



2026年3月期 (2025年9月8日～2026年3月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended March 2026 (September 8, 2025 – March 7, 2026)

2026年4月16日
 April 16, 2026

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 <https://www.nomura-am.co.jp>
 代表者名 CEO 兼代表取締役社長 大越 昇一
 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 <https://www.nomura-am.co.jp>
 Representative: Ohkoshi Shoichi, President & CEO
 Contact person: Satoshi Nagasaka, Head of Support Dial Team

有価証券報告書提出予定日 2026年5月27日
 分配金支払開始日 2026年4月15日
 Scheduled date of submission of securities report: May 27, 2026
 Date of commencing dividend payment: April 15, 2026

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2026年3月期の運用状況 (2025年9月8日～2026年3月7日)

Management Status for Year ended March 2026 (from September 8, 2025 to March 7, 2026)

(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.	%
2026年3月期 FY ended Mar. 2026	180,354	(99.1)	1,692	(0.9)	182,046	(100.0)
2025年9月期 FY ended Sep. 2025	186,366	(99.6)	689	(0.4)	187,056	(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
2026年3月期 FY ended Mar. 2026	249,360	45,140	49,590	244,910
2025年9月期 FY ended Sep. 2025	208,300	51,380	10,320	249,360

(3) 基準価額

Net Asset Value

	総資産 Total Assets (①)	負債 Liabilities (②)	純資産 Net Assets (③(①-②))	100口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×100) Net Asset Value per 100 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×100)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2026年3月期 FY ended Mar. 2026	185,935	3,888	182,046	74,332
2025年9月期 FY ended Sep. 2025	191,243	4,187	187,056	75,014

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2026年3月期 FY ended Mar. 2026	1,100
2025年9月期 FY ended Sep. 2025	1,010

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16期 (2025年9月7日現在) 16th Fiscal Year As of September 7, 2025	第17期 (2026年3月7日現在) 17th Fiscal Year As of March 7, 2026
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
預金 Deposits	378,701,911	397,888,194
コール・ローン Call loans	317,502,910	304,551,447
国債証券 Government bonds	186,366,853,910	180,354,384,174
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	-	383,239,036
未収入金 Accounts receivable - other	2,442,665,555	2,674,756,367
未収利息 Accrued interest	1,381,564,406	1,431,588,324
前払費用 Prepaid expenses	333,683,203	353,875,038
その他未収収益 Other accrued revenue	145,467	10,608,715
差入委託証拠金 Margin deposits	22,577,522	24,265,234
流動資産合計 Total current assets	191,243,694,884	185,935,156,529
資産合計 Total assets	191,243,694,884	185,935,156,529
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	1,520,525,044	1,032,707,793
未払金 Accounts payable - other	21,970,216	27,410,189
未払収益分配金 Unpaid dividends	2,518,536,000	2,694,010,000
未払受託者報酬 Trustee fees payable	19,018,011	18,797,658
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	95,073,554	93,928,323
その他未払費用 Other accrued expenses	12,429,136	21,832,821

流動負債合計 Total current liabilities	4,187,551,961	3,888,686,784
負債合計 Total liabilities	4,187,551,961	3,888,686,784
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	249,360,000,000	244,910,000,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	△62,303,857,077	△62,863,530,255
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	20,987,903	4,248,663
元本等合計 Total principal and other	187,056,142,923	182,046,469,745
純資産合計 Total net assets	187,056,142,923	182,046,469,745
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	191,243,694,884	185,935,156,529

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

(単位：円) (Unit：JPY)

	第16期 自 2025年3月8日 至 2025年9月7日 16th Fiscal Year From March 8, 2025 to September 7, 2025	第17期 自 2025年9月8日 至 2026年3月7日 17th Fiscal Year From September 8, 2025 to March 7, 2026
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取利息 Interest income	2,670,612,079	2,813,300,034
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	1,182,258,028	943,031,860
為替差損益 Foreign exchange gains or losses	△2,876,353,572	△2,451,915,598
その他収益 Other revenue	9,124,990	12,069,387
営業収益合計 Total operating revenue	985,641,525	1,316,485,683
営業費用 Operating expenses		
受託者報酬 Trustee fees	19,018,011	18,797,658
委託者報酬 Investment trust management fees	95,073,554	93,928,323
その他費用 Other expenses	31,276,519	35,372,680
営業費用合計	145,368,084	148,098,661

Total operating expenses		
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	840,273,441	1,168,387,022
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	840,273,441	1,168,387,022
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	840,273,441	1,168,387,022
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	△50,801,542,718	△62,303,857,077
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	2,473,486,400	12,136,439,200
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	2,473,486,400	12,136,439,200
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	12,297,538,200	11,170,489,400
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	12,297,538,200	11,170,489,400
分配金 Dividends	2,518,536,000	2,694,010,000
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	△62,303,857,077	△62,863,530,255

(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。 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、2025年9月8日から2026年3月7日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

第16期 2025年9月7日現在	第17期 2026年3月7日現在
---------------------	---------------------

<p>1. 計算期間の末日における受益権の総数 249,360,000 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>元本の欠損 62,303,857,077 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 1口当たり純資産額 750.14 円 (100口当たり純資産額) (75,014 円)</p> <p>4. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 3,352,794,405 円</p> <p>なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。</p> <p>5. 自由処分権を有する担保受入金融資産の時価 貸付有価証券の担保として受け入れている資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 3,579,737,076 円</p> <p>なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。</p>	<p>1. 計算期間の末日における受益権の総数 244,910,000 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>元本の欠損 62,863,530,255 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 1口当たり純資産額 743.32 円 (100口当たり純資産額) (74,332 円)</p> <p>4. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 4,814,608,276 円</p> <p>なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。</p> <p>5. 自由処分権を有する担保受入金融資産の時価 貸付有価証券の担保として受け入れている資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 5,027,208,565 円</p> <p>なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。</p>
---	---

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自 2025年3月8日 至 2025年9月7日	第17期 自 2025年9月8日 至 2026年3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: 10%;"></th> <th style="width: 60%;"></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;">2,679,737,069 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;">5,154,918 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;">2,684,891,987 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">E</td> <td style="text-align: right;">145,368,084 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;">2,539,523,903 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">G</td> <td style="text-align: right;">2,518,536,000 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;">20,987,903 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">I</td> <td style="text-align: right;">249,360,000 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;">1,010 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち17,352,605円は対象指数についての商標使用料、5,746,398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	2,679,737,069 円	親ファンドの配当等収益額	B	0 円	分配準備積立金	C	5,154,918 円	配当等収益合計額	D=A+B+C	2,684,891,987 円	経費	E	145,368,084 円	収益分配可能額	F=D-E	2,539,523,903 円	収益分配金	G	2,518,536,000 円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	20,987,903 円	口数	I	249,360,000 口	100口当たり分配金	J=G/I×100	1,010 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: 10%;"></th> <th style="width: 60%;"></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;">2,825,369,421 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;">20,987,903 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;">2,846,357,324 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">E</td> <td style="text-align: right;">148,098,661 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;">2,698,258,663 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">G</td> <td style="text-align: right;">2,694,010,000 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;">4,248,663 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">I</td> <td style="text-align: right;">244,910,000 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;">1,100 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち16,965,092円は対象指数についての商標使用料、6,082,778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	2,825,369,421 円	親ファンドの配当等収益額	B	0 円	分配準備積立金	C	20,987,903 円	配当等収益合計額	D=A+B+C	2,846,357,324 円	経費	E	148,098,661 円	収益分配可能額	F=D-E	2,698,258,663 円	収益分配金	G	2,694,010,000 円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	4,248,663 円	口数	I	244,910,000 口	100口当たり分配金	J=G/I×100	1,100 円
項目																																																																			
当期配当等収益額	A	2,679,737,069 円																																																																	
親ファンドの配当等収益額	B	0 円																																																																	
分配準備積立金	C	5,154,918 円																																																																	
配当等収益合計額	D=A+B+C	2,684,891,987 円																																																																	
経費	E	145,368,084 円																																																																	
収益分配可能額	F=D-E	2,539,523,903 円																																																																	
収益分配金	G	2,518,536,000 円																																																																	
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	20,987,903 円																																																																	
口数	I	249,360,000 口																																																																	
100口当たり分配金	J=G/I×100	1,010 円																																																																	
項目																																																																			
当期配当等収益額	A	2,825,369,421 円																																																																	
親ファンドの配当等収益額	B	0 円																																																																	
分配準備積立金	C	20,987,903 円																																																																	
配当等収益合計額	D=A+B+C	2,846,357,324 円																																																																	
経費	E	148,098,661 円																																																																	
収益分配可能額	F=D-E	2,698,258,663 円																																																																	
収益分配金	G	2,694,010,000 円																																																																	
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	4,248,663 円																																																																	
口数	I	244,910,000 口																																																																	
100口当たり分配金	J=G/I×100	1,100 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16期 自 2025年3月8日 至 2025年9月7日	第17期 自 2025年9月8日 至 2026年3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。</p> <p>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。</p> <p>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</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>ク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>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>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。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>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。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>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。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>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。</p>	<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>
--	------------------------------------

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第16期 2025年9月7日現在	第17期 2026年3月7日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第16期 自 2025年3月8日 至 2025年9月7日	第17期 自 2025年9月8日 至 2026年3月7日
<p>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。</p>	<p>同左</p>

(その他の注記)

1 元本の移動

第16期 自 2025年3月8日 至 2025年9月7日	第17期 自 2025年9月8日 至 2026年3月7日
<p>期首元本額 208,300,000,000円</p>	<p>期首元本額 249,360,000,000円</p>
<p>期中追加設定元本額 51,380,000,000円</p>	<p>期中追加設定元本額 45,140,000,000円</p>
<p>期中一部解約元本額 10,320,000,000円</p>	<p>期中一部解約元本額 49,590,000,000円</p>

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第16期 自 2025年3月8日 至 2025年9月7日	第17期 自 2025年9月8日 至 2026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	962,373,260	563,089,857
合計	962,373,260	563,089,857

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16期(2025年9月7日現在)				第17期(2026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	189,046,345,908	—	190,566,870,952	△1,520,525,044	186,386,666,115	—	187,036,134,872	△649,468,757
米ドル	86,438,016,457	—	87,205,223,980	△767,207,523	84,281,117,363	—	85,162,460,360	△881,342,997
カナダドル	3,774,371,812	—	3,789,915,100	△15,543,288	3,933,024,991	—	3,976,829,568	△43,804,577
メキシコペソ	1,627,204,510	—	1,637,508,790	△10,304,280	1,773,969,109	—	1,743,076,764	30,892,345
ユーロ	56,889,748,600	—	57,359,387,120	△469,638,520	55,524,119,034	—	55,209,119,728	314,999,306
英ポンド	10,705,265,019	—	10,754,092,000	△48,826,981	11,127,222,981	—	11,144,088,629	△16,865,648
スウェーデン クローナ	272,630,610	—	276,066,000	△3,435,390	333,164,797	—	330,768,193	2,396,604
ノルウェー クローネ	290,969,789	—	293,434,560	△2,464,771	302,680,166	—	302,636,588	43,578
デンマーク クローネ	461,365,420	—	464,742,100	△3,376,680	377,553,838	—	375,378,432	2,175,406
ズロチ	1,253,124,200	—	1,267,647,970	△14,523,770	1,346,423,544	—	1,323,187,397	23,236,147
豪ドル	2,487,998,716	—	2,504,572,770	△16,574,054	2,541,372,746	—	2,537,068,794	4,303,952
ニュージー ランドドル	505,195,470	—	506,434,500	△1,239,030	496,211,807	—	495,002,430	1,209,377
シンガポ ールドル	1,796,374,620	—	1,803,930,000	△7,555,380	1,722,186,535	—	1,719,591,650	2,594,885
人民元	21,829,016,498	—	21,988,644,750	△159,628,252	21,870,250,529	—	21,944,311,293	△74,060,764
新シエケル	715,064,187	—	715,271,312	△207,125	757,368,675	—	772,615,046	△15,246,371
合計	189,046,345,908	—	190,566,870,952	△1,520,525,044	186,386,666,115	—	187,036,134,872	△649,468,757

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2026年3月7日現在)

(2) 株式以外の有価証券(2026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	16,930,000.00	17,631,668.92	
		US TREASURY BOND	3,600,000.00	3,752,578.08	
		US TREASURY BOND	600,000.00	609,632.76	
		US TREASURY BOND	1,900,000.00	1,496,769.46	
		US TREASURY BOND	3,400,000.00	3,019,890.54	
		US TREASURY BOND	900,000.00	910,617.12	
		US TREASURY N/B	2,450,000.00	2,456,671.59	
		US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,211,484.36	
		US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,898,007.20	
		US TREASURY N/B	24,900,000.00	25,148,026.41	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,976,250.00	
		US TREASURY N/B	100,000.00	101,246.09	
		US TREASURY N/B	100,000.00	101,017.57	
		US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,877,734.28	
		US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,618,740.09	
		US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,607,171.56	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,310,257.78	
		US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,606,718.72	
		US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,714,144.51	
		US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,738,750.00	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,512,861.30	
		US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,813,234.20	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,309,013.55	
		US TREASURY N/B	500,000.00	474,160.15	
		US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,211,000.00	
		US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,416,542.96	
		US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,396,531.04	
		US TREASURY N/B	3,710,000.00	3,652,973.21	
US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,593,896.25			
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,048,845.60			
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,225,562.24			
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,717,312.50			

	US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,809,062.40
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,497,480.45
	US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,024,794.89
	US TREASURY N/B	600,000.00	570,246.06
	US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,303,029.07
	US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,276,859.36
	US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,308,429.59
	US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,694,214.72
	US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,050,234.00
	US TREASURY N/B	13,830,000.00	13,603,370.55
	US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,379,869.06
	US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,702,792.80
	US TREASURY N/B	400,000.00	408,085.92
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,405,878.88
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,022,070.20
	US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,167,703.08
	US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,044,812.48
	US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,545,605.25
	US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,147,484.16
	US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,131,787.07
	US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,010,872.97
	US TREASURY N/B	4,900,000.00	5,047,095.55
	US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,852,265.60
	US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,726,827.88
	US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,902,050.52
	US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,657,652.02
	US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,058,710.90
	US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,195,456.99
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,720,419.89
	US TREASURY N/B	4,170,000.00	4,100,608.28
	US TREASURY N/B	8,600,000.00	8,597,480.20
	US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,022,910.10
	US TREASURY N/B	300,000.00	298,593.75
	US TREASURY N/B	4,700,000.00	4,756,179.57
	US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,829,039.04

	US TREASURY N/B	800,000.00	813,031.20
	US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,813,605.30
	US TREASURY N/B	4,900,000.00	5,024,413.94
	US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,777,974.54
	US TREASURY N/B	8,900,000.00	9,007,599.22
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,990,234.00
	US TREASURY N/B	400,000.00	352,843.72
	US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,811,249.76
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,403,144.40
	US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,834,343.68
	US TREASURY N/B	400,000.00	406,820.28
	US TREASURY N/B	9,400,000.00	10,094,718.28
	US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,841,695.20
	US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,662,718.48
	US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,705,523.34
	US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,700,585.90
	US TREASURY N/B	7,200,000.00	7,494,468.48
	US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,353,591.61
	US TREASURY N/B	800,000.00	813,781.20
	US TREASURY N/B	4,400,000.00	3,856,187.28
	US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,694,290.90
	US TREASURY N/B	700,000.00	694,285.13
	US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,626,374.88
	US TREASURY N/B	3,400,000.00	2,978,585.64
	US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,760,413.97
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,278,117.16
	US TREASURY N/B	400,000.00	411,546.84
	US TREASURY N/B	6,600,000.00	5,917,054.44
	US TREASURY N/B	11,600,000.00	11,780,796.44
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,726,263.64
	US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,310,816.39
	US TREASURY N/B	9,800,000.00	9,273,250.00
	US TREASURY N/B	5,700,000.00	5,335,734.09
	US TREASURY N/B	11,100,000.00	11,098,048.62
	US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,634,937.50

US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,509,226.36
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,342,500.00
US TREASURY N/B	100,000.00	99,507.81
US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,968,093.60
US TREASURY N/B	800,000.00	800,593.68
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,435,087.46
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,944,042.50
US TREASURY N/B	7,400,000.00	7,505,796.32
US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,437,349.30
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,328,345.66
US TREASURY N/B	300,000.00	303,421.86
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,475,781.25
US TREASURY N/B	800,000.00	736,187.44
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,978,281.20
US TREASURY N/B	6,100,000.00	6,166,122.78
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,991,992.00
US TREASURY N/B	900,000.00	917,964.81
US TREASURY N/B	100,000.00	64,503.90
US TREASURY N/B	1,000,000.00	837,773.40
US TREASURY N/B	600,000.00	425,343.72
US TREASURY N/B	800,000.00	667,187.44
US TREASURY N/B	3,100,000.00	2,317,007.58
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,183,165.92
US TREASURY N/B	1,100,000.00	929,757.73
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,174,980.45
US TREASURY N/B	1,000,000.00	856,562.50
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,026,578.06
US TREASURY N/B	900,000.00	834,503.85
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,051,562.50
US TREASURY N/B	700,000.00	637,328.09
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,271,949.14
US TREASURY N/B	5,100,000.00	4,464,890.37
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,063,562.50
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,353,710.50
US TREASURY N/B	1,000,000.00	979,335.90

	US TREASURY N/B	2,200,000.00	1,843,273.30
	US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,192,453.08
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,206,152.25
	US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,767,222.49
	US TREASURY N/B	2,730,000.00	2,145,395.88
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,983,125.00
	US TREASURY N/B	2,500,000.00	1,800,195.25
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,013,710.80
	US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,109,902.31
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,067,663.94
	US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,576,835.85
	US TREASURY N/B	1,100,000.00	854,175.74
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,384,140.52
	US TREASURY N/B	6,450,000.00	4,569,043.90
	US TREASURY N/B	800,000.00	612,343.68
	US TREASURY N/B	1,420,000.00	1,083,914.82
	US TREASURY N/B	330,000.00	239,894.52
	US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,009,515.56
	US TREASURY N/B	100,000.00	75,367.18
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	804,648.40
	US TREASURY N/B	100,000.00	75,007.81
	US TREASURY N/B	300,000.00	147,035.13
	US TREASURY N/B	1,200,000.00	855,609.36
	US TREASURY N/B	2,300,000.00	1,680,796.76
	US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,147,529.24
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,648,789.00
	US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,471,074.20
	US TREASURY N/B	3,100,000.00	2,793,148.36
	US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,896,808.57
	US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,220,000.00
	US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,112,308.20
	US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,312,000.00
	US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,180,625.00
	US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,388,281.25
	US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,799,234.20

小計	US TREASURY N/B	5,900,000.00	5,902,304.54
	US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,529,968.48
	銘柄数 : 174	536,220,000.00	520,887,820.89 (82,013,787,399)
	組入時価比率 : 45.1%		45.5%
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	790,687.20
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	702,404.01
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	399,678.52
	CANADIAN GOVERNMENT	900,000.00	912,932.91
	CANADIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,762,564.76
	CANADIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,496,770.24
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,083,225.66
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	614,136.48
	CANADIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,291,998.99
	CANADIAN GOVERNMENT	1,650,000.00	1,544,477.71
	CANADIAN GOVERNMENT	3,100,000.00	2,880,452.11
	CANADIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,656,945.54
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	939,749.00
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	674,255.33
	CANADIAN GOVERNMENT	2,370,000.00	2,766,201.43
	CANADIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,406,427.54
	CANADIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,672,935.66
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	399,747.08
	CANADIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,091,981.36
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	198,529.06
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	114,610.12
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	525,160.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,430,000.00	1,394,879.20
	CANADIAN GOVERNMENT	1,580,000.00	1,342,360.73
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	566,001.60
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	390,671.22
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	896,607.58
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	94,693.37
小計	銘柄数 : 28	34,330,000.00	33,611,084.41 (3,873,677,478)

	組入時価比率：2.1%		2.1%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,300,000.00	14,356,426.37	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	23,000,000.00	23,472,650.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,200,000.00	8,369,663.74	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,800,000.00	31,398,607.24	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	14,675,895.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,000,000.00	6,610,338.70	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	29,500,000.00	27,832,412.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,000,000.00	3,789,485.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,300,000.00	3,560,039.01	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,500,000.00	29,058,768.25	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,400,000.00	12,495,011.04	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,700,000.00	6,755,298.55	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,500,000.00	6,528,037.50	
	小計	銘柄数：13 組入時価比率：0.9%	195,200,000.00	188,902,632.80 (1,682,820,214) 0.9%
	ユーロ	BELGIUM KINGDOM	2,500,000.00	2,384,000.00
BELGIUM KINGDOM		300,000.00	269,773.56	
BELGIUM KINGDOM		250,000.00	223,122.12	
BELGIUM KINGDOM		1,500,000.00	1,505,100.00	
BELGIUM KINGDOM		1,000,000.00	995,600.00	
BELGIUM KINGDOM		1,500,000.00	1,470,150.00	
BELGIUM KINGDOM		100,000.00	81,680.00	
BELGIUM KINGDOM		800,000.00	671,920.00	
BELGIUM KINGDOM		400,000.00	255,600.00	
BELGIUM KINGDOM		1,300,000.00	1,380,080.00	
BELGIUM KINGDOM		300,000.00	286,740.00	
BELGIUM KINGDOM		700,000.00	682,101.28	
BELGIUM KINGDOM		200,000.00	131,120.00	
BELGIUM KINGDOM		1,600,000.00	1,011,680.00	
BELGIUM KINGDOM		600,000.00	331,020.00	
BELGIUM KINGDOM		100,000.00	85,420.00	
BELGIUM KINGDOM		300,000.00	264,360.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT		2,200,000.00	2,341,020.00	

	BELGIUM KINGDOM GOVT	850,000.00	968,212.64
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,100,000.00	1,100,532.40
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000.00	1,173,177.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,600,000.00	2,781,225.20
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000.00	1,164,180.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,300,000.00	3,403,961.55
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,600,000.00	2,457,046.02
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	840,546.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,500,000.00	2,512,512.50
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,250,000.00	1,149,533.12
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,800,000.00	1,831,356.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,404,647.44
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,300,000.00	2,327,663.25
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	724,654.70
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,058,198.50
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	307,028.85
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,700,000.00	1,760,149.74
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	457,562.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	384,008.08
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,670,000.00	1,976,670.45
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	693,433.60
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	650,000.00	535,071.87
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	108,110.80
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	661,980.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,394,976.80
	BUNDES OBLIGATION	100,000.00	99,945.19
	BUNDES OBLIGATION	3,200,000.00	3,180,455.68
	BUNDES OBLIGATION	100,000.00	99,411.54
	BUNDES OBLIGATION	1,300,000.00	1,306,219.20
	BUNDES OBLIGATION	900,000.00	900,100.08
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	5,807,670.00
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	954,421.83
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,056,482.00
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	660,226.84
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,016,725.60

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,600,000.00	1,585,565.12
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,254,782.65
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	912,237.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,100,000.00	1,889,382.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	997,734.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,932,533.48
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	177,552.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	172,455.44
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	694,964.13
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	979,568.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,687,636.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	963,848.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,151,371.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	989,431.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	800,000.00	782,720.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	77,505.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	393,047.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,300,000.00	1,718,054.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,650,000.00	2,916,113.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,500,000.00	2,780,375.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,240,692.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	593,411.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	770,000.00	686,518.14
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,900,000.00	2,543,285.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	199,919.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,350,000.00	2,387,282.36
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	714,195.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,800,000.00	2,332,510.32
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	5,400,000.00	5,402,216.70
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,522,350.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	904,410.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	319,980.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	703,780.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	917,370.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	501,950.00

	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,900,000.00	4,067,700.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	202,200.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,250,160.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,600,000.00	4,653,820.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	5,207,000.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,037,000.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	403,280.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	841,360.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,900,000.00	2,982,650.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,500,000.00	2,562,500.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,915,580.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,513,350.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,509,600.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,800,000.00	5,570,400.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,396,500.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	646,680.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,502,620.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,062,200.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,036,400.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,569,120.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	516,450.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	101,410.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,008,500.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	330,680.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	960,000.00	851,616.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	498,768.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,286,680.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,203,792.61	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	92,421.12	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	720,000.00	812,160.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,600,000.00	1,654,720.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	112,740.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,576,650.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,528,800.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,293,100.00	

	BUONI POLIENNALI DEL TES	770,000.00	679,063.00
	BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	240,630.00
	BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	808,713.63
	BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	475,802.55
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,441,720.00
	BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	314,550.00
	FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	297,519.18
	FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	292,268.73
	FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	668,825.50
	FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	405,338.00
	FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	746,927.84
	FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	173,882.60
	FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	369,065.00
	FINNISH GOVERNMENT	600,000.00	604,099.20
	FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	99,898.30
	FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	198,267.44
	FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	515,864.30
	FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	266,796.36
	FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	121,342.24
	FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	159,800.00
	FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	425,604.50
	FRANCE (GOVT OF)	1,900,000.00	1,834,830.00
	FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	300,600.00
	FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	478,200.00
	FRANCE (GOVT OF)	6,300,000.00	6,351,660.00
	FRANCE (GOVT OF)	3,000,000.00	2,817,300.00
	FRANCE (GOVT OF)	400,000.00	364,080.00
	FRANCE (GOVT OF)	8,100,000.00	8,144,550.00
	FRANCE (GOVT OF)	3,100,000.00	3,067,450.00
	FRANCE (GOVT OF)	1,700,000.00	1,695,750.00
	FRANCE (GOVT OF)	5,700,000.00	5,670,930.00
	FRANCE (GOVT OF)	7,800,000.00	7,984,080.00
	FRANCE (GOVT OF)	3,200,000.00	2,735,723.84
	FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	491,550.00
	FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,482,900.00

	FRANCE (GOVT OF)	1, 100, 000. 00	1, 102, 939. 75	
	FRANCE (GOVT OF)	100, 000. 00	80, 588. 90	
	FRANCE (GOVT OF)	1, 300, 000. 00	833, 560. 00	
	FRANCE (GOVT OF)	100, 000. 00	54, 970. 00	
	FRANCE (GOVT OF)	1, 800, 000. 00	1, 814, 940. 00	
	FRANCE (GOVT OF)	1, 300, 000. 00	899, 600. 00	
	FRANCE (GOVT OF)	900, 000. 00	533, 430. 00	
	FRANCE (GOVT OF)	3, 400, 000. 00	2, 678, 819. 20	
	FRANCE (GOVT OF)	700, 000. 00	576, 800. 00	
	FRANCE (GOVT OF)	200, 000. 00	181, 880. 00	
	FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2, 000, 000. 00	2, 183, 400. 00	
	FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1, 800, 000. 00	1, 684, 471. 86	
	FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5, 300, 000. 00	5, 863, 775. 31	
	FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1, 000, 000. 00	1, 031, 200. 00	
	FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2, 300, 000. 00	2, 490, 900. 00	
	FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3, 000, 000. 00	2, 686, 076. 10	
	FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2, 500, 000. 00	2, 380, 000. 00	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	200, 000. 00	195, 508. 50	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	400, 000. 00	389, 565. 40	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	100, 000. 00	90, 357. 30	
	IRISH GOVERNMENT	440, 000. 00	427, 416. 52	
	IRISH GOVERNMENT	700, 000. 00	599, 550. 00	
	IRISH TSY 0. 4% 2035	300, 000. 00	237, 527. 25	
	IRISH TSY 1. 10% 2029	1, 000, 000. 00	961, 179. 80	
	IRISH TSY 1. 3% 2033	200, 000. 00	180, 875. 00	
	IRISH TSY 1. 5% 2050	650, 000. 00	433, 732. 97	
	IRISH TSY 1. 7% 2037	230, 000. 00	198, 558. 08	
	IRISH TSY 2. 4% 2030	500, 000. 00	498, 047. 75	
	IRISH TSY 2% 2045	400, 000. 00	318, 482. 00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	100, 000. 00	98, 200. 00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1, 550, 000. 00	1, 641, 140. 00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	800, 000. 00	772, 412. 00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	800, 000. 00	751, 200. 00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	800, 000. 00	745, 450. 00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500, 000. 00	499, 450. 00	

	NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	539,015.22
	NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	296,186.61
	NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	788,800.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,300,000.00	1,267,503.25
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,100,000.00	1,198,247.05
	NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	278,480.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	209,665.50
	NETHERLANDS GOVERNMENT	950,000.00	1,003,859.01
	NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	297,300.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	750,000.00	676,440.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	206,573.25
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,100,000.00	805,310.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	301,200.00
	OBRIGACOES DO TESOURO	700,000.00	715,190.00
	OBRIGACOES DO TESOURO	500,000.00	498,750.00
	OBRIGACOES DO TESOURO	200,000.00	197,860.00
	OBRIGACOES DO TESOURO	1,000,000.00	1,055,400.00
	OBRIGACOES DO TESOURO	600,000.00	563,040.00
	OBRIGACOES DO TESOURO	300,000.00	286,140.00
	OBRIGACOES DO TESOURO	500,000.00	499,000.00
	OBRIGACOES DO TESOURO	800,000.00	793,489.20
	OBRIGACOES DO TESOURO	600,000.00	646,126.80
	OBRIGACOES DO TESOURO	100,000.00	105,223.37
	OBRIGACOES DO TESOURO	700,000.00	666,821.12
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	35,080.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	143,351.55
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	194,280.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,100,000.00	1,041,610.68
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	710,570.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	800,480.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,400,000.00	1,268,820.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	207,580.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	263,850.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	600,000.00	540,120.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	802,480.00

	REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	897,660.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,030,000.00	989,315.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	369,050.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	434,930.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	98,230.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	121,304.44	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,200,000.00	1,131,937.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	350,000.00	240,548.70	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,100,000.00	569,690.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	134,610.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	50,000.00	50,255.00	
	SPANISH GOVERNMENT	1,150,000.00	1,344,065.60	
	SPANISH GOVERNMENT	5,100,000.00	5,487,268.50	
小計	銘柄数 : 241	298,470,000.00	291,068,235.20 (53,207,273,394)	
	組入時価比率 : 29.2%		29.5%	
英債券	UK TREASURY	500,000.00	456,123.05	
	UK TREASURY	2,000,000.00	1,679,192.60	
	UK TREASURY	4,800,000.00	4,521,195.84	
	UK TREASURY	1,800,000.00	1,415,811.78	
	UK TREASURY	800,000.00	780,237.60	
	UK TREASURY	1,430,000.00	1,301,646.48	
	UK TREASURY	400,000.00	399,240.00	
	UK TREASURY	100,000.00	65,065.86	
	UK TREASURY	1,000,000.00	942,834.80	
	UK TREASURY	420,000.00	390,761.74	
	UK TREASURY	1,400,000.00	1,317,652.14	
	UK TREASURY	400,000.00	321,680.00	
	UK TREASURY	920,000.00	814,140.29	
	UK TREASURY	640,000.00	336,958.27	
	UK TREASURY	500,000.00	270,300.00	
	UK TREASURY	1,510,000.00	1,316,267.00	
	UK TREASURY	2,000,000.00	883,200.00	
	UK TREASURY	1,000,000.00	789,848.60	
	UK TREASURY	600,000.00	274,560.00	

	UK TREASURY	1,500,000.00	1,172,259.75
	UK TREASURY	200,000.00	93,180.00
	UK TREASURY	500,000.00	403,900.00
	UK TREASURY	500,000.00	399,850.00
	UK TREASURY	200,000.00	110,324.52
	UK TSY 0 5/8% 2050	600,000.00	221,100.00
	UK TSY 3 1/4% 2044	700,000.00	548,380.00
	UNITED KINGDOM GILT	5,100,000.00	5,119,891.02
	UNITED KINGDOM GILT	2,200,000.00	2,217,542.36
	UNITED KINGDOM GILT	600,000.00	609,995.16
	UNITED KINGDOM GILT	4,400,000.00	4,384,724.52
	UNITED KINGDOM GILT	500,000.00	496,629.65
	UNITED KINGDOM GILT	2,600,000.00	2,647,998.86
	UNITED KINGDOM GILT	700,000.00	692,841.94
	UNITED KINGDOM GILT	500,000.00	501,175.00
	UNITED KINGDOM GILT	700,000.00	711,588.01
	UNITED KINGDOM GILT	3,900,000.00	3,703,440.00
	UNITED KINGDOM GILT	3,000,000.00	2,881,800.00
	UNITED KINGDOM GILT	1,400,000.00	1,219,846.46
	UNITED KINGDOM GILT	500,000.00	510,350.00
	UNITED KINGDOM (GOVERNMEN	1,150,000.00	980,030.00
小計	銘柄数 : 40	53,670,000.00	47,903,563.30 (10,079,867,789)
	組入時価比率 : 5.5%		5.6%
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	2,800,000.00	2,726,426.64
	SWEDISH GOVERNMENT	2,200,000.00	2,092,467.30
	SWEDISH GOVERNMENT	2,000,000.00	1,789,555.00
	SWEDISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,486,380.00
	SWEDISH GOVERNMENT	4,200,000.00	3,975,719.58
	SWEDISH GOVERNMENT	5,000,000.00	4,842,575.00
	SWEDISH GOVERNMENT	2,100,000.00	2,249,341.50
小計	銘柄数 : 7	19,800,000.00	19,162,465.02 (327,294,902)
	組入時価比率 : 0.2%		0.2%
ノルウェークロー	NORWEGIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,874,329.10

ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,355,877.18
	NORWEGIAN GOVERNMENT	700,000.00	622,505.59
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,717,027.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	3,882,695.04
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	3,634,000.00
	小計	銘柄数 : 6 組入時価比率 : 0.2%	19,700,000.00
デンマーククローネ	DENMARK GOVT BOND	2,000,000.00	1,924,892.00
	KINGDOM OF DENMARK	1,100,000.00	1,074,713.20
	KINGDOM OF DENMARK	3,000,000.00	2,821,613.40
	KINGDOM OF DENMARK	1,600,000.00	1,400,384.80
	KINGDOM OF DENMARK	2,100,000.00	2,056,245.45
	KINGDOM OF DENMARK	4,500,000.00	5,319,650.25
	KINGDOM OF DENMARK	1,000,000.00	484,463.10
	小計	銘柄数 : 7 組入時価比率 : 0.2%	15,300,000.00
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	900,000.00	889,434.63
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,426,184.30
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,405,214.50
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,030,724.60
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	4,744,574.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,058,598.70
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	862,982.20
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	1,986,743.80
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	2,518,813.50
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	2,955,524.40
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	1,953,821.80
	小計	銘柄数 : 11 組入時価比率 : 0.7%	30,400,000.00
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,508,175.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,462,080.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	100,000.00	95,995.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	290,397.00

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	850,000.00	803,292.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	550,000.00	510,543.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,100,000.00	2,673,099.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,230,821.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,071,525.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,179,580.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,070,000.00	1,063,462.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,323,646.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	748,888.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	193,896.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	820,773.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,274,400.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,052,546.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	532,455.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	600,000.00	431,292.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	101,832.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,017,434.00	
小計	銘柄数 : 21	25,270,000.00	22,386,131.80	
			(2,476,130,038)	
	組入時価比率 : 1.4%		1.4%	
ニュージーランドドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	400,000.00	375,408.56	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1,200,000.00	1,183,644.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	250,000.00	257,682.85	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	900,000.00	799,411.50	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1,500,000.00	1,438,806.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	250,000.00	252,658.87	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	400,000.00	267,983.48	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	600,000.00	590,211.60	
小計	銘柄数 : 8	5,500,000.00	5,165,808.06	
			(480,626,781)	
	組入時価比率 : 0.3%		0.3%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	360,450.18	
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	409,108.88	
	SINGAPORE GOVERNMENT	600,000.00	616,079.94	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,253,999.88	

	SINGAPORE GOVERNMENT	3,200,000.00	3,196,799.68
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,100,000.00	3,267,183.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	800,000.00	886,399.92
	SINGAPORE GOVERNMENT	800,000.00	890,799.92
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	205,341.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	600,000.00	620,700.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	204,553.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	442,780.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	287,400.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	950,000.10
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	246,146.00
小計	銘柄数 : 15	13,300,000.00	13,837,741.50
			(1,703,149,223)
	組入時価比率 : 0.9%		0.9%
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	13,000,000.00	13,042,572.40
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,014,339.50
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,006,920.90
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,001,520.80
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,106,909.60
	CHINA GOVERNMENT BOND	23,000,000.00	23,114,546.90
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,003,897.00
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,121,951.20
	CHINA GOVERNMENT BOND	19,000,000.00	19,043,895.70
	CHINA GOVERNMENT BOND	57,000,000.00	57,029,292.30
	CHINA GOVERNMENT BOND	18,200,000.00	18,680,314.38
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,066,120.00
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,900,000.00	5,040,151.27
	CHINA GOVERNMENT BOND	45,000,000.00	45,156,514.50
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,000,000.00	11,281,363.50
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,000,000.00	11,018,604.30
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,388,958.40
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,320,396.00
	CHINA GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	33,038,788.20
	CHINA GOVERNMENT BOND	22,000,000.00	22,640,611.40
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,314,246.80

	CHINA GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	14,291,823.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	16,000,000.00	16,726,305.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,000,000.00	13,213,474.30	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,129,963.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,057,375.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,261,391.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	70,000,000.00	69,925,289.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,500,000.00	6,863,554.75	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,738,292.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,047,716.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,738,078.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	38,000,000.00	38,182,818.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,002,373.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	22,000,000.00	22,816,545.40	
	CHINA GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	14,410,219.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	16,000,000.00	16,256,550.40	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,230,055.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,000,000.00	16,908,477.10	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,271,296.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	18,000,000.00	18,208,816.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,382,831.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,025,698.90	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,151,067.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,006,335.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,300,054.92	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,349,869.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,599,865.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,000,000.00	8,572,089.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	23,000,000.00	24,114,577.70	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,426,642.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,451,296.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	24,000,000.00	24,574,070.40	
	CHINA GOVERNMENT BOND	30,000,000.00	29,633,811.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	30,000,000.00	29,802,063.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,000,000.00	8,033,047.20	

		CHINA GOVERNMENT BOND	42,000,000.00	41,978,466.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,536,154.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,478,778.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND	12,600,000.00	15,117,206.58	
		CHINA GOVERNMENT BOND	9,900,000.00	11,496,183.93	
		CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	7,066,621.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND	23,000,000.00	26,331,094.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	12,917,966.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,043,587.20	
	小計	銘柄数：65	935,300,000.00	957,101,709.93 (21,807,179,620)	
		組入時価比率：12.0%		12.1%	
	新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	1,400,000.00	1,379,377.86	
		ISRAEL FIXED BOND	2,500,000.00	2,510,174.75	
		ISRAEL FIXED BOND	1,200,000.00	1,164,506.28	
		ISRAEL FIXED BOND	1,500,000.00	1,511,971.20	
		ISRAEL FIXED BOND	1,000,000.00	907,284.90	
		ISRAEL FIXED BOND	1,000,000.00	1,020,939.70	
		ISRAEL FIXED BOND	1,700,000.00	1,750,955.80	
		ISRAEL FIXED BOND	2,000,000.00	1,578,986.20	
		ISRAEL FIXED BOND	400,000.00	471,410.40	
		ISRAEL FIXED BOND	1,000,000.00	947,968.50	
		ISRAEL FIXED BOND	2,200,000.00	1,685,058.32	
	小計	銘柄数：11	15,900,000.00	14,928,633.91 (761,427,508)	
		組入時価比率：0.4%		0.4%	
	合計			180,354,384,174 (180,354,384,174)	

(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。

(3) 貸付有価証券の明細(2026年3月7日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	850,000	
		US TREASURY N/B	1,445,000	
		US TREASURY N/B	380,000	
		US TREASURY N/B	70,000	

	US TREASURY N/B	109,000
	US TREASURY N/B	7,000
	US TREASURY N/B	6,000
	US TREASURY N/B	3,000
	US TREASURY N/B	1,558,000
	US TREASURY N/B	212,000
	US TREASURY N/B	180,000
	US TREASURY N/B	12,000
	US TREASURY N/B	8,000
	US TREASURY N/B	5,000
	US TREASURY N/B	233,000
	US TREASURY N/B	586,000
	US TREASURY N/B	94,000
	US TREASURY N/B	81,000
	US TREASURY N/B	26,000
	US TREASURY N/B	340,000
	US TREASURY N/B	1,000,000
	US TREASURY N/B	4,845,000
	US TREASURY N/B	2,000,000
	US TREASURY N/B	1,966,000
	US TREASURY N/B	159,000
	US TREASURY N/B	2,125,000
	US TREASURY N/B	4,505,000
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,635,000
英ポンド	UK TREASURY	1,275,000
	UNITED KINGDOM GILT	595,000
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,275,000
ユーロ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,785,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	160,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	419,500
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	680,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	340,000
	FRANCE (GOVT OF)	425,000

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。