
	US TREASURY N/B	100,000.00	97,757.81
	US TREASURY N/B	100,000.00	97,679.68
	US TREASURY N/B	100,000.00	97,835.93
	US TREASURY N/B	210,000.00	201,895.30
	US TREASURY N/B	230,000.00	223,117.96
	US TREASURY N/B	120,000.00	121,171.87
	US TREASURY N/B	150,000.00	147,433.59
	US TREASURY N/B	150,000.00	146,800.76
	US TREASURY N/B	550,000.00	541,320.28
	US TREASURY N/B	260,000.00	240,459.36
	US TREASURY N/B	320,000.00	309,749.97
	US TREASURY N/B	20,000.00	20,125.00
	US TREASURY N/B	10,000.00	12,276.56
	US TREASURY N/B	260,000.00	312,893.74
	US TREASURY N/B	480,000.00	429,187.48
	US TREASURY N/B	90,000.00	88,678.12
小計	銘柄数 : 26	5,020,000.00	4,950,183.70 (552,787,013)
	組入時価比率 : 45.4%		46.1%
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	20,000.00	20,013.40
	CANADIAN GOVERNMENT	50,000.00	48,880.00
	CANADIAN GOVERNMENT	30,000.00	29,777.70
	CANADIAN GOVERNMENT	30,000.00	31,193.70
	CANADIAN GOVERNMENT	40,000.00	40,634.00
	CANADIAN GOVERNMENT	10,000.00	14,703.70
	CANADIAN GOVERNMENT	30,000.00	39,998.70
	CANADIAN GOVERNMENT	20,000.00	22,812.00
小計	銘柄数 : 8	230,000.00	248,013.20

			(20,599,976)	
		組入時価比率：1.7%	1.7%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	287,367.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	327,837.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	289,089.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	200,000.00	191,352.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	200,000.00	227,240.00	
小計	銘柄数：5	1,300,000.00	1,322,885.00	
	組入時価比率：0.6%		(7,633,046)	0.6%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	50,000.00	56,747.00	
	BELGIUM KINGDOM	50,000.00	52,808.50	
	BELGIUM KINGDOM	30,000.00	30,768.00	
	BELGIUM KINGDOM	20,000.00	20,572.18	
	BELGIUM KINGDOM	20,000.00	20,039.70	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	30,000.00	47,200.32	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	80,000.00	83,968.88	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	40,000.00	40,900.52	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	50,000.00	60,454.65	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	50,000.00	59,700.62	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	108,519.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	20,000.00	27,383.94	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	70,000.00	72,130.89	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	40,000.00	43,440.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	60,000.00	94,303.26	
	BUNDES OBLIGATION	140,000.00	141,576.40	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	50,000.00	53,725.50	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	108,051.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	105,000.00	106,035.30	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	40,000.00	41,726.40	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,000.00	16,220.30	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,000.00	32,987.72	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	60,000.00	93,785.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,000.00	28,683.80		
BUONI POLIENNALI DEL TES	120,000.00	126,637.20		

BUONI POLIENNALI DEL TES	50,000.00	51,800.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	100,550.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,000.00	34,485.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	130,000.00	147,173.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	99,710.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	50,000.00	49,500.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,000.00	30,501.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	60,000.00	73,704.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	50,000.00	43,460.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	60,000.00	53,094.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000.00	11,006.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	40,000.00	47,628.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,000.00	17,424.00
FINNISH GOVERNMENT	20,000.00	20,261.62
FINNISH GOVERNMENT	20,000.00	20,569.88
FINNISH GOVERNMENT	10,000.00	12,225.05
FINNISH GOVERNMENT	10,000.00	13,550.62
FRANCE (GOVT OF)	130,000.00	146,043.17
FRANCE (GOVT OF)	80,000.00	80,118.24
FRANCE (GOVT OF)	10,000.00	10,922.83
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	80,000.00	83,674.02
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	50,000.00	54,490.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	150,000.00	151,639.42
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	140,000.00	168,994.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	20,000.00	29,889.14
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	20,000.00	21,739.60
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	60,000.00	93,816.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	100,000.00	140,176.80
IRISH GOVERNMENT	20,000.00	20,512.00
IRISH TSY 0.8% 2022	30,000.00	30,977.40
IRISH TSY 1.7% 2037	10,000.00	10,540.00
IRISH TSY 3.4% 2024	30,000.00	35,112.60
NETHERLANDS GOVERNMENT	20,000.00	20,263.94
NETHERLANDS GOVERNMENT	20,000.00	21,805.40
NETHERLANDS GOVERNMENT	60,000.00	63,111.66

小計	NETHERLANDS GOVERNMENT	30,000.00	48,908.73
	REPUBLIC OF AUSTRIA	20,000.00	21,180.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	20,000.00	20,226.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	30,000.00	32,769.18
	REPUBLIC OF AUSTRIA	20,000.00	20,880.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	10,000.00	12,230.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	20,000.00	28,865.76
	銘柄数 : 67 組入時価比率 : 39.1%	3,345,000.00	3,763,895.06 (475,304,668) 39.6%
英ポンド	UK TREASURY	60,000.00	62,693.40
	UK TREASURY	40,000.00	41,280.80
	UK TREASURY	40,000.00	43,902.00
	UK TREASURY	40,000.00	41,324.80
	UK TREASURY	30,000.00	31,081.80
	UK TREASURY	10,000.00	14,105.00
	UK TREASURY	20,000.00	27,944.00
	UK TREASURY	200,000.00	311,500.00
小計	銘柄数 : 8 組入時価比率 : 6.9%	440,000.00	573,831.80 (84,445,087) 7.0%
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	100,000.00	114,810.00
	SWEDISH GOVERNMENT	200,000.00	207,022.92
小計	銘柄数 : 2 組入時価比率 : 0.3%	300,000.00	321,832.92 (3,865,213) 0.3%
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	100,000.00	102,840.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	100,000.00	100,724.00
小計	銘柄数 : 2 組入時価比率 : 0.2%	200,000.00	203,564.00 (2,625,975) 0.2%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	100,000.00	108,760.00
	KINGDOM OF DENMARK	200,000.00	208,200.00
	KINGDOM OF DENMARK	50,000.00	88,148.25
小計	銘柄数 : 3	350,000.00	405,108.25 (6,854,431)

		組入時価比率：0.6%		0.6%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	90,000.00	97,411.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	80,000.00	79,592.00	
小計	銘柄数：2	170,000.00	177,003.50	(5,202,132)
				組入時価比率：0.4%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	70,000.00	76,125.79	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	40,000.00	40,942.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	30,000.00	31,557.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	130,000.00	137,375.03	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	30,000.00	31,622.73	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,000.00	10,727.00	
小計	銘柄数：6	310,000.00	328,349.55	(25,775,439)
				組入時価比率：2.1%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	61,848.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	40,000.00	42,260.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	10,000.00	10,295.00	
小計	銘柄数：3	110,000.00	114,403.00	(9,414,222)
				組入時価比率：0.8%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	199,618.48	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	300,000.00	275,728.08	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	300,000.00	269,940.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	181,213.26	
小計	銘柄数：4	1,000,000.00	926,499.82	(7,254,493)
				組入時価比率：0.6%
合計			1,201,761,695	(1,201,761,695)

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。