



2022年3月期 (2021年9月8日～2022年3月7日) 決算短信  
 Earnings Report for Fiscal Year ended March 2022 (September 8, 2021 – March 7, 2022)

2022年4月18日  
 April 18, 2022

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 小池 広靖  
 問合せ先責任者 サポートダイヤル 長坂 智 TEL 0120-753104

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: Hiroyasu Koike, President & CEO  
 Contact person: Satoshi Nagasaka, Head of Support Dial Team

有価証券報告書提出予定日 2022年5月30日  
 分配金支払開始日 2022年4月15日  
 Scheduled date of submission of securities report: May 30, 2022  
 Date of commencing dividend payment: April 15, 2022

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2022年3月期の運用状況 (2021年9月8日～2022年3月7日)

Management Status for Year ended March 2022 (from September 8, 2021 to March 7, 2022)

(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.	%
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	70,956	(97.8)	1,596	(2.2)	72,553	(100.0)
2021年9月期 FY ended Sep. 2021	46,273	(99.4)	281	(0.6)	46,554	(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
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	45,360	31,590	3,380	73,570
2021年9月期 FY ended Sep. 2021	20,860	30,400	5,900	45,360

(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
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	73,121	567	72,553	98,619
2021年9月期 FY ended Sep. 2021	47,109	554	46,554	102,634

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	590
2021年9月期 FY ended Sep. 2021	580

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8期 (2021年9月7日現在) 8th Fiscal Year As of September 7, 2021	第9期 (2022年3月7日現在) 9th Fiscal Year As of March 7, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
預金 Deposits	133,290,087	97,782,638
コール・ローン Call loans	314,451,511	452,808,965
国債証券 Government bonds	46,273,159,921	70,956,902,658
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	26,326,870	1,047,327,604
未収入金 Accounts receivable - other	96,534,377	173,238,313
未収利息 Accrued interest	157,427,624	283,113,521
前払費用 Prepaid expenses	66,560,249	58,891,640
その他未収収益 Other accrued revenue	-	2,026,305
差入委託証拠金 Margin deposits	41,456,800	48,956,121
流動資産合計 Total current assets	47,109,207,439	73,121,047,765
資産合計 Total assets	47,109,207,439	73,121,047,765
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	153,277,247	29,116,284
未払金 Accounts payable - other	113,172,250	59,736,658
未払収益分配金 Unpaid dividends	263,088,000	434,063,000
未払受託者報酬 Trustee fees payable	3,676,445	6,641,070
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	18,382,168	33,205,300
未払利息 Accrued interest expenses	214	65

その他未払費用 Other accrued expenses	2,700,188	4,465,285
流動負債合計 Total current liabilities	554,296,512	567,227,662
負債合計 Total liabilities	554,296,512	567,227,662
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	45,360,000,000	73,570,000,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	1,194,910,927	△1,016,179,897
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	1,643,037	1,001,918
元本等合計 Total principal and other	46,554,910,927	72,553,820,103
純資産合計 Total net assets	46,554,910,927	72,553,820,103
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	47,109,207,439	73,121,047,765

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

(単位:円)(Unit:JPY)

	第8期 自 2021年3月8日 至 2021年9月7日 8th Fiscal Year From March 8, 2021 to September 7, 2021	第9期 自 2021年9月8日 至 2022年3月7日 9th Fiscal Year From September 8, 2021 to March 7, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取利息 Interest income	290,101,113	487,145,994
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	235,595,238	△2,387,237,490
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	9,892,996	7,512,407
為替差損益 Foreign exchange gains or losses	△7,335,359	△93,726,722
その他収益 Other revenue	796,584	2,026,305
営業収益合計 Total operating revenue	529,050,572	△1,984,279,506
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	211,249	193,919
受託者報酬	3,676,445	6,641,070

Trustee fees		
委託者報酬 Investment trust management fees	18,382,168	33,205,300
その他費用 Other expenses	5,831,386	15,710,129
営業費用合計 Total operating expenses	28,101,248	55,750,418
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	500,949,324	△2,040,029,924
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	500,949,324	△2,040,029,924
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	500,949,324	△2,040,029,924
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	379,837,103	1,194,910,927
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	750,845,100	280,535,300
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit from additional subscriptions for period	750,845,100	280,535,300
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	173,632,600	17,533,200
当期一部解約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 partial redemptions	173,632,600	17,533,200
分配金 Dividends	263,088,000	434,063,000
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	1,194,910,927	△1,016,179,897

### (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	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年9月8日から2022年3月7日までとなっております。
--------	--

(重要な会計上の見積りに関する注記)  
 該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

第8期 2021年9月7日現在	第9期 2022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 45,360,000口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 73,570,000口
2. 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 1,026.34円 (100口当たり純資産額) (102,634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 1,016,179,897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 986.19円 (100口当たり純資産額) (98,619円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自2021年3月8日 至2021年9月7日	第9期 自2021年9月8日 至2022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>290,686,448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>1,934,588円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>D=A+B+C</td> <td>292,621,036円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>E</td> <td>27,889,999円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>F=D-E</td> <td>264,731,037円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>G</td> <td>263,088,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>H=F-G</td> <td>1,643,037円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>I</td> <td>45,360,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>J=G/I×100</td> <td>580円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	290,686,448円	親ファンドの配当等収益額	B	0円	分配準備積立金	C	1,934,588円	配当等収益合計額	D=A+B+C	292,621,036円	経費	E	27,889,999円	収益分配可能額	F=D-E	264,731,037円	収益分配金	G	263,088,000円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	1,643,037円	口数	I	45,360,000口	100口当たり分配金	J=G/I×100	580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>488,978,380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>1,643,037円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>D=A+B+C</td> <td>490,621,417円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>E</td> <td>55,556,499円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>F=D-E</td> <td>435,064,918円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>G</td> <td>434,063,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>H=F-G</td> <td>1,001,918円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>I</td> <td>73,570,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>J=G/I×100</td> <td>590円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	488,978,380円	親ファンドの配当等収益額	B	0円	分配準備積立金	C	1,643,037円	配当等収益合計額	D=A+B+C	490,621,417円	経費	E	55,556,499円	収益分配可能額	F=D-E	435,064,918円	収益分配金	G	434,063,000円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	1,001,918円	口数	I	73,570,000口	100口当たり分配金	J=G/I×100	590円
項目																																																																			
当期配当等収益額	A	290,686,448円																																																																	
親ファンドの配当等収益額	B	0円																																																																	
分配準備積立金	C	1,934,588円																																																																	
配当等収益合計額	D=A+B+C	292,621,036円																																																																	
経費	E	27,889,999円																																																																	
収益分配可能額	F=D-E	264,731,037円																																																																	
収益分配金	G	263,088,000円																																																																	
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	1,643,037円																																																																	
口数	I	45,360,000口																																																																	
100口当たり分配金	J=G/I×100	580円																																																																	
項目																																																																			
当期配当等収益額	A	488,978,380円																																																																	
親ファンドの配当等収益額	B	0円																																																																	
分配準備積立金	C	1,643,037円																																																																	
配当等収益合計額	D=A+B+C	490,621,417円																																																																	
経費	E	55,556,499円																																																																	
収益分配可能額	F=D-E	435,064,918円																																																																	
収益分配金	G	434,063,000円																																																																	
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	1,001,918円																																																																	
口数	I	73,570,000口																																																																	
100口当たり分配金	J=G/I×100	590円																																																																	
2. その他費用 その他費用のうち941,519円は上場に係る費用、3,354,056円は対象指数についての商標使用料、1,104,899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7,386,256円は上場に係る費用、6,053,875円は対象指数についての商標使用料、1,526,204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8期 自2021年3月8日 至2021年9月7日	第9期 自2021年9月8日 至2022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	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左

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。	
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なっております。	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左
○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8期 2021年9月7日現在	第9期 2022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。	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 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。	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8期 自 2021年3月8日 至 2021年9月7日	第9期 自 2021年9月8日 至 2022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8期 自 2021年3月8日 至 2021年9月7日	第9期 自 2021年9月8日 至 2022年3月7日
期首元本額 20,860,000,000円	期首元本額 45,360,000,000円
期中追加設定元本額 30,400,000,000円	期中追加設定元本額 31,590,000,000円
期中一部解約元本額 5,900,000,000円	期中一部解約元本額 3,380,000,000円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第8期 自 2021年3月8日 至 2021年9月7日	第9期 自 2021年9月8日 至 2022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	205,834,003	△2,270,503,016
合計	205,834,003	△2,270,503,016

### 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8期(2021年9月7日現在)				第9期(2022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	46,557,408,540	—	46,684,358,917	△126,950,377	71,909,271,150	—	70,891,059,830	1,018,211,320
米ドル	21,108,687,412	—	21,082,360,542	26,326,870	34,847,659,437	—	34,717,658,994	130,000,443
カナダドル	955,820,086	—	960,609,575	△4,789,489	1,441,067,275	—	1,441,094,416	△27,141
メキシコペソ	338,134,920	—	341,943,906	△3,808,986	521,491,038	—	509,128,100	12,362,938
ユーロ	18,972,767,802	—	19,077,982,058	△105,214,256	27,184,923,438	—	26,391,316,342	793,607,096
英ポンド	2,916,783,910	—	2,930,487,089	△13,703,179	4,060,119,160	—	3,997,884,971	62,234,189
スウェーデン クローナ	142,631,097	—	143,679,600	△1,048,503	171,264,019	—	164,178,300	7,085,719
ノルウェーク ローネ	114,852,621	—	115,047,540	△194,919	147,457,323	—	146,653,579	803,744
デンマークク ローネ	232,273,100	—	233,492,480	△1,219,380	331,214,591	—	321,266,986	9,947,605
ズロチ	277,039,592	—	280,733,671	△3,694,079	285,682,674	—	263,334,549	22,348,125
豪ドル	899,340,568	—	917,599,680	△18,259,112	1,141,141,981	—	1,170,116,584	△28,974,603
シンガポール ドル	390,152,872	—	390,730,768	△577,896	643,149,368	—	638,744,681	4,404,687
人民元	—	—	—	—	834,149,134	—	830,967,720	3,181,414
新シケル	208,924,560	—	209,692,008	△767,448	299,951,712	—	298,714,608	1,237,104
合計	46,557,408,540	—	46,684,358,917	△126,950,377	71,909,271,150	—	70,891,059,830	1,018,211,320

(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(2022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(2022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	100,000.00	101,914.06	
		US TREASURY BOND	100,000.00	116,867.18	
		US TREASURY BOND	30,000.00	37,265.62	
		US TREASURY BOND	1,000,000.00	1,101,015.60	
		US TREASURY BOND	670,000.00	840,431.25	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	994,101.50	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,007,890.60	
		US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,125,731.15	
		US TREASURY N/B	500,000.00	508,906.25	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,470,214.75	
		US TREASURY N/B	830,000.00	835,252.32	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,480,781.25	
		US TREASURY N/B	700,000.00	713,015.59	
		US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,402,187.50	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	984,375.00	
		US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,297,163.98	
		US TREASURY N/B	150,000.00	152,566.39	
		US TREASURY N/B	800,000.00	786,374.96	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,000,702.90	
		US TREASURY N/B	600,000.00	612,281.22	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,946,562.50	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	981,328.10	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,500,000.00	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,473,867.15	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,449,609.25	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,007,031.20	
		US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,684,937.32	
		US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,144,762.41	
		US TREASURY N/B	250,000.00	252,871.07	
		US TREASURY N/B	400,000.00	409,875.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,954,062.40			
US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,297,109.37			
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,950,937.40			

	US TREASURY N/B	420,000.00	425,939.05
	US TREASURY N/B	600,000.00	611,296.86
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	988,789.00
	US TREASURY N/B	800,000.00	819,250.00
	US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,921,718.60
	US TREASURY N/B	600,000.00	607,031.22
	US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,626,624.96
	US TREASURY N/B	700,000.00	682,171.84
	US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,240,000.00
	US TREASURY N/B	720,000.00	726,975.00
	US TREASURY N/B	120,000.00	121,743.74
	US TREASURY N/B	150,000.00	153,070.30
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,458,046.80
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,019,531.20
	US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,911,875.00
	US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,363,605.43
	US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,612,085.84
	US TREASURY N/B	250,000.00	253,281.25
	US TREASURY N/B	600,000.00	602,578.08
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,216,156.14
	US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,975,390.40
	US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,425,000.00
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,013,554.60
	US TREASURY N/B	800,000.00	798,374.96
	US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,413,867.10
	US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,932,507.67
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,995,000.00
	US TREASURY N/B	150,000.00	152,636.71
	US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,115,210.91
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,993,125.00
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	983,789.00
	US TREASURY N/B	100,000.00	101,785.15
	US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,807,171.74
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,479,726.45
	US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,183,749.05

	US TREASURY N/B	1,000,000.00	993,476.50
	US TREASURY N/B	100,000.00	101,125.00
	US TREASURY N/B	400,000.00	413,031.24
	US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,464,062.50
	US TREASURY N/B	200,000.00	205,945.30
	US TREASURY N/B	850,000.00	821,412.03
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,076,406.20
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,634,589.78
	US TREASURY N/B	150,000.00	152,320.30
	US TREASURY N/B	500,000.00	519,238.25
	US TREASURY N/B	700,000.00	669,074.21
	US TREASURY N/B	600,000.00	621,281.22
	US TREASURY N/B	550,000.00	525,185.54
	US TREASURY N/B	900,000.00	858,445.29
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,517,695.20
	US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,606,913.98
	US TREASURY N/B	800,000.00	762,218.72
	US TREASURY N/B	700,000.00	732,539.01
	US TREASURY N/B	800,000.00	761,000.00
	US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,717,771.75
	US TREASURY N/B	700,000.00	665,246.05
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,532,343.75
	US TREASURY N/B	600,000.00	572,320.26
	US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,486,812.32
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,906,562.40
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,036,562.50
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	951,406.20
	US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,448,640.62
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,032,421.80
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,432,210.92
	US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,410,449.00
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,697,476.52
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,527,949.20
	US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,155,796.80
	US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,027,421.80

US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,903,437.50
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,540,312.50
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,482,538.95
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,404,296.75
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,998,125.00
US TREASURY N/B	400,000.00	386,484.36
US TREASURY N/B	600,000.00	599,531.22
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,953,359.20
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,625,249.92
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,898,960.89
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,965,078.00
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,010,468.60
US TREASURY N/B	1,000,000.00	981,992.10
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,073,413.96
US TREASURY N/B	2,440,000.00	2,510,340.56
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,925,585.90
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,320,703.02
US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,916,122.88
US TREASURY N/B	950,000.00	895,152.32
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,694,812.50
US TREASURY N/B	850,000.00	876,496.03
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,117,593.72
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,311,843.68
US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,051,635.91
US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,283,072.62
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,422,749.76
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,115,249.92
US TREASURY N/B	700,000.00	670,523.42
US TREASURY N/B	1,630,000.00	1,747,792.92
US TREASURY N/B	1,000,000.00	965,312.50
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,431,054.50
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,568,000.00
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,362,500.00
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,975,468.60
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,960,078.00

	US TREASURY N/B	2,950,000.00	3,132,070.16
	US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,068,290.57
	US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,393,250.00
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,213,577.96
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,868,359.20
	US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,059,917.93
	US TREASURY N/B	700,000.00	944,835.92
	US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,528,066.20
	US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,474,929.62
	US TREASURY N/B	340,000.00	444,364.05
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,287,831.75
	US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,780,859.20
	US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,303,624.88
	US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,392,538.80
	US TREASURY N/B	110,000.00	147,391.39
	US TREASURY N/B	230,000.00	313,967.96
	US TREASURY N/B	520,000.00	634,440.61
	US TREASURY N/B	310,000.00	413,075.00
	US TREASURY N/B	600,000.00	823,406.22
	US TREASURY N/B	1,250,000.00	1,688,769.50
	US TREASURY N/B	1,130,000.00	942,578.87
	US TREASURY N/B	1,670,000.00	2,213,924.17
	US TREASURY N/B	730,000.00	635,157.01
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	2,112,187.50
	US TREASURY N/B	2,030,000.00	2,736,059.37
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,119,953.04
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,567,253.80
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,145,859.30
	US TREASURY N/B	300,000.00	288,656.25
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,520,890.46
	US TREASURY N/B	650,000.00	731,148.40
	US TREASURY N/B	700,000.00	756,820.26
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,512,054.60
	US TREASURY N/B	800,000.00	914,937.44
	US TREASURY N/B	700,000.00	861,656.25

	US TREASURY N/B	890,000.00	1,098,037.50	
	US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,430,062.44	
	US TREASURY N/B	900,000.00	1,033,101.54	
	US TREASURY N/B	930,000.00	1,048,030.02	
	US TREASURY N/B	350,000.00	362,988.25	
	US TREASURY N/B	210,000.00	237,152.32	
	US TREASURY N/B	690,000.00	764,552.29	
	US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,472,351.53	
	US TREASURY N/B	750,000.00	780,351.52	
	US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,134,536.63	
	US TREASURY N/B	1,420,000.00	1,411,901.45	
	US TREASURY N/B	600,000.00	668,765.58	
	US TREASURY N/B	600,000.00	684,703.08	
	US TREASURY N/B	1,420,000.00	1,624,346.80	
	US TREASURY N/B	2,030,000.00	2,232,365.62	
	US TREASURY N/B	520,000.00	572,446.83	
	US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,433,071.84	
	US TREASURY N/B	400,000.00	473,218.72	
	US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,540,825.74	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,240,390.60	
	US TREASURY N/B	500,000.00	582,578.10	
	US TREASURY N/B	820,000.00	935,825.00	
	US TREASURY N/B	440,000.00	445,121.86	
	US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,092,328.12	
	US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,229,499.90	
	US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,015,409.31	
	US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,268,750.00	
	US TREASURY N/B	1,100,000.00	965,679.66	
	US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,213,519.45	
	US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,764,250.00	
	US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,885,273.40	
	US TREASURY N/B	300,000.00	306,750.00	
小計	銘柄数：205	295,620,000.00	300,258,229.90	
			(34,535,701,603)	
	組入時価比率：47.6%		48.7%	

カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	650,000.00	653,498.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	791,195.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	580,000.00	581,896.02	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	101,061.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	690,647.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	988,128.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	203,379.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	586,218.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	60,000.00	61,447.92	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	400,884.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,094,112.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	774,913.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	763,508.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	420,000.00	421,308.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	586,234.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	340,232.64	
	CANADIAN GOVERNMENT	650,000.00	634,728.25	
	CANADIAN GOVERNMENT	900,000.00	820,443.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	593,811.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	690,242.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	420,000.00	590,451.54	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	280,167.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	420,000.00	553,971.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	423,495.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	480,000.00	557,406.72	
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	707,167.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,039,261.30	
小計	銘柄数 : 27	15,640,000.00	15,929,813.39	
			(1,438,780,745)	
	組入時価比率 : 2.0%		2.0%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,700,000.00	8,740,020.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,600,000.00	4,847,430.32	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	9,260,787.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,000,000.00	6,507,315.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	9,011,700.00	

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,300,000.00	5,203,509.79
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,400,000.00	6,582,426.24
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,500,000.00	10,289,685.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,800,000.00	9,496,690.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	346,800.03
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,500,000.00	2,534,576.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,400,000.00	5,987,584.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,700,000.00	4,498,080.95
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	6,000,000.00	6,013,186.80
	銘柄数 : 14	92,200,000.00	89,319,791.63 (490,008,376)
組入時価比率 : 0.7%		0.7%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	103,795.00
	BELGIUM KINGDOM	570,000.00	578,065.50
	BELGIUM KINGDOM	80,000.00	85,848.00
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	410,880.80
	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	832,677.60
	BELGIUM KINGDOM	1,050,000.00	1,107,523.20
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	209,894.00
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	200,973.60
	BELGIUM KINGDOM	660,000.00	694,345.74
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,058,135.00
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	296,820.00
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	673,606.50
	BELGIUM KINGDOM	50,000.00	67,929.20
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	394,080.00
	BELGIUM KINGDOM	750,000.00	814,950.00
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	643,404.50
	BELGIUM KINGDOM	540,000.00	592,189.38
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	351,786.60
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	317,380.40
	BELGIUM KINGDOM	290,000.00	455,842.59
	BELGIUM KINGDOM	780,000.00	873,031.38
BELGIUM KINGDOM	700,000.00	801,027.08	
BELGIUM KINGDOM	200,000.00	261,576.20	



	BELGIUM KINGDOM GOVT	400,000.00	537,521.20	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	50,000.00	77,358.30	
	BONOS Y OBLIG DE	400,000.00	386,187.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,100,000.00	1,112,592.80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	50,000.00	53,999.36	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	219,876.80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	108,750.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,300,000.00	1,307,173.66	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	950,000.00	961,020.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,300,000.00	2,484,717.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,250,000.00	1,255,000.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	738,045.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	579,201.65	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	650,000.00	701,478.70	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	997,700.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	968,192.10	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,060,000.00	1,329,293.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	948,113.10	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	750,000.00	797,025.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	318,270.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	780,440.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,080,000.00	1,146,927.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	529,200.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	950,000.00	1,012,527.10	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	501,135.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	850,000.00	841,064.80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,150,000.00	1,270,417.65	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000.00	1,251,480.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,100,000.00	1,029,050.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	571,500.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	651,690.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	656,113.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	960,000.00	927,369.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	210,000.00	330,520.89	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	462,200.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	637,006.43
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	720,000.00	922,901.76
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	950,000.00	1,181,887.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	850,000.00	725,249.75
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	425,691.90
BUNDESobligation	200,000.00	202,792.00
BUNDESobligation	500,000.00	511,320.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	950,000.00	975,963.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	226,214.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,600,000.00	1,667,536.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000.00	2,069,200.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,055,390.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,145,001.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	755,000.00	771,715.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	1,345,383.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	825,072.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	209,818.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,532,400.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	813,666.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	340,000.00	357,629.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	130,000.00	134,915.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,021,510.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	480,000.00	498,662.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	1,326,767.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	607,916.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,121,285.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,526,355.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	510,580.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	317,984.10
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,015,390.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	506,285.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,410,000.00	2,262,548.04
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	996,940.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,091,948.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	350,000.00	561,692.25

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	993,007.26
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	749,362.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	860,000.00	1,432,262.06
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	890,921.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	790,000.00	1,272,192.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	840,000.00	1,099,501.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	800,000.00	775,208.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	800,000.00	765,928.00
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	600,000.00	604,672.92
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	506,795.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,012,910.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	950,000.00	989,520.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	850,000.00	863,090.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,091,300.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,076,700.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,091,600.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,137,510.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,000.00	31,920.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	171,315.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,139,820.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,078,833.20
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	420,120.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	210,000.00	226,422.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	847,920.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,002,220.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	603,720.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,461,740.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	639,660.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	973,500.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,000.00	39,255.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	566,665.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	908,505.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	269,000.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,200,000.00	1,279,800.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,008,800.00

BUONI POLIENNALI DEL TES	850,000.00	907,035.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	291,210.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	1,115,100.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	860,000.00	963,200.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	780,000.00	884,208.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,000.00	39,282.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,030,000.00	1,215,400.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,370,000.00	1,385,344.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	681,800.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	923,812.20
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,300,000.00	1,246,793.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	477,302.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	950,000.00	968,905.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	946,100.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	210,000.00	298,977.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	436,400.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	966,000.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,150,000.00	1,367,350.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,065,350.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,160,000.00	1,235,284.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	232,452.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	267,720.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	460,160.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	120,000.00	175,800.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	528,525.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	741,250.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	436,950.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	719,280.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	695,286.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,080,000.00	1,203,336.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	250,180.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	1,206,180.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	523,500.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	179,064.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	294,300.00

	BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	160,199.49
	FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	100,921.80
	FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,011,643.00
	FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,563,489.15
	FINNISH GOVERNMENT	20,000.00	20,617.42
	FINNISH GOVERNMENT	260,000.00	305,548.36
	FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	205,080.00
	FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	208,549.60
	FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	374,754.00
	FINNISH GOVERNMENT	10,000.00	13,931.58
	FINNISH GOVERNMENT	170,000.00	200,748.58
	FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	168,492.60
	FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	503,500.00
	FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,862,280.00
	FRANCE (GOVT OF)	3,800,000.00	3,849,311.84
	FRANCE (GOVT OF)	2,500,000.00	2,531,000.00
	FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	531,746.00
	FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,013,115.00
	FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,059,908.00
	FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,136,397.90
	FRANCE (GOVT OF)	1,150,000.00	1,175,824.40
	FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,512,900.00
	FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,060,560.00
	FRANCE (GOVT OF)	2,400,000.00	2,518,440.00
	FRANCE (GOVT OF)	1,400,000.00	1,469,832.00
	FRANCE (GOVT OF)	1,650,000.00	1,700,892.60
	FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	692,705.30
	FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	1,431,795.60
	FRANCE (GOVT OF)	1,700,000.00	1,663,099.80
	FRANCE (GOVT OF)	1,600,000.00	1,545,742.40
	FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	670,530.00
	FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	1,300,474.80
	FRANCE (GOVT OF)	750,000.00	812,550.00
	FRANCE (GOVT OF)	910,000.00	1,074,382.40
	FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,051,069.80

FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	463,985.00
FRANCE (GOVT OF)	900,000.00	1,129,667.40
FRANCE (GOVT OF)	1,460,000.00	1,655,891.12
FRANCE (GOVT OF)	1,330,000.00	1,242,489.99
FRANCE (GOVT OF)	1,400,000.00	1,290,900.80
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	130,000.00	140,667.80
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1,200,000.00	1,275,354.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	400,000.00	494,781.20
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1,000,000.00	1,049,700.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	900,000.00	910,777.50
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	800,000.00	927,000.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	400,000.00	465,540.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1,000,000.00	1,392,745.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1,060,000.00	1,179,251.06
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1,240,000.00	1,941,216.28
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	900,000.00	1,385,397.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1,010,000.00	1,545,754.50
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	700,000.00	1,150,310.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	780,000.00	1,172,418.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	200,000.00	366,880.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	400,000.00	772,004.40
IRISH GOVERNMENT	40,000.00	42,358.68
IRISH GOVERNMENT	700,000.00	681,983.40
IRISH TSY 0.2%	800,000.00	812,540.40
IRISH TSY 0.2% 2030	500,000.00	494,412.00
IRISH TSY 0.4% 2035	300,000.00	288,660.00
IRISH TSY 1.10% 2029	420,000.00	447,630.54
IRISH TSY 1.5% 2050	250,000.00	277,191.00
IRISH TSY 1.7% 2037	230,000.00	259,651.14
IRISH TSY 1% 2026	400,000.00	421,305.60
IRISH TSY 2.4% 2030	100,000.00	117,613.80
IRISH TSY 2% 2045	210,000.00	258,224.63
IRISH TSY 3.4% 2024	1,330,000.00	1,438,730.16
NETHERLANDS GOVERNMENT	620,000.00	644,800.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,013,751.00

	NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	428,000.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	824,000.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	700,000.00	727,930.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	460,000.00	485,190.56
	NETHERLANDS GOVERNMENT	450,000.00	598,545.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	423,560.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	621,840.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	798,994.16
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	496,350.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	438,461.80
	NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	464,869.80
	NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	286,344.21
	NETHERLANDS GOVERNMENT	700,000.00	731,837.40
	NETHERLANDS GOVERNMENT	450,000.00	755,959.95
	NETHERLANDS GOVERNMENT	450,000.00	723,720.60
	NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	363,456.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	930,000.00	966,624.33
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,519,950.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	529,560.25
	REPUBLIC OF AUSTRIA	730,000.00	761,728.72
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	155,002.80
	REPUBLIC OF AUSTRIA	730,000.00	763,328.15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	883,277.10
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	971,237.40
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	283,114.13
	REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	472,110.50
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	613,900.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	380,000.00	579,779.68
	REPUBLIC OF AUSTRIA	250,000.00	295,100.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	696,231.90
	REPUBLIC OF AUSTRIA	50,000.00	99,474.00
	SPANISH GOVERNMENT	140,000.00	193,113.76
	SPANISH GOVERNMENT	150,000.00	222,855.00
	SPANISH GOVERNMENT	500,000.00	707,939.00
小計	銘柄数 : 267	195,235,000.00	213,659,065.37

			(26,711,656,352)
	組入時価比率 : 36.8%		37.6%
英債券	UK TREASURY	450,000.00	448,272.00
	UK TREASURY	100,000.00	101,675.36
	UK TREASURY	900,000.00	883,665.00
	UK TREASURY	600,000.00	599,400.00
	UK TREASURY	600,000.00	624,523.44
	UK TREASURY	400,000.00	390,624.00
	UK TREASURY	500,000.00	558,437.20
	UK TREASURY	350,000.00	346,030.65
	UK TREASURY	700,000.00	724,005.80
	UK TREASURY	340,000.00	347,705.89
	UK TREASURY	700,000.00	679,323.68
	UK TREASURY	460,000.00	466,601.00
	UK TREASURY	450,000.00	530,864.01
	UK TREASURY	700,000.00	664,594.00
	UK TREASURY	30,000.00	31,216.23
	UK TREASURY	500,000.00	481,217.00
	UK TREASURY	370,000.00	365,393.50
	UK TREASURY	500,000.00	470,739.20
	UK TREASURY	1,000,000.00	918,240.00
	UK TREASURY	430,000.00	555,899.70
	UK TREASURY	500,000.00	480,125.00
	UK TREASURY	660,000.00	898,906.80
	UK TREASURY	100,000.00	90,471.00
	UK TREASURY	500,000.00	681,817.20
	UK TREASURY	510,000.00	532,776.60
	UK TREASURY	400,000.00	599,507.84
	UK TREASURY	600,000.00	570,216.00
	UK TREASURY	250,000.00	358,820.00
UK TREASURY	420,000.00	612,703.05	
UK TREASURY	810,000.00	779,058.00	
UK TREASURY	440,000.00	680,051.50	
UK TREASURY	300,000.00	418,124.40	
UK TREASURY	520,000.00	818,818.00	



	UK TREASURY	540,000.00	543,978.72	
	UK TREASURY	720,000.00	768,384.00	
	UK TREASURY	860,000.00	1,408,052.20	
	UK TREASURY	1,000,000.00	953,880.00	
	UK TREASURY	500,000.00	784,945.00	
	UK TREASURY	550,000.00	563,065.36	
	UK TREASURY	900,000.00	949,361.58	
	UK TREASURY	500,000.00	550,675.40	
	UK TREASURY	270,000.00	482,216.43	
	UK TSY 0 1/2% 2061	250,000.00	187,147.50	
	UK TSY 0 5/8% 2050	830,000.00	676,862.01	
	UK TSY 3 1/4% 2044	300,000.00	399,791.10	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	351,592.00	
	UNITED KINGDOM (GOVERNMEN	200,000.00	353,292.00	
小計	銘柄数 : 47	23,910,000.00	26,683,066.35	
			(4,054,225,101)	
	組入時価比率 : 5.6%		5.7%	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	2,100,000.00	2,260,650.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,200,000.00	2,280,564.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	200,000.00	205,708.52	
	SWEDISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,305,088.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,700,000.00	2,640,007.89	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,500,000.00	2,958,325.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	100,000.00	147,664.00	
小計	銘柄数 : 7	13,000,000.00	13,798,007.41	
			(159,642,945)	
	組入時価比率 : 0.2%		0.2%	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	100,000.00	100,840.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,027,580.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,600,447.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	990,355.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	300,000.00	298,260.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,978,955.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	700,000.00	673,249.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,361,975.00	

小計	銘柄数：8  組入時価比率：0.2%	11,200,000.00	11,031,661.90  (141,205,272)  0.2%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	2,000,000.00	2,074,222.00
	KINGDOM OF DENMARK	1,000,000.00	1,012,550.00
	KINGDOM OF DENMARK	1,000,000.00	1,075,200.00
	KINGDOM OF DENMARK	2,100,000.00	2,171,676.36
	KINGDOM OF DENMARK	2,700,000.00	2,790,720.00
	KINGDOM OF DENMARK	2,500,000.00	2,452,140.00
	KINGDOM OF DENMARK	3,370,000.00	5,791,661.44
	KINGDOM OF DENMARK	1,300,000.00	1,266,414.50
小計	銘柄数：8  組入時価比率：0.4%	15,970,000.00	18,634,584.30  (313,061,016)  0.4%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	3,901,970.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,242,300.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,300,000.00	1,183,260.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,500,000.00	2,282,500.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	1,572,800.00
小計	銘柄数：5  組入時価比率：0.4%	11,400,000.00	10,182,830.00  (257,714,189)  0.4%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	100,000.00	105,439.65
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	880,000.00	909,832.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	387,496.12
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	315,368.76
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	474,005.95
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	769,609.61
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	600,000.00	565,020.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	600,000.00	684,483.18
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	480,000.00	501,408.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	509,175.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	209,464.54
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	757,219.75
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	473,445.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	350,000.00	361,224.78

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,093,452.24	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	189,541.14	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	904,300.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	458,961.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	480,095.95	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	670,000.00	824,056.38	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	630,000.00	662,075.19	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	351,118.95	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	331,050.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	220,000.00	224,540.42	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	464,728.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	323,080.00	
小計	銘柄数 : 26	13,120,000.00	13,330,191.81 (1,133,199,605)	
	組入時価比率 : 1.6%		1.6%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	163,459.79	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	104,060.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	515,100.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	289,410.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	450,000.00	459,900.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	982,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	217,160.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	600,000.00	631,020.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	550,000.00	589,875.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	600,000.00	648,900.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	979,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	512,890.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	313,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	155,751.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	446,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	283,800.00	
小計	銘柄数 : 16	7,100,000.00	7,294,126.19 (615,332,485)	
	組入時価比率 : 0.8%		0.9%	
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	14,040,406.80	

小計	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,017,660.00		
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,000,000.00	7,933,200.00		
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,048,690.00		
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,032,205.00		
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,016,044.30		
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,101,461.00		
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,055,339.00		
	銘柄数 : 8	45,000,000.00	45,245,006.10 (823,545,076)	1.2%	
	組入時価比率 : 1.1%				
	新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	1,600,000.00	1,622,021.92	
		ISRAEL FIXED BOND	600,000.00	611,781.78	
		ISRAEL FIXED BOND	400,000.00	412,466.04	
		ISRAEL FIXED BOND	1,200,000.00	1,257,552.36	
		ISRAEL FIXED BOND	3,200,000.00	3,022,104.00	
ISRAEL FIXED BOND		500,000.00	442,446.60		
ISRAEL FIXED BOND		400,000.00	580,190.40		
ISRAEL FIXED BOND		100,000.00	116,046.58		
銘柄数 : 8		8,000,000.00	8,064,609.68 (282,829,893)	0.4%	
組入時価比率 : 0.4%					
合計		70,956,902,658 (70,956,902,658)			

(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。