



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

2018年10月17日
 October 17, 2018

		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 兼執行役社長	渡邊 国夫	
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:	Kunio Watanabe, 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	2018年12月5日
分配金支払開始日	2018年10月16日
Scheduled date of submission of securities report:	December 5, 2018
Date of commencing dividend payment:	October 16, 2018

I ファンドの運用状況

Fund Management

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

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

(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.	%
2018年9月期 FY ended Sep. 2018	903	(97.9)	19	(2.1)	922	(100.0)
2018年3月期 FY ended Mar. 2018	524	(97.7)	12	(2.3)	536	(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
2018年9月期 FY ended Sep. 2018	550	400	0	950
2018年3月期 FY ended Mar. 2018	0	550	0	550

(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
2018年9月期 FY ended Sep. 2018	929	7	922	97,122
2018年3月期 FY ended Mar. 2018	540	3	536	97,585

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2018年9月期 FY ended Sep. 2018	710
2018年3月期 FY ended Mar. 2018	320

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1期 (2018年3月7日現在) 1st Fiscal Year As of March 7, 2018	第2期 (2018年9月7日現在) 2nd Fiscal Year As of September 7, 2018
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
預金 Deposits	2,561,141	558,820
コール・ローン Call loans	5,222,719	7,517,259
国債証券 Government bonds	524,130,424	903,259,508
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	2,879,468	3,539,085
未収入金 Accounts receivable - other	-	5,229,071
未収利息 Accrued interest	2,314,106	4,471,590
前払費用 Prepaid expenses	2,404,445	1,954,133
差入委託証拠金 Customers' margin	703,697	3,398,139
流動資産合計 Total current assets	540,216,000	929,927,605
資産合計 Total assets	540,216,000	929,927,605
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	1,527,418	4,524
未払収益分配金 Unpaid dividends	1,760,000	6,745,000
未払受託者報酬 Trustee fee payable	28,189	68,347
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	140,926	341,633
未払利息 Accrued interest expenses	7	12
その他未払費用 Other accrued expenses	44,569	104,967
流動負債合計 Total current liabilities	3,501,109	7,264,483

負債合計 Total liabilities	3,501,109	7,264,483
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	550,000,000	950,000,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	△13,285,109	△27,336,878
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	45,298	66,705
元本等合計 Total principal and other	536,714,891	922,663,122
純資産合計 Total net assets	536,714,891	922,663,122
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	540,216,000	929,927,605

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

(単位:円) (Unit:JPY)

	第1期 自 2017年12月7日 至 2018年3月7日 1st Fiscal Year From December 7, 2017 to March 7, 2018	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
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取利息 Interest income	2,790,700	7,416,474
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△11,441,363	△1,939,395
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△6,463	△143,459
為替差損益 Foreign exchange gains or losses	△1,507,081	△3,797,022
その他収益 Other revenue	-	12,431
営業収益合計 Total operating revenue	△10,164,207	1,549,029
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	3,459	2,478
受託者報酬 Trustee fee	28,189	68,347
委託者報酬 Investment trust management fee	140,926	341,633
その他費用	812,828	250,040

Other expenses		
営業費用合計 Total operating expenses	985,402	662,498
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	△11,149,609	886,531
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	△11,149,609	886,531
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	△11,149,609	886,531
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
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	375,500	8,193,300
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	375,500	8,193,300
分配金 Dividends	1,760,000	6,745,000
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	△13,285,109	△27,336,878

(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	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。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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。
3. 費用・収益の計上基準	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。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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った場合、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。
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、2018年3月8日から2018年9月7日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2018年3月7日現在	第2期 2018年9月7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1. 計算期間の末日における受益権の総数

<p style="text-align: right;">550,000 口</p> <p>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</p> <p style="text-align: right;">元本の欠損 13,285,109 円</p> <p>3. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額</p> <p style="text-align: right;">1 口当たり純資産額 975.85 円 (100 口当たり純資産額) (97,585 円)</p>	<p style="text-align: right;">950,000 口</p> <p>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</p> <p style="text-align: right;">元本の欠損 27,336,878 円</p> <p>3. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額</p> <p style="text-align: right;">1 口当たり純資産額 971.22 円 (100 口当たり純資産額) (97,122 円)</p>
--	--

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 1 期 自 2017 年 12 月 7 日 至 2018 年 3 月 7 日	第 2 期 自 2018 年 3 月 8 日 至 2018 年 9 月 7 日																																																																		
<p>1. 分配金の計算過程</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">項目</th> <th style="width: 30%;"></th> <th style="width: 40%;"></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">2,787,241 円</td> </tr> <tr> <td>親ファンドの配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">0 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">C</td> <td style="text-align: right;">0 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">D=A+B+C</td> <td style="text-align: right;">2,787,241 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">E</td> <td style="text-align: right;">981,943 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">F=D-E</td> <td style="text-align: right;">1,805,298 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">G</td> <td style="text-align: right;">1,760,000 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">H=F-G</td> <td style="text-align: right;">45,298 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">I</td> <td style="text-align: right;">550,000 口</td> </tr> <tr> <td>100 口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">J=G/I×100</td> <td style="text-align: right;">320 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち 600,951 円は上場に係る費用、170,060 円は外貨建資産の保管等に要する費用であります。</p> <p>3. 追加情報 2016 年 1 月 29 日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。</p>	項目			当期配当等収益額	A	2,787,241 円	親ファンドの配当等収益額	B	0 円	分配準備積立金	C	0 円	配当等収益合計額	D=A+B+C	2,787,241 円	経費	E	981,943 円	収益分配可能額	F=D-E	1,805,298 円	収益分配金	G	1,760,000 円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	45,298 円	口数	I	550,000 口	100 口当たり分配金	J=G/I×100	320 円	<p>1. 分配金の計算過程</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">項目</th> <th style="width: 30%;"></th> <th style="width: 40%;"></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">7,426,427 円</td> </tr> <tr> <td>親ファンドの配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">0 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">C</td> <td style="text-align: right;">45,298 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">D=A+B+C</td> <td style="text-align: right;">7,471,725 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">E</td> <td style="text-align: right;">660,020 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">F=D-E</td> <td style="text-align: right;">6,811,705 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">G</td> <td style="text-align: right;">6,745,000 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">H=F-G</td> <td style="text-align: right;">66,705 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">I</td> <td style="text-align: right;">950,000 口</td> </tr> <tr> <td>100 口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">J=G/I×100</td> <td style="text-align: right;">710 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>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。</p>	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	2,787,241 円																																																																	
親ファンドの配当等収益額	B	0 円																																																																	
分配準備積立金	C	0 円																																																																	
配当等収益合計額	D=A+B+C	2,787,241 円																																																																	
経費	E	981,943 円																																																																	
収益分配可能額	F=D-E	1,805,298 円																																																																	
収益分配金	G	1,760,000 円																																																																	
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	45,298 円																																																																	
口数	I	550,000 口																																																																	
100 口当たり分配金	J=G/I×100	320 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																																																																	

(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 1 期 自 2017 年 12 月 7 日 至 2018 年 3 月 7 日	第 2 期 自 2018 年 3 月 8 日 至 2018 年 9 月 7 日
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>

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。 ○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。	同左
--	----

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第1期 2018年3月7日現在	第2期 2018年9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1期 自 2017年12月7日 至 2018年3月7日	第2期 自 2018年3月8日 至 2018年9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1期 自 2017年12月7日 至 2018年3月7日	第2期 自 2018年3月8日 至 2018年9月7日
期首元本額	期首元本額
期中追加設定元本額	期中追加設定元本額
期中一部解約元本額	期中一部解約元本額
円	円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2017年12月7日 至 2018年3月7日	第2期 自 2018年3月8日 至 2018年9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	△11,326,374	△1,863,029
合計	△11,326,374	△1,863,029

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1期(2018年3月7日現在)				第2期(2018年9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	533,598,406	—	532,246,356	1,352,050	921,485,746	—	917,951,185	3,534,561
米ドル	229,468,925	—	226,956,906	2,512,019	411,123,427	—	409,587,573	1,535,854
カナダドル	9,466,368	—	9,283,020	183,348	17,404,452	—	17,206,020	198,432
メキシコペソ	3,163,696	—	3,130,280	33,416	6,782,669	—	6,714,600	68,069
ユーロ	224,438,288	—	225,924,630	△1,486,342	375,280,166	—	374,249,898	1,030,268
英ポンド	37,713,677	—	37,696,002	17,675	64,403,730	—	64,125,670	278,060
スイスフラン	1,254,315	—	1,250,748	3,567	—	—	—	—
スウェーデン クローナ	1,545,480	—	1,543,200	2,280	2,667,099	—	2,670,800	△3,701
ノルウェーク ローネ	1,430,420	—	1,435,240	△4,820	1,400,692	—	1,389,660	11,032
デンマークク ローネ	3,707,752	—	3,731,200	△23,448	5,214,413	—	5,200,440	13,973
ズロチ	3,143,442	—	3,156,250	△12,808	5,231,695	—	5,183,500	48,195
豪ドル	11,200,044	—	11,145,200	54,844	18,433,275	—	18,351,984	81,291
シンガポール ドル	3,537,921	—	3,519,560	18,361	8,400,434	—	8,344,960	55,474
ランド	3,528,078	—	3,474,120	53,958	5,143,694	—	4,926,080	217,614
合計	533,598,406	—	532,246,356	1,352,050	921,485,746	—	917,951,185	3,534,561

(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いません。

※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(2018年9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(2018年9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 N/B	100,000.00	100,968.75
		US TREASURY N/B	270,000.00	264,958.58
		US TREASURY N/B	150,000.00	147,023.43
		US TREASURY N/B	200,000.00	195,742.18
		US TREASURY N/B	300,000.00	295,734.36
		US TREASURY N/B	220,000.00	216,631.25
		US TREASURY N/B	100,000.00	97,734.37
		US TREASURY N/B	250,000.00	244,130.85
		US TREASURY N/B	100,000.00	96,640.62
		US TREASURY N/B	100,000.00	96,546.87
		US TREASURY N/B	100,000.00	96,609.37
		US TREASURY N/B	230,000.00	219,973.42
		US TREASURY N/B	100,000.00	96,890.62
		US TREASURY N/B	550,000.00	532,769.48
		US TREASURY N/B	140,000.00	126,689.05
		US TREASURY N/B	220,000.00	208,982.79
		US TREASURY N/B	10,000.00	12,139.84
		US TREASURY N/B	190,000.00	226,960.92
		US TREASURY N/B	410,000.00	367,494.50
		小計	銘柄数：19 組入時価比率：43.7%	3,740,000.00
	カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	20,000.00	19,967.60
CANADIAN GOVERNMENT		50,000.00	48,088.00	
CANADIAN GOVERNMENT		30,000.00	29,138.70	
CANADIAN GOVERNMENT		30,000.00	30,531.60	
CANADIAN GOVERNMENT		40,000.00	39,222.00	
CANADIAN GOVERNMENT		20,000.00	26,121.60	
CANADIAN GOVERNMENT		10,000.00	11,101.00	
小計		銘柄数：7 組入時価比率：1.9%	200,000.00	204,170.50 (17,144,196) 1.9%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	285,978.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	330,228.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	290,250.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	200,000.00	236,388.00	

小計	銘柄数 : 4	1, 100, 000. 00	1, 142, 844. 00	
	組入時価比率 : 0. 7%		(6, 571, 353)	0. 7%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	60, 000. 00	62, 230. 20	
	BELGIUM KINGDOM	50, 000. 00	57, 718. 54	
	BELGIUM KINGDOM	50, 000. 00	52, 222. 30	
	BELGIUM KINGDOM	20, 000. 00	19, 758. 60	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	30, 000. 00	47, 134. 80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	80, 000. 00	85, 674. 92	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	40, 000. 00	40, 949. 88	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	50, 000. 00	61, 171. 30	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100, 000. 00	106, 566. 97	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	60, 000. 00	60, 076. 44	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	30, 000. 00	31, 500. 00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	40, 000. 00	60, 883. 44	
	BUNDESOBLIGATION	50, 000. 00	50, 706. 00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	50, 000. 00	54, 131. 50	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	50, 000. 00	54, 205. 50	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	90, 000. 00	89, 151. 30	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20, 000. 00	20, 385. 20	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10, 000. 00	16, 044. 60	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20, 000. 00	32, 372. 52	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	40, 000. 00	60, 350. 20	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20, 000. 00	27, 411. 40	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	120, 000. 00	126, 516. 00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	50, 000. 00	50, 825. 00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	100, 000. 00	97, 860. 00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	100, 000. 00	110, 540. 00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	50, 000. 00	48, 005. 00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	40, 000. 00	38, 056. 00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	60, 000. 00	71, 994. 00		
BUONI POLIENNALI DEL TES	20, 000. 00	16, 926. 00		
BUONI POLIENNALI DEL TES	70, 000. 00	60, 690. 00		
BUONI POLIENNALI DEL TES	20, 000. 00	23, 836. 00		
BUONI POLIENNALI DEL TES	20, 000. 00	17, 392. 00		

		FINNISH GOVERNMENT	20,000.00	20,301.20	
		FINNISH GOVERNMENT	10,000.00	12,128.85	
		FRANCE (GOVT OF)	130,000.00	146,495.05	
		FRANCE (GOVT OF)	30,000.00	29,614.11	
		FRANCE (GOVT OF)	10,000.00	10,779.37	
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	80,000.00	85,252.91	
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	50,000.00	55,507.50	
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	50,000.00	50,504.16	
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	110,000.00	131,901.00	
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	60,000.00	93,699.00	
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	70,000.00	97,171.76	
		IRISH GOVERNMENT	20,000.00	20,083.60	
		IRISH TSY 3.4% 2024	30,000.00	35,303.10	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	40,000.00	40,485.04	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	90,000.00	91,148.62	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	20,000.00	21,894.10	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	30,000.00	31,036.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	20,000.00	31,968.24	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	20,000.00	21,626.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	30,000.00	32,815.38	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	20,000.00	20,602.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	10,000.00	12,068.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	20,000.00	28,409.00	
	小計	銘柄数：55	2,580,000.00	2,874,080.40	
				(368,945,700)	
		組入時価比率：40.0%		40.8%	
	英ボンド	UK TREASURY	60,000.00	63,599.40	
		UK TREASURY	40,000.00	41,318.80	
		UK TREASURY	20,000.00	21,931.40	
		UK TREASURY	30,000.00	30,621.00	
		UK TREASURY	20,000.00	20,394.00	
		UK TREASURY	20,000.00	27,736.00	
		UK TREASURY	150,000.00	231,735.00	
	小計	銘柄数：7	340,000.00	437,335.60	
				(62,447,150)	
		組入時価比率：6.8%		6.9%	

スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	100,000.00	115,295.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	100,000.00	102,085.30	
小計	銘柄数：2	200,000.00	217,380.30	
	組入時価比率：0.3%		(2,638,996)	0.3%
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	100,000.00	102,680.00	
	銘柄数：1	100,000.00	102,680.00	
小計	組入時価比率：0.1%		(1,347,161)	0.1%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	100,000.00	108,690.00	
	KINGDOM OF DENMARK	100,000.00	101,905.00	
	KINGDOM OF DENMARK	50,000.00	86,527.50	
小計	銘柄数：3	250,000.00	297,122.50	
	組入時価比率：0.6%		(5,116,449)	0.6%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	100,000.00	100,400.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	80,000.00	76,480.00	
小計	銘柄数：2	180,000.00	176,880.00	
	組入時価比率：0.6%		(5,249,798)	0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	70,000.00	76,823.81	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	30,000.00	30,763.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	80,000.00	81,277.37	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	30,000.00	29,633.74	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,000.00	9,881.00	
	小計	銘柄数：5	220,000.00	228,379.42
	組入時価比率：2.0%		(18,135,609)	2.0%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	61,734.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	40,000.00	41,560.00	
	銘柄数：2	100,000.00	103,294.60	
小計	組入時価比率：0.9%		(8,302,819)	0.9%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	193,723.24	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	300,000.00	267,784.17	

		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	100,000.00	87,770.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	100,000.00	87,779.91	
	小計	銘柄数：4	700,000.00	637,057.32	
		組入時価比率：0.5%		(4,593,183)	0.5%
	合計			903,259,508	(903,259,508)

(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。