



2023年9月期 (2023年3月8日～2023年9月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended September 2023 (March 8, 2023 - September 7, 2023)

2023年10月18日
 October 18, 2023

		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	2023年11月30日
分配金支払開始日	2023年10月16日
Scheduled date of submission of securities report:	November 30, 2023
Date of commencing dividend payment:	October 16, 2023

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2023年9月期の運用状況 (2023年3月8日～2023年9月7日)

Management Status for Year ended September 2023 (from March 8, 2023 to September 7, 2023)

(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.	% %
2023年9月期 FY ended Sep. 2023	104,034	(99.1)	898	(0.9)	104,933	(100.0)
2023年3月期 FY ended Mar. 2023	99,056	(98.8)	1,188	(1.2)	100,245	(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
2023年9月期 FY ended Sep. 2023	123,160	17,930	8,200	132,890
2023年3月期 FY ended Mar. 2023	117,160	17,590	11,590	123,160

(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
2023年9月期 FY ended Sep. 2023	107,847	2,914	104,933	78,963
2023年3月期 FY ended Mar. 2023	101,730	1,484	100,245	81,394

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2023年9月期 FY ended Sep. 2023	870
2023年3月期 FY ended Mar. 2023	730

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11期 (2023年3月7日現在) 11th Fiscal Year As of March 7, 2023	第12期 (2023年9月7日現在) 12th Fiscal Year As of September 7, 2023
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
預金 Deposits	547,786,564	1,117,164,722
コール・ローン Call loans	407,968,108	456,886,858
国債証券 Government bonds	99,056,300,968	104,034,730,901
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	76,896,251	308,101,335
未収入金 Accounts receivable - other	902,933,607	1,127,499,554
未収利息 Accrued interest	539,153,132	617,617,711
前払費用 Prepaid expenses	104,457,948	91,323,527
その他未収収益 Other accrued revenue	5,305,383	-
差入委託証拠金 Margin deposits	89,346,865	94,572,255
流動資産合計 Total current assets	101,730,148,826	107,847,896,863
資産合計 Total assets	101,730,148,826	107,847,896,863
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	250,923,254	804,644,619
未払金 Accounts payable - other	263,414,087	878,879,689
未払収益分配金 Unpaid dividends	899,068,000	1,156,143,000
未払受託者報酬 Trustee fees payable	10,829,766	11,301,354
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	54,148,784	56,506,679
未払利息 Accrued interest expenses	117	859

その他未払費用 Other accrued expenses	6,511,323	7,130,716
流動負債合計 Total current liabilities	1,484,895,331	2,914,606,916
負債合計 Total liabilities	1,484,895,331	2,914,606,916
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	123,160,000,000	132,890,000,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	△22,914,746,505	△27,956,710,053
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	7,182,295	2,733,926
元本等合計 Total principal and other	100,245,253,495	104,933,289,947
純資産合計 Total net assets	100,245,253,495	104,933,289,947
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	101,730,148,826	107,847,896,863

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第11期 自 2022年9月8日 至 2023年3月7日 11th Fiscal Year From September 8, 2022 to March 7, 2023	第12期 自 2023年3月8日 至 2023年9月7日 12th Fiscal Year From March 8, 2023 to September 7, 2023
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取利息 Interest income	981,275,334	1,230,583,236
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△4,582,245,599	△502,317,252
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	10,548,844	△5,544,406
為替差損益 Foreign exchange gains or losses	△1,710,203,612	△2,642,056,221
その他収益 Other revenue	6,042,291	7,545,258
営業収益合計 Total operating revenue	△5,294,582,742	△1,911,789,385
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	173,613	190,491
受託者報酬	10,829,766	11,301,354

Trustee fees		
委託者報酬 Investment trust management fees	54,148,784	56,506,679
その他費用 Other expenses	19,709,520	18,435,339
営業費用合計 Total operating expenses	84,861,683	86,433,863
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	△5,379,444,425	△1,998,223,248
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	△5,379,444,425	△1,998,223,248
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	△5,379,444,425	△1,998,223,248
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	△15,647,847,180	△22,914,746,505
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	1,862,391,900	1,369,204,000
当期一部解約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 partial redemptions	1,862,391,900	1,369,204,000
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	2,850,778,800	3,256,801,300
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	2,850,778,800	3,256,801,300
分配金 Dividends	899,068,000	1,156,143,000
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	△22,914,746,505	△27,956,710,053

(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。

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、2023年3月8日から2023年9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11期 2023年3月7日現在	第12期 2023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 123,160,000口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 132,890,000口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 22,914,746,505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 27,956,710,053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 813.94円 (100口当たり純資産額) (81,394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 789.63円 (100口当たり純資産額) (78,963円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自 2022年9月8日 至 2023年3月7日	第12期 自 2023年3月8日 至 2023年9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>987,144,012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>3,794,353円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>D=A+B+C</td> <td>990,938,365円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>E</td> <td>84,688,070円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>F=D-E</td> <td>906,250,295円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>G</td> <td>899,068,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>H=F-G</td> <td>7,182,295円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>I</td> <td>123,160,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>J=G/I×100</td> <td>730円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	987,144,012円	親ファンドの配当等収益額	B	0円	分配準備積立金	C	3,794,353円	配当等収益合計額	D=A+B+C	990,938,365円	経費	E	84,688,070円	収益分配可能額	F=D-E	906,250,295円	収益分配金	G	899,068,000円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	7,182,295円	口数	I	123,160,000口	100口当たり分配金	J=G/I×100	730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>1,237,938,003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>7,182,295円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>D=A+B+C</td> <td>1,245,120,298円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>E</td> <td>86,243,372円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>F=D-E</td> <td>1,158,876,926円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>G</td> <td>1,156,143,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>H=F-G</td> <td>2,733,926円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>I</td> <td>132,890,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>J=G/I×100</td> <td>870円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	1,237,938,003円	親ファンドの配当等収益額	B	0円	分配準備積立金	C	7,182,295円	配当等収益合計額	D=A+B+C	1,245,120,298円	経費	E	86,243,372円	収益分配可能額	F=D-E	1,158,876,926円	収益分配金	G	1,156,143,000円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	2,733,926円	口数	I	132,890,000口	100口当たり分配金	J=G/I×100	870円
項目																																																																			
当期配当等収益額	A	987,144,012円																																																																	
親ファンドの配当等収益額	B	0円																																																																	
分配準備積立金	C	3,794,353円																																																																	
配当等収益合計額	D=A+B+C	990,938,365円																																																																	
経費	E	84,688,070円																																																																	
収益分配可能額	F=D-E	906,250,295円																																																																	
収益分配金	G	899,068,000円																																																																	
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	7,182,295円																																																																	
口数	I	123,160,000口																																																																	
100口当たり分配金	J=G/I×100	730円																																																																	
項目																																																																			
当期配当等収益額	A	1,237,938,003円																																																																	
親ファンドの配当等収益額	B	0円																																																																	
分配準備積立金	C	7,182,295円																																																																	
配当等収益合計額	D=A+B+C	1,245,120,298円																																																																	
経費	E	86,243,372円																																																																	
収益分配可能額	F=D-E	1,158,876,926円																																																																	
収益分配金	G	1,156,143,000円																																																																	
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	2,733,926円																																																																	
口数	I	132,890,000口																																																																	
100口当たり分配金	J=G/I×100	870円																																																																	
2. その他費用 その他費用のうち9,859,012円は対象指数についての商標使用料、2,191,562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10,375,851円は対象指数についての商標使用料、2,779,148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11期 自 2022年9月8日 至 2023年3月7日	第12期 自 2023年3月8日 至 2023年9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。	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左

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。

○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。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

同左

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第11期 2023年3月7日現在	第12期 2023年9月7日現在
<p>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。</p> <p>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。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第11期 自 2022年9月8日 至 2023年3月7日	第12期 自 2023年3月8日 至 2023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11期 自 2022年9月8日 至 2023年3月7日	第12期 自 2023年3月8日 至 2023年9月7日
期首元本額 117,160,000,000円	期首元本額 123,160,000,000円
期中追加設定元本額 17,590,000,000円	期中追加設定元本額 17,930,000,000円
期中一部解約元本額 11,590,000,000円	期中一部解約元本額 8,200,000,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第11期 自 2022年9月8日 至 2023年3月7日	第12期 自 2023年3月8日 至 2023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	△4,026,664,701	△918,393,648

合計	△4,026,664,701	△918,393,648
----	----------------	--------------

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11期(2023年3月7日現在)				第12期(2023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	101,026,459,044	—	101,200,486,047	△174,027,003	106,759,415,731	—	107,255,959,015	△496,543,284
米ドル	50,700,431,400	—	50,660,551,100	39,880,300	50,907,084,528	—	51,630,989,630	△723,905,102
カナダドル	2,020,038,380	—	2,011,776,580	8,261,800	2,126,987,676	—	2,137,415,940	△10,428,264
メキシコペソ	909,425,920	—	927,743,200	△18,317,280	1,116,605,002	—	1,078,359,450	38,245,552
ユーロ	33,710,871,450	—	33,923,930,770	△213,059,320	35,682,842,895	—	35,464,940,420	217,902,475
英ポンド	4,716,615,150	—	4,698,894,000	17,721,150	5,401,394,652	—	5,378,091,420	23,303,232
スウェーデン クローナ	232,032,210	—	230,460,340	1,571,870	210,109,324	—	207,505,264	2,604,060
ノルウェーク ローネ	192,869,310	—	191,125,845	1,743,465	171,415,852	—	171,520,940	△105,088
デンマークク ローネ	333,414,586	—	335,272,720	△1,858,134	345,798,720	—	343,611,720	2,187,000
ズロチ	435,712,725	—	439,912,707	△4,199,982	542,605,722	—	527,582,314	15,023,408
豪ドル	1,561,675,995	—	1,557,512,385	4,163,610	1,592,086,860	—	1,585,284,022	6,802,838
ニュージーラ ンドドル	183,984,680	—	184,739,720	△755,040	251,098,240	—	250,538,830	559,410
シンガポール ドル	924,985,211	—	925,414,281	△429,070	1,010,977,513	—	1,012,952,099	△1,974,586
人民元	4,737,169,924	—	4,740,780,000	△3,610,076	7,089,634,661	—	7,156,764,100	△67,129,439
新シェケル	367,232,103	—	372,372,399	△5,140,296	310,774,086	—	310,402,866	371,220
合計	101,026,459,044	—	101,200,486,047	△174,027,003	106,759,415,731	—	107,255,959,015	△496,543,284

(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(2023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(2023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 BOND	3,400,000.00	3,484,734.12	
		US TREASURY BOND	30,000.00	31,792.96	
		US TREASURY BOND	1,600,000.00	1,655,687.36	
		US TREASURY BOND	500,000.00	502,578.10	
		US TREASURY BOND	1,000,000.00	778,203.10	
		US TREASURY BOND	670,000.00	596,012.10	
		US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,670,736.92	
		US TREASURY N/B	500,000.00	474,570.30	
		US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,833,537.05	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,913,750.00	
		US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,531,926.69	
		US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,590,348.54	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,367,675.75	
		US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,018,829.96	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,908,320.20	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	947,070.30	
		US TREASURY N/B	100,000.00	96,103.51	
		US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,718,753.76	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,837,167.80	
		US TREASURY N/B	2,730,000.00	2,627,784.70	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	947,695.30	
		US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,107,087.81	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,370,117.00	
		US TREASURY N/B	100,000.00	96,455.07	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,354,589.75	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,848,183.50	
		US TREASURY N/B	200,000.00	192,246.08	
		US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,729,335.78	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,927,421.80	
		US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,572,234.29	
		US TREASURY N/B	2,150,000.00	2,045,229.42	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,442,050.65	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,042,663.80			
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,517,484.37			

US TREASURY N/B	1,000,000.00	962,148.40
US TREASURY N/B	600,000.00	575,777.34
US TREASURY N/B	150,000.00	137,542.96
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,444,980.45
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,921,250.00
US TREASURY N/B	1,000,000.00	944,160.10
US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,770,435.38
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,821,328.00
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,555,324.08
US TREASURY N/B	1,000,000.00	908,515.60
US TREASURY N/B	3,690,000.00	3,542,400.00
US TREASURY N/B	2,200,000.00	1,991,515.46
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,305,585.85
US TREASURY N/B	1,000,000.00	990,429.60
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,392,187.50
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,076,468.58
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,140,656.16
US TREASURY N/B	100,000.00	90,304.68
US TREASURY N/B	1,000,000.00	949,218.70
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,597,343.60
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,342,949.11
US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,234,386.43
US TREASURY N/B	1,000,000.00	945,585.90
US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,971,949.14
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,350,820.20
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,381,406.25
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,399,218.75
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,077,515.52
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,388,642.55
US TREASURY N/B	100,000.00	89,976.56
US TREASURY N/B	1,000,000.00	889,921.80
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,413,345.64
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,361,601.45
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,336,171.80
US TREASURY N/B	1,000,000.00	913,632.80

US TREASURY N/B	400,000.00	357,109.36
US TREASURY N/B	600,000.00	546,562.50
US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,882,945.26
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,473,187.36
US TREASURY N/B	400,000.00	363,703.12
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,796,406.20
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,823,125.00
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,049,640.54
US TREASURY N/B	1,000,000.00	901,757.80
US TREASURY N/B	2,440,000.00	2,255,760.72
US TREASURY N/B	100,000.00	88,886.71
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,735,976.30
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,175,097.50
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,793,984.30
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,208,593.68
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,344,531.25
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,496,339.80
US TREASURY N/B	2,950,000.00	2,538,843.75
US TREASURY N/B	1,000,000.00	932,441.40
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,574,960.90
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,907,187.40
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,361,937.44
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,776,165.98
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,512,972.61
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,108,960.84
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,179,339.70
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,607,503.74
US TREASURY N/B	100,000.00	98,367.18
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,187,320.26
US TREASURY N/B	1,020,000.00	930,909.32
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,530,703.08
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,017,843.72
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,701,562.40
US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,496,042.10
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,726,875.00

	US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,386,500.00
	US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,594,296.80
	US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,728,593.60
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,291,552.65
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,959,218.60
	US TREASURY N/B	4,200,000.00	3,562,125.00
	US TREASURY N/B	1,630,000.00	1,514,944.82
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,277,402.25
	US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,137,744.00
	US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,373,874.88
	US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,002,124.80
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,294,160.10
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,283,320.20
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	1,916,148.30
	US TREASURY N/B	3,450,000.00	3,146,911.98
	US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,138,515.56
	US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,885,734.27
	US TREASURY N/B	1,750,000.00	1,612,734.37
	US TREASURY N/B	1,920,000.00	1,721,849.85
	US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,103,152.20
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,595,974.45
	US TREASURY N/B	800,000.00	725,124.96
	US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,056,312.32
	US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,793,984.30
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,454,706.90
	US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,031,906.16
	US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,500,851.42
	US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,761,210.78
	US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,929,101.30
	US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,752,843.75
	US TREASURY N/B	5,450,000.00	4,271,650.05
	US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,693,359.20
	US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,478,140.53
	US TREASURY N/B	4,140,000.00	4,410,555.21
	US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,734,632.76

US TREASURY N/B	2,500,000.00	1,989,746.00
US TREASURY N/B	3,300,000.00	2,635,616.94
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,311,874.80
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,581,250.00
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,446,625.00
US TREASURY N/B	4,700,000.00	4,627,296.64
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,062,156.14
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,708,124.80
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,932,343.60
US TREASURY N/B	110,000.00	113,158.19
US TREASURY N/B	500,000.00	536,953.10
US TREASURY N/B	2,330,000.00	2,368,317.54
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,099,286.61
US TREASURY N/B	310,000.00	304,696.08
US TREASURY N/B	600,000.00	605,929.68
US TREASURY N/B	100,000.00	102,333.98
US TREASURY N/B	250,000.00	247,880.85
US TREASURY N/B	1,030,000.00	617,195.26
US TREASURY N/B	670,000.00	653,276.13
US TREASURY N/B	730,000.00	455,038.05
US TREASURY N/B	100,000.00	103,453.12
US TREASURY N/B	2,900,000.00	1,966,505.66
US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,015,877.67
US TREASURY N/B	2,400,000.00	1,727,812.32
US TREASURY N/B	1,100,000.00	996,746.08
US TREASURY N/B	2,900,000.00	1,901,595.54
US TREASURY N/B	1,000,000.00	824,882.80
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,298,271.33
US TREASURY N/B	800,000.00	657,031.20
US TREASURY N/B	3,100,000.00	2,251,859.22
US TREASURY N/B	650,000.00	521,193.33
US TREASURY N/B	400,000.00	333,750.00
US TREASURY N/B	700,000.00	537,783.19
US TREASURY N/B	700,000.00	536,238.22
US TREASURY N/B	1,100,000.00	893,148.41

US TREASURY N/B	400,000.00	349,625.00
US TREASURY N/B	890,000.00	776,159.92
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,005,796.80
US TREASURY N/B	900,000.00	723,269.52
US TREASURY N/B	930,000.00	730,812.87
US TREASURY N/B	500,000.00	358,271.45
US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,337,707.52
US TREASURY N/B	3,890,000.00	2,970,607.44
US TREASURY N/B	600,000.00	468,011.70
US TREASURY N/B	750,000.00	531,855.45
US TREASURY N/B	1,090,000.00	771,685.88
US TREASURY N/B	1,420,000.00	953,230.38
US TREASURY N/B	600,000.00	455,250.00
US TREASURY N/B	800,000.00	620,437.44
US TREASURY N/B	1,420,000.00	1,100,777.32
US TREASURY N/B	2,030,000.00	1,499,900.21
US TREASURY N/B	770,000.00	568,266.00
US TREASURY N/B	740,000.00	572,748.38
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,267,249.92
US TREASURY N/B	1,930,000.00	1,492,885.10
US TREASURY N/B	500,000.00	414,375.00
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,392,328.08
US TREASURY N/B	1,320,000.00	996,909.27
US TREASURY N/B	1,340,000.00	886,336.70
US TREASURY N/B	1,450,000.00	985,886.61
US TREASURY N/B	1,480,000.00	920,317.13
US TREASURY N/B	3,320,000.00	1,680,879.48
US TREASURY N/B	6,950,000.00	3,637,483.35
US TREASURY N/B	1,200,000.00	672,773.40
US TREASURY N/B	2,800,000.00	1,674,750.00
US TREASURY N/B	2,700,000.00	1,822,077.99
US TREASURY N/B	2,900,000.00	1,785,255.66
US TREASURY N/B	2,600,000.00	1,548,116.96
US TREASURY N/B	2,400,000.00	1,571,156.16
US TREASURY N/B	2,300,000.00	1,734,253.82

小計	US TREASURY N/B	400,000.00	309,718.72
	US TREASURY N/B	100,000.00	93,859.37
	US TREASURY N/B	3,400,000.00	2,980,578.04
	銘柄数 : 212	388,790,000.00	339,224,728.24 (50,184,906,295)
	組入時価比率 : 47.8%		48.3%
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	386,622.96
	CANADIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,899,140.60
	CANADIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,631,751.80
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,582,644.12
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	721,907.68
	CANADIAN GOVERNMENT	420,000.00	389,910.78
	CANADIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,702,561.31
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	303,363.72
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	92,237.77
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	297,929.13
	CANADIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,430,920.98
	CANADIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,190,023.52
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	927,262.93
	CANADIAN GOVERNMENT	1,750,000.00	1,526,730.97
	CANADIAN GOVERNMENT	970,000.00	1,130,424.32
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	227,851.44
	CANADIAN GOVERNMENT	320,000.00	334,473.60
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	325,036.80
	CANADIAN GOVERNMENT	480,000.00	416,941.63
	CANADIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,166,613.76
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	675,464.00
	CANADIAN GOVERNMENT	250,000.00	208,722.50
小計	銘柄数 : 22	22,000,000.00	19,568,536.32 (2,121,229,337)
	組入時価比率 : 2.0%		2.0%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,700,000.00	6,496,274.44
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,600,000.00	7,512,606.08
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	9,262,000.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	18,000,000.00	16,260,494.40
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,500,000.00	3,221,820.00

	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	8,723,300.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,300,000.00	14,190,597.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,900,000.00	8,504,306.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,500,000.00	4,971,450.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,000,000.00	1,754,380.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	17,800,000.00	15,732,530.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,000,000.00	3,597,758.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	312,084.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,500,000.00	2,290,275.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	12,400,000.00	10,445,388.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,700,000.00	6,604,829.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	4,249,550.00	
小計	銘柄数 : 17	137,200,000.00	124,129,642.32 (1,043,570,315)	
	組入時価比率 : 1.0%		1.0%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	900,000.00	871,331.40	
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	95,797.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	947,000.00	
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	644,898.80	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	354,000.00	
	BELGIUM KINGDOM	560,000.00	506,413.60	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	889,917.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,028,400.00	
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	544,250.00	
	BELGIUM KINGDOM	50,000.00	53,072.25	
	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	469,860.00	
	BELGIUM KINGDOM	750,000.00	631,575.00	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	484,553.50	
	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	624,536.00	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	407,593.50	
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	108,818.30	
	BELGIUM KINGDOM	590,000.00	602,530.42	
	BELGIUM KINGDOM	780,000.00	530,286.12	
	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	535,968.40	
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	416,671.50	

BELGIUM KINGDOM	200,000.00	146,812.40
BELGIUM KINGDOM	150,000.00	103,950.15
BELGIUM KINGDOM GOVT	400,000.00	442,128.40
BELGIUM KINGDOM GOVT	550,000.00	633,626.40
BONOS Y OBLIG DE	1,000,000.00	789,386.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	950,000.00	904,979.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	679,238.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,800,000.00	1,696,327.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	204,396.42
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	923,100.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	771,700.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,378,066.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,060,000.00	1,132,057.84
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	846,094.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	150,000.00	140,707.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	728,360.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,600,000.00	1,487,184.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	694,720.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	918,522.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,300,000.00	1,189,370.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,085,650.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	950,000.00	857,565.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	518,460.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	678,592.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	850,000.00	705,259.45
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	728,454.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000.00	1,038,480.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	773,000.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	553,490.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	735,696.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	959,800.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,600,000.00	1,423,200.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	653,848.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,300,000.00	878,077.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	196,758.32

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,900,000.00	1,240,109.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	210,000.00	227,517.15
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	361,080.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	424,826.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	920,000.00	754,894.96
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,350,000.00	1,048,998.06
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	297,251.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	616,400.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	168,757.46
BUNDES OBLIGATION	100,000.00	94,038.00
BUNDES OBLIGATION	900,000.00	835,560.00
BUNDES OBLIGATION	900,000.00	825,624.00
BUNDES OBLIGATION	1,000,000.00	906,960.00
BUNDES OBLIGATION	700,000.00	662,466.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,100,000.00	2,019,402.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,441,485.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	565,896.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	655,000.00	603,412.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,900,000.00	2,150,705.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	183,790.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,342,755.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	1,006,362.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,340,000.00	1,220,673.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,730,000.00	1,541,620.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	874,330.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	480,000.00	423,172.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	171,836.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,500,000.00	2,426,075.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	846,755.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	84,846.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	922,053.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	150,000.00	125,859.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,610,000.00	1,917,043.10
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	828,030.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	899,349.00

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	403,180.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	800,000.00	743,024.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,010,000.00	2,396,423.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,095,585.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	991,410.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	350,000.00	397,407.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	314,004.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	674,201.13
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	1,132,644.24
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	960,000.00	1,020,614.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	970,000.00	926,896.11
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,190,000.00	1,135,652.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	840,000.00	616,686.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	194,644.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	691,500.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,550,000.00	1,245,254.50
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	500,000.00	484,990.00
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	1,200,000.00	1,182,804.00
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2,600,000.00	2,570,230.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,071,114.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,000.00	29,561.10
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	954,000.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	954,680.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,950,000.00	3,002,746.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	95,920.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	962,979.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	387,200.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	96,420.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	529,464.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,200,000.00	1,091,520.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	901,782.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	945,700.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	957,400.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,351,800.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,000.00	33,117.00

BUONI POLIENNALI DEL TES	1,050,000.00	972,720.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	819,495.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	639,310.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	236,775.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,200,000.00	1,127,760.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	807,570.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	669,480.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	850,000.00	789,055.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	427,550.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,200,000.00	1,024,800.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	937,170.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	860,000.00	817,516.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	832,000.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,600,000.00	1,506,880.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	780,000.00	742,170.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,000.00	32,193.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	893,970.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	584,160.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,370,000.00	1,160,938.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	979,500.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	570,430.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	764,100.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	634,904.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	338,250.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	76,480.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,090,357.80
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	904,200.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	76,550.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	607,880.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	630,000.00	701,820.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,750,000.00	1,765,750.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	212,875.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,574,400.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,450,000.00	1,306,015.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	71,310.00

BUONI POLIENNALI DEL TES	1,160,000.00	905,960.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	171,018.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	64,590.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,200,000.00	1,028,880.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	329,720.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	120,000.00	124,968.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,156,680.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	834,560.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	199,560.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	193,000.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	503,250.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	289,550.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	970,000.00	781,335.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	580,000.00	422,124.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	739,080.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	784,980.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	200,820.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	364,440.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	285,690.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	165,547.50
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	955,371.00
FINNISH GOVERNMENT	20,000.00	18,745.66
FINNISH GOVERNMENT	260,000.00	256,989.20
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	176,910.00
FINNISH GOVERNMENT	600,000.00	517,145.40
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	168,656.36
FINNISH GOVERNMENT	600,000.00	474,167.40
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	196,698.36
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	268,478.40
FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	134,929.35
FINNISH GOVERNMENT	170,000.00	116,889.09
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	171,290.60
FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	286,050.00
FRANCE (GOVT OF)	2,500,000.00	2,380,000.00
FRANCE (GOVT OF)	2,450,000.00	2,337,306.37

FRANCE (GOVT OF)	1,600,000.00	1,496,000.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,900,000.00	1,865,729.70	
FRANCE (GOVT OF)	1,150,000.00	1,054,550.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	450,614.50	
FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,026,300.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,550,000.00	2,312,926.50	
FRANCE (GOVT OF)	2,100,000.00	1,895,069.40	
FRANCE (GOVT OF)	1,900,000.00	1,696,975.50	
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	789,080.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	871,300.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,498,651.20	
FRANCE (GOVT OF)	400,000.00	388,840.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,600,000.00	1,290,414.40	
FRANCE (GOVT OF)	2,600,000.00	2,028,637.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,300,000.00	996,190.00	
FRANCE (GOVT OF)	350,000.00	318,487.40	
FRANCE (GOVT OF)	1,600,000.00	1,575,664.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,400,000.00	1,971,619.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	940,200.00	
FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	448,920.00	
FRANCE (GOVT OF)	210,000.00	167,826.96	
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	500,104.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	425,963.50	
FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	337,365.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	902,400.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	713,583.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,330,000.00	667,836.89	
FRANCE (GOVT OF)	2,400,000.00	1,174,440.00	
FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	265,003.74	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	315,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1,800,000.00	1,909,800.00	
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1,100,000.00	1,049,565.00	
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	900,000.00	833,990.94	
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	800,000.00	806,520.00	
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2,400,000.00	2,375,280.00	

FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1,300,000.00	1,470,300.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3,460,000.00	3,102,578.54
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	740,000.00	891,815.44
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	800,000.00	910,334.40
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1,610,000.00	1,718,153.36
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1,700,000.00	1,921,510.00
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	780,000.00	745,366.44
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	400,000.00	428,494.68
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	700,000.00	753,465.30
IRISH GOVERNMENT	40,000.00	36,463.08
IRISH GOVERNMENT	400,000.00	315,758.40
IRISH GOVERNMENT	100,000.00	62,088.80
IRISH TSY 0.2%	800,000.00	721,810.08
IRISH TSY 0.2% 2030	500,000.00	411,415.00
IRISH TSY 0.4% 2035	300,000.00	218,850.00
IRISH TSY 1.10% 2029	420,000.00	379,436.23
IRISH TSY 1.35% 2031	500,000.00	444,854.00
IRISH TSY 1.5% 2050	350,000.00	230,071.10
IRISH TSY 1.7% 2037	230,000.00	188,177.95
IRISH TSY 1% 2026	100,000.00	94,871.50
IRISH TSY 2.4% 2030	100,000.00	96,648.60
IRISH TSY 2% 2045	410,000.00	318,149.34
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	474,140.30
NETHERLANDS GOVERNMENT	700,000.00	655,830.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	372,860.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	455,400.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	760,000.00	711,588.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	450,000.00	497,700.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	723,000.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	516,273.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	329,421.60
NETHERLANDS GOVERNMENT	700,000.00	559,843.62
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,100,000.00	894,741.43
NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	337,720.25
NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	660,658.80

	NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	258,473.60	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	539,168.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	450,000.00	491,859.45	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	650,000.00	620,782.50	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	264,641.34	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	240,556.86	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	162,660.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	67,465.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	490,086.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	960,540.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	730,000.00	680,347.29	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,150,000.00	1,050,544.55	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	730,000.00	660,416.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	174,190.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	738,549.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	158,768.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	600,000.00	499,668.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	291,801.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	212,507.58	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	336,984.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	732,420.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	280,000.00	270,320.68	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	250,000.00	172,075.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	600,000.00	322,849.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	50,000.00	54,170.00	
	SPANISH GOVERNMENT	140,000.00	158,053.84	
	SPANISH GOVERNMENT	150,000.00	174,780.00	
	SPANISH GOVERNMENT	400,000.00	413,989.20	
小計	銘柄数 : 293	242,155,000.00	215,898,039.33	
			(34,239,270,057)	
	組入時価比率 : 32.6%		32.9%	
英債券	UK TREASURY	100,000.00	34,818.64	
	UK TREASURY	200,000.00	195,341.28	
	UK TREASURY	2,000,000.00	1,872,920.00	
	UK TREASURY	100,000.00	99,945.40	

UK TREASURY	100,000.00	92,858.00
UK TREASURY	200,000.00	182,918.40
UK TREASURY	700,000.00	611,757.02
UK TREASURY	460,000.00	405,334.52
UK TREASURY	450,000.00	442,973.25
UK TREASURY	400,000.00	329,464.00
UK TREASURY	1,100,000.00	955,785.60
UK TREASURY	2,800,000.00	2,254,840.00
UK TREASURY	100,000.00	80,964.00
UK TREASURY	100,000.00	75,289.50
UK TREASURY	100,000.00	101,790.30
UK TREASURY	1,000,000.00	721,744.00
UK TREASURY	200,000.00	151,494.00
UK TREASURY	130,000.00	128,214.58
UK TREASURY	400,000.00	361,081.28
UK TREASURY	2,600,000.00	1,847,347.84
UK TREASURY	860,000.00	853,749.52
UK TREASURY	300,000.00	191,400.00
UK TREASURY	1,060,000.00	1,022,158.00
UK TREASURY	350,000.00	244,712.16
UK TREASURY	230,000.00	205,988.00
UK TREASURY	400,000.00	400,690.40
UK TREASURY	550,000.00	333,902.80
UK TREASURY	700,000.00	659,618.40
UK TREASURY	1,020,000.00	956,178.60
UK TREASURY	700,000.00	403,956.00
UK TREASURY	840,000.00	808,597.94
UK TREASURY	500,000.00	411,682.50
UK TREASURY	520,000.00	477,820.20
UK TREASURY	240,000.00	128,210.40
UK TREASURY	720,000.00	401,414.40
UK TREASURY	1,010,000.00	925,843.77
UK TREASURY	2,000,000.00	925,616.00
UK TREASURY	1,000,000.00	839,500.00
UK TREASURY	1,650,000.00	801,182.25

小計	UK TREASURY	650,000.00	324,242.10	
	UK TREASURY	700,000.00	356,842.50	
	UK TREASURY	100,000.00	88,445.90	
	UK TREASURY	300,000.00	184,620.00	
	UK TREASURY	100,000.00	79,580.00	
	UK TSY 0 1/2% 2061	100,000.00	28,149.00	
	UK TSY 0 5/8% 2050	930,000.00	350,665.80	
	UK TSY 3 1/4% 2044	300,000.00	239,136.60	
	UNITED KINGDOM GILT	2,450,000.00	2,365,863.08	
	UNITED KINGDOM GILT	700,000.00	682,425.94	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	186,261.60	
	UNITED KINGDOM (GOVERNMEN	1,050,000.00	966,399.00	
	銘柄数 : 51	35,670,000.00	27,791,734.47	(5,137,857,951)
	組入時価比率 : 4.9%			4.9%
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	6,100,000.00	6,007,890.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,100,000.00	1,029,285.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	600,000.00	542,906.16	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,200,000.00	1,940,631.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,700,000.00	2,201,245.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,500,000.00	2,389,298.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,100,000.00	1,174,327.00	
	銘柄数 : 7	16,300,000.00	15,285,582.76	(203,451,106)
組入時価比率 : 0.2%			0.2%	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,432,095.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	938,450.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	300,000.00	277,380.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,649,030.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	700,000.00	591,920.70	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	3,269,520.00	
	銘柄数 : 6	13,600,000.00	12,158,396.10	(167,907,450)
組入時価比率 : 0.2%			0.2%	
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,800,000.00	1,730,692.44	
	KINGDOM OF DENMARK	1,000,000.00	970,400.00	

小計	KINGDOM OF DENMARK	2,100,000.00	1,910,035.47
	KINGDOM OF DENMARK	1,900,000.00	1,650,910.00
	KINGDOM OF DENMARK	2,500,000.00	1,992,695.00
	KINGDOM OF DENMARK	1,100,000.00	1,036,544.52
	KINGDOM OF DENMARK	4,670,000.00	5,578,491.99
	KINGDOM OF DENMARK	1,900,000.00	923,067.50
	銘柄数 : 8	16,970,000.00	15,792,836.92 (335,913,641)
	組入時価比率 : 0.3%		0.3%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	3,968,422.80
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,290,000.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,900,000.00	2,752,830.80
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,400,000.00	1,266,720.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,500,000.00	2,166,365.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	1,516,460.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,700,000.00	2,005,560.00
	銘柄数 : 7	17,100,000.00	14,966,358.60 (519,405,978)
組入時価比率 : 0.5%		0.5%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	382,543.48
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,550,000.00	1,534,296.33
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	809,038.24
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	724,080.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	600,000.00	619,163.34
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	600,000.00	575,666.58
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,350,000.00	1,257,997.50
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	189,690.20
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	677,458.39
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	420,435.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	550,000.00	502,822.10
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	973,356.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	581,873.67
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	785,700.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,031,245.02
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,394,205.53
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	670,000.00	690,466.28

小計	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	816,128.73
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	830,000.00	719,497.61
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	283,735.98
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	347,280.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	320,000.00	253,808.89
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	840,000.00	654,528.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	281,000.00
	銘柄数 : 24 組入時価比率 : 1.5%	18,660,000.00	16,506,016.87 (1,556,682,451) 1.5%
ニュージーランドドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	700,000.00	669,760.00
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	600,000.00	481,952.88
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	500,000.00	485,550.00
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	800,000.00	708,561.68
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	400,000.00	241,646.68
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	300,000.00	192,150.00
	銘柄数 : 6 組入時価比率 : 0.2%	3,300,000.00	2,779,621.24 (241,271,123) 0.2%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	99,400.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	650,000.00	637,208.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,127,160.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	450,000.00	435,060.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	938,300.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	201,600.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	600,000.00	586,500.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	550,000.00	540,650.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,078,000.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	900,000.00	801,450.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	507,317.50
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	451,500.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	271,473.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	133,073.50
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	378,800.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	235,200.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	777,480.00

小計	銘柄数：17	9,890,000.00	9,200,172.00	
			(997,390,646)	
	組入時価比率：1.0%		1.0%	
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	11,000,000.00	11,043,110.10	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,026,899.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,018,258.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,500,000.00	11,535,650.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	16,000,000.00	16,018,105.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	3,989,200.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,992,854.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	8,997,336.90	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,000,000.00	12,048,678.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,003,934.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,045,903.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,000,000.00	7,971,132.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	19,000,000.00	18,990,895.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,007,482.30	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,010,623.90	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	6,999,416.90	
	CHINA GOVERNMENT BOND	21,100,000.00	21,249,149.57	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,900,000.00	4,929,105.02	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	3,992,183.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,171,027.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,081,920.30	
	CHINA GOVERNMENT BOND	16,000,000.00	16,144,225.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,001,056.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,083,205.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	12,628,556.25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	18,000,000.00	17,976,927.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,087,063.30	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,046,258.20	
CHINA GOVERNMENT BOND	11,000,000.00	11,046,539.90		
CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,996,482.20		
CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,067,053.00		
CHINA GOVERNMENT BOND	7,200,000.00	7,322,413.68		

		CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,006,272.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,265,118.20	
		CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,195,520.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	15,600,000.00	16,521,529.44	
		CHINA GOVERNMENT BOND	9,900,000.00	10,122,751.98	
		CHINA GOVERNMENT BOND	6,600,000.00	6,891,132.60	
	小計	銘柄数 : 38 組入時価比率 : 6.7%	342,300,000.00	345,524,970.44 (6,982,368,602) 6.7%	
	新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	1,800,000.00	1,692,214.56	
		ISRAEL FIXED BOND	100,000.00	95,266.44	
		ISRAEL FIXED BOND	500,000.00	457,141.80	
		ISRAEL FIXED BOND	1,400,000.00	1,310,306.06	
		ISRAEL FIXED BOND	1,200,000.00	1,110,741.36	
		ISRAEL FIXED BOND	700,000.00	583,251.48	
		ISRAEL FIXED BOND	1,000,000.00	808,769.90	
		ISRAEL FIXED BOND	500,000.00	366,315.75	
		ISRAEL FIXED BOND	400,000.00	468,240.00	
		ISRAEL FIXED BOND	400,000.00	370,384.68	
		ISRAEL FIXED BOND	800,000.00	601,235.04	
	小計	銘柄数 : 11 組入時価比率 : 0.3%	8,800,000.00	7,863,867.07 (303,505,949) 0.3%	
	合計			104,034,730,901 (104,034,730,901)	

(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。