

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	無期限	
運用方針	PRU海外債券マザーファンド受益証券への投資を通じて日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本）の動きに追随する投資成果を目標として運用を行います。	
主要投資対象	PRU海外債券マーケット・パフォーマー	PRU海外債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、海外の公社債等に直接投資することがあります。
	PRU海外債券マザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	PRU海外債券マーケット・パフォーマー	株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。また、外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	PRU海外債券マザーファンド	株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。また、外貨建資産への投資には制限を設けません。
分配方針	年1回の毎決算時（12月10日。ただし、休業日の場合は翌営業日）に、経費控除後の利子・配当収入および売買益等の全額を分配対象額の範囲とし、委託会社が基準価額の水準等を勘案して収益分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないこともあります。	

## 運用報告書（全体版）

第20期（2020年12月10日決算）

# PRU

## 海外債券マーケット・パフォーマー

---

---

### 追加型投信／海外／債券

#### 受益者のみなさまへ

平素は格別のお引き立てを賜り、ありがたく厚く御礼申し上げます。

さて、「PRU海外債券マーケット・パフォーマー」は、12月10日に第20期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

## PGIMジャパン株式会社

〒100-0014東京都千代田区永田町2-13-10ブルデンシャルタワー  
<https://www.pgimjp.com/>

#### <お問い合わせ先>

ぶる PRUホットライン 03-6832-7111(受付時間：営業日の9：00～17：00)  
土日・祝休日、12月31日～1月3日は休業

**\* 最近5期の運用実績 \***

決算期	基準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本)		債組 比	券入 率	純資 産額
	(分配落)	税込 分 配 金	期 騰 落 率	期 騰 落 率	期 騰 落 率			
	円	円	%		%	%		百万円
16期 (2016年12月12日)	19,552	0	△7.5	22,120.57	△6.7	98.1		5,957
17期 (2017年12月11日)	20,749	0	6.1	23,620.38	6.8	98.6		4,863
18期 (2018年12月10日)	19,943	0	△3.9	22,878.62	△3.1	98.4		4,582
19期 (2019年12月10日)	20,464	0	2.6	23,660.94	3.4	96.9		4,496
20期 (2020年12月10日)	21,599	0	5.5	25,170.10	6.4	98.9		4,486

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

**\* 当期中の基準価額と市況推移 \***

年 月 日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本)		債 券 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率	
(期 首)	円	%		%	%
2019年12月10日	20,464	—	23,660.94	—	96.9
12月末	20,718	1.2	23,961.10	1.3	97.0
2020年1月末	20,878	2.0	24,159.07	2.1	98.0
2月末	21,113	3.2	24,434.61	3.3	98.1
3月末	21,143	3.3	24,443.83	3.3	98.5
4月末	20,716	1.2	24,020.15	1.5	98.1
5月末	21,009	2.7	24,382.81	3.1	98.9
6月末	21,333	4.2	24,786.53	4.8	97.9
7月末	21,539	5.3	25,028.21	5.8	98.4
8月末	21,499	5.1	24,999.08	5.7	98.6
9月末	21,591	5.5	25,122.44	6.2	99.0
10月末	21,254	3.9	24,746.77	4.6	98.9
11月末	21,459	4.9	24,994.98	5.6	98.7
(期 末)					
2020年12月10日	21,599	5.5	25,170.10	6.4	98.9

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

※FTSE世界国債インデックス (除く日本) は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

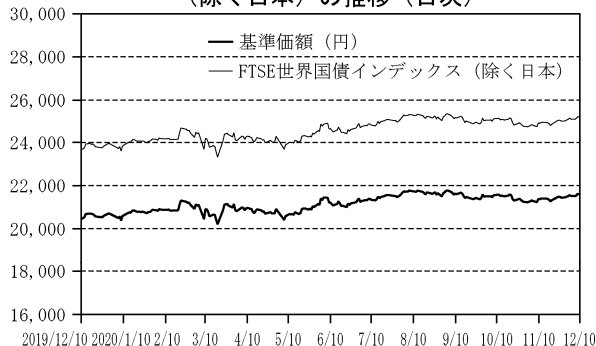
※外債資産のリスク・リターンは、FTSE世界国債インデックス・データに基づき当社が計算したものです。

《第20期の運用経過》（2019.12.11～2020.12.10）

## I 運用経過と基準価額の推移

<PRU海外債券マーケット・パフォーマンスの運用経過と基準価額の推移>

基準価額とFTSE世界国債インデックス  
（除く日本）の推移（日次）



期首	期中高値	期中安値	期末
2019/12/10	2020/09/04	2020/03/19	2020/12/10
20,464円	21,780円	20,215円	21,599円

※FTSE世界国債インデックス（除く日本）は設定日（2001年3月8日）を10,000として指数化しています。

当ファンドは、PRU海外債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本）の動きに追随する投資成果を目標として運用を行っております。当期の運用につきましては、期中を通じて同受益証券の組入れを高位に維持することで、海外債券の実質組入比率を高位に維持しました。なお、当ファンドでは、債券に対する直接投資は行いませんでした。

このような運用の結果、当ファンドの基準価額は、概ねFTSE世界国債インデックス（除く日本）に追随する動きとなりました。

<基準価額の主な変動要因>

上昇要因

米国と欧州で共に国債利回りが期中低下（価格は上昇）したことが、基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

米ドルが主要国通貨に対して値下がりしたことが、基準価額の下落要因となりました。

<PRU海外債券マザーファンドの運用経過>

当マザーファンドは、FTSE世界国債インデックス（除く日本）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行っています。当期につきましても、ポートフォリオの満期構成・デュレーションなどの特性値や通貨構成をFTSE世界国債インデックス（除く日本）に近づけるよう、適宜リバランス（組入銘柄と組入比率の見直し）を行いました。

この結果、当ファンドの基準価額は、FTSE世界国債インデックス（除く日本）に追随する動きとなりました。

## II 投資環境

FTSE世界国債インデックス  
(除く日本、現地通貨ベース)の推移



スク資産市場が実体経済に先駆けて回復する中でも金融緩和と姿勢の長期化期待から各国の長期金利は低位での推移を続けていますが、景気回復に遅れが見られる欧州の長期国債利回りが低下基調を続ける一方、米国の長期債利回りは当初予想を上回る景気回復ペースに国債供給増懸念も加わり、夏場以降上昇基調に転じています。

期末時点の主要国10年国債利回りは、米国0.94%（前期末比-0.88%）、ドイツ-0.61%（前期末比-0.30%）、英国0.26%（前期末比-0.50%）、となっています。

### <海外債券市場>

当期の海外債券市場における主要国の国債利回りは、3月に大幅低下した後も低位での推移が続く中、夏場以降は米国債利回りが緩やかながら上昇基調に転じています。

当初は堅調な景気指標を背景に米欧の長期金利は上昇基調でしたが、年明け以降は新型コロナウイルスの感染拡大に伴うグローバル景気の減速懸念から米欧の長期債利回りは大幅低下に転じました。各国中央銀行が積極的な金融緩和措置を打ち出す中、特に3月にかけては米連邦準備制度理事会（FRB）による二度にわたる計1.5%の緊急利下げを受けた米国債利回りの低下が顕著となりました。各国当局の財政、金融両面にわたる迅速な対応が奏功し、4月以降リ

円相場（仲値）の推移



が7月に復興基金の創設に関する合意に達したことも好感され、ユーロを始めとする欧州通貨は騰勢を維持しています。ユーロは1ユーロ=126円16銭（前期末比6円08銭の円安ユーロ高）で期末を迎えています。

### <為替相場>

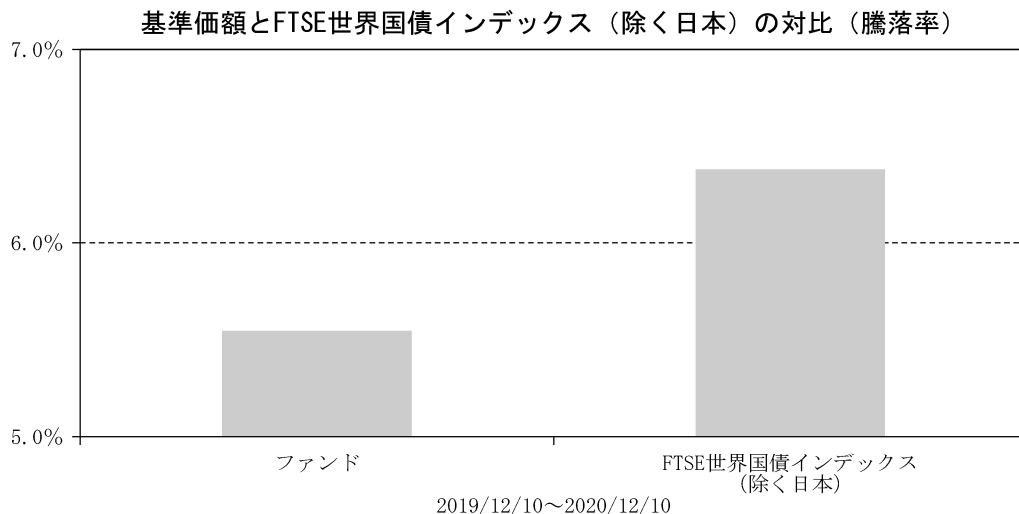
当期の為替市場では、米ドルが対円で下落する一方、ユーロを中心とする欧州通貨は対円で上昇しました。

年初は景況感格差を背景に米ドルが主要国通貨に対して強含む局面も見られましたが、その後新型コロナウイルスの感染拡大を受けた米連邦準備制度理事会（FRB）による大幅利下げを契機として、米ドルは軟化に転じています。大幅利下げにより金利較差面での底支えを失った米ドルは、財政収支、貿易収支両面で双子の赤字拡大懸念も加わり、その他主要国通貨に対して4月以降は軟化基調を続けています。米ドルは1ドル=104円16銭（前期末比4円44銭の円高ドル安）で期末を迎えています。一方で欧州連合

### III 当該投資信託のベンチマークとの差異

ベンチマークの騰落率は6.4%となりました。一方、当ファンドの騰落率は5.5%となりました。信託報酬等のコストが乖離の要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



### IV 分配金

当期につきましては、収益分配を見送らせていただきました。なお、収益分配に充てなかった利益につきましては信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

#### 分配原資の内訳

(単位：円・%、1万口当たり・税引前)

項目	第20期
	2019年12月11日 ～2020年12月10日
当期分配金	—
（対基準価額比率）	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	14,539

(注1) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

## V 今後の運用方針

### <PRU海外債券マーケット・パフォーマンスの運用方針>

今後の運用におきましても、FTSE世界国債インデックス（除く日本）の動きに追随する投資成果を目指して、PRU海外債券マザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持する運用を行ってまいります。

受益者の皆様におかれましては、当ファンドの仕組み等について十分にご理解をいただき、引き続きご愛顧賜りますよう、お願い申し上げます。

### <PRU海外債券マザーファンドの運用方針>

今後の運用におきましても、FTSE世界国債インデックス（除く日本）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ってまいります。来期につきましても、ポートフォリオの満期構成・デュレーションなどの特性値や通貨構成をFTSE世界国債インデックス（除く日本）に近づけるよう、適宜リバランス（組入銘柄と組入比率の見直し）を行う予定です。

\* 1万口当たりの費用明細 \*

項目	当期		項目の概要
	2019/12/11～2020/12/10		
	金額	比率	
信託報酬	151円	0.715%	信託報酬＝〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は21,187円です。
（投信会社）	（75）	（0.352）	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	（61）	（0.286）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	（16）	（0.077）	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
その他費用	28	0.132	その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕}$
（保管費用）	（17）	（0.079）	その他費用 ・保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 ・監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ・その他には、投資信託財産に関する信託事務の処理に要する諸費用等として、法定書類等の作成、印刷及び交付にかかわる費用等が含まれます。
（監査費用）	（1）	（0.005）	
（その他）	（10）	（0.047）	
合計	179	0.847	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

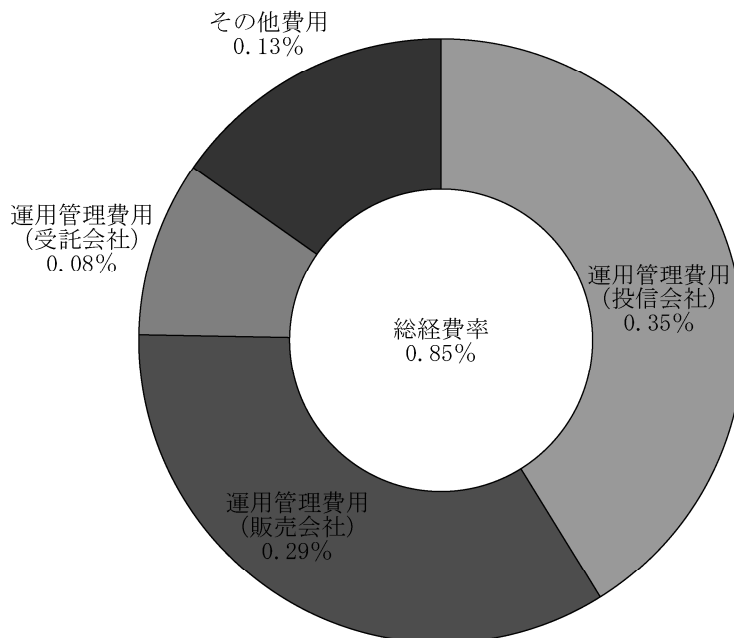
(注2) 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

■総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.85%です。



(注1) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注2) 各比率は、年率換算した値です。

(注3) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。



**\* 売買及び取引の状況 \*** (2019年12月11日から2020年12月10日まで)

**親投資信託受益証券の設定、解約状況**

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
PRU海外債券マザーファンド	千口 81,441	千円 196,496	千口 200,583	千円 483,579

(注) 単位未満は切り捨て。

**\* 利害関係人との取引状況等 \*** (2019年12月11日から2020年12月10日まで)

当期における利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

**\* 組入資産の明細 \***

**親投資信託残高**

(2020年12月10日現在)

種 類	期 首 (前期末)		
	口 数	口 数	評 価 額
PRU海外債券マザーファンド	千口 1,933,281	千口 1,814,139	千円 4,486,729

(注1) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末におけるPRU海外債券マザーファンド全体の口数は、2,045,882千口です。

**\* 投資信託財産の構成 \***

(2020年12月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
PRU海外債券マザーファンド	千円 4,486,729	% 99.5
コール・ローン等、その他	22,925	0.5
投資信託財産総額	4,509,654	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨て。

(注2) PRU海外債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(5,072,281千円)の投資信託財産総額(5,108,558千円)に対する比率は99.3%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1アメリカドル=104.28円、1カナダドル=81.35円、1メキシコペソ=5.25円、1ユーロ=125.97円、1イギリスポンド=139.47円、1スイスフラン=117.26円、1スウェーデンクローネ=12.28円、1ノルウェークローネ=11.81円、1デンマーククローネ=16.92円、1ポーランドズロチ=28.44円、1オーストラリアドル=77.62円、1シンガポールドル=78.01円、1マレーシアドル=25.65円、1イスラエルシェケル=32.05円です。

**\* 資産、負債、元本および基準価額の状況 \***

(2020年12月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,509,654,860円
PRU海外債券マザーファンド(評価額)	4,486,729,670
未 収 入 金	22,925,190
(B) 負 債	22,925,190
未 払 解 約 金	5,692,912
未 払 信 託 報 酬	16,047,791
そ の 他 未 払 費 用	1,184,487
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	4,486,729,670
元 本	2,077,241,218
次 期 繰 越 損 益 金	2,409,488,452
(D) 受 益 権 総 口 数	2,077,241,218口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,599円

(注) 当期	
期首元本額	2,197,187,597円
期中追加設定元本額	92,911,771円
期中一部解約元本額	212,858,150円
計算口数当たり純資産額	2,1599円

**\* 損益の状況 \***

当期(自2019年12月11日 至2020年12月10日)

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	263,722,375円
売 買 益	280,729,919
売 買 損	△ 17,007,544
(B) 信 託 報 酬 等	△ 34,496,134
(C) 当 期 損 益 金 (A+B)	229,226,241
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	795,429,402
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,384,832,809
(配 当 等 相 当 額)	( 1,513,827,864)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 128,995,055)
(F) 計 (C+D+E)	2,409,488,452
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F+G)	2,409,488,452
追 加 信 託 差 損 益 金	1,384,832,809
(配 当 等 相 当 額)	( 1,514,256,416)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 129,423,607)
分 配 準 備 積 立 金	1,505,869,086
繰 越 損 益 金	△ 481,213,443

- (注1) 損益の状況の中で(A)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
- (注2) 損益の状況の中で(B)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
- (注3) 損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
- (注4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(100,859,643円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,514,256,416円)および分配準備積立金(1,405,009,443円)より分配対象収益は3,020,125,502円(10,000口当たり14,539円)ですが、当期に分配した金額はありません。

**■ 分配金のお知らせ**

1万口当たり分配金(税引前)	当 期
	一円

※本運用報告書作成時点においては、当作成期間に係る当ファンドの監査は終了しておりません。

## 〈PRU海外債券マザーファンド〉

## 運用状況について

「PRU海外債券マザーファンド」は、「PRU海外債券マーケット・パフォーマー」が投資対象とする親投資信託で、投資信託財産の実質的な運用を行っております。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第20期の運用状況をご報告いたします。

## \* 最近5期の運用実績 \*

決 算 期	基 準 価 額		FTSE世界国債インデックス (除 く 日 本)		債 券 組 入 率 比	純 資 産 額 総
	円	騰落率 %	円	騰落率 %		
16期 (2016年12月 5 日)	21,541	△8.0	21,916.40	△7.9	98.4	6,565
17期 (2017年12月 5 日)	23,069	7.1	23,457.64	7.0	98.7	5,498
18期 (2018年12月 5 日)	22,457	△2.7	22,836.93	△2.6	98.7	5,234
19期 (2019年12月 5 日)	23,358	4.0	23,765.39	4.1	97.4	5,106
20期 (2020年12月 7 日)	24,630	5.4	25,065.84	5.5	98.6	5,080

## \* 当期中の基準価額と市況推移 \*

年 月 日	基 準 価 額		FTSE世界国債インデックス (除 く 日 本)		債 券 組 入 率 比
	円	騰落率 %	円	騰落率 %	
(期 首) 2019年12月 5 日	23,358	—	23,765.39	—	97.4
12月末	23,556	0.8	23,961.10	0.8	97.0
2020年 1 月末	23,753	1.7	24,159.07	1.7	97.8
2 月末	24,034	2.9	24,434.61	2.8	97.9
3 月末	24,084	3.1	24,443.83	2.9	98.3
4 月末	23,614	1.1	24,020.15	1.1	97.8
5 月末	23,961	2.6	24,382.81	2.6	98.6
6 月末	24,345	4.2	24,786.53	4.3	97.9
7 月末	24,596	5.3	25,028.21	5.3	98.3
8 月末	24,566	5.2	24,999.08	5.2	98.5
9 月末	24,687	5.7	25,122.44	5.7	98.8
10 月末	24,317	4.1	24,746.77	4.1	98.6
11 月末	24,567	5.2	24,994.98	5.2	98.3
(期 末) 2020年12月 7 日	24,630	5.4	25,065.84	5.5	98.6

(注) 騰落率は期首比です。

※FTSE世界国債インデックス (除く日本) は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

※外債資産のリスク・リターンは、FTSE世界国債インデックス・データに基づき当社が計算したものです。

## \* 1万口当たりの費用明細 \*

項目	当期		項目の概要
	2019/12/6~2020/12/7		
	金額	比率	
その他費用 (保管費用)	19円 (19)	0.079% (0.079)	<p>期中の平均基準価額は24,173円です。</p> <p>その他費用 = <math>\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}}</math></p> <p>その他費用 ・ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用</p>
合計	19	0.079	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## \* 売買及び取引の状況 \* (2019年12月6日から2020年12月7日まで)

## (1) 公社債

		種 類	買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千アメリカドル 2,063	千アメリカドル 4,750
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 155	千カナダドル 84 (225)
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシカンペソ 537	千メキシカンペソ 1,525
	ユ ー ロ		千ユーロ	千ユーロ
	ド イ ツ	国 債 証 券	1,181	481
	イ タ リ ア	国 債 証 券	400	132
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	690	641
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	113	78
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	332	164 (70)
	ベルギー	国 債 証 券	129	278
国	オーストリア	国 債 証 券	117	72
	フィンランド	国 債 証 券	84	—
	アイルランド	国 債 証 券	64	— (135)
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 927	千イギリスポンド 827
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 118	千スウェーデンクローナ 430
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 422	千ノルウェークローネ —

		種 類	買 付 額	売 付 額
外	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 366	千デンマーククローネ -
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 352	千ポーランドズロチ -
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 547	千オーストラリアドル 210
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 41	千シンガポールドル -
国	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 941	千マレーシアリンギット -
	イスラエル	国債証券	千シェケイ 768	千シェケイ -
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド -	千南アフリカランド 5,163

(注1) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) ( ) 内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## (2) スワップ及び先渡取引状況

種 類	当 期
	取 引 契 約 金 額
直 物 為 替 先 渡 取 引	百万円 155

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

## \* 主要な売買銘柄 \* (2019年12月6日から2020年12月7日まで) 公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA(ユーロ・ドイツ)	45,668	US TREASURY N/B(アメリカ)	248,073
UNITED KINGDOM TREASURY(イギリス)	41,248	UNITED KINGDOM TREASURY(イギリス)	87,718
ITALY BUONI POLIENNALI D(ユーロ・イタリア)	38,159	US TREASURY N/B(アメリカ)	65,767
UNITED KINGDOM GILT(イギリス)	34,027	US TREASURY N/B(アメリカ)	41,739
SPAIN GOVERNMENT BOND(ユーロ・スペイン)	32,897	FRANCE GOVERNMENT BOND 0(ユーロ・フランス)	40,532
UNITED KINGDOM GILT(イギリス)	32,783	US TREASURY N/B(アメリカ)	27,726
FRENCH REPUBLIC GOVERNME(ユーロ・フランス)	31,731	US TREASURY N/B(アメリカ)	24,186
US TREASURY N/B(アメリカ)	30,861	US TREASURY N/B(アメリカ)	20,128
US TREASURY N/B(アメリカ)	28,573	BELGIUM GOVERNMENT BOND(ユーロ・ベルギー)	18,143
FRENCH REPUBLIC GOVERNME(ユーロ・フランス)	27,570	US TREASURY N/B(アメリカ)	17,930

(注1) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 現先取引によるものは含まれておりません。

(注3) 金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

## \* 利害関係人との取引状況等 \* (2019年12月6日から2020年12月7日まで)

当期における利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## \* 組入資産の明細 \*

## 債券種類別開示

## 外国（外貨建）公社債

（2020年12月7日現在）

区 分	作 成 期	当 期			末				
		額面金額	評 価 額		組 入 率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
			外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千アメリカドル 18,025	千アメリカドル 20,294	千円 2,112,302	% 41.6	% —	% 19.2	% 12.9	% 9.5	
カ ナ ダ	千カナダドル 575	千カナダドル 822	66,973	1.3	—	1.3	0.0	0.0	
メ キ シ コ	千メキシカンペソ 5,910	千メキシカンペソ 6,751	35,514	0.7	—	0.6	—	0.1	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ							
ド イ ツ	2,284	2,960	373,763	7.4	—	4.2	2.5	0.7	
イ タ リ ア	3,245	4,068	513,601	10.1	—	6.6	1.7	1.9	
フ ラ ン ス	3,270	4,287	541,276	10.7	—	7.9	2.5	0.2	
オ ラ ン ダ	615	766	96,751	1.9	—	1.6	0.3	—	
ス ペ イ ン	1,730	2,359	297,849	5.9	—	3.9	1.8	0.1	
ベ ル ギ ー	755	947	119,659	2.4	—	1.9	0.1	0.3	
オ ー ス ト リ ア	395	537	67,921	1.3	—	1.3	0.0	—	
フ ィ ン ラ ン ド	350	376	47,544	0.9	—	0.7	—	0.2	
ア イ ル ラ ン ド	315	368	46,536	0.9	—	0.6	0.3	—	
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 1,645	千イギリスポンド 2,246	313,955	6.2	—	5.8	0.1	0.3	
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ 935	千スウェーデンクローナ 1,130	13,922	0.3	—	0.1	0.2	—	
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 1,205	千ノルウェークローネ 1,275	15,093	0.3	—	0.1	0.2	—	
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 1,645	千デンマーククローネ 2,058	34,911	0.7	—	0.2	0.5	—	
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 1,655	千ポーランドズロチ 1,784	50,423	1.0	—	—	0.6	0.4	
オ ー ス ト ラ リ ア	千オーストラリアドル 1,735	千オーストラリアドル 2,047	158,335	3.1	—	2.2	0.9	—	
シ ン ガ ポ ー ル	千シンガポールドル 255	千シンガポールドル 292	22,852	0.4	—	0.3	0.2	—	
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 2,140	千マレーシアリンギット 2,218	56,533	1.1	—	0.1	1.0	—	
イ ス ラ エ ル	千シエケイ 650	千シエケイ 765	24,388	0.5	—	0.2	0.3	—	
南 ア フ リ カ	千南アフリカランド —	千南アフリカランド —	—	—	—	—	—	—	
合 計	—	—	5,010,107	98.6	—	58.8	26.2	13.6	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) —印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

個別銘柄開示  
外国（外貨建）公社債

(2020年12月7日現在)

種 類	銘 柄 名	利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	末	
					評 価 額	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ) 国債証券		%		千アメリカドル	千アメリカドル	千円
	US TREASURY N/B	3.125	2021/5/15	575	582	60,643
	US TREASURY N/B	2.0	2021/10/31	375	381	39,691
	US TREASURY N/B	2.0	2021/11/15	1,130	1,150	119,696
	US TREASURY N/B	1.75	2022/3/31	890	908	94,592
	US TREASURY N/B	1.625	2022/8/15	610	625	65,068
	US TREASURY N/B	1.75	2022/9/30	325	334	34,806
	US TREASURY N/B	1.875	2022/10/31	335	345	35,999
	US TREASURY N/B	2.0	2022/11/30	285	295	30,745
	US TREASURY N/B	1.75	2023/1/31	110	113	11,841
	US TREASURY N/B	2.875	2023/10/31	400	430	44,834
	US TREASURY N/B	2.5	2024/5/15	1,335	1,437	149,595
	US TREASURY N/B	2.25	2024/11/15	2,260	2,431	253,101
	US TREASURY N/B	2.625	2025/3/31	290	318	33,120
	US TREASURY N/B	2.125	2025/5/15	915	985	102,584
	US TREASURY N/B	2.0	2025/8/15	165	177	18,455
	US TREASURY N/B	2.25	2025/11/15	350	381	39,683
	US TREASURY N/B	1.625	2026/2/15	195	206	21,518
	US TREASURY N/B	1.625	2026/5/15	155	164	17,117
	US TREASURY N/B	6.75	2026/8/15	145	195	20,373
	US TREASURY N/B	1.75	2026/12/31	250	267	27,846
	US TREASURY N/B	1.5	2027/1/31	190	200	20,865
	US TREASURY N/B	2.25	2027/2/15	90	99	10,315
	US TREASURY N/B	6.375	2027/8/15	640	880	91,671
	US TREASURY N/B	0.375	2027/9/30	275	269	28,031
	US TREASURY N/B	2.875	2028/8/15	390	451	46,979
	US TREASURY N/B	5.25	2028/11/15	520	699	72,835
	US TREASURY N/B	5.25	2029/2/15	210	284	29,597
	US TREASURY N/B	2.625	2029/2/15	310	354	36,875
	US TREASURY N/B	0.625	2030/5/15	170	165	17,195
	US TREASURY N/B	0.625	2030/8/15	295	285	29,758
	US TREASURY N/B	4.375	2040/5/15	140	210	21,931
	US TREASURY N/B	4.25	2040/11/15	10	14	1,549
	US TREASURY N/B	1.375	2040/11/15	195	190	19,781
	US TREASURY N/B	4.75	2041/2/15	325	514	53,544
	US TREASURY N/B	3.125	2043/2/15	200	259	26,959
	US TREASURY N/B	2.875	2043/5/15	275	342	35,690
	US TREASURY N/B	3.625	2043/8/15	90	125	13,059
	US TREASURY N/B	3.375	2044/5/15	360	485	50,531
	US TREASURY N/B	2.5	2045/2/15	410	481	50,067

作成期 種類	当 銘柄名	期 利率	期 償還年月日	期 額面金額	末	
					評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ) 国債証券	US TREASURY N/B US TREASURY N/B US TREASURY N/B US TREASURY N/B US TREASURY N/B US TREASURY N/B US TREASURY N/B	% 3.0 2.875 2.5 2.875 2.75 2.0 1.25	2045/5/15 2045/8/15 2046/5/15 2046/11/15 2047/11/15 2050/2/15 2050/5/15	千アメリカドル 540 270 115 625 30 190 65	千アメリカドル 689 338 135 785 37 202 57	千円 71,775 35,199 14,067 81,772 3,854 21,069 6,007
小計						2,112,302
(カナダ) 国債証券	CANADIAN GOVERNMENT CANADIAN GOVERNMENT BOND CANADIAN GOVERNMENT BOND CANADIAN GOVERNMENT BOND CANADIAN GOVERNMENT BOND CANADIAN GOVERNMENT BOND	5.75 2.75 0.5 0.25 4.0 3.5	2033/6/1 2022/6/1 2025/9/1 2026/3/1 2041/6/1 2045/12/1	千カナダドル 275 10 25 85 160 20	千カナダドル 430 10 25 83 242 29	35,102 844 2,039 6,827 19,748 2,410
小計						66,973
(メキシコ) 国債証券	MEXICAN BONOS MEXICAN BONOS MEXICAN BONOS MEXICAN BONOS	6.5 7.5 10.0 7.75	2021/6/10 2027/6/3 2036/11/20 2042/11/13	千メキシカンペソ 1,080 2,500 1,000 1,330	千メキシカンペソ 1,090 2,811 1,366 1,483	5,734 14,788 7,187 7,805
小計						35,514
(ユーロ)				千ユーロ	千ユーロ	
(ドイツ) 国債証券	BUNDESOBLIGATION BUNDESREPUB DEUTSCHLAND BUNDESREPUB DEUTSCHLAND BUNDESREPUB DEUTSCHLAND BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA	— 6.25 5.5 4.75 1.75 1.0 4.75 — 3.25 2.5 —	2022/4/8 2024/1/4 2031/1/4 2034/7/4 2024/2/15 2025/8/15 2028/7/4 2030/8/15 2042/7/4 2046/8/15 2050/8/15	260 170 174 40 270 465 260 190 345 60 50	262 207 283 69 292 504 370 200 616 102 51	33,148 26,177 35,841 8,740 36,877 63,659 46,758 25,286 77,786 12,944 6,542
(イタリア) 国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES ITALY BUONI POLIENNALI D ITALY BUONI POLIENNALI D ITALY BUONI POLIENNALI D ITALY BUONI POLIENNALI D ITALY BUONI POLIENNALI D ITALY BUONI POLIENNALI D	5.0 3.75 5.0 2.0 4.5 1.6 7.25	2039/8/1 2021/3/1 2022/3/1 2025/12/1 2026/3/1 2026/6/1 2026/11/1	430 385 335 45 330 95 75	706 388 357 49 406 102 106	89,238 49,092 45,151 6,248 51,342 12,998 13,428



作成期 種類	当 銘柄名	期 利率	期 償還年月日	期 額面金額	末	
					評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ)		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
(イタリア) 国債証券	ITALY BUONI POLIENNALI D	2.05	2027/8/1	80	89	11,302
	ITALY BUONI POLIENNALI D	6.5	2027/11/1	315	448	56,622
	ITALY BUONI POLIENNALI D	0.95	2030/8/1	330	342	43,243
	ITALY BUONI POLIENNALI D	5.0	2034/8/1	10	15	1,927
	ITALY BUONI POLIENNALI D	3.1	2040/3/1	30	39	5,006
	ITALY BUONI POLIENNALI D	4.75	2044/9/1	85	143	18,124
	ITALY BUONI POLIENNALI D	2.7	2047/3/1	5	6	808
	ITALY BUONI POLIENNALI D	3.45	2048/3/1	140	203	25,691
	ITALY BUONI POLIENNALI D	2.8	2067/3/1	20	26	3,327
	REPUBLIC OF ITALY GOVERN	5.125	2024/7/31	535	634	80,045
(フランス) 国債証券	FRANCE GOVERNMENT BOND O	—	2021/5/25	70	70	8,864
	FRANCE GOVERNMENT BOND O	0.5	2025/5/25	55	57	7,311
	FRANCE GOVERNMENT BOND O	3.5	2026/4/25	335	410	51,859
	FRANCE GOVERNMENT BOND O	0.5	2026/5/25	260	276	34,851
	FRANCE GOVERNMENT BOND O	4.0	2038/10/25	215	368	46,585
	FRANCE GOVERNMENT BOND O	1.75	2066/5/25	160	243	30,795
	FRANCE O. A. T.	8.5	2023/4/25	715	873	110,263
	FRANCE O. A. T.	5.75	2032/10/25	390	672	84,955
	FRENCH REPUBLIC GOVERNME	—	2025/3/25	85	87	11,039
	FRENCH REPUBLIC GOVERNME	0.25	2026/11/25	50	52	6,630
	FRENCH REPUBLIC GOVERNME	1.0	2027/5/25	95	104	13,219
	FRENCH REPUBLIC GOVERNME	2.75	2027/10/25	265	326	41,196
	FRENCH REPUBLIC GOVERNME	0.75	2028/5/25	55	60	7,599
	FRENCH REPUBLIC GOVERNME	2.5	2030/5/25	45	57	7,248
	FRENCH REPUBLIC GOVERNME	—	2030/11/25	70	72	9,112
	FRENCH REPUBLIC GOVERNME	1.5	2031/5/25	30	35	4,509
	FRENCH REPUBLIC GOVERNME	1.25	2034/5/25	210	249	31,466
	FRENCH REPUBLIC GOVERNME	3.25	2045/5/25	105	180	22,789
FRENCH REPUBLIC GOVERNME	2.0	2048/5/25	60	86	10,975	
(オランダ) 国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT B	7.5	2023/1/15	115	135	17,066
	NETHERLANDS GOVERNMENT B	0.5	2026/7/15	260	277	35,008
	NETHERLANDS GOVERNMENT B	0.75	2028/7/15	10	11	1,393
	NETHERLANDS GOVERNMENT B	—	2030/7/15	100	104	13,201
	NETHERLANDS GOVERNMENT B	3.75	2042/1/15	90	167	21,121
	NETHERLANDS GOVERNMENT B	2.75	2047/1/15	40	70	8,960
(スペイン) 国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0	2029/1/31	15	22	2,837
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.75	2032/7/30	285	468	59,108
	SPAIN GOVERNMENT BOND	0.05	2021/1/31	45	45	5,686
	SPAIN GOVERNMENT BOND	3.8	2024/4/30	230	264	33,343
	SPAIN GOVERNMENT BOND	2.75	2024/10/31	25	28	3,558
	SPAIN GOVERNMENT BOND	4.65	2025/7/30	360	446	56,323

作成期 種類	当 銘柄名	期 利率	期 償還年月日	額面金額	末	
					評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ)		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
(スペイン) 国債証券	SPAIN GOVERNMENT BOND	5.9	2026/7/30	110	149	18,840
	SPAIN GOVERNMENT BOND	5.15	2028/10/31	110	155	19,694
	SPAIN GOVERNMENT BOND	1.95	2030/7/30	50	59	7,473
	SPAIN GOVERNMENT BOND	1.25	2030/10/31	225	250	31,677
	SPAIN GOVERNMENT BOND	2.35	2033/7/30	35	44	5,561
	SPAIN GOVERNMENT BOND	4.7	2041/7/30	120	214	27,026
	SPAIN GOVERNMENT BOND	5.15	2044/10/31	30	58	7,438
	SPAIN GOVERNMENT BOND	2.9	2046/10/31	30	44	5,641
	SPAIN GOVERNMENT BOND	3.45	2066/7/30	60	108	13,637
(ベルギー) 国債証券	BELGIUM GOVERNMENT BOND	4.0	2022/3/28	115	122	15,418
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	0.8	2025/6/22	45	48	6,065
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	1.0	2026/6/22	240	261	33,052
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	4.25	2041/3/28	115	208	26,350
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	2.15	2066/6/22	65	109	13,824
	KINGDOM OF BELGIUM GOVER KINGDOM OF BELGIUM GOVER	0.8 1.0	2028/6/22 2031/6/22	40 135	43 153	5,554 19,391
(オーストリア) 国債証券	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	1.75	2023/10/20	10	10	1,352
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	4.15	2037/3/15	95	162	20,487
	REPUBLIC OF AUSTRIA GOVE	0.75	2026/10/20	65	70	8,877
	REPUBLIC OF AUSTRIA GOVE	0.5	2027/4/20	110	117	14,877
	REPUBLIC OF AUSTRIA GOVE	2.4	2034/5/23	40	54	6,862
	REPUBLIC OF AUSTRIA GOVE	3.15	2044/6/20	30	52	6,626
	REPUBLIC OF AUSTRIA GOVE REPUBLIC OF AUSTRIA GOVE	1.5 2.1	2047/2/20 2117/9/20	35 10	48 21	6,065 2,771
(フィンランド) 国債証券	FINLAND GOVERNMENT BOND	3.5	2021/4/15	90	91	11,531
	FINLAND GOVERNMENT BOND	0.5	2026/4/15	195	207	26,169
	FINLAND GOVERNMENT BOND	—	2030/9/15	20	20	2,620
	FINLAND GOVERNMENT BOND	1.125	2034/4/15	35	41	5,220
	FINLAND GOVERNMENT BOND	2.625	2042/7/4	10	15	2,002
(アイルランド) 国債証券	IRELAND GOVERNMENT BOND	3.9	2023/3/20	50	55	6,980
	IRELAND GOVERNMENT BOND	5.4	2025/3/13	45	56	7,159
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.0	2026/5/15	25	27	3,427
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.9	2028/5/15	135	148	18,743
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.3	2033/5/15	5	5	745
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.7	2037/5/15	20	25	3,212
	IRELAND GOVERNMENT BOND	2.0	2045/2/18	35	49	6,266
小計						2,104,902
(イギリス) 国債証券				千イギリスポンド	千イギリスポンド	
	UNITED KINGDOM GILT	1.5	2021/1/22	110	110	15,403
	UNITED KINGDOM GILT	0.75	2023/7/22	35	35	4,992
	UNITED KINGDOM GILT	0.125	2026/1/30	235	235	32,913

作成期 種類	当 銘柄名	期 利率	償還年月日	額面金額	末	
					評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(イギリス) 国債証券		%		千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円
	UNITED KINGDOM GILT	1.5	2026/7/22	10	10	1,511
	UNITED KINGDOM GILT	1.75	2037/9/7	30	34	4,846
	UNITED KINGDOM GILT	4.25	2039/9/7	15	24	3,364
	UNITED KINGDOM GILT	4.25	2040/12/7	210	342	47,909
	UNITED KINGDOM GILT	4.5	2042/12/7	10	17	2,416
	UNITED KINGDOM GILT	3.25	2044/1/22	15	22	3,125
	UNITED KINGDOM GILT	3.5	2045/1/22	220	343	48,015
	UNITED KINGDOM GILT	4.25	2046/12/7	170	301	42,118
	UNITED KINGDOM GILT	1.5	2047/7/22	10	11	1,589
	UNITED KINGDOM GILT	1.75	2049/1/22	330	398	55,695
	UNITED KINGDOM GILT	3.5	2068/7/22	15	30	4,277
UNITED KINGDOM TREASURY	4.25	2032/6/7	230	327	45,776	
小計						313,955
(スウェーデン) 国債証券				千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ	
	SWEDEN GOVERNMENT BOND	2.5	2025/5/12	630	708	8,734
	SWEDEN GOVERNMENT BOND	0.75	2028/5/12	110	117	1,444
SWEDEN GOVERNMENT BOND	3.5	2039/3/30	195	303	3,742	
小計						13,922
(ノルウェー) 国債証券				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ	
	NORWAY GOVERNMENT BOND	2.0	2023/5/24	410	427	5,054
	NORWAY GOVERNMENT BOND	3.0	2024/3/14	415	450	5,328
NORWAY GOVERNMENT BOND	1.5	2026/2/19	380	398	4,710	
小計						15,093
(デンマーク) 国債証券				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	
	DENMARK GOVERNMENT BOND	1.5	2023/11/15	150	159	2,707
	DENMARK GOVERNMENT BOND	1.75	2025/11/15	1,210	1,353	22,953
DENMARK GOVERNMENT BOND	4.5	2039/11/15	285	545	9,251	
小計						34,911
(ポーランド) 国債証券				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	2021/7/25	660	667	18,865
	POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	2023/10/25	140	155	4,396
POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	2025/7/25	855	961	27,161	
小計						50,423
(オーストラリア) 国債証券				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	
	AUSTRALIA GOVERNMENT BON	5.5	2023/4/21	360	405	31,374
	AUSTRALIA GOVERNMENT BON	3.25	2025/4/21	175	197	15,294
	AUSTRALIA GOVERNMENT BON	4.25	2026/4/21	510	615	47,562
	AUSTRALIA GOVERNMENT BON	3.25	2029/4/21	395	473	36,608
	AUSTRALIA GOVERNMENT BON	2.75	2029/11/21	125	145	11,227
AUSTRALIA GOVERNMENT BON	3.75	2037/4/21	70	92	7,175	

作成期 種類	当 銘柄名	利 率	期 償還年月日	額 面金額	末 評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(オーストラリア) 国債証券	AUSTRALIA GOVERNMENT BON	%		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円
	AUSTRALIA GOVERNMENT BON	3.25	2039/6/21	35	43	3,391
	AUSTRALIA GOVERNMENT BON	3.0	2047/3/21	45	54	4,244
	AUSTRALIA GOVERNMENT BON	1.75	2051/6/21	20	18	1,454
小計						158,335
(シンガポール) 国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT BON	3.0	2024/9/1	千シンガポールドル	千シンガポールドル	
	SINGAPORE GOVERNMENT BON	2.875	2030/9/1	100	109	8,555
	SINGAPORE GOVERNMENT BON	2.25	2036/8/1	135	159	12,481
	SINGAPORE GOVERNMENT BON			20	23	1,814
小計						22,852
(マレーシア) 国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.48	2023/3/15	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	
	MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.844	2033/4/15	1,955	2,023	51,564
小計				185	195	4,969
						56,533
(イスラエル) 国債証券	ISRAEL GOVERNMENT BOND -	1.5	2023/11/30	千シェケイ	千シェケイ	
	ISRAEL GOVERNMENT BOND -	2.25	2028/9/28	425	441	14,056
	ISRAEL GOVERNMENT BOND -	5.5	2042/1/31	110	123	3,943
	ISRAEL GOVERNMENT BOND -			115	200	6,388
小計						24,388
合計						5,010,107

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

### スワップ及び先渡取引残高

種 類	取 引 契 約 残 高
	第20作成期末想定元本額
直 物 為 替 先 渡 取 引	百万円 30

## \* 投資信託財産の構成 \*

(2020年12月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 5,010,108	% 98.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	77,687	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	5,087,795	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産 (5,051,164千円) の投資信託財産総額 (5,087,795千円) に対する比率は99.3%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1アメリカドル=104.08円、1カナダドル=81.45円、1メキシコペソ=5.26円、1ユーロ=126.25円、1イギリスポンド=139.74円、1スイスフラン=116.79円、1スウェーデンクローネ=12.32円、1ノルウェークローネ=11.83円、1デンマーククローネ=16.96円、1ポーランドズロチ=28.26円、1オーストラリアドル=77.33円、1シンガポールドル=78.03円、1マレーシアドル=25.48円、1イスラエルシェケル=31.87円です。

## \* 特定資産の価格等の調査 \*

PRU海外債券マザーファンドにおいて行った取引のうち、投資信託及び投資法人に関する法律により価格等の調査が必要とされた資産の取引については、PwCあらた有限責任監査法人へその調査を委託しました。

対象期間中 (2019年12月6日から2020年12月7日) に該当した取引は、直物為替先渡取引8件あり、該当取引については当該監査法人からの調査報告書を受領しました。

なお、直物為替先渡取引については、取引相手方の名称、銘柄、数量、約定単価、その他直物為替先渡取引の内容に関することについて調査を委託しました。

## \* 資産、負債、元本および基準価額の状況 \*

(2020年12月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	5,654,395,952円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	35,485,019
公 社 債(評価額)	5,010,108,048
未 収 入 金	571,179,285
未 収 利 息	36,794,267
前 払 費 用	829,333
(B) 負 債	573,867,692
未 払 金	571,995,301
未 払 解 約 金	1,872,306
未 払 利 息	85
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	5,080,528,260
元 本	2,062,725,454
次 期 繰 越 損 益 金	3,017,802,806
(D) 受 益 権 総 口 数	2,062,725,454口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	24,630円

(注) 当期

期首元本額	2,186,006,926円
期中追加設定元本額	162,381,388円
期中一部解約元本額	285,662,860円
計算口数当たり純資産額	2,4630円
当マザーファンドを投資対象とする投資信託元本額の内訳	
PRU海外債券マーケット・パフォーマー	1,822,826,008円
PRUグッドライフ2020(年金)	8,199,107円
PRUグッドライフ2030(年金)	111,004,359円
PRUグッドライフ2040(年金)	57,992,792円
PRUグッドライフ2050(年金)	4,551,836円
ブルデンシャル私募海外債券マーケット・パフォーマー(適格機関投資家向け)	58,151,352円

## \* 損益の状況 \*

当期(自2019年12月6日 至2020年12月7日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	134,671,316円
受 取 利 息	134,775,430
そ の 他 収 益 金	8,079
支 払 利 息	△ 112,193
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	140,298,695
売 買 益	325,318,770
売 買 損	△ 185,020,075
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 1,568,421
取 引 益	588,354
取 引 損	△ 2,156,775
(D) 信 託 報 酬 等	△ 4,029,152
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	269,372,438
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	2,920,066,927
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	228,473,379
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 400,109,938
(I) 計 (E+F+G+H)	3,017,802,806
次 期 繰 越 損 益 金(I)	3,017,802,806

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。