



2021年3月期 (2020年9月8日～2021年3月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended March 2021 (September 8, 2020 – March 7, 2021)

2021年4月16日
 April 16, 2021

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 山中 淳 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: Jun Yamanaka, Head of Support Dial Team, Investment Trust Marketing Dept.

有価証券報告書提出予定日 2021年5月19日
 分配金支払開始日 2021年4月15日
 Scheduled date of submission of securities report: May 19, 2021
 Date of commencing dividend payment: April 15, 2021

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2021年3月期の運用状況 (2020年9月8日～2021年3月7日)

Management Status for Year ended March 2021 (from September 8, 2020 to March 7, 2021)

(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.	%
2021年3月期 FY ended Mar. 2021	21,113	(99.4)	126	(0.6)	21,239	(100.0)
2020年9月期 FY ended Sep. 2020	9,831	(99.0)	98	(1.0)	9,930	(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
2021年3月期 FY ended Mar. 2021	9,440	11,830	410	20,860
2020年9月期 FY ended Sep. 2020	6,100	5,990	2,650	9,440

(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
2021年3月期 FY ended Mar. 2021	21,972	732	21,239	101,821
2020年9月期 FY ended Sep. 2020	10,116	185	9,930	105,194

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2021年3月期 FY ended Mar. 2021	490
2020年9月期 FY ended Sep. 2020	550

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6期 (2020年9月7日現在) 6th Fiscal Year As of September 7, 2020	第7期 (2021年3月7日現在) 7th Fiscal Year As of March 7, 2021
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
預金 Deposits	21,754,667	583,650,012
コール・ローン Call loans	29,084,097	123,886,365
国債証券 Government bonds	9,831,846,206	21,113,516,318
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	1,386,607	2,099,196
未収入金 Accounts receivable - other	141,726,411	517,054
未収利息 Accrued interest	32,528,968	69,261,160
前払費用 Prepaid expenses	16,777,838	37,691,248
その他未収収益 Other accrued revenue	-	366,605
差入委託証拠金 Customers' margin	41,033,782	41,757,401
流動資産合計 Total current assets	10,116,138,576	21,972,745,359
資産合計 Total assets	10,116,138,576	21,972,745,359
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	54,480,895	167,056,167
未払金 Accounts payable - other	74,769,637	453,887,241
未払収益分配金 Unpaid dividends	51,920,000	102,214,000
未払受託者報酬 Trustee fee payable	667,788	1,445,155
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	3,338,908	7,225,743
未払利息 Accrued interest expenses	41	142

その他未払費用 Other accrued expenses	629,517	1,079,808
流動負債合計 Total current liabilities	185,806,786	732,908,256
負債合計 Total liabilities	185,806,786	732,908,256
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	9,440,000,000	20,860,000,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	490,331,790	379,837,103
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	22,894	1,934,588
元本等合計 Total principal and other	9,930,331,790	21,239,837,103
純資産合計 Total net assets	9,930,331,790	21,239,837,103
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	10,116,138,576	21,972,745,359

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

(単位:円) (Unit:JPY)

	第6期 自 2020年3月8日 至 2020年9月7日 6th Fiscal Year From March 8, 2020 to September 7, 2020	第7期 自 2020年9月8日 至 2021年3月7日 7th Fiscal Year From September 8, 2020 to March 7, 2021
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取利息 Interest income	57,373,391	116,314,831
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	38,468,175	△617,163,970
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	12,619,409	△441,635
為替差損益 Foreign exchange gains or losses	△16,958,323	△4,212,276
その他収益 Other revenue	256,895	366,605
営業収益合計 Total operating revenue	91,759,547	△505,136,445
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	101,858	66,160
受託者報酬	667,788	1,445,155

Trustee fee		
委託者報酬 Investment trust management fee	3,338,908	7,225,743
その他費用 Other expenses	1,669,772	3,818,684
営業費用合計 Total operating expenses	5,778,326	12,555,742
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	85,981,221	△517,692,187
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	85,981,221	△517,692,187
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	85,981,221	△517,692,187
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	313,353,969	490,331,790
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	306,867,800	525,044,500
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	306,867,800	525,044,500
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	163,951,200	15,633,000
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	163,951,200	15,633,000
分配金 Dividends	51,920,000	102,214,000
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	490,331,790	379,837,103

(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

5. その他	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。 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2020年9月8日から2021年3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6期 2020年9月7日現在	第7期 2021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 9,440,000口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 20,860,000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 1,051.94円 (100口当たり純資産額) (105,194円)	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 1,018.21円 (100口当たり純資産額) (101,821円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第6期 自2020年3月8日 至2020年9月7日	第7期 自2020年9月8日 至2021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" style="width: 100%;"> <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>57,528,428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>90,934円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>D=A+B+C</td> <td>57,619,362円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>E</td> <td>5,676,468円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>F=D-E</td> <td>51,942,894円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>G</td> <td>51,920,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>H=F-G</td> <td>22,894円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>I</td> <td>9,440,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>J=G/I×100</td> <td>550円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	57,528,428円	親ファンドの配当等収益額	B	0円	分配準備積立金	C	90,934円	配当等収益合計額	D=A+B+C	57,619,362円	経費	E	5,676,468円	収益分配可能額	F=D-E	51,942,894円	収益分配金	G	51,920,000円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	22,894円	口数	I	9,440,000口	100口当たり分配金	J=G/I×100	550円	<table border="1" style="width: 100%;"> <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>116,615,276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>22,894円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>D=A+B+C</td> <td>116,638,170円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>E</td> <td>12,489,582円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>F=D-E</td> <td>104,148,588円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>G</td> <td>102,214,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>H=F-G</td> <td>1,934,588円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>I</td> <td>20,860,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>J=G/I×100</td> <td>490円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	116,615,276円	親ファンドの配当等収益額	B	0円	分配準備積立金	C	22,894円	配当等収益合計額	D=A+B+C	116,638,170円	経費	E	12,489,582円	収益分配可能額	F=D-E	104,148,588円	収益分配金	G	102,214,000円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	1,934,588円	口数	I	20,860,000口	100口当たり分配金	J=G/I×100	490円
項目																																																																			
当期配当等収益額	A	57,528,428円																																																																	
親ファンドの配当等収益額	B	0円																																																																	
分配準備積立金	C	90,934円																																																																	
配当等収益合計額	D=A+B+C	57,619,362円																																																																	
経費	E	5,676,468円																																																																	
収益分配可能額	F=D-E	51,942,894円																																																																	
収益分配金	G	51,920,000円																																																																	
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	22,894円																																																																	
口数	I	9,440,000口																																																																	
100口当たり分配金	J=G/I×100	550円																																																																	
項目																																																																			
当期配当等収益額	A	116,615,276円																																																																	
親ファンドの配当等収益額	B	0円																																																																	
分配準備積立金	C	22,894円																																																																	
配当等収益合計額	D=A+B+C	116,638,170円																																																																	
経費	E	12,489,582円																																																																	
収益分配可能額	F=D-E	104,148,588円																																																																	
収益分配金	G	102,214,000円																																																																	
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	1,934,588円																																																																	
口数	I	20,860,000口																																																																	
100口当たり分配金	J=G/I×100	490円																																																																	
2. その他費用 その他費用のうち223,903円は上場に係る費用、606,798円は対象指数についての商標使用料、756,857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1,461,662円は上場に係る費用、1,315,523円は対象指数についての商標使用料、821,445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6期 自2020年3月8日 至2020年9月7日	第7期 自2020年9月8日 至2021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	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

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。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第6期 2020年9月7日現在	第7期 2021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6期 自2020年3月8日 至2020年9月7日	第7期 自2020年9月8日 至2021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6期 自2020年3月8日 至2020年9月7日	第7期 自2020年9月8日 至2021年3月7日
期首元本額 6,100,000,000円	期首元本額 9,440,000,000円
期中追加設定元本額 5,990,000,000円	期中追加設定元本額 11,830,000,000円
期中一部解約元本額 2,650,000,000円	期中一部解約元本額 410,000,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第6期 自2020年3月8日 至2020年9月7日	第7期 自2020年9月8日 至2021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	6,666,131	△612,388,674
合計	6,666,131	△612,388,674

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6期(2020年9月7日現在)				第7期(2021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	9,927,453,232	—	9,980,547,520	△53,094,288	21,230,160,977	—	21,395,117,948	△164,956,971
米ドル	4,336,245,308	—	4,375,353,432	△39,108,124	9,240,676,008	—	9,382,151,910	△141,475,902
カナダドル	178,272,784	—	180,158,567	△1,885,783	407,847,860	—	412,223,699	△4,375,839
メキシコペソ	71,411,765	—	72,904,560	△1,492,795	130,658,959	—	130,897,260	△238,301
ユーロ	4,189,950,419	—	4,199,738,020	△9,787,601	8,981,673,213	—	8,986,568,492	△4,895,279
英ポンド	632,852,878	—	634,193,637	△1,340,759	1,370,188,861	—	1,383,589,623	△13,400,762
スウェーデン クローナ	25,533,511	—	25,456,200	77,311	63,726,292	—	63,323,100	403,192
ノルウェー クローネ	18,795,651	—	18,651,060	144,591	55,550,851	—	55,958,980	△408,129
デンマーク クローネ	38,985,105	—	39,119,040	△133,935	119,894,581	—	119,992,320	△97,739
ズロチ	62,605,108	—	61,873,840	731,268	100,943,499	—	100,139,480	804,019
豪ドル	252,089,961	—	251,656,524	433,437	501,484,819	—	500,604,144	880,675
シンガポール ドル	90,382,140	—	90,819,740	△437,600	185,972,538	—	187,452,340	△1,479,802
新シエケル	30,328,602	—	30,622,900	△294,298	71,543,496	—	72,216,600	△673,104
合計	9,927,453,232	—	9,980,547,520	△53,094,288	21,230,160,977	—	21,395,117,948	△164,956,971

(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ありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021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(2021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	106,781.25	
		US TREASURY BOND	100,000.00	125,492.18	

	US TREASURY BOND	30,000.00	39,703.12
	US TREASURY BOND	220,000.00	286,687.50
	US TREASURY BOND	100,000.00	129,781.25
	US TREASURY BOND	270,000.00	344,735.13
	US TREASURY N/B	300,000.00	304,898.43
	US TREASURY N/B	600,000.00	610,593.72
	US TREASURY N/B	400,000.00	407,593.72
	US TREASURY N/B	400,000.00	401,171.84
	US TREASURY N/B	200,000.00	204,773.42
	US TREASURY N/B	100,000.00	101,902.34
	US TREASURY N/B	200,000.00	204,054.68
	US TREASURY N/B	500,000.00	509,746.05
	US TREASURY N/B	100,000.00	102,402.34
	US TREASURY N/B	800,000.00	817,562.48
	US TREASURY N/B	900,000.00	917,929.62
	US TREASURY N/B	400,000.00	410,562.48
	US TREASURY N/B	100,000.00	102,171.87
	US TREASURY N/B	400,000.00	408,890.60
	US TREASURY N/B	170,000.00	174,489.05
	US TREASURY N/B	200,000.00	204,328.12
	US TREASURY N/B	750,000.00	769,218.75
	US TREASURY N/B	600,000.00	613,406.22
	US TREASURY N/B	300,000.00	308,273.43
	US TREASURY N/B	100,000.00	102,906.25
	US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,649,374.88
	US TREASURY N/B	400,000.00	410,140.60
	US TREASURY N/B	250,000.00	258,066.40
	US TREASURY N/B	400,000.00	410,578.12
	US TREASURY N/B	500,000.00	512,558.55
	US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,133,515.57
	US TREASURY N/B	900,000.00	938,039.04
	US TREASURY N/B	100,000.00	103,585.93
	US TREASURY N/B	400,000.00	402,765.60
	US TREASURY N/B	800,000.00	822,124.96
	US TREASURY N/B	120,000.00	123,740.61

	US TREASURY N/B	830,000.00	858,466.34
	US TREASURY N/B	500,000.00	499,394.50
	US TREASURY N/B	700,000.00	740,140.59
	US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,802,320.20
	US TREASURY N/B	400,000.00	410,843.72
	US TREASURY N/B	800,000.00	819,937.44
	US TREASURY N/B	150,000.00	158,378.89
	US TREASURY N/B	800,000.00	798,093.68
	US TREASURY N/B	600,000.00	637,640.58
	US TREASURY N/B	400,000.00	398,890.60
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,543,828.05
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,495,371.00
	US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,390,289.03
	US TREASURY N/B	120,000.00	128,034.37
	US TREASURY N/B	250,000.00	262,753.90
	US TREASURY N/B	400,000.00	428,468.72
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	995,664.00
	US TREASURY N/B	350,000.00	373,050.75
	US TREASURY N/B	420,000.00	443,723.40
	US TREASURY N/B	600,000.00	638,203.08
	US TREASURY N/B	800,000.00	857,374.96
	US TREASURY N/B	600,000.00	632,250.00
	US TREASURY N/B	700,000.00	738,226.51
	US TREASURY N/B	220,000.00	231,360.93
	US TREASURY N/B	120,000.00	127,134.37
	US TREASURY N/B	150,000.00	160,242.18
	US TREASURY N/B	150,000.00	157,980.46
	US TREASURY N/B	100,000.00	104,476.56
	US TREASURY N/B	250,000.00	264,492.17
	US TREASURY N/B	600,000.00	627,187.50
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,059,687.50
	US TREASURY N/B	400,000.00	426,000.00
	US TREASURY N/B	150,000.00	159,796.87
	US TREASURY N/B	100,000.00	106,078.12
	US TREASURY N/B	100,000.00	106,632.81

US TREASURY N/B	600,000.00	627,984.36
US TREASURY N/B	130,000.00	139,963.27
US TREASURY N/B	100,000.00	105,789.06
US TREASURY N/B	400,000.00	434,781.24
US TREASURY N/B	200,000.00	216,578.12
US TREASURY N/B	850,000.00	847,343.75
US TREASURY N/B	200,000.00	198,140.62
US TREASURY N/B	150,000.00	159,503.89
US TREASURY N/B	500,000.00	547,539.05
US TREASURY N/B	700,000.00	689,007.76
US TREASURY N/B	600,000.00	654,421.86
US TREASURY N/B	550,000.00	540,847.61
US TREASURY N/B	300,000.00	294,632.79
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,588,828.05
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,693,375.00
US TREASURY N/B	800,000.00	784,812.48
US TREASURY N/B	700,000.00	773,281.25
US TREASURY N/B	800,000.00	784,000.00
US TREASURY N/B	640,000.00	707,549.95
US TREASURY N/B	700,000.00	685,179.67
US TREASURY N/B	600,000.00	589,968.72
US TREASURY N/B	800,000.00	871,750.00
US TREASURY N/B	450,000.00	468,667.93
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,248,375.00
US TREASURY N/B	550,000.00	567,875.00
US TREASURY N/B	500,000.00	512,812.50
US TREASURY N/B	600,000.00	622,546.86
US TREASURY N/B	600,000.00	617,625.00
US TREASURY N/B	640,000.00	686,549.95
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,006,796.80
US TREASURY N/B	500,000.00	483,437.50
US TREASURY N/B	350,000.00	377,972.63
US TREASURY N/B	950,000.00	917,269.46
US TREASURY N/B	250,000.00	267,871.07
US TREASURY N/B	600,000.00	574,453.08

US TREASURY N/B	220,000.00	235,571.86
US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,336,104.62
US TREASURY N/B	700,000.00	779,296.84
US TREASURY N/B	230,000.00	256,270.30
US TREASURY N/B	400,000.00	453,250.00
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,700,156.25
US TREASURY N/B	1,420,000.00	1,531,603.05
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,630,124.96
US TREASURY N/B	700,000.00	702,679.67
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,064,289.00
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,381,171.80
US TREASURY N/B	40,000.00	54,418.74
US TREASURY N/B	110,000.00	148,044.52
US TREASURY N/B	230,000.00	314,632.80
US TREASURY N/B	20,000.00	24,450.00
US TREASURY N/B	310,000.00	415,085.13
US TREASURY N/B	750,000.00	1,024,921.87
US TREASURY N/B	430,000.00	357,101.54
US TREASURY N/B	1,130,000.00	981,864.00
US TREASURY N/B	430,000.00	591,384.37
US TREASURY N/B	500,000.00	635,546.85
US TREASURY N/B	400,000.00	465,593.72
US TREASURY N/B	150,000.00	171,082.02
US TREASURY N/B	200,000.00	250,609.36
US TREASURY N/B	190,000.00	238,360.92
US TREASURY N/B	430,000.00	489,864.04
US TREASURY N/B	350,000.00	365,558.58
US TREASURY N/B	210,000.00	239,547.65
US TREASURY N/B	690,000.00	771,075.00
US TREASURY N/B	950,000.00	991,042.94
US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,136,921.01
US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,014,023.41
US TREASURY N/B	200,000.00	223,562.50
US TREASURY N/B	120,000.00	137,456.24
US TREASURY N/B	530,000.00	580,018.75

小計	US TREASURY N/B	520,000.00	568,912.49
	US TREASURY N/B	140,000.00	160,485.93
	US TREASURY N/B	280,000.00	321,409.36
	US TREASURY N/B	420,000.00	471,876.55
	US TREASURY N/B	440,000.00	435,978.09
	US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,011,403.04
	US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,019,700.00
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	798,281.20
	銘柄数 : 150	82,690,000.00	85,825,222.13 (9,260,541,467)
組入時価比率 : 43.6%		43.9%	
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	101,177.00
	CANADIAN GOVERNMENT	900,000.00	900,162.00
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	154,435.50
	CANADIAN GOVERNMENT	80,000.00	82,132.80
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	104,085.00
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	210,738.00
	CANADIAN GOVERNMENT	60,000.00	63,823.20
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	612,450.00
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	295,434.00
	CANADIAN GOVERNMENT	120,000.00	123,072.00
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	348,810.00
	CANADIAN GOVERNMENT	650,000.00	642,245.50
	CANADIAN GOVERNMENT	120,000.00	175,125.60
	CANADIAN GOVERNMENT	120,000.00	164,730.00
	CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	171,899.00
	CANADIAN GOVERNMENT	480,000.00	570,662.40
小計	銘柄数 : 16	4,440,000.00	4,720,982.00 (401,802,778)
組入時価比率 : 1.9%		1.9%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	308,391.90
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,600,000.00	5,416,546.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,000,000.00	1,027,420.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,300,000.00	5,869,884.09
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,400,000.00	1,642,709.60

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,500,000.00	3,920,627.20
	MEX BONOS DESARR FIX RT	800,000.00	886,452.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	393,572.10
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,500,000.00	2,891,570.25
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,700,000.00	1,865,121.00
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	1,000,000.00	1,092,230.00
	銘柄数 : 11 組入時価比率 : 0.6%	22,400,000.00	25,314,524.14 (129,104,073) 0.6%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	50,000.00	52,475.25
	BELGIUM KINGDOM	1,100,000.00	1,174,296.97
	BELGIUM KINGDOM	70,000.00	71,592.50
	BELGIUM KINGDOM	80,000.00	88,592.00
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	416,289.04
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	529,796.50
	BELGIUM KINGDOM	50,000.00	54,027.00
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	215,428.00
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	204,987.20
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	173,291.87
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	328,043.40
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	306,090.00
	BELGIUM KINGDOM	50,000.00	72,355.60
	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	286,325.00
	BELGIUM KINGDOM	240,000.00	283,484.49
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	326,245.58
	BELGIUM KINGDOM	430,000.00	528,546.97
	BELGIUM KINGDOM GOVT	50,000.00	83,635.80
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	404,224.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	304,755.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	778,938.44
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	403,960.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	50,000.00	56,497.03
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	230,674.20
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	113,340.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	303,671.40	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	150,000.00	153,292.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	250,000.00	253,237.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	755,986.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	650,000.00	723,653.45
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	333,667.26
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	60,000.00	79,801.78
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	250,000.00	274,887.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	329,655.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	526,928.16
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	219,660.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	250,000.00	276,434.95
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	650,000.00	664,526.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	250,000.00	288,948.25
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	217,780.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	365,310.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	463,719.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	360,000.00	375,010.59
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,000.00	16,936.13
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	270,000.00	500,554.08
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	220,000.00	306,317.88
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	250,000.00	339,251.66
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	250,000.00	235,007.75
BUNDES OBLIGATION	200,000.00	203,744.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	50,000.00	51,607.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	150,000.00	157,293.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	239,812.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	535,610.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	211,924.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	419,056.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	317,301.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	755,000.00	781,047.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	735,770.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	291,622.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	572,444.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	340,000.00	364,741.80

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	130,000.00	137,319.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	480,000.00	507,475.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	310,806.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	621,054.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	206,712.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,000.00	15,890.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	853,191.24
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	304,158.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	150,000.00	248,514.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	120,000.00	215,138.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	260,000.00	439,454.86
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	270,000.00	422,788.14
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	690,000.00	1,104,220.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	240,000.00	310,048.80
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	101,700.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	203,750.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	102,766.87
BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	372,857.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	302,148.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	512,650.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	408,280.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	373,975.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	50,000.00	51,190.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,139,500.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,062,450.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	634,500.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,000.00	32,877.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	180,172.90
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	530,150.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	210,000.00	234,234.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	109,170.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	120,000.00	144,480.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	215,420.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	662,700.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,000.00	41,925.00

BUONI POLIENNALI DEL TES	50,000.00	52,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	207,110.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	167,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	499,770.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	394,440.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	60,000.00	70,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	780,000.00	936,546.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,000.00	41,856.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	630,000.00	788,571.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	606,537.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	718,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	50,000.00	54,355.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	210,000.00	325,395.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	117,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	650,000.00	842,855.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	104,470.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	60,000.00	69,378.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	252,630.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	506,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	120,000.00	192,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	160,245.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	491,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	500,647.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	595,056.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	300,740.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	103,560.50	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	101,719.60	
FINNISH GOVERNMENT	20,000.00	21,068.52	
FINNISH GOVERNMENT	260,000.00	320,126.56	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	217,786.00	
FINNISH GOVERNMENT	10,000.00	14,891.73	
FINNISH GOVERNMENT	170,000.00	214,025.75	
FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	303,831.00	
FRANCE (GOVT OF)	900,000.00	911,835.00	
FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	737,550.10	

FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	509,400.00
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	546,408.00
FRANCE (GOVT OF)	200,000.00	204,598.00
FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	315,526.20
FRANCE (GOVT OF)	650,000.00	675,827.75
FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	326,280.00
FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	753,667.60
FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	754,810.00
FRANCE (GOVT OF)	150,000.00	158,711.40
FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	709,474.50
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	503,146.50
FRANCE (GOVT OF)	900,000.00	1,027,941.30
FRANCE (GOVT OF)	150,000.00	171,885.00
FRANCE (GOVT OF)	510,000.00	635,855.25
FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	302,783.40
FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	804,906.00
FRANCE (GOVT OF)	660,000.00	802,624.68
FRANCE (GOVT OF)	530,000.00	532,064.35
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	50,000.00	52,072.70
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	350,000.00	352,741.44
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	350,000.00	366,703.05
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	130,000.00	146,978.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	400,000.00	435,233.20
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	400,000.00	523,399.20
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	400,000.00	428,980.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	100,000.00	102,401.70
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	100,000.00	120,765.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	400,000.00	483,960.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	700,000.00	1,032,008.94
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	160,000.00	185,335.20
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	240,000.00	400,695.36
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	500,000.00	822,027.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	110,000.00	179,567.74
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	180,000.00	290,863.08
IRISH GOVERNMENT	40,000.00	43,434.24

	IRISH TSY 0.2% 2030	100,000.00	102,295.00
	IRISH TSY 0.8% 2022	90,000.00	91,294.11
	IRISH TSY 1.10% 2029	20,000.00	22,100.98
	IRISH TSY 1.5% 2050	50,000.00	60,835.17
	IRISH TSY 1.7% 2037	230,000.00	280,562.28
	IRISH TSY 1% 2026	400,000.00	430,382.40
	IRISH TSY 2.4% 2030	100,000.00	123,170.40
	IRISH TSY 2% 2045	110,000.00	146,345.32
	IRISH TSY 2022	300,000.00	302,929.80
	IRISH TSY 3.4% 2024	30,000.00	33,639.42
	NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	207,970.40
	NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	108,319.10
	NETHERLANDS GOVERNMENT	20,000.00	21,160.72
	NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	436,160.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	207,620.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	460,000.00	496,346.90
	NETHERLANDS GOVERNMENT	150,000.00	212,670.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	307,425.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	50,000.00	65,854.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	150,000.00	245,382.45
	NETHERLANDS GOVERNMENT	50,000.00	87,672.25
	NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	577,918.95
	REPUBLIC OF AUSTRIA	60,000.00	60,609.24
	REPUBLIC OF AUSTRIA	730,000.00	776,144.76
	REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	541,643.50
	REPUBLIC OF AUSTRIA	30,000.00	32,123.25
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	158,879.40
	REPUBLIC OF AUSTRIA	30,000.00	32,368.68
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	301,283.27
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	187,940.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	380,000.00	622,709.60
	REPUBLIC OF AUSTRIA	50,000.00	109,046.55
	SPANISH GOVERNMENT	140,000.00	204,903.86
	SPANISH GOVERNMENT	150,000.00	238,650.00
小計	銘柄数 : 200	59,375,000.00	68,970,378.79

			(8,904,765,605)
	組入時価比率 : 41.9%		42.2%
英債券	UK TREASURY	10,000.00	10,071.84
	UK TREASURY	150,000.00	152,412.90
	UK TREASURY	100,000.00	105,438.20
	UK TREASURY	400,000.00	399,642.16
	UK TREASURY	300,000.00	327,338.40
	UK TREASURY	100,000.00	119,141.12
	UK TREASURY	350,000.00	355,897.50
	UK TREASURY	340,000.00	360,827.72
	UK TREASURY	460,000.00	483,019.32
	UK TREASURY	50,000.00	62,592.24
	UK TREASURY	30,000.00	32,393.92
	UK TREASURY	270,000.00	274,677.58
	UK TREASURY	200,000.00	192,919.26
	UK TREASURY	100,000.00	94,195.84
	UK TREASURY	230,000.00	313,598.74
	UK TREASURY	660,000.00	954,692.11
	UK TREASURY	100,000.00	93,812.62
	UK TREASURY	310,000.00	338,411.99
	UK TREASURY	220,000.00	338,730.12
	UK TREASURY	410,000.00	410,415.89
	UK TREASURY	240,000.00	390,047.52
	UK TREASURY	320,000.00	529,958.01
	UK TREASURY	440,000.00	462,967.82
	UK TREASURY	320,000.00	356,429.95
UK TREASURY	460,000.00	792,135.64	
UK TREASURY	200,000.00	220,004.00	
UK TREASURY	170,000.00	317,624.39	
UK TSY 0 1/2% 2061	150,000.00	116,737.50	
UK TSY 0 5/8% 2050	530,000.00	444,866.63	
小計	銘柄数 : 29	7,620,000.00	9,051,000.93
			(1,357,107,079)
	組入時価比率 : 6.4%		6.4%
スウェーデンクロ	SWEDISH GOVERNMENT	1,100,000.00	1,219,405.00

ーナ	SWEDISH GOVERNMENT	2,200,000.00	2,319,834.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	200,000.00	208,076.84	
	SWEDISH GOVERNMENT	200,000.00	207,680.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	700,000.00	679,016.45	
	SWEDISH GOVERNMENT	100,000.00	146,783.37	
	小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.3%	4,500,000.00	4,780,795.66 (60,668,296) 0.3%
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	100,000.00	103,193.87	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,068,830.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,024,228.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	300,000.00	310,020.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,030,265.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	700,000.00	696,111.50	
小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.2%	4,100,000.00	4,232,648.37 (53,077,410) 0.3%	
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	100,000.00	105,380.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,000,000.00	1,103,650.00	
	KINGDOM OF DENMARK	600,000.00	633,807.00	
	KINGDOM OF DENMARK	2,700,000.00	2,859,030.00	
	KINGDOM OF DENMARK	970,000.00	1,745,472.90	
	KINGDOM OF DENMARK	100,000.00	96,620.00	
小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.5%	5,470,000.00	6,543,959.90 (113,603,143) 0.5%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,024,900.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	800,000.00	851,276.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	800,000.00	882,760.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	200,000.00	267,810.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	500,000.00	488,000.00	
	小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.5%	3,300,000.00	3,514,746.00 (99,432,164) 0.5%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	140,000.00	145,066.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	100,000.00	111,380.46	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	280,000.00	302,722.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	397,735.72	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	332,597.43	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	195,750.72	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	821,520.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	480,000.00	528,422.68	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	100,000.00	106,630.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	219,983.72	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	494,640.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	483,211.44	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	280,322.61	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	100,000.00	97,453.12	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	100,000.00	93,765.02	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	370,000.00	474,444.48	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	230,000.00	247,739.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	70,000.00	72,738.61	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	470,844.00	
小計	銘柄数 : 19	5,410,000.00	5,876,967.91	
			(489,022,499)	
	組入時価比率 : 2.3%		2.3%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	102,447.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	168,004.52	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	108,069.16	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	296,437.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	53,155.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	228,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	55,985.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	600,000.00	674,694.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	106,241.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	108,289.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	161,420.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	116,750.00	
小計	銘柄数 : 12	2,000,000.00	2,179,992.68	
			(175,772,809)	
	組入時価比率 : 0.8%		0.8%	

新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	200,000.00	206,999.18	
	ISRAEL FIXED BOND	600,000.00	635,029.32	
	ISRAEL FIXED BOND	200,000.00	219,636.72	
	ISRAEL FIXED BOND	600,000.00	593,827.38	
	ISRAEL FIXED BOND	200,000.00	323,925.48	
	ISRAEL FIXED BOND	100,000.00	130,637.12	
	小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.3%	1,900,000.00	2,110,055.20 (68,618,995) 0.3%
合計			21,113,516,318 (21,113,516,318)	

(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。