

●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／内外／資産複合
信託期間	信託期間は2001年9月28日から2040年12月14日までとします。
運用方針	この投資信託は、投資信託財産の中・長期的な成長を図ることを目標として、ファミリーファンド方式で運用を行います。
主要投資対象	PRU国内株式マザーファンド受益証券、PRU国内債券マザーファンド受益証券、PRU海外株式マザーファンド受益証券および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、内外の株式・公社債等に直接投資することができます。
	PRU国内株式マザーファンド 金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
	PRU国内債券マザーファンド わが国の公社債を主要投資対象とします。
	PRU海外株式マザーファンド 原則として、MSCI KOKUSAIインデックスを構成している国の株式を主要投資対象とします。
	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グッドライフ2040(年金) 株式への投資割合には制限を設けません。また、外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。
	PRU国内株式マザーファンド 株式への投資には制限を設けません。また、外貨建資産への投資は行いません。
	PRU国内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は行いません。
	PRU海外株式マザーファンド 株式への投資には制限を設けません。また、外貨建資産への投資にも制限を設けません。
	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15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、必ず分配を行うものではありません。

運用報告書（全体版）

第20期（2020年12月15日決算）

PRU グッドライフ2040(年金) ゴールデン・ゲート（愛称）

追加型投信／内外／資産複合

受益者のみなさまへ

平素は格別のお引き立てを賜り、ありがとうございます。

さて、「PRUグッドライフ2040(年金)（愛称：ゴールデン・ゲート）」は、12月15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.pgim.jp.com/>

＜お問い合わせ先＞

ふる
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			参 考 指 数	株 式 入 率	株 式 物 率	債 組 比	券 入 率	投 資 信 託 証 券 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込み 分 配 金	期 中 謄 落 率		期 中 謄 落 率					
16期 (2016年12月15日)	円 17,270	円 0	% 3.0	18,292.66	% 3.8	% 49.1	% 1.6	% 45.0	% 0.5	百万円 1,886
17期 (2017年12月15日)	18,613	0	7.8	19,732.75	7.9	47.3	1.8	46.8	0.5	2,100
18期 (2018年12月17日)	17,934	0	△3.6	19,077.25	△3.3	42.3	1.6	52.0	0.5	2,134
19期 (2019年12月16日)	19,228	0	7.2	20,360.78	6.7	47.5	1.5	48.5	0.6	2,355
20期 (2020年12月15日)	19,871	0	3.3	20,990.88	3.1	49.9	2.0	45.8	0.6	2,459

(注 1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

(注 3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注 4) 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。

(注 5) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券比率」は実質比率を記載しております。

(注 6) 株式先物比率は買建比率－売建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		参 考 指 数	株 式 入 率	株 式 物 率	債 組 比	券 入 率	投 資 信 託 証 券 比 率
		騰 落 率						
(期 首) 2019年12月16日	円 19,228	% —	20,360.78	% —	% 47.5	% 1.5	% 48.5	% 0.6
12月末	19,268	0.2	20,390.18	0.1	47.6	1.5	48.4	0.6
2020年1月末	19,184	△0.2	20,332.92	△0.1	47.0	1.7	48.6	0.6
2月末	18,378	△4.4	19,588.44	△3.8	43.8	1.6	51.6	0.6
3月末	17,398	△9.5	18,678.76	△8.3	42.7	1.8	52.8	0.6
4月末	17,910	△6.9	19,194.32	△5.7	44.2	1.9	51.4	0.5
5月末	18,376	△4.4	19,648.92	△3.5	46.7	2.1	48.5	0.6
6月末	18,403	△4.3	19,692.33	△3.3	47.7	1.8	47.9	0.6
7月末	18,339	△4.6	19,631.33	△3.6	47.4	1.8	48.3	0.6
8月末	19,019	△1.1	20,236.45	△0.6	49.4	1.8	46.4	0.7
9月末	18,937	△1.5	20,174.86	△0.9	48.6	1.9	46.9	0.7
10月末	18,631	△3.1	19,908.82	△2.2	47.8	1.4	48.5	0.6
11月末	19,709	2.5	20,837.68	2.3	49.6	1.9	46.2	0.6
(期 末) 2020年12月15日	19,871	3.3	20,990.88	3.1	49.9	2.0	45.8	0.6

(注 1) 謄落率は期首比です。

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

(注 3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注 4) 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。

(注 5) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券比率」は実質比率を記載しております。

(注 6) 株式先物比率は買建比率－売建比率を記載しております。

※参考指数は、国内株式：東証株価指数（TOPIX）、国内債券：NOMURA-BPI（総合）、海外株式：MSCI KOKUSAIインデックス（円換算ベース）、海外債券：FTSE世界国債インデックス（除く日本）（円換算ベース）および無担保コール翌日物（短期金融商品）を基本ガイドラインの比率で独自に合成して計算した指数です。

《第20期の運用経過》 (2019.12.17～2020.12.15)

I 運用経過と基準価額の推移

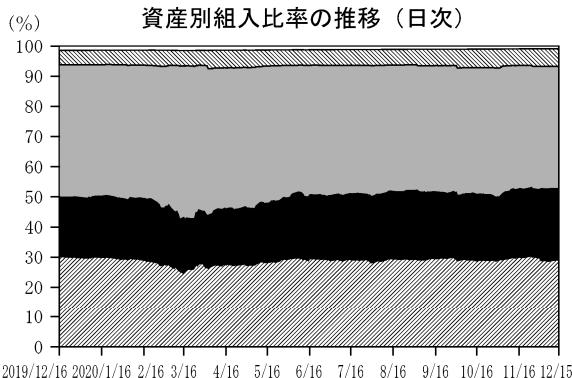
基準価額と参考指数の推移 (日次)



※参考指数は設定日（2001年9月28日）を10,000としています。

基準価額の推移

期 首	期 中 高 値	期 中 安 値	期 末
2019/12/16	2020/12/09	2020/03/17	2020/12/15
19,228円	19,908円	16,565円	19,871円



※MF : マザーファンド

<PRUグットライフ2040（年金）の運用経過と基準価額の推移>

当ファンドは、4種類のマザーファンドへの投資を通じて、わが国の株式・公社債等および海外の株式・公社債等に分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ投資信託財産の中・長期的な成長を目指して運用しています。

2020年始からコロナウイルスの感染拡大懸念が広がるなか、2月後半以降、欧米で感染が爆発的に広がり、欧米で都市のロックダウンが行われました。グローバルに経済活動が停止し、主要株式市場は急落しました。各国政府は大規模な財政政策を導入し経済を支え、各中央銀行もさまざまな緊急プログラムにより流動性を供給し、クレジット市場を支えました。徐々に経済活動が再開し、人々の生活が戻り始めるに、株式市場は景気回復期待から上昇に転じました。11月の米大統領選挙に向けて接戦が伝えられると不透明感から株式市場は下落に転じる場面もありました。しかし、コロナウイルスワクチンの開発期待や接種の普及への期待から、株式市場は年末にかけて堅調な推移となりました。特に米株式市場では、コロナウイルス感染拡大以前の株価を上回り、高値更新を続け、堅調地合いが継続しました。金融政策面では、米連邦準備理事会（FRB）はゼロ金利を導入し、また資産買入れプログラムを継続し、緩和的な金融政策を続けており、日本や欧州でも金融緩和政策が継続しています。今後も、雇用や物価安定に進展がみられるまで、日米欧ともに緩和的な金融政策を継続する姿勢を示しています。

このような状況下、当期の運用にあたっては、良好なファンダメンタルズを背景に株式市場は堅調に推移しており債券と比較して魅力的であるとの評価から、株式をガイドライン比オーバーウェイトとする戦略を基軸としました。

こうした運用の結果、基準価格は、19,289円でスタートし、2020年3月17日に当期中の安値となる16,565円となりました。その後、2020年12月9日に当期中の高値となる19,908円となり、期末時点では19,871円となりました。

当期の基本ガイドライン

	PRU国内株式 マザーファンド	PRU海外株式 マザーファンド	PRU国内債券 マザーファンド	短 期 金融商品	PRU海外債券 マザーファンド
期 首 か ら 2020/3/31まで	26.875%	16.125%	46.875%	3.000%	7.125%
2020/4/1から 2020/9/30まで	26.250%	15.750%	47.750%	3.000%	7.250%
2020/10/1から 期 末 ま で	25.625%	15.375%	48.625%	3.000%	7.375%

※基本ガイドラインは償還時期に向けて、実質的に組入れている株式の組入比率を漸減させ、公社債および短期金融商品の組入比率を増加させることにより、償還直前には実質的な組入れが短期金融商品100%となるように変化します。

＜基準価額の主な変動要因＞

当ファンドは、4種類のマザーファンドへの投資を通じて、日本の株式・公社債等および海外の株式・公社債等に分散投資しております。この結果、コロナウイルスの感染拡大により、世界的に経済活動が停止し、株式市場が急落したことが基準価額の下落要因となりました。一方で各国政府及び中央銀行の大規模な財政支出及び金融緩和、米国大統領及び議会選挙の結果が市場に好感されたこと、ワクチン開発への期待等に加え、消費者及び企業の行動変容から恩恵を受けると見られる企業の収益成長期待が高まったことで世界の主要株式が上昇したことが基準価額の上昇要因となりました。

＜PRU国内株式マザーファンドの運用経過＞

当マザーファンドは、東証株価指数（TOPIX）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、①多銘柄への分散投資、②90%台後半の高い実質組入比率（株式現物+株価指数先物）の継続、③適宜のリバランス（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、概ね東証株価指数（TOPIX）に連動する動きとなりました。

＜PRU国内債券マザーファンドの運用経過＞

当マザーファンドは、NOMURA-BPI（総合）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、ポートフォリオの償還年限や利回り、デュレーションなどの特性値をNOMURA-BPI（総合）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、概ねNOMURA-BPI（総合）に追随する動きとなりました。

＜PRU海外株式マザーファンドの運用経過＞

当マザーファンドは、MSCI KOKUSAIインデックス（円換算ベース）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、①多銘柄への分散投資、②90%台後半の高い実質組入比率（株式現物+株価指数先物）の継続、③適宜のリバランス（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、概ねMSCI KOKUSAIインデックス（円換算ベース）に追随する動きとなりました。

＜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



＜国内株式市場＞

国内株式市場は、売買代金が細る中、米下院によるトランプ米大統領の弾劾訴追決議案の可決が嫌気され下落基調で始まりました。新年明けの1月は、ニューヨーク・ダウが史上最高値を更新し円ドルレートも安定的に推移したため堅調な展開で始まりました。しかし、中国で新型コロナウイルスの発症が表面化すると感染拡大への警戒感から反落しました。2月は、コロナウイルスの感染拡大により下落して始まったものの、中国人民銀行による流動性の供給などが下支え要因となりボックス相場が続きました。しかし、月末にかけて、コロナウイルスの感染が中国やアジアだけでなく中東や欧州にも拡がり、

さらに米疾病対策センター（CDC）が米国初の市中感染の可能性を発表するなど、コロナウイルス感染拡大の影響が懸念され、米国はじめ世界的に株式市場が急落、日本株も連日下落しました。3月に入りても、世界的なコロナウイルスの感染拡大から、続落して始まりましたが、日銀が金融政策決定会合を前倒しで実施し、ETF購入枠の倍増を決定すると下値不安が徐々に和らぎ、反発に転じました。また、ECB（欧州中央銀行）による90兆円規模の資産買入策の発表や米議会での220兆円の経済対策の合意など各国で追加的な金融政策及び大規模な財政政策が発動されたことから、世界的に株式市場は上昇基調となりました。4月は、米連邦準備理事会（FRB）の追加的金融緩和や感染者増加数の低減もあり、ボックス圏で推移しました。5月に入り、先進国での経済活動が段階的に再開されたこと、欧州で景気下支えのための基金創設設計画が報道されたこと、政府が一般会計歳出などの真水で33兆円を用意して企業を支援すると発表したことなどから上昇しました。6月に入ると、米連邦公開市場委員会（FOMC）で米国景気の先行きに慎重な見方が示されたことやコロナウイルス感染「第2波」への警戒感が強まることから、下落基調に転じました。7月は、「香港国家安全維持法」の施行を契機とした米中対立の悪化や国内企業の4-6月期の決算発表に対する懸念から、下落基調が続きました。8月に入り、世界経済が徐々に正常化し景気が回復に向かうとの期待が高まつたこと、コロナウイルスのワクチン開発の進展が期待されたこと、企業決算発表において個別企業ごとの優勝劣敗が鮮明になったものの総じて市場が警戒するほどの減益にはならなかったことなどから反発に転じました。9月に入ると、菅氏が自民党総裁に選出されることが確実視され規制改革への期待などから堅調な展開となりましたが、米国で追加経済対策や大統領選挙に対する先行き不透明感が台頭したこと、欧州でコロナウイルスの感染が再拡大したことなどから上値も限定的なものとなりました。10月には、米追加経済対策について、早期成立は困難との見方が支配的になったことや、欧米でコロナウイルス感染者数が再度急速に拡大し、欧州諸国の一帯でロックダウン（都市封鎖）が実施されたため下落しました。11月に入ると、米大統領選でバイデン氏が優勢となる中、上院選では共和党が多数派となる可能性が報じられ、米大統領選に関わる不透明感が払拭されたことや、コロナウイルスに対する予防効果が有効と認められるワクチンの早期実用化が期待されたことから、上昇基調に転じ年初来高値を更新しました。12月に入りても、ワクチン普及に対する期待から、堅調な展開が続きました。結果、期末のTOPIXは、1,782.05ポイントで引けました。

NOMURA-BPI（総合）の推移



<国内債券市場>

2020年年始以降、新型コロナウイルスに関するヘッドラインが続くなかったが、3月には欧米で爆発的に感染が拡大しました。3月初からコロナウイルス感染拡大を受けてFEDが緊急利下げに動くなど海外各国が政策対応に動きました。リスク資産価格が下落する中、米国債金利は史上最低を記録し10年日本国債利回りも一時マイナス0.15%を下回りました。3月16日日本時間早朝にFEDが100bpの利下げと資産購入を公表し、日銀も同日に決定会合を前倒しで開催し追加の金融緩和措置を決定しました。月央にかけては資産の現金化やボラティリティ上昇を受けてのリスク削減、アロケーション変更、利益確定売り等からJGBは売り優勢となり、10年金利は一時1年3ヶ月

ぶりにプラス0.10%の水準まで上昇しました。4月に入り、緊急事態宣言下、証券会社や投資家等において通常とは異なるオペレーション体制が実施されていることもあります。国債市場の流動性が低下していく、狭い値幅での推移となりました。二次補正予算に関して国債増発が話題になりましたが、日銀の買入れによって相場は支えられるとの見方もあり、10年金利は0%近傍で推移しました。一方で、10年以下中心と見られていた2次補正予算を受けた国債の増発年限で、30年を含む超長期債も増発対象となったことから、超長期国債の需給は重めとなり、7月からの国債増発を控え、超長期セクターは緩やかに金利上昇し、カーブはステイプニングしていきました。7月から国債が増発されたものの、入札は順調に消化され金利は安定的に推移しました。超長期国債も事前に調整したこともあり、増発分は順調に消化され、カーブはフラットニングしました。国債増発懸念を材料とした4月からのステイプニングのトレンドは一服した形となりました。8月28日には安倍首相が体調不良を理由に辞意を表明し、一時株価が急落するなど市場の反応がありました。国債市場については比較的影響は限定的でした。菅内閣が発足した後も円債市場については影響は限定的で、長期金利は引き続き0%近傍での狭いレンジでの推移となりました。さらに、10月以降米国債が金利上昇するなかでも、海外市場の影響を受けず、投資家需要から長期金利は引き続き0%近傍で取引となりました。11月の米国の大統領選挙の投開票やコロナウイルスのワクチン開発の進展等から、グローバルに株式市場は堅調に推移し、米国債市場では金利上昇基調となるなか、円金利はイールドカーブコントロールのもと膠着感が強く比較的狭いレンジでの推移が継続し、長期金利は0%近傍での推移が継続しました。

MSCI KOKUSAIインデックス (現地通貨ベース) の推移



＜海外株式市場＞

当期のグローバル株式市場は、期初は米中の好調な経済指標を受け好調に推移したものの、新型コロナウイルス感染症拡大が深刻化するにつれ、2月下旬から歴史的に最も急激かつ大幅な下落を記録しました。しかし、3月下旬から各国政府・中央銀行による未曾有の景気対策から反発に転じ、その後も企業や消費者の行動変容から恩恵を受ける企業の収益成長期待や、米国の大統領及び議会選挙結果、ワクチン開発期待等を背景に概ね上昇基調を維持し期末を迎きました。

2019年12月に米国による対中追加関税が見送りとなり、米中の好調な経済指標と相まって1-3月期の半ばまではグローバル株式市場は好調に推移した

ものの、新型コロナウイルス感染症拡大の規模と深刻度が広く知れ渡るにつれ、グローバル資本市場の様相が一変しました。2月19日に史上最高値を記録した世界の株式市場は、多くの主要指標が高値から25営業日で30%以上下落するなど、歴史的に最も急激かつ大幅な下落を記録しました。セクター別では、エネルギー及び金融セクターが最大の下落幅となりました。

4-6月期のグローバル株式市場は、各国政府・中央銀行による未曾有の財政支出及び金融緩和を背景に、2月中旬から3月下旬までの急落と同程度の非常な勢いで急回復しました。新型コロナ禍及びコロナ後の環境における勝者及び敗者間の二極化が鮮明となり、恩恵を受けるテクノロジー、一般消費財の各セクターが大幅に上昇し、多くの企業の株価が最高値を更新する一方、苦境に直面すると見られる企業は厳しい業績回復見通しが予想される中、株価が低迷しました。

7-9月には、コロナ禍が日常化し、世界中の個人、企業、政府の行動変容が継続する中で、3月以降の上昇基調を概ね維持しました。株式市場は7月と8月は堅調に上昇し、各主要指標は年初の高値水準を回復しました。8月末まで株式市場をけん引していた成長企業は、将来の成長力へのバリュエーション評価が短期的には行き過ぎではとの懸念から、9月にはやや反落しました。4-6月期に続き一般消費財、テクノロジーの両セクターが大幅に上昇した一方、エネルギーセクターが大幅に下落した他、金融、不動産、公益等のセクターが出遅れました。

10-12月には、引続き米国の追加経済対策期待や中国経済の回復基調を好し上昇した後、欧州のコロナ感染再拡大や米経済対策合意が遠のいたことでもみ合いとなりましたが、米大統領及び議会選挙の結果を受け、「適温相場」が継続するとの見方から上昇し、その後も新型コロナのワクチン関連情報により景気敏感株が主導する形で上昇基調を維持しました。それまで大きく劣後していたエネルギーや金融セクター等が大きく反発した一方、生活必需品やヘルスケア等のディフェンシブなセクターが出遅れました。

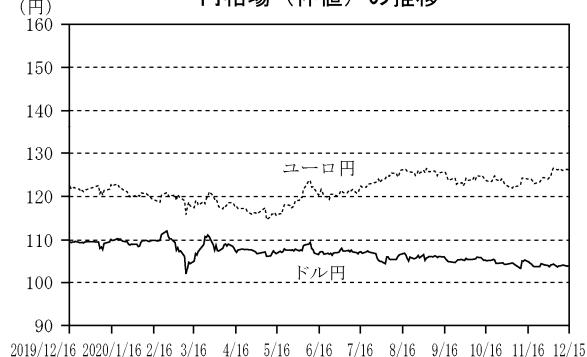
FTSE世界国債インデックス (除く日本、現地通貨ベース) の推移



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0.89%（前期末比-0.93%）、ドイツ-0.62%（前期末比-0.33%）、英国0.22%（前期末比-0.57%）、となっています。

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、ユーロを中心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09銭（前期末比3円71銭の円安ユーロ高）で期末を迎えています。

＜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月以降リラクゼーション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0.89%（前期末比-0.93%）、ドイツ-0.62%（前期末比-0.33%）、英国0.22%（前期末比-0.57%）、となっています。

＜為替市場＞

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04銭（前期末比5円52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

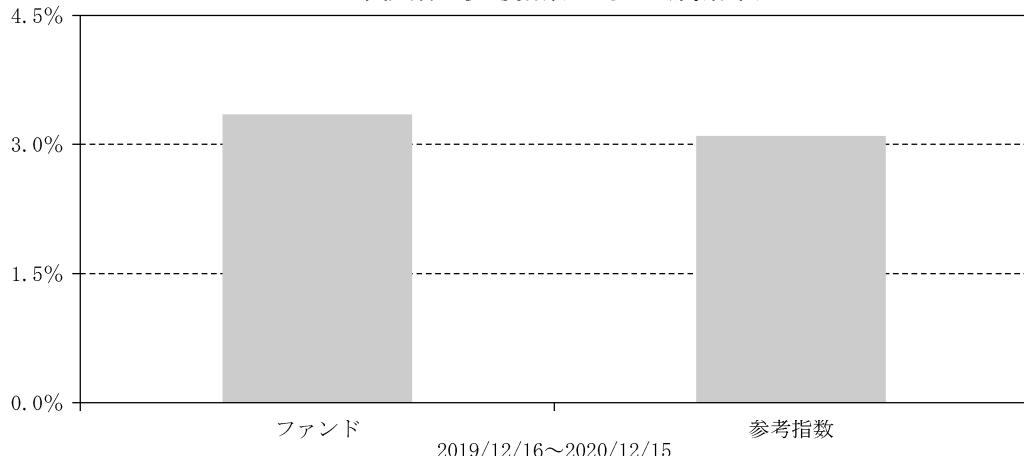
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

参考指数の騰落率は3.1%となりました。一方、当ファンドの騰落率は3.3%となりました。

マザーファンドで保有している国内株式の配当金について配当権利落ちによりファンドには未収配当金が計上されていること、信託報酬等のコストなど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参考指数の騰落率の対比です。

基準価額と参考指数の対比（騰落率）



IV 分配金

当期につきましては、収益分配を見送さ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17日 ～2020年12月15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	11,950

（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、ファンドの收益率とは異なります。

V 今後の運用方針

第21期の基本ガイドライン

	PRU国内株式 マザーファンド	PRU海外株式 マザーファンド	PRU国内債券 マザーファンド	短期 金融商品	PRU海外債券 マザーファンド
期 首 か ら 2021/3/31ま で	25.625%	15.375%	48.625%	3.000%	7.375%
2021/4/1か ら 2021/9/30ま で	25.000%	15.000%	49.500%	3.000%	7.500%
2021/10/1か ら 期 末 ま で	24.375%	14.625%	50.375%	3.000%	7.625%

※上記ガイドラインは第20期決算日現在の予定です。

<PRUグッドライフ2040（年金）の運用方針>

様々なマクロ経済及び地政学要因の短期的な振幅が拡大し、投資家心理に影響を与えたことで株式市場のバリュエーションの振幅が拡大しています。

一方で、米中貿易戦争を巡る動きは楽観できない状況が続くと見られるものの、金融緩和政策の恩恵や堅調な消費動向を背景に米国を始めとする主要企業の収益は緩やかに成長を続ける見込みです。

日本では、消費税引き上げ後の反動による消費の落込みには留意を要するものの、米中貿易戦争の一級落により製造業の生産活動や企業の設備投資にポジティブな影響が期待されます。また、経済対策に伴う政府支出の拡大や企業の自社株買いなどの好材料に加え、株価バリュエーションは魅力的な水準にあり、これが株価を下支えすると思われます。

従いまして今後の運用にあたりましては、引き続き株式資産のオーバーウェイト、債券資産のアンダーウェイトを基本とする方針で臨み、市場の変動に応じて戦略的に見直しを行います。

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、お願ひ申し上げます。

<PRU国内株式マザーファンドの運用方針>

今後の運用におきましても、東証株価指数（TOPIX）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、①多銘柄への分散投資、②90%台後半の高い実質組入比率（株式現物+株価指標先物）の継続、③適宜のリバランス（組入銘柄と組入比率の見直し）、を行う予定です。

<PRU国内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、NOMURA-BPI（総合）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、ポートフォリオの償還年限や利回り、デュレーションなどの特性値をNOMURA-BPI（総合）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。

<PRU海外株式マザーファンドの運用方針>

今後の運用におきましてもMSCI KOKUSAIインデックス（円換算ベース）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、①多銘柄への分散投資、②90%台後半の高い実質組入比率（株式現物+株価指標先物）の継続、③適宜のリバランス（組入銘柄と組入比率の見直し）、を継続する予定です。

<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	
	2019/12/17～2020/12/15			
	金額	比率		
信託報酬	92円	0.494%	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18,629円です。 委託した資金の運用の対価 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 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価	
(投信会社)	(10)	(0.055)		
(販売会社)	(72)	(0.384)		
(受託会社)	(10)	(0.055)		
売買委託手数料	4	0.019	売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]}$	
(株式)	(3)	(0.019)	売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)		
(先物・オプション)	(0)	(0.001)		
有価証券取引税	0	0.001	有価証券取引税 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]}$	
(株式)	(0)	(0.001)	有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)		
その他費用	33	0.176	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)	(22)	(0.120)	その他費用	
(監査費用)	(1)	(0.005)	・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	
(その他)	(9)	(0.050)	・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る費用等が含 まれます。	
合計	129	0.690		

(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、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、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。

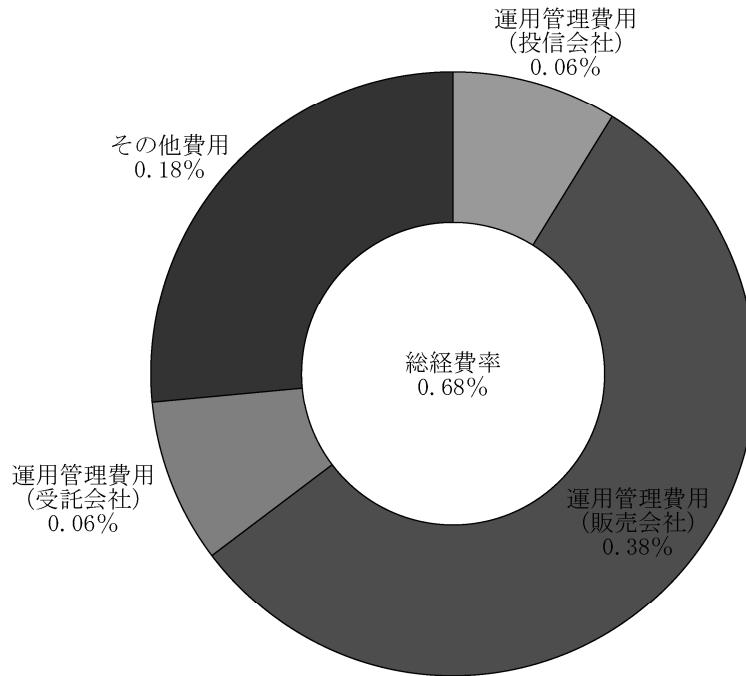
(注2) 各項目毎に円未満は四捨五入しております。

(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0.68%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17日から2020年12月15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
	千口	千円	千口	千円
PRU国内株式マザーファンド	60,891	108,716	78,871	144,462
PRU国内債券マザーファンド	115,307	157,459	141,268	193,140
PRU海外株式マザーファンド	54,512	149,964	29,594	82,091
PRU海外債券マザーファンド	30,984	74,997	21,359	51,156

(注) 単位未満は切り捨て。

* 株式売買比率 *

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期		
	PRUグッドライフ2040(年金)	PRU国内株式マザーファンド	PRU海外株式マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	一千円	1,448,094千円	2,355,543千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	一千円	2,795,724千円	3,005,050千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	—	0.51	0.78

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) 外国株式の(a)は各月末(決算日の属する月については決算日)、(b)は各月末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。

(注3) 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17日から2020年12月15日まで)

利害関係人の発行する有価証券等

PRU海外株式マザーファンド

種 類	当 期 末		
	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
	百万円	百万円	百万円
株 式	0.169205	1	1

(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あり、当ファンドに係る利害関係人とはブルデンシャルファイナンシャルインクです。

* 組入資産の明細 *

親投資信託残高

(2020年12月15日現在)

種 類	期首 (前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
PRU国内株式マザーファンド	367,861	349,881	711,693
PRU国内債券マザーファンド	756,074	730,113	995,509
PRU海外株式マザーファンド	160,378	185,296	580,571
PRU海外債券マザーファンド	48,319	57,944	143,911

(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国内株式マザーファンド全体の口数は、1,551,895千口です。

当期末におけるPRU国内債券マザーファンド全体の口数は、3,354,610千口です。

当期末におけるPRU海外株式マザーファンド全体の口数は、897,327千口です。

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、2,046,234千口です。

* 投資信託財産の構成 *

(2020年12月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
PRU国内株式マザーファンド	711,693	28.9
PRU国内債券マザーファンド	995,509	40.4
PRU海外株式マザーファンド	580,571	23.5
PRU海外債券マザーファンド	143,911	5.8
コール・ローン等、その他	33,765	1.4
投資信託財産総額	2,465,449	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨て。

(注2) PRU海外株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(2,800,648千円)の投資信託財産総額(2,814,956千円)に対する比率は99.5%です。

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(5,060,706千円)の投資信託財産総額(5,091,030千円)に対する比率は99.4%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、なお、当期末における邦貨換算レートは、1アメリカドル=104.12円、1カナダドル=81.64円、1メキシコペソ=5.15円、1ユーロ=126.60円、1イギリスポンド=138.93円、1スイスフラン=117.46円、1スウェーデンクローネ=12.41円、1ノルウェークローネ=11.94円、1デンマーククローネ=17.01円、1ポーランドズロチ=28.53円、1オーストラリアドル=78.49円、1ニュージーランドドル=73.75円、1香港ドル=13.43円、1シンガポールドル=78.10円、1マレーシアドル=25.65円、1イスラエルシェケル=31.95円です。

* 資産、負債、元本および基準価額の状況 *

(2020年12月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,465,449,659円
コール・ローン等	27,406,878
PRU国内株式マザーファンド(評価額)	711,693,003
PRU国内債券マザーファンド(評価額)	995,509,963
PRU海外株式マザーファンド(評価額)	580,571,225
PRU海外債券マザーファンド(評価額)	143,911,725
未 収 入 金	6,356,865
(B) 負 債	6,413,378
未 払 解 約 金	67,827
未 払 信 託 報 酬	5,705,840
未 払 利 息	75
そ の 他 未 払 費 用	639,636
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	2,459,036,281
元 本	1,237,528,808
次 期 緑 越 損 益 金	1,221,507,473
(D) 受 益 権 総 口 数	1,237,528,808口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,871円

(注) 当期

期首元本額	1,225,251,100円
期中追加設定元本額	168,763,332円
期中一部解約元本額	156,485,624円
計算口数当たり純資産額	1,9871円

* 損益の状況 *

当期 (自2019年12月17日 至2020年12月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 取 益 支 払 利 息	△ 28,148円
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益 売 買 買 損	△ 28,148 99,927,959 125,301,576 △ 25,373,617
(C) 信 託 報 酬 等	△ 12,556,065
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 87,343,746
(E) 前 期 緑 越 損 益 金	446,021,217
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金 (配 当 等 相 當 額) (壳 買 損 益 相 當 額)	688,142,510 (945,083,868) (△ 256,941,358)
(G) 計 算 (D+E+F)	1,221,507,473
(H) 収 益 分 配 金 次 期 緑 越 損 益 金 (G+H) 追 加 信 託 差 損 益 金 (配 当 等 相 當 額) (壳 買 損 益 相 當 額)	0 1,221,507,473 688,142,510 (945,490,270) (△ 257,347,760) 533,364,963

(注1) 損益の状況の中で(B)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(C)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(F)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(31,329,222円)、費用控除後の有価証券等損益額(56,014,524円)、信託約款に規定する収益調整金(945,490,270円)および分配準備積立金(446,021,217円)より分配対象収益は1,478,855,233円(10,000口当たり11,950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国内株式マザーファンド〉

運用状況について

「PRU国内株式マザーファンド」は、「PRUグッドライフ2040（年金）」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		東証株価指数		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	期中騰落率	(TOPIX)	期中騰落率	(TOPIX)			
16期（2016年12月5日）	円 15,358	% △ 5.7	1,466.96	% △ 7.5	96.6	% 3.2	百万円 4,111
17期（2017年12月5日）	19,108	24.4	1,790.97	22.1	96.0	3.7	4,282
18期（2018年12月5日）	17,866	△ 6.5	1,640.49	△ 8.4	96.4	3.5	3,299
19期（2019年12月5日）	19,060	6.7	1,711.41	4.3	97.2	2.7	3,225
20期（2020年12月7日）	20,099	5.5	1,760.75	2.9	96.6	2.8	3,158

（注）株式先物比率は買建比率－売建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		東証株価指数		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	(TOPIX)	騰落率	(TOPIX)		
（期首） 2019年12月5日	円 19,060	% —	1,711.41	% —	97.2	% 2.7
12月末	19,196	0.7	1,721.36	0.6	97.0	2.7
2020年1月末	18,786	△ 1.4	1,684.44	△ 1.6	96.6	3.2
2月末	16,858	△ 11.6	1,510.87	△ 11.7	95.9	3.2
3月末	15,861	△ 16.8	1,403.04	△ 18.0	95.6	3.8
4月末	16,548	△ 13.2	1,464.03	△ 14.5	95.9	3.8
5月末	17,665	△ 7.3	1,563.67	△ 8.6	95.9	3.8
6月末	17,634	△ 7.5	1,558.77	△ 8.9	96.2	3.2
7月末	16,926	△ 11.2	1,496.06	△ 12.6	96.5	3.3
8月末	18,305	△ 4.0	1,618.18	△ 5.4	96.7	2.8
9月末	18,537	△ 2.7	1,625.49	△ 5.0	96.1	3.3
10月末	18,017	△ 5.5	1,579.33	△ 7.7	97.0	2.8
11月末	20,030	5.1	1,754.92	2.5	95.9	3.3
（期末） 2020年12月7日	20,099	5.5	1,760.75	2.9	96.6	2.8

（注1）騰落率は期首比です。

（注2）株式先物比率は買建比率－売建比率を記載しております。

※東証株価指数（TOPIX=Tokyo Stock Price Index）とは、わが国の代表的な株価指数で、東京証券取引所第一部銘柄の基準時（1968年1月4日終値）の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。TOPIXの指數値およびTOPIXの商標は、(株)東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指數値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標または商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指數値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指數値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。(株)東京証券取引所は、当ファンドの運用成果等に關し責任を有しません。

* 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		
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	11円 (11) (0)	0.063% (0.060) (0.002)	期中の平均基準価額は17,863円です。 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料	
合計	11	0.063		

(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おります。

(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) 株式

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
国内	千株	千円	千株	千円
上場	556 (△136)	676,263 (-)	613	839,650

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) () 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	507	509	—	—

(注) 単位未満は切り捨て。

* 株式売買比率 *

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	1,515,914千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,795,724千円
(c) 売買高比率(a) / (b)	0.54

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

株式

当期							
買付			売付				
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
NTTドコモ	千株 4.1	千円 15,153	円 3,695	NTTドコモ	千株 13.3	千円 50,617	円 3,805
トヨタ自動車	1.5	10,526	7,017	トヨタ自動車	1.915	13,634	7,119
ソフトバンクグループ	1	5,714	5,714	キーエンス	0.2	9,065	45,325
キーエンス	0.1	5,226	52,268	ソフトバンクグループ	1.4	8,342	5,958
東海旅客鉄道	0.3	4,959	16,530	ソニー	1	8,051	8,051
日本電信電話	1.6	4,560	2,850	東海旅客鉄道	0.4	6,667	16,669
武田薬品工業	1.2	4,553	3,794	武田薬品工業	1.6	6,176	3,860
ソニー	0.5	4,106	8,212	KDDI	1.7	5,443	3,202
SHI FT	0.3	3,840	12,800	三菱UFJフィナンシャル・グループ	11.6	5,394	465
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8.1	3,567	440	日本電信電話	1.7	4,634	2,726

(注) 金額は受渡代金。

* 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 (2020年12月7日現在)

(1) 国内株式

上場株式

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
水産・農林業 (0.1%)				
極洋	0.1	0.1	281	
日本水産	1.7	1.8	757	
マルハニチロ	0.3	0.3	655	
雪国まいたけ	—	0.1	171	
カネコ種苗	0.1	0.1	151	
サカタのタネ	0.2	0.2	675	
ホクト	0.2	—	—	
鉱業 (0.1%)				
三井松島ホールディングス	0.1	—	—	
国際石油開発帝石	7	6.2	3,552	
石油資源開発	0.3	0.2	354	
K&Oエナジーグループ	0.1	—	—	
建設業 (2.4%)				
ショーボンドホールディングス	0.3	0.3	1,506	
ミライト・ホールディングス	0.5	0.5	804	
タマホーム	0.1	0.1	140	
日本アクリア	—	0.1	63	
T A T E R U	0.5	—	—	
スペーススピリューホールディングス	0.3	0.2	122	
安藤・間	1.1	1	701	
東急建設	0.5	0.5	248	
コムシスホールディングス	0.6	0.6	1,872	
ミサワホーム	0.1	—	—	
ビーアールホールディングス	0.3	0.2	131	
高松コンストラクショングループ	0.1	0.1	203	
東建コーポレーション	0.1	0.1	776	
ソネック	—	0.1	85	
大成建設	1.4	1.3	4,920	
大林組	4.2	4	3,784	
清水建設	4.1	4.1	3,341	
飛島建設	0.2	—	—	
長谷工コーポレーション	1.8	1.5	1,767	
松井建設	0.2	0.2	148	
鹿島建設	3.3	3.1	4,278	
不動テトラ	0.1	0.1	169	
鉄建建設	0.1	0.1	181	
西松建設	0.3	0.4	817	
三井住友建設	1.1	0.7	301	
大豊建設	0.1	0.1	349	
前田建設工業	1	0.9	783	
佐田建設	—	0.1	44	
奥村組	0.2	0.2	484	
東鉄工業	0.2	0.2	550	
戸田建設	1.7	1.7	1,081	
熊谷組	0.2	0.2	518	
北野建設	—	0.1	260	
植木組	—	0.1	280	
矢作建設工業	0.2	0.2	172	
ピーエス三菱	0.1	0.1	57	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
日本ハウスホールディングス				
大東建託	0.3	0.4	95	
新日本建設	0.5	0.4	3,812	
N I P P O	0.2	0.2	171	
前田道路	0.4	0.4	822	
日本道路	0.1	—	681	
東亜建設工業	0.2	0.1	200	
日本国土開発	0.3	0.3	169	
若築建設	0.1	—	—	
東洋建設	0.5	0.5	206	
五洋建設	1.7	1.6	1,368	
世紀東急工業	0.2	0.2	165	
福田組	0.1	—	—	
住友林業	1	1	1,851	
日本基礎技術	—	0.1	49	
巴コーポレーション	0.3	0.2	82	
大和ハウス工業	4	3.9	12,963	
ライトイ工業	0.3	0.2	343	
積水ハウス	4.3	4.3	8,421	
日特建設	0.2	—	—	
北陸電気工事	—	0.1	123	
ユアテック	0.2	0.2	148	
日本リーテック	—	0.1	233	
中電工	0.2	—	—	
関電工	0.6	0.5	404	
きんでん	0.9	1	1,625	
東京エヌシス	0.1	0.2	171	
住友電設	0.1	0.1	261	
日本電設工業	0.2	0.2	416	
協和エクシオ	0.6	0.6	1,648	
新日本空調	0.1	0.1	212	
九電工	0.3	0.3	909	
三機工業	0.3	0.3	351	
日揮ホールディングス	1.2	1.2	1,111	
ヤマト	—	0.1	76	
太平電業	0.1	0.1	251	
高砂熱学工業	0.3	0.3	432	
明星工業	0.3	0.3	231	
大氣社	0.2	0.2	540	
ダイダン	0.1	0.1	278	
日比谷総合設備	0.1	0.2	373	
東芝プラントシステム	0.3	—	—	
O S J B ホールディングス	0.7	1.4	362	
東洋エンジニアリング	0.2	—	—	
レイズネクスト	0.3	0.2	224	
食料品 (3.6%)				
日本製粉	0.4	—	—	
日清製粉グループ本社	1.4	1.4	2,382	
昭和産業	0.1	0.1	309	
鳥越製粉	0.1	0.1	99	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
中部飼料	千株	千株	千円	
フィード・ワン	0.1	0.1	140	
日本甜菜製糖	1	0.2	177	
三井製糖	0.1	0.1	160	
塩水港精糖	0.1	0.1	178	
日新製糖	—	0.4	89	
森永製菓	0.1	0.1	185	
江崎グリコ	0.3	0.3	1,155	
名糖産業	0.4	0.4	1,770	
井村屋グループ	0.1	—	—	
不二家	0.1	0.1	255	
山崎製パン	0.9	1	1,760	
亀田製菓	0.1	0.1	483	
寿スピリッツ	0.1	0.1	545	
カルビー	0.6	0.6	1,797	
森永乳業	0.3	0.2	993	
六甲バター	0.1	0.1	189	
ヤクルト本社	0.9	0.9	4,734	
明治ホールディングス	0.9	0.8	5,840	
雪印メグミルク	0.3	0.3	659	
プリマハム	0.2	0.2	599	
日本ハム	0.5	0.5	2,352	
林兼産業	—	0.2	117	
丸大食品	0.1	0.2	331	
S Foods	0.1	0.1	315	
柿安本店	—	0.1	252	
伊藤ハム米久ホールディングス	0.8	0.9	605	
サッポロホールディングス	0.4	0.4	822	
アサヒグループホールディングス	2.7	2.7	11,982	
キリンホールディングス	5.5	5.3	12,833	
宝ホールディングス	0.9	1	1,235	
オエノンホールディングス	0.4	0.5	205	
養命酒製造	0.1	—	—	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	0.9	1	1,729	
サントリー食品インターナショナル	0.9	0.8	3,120	
ダイドーグループホールディングス	0.1	0.1	564	
伊藤園	0.4	0.4	3,012	
キーコーヒー	0.1	—	—	
ユニカフエ	—	0.1	115	
ジャパンフーズ	—	0.1	121	
日清オイリオグループ	0.2	0.2	590	
不二製油グループ本社	0.3	0.3	843	
J-オイルミルズ	0.1	0.1	350	
キッコーマン	0.9	0.9	5,985	
味の素	2.8	2.8	6,284	
キューピー	0.7	0.7	1,504	
ハウス食品グループ本社	0.5	0.5	1,835	
カゴメ	0.5	0.5	1,820	
焼津水産化学工業	0.1	—	—	
アリアケジャパン	0.1	0.1	740	
ニチレイ	0.6	0.6	1,644	
東洋水産	0.7	0.6	3,102	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
イートアンドホールディングス	千株	千株	千円	—
大冷	0.1	—	196	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	—	0.1	85	
日清食品ホールディングス	0.5	0.5	4,340	
永谷園ホールディングス	0.1	0.1	226	
一正蒲鉾	—	0.1	114	
フジツコ	0.2	—	—	
ロック・フィールド	0.2	0.2	328	
日本たばこ産業	7.4	6.8	14,552	
ケンコー・マヨネーズ	0.1	—	—	
わらべや日洋ホールディングス	0.1	0.1	141	
などり	0.1	0.1	191	
北の達人コーポレーション	0.5	0.5	246	
ユーブレナ	0.6	0.5	398	
理研ビタミン	0.1	0.1	139	
織維製品 (0.5%)				
片倉工業	0.2	0.2	278	
グンゼ	0.1	0.1	356	
東洋紡	0.5	0.5	671	
ユニチカ	0.5	0.4	156	
富士紡ホールディングス	0.1	0.1	361	
倉敷紡績	0.1	0.1	186	
シキボウ	0.1	0.1	102	
日本毛織	0.4	0.4	402	
トーワ紡コーポレーション	—	0.1	48	
帝国織維	0.1	0.1	260	
帝人	1	1	1,936	
東レ	9.4	8.8	5,426	
イチカワ	—	0.1	130	
アツギ	0.2	0.2	103	
セーレン	0.3	0.3	467	
小松マテーレ	0.2	0.3	289	
ワコールホールディングス	0.3	0.3	609	
ホギメディカル	0.2	0.1	329	
クラウディアホールディングス	—	0.3	86	
T S I ホールディングス	0.5	0.5	103	
マツオカコーポレーション	0.1	—	—	
ワールド	0.2	0.2	261	
三陽商会	0.1	—	—	
オンワードホールディングス	0.7	0.9	184	
ゴールドワイン	0.2	0.2	1,346	
デサント	0.3	0.3	505	
キング	—	0.2	104	
ヤマトイントンナショナル	—	0.2	68	
パルプ・紙 (0.2%)				
特種東海製紙	0.1	0.1	523	
王子ホールディングス	5.5	5.1	2,616	
日本製紙	0.5	0.5	596	
三義製紙	0.3	—	—	
北越コーポレーション	0.8	0.8	293	
中越パルプ工業	0.1	0.1	126	
大王製紙	0.6	0.6	1,059	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
レンゴー	1.2	1.2	972	
トモク	0.1	0.1	173	
ザ・パック	0.1	0.1	292	
化学 (7.6%)				
クラレ	1.9	2	2,230	
旭化成	8.5	8.2	8,601	
昭和電工	0.9	0.9	1,857	
住友化学	9.2	9	3,807	
住友精化	0.1	0.1	402	
日産化学	0.7	0.7	4,508	
ラサ工業	—	0.1	226	
クレハ	0.1	0.1	607	
ティカ	0.1	0.1	155	
石原産業	0.2	0.2	121	
日本曹達	0.2	0.2	563	
東ソー	1.9	1.9	3,256	
トクヤマ	0.4	0.4	933	
セントラル硝子	0.3	0.2	448	
東亞合成	0.8	0.8	992	
大阪ソーダ	0.1	0.1	270	
関東電化工業	0.3	0.2	148	
デンカ	0.5	0.5	1,830	
信越化学工業	2.2	2.1	36,330	
堺化学工業	0.1	—	—	
第一稀元素化学工業	0.2	0.2	144	
エア・ウォーター	1	1.1	2,010	
日本酸素ホールディングス	1.2	1.2	2,138	
日本バーカライジング	0.7	0.6	664	
高圧ガス工業	0.2	0.2	159	
四国化成工業	0.2	0.2	247	
戸田工業	0.1	—	—	
ステラ ケミファ	0.1	0.1	338	
日本触媒	0.2	0.2	1,082	
大日精化工業	0.1	0.1	238	
カネカ	0.3	0.3	1,009	
三菱瓦斯化学	1.2	1.1	2,523	
三井化学	1.1	1.2	3,518	
J S R	1.2	1.2	3,381	
東京応化工業	0.2	0.2	1,354	
大阪有機化学工業	0.2	0.1	296	
三義ケミカルホールディングス	8.4	8.3	5,355	
K H ネオケム	0.2	0.2	548	
ダイセル	1.8	1.6	1,144	
住友ベークライト	0.2	0.2	700	
積水化学工業	2.6	2.6	4,955	
日本ゼオン	1.1	1.1	1,512	
アイカ工業	0.4	0.4	1,446	
宇部興産	0.6	0.6	1,151	
積水樹脂	0.2	0.2	431	
タキロンシーアイ	0.2	0.3	206	
旭有機材	0.1	—	—	
日立化成	0.6	—	—	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
ニチバン	0.1	—	—	
リケンテクノス	0.4	0.3	138	
大倉工業	0.1	—	—	
積水化成品工業	0.2	0.2	106	
群栄化学工業	0.1	—	—	
ミライアル	—	0.1	123	
ダイキヨーニシカワ	0.3	0.3	241	
森六ホールディングス	0.2	—	—	
日本化薬	0.7	0.8	768	
カーリットホールディングス	0.2	—	—	
日本精化	0.1	0.1	145	
扶桑化学工業	0.1	0.1	378	
A D E K A	0.6	0.5	857	
日油	0.5	0.5	2,352	
ハリマ化成グループ	0.1	0.1	102	
花王	3.1	3	23,301	
第一工業製薬	0.1	—	—	
三洋化成工業	0.1	0.1	461	
大日本塗料	0.1	0.1	99	
日本ペイントホールディングス	1	1	11,960	
関西ペイント	1.4	1.4	4,284	
中国塗料	0.4	0.4	398	
日本特殊塗料	0.1	0.1	122	
藤倉化成	0.1	0.2	108	
太陽ホールディングス	0.1	0.1	632	
D I C	0.5	0.5	1,305	
サカタインクス	0.3	0.3	360	
東洋インキSCホールディングス	0.3	0.2	395	
T & K T O K A	0.1	0.1	83	
富士フイルムホールディングス	2.5	2.4	13,668	
資生堂	2.6	2.5	18,500	
ライオン	1.6	1.6	3,928	
高砂香料工業	0.1	0.1	253	
マンダム	0.3	0.3	485	
ミルボン	0.2	0.2	1,202	
ファンケル	0.6	0.5	2,080	
コーワー	0.2	0.2	3,238	
コタ	0.1	0.1	137	
ボーラ・オルビスホールディングス	0.5	0.5	1,016	
ノエビアホールディングス	0.1	0.1	421	
エステー	0.1	0.1	197	
アグロ カネショウ	0.1	0.1	176	
コニシ	0.2	0.2	321	
長谷川香料	0.2	0.2	404	
星光P M C	—	0.1	72	
小林製薬	0.4	0.4	4,824	
荒川化学工業	0.1	0.2	232	
メック	0.1	0.1	235	
日本高純度化学	0.1	0.1	268	
タカラバイオ	0.3	0.3	873	
J C U	0.2	0.1	375	
新田ゼラチン	—	0.1	67	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
デクセリアルズ	千株	千株	千円	
アース製薬	0.4	0.3	393	
北興化学工業	0.1	0.1	590	
クミアイ化学工業	—	0.1	110	
日本農薬	0.5	0.6	636	
アキレス	0.2	0.3	162	
有沢製作所	0.1	0.1	143	
日東電工	0.2	0.2	187	
レック	0.9	0.9	7,812	
三光合成	0.2	0.2	308	
きもと	—	0.3	118	
藤森工業	0.1	0.1	61	
前澤化成工業	0.1	—	475	
未来工業	0.1	0.1	—	
J S P	0.1	0.1	178	
エフピコ	0.1	0.3	157	
天馬	0.1	0.1	218	
信越ボリマー	0.2	0.3	197	
東リ	0.5	—	291	
ニフコ	0.5	0.5	—	
バルカー	0.1	0.1	1,950	
ユニ・チャーム	2.5	2.7	199	
医薬品 (6.1%)				
協和キリン	1.3	1.3	12,546	
武田薬品工業	10.8	10.4	3,755	
アステラス製薬	11.4	10.9	40,248	
大日本住友製薬	0.9	0.9	16,431	
塙野義製薬	1.6	1.6	1,181	
田辺三菱製薬	1.6	—	9,048	
わかもと製薬	—	0.2	—	
あすか製薬	0.2	0.2	51	
日本新薬	0.3	0.3	379	
ビオフェルミン製薬	—	0.1	2,178	
中外製薬	0.2	0.1	243	
科研製薬	1.3	3.9	19,648	
エーザイ	0.2	0.2	773	
ロート製薬	1.5	1.5	11,422	
小野薬品工業	0.7	0.7	2,233	
久光製薬	3	2.9	9,230	
持田製薬	0.4	0.3	1,839	
参天製薬	0.2	0.2	787	
扶桑薬品工業	2.4	2.3	3,942	
ツムラ	0.1	—	787	
日医工	0.4	0.4	—	
キッセイ薬品工業	0.2	0.2	1,248	
生化学工業	0.3	0.2	400	
榮研化学	0.2	0.2	207	
鳥居薬品	0.1	0.1	392	
J C R ファーマ	0.1	0.1	320	
東和薬品	0.1	0.1	993	
富士製薬工業	0.1	0.1	127	
沢井製薬	0.3	0.3	1,416	

銘柄	期首(前期末)	当期末			
		株数	株数	評価額	
ゼリア新薬工業	千株	千株	千円		
第一三共	0.3	0.2	377		
キヨーリン製薬ホールディングス	3.7	10.7	37,278		
大幸薬品	0.3	0.3	561		
ダイト	0.1	0.2	322		
大塚ホールディングス	0.1	0.1	365		
大正製薬ホールディングス	2.5	2.6	11,432		
ペプチドリーム	0.3	0.3	1,965		
石油・炭素製品 (0.4%)	0.6	0.6	3,192		
日本コーカス工業	—	1	1.5	108	
ニチレイ	0.2	0.1	165		
ユシロ化学工業	0.1	0.1	118		
富士石油	—	0.6	106		
出光興産	1.4	1.5	3,297		
ENEOSホールディングス	20.3	19.2	6,900		
コスモエネルギーホールディングス	0.4	0.4	703		
ゴム製品 (0.5%)					
横浜ゴム	0.7	0.7	1,116		
T O Y O T I R E	0.7	0.7	1,157		
ブリヂストン	4	3.3	12,246		
住友ゴム工業	1.1	1.1	1,009		
オカモト	0.1	0.1	407		
ニッタ	0.1	0.1	228		
住友理工	0.3	0.3	168		
三ツ星ベルト	0.2	0.1	169		
パンドー化学	0.2	0.2	118		
ガラス・土石製品 (0.8%)					
日東紡績	0.2	0.2	806		
A G C	1.2	1.1	3,883		
日本板硝子	0.6	0.6	260		
日本山村硝子	0.1	0.2	180		
日本電気硝子	0.5	0.4	946		
オハラ	—	0.1	152		
住友大阪セメント	0.3	0.2	651		
太平洋セメント	0.8	0.8	2,262		
日本ヒューム	0.2	0.3	237		
日本コンクリート工業	0.3	0.2	64		
三谷セキサン	0.1	0.1	392		
アジアパイルホールディングス	0.2	0.2	92		
東海カーボン	1.3	1.2	1,368		
日本カーボン	0.1	0.1	382		
東洋炭素	0.1	—	—		
ノリタケカンパニーリミテド	0.1	0.1	294		
T O T O	1	0.9	5,319		
日本碍子	1.5	1.5	2,559		
日本特殊陶業	1.1	1	1,906		
ダントーホールディングス	—	0.1	50		
M A R U W A	0.1	—	—		
品川リフラクトリーズ	0.1	—	—		
ヨータイ	0.2	—	—		
ニッカトー	—	0.1	73		
フジミインコーポレーテッド	0.1	0.1	385		

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
ニチアス	0.3	0.3	721	
ニチハ	0.2	0.2	662	
鉄鋼 (0.6%)				
日本製鉄	5.7	5.5	7,326	
神戸製鋼所	2.3	2.3	1,205	
中山製鋼所	0.3	—	—	
合同製鉄	0.1	0.1	189	
ジェイ エフ イー ホールディングス	3.4	3.3	3,405	
東京製鐵	0.7	0.6	383	
共英製鋼	0.1	0.1	145	
大和工業	0.3	0.3	813	
東京鐵鋼	0.1	0.1	215	
大阪製鐵	0.1	—	—	
淀川製鋼所	0.2	0.2	393	
丸一鋼管	0.4	0.4	900	
モリ工業	0.1	—	—	
大同特殊鋼	0.2	0.2	899	
日本冶金工業	0.1	0.1	184	
山陽特殊製鋼	0.2	0.1	130	
愛知製鋼	0.1	0.1	289	
日立金属	1.3	1.3	1,978	
大平洋金属	0.1	0.1	208	
新日本電工	1.1	0.9	221	
栗本鐵工所	0.1	—	—	
三菱製鋼	0.1	—	—	
日亜鋼業	—	0.2	59	
シンニッタン	0.3	—	—	
非鉄金属 (0.7%)				
大紀アルミニウム工業所	0.2	0.2	142	
日本軽金属ホールディングス	3.6	0.3	578	
三井金属鉱業	0.3	0.3	939	
東邦亜鉛	0.1	0.1	219	
三菱マテリアル	0.8	0.8	1,632	
住友金属鉱山	1.7	1.6	6,688	
DOWAホールディングス	0.3	0.3	1,093	
古河機械金属	0.2	0.2	242	
大阪チタニウムテクノロジーズ	0.2	0.1	91	
東邦チタニウム	0.3	0.2	148	
U A C J	0.2	0.2	382	
古河電気工業	0.4	0.4	1,162	
住友電気工業	4.8	4.7	5,886	
フジクラ	1.5	1.5	678	
昭和電線ホールディングス	0.2	0.1	172	
東京特殊電線	—	0.1	239	
タツタ電線	0.4	0.1	59	
リョービ	0.2	0.1	123	
アーレステイ	0.2	—	—	
アサヒホールディングス	0.2	0.2	647	
金属製品 (0.6%)				
稻葉製作所	0.1	—	—	
宮地エンジニアリンググループ	0.1	—	—	
トーカロ	0.3	0.4	510	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
SUMCO	1.5	1.6	3,715	
信和	0.1	—	—	
東洋製罐グループホールディングス	0.8	0.8	872	
ホッカンホールディングス	0.1	0.1	138	
横河ブリッジホールディングス	0.2	0.2	413	
三和ホールディングス	1.3	1.1	1,301	
文化シヤッター	0.4	0.3	275	
三協立山	0.2	0.2	152	
アルインコ	0.1	0.1	92	
LIXIL	1.9	1.8	4,210	
ノーリツ	0.3	0.3	507	
長府製作所	0.1	0.1	204	
リンナイ	0.2	0.2	2,436	
ダイニチ工業	—	0.1	82	
日東精工	0.2	0.2	86	
三洋工業	—	0.1	189	
岡部	0.3	0.3	237	
ジーテクト	0.2	0.2	296	
東プレ	0.2	0.2	283	
高周波熱練	0.3	0.2	94	
東京製鋼	0.1	0.1	89	
サンコール	—	0.2	90	
バイオラックス	0.2	0.2	332	
エイチワン	0.2	—	—	
日本発條	1.3	1.3	859	
立川ブラインド工業	—	0.1	132	
三益半導体工業	0.1	0.1	284	
機械 (5.8%)				
日本製鋼所	0.4	0.4	1,111	
三浦工業	0.5	0.5	2,765	
タクマ	0.5	0.4	700	
ツガミ	0.3	0.2	307	
オークマ	0.2	0.1	590	
芝浦機械	0.2	0.1	232	
アマダ	1.9	1.5	1,642	
アイダエンジニアリング	0.3	0.3	276	
FUJI	0.5	0.5	1,298	
牧野フライス製作所	0.1	0.1	409	
オーエスジー	0.6	0.6	1,131	
旭ダイヤモンド工業	0.3	0.3	129	
DMG森精機	0.8	0.8	1,257	
ソディック	0.3	0.3	250	
ディスコ	0.2	0.2	6,440	
日東工器	0.1	0.1	166	
豊和工業	—	0.1	81	
石川製作所	—	0.1	176	
東洋機械金属	—	0.3	120	
島精機製作所	0.2	0.2	358	
オptron	0.1	0.2	468	
フリュー	0.1	0.1	110	
ヤマシンフィルタ	0.2	0.3	320	
日阪製作所	0.2	0.2	169	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
やまびこ	千株	千株	千円	
平田機工	0.3	0.2	270	
ペガサスミシン製造	0.1	0.1	827	
タツモ	—	0.1	154	
ナブテスコ	0.7	0.7	2,982	
三井海洋開発	0.1	0.1	177	
レオソン自動機	0.1	0.1	116	
SMC	0.4	0.4	25,804	
ユニオンツール	0.1	—	—	
オイレス工業	0.2	0.2	331	
サトーホールディングス	0.2	0.2	436	
技研製作所	0.1	0.1	403	
日精樹脂工業	0.2	0.1	87	
オカダアイヨン	—	0.1	107	
小松製作所	5.8	5.6	15,131	
住友重機械工業	0.7	0.7	1,580	
日立建機	0.5	0.5	1,479	
日工	—	0.2	132	
巴工業	0.1	0.1	191	
井関農機	0.2	0.1	139	
TOWA	0.1	0.1	193	
北川鉄工所	0.1	0.1	137	
ローツエ	0.1	0.1	574	
クボタ	6.8	6.6	14,226	
荏原実業	0.1	—	—	
三菱化工機	0.1	—	—	
月島機械	0.3	0.2	262	
帝國電機製作所	0.1	0.1	126	
新東工業	0.3	0.4	286	
澁谷工業	0.1	0.1	342	
アイチ コーポレーション	0.2	0.2	185	
小森コーポレーション	0.4	0.3	215	
鶴見製作所	0.1	0.1	178	
荏原製作所	0.6	0.5	1,740	
西島製作所	0.1	0.1	85	
北越工業	0.1	0.1	103	
ダイキン工業	1.7	1.6	37,152	
オルガノ	—	0.1	604	
トヨーカネツ	0.1	0.1	210	
栗田工業	0.7	0.7	2,604	
椿本チエイン	0.2	0.2	554	
木村化工機	—	0.1	54	
アネスト岩田	0.2	0.2	197	
ダイフク	0.7	0.6	7,146	
加藤製作所	0.1	0.1	100	
タダノ	0.6	0.6	519	
フジテック	0.4	0.4	859	
CKD	0.3	0.3	692	
キトー	0.1	0.1	157	
平和	0.4	0.4	578	
理想科学工業	0.1	0.1	130	
SANKYO	0.3	0.3	782	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
日本金銭機械	千株	千株	千円	
マースグループホールディングス	0.2	0.2	108	
フクシマガリレイ	0.1	0.1	441	
ダイコク電機	0.1	—	—	
竹内製作所	0.2	0.2	501	
アマノ	0.4	0.4	1,016	
JUKI	0.2	0.2	103	
サンデンホールディングス	0.2	—	—	
蛇の目ミシン工業	—	0.1	80	
マックス	0.2	0.2	284	
グローリー	0.3	0.3	634	
新晃工業	0.1	0.1	171	
大和冷機工業	0.2	0.2	216	
セガサミーホールディングス	1.3	1.2	1,707	
日本ビストンリング	0.1	—	—	
リケン	0.1	0.1	222	
TPR	0.2	0.2	282	
ツバキ・ナカシマ	0.3	0.2	189	
ホシザキ	0.4	0.4	4,012	
大豊工業	0.1	0.1	64	
日本精工	2.6	2.4	2,174	
NTN	2.8	2.9	707	
ジェイテクト	1.2	1.2	957	
不二越	0.1	0.1	434	
日本トムソン	0.4	0.3	111	
THK	0.7	0.8	2,720	
ユーシン精機	0.1	0.1	83	
前澤縫装工業	0.1	0.1	233	
イーグル工業	0.1	0.2	192	
日本ビラー工業	0.2	0.1	160	
キッツ	0.5	0.5	300	
マキタ	1.7	1.6	8,544	
日立造船	1.1	0.8	325	
三菱重工業	2.2	2.1	5,419	
IHI	0.9	0.9	1,523	
スター精密	0.2	—	—	
電気機器 (17.0%)				
日清紡ホールディングス	0.8	0.7	560	
イビデン	0.8	0.8	3,932	
コニカミノルタ	2.7	2.7	945	
ブラザー工業	1.6	1.5	3,082	
ミネベアミツミ	2.3	2.3	5,094	
日立製作所	6.2	6	24,390	
三菱電機	12.7	12.5	19,162	
富士電機	0.8	0.7	2,450	
東洋電機製造	0.1	0.1	119	
安川電機	1.5	1.3	6,337	
シンフォニアテクノロジー	0.2	0.2	280	
明電舎	0.3	0.2	386	
山洋電気	0.1	0.1	524	
デンヨー	0.1	0.1	209	
東芝テック	0.2	0.2	774	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
マブチモーター	千株	千株	千円	
	0.3	0.4	1,862	
日本電産	1.5	3	38,370	
トレックス・セミコンダクター	0.1	0.1	128	
東光高岳	0.1	0.1	163	
ダブル・スコープ	0.2	0.2	173	
ダイヘン	0.1	0.1	478	
ヤーマン	0.2	0.2	428	
JVCケンウッド	1	1.2	180	
ミマキエンジニアリング	0.2	0.1	50	
I-P-E-X	—	0.1	208	
日新電機	0.3	0.3	344	
大崎電気工業	0.3	0.3	163	
オムロン	1.3	1.1	10,120	
日東工業	0.2	0.2	396	
I-D-E-C	0.2	0.2	377	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	0.5	0.4	1,053	
サクサホールディングス	0.1	—	—	
メルコホールディングス	0.1	—	—	
テクノメディア	0.1	—	—	
日本電気	1.6	1.5	8,220	
富士通	1.2	1.2	16,290	
沖電気工業	0.6	0.5	453	
電気興業	0.1	0.1	280	
サンケン電気	0.1	0.1	387	
ナカヨ	—	0.1	147	
アイホン	0.1	—	—	
ルネサスエレクトロニクス	6.1	5.4	5,400	
セイコーエプソン	1.6	1.6	2,617	
ワコム	0.9	0.9	807	
アルパック	0.3	0.2	879	
E-I-Z-O	0.1	0.1	373	
日本信号	0.3	0.3	284	
京三製作所	0.3	0.2	86	
能美防災	0.2	0.2	464	
ホーチキ	0.1	0.1	129	
星和電機	—	0.1	64	
エレコム	0.1	0.2	921	
パナソニック	14.7	14.3	16,344	
シャープ	1.4	1.5	2,065	
アンリツ	0.8	0.8	1,812	
富士通ゼネラル	0.4	0.3	871	
ソニー	8.3	7.8	75,465	
T-D-K	0.6	0.6	8,724	
帝国通信工業	0.1	0.2	233	
タムラ製作所	0.5	0.3	162	
アルプスアルパイン	1.3	1.1	1,466	
鈴木	—	0.1	96	
ローランド ディー.ジー.	0.1	0.1	186	
フォスター電機	0.1	0.2	240	
ヨコオ	0.1	0.1	247	
ホシデン	0.4	0.4	362	
ヒロセ電機	0.2	0.2	2,934	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
日本航空電子工業	千株	千株	千円	
T O A	0.3	0.3	443	
マクセルホールディングス	0.1	0.1	85	
古野電気	0.3	0.3	381	
ユニデンホールディングス	0.2	0.2	229	
スミダコーポレーション	0.1	—	—	
アイコム	0.1	0.1	268	
リオン	0.1	0.1	302	
船井電機	—	0.2	86	
横河電機	1.3	1.2	2,360	
新電元工業	0.1	—	—	
アズビル	0.8	0.8	4,008	
日本光電工業	0.5	0.5	1,680	
共和電業	0.2	0.3	121	
堀場製作所	0.3	0.3	1,668	
アドバンテスト	0.9	0.9	6,759	
小野測器	—	0.2	102	
エスベック	0.1	0.2	401	
キーエンス	1.2	1.1	57,035	
日置電機	0.1	0.1	412	
シスメックス	1	0.9	10,120	
日本マイクロニクス	0.2	0.2	213	
メガチップス	0.1	0.1	292	
O B A R A G R O U P	0.1	0.1	367	
原田工業	—	0.1	84	
コーワセル	0.2	0.2	237	
イリソ電子工業	0.1	0.1	442	
オブテックスグループ	0.2	0.2	389	
千代田インテグレ	0.1	—	—	
レーベルテック	0.3	0.6	6,462	
スタンレー電気	0.9	0.9	3,069	
岩崎電気	0.1	0.1	141	
ウシオ電機	0.7	0.7	914	
ヘリオス テクノ ホールディング	0.1	—	—	
日本セラミック	0.1	0.1	291	
遠藤照明	—	0.1	54	
古河電池	0.2	0.1	158	
山一電機	0.1	0.1	157	
図研	0.1	0.1	278	
日本電子	0.3	0.2	884	
カシオ計算機	1.1	1.1	2,070	
ファナック	1.2	1.2	31,038	
日本シイエムケイ	0.3	0.3	125	
エンプラス	0.1	0.1	348	
大真空	—	0.1	258	
ローム	0.6	0.5	4,745	
浜松ホトニクス	0.9	0.9	5,256	
三井ハイテック	0.2	0.1	286	
新光電気工業	0.5	0.4	924	
京セラ	1.8	1.8	11,158	
太陽誘電	0.6	0.6	2,796	
村田製作所	3.9	3.7	32,737	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
双葉電子工業	千株	千株	千円	
ニチコン	0.2	0.2	174	
日本ケミコン	0.4	0.4	444	
KOA	0.1	0.1	167	
市光工業	0.2	0.2	296	
小糸製作所	0.2	0.2	119	
ミツバ	0.8	0.7	4,886	
SCREENホールディングス	0.3	0.2	97	
SCREENホールディングス	0.2	0.2	1,424	
キヤノン電子	0.2	0.2	300	
キヤノン	7	6.2	12,167	
リコー	3.8	3.2	2,361	
象印マホービン	0.4	0.3	541	
MUTOHホールディングス	—	0.1	145	
東京エレクトロン	0.9	0.8	29,512	
輸送用機器 (7.3%)				
トヨタ紡織	0.4	0.4	630	
ユニプレス	0.2	0.2	190	
豊田自動織機	1.1	1	7,980	
モリタホールディングス	0.2	0.2	336	
三櫻工業	0.2	0.1	75	
デンソー	2.8	2.8	16,226	
東海理化電機製作所	0.3	0.3	500	
三井E&Sホールディングス	0.5	0.5	184	
川崎重工業	1	1	1,586	
名村造船所	0.5	0.9	144	
日本車輪製造	0.1	—	—	
三菱ロジスネクスト	0.2	0.2	240	
日産自動車	15.3	14.7	7,829	
いすゞ自動車	3.9	3.6	3,711	
トヨタ自動車	14.4	14	100,856	
日野自動車	1.6	1.6	1,473	
三菱自動車工業	4.6	4.8	916	
武藏精密工業	0.3	0.3	481	
日産車体	0.2	0.2	181	
新明和工業	0.5	0.4	342	
極東開発工業	0.3	0.2	283	
日信工業	0.3	—	—	
トピー工業	0.1	0.1	117	
曙ブレーキ工業	0.8	0.7	95	
タチエス	0.2	0.2	227	
NOK	0.7	0.7	823	
フタバ産業	0.4	0.4	213	
大同メタル工業	0.2	0.2	94	
ブレス工業	0.7	0.6	197	
ミクニ	—	0.2	59	
太平洋工業	0.3	0.2	216	
ケーピン	0.3	—	—	
河西工業	0.1	0.2	73	
アイシン精機	1.1	1	3,185	
マツダ	4	3.7	2,401	
今仙電機製作所	0.2	0.1	90	
本田技研工業	10.3	9.8	30,556	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
スズキ	千株	千株	千円	
SUBARU	2.6	2.5	13,777	
安永	4	3.9	8,275	
ヤマハ発動機	0.1	0.1	136	
ショーワ	1.7	1.8	3,891	
TBK	0.3	—	—	
エクセディ	0.2	0.2	44	
豊田合成	0.4	0.4	266	
愛三工業	0.2	0.2	92	
日本プラスト	0.2	0.1	1,158	
ヨロズ	0.2	0.2	413	
エフ・シー・シー	0.5	0.5	948	
シマノ	0.3	0.3	12,200	
ティ・エス・テック	0.1	—	—	
ジャムコ	0.1	—	—	
精密機器 (2.7%)				
テルモ	3.6	3.5	14,539	
日機装	0.4	0.4	416	
日本エム・ディ・エム	0.1	0.1	231	
島津製作所	1.6	1.5	5,752	
JMS	—	0.1	89	
長野計器	0.2	0.1	82	
ブイ・テクノロジー	0.1	0.1	545	
東京計器	0.1	0.1	90	
インターフェクション	0.1	0.1	200	
東京精密	0.2	0.2	996	
マニー	0.5	0.5	1,293	
ニコン	0.2	0.2	1,257	
トプコン	0.7	0.6	789	
オリンパス	2.1	1.9	15,469	
理研計器	7.3	6.9	278	
タムロン	0.1	0.1	165	
HOYA	2.6	2.5	31,837	
ノーリツ鋼機	0.1	0.1	242	
エー・アンド・ディ	0.2	0.1	93	
朝日インテック	1.1	1.4	5,061	
シチズン時計	1.4	1.5	435	
大研医器	0.2	—	—	
メニコン	0.2	0.2	1,248	
松風	0.2	0.2	171	
セイコーホールディングス	0.1	0.1	277	
ニプロ	0.8	0.8	924	
その他製品 (2.8%)				
中本バックス	—	0.1	156	
スノーピーク	0.1	0.1	165	
バラマウントベッドホールディングス	0.1	0.1	432	
トランザクション	0.1	0.1	91	
ニホンフラッシュ	0.1	0.1	135	
前田工織	0.2	0.1	248	
永大産業	0.4	—	—	
アートネイチャー	0.1	0.1	65	
バンダイナムコホールディングス	1.3	1.3	12,199	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
SHOE I	千株	千株	千円	
フランスペッドホールディングス	0.1	0.1	365	
パイロットコーポレーション	0.2	0.3	257	
萩原工業	0.2	0.2	603	
トッパン・フォームズ	0.1	0.1	153	
フジシールインターナショナル	0.3	0.3	327	
タカラトミー	0.5	0.5	612	
タカノ	—	0.1	480	
プロネクサス	0.1	0.1	59	
ホクシン	—	0.5	103	
大建工業	—	0.5	54	
凸版印刷	0.1	0.1	192	
大日本印刷	1.9	1.8	2,894	
N I S S H A	1.7	1.6	3,049	
TAKARA & COMPANY	0.3	0.3	411	
アシックス	0.1	0.1	192	
ツツミ	—	1.1	2,246	
小松ウオール工業	0.1	0.1	206	
ヤマハ	0.8	0.8	171	
河合楽器製作所	0.8	0.8	5,144	
ピジョン	0.1	—	—	
キングジム	0.2	—	—	
リンテック	0.3	0.3	667	
イトーキ	0.4	0.2	69	
任天堂	0.8	0.8	46,216	
三菱鉛筆	0.2	0.2	278	
タカラスタンダード	0.3	0.3	411	
コクヨ	0.6	0.6	856	
ナカバヤシ	0.2	—	856	
グローブライド	0.1	0.1	—	
オカムラ	0.4	0.5	418	
美津濃	0.1	0.1	463	
電気・ガス業 (1.3%)	0.1	0.1	201	
東京電力ホールディングス	10.4	10	2,750	
中部電力	3.9	3.8	4,717	
関西電力	5	4.8	4,441	
中国電力	1.9	1.8	2,286	
北陸電力	1.2	1.1	760	
東北電力	3.4	3.2	2,764	
四国電力	1.1	1.1	770	
九州電力	2.6	2.6	2,238	
北海道電力	2.6	1.3	491	
沖縄電力	1.2	0.3	416	
電源開発	—	0.3	1,366	
エフオン	—	0.1	106	
イーレックス	0.2	0.2	376	
レノバ	0.3	0.2	555	
東京瓦斯	2.5	2.4	5,323	
大阪瓦斯	2.5	2.4	4,773	
東邦瓦斯	0.6	0.6	3,846	
北海道瓦斯	0.1	0.1	152	
広島ガス	0.4	0.5	91	
			182	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
西部瓦斯	千株	千株	千円	
静岡ガス	0.1	0.1	327	
メタウォーター	0.4	0.4	401	
陸運業 (3.5%)	0.1	0.1	224	
S B S ホールディングス	0.1	0.1	250	
東武鉄道	1.3	1.3	3,965	
相鉄ホールディングス	0.4	0.4	1,048	
東急	3.4	3.1	3,933	
京浜急行電鉄	1.7	1.6	2,881	
小田急電鉄	2	1.9	6,013	
京王電鉄	0.7	0.7	5,397	
京成電鉄	0.9	0.9	3,316	
富士急行	0.2	0.2	972	
新京成電鉄	0.1	—	—	
東日本旅客鉄道	2.3	2.2	15,204	
西日本旅客鉄道	1.1	1.1	5,923	
東海旅客鉄道	1.1	1	14,300	
西武ホールディングス	1.7	1.6	1,712	
鴻池運輸	0.2	0.1	104	
西日本鉄道	0.4	0.3	872	
ハマキョウレックス	0.1	0.1	287	
サカイ引越センター	0.1	0.1	523	
近鉄グループホールディングス	1.2	1.2	5,616	
阪急阪神ホールディングス	1.6	1.6	5,560	
南海電気鉄道	0.6	0.6	1,562	
京阪ホールディングス	0.6	0.5	2,480	
名古屋鉄道	1	1	2,826	
山陽電気鉄道	0.1	0.1	199	
日本通運	0.5	0.4	2,800	
ヤマトホールディングス	2.1	2	5,170	
山九	0.3	0.3	1,173	
丸全昭和運輸	0.1	0.1	342	
センコーグループホールディングス	0.7	0.6	585	
ニッコンホールディングス	0.4	0.4	824	
福山通運	0.2	0.1	442	
セイノーホールディングス	0.9	0.9	1,216	
日立物流	0.3	0.2	625	
丸和運輸機関	0.2	0.1	420	
C & F ロジホールディングス	0.1	0.1	182	
九州旅客鉄道	1.1	1	2,265	
S G ホールディングス	1.3	2.5	7,212	
海運業 (0.2%)	—	—	—	
日本郵船	1	1	2,395	
商船三井	0.7	0.7	2,063	
川崎汽船	0.4	0.4	765	
N S ユナイテッド海運	0.1	0.1	139	
明治海運	—	0.2	84	
飯野海運	0.7	0.6	253	
乾汽船	0.1	0.1	91	
空運業 (0.3%)	—	—	—	
日本航空	2.2	2.7	5,346	
ANAホールディングス	2.1	2.2	5,185	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
日新	0.1	0.1	123	
三菱倉庫	0.4	0.4	1,218	
三井倉庫ホールディングス	0.1	0.1	215	
住友倉庫	0.4	0.4	541	
瀧澤倉庫	0.1	0.1	231	
東陽倉庫	0.3	0.2	62	
日本トランシスティ	0.3	0.2	115	
中央倉庫	0.1	0.1	117	
川西倉庫	—	0.1	111	
安田倉庫	0.1	—	—	
宇德	—	0.1	47	
上組	0.7	0.7	1,299	
近鉄エクスプレス	0.2	0.3	662	
エーアイティー	0.1	0.1	97	
情報・通信業 (9.0%)				
NECネットエスアイ	0.1	0.4	687	
システム	0.5	0.4	854	
デジタルアーツ	0.1	0.1	851	
日鉄ソリューションズ	0.2	0.2	590	
キュー・システム	0.1	0.1	127	
コア	0.1	0.1	138	
ラクーンホールディングス	—	0.1	175	
ソリトンシステムズ	—	0.1	194	
ソフトクリエイトホールディングス	0.1	0.1	277	
T I S	0.4	1.2	2,397	
J N S ホールディングス	—	0.1	58	
電算システム	0.1	—	—	
グリー	0.9	0.8	456	
コーネーテクモホールディングス	0.2	0.3	1,740	
三菱総合研究所	0.1	0.1	414	
AGS	—	0.1	80	
ファインデックス	0.1	0.1	129	
K L a b	0.2	0.2	199	
ポートタウイン・ピットクルーホールディ	0.2	0.2	201	
ネクソン	3.5	3.1	9,315	
アイスタイル	0.3	0.4	164	
エムアップホールディングス	0.1	—	—	
エイチーム	0.1	0.1	111	
エニグモ	0.1	0.1	129	
テクノスジャパン	—	0.1	69	
コロプラ	0.4	0.4	366	
ブロードリーフ	0.6	0.7	476	
デジタルハーツホールディングス	0.1	0.1	123	
システム情報	—	0.1	108	
メディアドウ	0.1	—	—	
じげん	0.2	0.3	98	
ブイキュー	—	0.1	325	
フィックスターズ	0.1	0.2	198	
CARTA HOLDINGS	0.1	0.1	126	
オプティム	0.1	0.1	296	
S H I F T	—	0.1	1,382	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
ティーガイア				
日本アシアグループ	0.1	0.1	179	
豆蔵ホールディングス	—	0.1	78	
テクマトリックス	0.1	0.2	417	
ガンホー・オンライン・エクステイメント	0.3	0.3	789	
GMOペイメントゲートウェイ	0.2	0.3	4,104	
ザッパラス	—	0.2	93	
インターネットイニシアティブ	0.2	0.2	837	
さくらインターネット	0.2	0.2	136	
S R A ホールディングス	0.1	—	—	
朝日ネット	—	0.1	83	
e B A S E	0.1	0.1	104	
アバント	0.2	0.1	107	
アドソル日進	0.1	—	—	
フリービット	0.1	0.1	95	
コムチュア	0.2	0.1	307	
アステリア	—	0.1	111	
アイル	—	0.1	156	
マーカライズ	0.1	0.1	255	
メディカル・データ・ビジョン	0.1	0.1	277	
g u m i	0.2	0.2	174	
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	0.1	0.1	143	
P C I ホールディングス	—	0.1	122	
ランドコンピュータ	—	0.1	111	
オーブンドア	0.1	0.1	135	
L I N E	0.3	0.3	1,611	
カナミックネットワーク	—	0.1	77	
チエンジ	—	0.1	716	
オーケネット	0.1	0.1	137	
AOI TYO Holdings	0.2	0.2	83	
マクロミル	0.2	0.2	139	
ソルクシーズ	—	0.1	100	
プロトコーポレーション	0.1	0.1	103	
野村総合研究所	2.3	1.7	5,907	
サイバネットシステム	0.2	0.1	96	
C E ホールディングス	—	0.1	56	
インテージホールディングス	0.2	0.2	198	
東邦システムサイン	—	0.1	92	
ソースネクスト	0.5	0.7	212	
インフォコム	0.1	0.1	331	
ラクスル	—	0.1	491	
イーソル	—	0.1	128	
アルテリア・ネットワークス	0.2	0.3	453	
フォーカスシステムズ	0.1	0.1	91	
クレスコ	—	0.1	128	
フジ・メディア・ホールディングス	1.2	1.4	1,552	
オービック	0.4	0.4	8,816	
ジャストシステム	0.2	0.2	1,364	
T D C ソフト	0.1	0.1	97	
Z ホールディングス	17.4	16.9	10,356	
トレンドマイクロ	0.6	0.7	3,962	
日本オラクル	0.2	0.3	3,336	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
アルファシステムズ	0.1	—	—	
フューチャー	0.2	0.1	176	
CAC Holdings	0.1	—	—	
SBテクノロジー	0.1	—	—	
トーセ	—	0.1	85	
オーピックビジネスコンサルタント	0.1	0.1	685	
伊藤忠テクノソリューションズ	0.6	0.6	2,235	
アイティフォー	0.2	0.2	182	
エックスネット	—	0.1	97	
大塚商会	0.7	0.7	3,363	
サイボウズ	0.2	0.1	264	
電通国際情報サービス	0.1	0.1	698	
ACCESS	—	0.1	81	
デジタルガレージ	0.3	0.2	833	
EMシステムズ	0.1	0.2	165	
C I J	0.1	0.1	94	
WOWOW	0.1	0.2	564	
スカラ	0.1	0.1	80	
インテリジェント ウエイブ	—	0.1	69	
ネットワンシステムズ	0.4	0.5	1,772	
アルゴグラフィックス	0.1	0.1	299	
マーベラス	0.2	0.2	165	
エイベックス	0.2	0.2	199	
日本ユニシス	0.4	0.4	1,458	
兼松エレクトロニクス	0.1	0.1	392	
T B S ホールディングス	0.8	0.8	1,511	
日本テレビホールディングス	1.1	1.2	1,382	
朝日放送グループホールディングス	0.2	1	690	
テレビ朝日ホールディングス	0.3	0.5	831	
スカパーJ SATホールディングス	0.8	1.1	550	
テレビ東京ホールディングス	0.1	0.4	920	
日本B S放送	—	0.5	536	
ビジョン	—	0.2	200	
コネクシオ	0.1	0.1	123	
日本通信	1.1	1.9	368	
日本電信電話	8.3	16.6	42,056	
K D D I	9.9	9.1	27,017	
ソフトバンク	12.9	11.7	14,782	
光通信	0.1	0.1	2,500	
NTTドコモ	9.2	—	—	
エムティーアイ	0.1	0.2	164	
GMOインターネット	0.5	0.4	1,101	
ファイバーゲート	—	0.1	225	
KADOKAWA	0.4	0.3	970	
学研ホールディングス	—	0.2	336	
ゼンリン	0.3	0.2	248	
アイネット	0.1	—	—	
松竹	0.1	0.1	1,338	
東宝	0.8	0.7	2,908	
エヌ・ティ・ティ・データ	3.3	3.3	4,583	
D T S	0.3	0.3	660	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.6	0.5	3,135	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
シーアーシー	0.2	0.1	149	
カブコン	0.5	0.6	3,564	
ジャステック	0.1	0.1	127	
S C S K	0.3	0.3	1,797	
日本システムウエア	0.1	—	—	
アイネス	0.2	0.1	140	
T K C	0.1	0.1	678	
富士ソフト	0.2	0.1	477	
N S D	0.2	0.4	754	
コナミホールディングス	0.5	0.4	2,388	
J B C C ホールディングス	0.1	0.1	146	
ミクロ情報サービス	0.1	0.1	198	
ソフトバンクグループ	10.1	9.7	69,093	
卸売業 (4.6%)				
高千穂交易	0.1	—	—	
エレマテック	0.2	0.1	97	
あらた	0.1	0.1	487	
東京エレクトロン デバイス	—	0.1	315	
フィールズ	0.2	—	—	
双日	7	7	1,638	
アルフレッサ ホールディングス	1.4	1.4	2,835	
横浜冷凍	0.4	—	—	
ラサ商事	—	0.2	179	
アルコニックス	0.1	0.1	139	
神戸物産	0.4	0.9	3,082	
あい ホールディングス	0.2	0.2	419	
ディープイエックス	—	0.1	102	
ダイワボウホールディングス	0.1	0.1	663	
マクニカ・富士エレホールディングス	0.4	0.3	606	
バイタルケースケ・ホールディングス	0.3	0.3	256	
八洲電機	0.1	0.1	96	
レスターホールディングス	0.2	0.1	223	
ジュー・テックホールディングス	—	0.2	196	
大光	—	0.2	131	
T O K A I ホールディングス	0.6	0.8	798	
三洋貿易	0.1	0.1	97	
ワイン・パートナーズ	—	0.1	116	
シップヘルスケアホールディングス	0.3	0.2	1,022	
明治電機工業	—	0.1	139	
コメダホールディングス	0.3	0.2	371	
協栄産業	—	0.1	134	
小野建	0.1	—	—	
佐鳥電機	0.2	0.1	79	
伯東	0.1	0.1	106	
コンドーテック	0.1	0.1	102	
中山福	—	0.4	209	
ナガイレーベン	0.2	0.2	539	
三菱食品	0.1	0.2	549	
松田産業	0.1	0.1	192	
第一興商	0.2	0.2	727	
メディバルホールディングス	1.4	1.3	2,626	
S P K	—	0.1	128	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
萩原電気ホールディングス	千株	千株	千円	
アズワン	0.1	0.1	245	
シモジマ	0.1	0.1	134	
ドウシシャ	0.1	0.1	193	
小津産業	—	0.1	186	
高速	0.1	0.1	156	
たけびし	0.1	0.1	155	
リックス	—	0.1	163	
丸文	0.2	—	—	
ハビネット	0.1	0.1	143	
日本ライフライン	0.4	0.4	611	
タカショ一	—	0.1	78	
エクセル	0.1	—	—	
I DOM	0.5	0.4	224	
進和	0.1	0.1	217	
ダイトロン	0.1	—	—	
シークス	0.2	0.1	161	
オーハシテクニカ	0.1	—	—	
伊藤忠商事	9	8.7	25,251	
丸紅	13.3	12.8	8,172	
長瀬産業	0.7	0.7	1,016	
蝶理	0.1	0.1	156	
豊田通商	1.4	1.4	5,278	
三共生興	0.3	—	—	
兼松	0.5	0.4	493	
三井物産	11.2	10.7	20,437	
日本紙パルプ商事	0.1	0.1	352	
日立ハイテク	0.4	—	—	
カメイ	0.2	0.2	237	
O U G ホールディングス	—	0.1	281	
スター・ゼン	0.1	—	—	
山善	0.4	0.5	510	
住友商事	8.2	7.8	10,479	
内田洋行	0.1	—	—	
三菱商事	9	8	20,128	
第一実業	0.1	0.1	404	
キヤノンマークティングジャパン	0.3	0.3	643	
西華産業	0.1	0.1	127	
佐藤商事	0.1	—	—	
菱洋エレクトロ	0.1	0.1	268	
ユアサ商事	0.1	0.1	331	
神鋼商事	—	0.1	190	
阪和興業	0.2	0.2	509	
正栄食品工業	0.1	0.1	374	
カナデン	0.1	0.1	128	
菱電商事	0.1	—	—	
フルサト工業	0.1	0.2	251	
岩谷産業	0.3	0.3	1,662	
ナイス	—	0.1	163	
イワキ	0.3	0.2	101	
三愛石油	0.3	0.3	358	
稻畑産業	0.3	0.3	430	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
クワザワホールディングス	千株	千株	千円	
ヤマエ久野	—	0.2	114	
ワキタ	—	0.1	122	
東邦ホールディングス	0.3	0.3	336	
サンゲツ	0.4	0.4	761	
ミツワロコグループホールディングス	0.4	0.4	582	
シナネンホールディングス	0.2	0.2	265	
伊藤忠エネクス	0.1	0.1	292	
サンリオ	0.3	0.3	298	
サンワテクノス	0.4	0.3	463	
リヨーサン	—	0.1	95	
新光商事	0.1	0.1	190	
トーホー	0.2	0.2	146	
三信電気	0.1	—	—	
東陽テクニカ	0.1	0.1	216	
モスクードサービス	0.2	0.2	215	
加賀電子	0.1	0.1	541	
ソーダニッカ	—	0.2	212	
立花エレテック	0.1	0.1	107	
フォーパル	—	0.1	162	
P A L T A C	0.2	0.2	87	
三谷産業	—	0.2	1,116	
国際紙パルプ商事	0.5	—	81	
ヤマタネ	0.1	0.1	365	
日鉄物産	0.3	0.3	816	
トラスコ中山	0.5	0.5	667	
オートバックスセブン	0.1	0.1	60	
モリト	0.2	0.2	687	
加藤産業	0.1	0.1	95	
イノテック	0.2	0.2	312	
J K ホールディングス	—	0.1	82	
日伝	0.1	0.1	234	
北沢産業	—	0.3	81	
杉本商事	0.1	0.1	244	
因幡電機産業	0.4	0.4	964	
ミスミグループ本社	1.5	1.5	5,182	
アルテック	—	0.2	57	
タキヒヨー	0.1	—	—	
スズケン	0.6	0.5	1,965	
ジェコス	0.1	0.1	93	
小売業 (4.8%)				
ローソン	0.3	0.3	1,434	
サンエー	0.1	0.1	414	
カワチ薬品	0.1	0.1	293	
エービーシー・マート	0.2	0.2	1,126	
アスクル	0.1	0.1	429	
ゲオホールディングス	0.2	0.2	242	
アダストリア	0.2	0.2	363	
くら寿司	0.1	0.1	617	
キャンドゥ	0.1	0.1	186	
パルグループホールディングス	0.1	0.1	118	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
エディオン	千株	千株	千円	
0.6	0.6	608		
サーラコーポレーション	0.3	—	—	
ワッツ	—	0.1	81	
ハローズ	0.1	0.1	347	
フジオフードグループ本社	0.1	0.1	140	
ひらまつ	0.4	—	—	
ハニーズホールディングス	0.1	0.1	93	
ファーマライズホールディングス	—	0.1	77	
アルペン	0.1	0.1	232	
クオールホールディングス	0.2	0.2	210	
ジンズホールディングス	0.1	0.1	681	
ピックカメラ	0.7	0.8	888	
DCMホールディングス	0.6	0.8	900	
ペッパー・フードサービス	0.1	—	—	
Monotaro	0.9	0.9	5,058	
DDホールディングス	0.1	—	—	
アークランドサービスホールディングス	0.1	0.1	209	
J.フロントリテイリング	1.6	1.5	1,299	
ドトール・日レスホールディングス	0.2	0.2	300	
マツモトキヨシホールディングス	0.5	0.5	2,360	
プロンコビリー	0.1	—	—	
ZOZO	1.3	0.9	2,323	
ココカラファイン	0.1	0.1	766	
三越伊勢丹ホールディングス	2.3	2.1	1,186	
Hamee	—	0.1	160	
ウェルシアホールディングス	0.4	0.7	2,726	
クリエイトSDホールディングス	0.2	0.2	760	
丸善CHIホールディングス	—	0.5	180	
ショッピング	—	0.1	85	
オイシックス・ラ・大地	—	0.1	311	
ネクステージ	0.2	0.2	274	
ジョイフル本田	0.4	0.4	565	
島貴族	0.1	—	—	
キリン堂ホールディングス	0.1	—	—	
ホットランド	0.1	0.2	257	
すかいらーくホールディングス	1.4	1.4	2,304	
SFPホールディングス	0.1	0.1	128	
綿半ホールディングス	0.1	0.1	135	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	0.3	0.3	332	
ゴルフダイジェスト・オンライン	—	0.1	84	
BEENOS	0.1	0.1	263	
あさひ	0.1	0.1	158	
日本調剤	—	0.1	148	
コスモス薬品	0.1	0.1	1,672	
セブン&アイ・ホールディングス	5.1	4.8	16,814	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	0.3	0.7	418	
ツルハホールディングス	0.3	0.3	4,737	
サンマルクホールディングス	0.1	0.1	139	
トリドールホールディングス	0.2	0.3	418	
TOKYO BASE	0.1	0.1	50	
JMホールディングス	0.1	0.1	244	
アレンザホールディングス	—	0.1	127	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
パロックジャパンリミテッド	千株	千株	千円	
0.1	0.1	66		
クリスリのアオキホールディングス	0.1	0.1	869	
シローグローバルホールディングス	0.1	0.7	2,320	
LIXILビバ	0.1	—	—	
メディカルシステムネットワーク	0.2	0.1	64	
ノジマ	0.2	0.2	521	
カッパ・クリエイト	0.2	0.1	144	
良品計画	1.8	1.6	3,096	
三城ホールディングス	—	0.3	89	
アドヴァン	0.2	0.2	261	
アルビス	0.1	0.1	247	
コナカ	0.3	—	—	
G-7ホールディングス	—	0.1	230	
コジマ	0.3	0.2	139	
コーナン商事	0.2	0.2	618	
エコス	0.1	—	—	
ワタミ	0.2	0.1	90	
パン・パンifik・インターナショナル	3	2.7	6,669	
西松屋チェーン	0.3	0.3	433	
ゼンショーホールディングス	0.6	0.6	1,579	
幸楽苑ホールディングス	0.1	0.1	175	
サイゼリヤ	0.2	0.2	380	
VTHホールディングス	0.5	0.4	152	
フジ・コーポレーション	0.1	—	—	
ユナイテッドアローズ	0.2	0.1	158	
ハイディ日高	0.2	0.2	345	
コロワイド	0.4	0.4	642	
ビーシーデボコーポレーション	0.2	0.2	116	
壱番屋	0.1	0.1	511	
スギホールディングス	0.3	0.3	2,064	
薬王堂ホールディングス	0.1	0.1	242	
ヴィア・ホールディングス	0.3	—	—	
スクロール	0.3	0.2	142	
ヨンドシホールディングス	0.1	0.1	190	
ファミリーマート	1.4	—	—	
木曽路	0.2	0.2	479	
SR Sホールディングス	0.1	—	—	
千趣会	0.4	0.2	66	
リテールパートナーズ	—	0.2	280	
ケーヨー	0.2	0.3	211	
上新電機	0.1	0.1	266	
日本瓦斯	0.2	0.2	1,040	
ロイヤルホールディングス	0.2	0.2	377	
いなげや	0.1	0.2	394	
島忠	0.3	0.2	1,096	
チヨダ	0.1	0.1	93	
ライフコーポレーション	0.1	0.1	359	
リングガーハット	0.2	0.1	225	
Mr Max HD	0.3	0.2	161	
テンアライド	0.2	—	—	
AOKIホールディングス	0.2	0.3	139	
オークワ	0.2	0.2	262	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
コメリ	0.2	0.2	536	
青山商事	0.2	0.3	139	
しまむら	0.1	0.1	1,006	
高島屋	1	0.9	755	
松屋	0.3	0.2	154	
エイチ・ツー・オー リテイリング	0.7	0.6	402	
バルコ	0.1	—	—	
丸井グループ	1.1	1.1	2,099	
アクシアル リテイリング	0.1	0.1	488	
井筒屋	—	0.3	53	
イオン	4.8	4.7	14,184	
イズミ	0.3	0.3	1,108	
平和堂	0.2	0.3	641	
フジ	0.1	0.2	384	
ヤオコー	0.2	0.1	692	
ゼビオホールディングス	0.2	0.1	82	
ケーズホールディングス	1.3	1.2	1,506	
Genky Drug Stores	0.1	0.1	401	
総合メディカルホールディングス	0.1	—	—	
アインホールディングス	0.2	0.2	1,200	
ヤマダホールディングス	3.7	3.9	1,942	
アークランドサカモト	0.2	0.2	349	
ニトリホールディングス	0.5	0.5	10,407	
グルメ杵屋	0.2	0.1	99	
ケーユーホールディングス	—	0.1	80	
吉野家ホールディングス	0.4	0.4	777	
松屋フーズホールディングス	0.1	0.1	336	
サガミホールディングス	0.2	0.2	251	
関西スーパーマーケット	0.1	0.1	122	
王将フードサービス	0.1	0.1	587	
ブレナス	0.1	0.1	170	
ミニストップ	0.1	0.1	137	
アーチス	0.2	0.3	663	
バローホールディングス	0.3	0.3	769	
ベルク	0.1	0.1	618	
大庄	0.1	0.1	102	
ファーストリテイリング	0.2	0.2	17,054	
サンドラッグ	0.5	0.5	2,222	
サックスパー ホールディングス	0.2	—	—	
やまや	—	0.1	213	
ベルーナ	0.3	0.2	177	
銀行業 (4.6%)				
じもとホールディングス	1.1	0.1	89	
めぶきフィナンシャルグループ	6.4	6.5	1,371	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	0.2	0.2	230	
九州フィナンシャルグループ	2	2.6	1,253	
ゆうちょ銀行	4	3.5	2,940	
富山第一銀行	0.4	0.3	86	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	7.6	7	2,660	
西日本フィナンシャルホールディングス	0.8	0.7	529	
関西みらいフィナンシャルグループ	0.8	0.7	364	
三十三フィナンシャルグループ	0.1	0.1	128	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
第四北越フィナンシャルグループ	0.2	0.2	467	
ひろぎんホールディングス	—	1.8	1,081	
新生銀行	0.9	0.9	1,135	
あおぞら銀行	0.8	0.7	1,312	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	88.1	84.6	37,943	
りそなホールディングス	14.1	13.2	4,977	
三井住友トラスト・ホールディングス	2.4	2.3	7,304	
三井住友フィナンシャルグループ	8.9	8.5	26,197	
千葉銀行	4.3	4.2	2,494	
群馬銀行	2.5	2.6	873	
武蔵野銀行	0.2	0.1	158	
千葉興業銀行	0.4	0.3	77	
筑波銀行	0.6	0.6	118	
七十七銀行	0.4	0.4	598	
青森銀行	0.1	0.1	248	
秋田銀行	0.1	0.1	140	
山形銀行	0.1	0.1	109	
岩手銀行	0.1	0.1	217	
東邦銀行	1.2	1.1	244	
東北銀行	0.1	0.1	106	
みちのく銀行	0.1	0.1	111	
ふくおかフィナンシャルグループ	1.1	1.1	2,054	
静岡銀行	3.3	3	2,289	
十六銀行	0.2	0.2	383	
八十二銀行	3	3.3	1,227	
山梨中央銀行	0.2	0.1	76	
大垣共立銀行	0.3	0.3	677	
福井銀行	0.1	0.1	188	
北國銀行	0.1	0.1	287	
清水銀行	0.1	0.1	182	
滋賀銀行	0.3	0.3	679	
南都銀行	0.2	0.2	375	
百五銀行	1.1	1.5	468	
京都銀行	0.5	0.4	2,100	
紀陽銀行	0.4	0.4	612	
ほくほくフィナンシャルグループ	0.8	0.8	847	
広島銀行	1.8	—	—	
山陰合同銀行	0.7	0.6	333	
中国銀行	1.1	1.2	1,040	
伊予銀行	1.6	1.7	1,147	
百十四銀行	0.1	—	—	
四国銀行	0.2	0.1	69	
阿波銀行	0.2	0.2	505	
大分銀行	0.1	0.1	232	
宮崎銀行	0.1	0.1	226	
佐賀銀行	0.1	0.1	138	
沖縄銀行	0.1	0.1	291	
琉球銀行	0.3	0.2	169	
セブン銀行	4.2	3.7	806	
みずほフィナンシャルグループ	177.9	16.8	22,386	
山口フィナンシャルグループ	1.6	1.6	1,060	
長野銀行	0.1	0.1	146	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
名古屋銀行	千株	千株	千円	
北洋銀行	0.1	0.1	268	
愛知銀行	1.8	1.5	349	
中京銀行	0.1	0.1	305	
大光銀行	0.1	—	—	
愛媛銀行	0.2	0.2	213	
トマト銀行	—	0.1	105	
京葉銀行	0.6	0.4	178	
栃木銀行	0.8	0.3	54	
東和銀行	0.2	0.2	127	
大東銀行	—	0.1	62	
トモニホールディングス	1	0.8	269	
フィデアホールディングス	1.4	1.6	176	
池田泉州ホールディングス	1.4	1.4	212	
証券、商品先物取引業 (0.8%)				
F P G	0.4	0.4	207	
ジャパンインベストメントアドバイザー	—	0.1	145	
S B I ホールディングス	1.5	1.4	4,076	
ジャフコ グループ	0.2	0.2	906	
大和証券グループ本社	10	10	4,695	
野村ホールディングス	22.3	21.9	12,101	
岡三証券グループ	1.1	1.1	424	
丸三証券	0.4	0.4	188	
東洋証券	0.6	0.7	96	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1.5	1.4	438	
水戸証券	0.4	0.5	116	
いちよし証券	0.2	0.3	139	
松井証券	0.6	0.9	738	
マネックスクループ	1.2	0.9	297	
極東証券	0.2	0.2	138	
岩井コスモホールディングス	0.1	0.2	254	
藍澤證券	0.2	0.3	217	
スパークス・グループ	0.6	0.6	151	
保険業 (2.0%)				
かんぽ生命保険	0.4	0.5	929	
S O M P O ホールディングス	2.4	2.3	9,473	
アニコム ホールディングス	0.1	0.4	424	
MS&ADインシュアラントグループホールディングス	3.4	3.2	10,115	
ソニーフィナンシャルホールディングス	1	—	—	
第一生命ホールディングス	7.2	7	11,620	
東京海上ホールディングス	4.6	4.4	23,201	
T & D ホールディングス	3.9	3.7	4,517	
その他金融業 (1.1%)				
全国保険	0.4	0.3	1,414	
日本モーゲージサービス	—	0.1	114	
C a s a	0.1	—	—	
アルヒ	0.2	0.2	362	
プレミアグループ	0.1	0.1	213	
クレディセゾン	0.9	0.9	1,134	
芙蓉総合リース	0.1	0.1	651	
みずほリース	0.2	0.2	602	
東京センチュリー	0.2	0.2	1,426	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
日本証券金融	千株	千株	千円	
アイフル	0.5	0.6	312	
リコーリース	2	1.9	495	
イオンフィナンシャルサービス	0.1	0.1	300	
アコム	0.8	0.8	956	
ジャックス	2.6	2.5	1,252	
オリエントコーポレーション	0.1	0.1	183	
日立キャピタル	3.4	3.6	406	
オリックス	0.3	0.3	715	
三菱UFJリース	8.1	7.7	12,393	
日本取引所グループ	3.1	3.2	1,529	
イー・ギヤランティ	3.5	3.6	9,338	
NECキャピタルソリューション	0.1	0.1	206	
不動産業 (2.0%)				
いちご	—	1.6	1.6	528
日本駐車場開発	—	1.6	1.5	211
スター・マイカ・ホールディングス	0.1	0.1	138	
ADワークスグループ	—	0.6	94	
ヒューリック	2.7	2.6	2,865	
三栄建築設計	0.1	0.1	170	
野村不動産ホールディングス	0.8	0.7	1,610	
三重交通グループホールディングス	0.3	0.2	93	
サムティ	0.2	0.2	340	
ディア・ライフ	0.3	0.2	83	
エー・ディー・ワークス	5	—	—	
日本商業開発	0.1	0.1	169	
ブレサンスコーポレーション	0.2	—	—	
ユニゾホールディングス	0.2	—	—	
日本管理センター	0.1	0.1	124	
フージャースホールディングス	0.3	0.3	208	
オーブンハウス	0.4	0.4	1,554	
東急不動産ホールディングス	3.3	3.4	1,839	
飯田グループホールディングス	1	1.1	2,288	
イーグランド	—	0.1	76	
ビーロット	—	0.1	68	
ハウスドウ	0.1	0.1	120	
シーアールイー	—	0.1	132	
アグレ都市デザイン	—	0.1	62	
グッドコムアセット	—	0.1	154	
パーク24	0.7	0.7	1,154	
バラカ	0.1	—	—	
三井不動産	6.4	6	13,440	
三菱地所	9	8.7	15,468	
平和不動産	0.2	0.2	684	
東京建物	1.4	1.2	1,784	
ダイビル	0.4	0.3	394	
京阪神ビルディング	0.2	—	—	
住友不動産	2.9	2.8	9,934	
テオオーシー	0.3	0.2	139	
スターツコーポレーション	0.2	0.2	591	
フジ住宅	0.2	0.2	125	
空港施設	0.3	0.1	49	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
ゴールドクレスト	千株	千株	千円	
エスリード	0.1	0.1	154	
日神グループホールディングス	0.1	—	—	
日本エスコン	0.2	0.2	81	
タカラーベン	0.2	0.2	180	
AVANTIA	0.7	0.4	122	
イオンモール	0.1	—	—	
毎日コムネット	0.6	0.6	994	
ファースト住建	—	0.1	69	
ランド	0.1	0.1	103	
カチタス	—	7.7	69	
トセイ	0.1	0.3	921	
サンフロンティア不動産	0.2	0.2	239	
エフ・ジェー・ネクスト	0.1	0.1	177	
グランディハウス	—	0.2	100	
日本空港ビルディング	0.4	0.4	75	
サービス業 (5.8%)			2,564	
日本工営	0.1	—	—	
L I F U L L	0.4	0.5	187	
ミクシィ	—	0.2	502	
ジェイエイシーリクルートメント	0.1	0.1	188	
日本M&Aセンター	0.9	0.9	6,003	
メンバーズ	0.1	—	—	
UTグループ	—	0.2	647	
アイティメディア	—	0.1	221	
タケエイ	0.2	0.1	121	
E・Jホールディングス	—	0.1	102	
ピーネックスグループ	0.2	0.2	226	
コシダカホールディングス	0.3	0.3	132	
パソナグループ	0.2	0.1	190	
CDS	—	0.1	134	
リンクアンドモチベーション	0.3	0.2	118	
GCA	0.2	0.1	74	
エス・エム・エス	0.4	0.4	1,474	
パーソルホールディングス	1.2	1.2	2,410	
リニカル	0.1	—	—	
クックパッド	0.5	0.4	124	
学情	0.1	0.1	119	
スタジオアリス	0.1	0.1	197	
シミックホールディングス	0.1	0.1	136	
エブコ	—	0.1	101	
綜合警備保障	0.5	0.5	2,640	
カカクコム	0.9	0.9	2,466	
アイロムグループ	0.1	—	—	
セントケア・ホールディング	—	0.1	81	
ルネサンス	0.1	0.1	90	
ディップ	0.2	0.2	523	
デジタルホールディングス	0.1	0.1	193	
新日本科学	0.2	0.1	66	
ツクイホールディングス	0.3	0.2	105	
ベネフィット・ワン	0.3	0.4	1,232	
エムスリー	2.6	2.6	21,970	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
アウトソーシング	千株	千株	千円	
ウェルネット	0.7	0.7	999	
ワールドホールディングス	0.2	0.2	96	
ディー・エヌ・エー	0.1	—	—	
博報堂DYホールディングス	0.6	0.5	952	
ぐるなび	1.7	1.7	2,618	
タカミヤ	0.2	0.2	104	
ジャパンベストレスキューシステム	0.1	0.1	110	
ファンコミュニケーションズ	0.4	0.3	89	
ライク	0.1	—	130	
ビジネス・ブレークスルー	—	0.1	—	
エスブル	0.4	0.3	41	
WD Bホールディングス	0.1	0.1	215	
バリューコマース	0.1	0.1	268	
インフォマート	0.1	1.2	339	
J Pホールディングス	0.7	1.2	1,170	
E P Sホールディングス	0.6	0.4	112	
プレステージ・インターナショナル	0.2	0.2	198	
アミューズ	0.4	0.5	481	
クイック	0.1	0.1	255	
ケネディクス	0.1	0.1	114	
電通グループ	1.2	1	750	
シーティーエス	1.3	1.3	4,569	
H. U. グループホールディングス	0.2	0.1	94	
アルブス技研	0.3	0.2	1,140	
サニックス	0.1	0.1	216	
日本空調サービス	—	—	55	
オリエンタルランド	0.1	—	—	
ダスキン	1.4	1.3	23,237	
明光ネットワークジャパン	0.3	0.3	820	
フルコホールディングス	0.2	0.2	111	
ラウンドワン	0.1	0.1	164	
リゾートトラスト	0.4	0.3	279	
ビー・エム・エル	0.5	0.6	994	
りらいあコミュニケーションズ	0.2	0.2	662	
リゾー教育	0.2	0.2	257	
早稻田アカデミー	0.7	0.7	214	
ユー・エス・エス	—	0.1	96	
サイバーエージェント	1.4	1.3	2,697	
楽天	0.7	0.7	4,774	
クリーク・アンド・リバー社	—	—	5,583	
モーニングスター	0.1	0.1	102	
テー・オー・ダブリュー	0.1	—	44	
山田コンサルティンググループ	0.1	0.1	—	
セントラルスポーツ	0.1	—	97	
フルキャストホールディングス	0.1	0.1	—	
エン・ジャパン	0.2	0.2	173	
テクノプロ・ホールディングス	0.2	0.2	684	
アイ・アールジャパンホールディングス	0.1	—	1,646	
K e e P e r技研	0.1	0.1	—	
G u n o s y	0.1	0.1	208	
イー・ガーディアン	0.1	0.1	73	
	—	—	299	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
ジャパンマテリアル	0.3	0.4	580	
ベクトル	0.2	0.2	183	
ウチヤマホールディングス	—	0.4	120	
チャーム・ケア・コーポレーション	—	0.1	117	
I B J	0.1	0.1	79	
アサンテ	0.1	—	—	
N・フィールド	—	0.1	74	
M&Aキャピタルパートナーズ	0.1	0.1	627	
ライドオンエクスプレスホールディングス	0.1	0.1	194	
シグマクシス	0.1	0.1	174	
ワイルグループ	—	0.1	99	
エスクロー・エージェント・ジャパン	—	0.2	61	
メドビア	—	0.1	637	
リクルートホールディングス	8.8	8.6	34,881	
エラン	0.1	0.1	300	
日本郵政	10.2	9.8	7,633	
ベルシステム24ホールディングス	0.2	0.2	336	
鎌倉新書	0.1	0.1	101	
エアトリ	0.1	0.1	132	
ストライク	0.1	—	—	
ソラスト	0.3	0.3	436	
インソース	0.1	0.1	329	
ペイカレント・コンサルティング	0.1	0.1	1,576	
アイモバイル	—	0.1	115	
M S - J a p a n	0.1	—	—	
グレイステクノロジー	—	0.1	718	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	0.1	0.1	461	
グリーンズ	0.1	—	—	
G a m e W i t h	—	0.1	59	
日総工産	0.1	0.1	75	
キュービーネットホールディングス	0.1	—	—	
R P A ホールディングス	0.1	0.1	63	
スプリックス	0.1	—	—	
マネジメントソリューションズ	—	0.1	137	
カーブスホールディングス	—	0.4	308	
フォーラムエンジニアリング	—	0.1	81	
ダイレクトマーケティングミックス	—	0.1	278	
アドバンテッジリスクマネジメント	—	0.1	67	
リログループ	0.7	0.7	1,898	
東洋	0.1	0.1	157	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
エイチ・アイ・エス	0.2	0.2	336	
ラックランド	0.1	—	—	
共立メンテナンス	0.2	0.2	786	
イチネンホールディングス	0.2	0.1	126	
建設技術研究所	0.1	0.1	210	
スペース	0.1	0.1	79	
燐ホールディングス	0.2	0.1	119	
タナベ経営	—	0.1	130	
東京都競馬	0.1	0.1	502	
常磐興産	0.1	—	—	
カナモト	0.2	0.2	453	
東京ドーム	0.5	0.5	684	
西尾レントオール	0.1	0.1	211	
トランス・コスモス	0.1	0.1	264	
乃村工藝社	0.6	0.5	402	
藤田観光	0.1	0.1	150	
KNT-C T ホールディングス	0.1	0.1	98	
日本管財	0.1	0.2	404	
トーカイ	0.1	0.1	205	
セコム	1.3	1.3	12,688	
セントラル警備保障	0.1	0.1	363	
丹青社	0.2	0.3	234	
マイティック	0.1	0.1	505	
応用地質	0.1	0.2	242	
船井総研ホールディングス	0.2	0.2	504	
オオバ	0.2	0.1	75	
ベネッセホールディングス	0.4	0.4	868	
イオンディライト	0.1	0.2	511	
ナック	0.1	0.1	93	
ニチイ学館	0.2	—	—	
ダイセキ	0.2	0.2	607	
合計	株数	・ 金額	千株	千円
	銘柄数	＜比率＞	1,510	1,317 3,050,689
			1,518	1,536 〈96.6%〉

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注2) 評価額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注4) 一印は組み入れなし。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

(2020年12月7日現在)

銘柄名	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
株式先物取引		
TOPIX	88	—

(注1) 単位未満は切り捨て。

(注2) 一印は組み入れなし。

* 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
株式	千円	%
コール・ローン等、その他	3,050,689	96.3
投資信託財産総額	115,992	3.7
	3,166,681	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨て。

* 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	3,166,681,979円
コード・ローン等	105,656,948
株式(評価額)	3,050,689,490
未収入金	7,242,300
未収配当金	5,563,241
差入委託証拠金	△ 2,470,000
(B) 負債	8,275,650
未払解約金	8,275,361
未払利息	289
(C) 純資産額(A-B)	3,158,406,329
元本	1,571,386,505
次期繰越損益金	1,587,019,824
(D) 受益権総口数	1,571,386,505口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,099円

(注)当期

期首元本額	1,692,214,087円
期中追加設定元本額	250,912,595円
期中一部解約元本額	371,740,177円
計算口数当たり純資産額	2,0099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グッドライフ2020(年金)	15,620,453円
PRUグッドライフ2030(年金)	292,726,966円
PRUグッドライフ2040(年金)	350,162,781円
PRUグッドライフ2050(年金)	66,105,209円
ブルデンシャル私募国内株式マーケット・パフォーマー(適格機関投資家向け)	843,618,643円
ブルデンシャル私募国内株式・債券バランスファンド(適格機関投資家向け)	3,152,453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	66,367,119円
受取配当金	66,442,054
その他の収益金	13,523
支払利息	△ 88,458
(B) 有価証券売買損益	78,264,211
売買益	408,767,949
売買損	△ 330,503,738
(C) 先物取引等取引損益	5,609,600
取引益	27,567,800
取引損	△ 21,958,200
(D) 信託報酬等	△ 473
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	150,240,457
(F) 前期繰越損益金	1,533,199,846
(G) 追加信託差損益金	205,001,550
(H) 解約差損益金	△ 301,422,029
(I) 計(Е+F+G+H)	1,587,019,824
次期繰越損益金(I)	1,587,019,824

(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算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。

〈PRU国内債券マザーファンド〉

運用状況について

「PRU国内債券マザーファンド」は、「PRUグッドライフ2040（年金）」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		NOMURA-BPI(総合)	債券組入率	純資産額
	期	騰落率			
16期（2016年12月5日）	円 13,424	% 4.2	381.70	% 4.2	% 99.4 百万円 6,405
17期（2017年12月5日）	13,353	△0.5	379.79	△0.5	98.9 6,176
18期（2018年12月5日）	13,426	0.5	381.82	0.5	98.5 5,768
19期（2019年12月5日）	13,733	2.3	390.56	2.3	99.3 6,047
20期（2020年12月7日）	13,616	△0.9	387.31	△0.8	99.4 4,923

* 当期中の基準価額と市況推移 *

年月日	基準価額		NOMURA-BPI(総合)	騰落率	債券組入率
	騰	落			
(期首) 2019年12月5日	円 13,733	% —	390.56	% —	% 99.3
12月末	13,715	△0.1	390.14	△0.1	99.6
2020年1月末	13,773	0.3	391.77	0.3	99.0
2月末	13,881	1.1	394.74	1.1	98.9
3月末	13,659	△0.5	388.45	△0.5	98.9
4月末	13,704	△0.2	389.79	△0.2	98.9
5月末	13,645	△0.6	388.13	△0.6	98.9
6月末	13,590	△1.0	386.56	△1.0	99.0
7月末	13,638	△0.7	387.91	△0.7	99.1
8月末	13,574	△1.2	386.09	△1.1	99.0
9月末	13,614	△0.9	387.22	△0.9	98.8
10月末	13,591	△1.0	386.63	△1.0	98.7
11月末	13,609	△0.9	387.12	△0.9	99.0
(期末) 2020年12月7日	13,616	△0.9	387.31	△0.8	99.4

(注) 謙落率は期首比です。

※NOMURA-BPI（総合）とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI（総合）の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

*** 1万口当たりの費用明細***

当期における費用はありません。

*** 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)****公社債**

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 420,193	千円 1,364,429
	地方債証券	10,018	— (50,000)
	特殊債券	9,676	— (10,000)
	社債券(投資法人債券を含む)	—	— (30,000)

(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。

(注4) 社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)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
第359回 利付国債(10年)	千円 50,336	第139回 利付国債(5年)	千円 70,557
第357回 利付国債(10年)	40,839	第345回 利付国債(10年)	55,704
第358回 利付国債(10年)	40,418	第327回 利付国債(10年)	51,028
第413回 利付国債(2年)	40,190	第353回 利付国債(10年)	50,649
第142回 利付国債(5年)	30,481	第140回 利付国債(5年)	50,428
第360回 利付国債(10年)	30,198	第135回 利付国債(5年)	50,292
第171回 利付国債(20年)	20,402	第129回 利付国債(5年)	50,261
第144回 利付国債(5年)	20,166	第128回 利付国債(5年)	45,144
第65回 利付国債(30年)	15,344	第341回 利付国債(10年)	40,849
第172回 利付国債(20年)	15,139	第316回 利付国債(10年)	40,535

(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) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

*** 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

国内(邦貨建)公社債

(2020年12月7日現在)

作成期	当期					末		
	区分	額面金額	評価額	組入比率	うちB 格組 入比	残存期間別	組入比率	
					以 下 率	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	千円	千円	%	%	%	%	%	%
	3,655,000 (30,000)	4,002,355 (34,641)	81.3 (0.7)	— (—)	57.5 (0.7)	19.7 (—)	4.1 (—)	4.1 (—)
地方債証券	413,000 (413,000)	430,822 (430,822)	8.8 (8.8)	— (—)	4.8 (4.8)	2.3 (2.3)	1.7 (1.7)	
特殊債券 (除く金融債)	315,000 (315,000)	331,206 (331,206)	6.7 (6.7)	— (—)	3.4 (3.4)	1.4 (1.4)	1.8 (1.8)	
金融債券	10,000 (10,000)	9,999 (9,999)	0.2 (0.2)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	0.2 (0.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	115,000 (110,000)	118,495 (113,350)	2.4 (2.3)	— (—)	0.4 (0.4)	1.3 (1.3)	0.7 (0.6)	
合計	4,508,000 (878,000)	4,892,879 (920,020)	99.4 (18.7)	— (—)	66.1 (9.3)	24.7 (5.0)	8.5 (4.3)	

(注1) () 内は非上場債で内書きです。

(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) 一印は組み入れなし。

(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

国内(邦貨建)公社債

(2020年12月7日現在)

作成期	当期					末	
	種類	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
国債証券	第413回 利付国債(2年)		%	2022/6/1	40,000	40,148	
	第131回 利付国債(5年)		0.1	2022/3/20	20,000	20,057	
	第132回 利付国債(5年)		0.1	2022/6/20	20,000	20,072	
	第133回 利付国債(5年)		0.1	2022/9/20	20,000	20,089	
	第134回 利付国債(5年)		0.1	2022/12/20	40,000	40,203	
	第135回 利付国債(5年)		0.1	2023/3/20	20,000	20,112	
	第136回 利付国債(5年)		0.1	2023/6/20	30,000	30,182	
	第137回 利付国債(5年)		0.1	2023/9/20	25,000	25,171	
	第138回 利付国債(5年)		0.1	2023/12/20	40,000	40,298	
	第141回 利付国債(5年)		0.1	2024/9/20	35,000	35,326	
	第142回 利付国債(5年)		0.1	2024/12/20	30,000	30,291	
	第143回 利付国債(5年)		0.1	2025/3/20	10,000	10,101	
	第144回 利付国債(5年)		0.1	2025/6/20	20,000	20,209	
	第26回 利付国債(30年)		2.4	2037/3/20	10,000	13,394	
	第1回 利付国債(40年)		2.4	2048/3/20	5,000	7,298	
	第2回 利付国債(40年)		2.2	2049/3/20	10,000	14,159	
	第3回 利付国債(40年)		2.2	2050/3/20	5,000	7,098	

作成期	当期	期末			
種類	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
国債証券	第4回 利付国債(40年)	%	2051/3/20	10,000	14,245
	第5回 利付国債(40年)	2.2	2052/3/20	10,000	13,796
	第6回 利付国債(40年)	2.0	2053/3/20	10,000	13,607
	第7回 利付国債(40年)	1.9	2054/3/20	10,000	13,087
	第8回 利付国債(40年)	1.7	2055/3/20	10,000	12,239
	第9回 利付国債(40年)	1.4	2056/3/20	20,000	18,302
	第10回 利付国債(40年)	0.4	2057/3/20	15,000	16,100
	第11回 利付国債(40年)	0.9	2058/3/20	15,000	15,628
	第12回 利付国債(40年)	0.5	2059/3/20	15,000	14,115
	第13回 利付国債(40年)	0.5	2060/3/20	10,000	9,398
	第321回 利付国債(10年)	1.0	2022/3/20	25,000	25,360
	第323回 利付国債(10年)	0.9	2022/6/20	20,000	20,317
	第325回 利付国債(10年)	0.8	2022/9/20	45,000	45,756
	第326回 利付国債(10年)	0.7	2022/12/20	40,000	40,684
	第328回 利付国債(10年)	0.6	2023/3/20	40,000	40,676
	第329回 利付国債(10年)	0.8	2023/6/20	40,000	40,955
	第330回 利付国債(10年)	0.8	2023/9/20	35,000	35,919
	第331回 利付国債(10年)	0.6	2023/9/20	40,000	40,826
	第332回 利付国債(10年)	0.6	2023/12/20	35,000	35,788
	第333回 利付国債(10年)	0.6	2024/3/20	20,000	20,484
	第334回 利付国債(10年)	0.6	2024/6/20	45,000	46,173
	第335回 利付国債(10年)	0.5	2024/9/20	35,000	35,844
	第336回 利付国債(10年)	0.5	2024/12/20	15,000	15,386
	第337回 利付国債(10年)	0.3	2024/12/20	20,000	20,352
	第338回 利付国債(10年)	0.4	2025/3/20	35,000	35,805
	第339回 利付国債(10年)	0.4	2025/6/20	30,000	30,717
	第340回 利付国債(10年)	0.4	2025/9/20	35,000	35,866
	第342回 利付国債(10年)	0.1	2026/3/20	25,000	25,272
	第343回 利付国債(10年)	0.1	2026/6/20	30,000	30,342
	第344回 利付国債(10年)	0.1	2026/9/20	40,000	40,465
	第346回 利付国債(10年)	0.1	2027/3/20	40,000	40,505
	第347回 利付国債(10年)	0.1	2027/6/20	45,000	45,576
	第348回 利付国債(10年)	0.1	2027/9/20	40,000	40,518
	第349回 利付国債(10年)	0.1	2027/12/20	30,000	30,403
	第350回 利付国債(10年)	0.1	2028/3/20	40,000	40,542
	第351回 利付国債(10年)	0.1	2028/6/20	40,000	40,530
	第352回 利付国債(10年)	0.1	2028/9/20	45,000	45,580
	第354回 利付国債(10年)	0.1	2029/3/20	20,000	20,249
	第355回 利付国債(10年)	0.1	2029/6/20	40,000	40,479
	第356回 利付国債(10年)	0.1	2029/9/20	25,000	25,286
	第357回 利付国債(10年)	0.1	2029/12/20	40,000	40,434
	第358回 利付国債(10年)	0.1	2030/3/20	40,000	40,389
	第359回 利付国債(10年)	0.1	2030/6/20	20,000	20,181
	第360回 利付国債(10年)	0.1	2030/9/20	30,000	30,234

作成期	当	期	末		
種類	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
国債証券	第6回 利付国債(30年)	%		千円	千円
	第8回 利付国債(30年)	2.4	2031/11/20	10,000	12,552
	第10回 利付国債(30年)	1.8	2032/11/22	10,000	12,022
	第13回 利付国債(30年)	1.1	2033/3/20	5,000	5,603
	第15回 利付国債(30年)	2.0	2033/12/20	10,000	12,404
	第17回 利付国債(30年)	2.5	2034/6/20	5,000	6,562
	第18回 利付国債(30年)	2.4	2034/12/20	10,000	13,074
	第19回 利付国債(30年)	2.3	2035/3/20	10,000	12,969
	第20回 利付国債(30年)	2.3	2035/6/20	5,000	6,501
	第21回 利付国債(30年)	2.5	2035/9/20	5,000	6,665
	第22回 利付国債(30年)	2.3	2035/12/20	5,000	6,537
	第23回 利付国債(30年)	2.5	2036/3/20	10,000	13,400
	第25回 利付国債(30年)	2.5	2036/6/20	5,000	6,722
	第27回 利付国債(30年)	2.3	2036/12/20	10,000	13,200
	第28回 利付国債(30年)	2.5	2037/9/20	15,000	20,436
	第29回 利付国債(30年)	2.4	2038/3/20	15,000	20,539
	第30回 利付国債(30年)	2.4	2038/9/20	15,000	20,369
	第31回 利付国債(30年)	2.3	2039/3/20	15,000	20,198
	第32回 利付国債(30年)	2.2	2039/9/20	15,000	20,014
	第33回 利付国債(30年)	2.3	2040/3/20	15,000	20,374
	第34回 利付国債(30年)	2.0	2040/9/20	25,000	32,662
	第35回 利付国債(30年)	2.2	2041/3/20	20,000	26,980
	第36回 利付国債(30年)	2.0	2041/9/20	20,000	26,291
	第37回 利付国債(30年)	2.0	2042/3/20	20,000	26,378
	第38回 利付国債(30年)	1.9	2042/9/20	15,000	19,547
	第39回 利付国債(30年)	1.8	2043/3/20	15,000	19,295
	第40回 利付国債(30年)	1.9	2043/6/20	10,000	13,086
	第42回 利付国債(30年)	1.8	2043/9/20	15,000	19,324
	第43回 利付国債(30年)	1.7	2044/3/20	15,000	19,031
	第44回 利付国債(30年)	1.7	2044/6/20	10,000	12,700
	第45回 利付国債(30年)	1.7	2044/9/20	10,000	12,712
	第46回 利付国債(30年)	1.5	2044/12/20	15,000	18,415
	第47回 利付国債(30年)	1.5	2045/3/20	15,000	18,427
	第48回 利付国債(30年)	1.6	2045/6/20	10,000	12,513
	第49回 利付国債(30年)	1.4	2045/9/20	15,000	18,076
	第50回 利付国債(30年)	1.4	2045/12/20	10,000	12,055
	第51回 利付国債(30年)	0.8	2046/3/20	15,000	15,956
	第53回 利付国債(30年)	0.3	2046/6/20	15,000	14,160
	第54回 利付国債(30年)	0.6	2046/12/20	15,000	15,187
	第55回 利付国債(30年)	0.8	2047/3/20	15,000	15,897
	第56回 利付国債(30年)	0.8	2047/6/20	10,000	10,591
	第57回 利付国債(30年)	0.8	2047/9/20	10,000	10,583
	第58回 利付国債(30年)	0.8	2047/12/20	15,000	15,863
	第59回 利付国債(30年)	0.8	2048/3/20	15,000	15,833
	第59回 利付国債(30年)	0.7	2048/6/20	20,000	20,594

作成期	当期				末
種類	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
	第60回 利付国債 (30年)	0.9	2048/9/20	10,000	10,791
	第61回 利付国債 (30年)	0.7	2048/12/20	10,000	10,264
	第62回 利付国債 (30年)	0.5	2049/3/20	5,000	4,867
	第63回 利付国債 (30年)	0.4	2049/6/20	15,000	14,182
	第64回 利付国債 (30年)	0.4	2049/9/20	15,000	14,142
	第66回 利付国債 (30年)	0.4	2050/3/20	15,000	14,094
	第67回 利付国債 (30年)	0.6	2050/6/20	15,000	14,850
	第68回 利付国債 (30年)	0.6	2050/9/20	10,000	9,887
	第55回 利付国債 (20年)	2.0	2022/3/21	10,000	10,272
	第59回 利付国債 (20年)	1.7	2022/12/20	10,000	10,375
	第60回 利付国債 (20年)	1.4	2022/12/20	10,000	10,313
	第61回 利付国債 (20年)	1.0	2023/3/20	10,000	10,260
	第62回 利付国債 (20年)	0.8	2023/6/20	10,000	10,238
	第63回 利付国債 (20年)	1.8	2023/6/20	10,000	10,492
	第64回 利付国債 (20年)	1.9	2023/9/20	10,000	10,570
	第66回 利付国債 (20年)	1.8	2023/12/20	10,000	10,590
	第67回 利付国債 (20年)	1.9	2024/3/20	10,000	10,672
	第68回 利付国債 (20年)	2.2	2024/3/20	10,000	10,770
	第70回 利付国債 (20年)	2.4	2024/6/20	20,000	21,799
	第71回 利付国債 (20年)	2.2	2024/6/20	10,000	10,828
	第72回 利付国債 (20年)	2.1	2024/9/20	10,000	10,847
	第73回 利付国債 (20年)	2.0	2024/12/20	10,000	10,863
	第75回 利付国債 (20年)	2.1	2025/3/20	10,000	10,959
	第76回 利付国債 (20年)	1.9	2025/3/20	5,000	5,436
	第77回 利付国債 (20年)	2.0	2025/3/20	10,000	10,916
	第78回 利付国債 (20年)	1.9	2025/6/20	5,000	5,460
	第79回 利付国債 (20年)	2.0	2025/6/20	10,000	10,965
	第80回 利付国債 (20年)	2.1	2025/6/20	20,000	22,022
	第81回 利付国債 (20年)	2.0	2025/9/20	15,000	16,521
	第82回 利付国債 (20年)	2.1	2025/9/20	10,000	11,062
	第84回 利付国債 (20年)	2.0	2025/12/20	20,000	22,130
	第85回 利付国債 (20年)	2.1	2026/3/20	10,000	11,170
	第86回 利付国債 (20年)	2.3	2026/3/20	10,000	11,276
	第87回 利付国債 (20年)	2.2	2026/3/20	10,000	11,223
	第88回 利付国債 (20年)	2.3	2026/6/20	10,000	11,338
	第89回 利付国債 (20年)	2.2	2026/6/20	10,000	11,282
	第90回 利付国債 (20年)	2.2	2026/9/20	15,000	17,006
	第91回 利付国債 (20年)	2.3	2026/9/20	5,000	5,698
	第92回 利付国債 (20年)	2.1	2026/12/20	15,000	17,002
	第93回 利付国債 (20年)	2.0	2027/3/20	10,000	11,327
	第94回 利付国債 (20年)	2.1	2027/3/20	15,000	17,085
	第95回 利付国債 (20年)	2.3	2027/6/20	10,000	11,570
	第96回 利付国債 (20年)	2.1	2027/6/20	20,000	22,877
	第99回 利付国債 (20年)	2.1	2027/12/20	20,000	23,091

作成期	当期	期末			
種類	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第100回 利付国債 (20年)	2.2	2028/3/20	15,000	17,504
	第101回 利付国債 (20年)	2.4	2028/3/20	10,000	11,815
	第102回 利付国債 (20年)	2.4	2028/6/20	10,000	11,870
	第103回 利付国債 (20年)	2.3	2028/6/20	5,000	5,897
	第104回 利付国債 (20年)	2.1	2028/6/20	10,000	11,642
	第105回 利付国債 (20年)	2.1	2028/9/20	10,000	11,689
	第106回 利付国債 (20年)	2.2	2028/9/20	15,000	17,650
	第107回 利付国債 (20年)	2.1	2028/12/20	10,000	11,738
	第108回 利付国債 (20年)	1.9	2028/12/20	5,000	5,788
	第109回 利付国債 (20年)	1.9	2029/3/20	10,000	11,621
	第110回 利付国債 (20年)	2.1	2029/3/20	10,000	11,787
	第111回 利付国債 (20年)	2.2	2029/6/20	10,000	11,917
	第112回 利付国債 (20年)	2.1	2029/6/20	10,000	11,831
	第113回 利付国債 (20年)	2.1	2029/9/20	25,000	29,689
	第114回 利付国債 (20年)	2.1	2029/12/20	10,000	11,918
	第115回 利付国債 (20年)	2.2	2029/12/20	5,000	6,004
	第116回 利付国債 (20年)	2.2	2030/3/20	15,000	18,070
	第117回 利付国債 (20年)	2.1	2030/3/20	20,000	23,908
	第118回 利付国債 (20年)	2.0	2030/6/20	10,000	11,900
	第119回 利付国債 (20年)	1.8	2030/6/20	10,000	11,710
	第120回 利付国債 (20年)	1.6	2030/6/20	15,000	17,279
	第121回 利付国債 (20年)	1.9	2030/9/20	10,000	11,835
	第122回 利付国債 (20年)	1.8	2030/9/20	10,000	11,738
	第123回 利付国債 (20年)	2.1	2030/12/20	15,000	18,105
	第124回 利付国債 (20年)	2.0	2030/12/20	10,000	11,970
	第125回 利付国債 (20年)	2.2	2031/3/20	5,000	6,108
	第126回 利付国債 (20年)	2.0	2031/3/20	5,000	6,006
	第127回 利付国債 (20年)	1.9	2031/3/20	10,000	11,910
	第128回 利付国債 (20年)	1.9	2031/6/20	5,000	5,972
	第129回 利付国債 (20年)	1.8	2031/6/20	15,000	17,759
	第130回 利付国債 (20年)	1.8	2031/9/20	10,000	11,877
	第131回 利付国債 (20年)	1.7	2031/9/20	10,000	11,769
	第132回 利付国債 (20年)	1.7	2031/12/20	15,000	17,696
	第134回 利付国債 (20年)	1.8	2032/3/20	5,000	5,968
	第135回 利付国債 (20年)	1.7	2032/3/20	5,000	5,912
	第136回 利付国債 (20年)	1.6	2032/3/20	5,000	5,856
	第137回 利付国債 (20年)	1.7	2032/6/20	5,000	5,925
	第138回 利付国債 (20年)	1.5	2032/6/20	5,000	5,811
	第139回 利付国債 (20年)	1.6	2032/6/20	10,000	11,736
	第141回 利付国債 (20年)	1.7	2032/12/20	10,000	11,909
	第142回 利付国債 (20年)	1.8	2032/12/20	15,000	18,042
	第143回 利付国債 (20年)	1.6	2033/3/20	20,000	23,624
	第144回 利付国債 (20年)	1.5	2033/3/20	15,000	17,536
	第145回 利付国債 (20年)	1.7	2033/6/20	20,000	23,930

作成期	当期	末			
種類	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
国債証券	第146回 利付国債 (20年)	%		千円	千円
	第147回 利付国債 (20年)	1.7	2033/ 9/ 20	35,000	41,962
	第148回 利付国債 (20年)	1.6	2033/12/20	5,000	5,941
	第149回 利付国債 (20年)	1.5	2034/ 3/ 20	20,000	23,546
	第150回 利付国債 (20年)	1.5	2034/ 6/ 20	25,000	29,476
	第151回 利付国債 (20年)	1.4	2034/ 9/ 20	25,000	29,180
	第152回 利付国債 (20年)	1.2	2034/12/20	25,000	28,529
	第153回 利付国債 (20年)	1.3	2035/ 6/ 20	20,000	23,139
	第154回 利付国債 (20年)	1.2	2035/ 9/ 20	25,000	28,589
	第155回 利付国債 (20年)	1.0	2035/12/20	15,000	16,726
	第156回 利付国債 (20年)	0.4	2036/ 3/ 20	5,000	5,125
	第157回 利付国債 (20年)	0.2	2036/ 6/ 20	20,000	19,880
	第158回 利付国債 (20年)	0.5	2036/ 9/ 20	20,000	20,774
	第159回 利付国債 (20年)	0.6	2036/12/20	5,000	5,265
	第160回 利付国債 (20年)	0.7	2037/ 3/ 20	25,000	26,718
	第161回 利付国債 (20年)	0.6	2037/ 6/ 20	15,000	15,783
	第162回 利付国債 (20年)	0.6	2037/ 9/ 20	25,000	26,282
	第164回 利付国債 (20年)	0.5	2038/ 3/ 20	15,000	15,492
	第165回 利付国債 (20年)	0.5	2038/ 6/ 20	20,000	20,631
	第166回 利付国債 (20年)	0.7	2038/ 9/ 20	20,000	21,296
	第167回 利付国債 (20年)	0.5	2038/12/20	15,000	15,433
	第168回 利付国債 (20年)	0.4	2039/ 3/ 20	15,000	15,154
	第170回 利付国債 (20年)	0.3	2039/ 9/ 20	20,000	19,788
	第171回 利付国債 (20年)	0.3	2039/12/20	10,000	9,884
	第172回 利付国債 (20年)	0.4	2040/ 3/ 20	15,000	15,080
	第173回 利付国債 (20年)	0.4	2040/ 6/ 20	15,000	15,054
	第174回 利付国債 (20年)	0.4	2040/ 9/ 20	5,000	5,013
小計				3,655,000	4,002,355
地方債証券	第715回 東京都公募公債	0.76	2022/12/20	20,000	20,307
	第733回 東京都公募公債	0.581	2024/ 6/ 20	10,000	10,201
	第762回 東京都公募公債	0.175	2026/12/18	10,000	10,069
	平成29年度第15回 北海道公募公債	0.23	2028/ 2/ 28	10,000	10,096
	第4回 神奈川県公募公債 (30年)	2.62	2038/ 3/ 19	10,000	13,731
	第10回 大阪府公募公債 (20年)	1.72	2032/ 9/ 24	10,000	11,757
	第13回 大阪府公募公債 (20年)	1.203	2035/ 9/ 28	10,000	11,265
	平成27年度第13回 京都府公募公債	0.11	2026/ 3/ 17	10,000	10,034
	平成30年度第13回 京都府公募公債	0.165	2029/ 3/ 19	10,000	10,065
	第5回 兵庫県公募公債 (15年)	1.31	2028/ 5/ 26	10,000	10,905
	第9回 兵庫県公募公債 (15年)	1.02	2029/ 7/ 13	10,000	10,784
	第12回 静岡県公募公債 (20年)	2.003	2031/ 6/ 20	10,000	11,909
	平成28年度第1回 静岡県公募公債	0.08	2026/ 3/ 19	10,000	10,018
	平成23年度第5回 広島県公募公債	0.99	2022/ 1/ 27	20,000	20,223
	平成28年度第9回 埼玉県公募公債	0.249	2027/ 2/ 24	10,000	10,117
	平成29年度第8回 福岡県公募公債	0.23	2028/ 2/ 25	10,000	10,111
	第16回 千葉県公募公債 (20年)	1.555	2034/ 4/ 14	10,000	11,702

作成期	当期	末			
種類	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
地方債証券	平成25年度第10回 千葉県公募公債	%		千円	千円
	平成25年度第1回 新潟県公募公債	0.75	2024/1/25	10,000	10,232
	平成30年度第1回 岐阜県公募公債(10年)	0.65	2023/11/29	10,000	10,190
	平成26年度第1回 大分県公募公債	0.289	2028/10/31	10,000	10,165
	第149回 共同発行市場公募地方債	0.539	2024/10/31	10,000	10,206
	第153回 共同発行市場公募地方債	0.5	2025/8/25	10,000	10,230
	第201回 共同発行市場公募地方債	0.469	2025/12/25	10,000	10,226
	平成25年度第2回 島根県公募公債	0.115	2029/12/25	10,000	9,999
	平成24年度第1回 静岡市公募公債	0.67	2023/11/27	10,000	10,196
	第488回 名古屋市公募公債(10年)	0.82	2022/11/22	20,000	20,319
	平成23年度第4回 京都市公募公債	0.598	2024/9/20	10,000	10,222
	第12回 横浜市公募公債(20年)	1.067	2021/12/22	10,000	10,110
	第89回 川崎市公募公債	2.22	2027/3/19	10,000	11,351
	平成22年度第2回 北九州市公募公債	0.16	2026/12/18	10,000	10,060
	平成23年度第9回 福岡市公募公債	1.26	2020/12/24	11,000	11,006
	平成26年度第2回 広島市公募公債	1.01	2022/3/28	10,000	10,130
	平成22年度第2回 福井県公募公債	0.456	2024/12/25	12,000	12,216
	平成27年度第1回 岡山市公募公債(10年)	1.4	2021/4/23	10,000	10,052
	第50回 地方公共団体金融機関債券(20年)	0.395	2026/1/29	10,000	10,179
	第51回 地方公共団体金融機関債券	0.53	2036/3/28	10,000	10,261
	第122回 地方公共団体金融機関債券	0.841	2023/8/28	10,000	10,223
		0.065	2029/7/27	10,000	9,940
小計				413,000	430,822
特殊債券(除く金融債)	第168回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.839	2022/7/29	10,000	10,142
	第180回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.734	2022/12/28	10,000	10,151
	第186回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	2023/3/17	10,000	10,152
	第209回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.747	2024/1/31	10,000	10,234
	第263回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.379	2025/12/26	10,000	10,186
	第306回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	2027/3/31	10,000	10,085
	第315回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.13	2027/6/30	10,000	10,075
	第345回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.12	2028/4/28	10,000	10,072
	第37回 政府保証地方公共団体金融機関債券	0.895	2022/6/17	10,000	10,141
	第75回 政府保証地方公共団体金融機関債券	0.44	2025/8/15	10,000	10,203
	第80回 政府保証地方公共団体金融機関債券	0.32	2026/1/19	6,000	6,095
	第110回 政府保証地方公共団体金融機関債券	0.13	2028/7/18	9,000	9,068
	第15回 政府保証日本政策金融公庫債券	1.2	2020/12/17	20,000	20,006
	第23回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.645	2024/3/18	10,000	10,209
	第26回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.466	2024/12/12	10,000	10,184
	第27回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.11	2021/2/12	20,000	20,004
	第37回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.085	2026/12/14	10,000	10,045
	第22回 政府保証民間都市開発債券	0.245	2040/2/28	10,000	9,679
	第5回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.21	2025/12/19	10,000	11,078
	第8回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.45	2026/3/19	10,000	11,251
	第19回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.75	2047/3/20	10,000	14,876
	第83回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	2032/3/19	10,000	11,875

作成期	当期	期末			
種類	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
特殊債券(除く金融債)	第92回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	% 0.834	2022/6/20	千円 10,000	千円 10,127
	第146回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.345	2024/12/20	10,000	10,122
	第172回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.288	2036/6/20	10,000	9,879
	第342回 東京交通債券	2.4	2022/6/21	10,000	10,363
	第3回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.26	2027/3/19	10,000	11,354
	第62回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.13	2030/12/13	10,000	11,936
	第36回 中日本高速道路株式会社債(一般担保付)	1.066	2021/9/17	10,000	10,082
	第69回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.441	2034/8/4	10,000	11,520
	小計			315,000	331,206
金融債券	い第794号農林債	0.01	2021/7/27	10,000	9,999
普通社債券(含む投資法人債券)	第548回 東京電力株式会社債(一般担保付)	2.347	2028/9/29	10,000	11,080
	第530回 中部電力株式会社債(一般担保付)	0.274	2029/6/25	10,000	10,011
	第495回 関西電力株式会社債(一般担保付)	0.746	2021/9/17	10,000	10,052
	第497回 関西電力株式会社債(一般担保付)	1.002	2025/6/20	10,000	10,376
	第381回 中国電力株式会社債(一般担保付)	0.953	2024/4/25	10,000	10,289
	第471回 東北電力株式会社債(一般担保付)	1.168	2023/12/25	10,000	10,326
	第473回 東北電力株式会社債(一般担保付)	0.597	2021/4/23	10,000	10,021
	第371回 九州電力株式会社債(一般担保付)	1.43	2022/12/22	10,000	10,274
	第427回 九州電力株式会社債(一般担保付)	1.024	2024/5/24	10,000	10,311
	第317回 北海道電力株式会社債(一般担保付)	1.139	2023/11/24	10,000	10,304
	第9回 西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.28	2022/3/25	5,000	5,145
	第9回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.74	2022/9/20	10,000	10,302
	小計			115,000	118,495
	合計			4,508,000	4,892,879

(注)額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(2020年12月7日現在)

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 4,892,879	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	39,858	0.8
投 資 信 託 財 产 總 額	4,932,737	100.0

(注)金額の単位未満は切り捨て。

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	4,932,737,517円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	25,822,345
公 社 債(評価額)	4,892,879,980
未 収 利 息	13,948,102
前 払 費 用	87,090
(B) 負 債	9,300,941
未 払 解 約 金	9,300,871
未 払 利 息	70
(C) 純 資 産 總 額(A-B)	4,923,436,576
元 本	3,615,913,778
次 期 繰 越 損 益 金	1,307,522,798
(D) 受 益 權 總 口 数	3,615,913,778口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,616円

(注)当期

期首元本額	4,403,729,226円
期中追加設定元本額	502,437,392円
期中一部解約元本額	1,290,252,840円
計算口数当たり純資産額	1,3616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グッドラиф2020(年金)	256,981,082円
PRUグッドライフ2030(年金)	1,477,397,817円
PRUグッドライフ2040(年金)	730,728,587円
PRUグッドライフ2050(年金)	55,036,936円
ブルデンシャル私募国内債券マーケット・パフォーマー(連結機関投資家向け)	1,091,139,894円
ブルデンシャル私募国内株式・債券バランスファンド(連結機関投資家向け)	4,629,462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	50,555,873円
受 取 利 息	50,600,709
支 払 利 息	△ 44,836
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 100,296,160
売 買 益	461,950
売 買 損	△ 100,758,110
(C) 信 託 報 酬 等	△ 282
(D) 当 期 損 益 (A+B+C)	△ 49,740,569
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,643,801,331
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	184,065,521
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 470,603,485
(H) 計 (D+E+F+G)	1,307,522,798
次 期 繰 越 損 益 金(H)	1,307,522,798

(注1)損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換算によるものを含みます。

(注2)損益の状況の中で(C)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(F)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(G)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。

<PRU海外株式マザーファンド>

運用状況について

「PRU海外株式マザーファンド」は、「PRUグッドライフ2040（年金）」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		MSCI KOKUSAIインデックス (円換算ベース)	株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券比率	純資産総額
	期中騰落率	期中騰落率					
16期（2016年12月5日）	円 20,462	% △ 4.4	20,414.39	% △ 4.9	% 92.9	% 3.8	% 2.6 百万円 4,749
17期（2017年12月5日）	25,076	22.5	24,930.32	22.1	92.8	4.3	2.8 5,004
18期（2018年12月5日）	25,098	0.1	24,960.05	0.1	93.1	3.8	3.0 4,650
19期（2019年12月5日）	27,981	11.5	27,807.78	11.4	92.9	3.7	3.1 4,545
20期（2020年12月7日）	31,580	12.9	31,460.15	13.1	92.0	4.8	2.9 2,899

（注1）株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

（注2）株式先物比率は買建比率－売建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		MSCI KOKUSAIインデックス (円換算ベース)	株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券比率
	騰落率	騰落率				
（期首） 2019年12月5日	円 27,981	% —	27,807.78	% —	% 92.9	% 3.7 % 3.1
12月末	29,369	5.0	29,172.54	4.9	93.3	3.4 3.1
2020年1月末	29,407	5.1	29,212.92	5.1	92.8	3.8 3.1
2月末	27,068	△ 3.3	26,913.06	△ 3.2	92.6	3.8 3.2
3月末	23,066	△ 17.6	22,891.84	△ 17.7	92.8	4.0 3.1
4月末	25,325	△ 9.5	25,092.07	△ 9.8	93.0	4.3 2.9
5月末	26,382	△ 5.7	26,158.39	△ 5.9	91.4	4.9 3.1
6月末	26,824	△ 4.1	26,660.05	△ 4.1	92.4	4.2 2.9
7月末	27,670	△ 1.1	27,504.90	△ 1.1	92.5	4.3 2.9
8月末	29,783	6.4	29,650.89	6.6	92.4	4.2 3.2
9月末	28,599	2.2	28,479.95	2.4	92.4	4.1 3.2
10月末	27,800	△ 0.6	27,680.99	△ 0.5	94.1	2.7 2.9
11月末	31,013	10.8	30,879.59	11.0	92.9	4.2 2.9
（期末） 2020年12月7日	31,580	12.9	31,460.15	13.1	92.0	4.8 2.9

（注1）騰落率は期首比です。

（注2）株式先物比率は買建比率－売建比率を記載しております。

（注3）株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※「MSCI KOKUSAIインデックス」とは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国で構成されています。また、MSCI KOKUSAIインデックスに対する著作権及びその他知的財産権は、全てMSCI Inc. に帰属します。MSCIではかかるデータに基づく投資による損失に一切責任を負いません。

* 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		
売買委託手数料 (株式) (投資信託証券) (先物・オプション)	2円 (2) (0) (0)	0.009% (0.008) (0.000) (0.001)	期中の平均基準価額は27,692円です。 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]}$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料	
有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	2 (2) (0)	0.006 (0.005) (0.000)	有価証券取引税 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]}$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金	
その他費用 (保管費用) (その他)	130 (129) (0)	0.468 (0.467) (0.002)	その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]}$ 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 ・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る費用等が含まれます。	
合計	134	0.483		

(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おります。

(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) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外 ユ リ ロ 国	アメリカ	百株 295 (143)	千アメリカドル 2,351 (176)	百株 1,674 (32)	千アメリカドル 13,383 (537)
	カナダ	66 (4)	千カナダドル 185 (7)	240 (6)	千カナダドル 890 (18)
	ドイツ	36 (2)	千ユーロ 105 (4)	123 (0.45)	千ユーロ 484 (9)
	イタリア	151	23	342	97
	フランス	36 (1)	75 (2)	148 (0.3)	544 (3)
	オランダ	25 (△ 8)	55 (△ 43)	109	276
	スペイン	52 (253)	21 (4)	329 (144)	144 (4)
	ベルギー	0.79	6	8	45
	オーストリア	2	4	7	15
	ルクセンブルク	9 (0.63)	8 (-)	18	15
イ ギ リ ス	フィンランド	7	11	48	59
	アイルランド	0.95 (0.01)	7 (-)	19	33
	ポルトガル	1 (14)	0.83929 (0.12261)	29 (-)	10 (0.12261)
	その他	— (8)	— (43)	—	—
ス イ ス	イギリス	493 (65)	千イギリスポンド 115 (14)	1,879 (931)	千イギリスポンド 763 (10)
	スイス	15 (6)	千スイスフラン 106 (0.12236)	92 (-)	千スイスフラン 652 (2)
	スウェーデン	35 (4)	千スウェーデンクローナ 436 (10)	140 (1)	千スウェーデンクローナ 1,694 (11)
	ノルウェー	2	千ノルウェークローネ 46	26	千ノルウェーケローネ 308

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外 国	デンマーク	百株3	千デンマーククローネ95	百株23	千デンマーククローネ939
	オーストラリア	162	千オーストラリアドル88	467	千オーストラリアドル557
	ニュージーランド	5	千ニュージーランドドル4	32	千ニュージーランドドル27
	香港	124 (△ 27)	千香港ドル190 (-)	511	千香港ドル1,629
	シンガポール	34 (35)	千シンガポールドル8 (1)	248 (-)	千シンガポールドル100 (1)
	イスラエル	11 (0.64)	千イスラエルシェケル13 (0.75953)	30 (-)	千イスラエルシェケル78 (0.75953)

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(注3) () 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 投資信託証券

		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外 国	アメリカ	千口2 (0.101)	千アメリカドル339 (9)	千口9 (0.15)	千アメリカドル709 (9)
	カナダ	— (0.2)	千カナダドル— (4)	0.354	千カナダドル5
	ユーロ フランス	—	千ユーロ—	0.245 (-)	千ユーロ12 (0.09329)
	イギリス	0.137	千イギリスポンド1	1	千イギリスポンド9
	オーストラリア	6	千オーストラリアドル14	14	千オーストラリアドル45
	香港	0.2	千香港ドル12	1	千香港ドル68
	シンガポール	4 (1)	千シンガポールドル9 (2)	3 (1)	千シンガポールドル6 (3)

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(注3) () 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(3) 先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	S&P EMINI FU	百万円 614	百万円 637	百万円 —	百万円 —
	FTSE 100 IDX	32	32	—	—
	EURO STOXX50	72	78	—	—

(注1) 単位未満は切り捨て。

(注2) 外国の取引金額は、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。

(注3) 一印は組み入れなし。

* 株式売買比率 *

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	2,349,823千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,005,050千円
(c) 売買高比率(a) / (b)	0.78

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) 外国株式の(a)は各月末（決算日の属する月については決算日）、(b)は各月末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。

(注3) 単位未満は切り捨て。

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

(1) 外国株式

当期							
買付			売付				
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
APPLE INC(アメリカ)	千株 0.48	千円 10,468	円 21,810	APPLE INC(アメリカ)	千株 3	千円 82,495	円 27,452
MICROSOFT CORP(アメリカ)	0.505	10,419	20,631	MICROSOFT CORP(アメリカ)	3	73,977	19,596
AMAZON.COM INC(アメリカ)	0.03	8,418	280,615	AMAZON.COM INC(アメリカ)	0.215	54,644	254,162
FACEBOOK INC-A(アメリカ)	0.15	3,867	25,784	FACEBOOK INC-A(アメリカ)	1	27,577	22,512
ALPHABET INC-CL A(アメリカ)	0.02	3,194	159,745	ALPHABET INC-CL C(アメリカ)	0.165	24,535	148,702
NVIDIA CORP(アメリカ)	0.07	2,994	42,772	ALPHABET INC-CL A(アメリカ)	0.153	22,838	149,271
BERKSHIRE HATHAWAY INC(アメリカ)	0.135	2,817	20,872	JOHNSON & JOHNSON(アメリカ)	1	21,207	15,709
JOHNSON & JOHNSON(アメリカ)	0.17	2,696	15,863	NESTLE SA-REGISTERED(スイス)	1	18,016	11,706
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A(アメリカ)	0.1	2,693	26,931	VISA INC(アメリカ)	0.89	17,470	19,630
ALPHABET INC-CL C(アメリカ)	0.017	2,649	155,837	JPMORGAN CHASE & CO(アメリカ)	1	16,736	10,299

(注1) 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。

(注2) 単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は少数で記載。

(2) 投資信託証券

当				期							
買		付		売		付					
銘	柄	口	数	金	額	銘	柄	口	数	金	額
iShares Core S&P 500 ETF(アメリカ)		千口		千円		iShares Core S&P 500 ETF(アメリカ)		千口		千円	
AMERICAN TOWER CORP(アメリカ)		0.73	25,659	1,198	AMERICAN TOWER CORP(アメリカ)	0.88	29,583	0.045	5,954	0.23	PROLOGIS INC(アメリカ)
PROLOGIS INC(アメリカ)		0.115	1,045	857	PROLOGIS INC(アメリカ)	0.44	4,137	0.055	3,866	0.23	DIGITAL REALTY TRUST INC(アメリカ)
DIGITAL REALTY TRUST INC(アメリカ)		0.01	775	774	DIGITAL REALTY TRUST INC(アメリカ)	0.04	2,962	0.01	2,255	0.07	EQUINIX INC(アメリカ)
EQUINIX INC(アメリカ)		0.045	655	613	EQUINIX INC(アメリカ)	0.125	1,913	0.02	1,533	0.085	CROWN CASTLE INTL CORP(アメリカ)
CROWN CASTLE INTL CORP(アメリカ)		0.08	5	610	CROWN CASTLE INTL CORP(アメリカ)	0.23	1,481	5	REALTY INCOME CORPORATION(アメリカ)	0.23	SBA COMMUNICATIONS CORP(アメリカ)
REALTY INCOME CORPORATION(アメリカ)		0.21	575	575	REALTY INCOME CORPORATION(アメリカ)	0.04	2,962	0.21	EQUITY RESIDENTIAL PROPS TR(アメリカ)	0.2	575
VICINITY CENTRES(オーストラリア)					VICINITY CENTRES(オーストラリア)				VICINITY CENTRES(オーストラリア)		
VICI PROPERTIES INC(アメリカ)					VICI PROPERTIES INC(アメリカ)				VICI PROPERTIES INC(アメリカ)		

(注) 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。

* 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)

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期 末		
	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株 式	百万円 0.16914	百万円 1	百万円 1

(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あり、当ファンドに係る利害関係人とはブルデンシャルファイナンシャルリンクです。

組入資産の明細

(1) 外国株式

(2020年12月7日現在)

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ…ニューヨーク市場)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
AFLAC INC	7	3	18	1,878	保険	
AES CORPORATION	6	3	7	767	公益事業	
AT&T INC	73	40	119	12,387	電気通信サービス	
ABBOTT LABORATORIES	17	9	107	11,219	ヘルスケア機器・サービス	
ABBVIE INC	15	9	105	11,020	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACUITY BRANDS INC	0.4	—	—	—	資本財	
ADVANCE AUTO PARTS	0.8	0.4	6	634	小売	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3	1	20	2,157	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2	1	35	3,704	素材	
ALBEMARLE CORP	0.9	0.55	7	796	素材	
ALLEGHANY CORP	0.14	0.09	5	572	保険	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORPORATION	0.55	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	2	1	7	770	公益事業	
ALLSTATE CORP	3	1	18	1,955	保険	
ALLY FINANCIAL INC	4	1	6	634	各種金融	
ALTICE USA INC- A	1	1	4	505	メディア・娯楽	
ALTRIA GROUP INC	18	10	43	4,564	食品・飲料・タバコ	
AMEREN CORPORATION	2	1	10	1,123	公益事業	
AMERICAN ELECTRIC POWER	5	2	24	2,516	公益事業	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	7	3	48	4,997	各種金融	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	0.9	0.4	3	379	保険	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	9	4	19	2,075	保険	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1	1	14	1,549	公益事業	
AMERISOURCEBERGEN CORP	1	0.85	8	911	ヘルスケア機器・サービス	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1	0.7	13	1,430	各種金融	
AMETEK INC	2	1	15	1,580	資本財	
AMPHENOL CORP-CL A	3	1	21	2,282	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ANALOG DEVICES	3	2	29	3,056	半導体・半導体製造装置	
ANTHEM INC	2	1	46	4,878	ヘルスケア機器・サービス	
APACHE CORP	3	—	—	—	エネルギー	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	1	4	504	各種金融	
AQUA AMERICA INC	2	—	—	—	公益事業	
ARAMARK	2	1	4	477	消費者サービス	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	5	3	16	1,710	食品・飲料・タバコ	
ARCONIC INC	4	—	—	—	資本財	
ARISTA NETWORKS INC	0.5	0.3	8	843	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ARROW ELECTRONICS INC	1	0.4	3	400	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASSURANT INC	0.65	0.35	4	482	保険	
ATMOS ENERGY CORP	1	0.7	6	708	公益事業	
AUTOLIV INC	1	0.5	4	481	自動車・自動車部品	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	4	2	41	4,311	ソフトウェア・サービス	
AUTOZONE INC	0.25	0.13	15	1,573	小売	
AVALARA INC	—	0.45	7	782	ソフトウェア・サービス	
AVANTOR INC	—	3	8	875	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AVERY DENNISON CORP	0.9	0.5	7	801	素材	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	3	—	—	—	各種金融	
BB&T CORPORATION	7	—	—	—	銀行	
BAKER HUGHES A GE COMPANY	6	3	7	793	エネルギー	
BALL CORP	3	1	17	1,822	素材	
BANK OF AMERICA CORP	88	43	127	13,264	銀行	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	8	4	17	1,810	各種金融	

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
BAXTER INTERNATIONAL INC	百株 4	百株 2	千アメリカドル 21	千円 2,273	ヘルスケア機器・サービス	
BECTON DICKINSON & CO	2	1	38	3,992	ヘルスケア機器・サービス	
WR BERKLEY CORP	1	0.87	5	612	保険	
BERKSHIRE HATHAWAY INC	13	7	182	19,022	各種金融	
BEST BUY COMPANY INC	2	1	13	1,428	小売	
BIO-RAD LABORATORIES-A	0.1	0.12	6	698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BLACK KNIGHT INC	1	0.8	7	739	ソフトウェア・サービス	
BLACKROCK INC	1	0.88	61	6,443	各種金融	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	6	3	23	2,453	各種金融	
BOEING CO	5	2	68	7,145	資本財	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1	0.8	7	736	ソフトウェア・サービス	
BORGWARNER INC	1	1	5	622	自動車・自動車部品	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	14	8	27	2,904	ヘルスケア機器・サービス	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	23	12	78	8,177	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	1	0.65	9	1,009	ソフトウェア・サービス	
BROWN & BROWN INC	2	1	5	606	保険	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3	1	13	1,428	食品・飲料・タバコ	
BURLINGTON STORES INC	0.6	0.4	9	962	小売	
CBS CORP-CL B	3	—	—	—	メディア・娯楽	
CBRE GROUP INC	3	2	13	1,368	不動産	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2	1	5	535	素材	
CIGNA CORP	3	2	45	4,779	ヘルスケア機器・サービス	
CMS ENERGY CORP	2	1	10	1,057	公益事業	
CSX CORP	7	4	40	4,206	運輸	
CVS HEALTH CORPORATION	13	7	55	5,792	ヘルスケア機器・サービス	
CABLE ONE INC	—	0.02	4	439	メディア・娯楽	
CABOT OIL & GAS CORPORATION	4	2	4	427	エネルギー	
CAMPBELL SOUP CO	1	0.9	4	454	食品・飲料・タバコ	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	4	2	23	2,476	各種金融	
CARDINAL HEALTH INC	2	1	10	1,067	ヘルスケア機器・サービス	
CARMAX INC	1	1	9	1,034	小売	
CARNIVAL CORP	4	2	6	707	消費者サービス	
CARRIER GLOBAL CORP	—	4	17	1,793	資本財	
CARVANA CO	—	0.35	8	885	小売	
CATALENT INC	—	0.95	9	943	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CATERPILLAR INC	5	3	56	5,878	資本財	
CELANESE CORPORATION	1	0.65	8	897	素材	
CENTENE CORP	4	3	21	2,212	ヘルスケア機器・サービス	
CENTERPOINT ENERGY INC	5	2	6	642	公益事業	
CENTURYLINK INC	8	5	5	575	電気通信サービス	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	—	0.6	5	608	ソフトウェア・サービス	
CHEVRON CORP	19	10	101	10,582	エネルギー	
CHEWY INC - CLASS A	—	0.2	1	155	小売	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	0.25	0.15	20	2,083	消費者サービス	
CHURCH & DWIGHT CO INC	2	1	12	1,258	家庭用品・パーソナル用品	
CITIGROUP INC	22	11	68	7,095	銀行	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5	2	8	921	銀行	
CLOROX COMPANY	1	0.7	13	1,456	家庭用品・パーソナル用品	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	—	0.7	5	563	ソフトウェア・サービス	
COCA-COLA COMPANY	40	22	122	12,778	食品・飲料・タバコ	
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	8	4	38	3,982	家庭用品・パーソナル用品	
COMERICA INC	1	—	—	—	銀行	
CONAGRA BRANDS INC	5	2	8	923	食品・飲料・タバコ	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株	株	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
CONCHO RESOURCES INC	百株	百株	千アメリカドル	千円			
CONOCOPHILLIPS	2	1	8	871	エネルギー		
CONSOLIDATED EDISON INC	11	6	27	2,810	エネルギー		
CONSTITUTION BRANDS INC	3	1	14	1,489	公益事業		
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1	0.9	19	2,002	食品・飲料・タバコ		
COOPER COS INC/THE	1	—	—	—	エネルギー		
CORNING INC	0.5	0.3	10	1,079	ヘルスケア機器・サービス		
CORTEVA INC	8	4	17	1,777	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
COTY INC-CL A	8	4	16	1,729	素材		
CROWN HOLDINGS INC	2	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品		
CUMMINS INC	1	0.7	6	715	素材		
DR HORTON INC	1	0.8	17	1,831	資本財		
DTE ENERGY COMPANY	3	1	13	1,409	耐久消費財・アパレル		
DXC TECHNOLOGY CO	1	1	13	1,441	公益事業		
DANAHER CORP	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス		
DARDEN RESTAURANTS INC	6	3	80	8,409	ヘルスケア機器・サービス		
DAVITA INC	1	0.75	8	896	消費者サービス		
DEERE & CO	1	0.5	5	568	ヘルスケア機器・サービス		
DELL TECHNOLOGIES INC-C	3	1	43	4,483	資本財		
DELTA AIR LINES INC	1	1	9	968	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
DEVON ENERGY CORPORATION	1	1	4	462	運輸		
WALT DISNEY CO	3	1	—	—	エネルギー		
DISCOVER FINANCIAL SERVICES-W/I	18	10	157	16,379	メディア・娯楽		
DOLLAR GENERAL CORP	2	1	14	1,463	各種金融		
DOMINION ENERGY INC	8	4	29	3,109	小売		
DOMINO'S PIZZA INC	3	—	36	3,790	公益事業		
DOVER CORP	0.4	0.25	9	996	消費者サービス		
DOW INC	1	0.8	9	1,028	資本財		
DUKE ENERGY CORP	7	4	23	2,480	素材		
DUPONT DE NEMOURS INC	7	4	38	4,003	公益事業		
DYNATRACE INC	—	1	27	2,817	素材		
EOG RESOURCES INC	5	3	4	493	ソフトウェア・サービス		
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	1	0.7	18	1,930	エネルギー		
EATON VANCE CORP	1	—	7	745	素材		
ECOLAB INC	1	—	—	—	各種金融		
EDISON INTERNATIONAL	2	1	33	3,522	素材		
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3	2	14	1,480	公益事業		
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	2	3	30	3,213	ヘルスケア機器・サービス		
EMERSON ELECTRIC CO	4	2	7	795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ENTERGY CORP	6	3	26	2,751	資本財		
EPAM SYSTEMS INC	2	1	11	1,221	公益事業		
EQUIFAX INC	0.6	0.33	10	1,116	ソフトウェア・サービス		
EQUITABLE HOLDINGS INC	1	0.7	11	1,213	商業・専門サービス		
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	2	5	620	各種金融		
EVERGY INC	—	1	6	693	公益事業		
EVERSOURCE ENERGY	2	1	7	800	公益事業		
EXELON CORPORATION	3	1	15	1,629	公益事業		
EXXON MOBIL CORPORATION	9	5	22	2,317	公益事業		
FMC CORP	42	23	98	10,233	エネルギー		
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1	0.7	8	886	素材		
FAIR ISAAC CORP	0.3	0.2	7	730	各種金融		
FEDEX CORPORATION	—	0.15	7	772	ソフトウェア・サービス		
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	2	1	41	4,296	運輸		
FNF GROUP	6	3	52	5,412	ソフトウェア・サービス		
	3	1	5	581	保険		

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
FIRST REPUBLIC BANK/CA	百株 1	百株 1	千アメリカドル 12	千円 1,347	銀行	
FIRSTENERGY CORP		5	3	9	公益事業	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	0.9	0.5	13	1,394	ソフトウェア・サービス	
FLOWSERVE CORPORATION	1	—	—	—	資本財	
FORD MOTOR COMPANY	40	21	20	2,128	自動車・自動車部品	
FORTIVE CORP	2	1	13	1,372	資本財	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	1	0.8	6	674	資本財	
FRANKLIN RESOURCES INC	2	1	4	419	各種金融	
FREEPORT-MCMORAN INC	13	8	20	2,170	素材	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2	1	12	1,267	保険	
GAP INC	2	—	—	—	小売	
GARTNER INC	1	0.5	7	806	ソフトウェア・サービス	
GENERAC HOLDINGS INC	—	0.35	7	747	資本財	
GENERAL DYNAMICS CORP	2	1	21	2,273	資本財	
GENERAL ELECTRIC CO.	89	49	53	5,581	資本財	
GENERAL MILLS INC	6	3	21	2,264	食品・飲料・タバコ	
GENERAL MOTORS CO	13	7	32	3,419	自動車・自動車部品	
GENUINE PARTS CO	1	0.9	8	920	小売	
GLOBAL PAYMENTS INC	3	1	32	3,415	ソフトウェア・サービス	
GLOBE LIFE INC	1	0.5	4	501	保険	
GODADDY INC - CLASS A	2	1	8	872	ソフトウェア・サービス	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3	1	43	4,488	各種金融	
GRAINGER (W.W.) INC	0.5	0.25	10	1,053	資本財	
GRUBHUB INC	1	—	—	—	小売	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	0.5	0.5	6	671	ソフトウェア・サービス	
HCA HEALTHCARE INC	2	1	23	2,461	ヘルスケア機器・サービス	
HP INC	15	8	19	2,004	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HALLIBURTON CO	8	4	9	950	エネルギー	
HANESBRANDS INC	3	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
HARLEY-DAVIDSON INC	1	—	—	—	自動車・自動車部品	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	3	2	10	1,064	保険	
HASBRO INC	1	0.7	6	663	耐久消費財・アパレル	
HEICO CORP	0.4	0.25	3	345	資本財	
HEICO CORP-CLASS A	0.8	0.5	6	635	資本財	
THE HERSHEY COMPANY	1	0.85	12	1,334	食品・飲料・タバコ	
HESS CORP	2	1	9	1,018	エネルギー	
HEWLETT-PACKARD ENTERPRISE COMPANY	13	7	8	899	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	2	1	17	1,845	消費者サービス	
HOLLYFRONTIER CORP	1	—	—	—	エネルギー	
HOME DEPOT INC	11	6	158	16,485	小売	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	7	3	82	8,632	資本財	
HORMEL FOODS CORPORATION	3	1	7	789	食品・飲料・タバコ	
HOWMET AEROSPACE INC	—	2	5	528	資本財	
HUBSPOT INC	—	0.25	9	1,007	ソフトウェア・サービス	
HUMANA INC	1	0.75	30	3,222	ヘルスケア機器・サービス	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	0.4	0.25	4	436	資本財	
INDEX CORP	0.7	0.35	6	702	資本財	
ILLINOIS TOOL WORKS	3	1	36	3,842	資本財	
INGERSOLL-RAND INC	—	2	9	973	資本財	
INGREDION INC	0.9	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	5	3	33	3,467	各種金融	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	9	4	62	6,553	ソフトウェア・サービス	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1	0.46	5	555	素材	
INTERNATIONAL PAPER CO	3	2	10	1,068	素材	

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
INTERPUBLIC GROUP COS INC	百株 4	百株 2	千アメリカドル 4	千円 498	メディア・娯楽	
IQIVA HOLDINGS INC		1	1	19	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JPMORGAN CHASE & CO	32	17	209	2,006	銀行	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1	0.7	7	793	資本財	
JEFFERIES FINANCIAL	2	—	—	—	各種金融	
JOHNSON & JOHNSON	26	14	222	23,194	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JONES LANG LASALLE INC	0.6	—	—	—	不動産	
KKR & CO INC	5	3	11	1,235	各種金融	
KANSAS CITY SOUTHERN	1	0.6	11	1,212	運輸	
KELLOGG CO	2	1	9	1,038	食品・飲料・タバコ	
KEURIG DR PEPPER INC	—	3	9	1,016	食品・飲料・タバコ	
KEYCORP	10	5	8	922	銀行	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	2	1	12	1,282	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KIMBERLY-CLARK CORP	3	1	25	2,645	家庭用品・パーソナル用品	
KINDER MORGAN INC	20	11	16	1,741	エネルギー	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1	0.9	3	387	運輸	
KOHLS CORP	1	—	—	—	小売	
KROGER CO	8	4	13	1,432	食品・生活必需品小売	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2	1	24	2,517	資本財	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1	0.5	9	1,034	ヘルスケア機器・サービス	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1	0.7	5	556	食品・飲料・タバコ	
LAS VEGAS SANDS CORP	3	2	12	1,313	消費者サービス	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2	1	31	3,303	家庭用品・パーソナル用品	
LEAR CORP	0.7	0.3	4	491	自動車・自動車部品	
LEGGETT & PLATT INC	1	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
LEIDOS HOLDINGS INC	1	0.7	7	763	ソフトウェア・サービス	
LENNAR CORP-CL A	3	1	12	1,307	耐久消費財・アパレル	
LENNOX INTERNATIONAL INC	0.36	0.16	4	459	資本財	
LILLY (ELI) & CO	8	4	71	7,416	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LINCOLN NATIONAL CORP	2	1	6	677	保険	
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	1	0.9	6	655	メディア・娯楽	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	2	1	51	5,341	資本財	
LOEWS CORP	3	1	6	676	保険	
LOWE'S COMPANIES	8	4	63	6,557	小売	
M&T BANK CORP	1	0.81	10	1,079	銀行	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	5	2	7	799	消費者サービス	
MSCI INC	0.8	0.5	21	2,194	各種金融	
MANPOWER GROUP	0.7	—	—	—	商業・専門サービス	
MARATHON OIL CORP	7	—	—	—	エネルギー	
MARATHON PETROLEUM CORP	6	3	16	1,697	エネルギー	
MARKEL CORP	0.14	0.07	6	728	保険	
MARSH & MCLENNAN COS	5	2	34	3,602	保険	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	2	1	20	2,117	消費者サービス	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	0.6	0.3	8	889	素材	
MASCO CORP	2	1	7	805	資本財	
MASTERCARD INC-CLASS A	9	5	172	17,919	ソフトウェア・サービス	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1	1	13	1,368	食品・飲料・タバコ	
MCDONALD'S CORPORATION	7	4	87	9,146	消費者サービス	
MCKESSON HBOC INC	2	0.9	16	1,693	ヘルスケア機器・サービス	
MERCK & CO. INC.	25	14	116	12,169	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
METLIFE INC	8	4	20	2,169	保険	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	0.25	0.13	14	1,531	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MICRON TECHNOLOGY INC	11	6	45	4,732	半導体・半導体製造装置	
MOHAWK INDUSTRIES INC	0.6	0.3	3	414	耐久消費財・アパレル	

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
MOLINA HEALTHCARE INC	百株 —	百株 0.35	千アメリカドル 7	千円 778	ヘルスケア機器・サービス	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY - B	1	1	6	643	食品・飲料・タバコ	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	14	7	47	4,902	食品・飲料・タバコ	
MOODY'S CORPORATION	1	1	28	2,973	各種金融	
MORGAN ST DEAN WITTER & CO	12	7	49	5,114	各種金融	
THE MOSAIC COMPANY PRODUCES & DISTRIB-WI	3	1	3	379	素材	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1	0.98	16	1,738	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NRG ENERGY INC	3	1	5	574	公益事業	
NVR INC	0.03	0.02	7	832	耐久消費財・アパレル	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	4	—	—	—	エネルギー	
NEWELL BRANDS INC	4	1	4	447	耐久消費財・アパレル	
NEWMONT CORPORATION	8	4	27	2,845	素材	
NEXTERA ENERGY INC	4	10	79	8,227	公益事業	
NIKE INC -CL B	12	7	96	10,066	耐久消費財・アパレル	
NISOURCE INC	4	1	4	449	公益事業	
NOBLE ENERGY INC	5	—	—	—	エネルギー	
NORDSTROM INC	1	—	—	—	小売	
NORFOLK SOUTHERN CORP	2	1	34	3,599	運輸	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1	0.9	27	2,877	資本財	
NUCOR CORP	3	1	9	998	素材	
OGE ENERGY CORP	2	1	3	342	公益事業	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	9	5	9	1,006	エネルギー	
OMNICOM GROUP	2	1	9	946	メディア・娯楽	
ONEOK INC	4	2	10	1,057	エネルギー	
OTIS WORLDWIDE CORP	—	2	16	1,681	資本財	
OWENS CORNING	1	0.6	4	463	資本財	
P G & E CORP	—	8	10	1,078	公益事業	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4	2	34	3,634	銀行	
PPG INDUSTRIES INC	2	1	19	1,988	素材	
PPL CORPORATION	7	4	12	1,339	公益事業	
PVH CORP	0.9	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
PACKAGING CORP OF AMERICA	0.9	0.6	7	831	素材	
PALO ALTO NETWORKS INC	0.9	0.6	18	1,900	ソフトウェア・サービス	
PARKER HANNIFIN CORP	1	0.7	19	2,008	資本財	
PAYCOM SOFTWARE INC	0.5	0.3	13	1,364	ソフトウェア・サービス	
PEPSICO INC	14	7	112	11,734	食品・飲料・タバコ	
PERKINELMER INC	1	0.7	9	1,032	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PFIZER INC	55	31	125	13,024	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	15	8	70	7,311	食品・飲料・タバコ	
PHILLIPS 66	4	2	16	1,767	エネルギー	
PINNACLE WEST CAPITAL	1	0.6	4	514	公益事業	
PINTEREST INC- CLASS A	—	2	17	1,821	メディア・娯楽	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1	0.9	10	1,068	エネルギー	
POLARIS INC	0.6	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC	3	1	8	870	保険	
PROCTER & GAMBLE CO	25	13	192	20,016	家庭用品・ペーボナル用品	
PROGRESSIVE CORP	5	3	29	3,074	保険	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	3	2	18	1,945	保険	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	5	2	16	1,679	公益事業	
PULTE GROUP INC	3	1	6	700	耐久消費財・アパレル	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1	0.7	8	898	ヘルスケア機器・サービス	
RPM INTERNATIONAL INC	1	0.8	6	724	素材	
POLO RALPH LAUREN CORPORATION	0.7	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1	0.8	7	797	各種金融	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
RAYTHEON COMPANY	百株	百株	千アメリカドル	千円	—	資本財	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	2	—	—	—	6,692	資本財	
REGIONS FINANCIAL CORP	—	8	64	6,692	銀行		
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	9	5	8	859	保険		
REPUBLIC SERVICES INC	0.6	0.4	4	517	商業・専門サービス		
RESMED INC	2	1	12	1,294	ヘルスケア機器・サービス		
RINGCENTRAL INC-CLASS A	1	0.8	16	1,745	ソフトウェア・サービス		
ROBERT HALF INTL INC	0.5	0.45	14	1,558	商業・専門サービス		
ROCKWELL INTL CORP	1	0.65	4	480	ソフトウェア・サービス		
ROLLINS INC	1	1	16	1,677	資本財		
ROPER TECHNOLOGIES INC	1	0.6	5	578	商業・専門サービス		
S&P GLOBAL INC	2	1	25	2,610	資本財		
SALESFORCE.COM INC	8	5	47	4,946	各種金融		
SCHLUMBERGER LTD	13	8	116	12,176	ソフトウェア・サービス		
SEALED AIR CORP	1	1	18	1,967	エネルギー		
SEMPRA ENERGY	2	1	4	478	素材		
SERVICENOW INC	1	1	20	2,134	公益事業		
SHERWIN-WILLIAMS CO	0.8	0.44	57	6,018	ソフトウェア・サービス		
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	—	2	31	3,232	素材		
SMITH (A.O.) CORP	1	0.7	8	890	ソフトウェア・サービス		
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	1	0.65	3	401	資本財		
SNAP-ON INC	0.5	0.3	7	793	食品・飲料・タバコ		
SNAP INC - A	7	5	5	565	資本財		
SNOWFLAKE INC-CLASS A	—	0.15	25	2,603	メディア・娯楽		
SOUTHERN CO	10	5	5	605	ソフトウェア・サービス		
SOUTHWEST AIRLINES	1	0.7	36	3,777	公益事業		
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	1	—	3	346	運輸		
SPRINT CORP-W/I	8	—	—	—	資本財		
SQUARE INC - A	3	2	—	4,657	電気通信サービス		
STANLEY BLACK & DECKER INC	1	0.89	44	1,675	ソフトウェア・サービス		
STATE STREET CORP	3	2	16	1,709	資本財		
STRYKER CORP	3	1	16	4,613	各種金融		
SUNTRUST BANKS INC	4	—	44	4,613	ヘルスケア機器・サービス		
SYNCHRONY FINANCIAL	6	2	—	—	銀行		
SYSCO CORP	5	2	9	1,019	各種金融		
TJX COMPANIES INC	12	6	20	2,113	食品・生活必需品小売り		
T-MOBILE US INC	3	—	44	4,646	小売		
TAPESTRY INC	3	—	—	—	電気通信サービス		
TARGET CORP	5	2	—	—	耐久消費財・アパレル		
TARGA RESOURCES CORP	2	—	49	5,100	小売		
TELADOC HEALTH INC	—	0.55	—	—	エネルギー		
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	0.3	0.2	11	1,165	ヘルスケア機器・サービス		
TELEFLEX INC	0.5	0.25	7	817	資本財		
TEXAS INSTRUMENTS INC	9	5	9	1,006	ヘルスケア機器・サービス		
TEXTRON INC	1	1	84	8,839	半導体・半導体製造装置		
THERMO ELECTRON CORP	4	2	5	597	資本財		
3M CO	5	3	104	10,867	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
TIFFANY & CO	1	0.6	55	5,743	小売		
TRANSIGM CROUP INC	0.5	0.3	7	819	資本財		
TRANSUNION	—	—	18	1,891	商業・専門サービス		
THE TRAVELERS COS INC	1	1	10	1,081	保険		
TRUIST FINANCIAL CORP	2	1	19	1,998	銀行		
TWILIO INC - A	—	7	37	3,860	ソフ		
TWITTER INC	1	0.7	22	2,327	ソフトウェア・サービス		
	7	4	21	2,235	メディア・娯楽		

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
TYLER TECHNOLOGIES INC	百株 0.3	百株 0.25	千アメリカドル 10	千円 1,093	ソフトウェア・サービス	
TYSON FOODS INC	3	1	12	1,313	食品・飲料・タバコ	
UGI CORP	1	1	5	525	公益事業	
US BANCORP	15	7	34	3,541	銀行	
UBER TECHNOLOGIES INC	1	5	30	3,140	運輸	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	2	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	2	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
UNION PACIFIC CORP	7	3	77	8,042	運輸	
UNITED PARCEL SERVICE	7	3	65	6,788	運輸	
UNITED RENTALS INC	0.79	0.39	9	997	資本財	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	8	—	—	—	資本財	
UNITEDHEALTH GROUP INC	9	5	185	19,300	ヘルスケア機器・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	0.9	0.5	6	703	ヘルスケア機器・サービス	
UNUM GROUP	2	—	—	—	保険	
VF CORP	3	1	16	1,762	耐久消費財・アパレル	
VAIL RESORTS INC	0.4	0.25	7	736	消費者サービス	
VALERO ENERGY CORP	4	2	13	1,441	エネルギー	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS	0.9	0.5	8	908	ヘルスケア機器・サービス	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1	0.75	20	2,121	ヘルスケア機器・サービス	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	41	23	142	14,798	電気通信サービス	
VISA INC	17	9	199	20,807	ソフトウェア・サービス	
VISTRA CORP	4	2	4	498	公益事業	
VMWARC INC-CLASS A	0.9	0.5	7	729	ソフトウェア・サービス	
VOYA FINANCIAL INC	1	0.9	5	556	各種金融	
VULCAN MATERIALS CO	1	0.7	10	1,066	素材	
WABCO HOLDINGS INC	0.5	—	—	—	資本財	
WISCONSIN ENERGY CORPORATION	3	1	16	1,767	公益事業	
WABTEC CORP	2	1	7	786	資本財	
WALMART INC	14	7	117	12,243	食品・生活必需品小売り	
WASTE CONNECTIONS INC	2	1	14	1,561	商業・専門サービス	
WASTE MANAGEMENT INC	4	2	28	2,936	商業・専門サービス	
WATERS CORP	0.6	0.4	9	989	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WAYFAIR INC- CLASS A	0.6	0.35	8	871	小売	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	0.5	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
WELLS FARGO COMPANY	41	21	64	6,686	銀行	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	0.5	0.4	10	1,130	ヘルスケア機器・サービス	
WESTERN DIGITAL CORPORATION	2	1	9	980	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WESTERN UNION COMPANY-W/I	4	2	5	521	ソフトウェア・サービス	
WESTROCK CO	2	1	5	587	素材	
WHIRLPOOL CORP	0.7	0.3	5	574	耐久消費財・アパレル	
WILLIAMS COMPANIES INC	12	6	15	1,615	エネルギー	
WORKDAY INC-CLASS A	1	1	22	2,312	ソフトウェア・サービス	
XPO LOGISTICS INC	0.9	0.6	7	748	運輸	
XCEL ENERGY INC	5	3	20	2,121	公益事業	
XYLEM INC	2	1	9	1,024	資本財	
XEROX HOLDINGS CORPORATION	1	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YUM! BRANDS INC	3	1	19	1,983	消費者サービス	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	2	—	—	—	電気通信サービス	
ZENDESK INC	—	0.65	8	919	ソフトウェア・サービス	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2	1	16	1,706	ヘルスケア機器・サービス	
ZOETIS INC	4	2	42	4,438	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALLEGION PLC	1	0.5	5	596	資本財	
ALLERGAN PLC	3	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMCOR PLC	16	8	10	1,068	素材	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
AON PLC	百株	百株	千アメリカドル	千円			
AON PLC	—	1	26	2,752	保険		
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	2	—	—	—	保険		
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	2	1	4	477	保険		
ACCENTURE PLC-CL A	2	1	4	427	素材		
BUNGE LIMITED	6	3	89	9,364	ソフトウェア・サービス		
CAPRI HOLDINGS LIMITED	1	0.9	5	575	食品・飲料・タバコ		
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS INC	2	1	4	493	耐久消費財・アパレル		
EATON CORP PLC	4	2	26	2,733	資本財		
EVEREST RE GROUP LTD	0.4	0.25	5	610	保険		
IHS MARKIT LIMITED	3	2	20	2,144	商業・専門サービス		
INGERSOLL-RAND PLC	2	—	—	—	資本財		
INVESCO LTD	4	2	4	477	各種金融		
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	8	4	18	1,958	資本財		
LINDE PUBLIC LIMITED COMPANY	5	2	72	7,564	素材		
MEDTRONIC PLC	13	7	86	9,017	ヘルスケア機器・サービス		
APTV PLC	2	1	19	2,054	自動車・自動車部品		
NIELSEN HOLDINGS PLC	3	—	—	—	商業・専門サービス		
RENAISSANCEWE HOLDINGS LTD	0.4	0.3	4	512	保険		
PENTAIR PLC-REGISTERED	1	0.85	4	452	資本財		
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDINGS PLC	1	1	5	521	資本財		
STERIS PLC	0.9	0.5	9	1,006	ヘルスケア機器・サービス		
TECHNIPFMC PLC	4	—	—	—	エネルギー		
TRANE TECHNOLOGIES PLC	—	1	19	1,993	資本財		
CHUBB LIMITED	4	2	39	4,076	保険		
TE CONNECTIVITY LTD	3	1	22	2,366	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
AERCAP HOLDINGS NV	1	—	—	—	資本財		
LYONDELLBASELL INDU-CL A	2	1	14	1,486	素材		
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1	1	9	947	消費者サービス		
(アメリカ…アメリカン市場)							
CHENIERE ENERGY INC	2	1	8	871	エネルギー		
(アメリカ…米国店頭市場)							
ABTOMED INC	0.5	0.27	7	766	ヘルスケア機器・サービス		
ACTIVISION BLIZZARD INC	7	4	34	3,619	メディア・娯楽		
ADOBE INC	4	2	130	13,606	ソフトウェア・サービス		
ADVANCED MICRO DEVICES	10	6	61	6,410	半導体・半導体製造装置		
AKAMAI TECHNOLOGIES	1	0.9	9	975	ソフトウェア・サービス		
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2	1	15	1,630	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ALIGN TECHNOLOGY INC	0.8	0.4	20	2,172	ヘルスケア機器・サービス		
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1	0.6	7	809	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ALPHABET INC-CL C	3	1	308	32,153	メディア・娯楽		
ALPHABET INC-CL A	3	1	308	32,079	メディア・娯楽		
AMAZON.COM INC	4	2	752	78,340	小売		
AMERCO	0.1	0.05	2	225	運輸		
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	1	—	—	—	運輸		
AMGEN INC	6	3	75	7,824	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ANSYS INC	0.8	0.5	17	1,787	ソフトウェア・サービス		
APPLE INC	45	96	1,174	122,211	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
APPLIED MATERIALS INC	9	5	46	4,808	半導体・半導体製造装置		
AUTODESK INC	2	1	34	3,616	ソフトウェア・サービス		
BEIGENE LTD-ADR	0.4	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2	1	7	828	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
BIOGEN INC	1	0.84	20	2,149	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
BOOKING HOLDINGS INC	0.43	0.22	46	4,865	小売		

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
BROADCOM INC	4	百株	百株	千アメリカドル	千円	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1		2	91	9,555	
CDK GLOBAL INC	1		0.6	5	581	
CDW CORP/DE	1		—	—	—	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1		0.8	10	1,111	
CME GROUP INC	3		0.7	6	677	
CADENCE DESIGN SYSTEM INC	3		1	35	3,734	
CARLYLE GROUP INC/THE	—		1	18	1,909	
CERNER CORP	3		0.8	2	242	
CHARTER COMMUNICATION-A	1		1	12	1,314	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1		0.8	53	5,584	
CISCO SYSTEMS INC	43		1	8	863	
CINTAS CORP	0.9		23	106	11,039	
CITRIX SYSTEMS INC	1		0.5	18	1,891	
COGNEX CORP	2		0.65	8	883	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS	5		1	7	795	
COMCAST CORP-CL A	45		3	25	2,615	
COPART INC	2		25	131	13,686	
COSTCO WHOLESALE CORP	4		1	13	1,399	
COSTAR GROUP INC	0.35		2	94	9,794	
COUPA SOFTWARE INC	—		0.23	20	2,138	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	—		0.35	11	2,158	
DATADOG INC - CLASS A	—		0.85	14	1,479	
DENTSPLY SIIRONA INC	2		0.8	8	845	
DEXCOM INC	1		1	5	615	
DIAMONDBACK ENERGY INC	1		0.55	5	615	
DISCOVERY INC-A	1		—	19	1,992	
DISCOVERY INC-C	3		1	—	—	
DISH NETWORK CORPORATION-A	2		1	3	340	
DISH NETWORK CORP-A-RIGHTS	0.15		—	4	433	
DOCUSIGN INC	1		1	5	549	
DOLLAR TREE INC	2		1	5	549	
DRAFTKINGS INC - CL A	—		—	15	—	
DROPBOX INC-CLASS A	2		0.85	4	2,531	
E*TRADE FINANCIAL CORP	2		2	4	1,569	
EAST WEST BANCORP INC	1		—	4	423	
EBAY INC	7		1	—	—	
ELECTRONIC ARTS INC	3		4	—	—	
ENPHASE ENERGY INC	—		1	24	—	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	0.3		0.65	20	—	
ETSY INC	—		0.1	20	2,175	
EXACT SCIENCES CORP	1		0.7	8	2,143	
EXPEDIA GROUP INC	1		0.95	8	882	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1		0.77	12	半導体・半導体製造装置	
FLIR SYSTEMS INC	1		0.9	2	231	
FACEBOOK INC-A	24		—	10	—	
FASTENAL CO	6		13	—	—	
F5 NETWORKS INC	0.6		3	378	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FIFTH THIRD BANCORP	7		0.3	4	39,445	
FISERV INC	5		4	16	518	
FORTINET INC	1		3	10	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FOX CORPORATION CLASS A	3		0.8	10	1,140	
FOX CORPORATION CLASS B	1		1	5	3,852	
GILEAD SCIENCES INC	12		0.9	2	1,064	
			7	5	596	
				5	596	
				2	274	
				7	274	
				44	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
					4,613	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
HD SUPPLY HOLDINGS INC	百株	百株	千アメリカドル	千円			
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1	1	6	639	資本財		
HOLOGIC INC	0.8	0.4	6	659	ソフトウェア・サービス		
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	2	1	10	1,050	ヘルスケア機器・サービス		
HUNTINGTON BANCSHARES INC	0.9	0.5	6	714	運輸		
IAC/INTERACTIVECORP	10	5	7	750	銀行		
IAC/INTERACTIVECORP	—	0.5	7	756	メディア・娯楽		
IPG PHOTONICS CORP	0.7	—	—	—	メディア・娯楽		
IDEXX LABORATORIES INC	0.4	0.2	4	441	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
ILLUMINA INC	0.9	0.5	22	2,379	ヘルスケア機器・サービス		
INCYTE CORP	1	0.85	29	3,102	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
INSULET CORP	1	1	8	865	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
INTEL CORP	0.4	0.35	9	943	ヘルスケア機器・サービス		
INTUIT INC	44	23	124	12,931	半導体・半導体製造装置		
INTUITIVE SURGICAL INC	2	1	53	5,562	ソフトウェア・サービス		
IONIS PHARMACEUTICALS INC	1	0.66	51	5,360	ヘルスケア機器・サービス		
JUNIPER NETWORKS INC	1	0.9	4	479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
KLA CORPORATION	3	2	4	480	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
KRAFT HEINZ COMPANY	1	0.9	23	2,470	半導体・半導体製造装置		
LKQ CORP	6	3	13	1,392	食品・飲料・タバコ		
LAN RESEARCH CORP	3	1	6	656	小売		
LIBERTY BROADBAND-A	1	0.8	39	4,163	半導体・半導体製造装置		
LIBERTY BROADBAND-CORP-C	—	0.15	2	251	メディア・娯楽		
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	1	0.6	9	1,018	メディア・娯楽		
LIBERTY SIRIUSXM GROUP C	0.8	0.4	1	172	メディア・娯楽		
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	1	0.8	3	344	メディア・娯楽		
LULULEMON ATHLETICA INC	2	1	4	450	メディア・娯楽		
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1	0.7	26	2,747	耐久消費財・アパレル		
MASIMO CORP	0.4	0.2	10	1,122	各種金融		
MATCH GROUP INC	—	0.25	6	690	ヘルスケア機器・サービス		
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2	1	20	2,148	メディア・娯楽		
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	2	1	13	1,438	半導体・半導体製造装置		
MERCADOLIBRE INC	0.45	0.25	1	204	消費者サービス		
MICROSOFT CORP	73	40	866	4,052	小売		
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2	1	20	90,134	ソフトウェア・サービス		
MIDDLEBY CORP	0.5	—	—	2,101	半導体・半導体製造装置		
MODERNA INC	—	1	—	—	資本財		
MONGODB INC	0.5	0.3	24	2,539	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	0.22	8	866	ソフトウェア・サービス		
MONSTER BEVERAGE CORP	4	2	7	735	半導体・半導体製造装置		
NASDAQ INC	1	0.65	19	2,002	食品・飲料・タバコ		
NETAPP INC	2	1	8	847	各種金融		
NETFLIX INC	4	2	7	749	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	0.9	0.5	124	12,966	メディア・娯楽		
NEWS CORP NEW-CL A-W/I	4	1	4	502	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
NORDSON CORP	—	0.3	3	351	メディア・娯楽		
NORTHERN TRUST CORP	2	1	6	625	資本財		
NORTONLIFELOCK INC	6	3	10	1,085	各種金融		
NVIDIA CORP	5	3	6	681	ソフトウェア・サービス		
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	0.8	0.4	187	19,473	半導体・半導体製造装置		
OKTA INC	1	0.65	18	1,873	小売		
OLD DOMINION FREIGHT LINE	0.7	0.55	15	1,630	ソフトウェア・サービス		
ON SEMICONDUCTOR CORP	4	2	11	1,197	運輸		
ORACLE CORPORATION	24	11	7	778	半導体・半導体製造装置		
			68	7,114	ソフトウェア・サービス		

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
PPD INC	百株 —	百株 0.7	千アメリカドル 2	千円 253	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PTC INC	1	0.7	7	798	ソフトウェア・サービス	
PACCAR INC	3	2	17	1,849	資本財	
PAYCHEX INC	3	1	17	1,769	ソフトウェア・サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	11	6	135	14,052	ソフトウェア・サービス	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	—	1	12	1,310	耐久消費財・アパレル	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	4	—	—	—	銀行	
POOL CORP	—	0.2	6	675	小売	
T ROWE PRICE GROUP INC	2	1	19	2,063	各種金融	
QORVO INC	1	0.65	10	1,118	半導体・半導体製造装置	
QUALCOMM INC	12	6	100	10,499	半導体・半導体製造装置	
REGENERON PHARMACEUTICALS	0.8	0.6	29	3,075	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ROKU INC	0.8	0.6	17	1,850	メディア・娯楽	
ROSS STORES INC	3	2	24	2,518	小売	
SEI INVESTMENT COMPANY	1	0.8	4	471	各種金融	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2	1	8	888	ソフトウェア・サービス	
SVB FINANCIAL GROUP	0.6	0.25	8	932	銀行	
SABRE CORP	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	0.9	0.4	6	658	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HENRY SCHEIN INC	1	0.8	5	569	ヘルスケア機器・サービス	
SCHWAB (SHARELES) CORP	11	8	43	4,484	各種金融	
SEAGEN INC/WA	—	0.7	12	1,305	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEATTLE GENETICS INC	1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SIGNATURE BANK	0.5	—	—	—	銀行	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	16	7	4	461	メディア・娯楽	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1	0.9	13	1,406	半導体・半導体製造装置	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	—	0.3	8	849	半導体・半導体製造装置	
SPLUNK INC	1	0.9	14	1,508	ソフトウェア・サービス	
STARBUCKS CORP	12	6	66	6,919	消費者サービス	
STEEL DYNAMICS INC	2	1	3	404	素材	
SUNRUN INC	—	0.7	4	420	資本財	
SYNOPSYS INC	1	0.9	21	2,218	ソフトウェア・サービス	
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	2	—	—	—	各種金融	
T-MOBILE US INC	—	3	42	4,375	電気通信サービス	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	1	0.65	11	1,222	メディア・娯楽	
10X GENOMICS INC-CLASS A	—	0.25	3	387	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TERADYNE INC	1	1	11	1,207	半導体・半導体製造装置	
TESLA INC	1	4	251	26,186	自動車・自動車部品	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	10	6	6	658	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	—	0.25	22	2,351	ソフトウェア・サービス	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1	0.6	8	839	小売	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	—	0.5	3	318	各種金融	
TRIMBLE INC	3	1	9	983	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TRIPADVISOR INC	1	—	—	—	メディア・娯楽	
ULTA BEAUTY INC	0.6	0.25	6	727	小売	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	0.8	—	—	—	運輸	
VERISIGN INC	1	0.6	12	1,273	ソフトウェア・サービス	
VERISK ANALYTICS INC	1	0.9	17	1,832	商業・専門サービス	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2	1	34	3,564	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VIACOM INC-CL B	4	—	—	—	メディア・娯楽	
VIACOMCBS INC	—	3	11	1,215	メディア・娯楽	
VIATRIS INC	—	6	12	1,252	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WALGREEN CO	7	4	18	1,897	食品・生活必需品小売り	
WYNN RESORTS LTD	1	0.6	6	708	消費者サービス	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
XILINX INC	百株	百株	千アメリカドル	千円			
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2	1	20	2,155		半導体・半導体製造装置	
ZILLOW GROUP INC - A	0.6	0.25	9	984		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ZILLOW GROUP INC - C	—	0.35	3	402		メディア・娯楽	
ZIONS BANCORPORATION	1	0.75	8	835		メディア・娯楽	
ZSCALER INC	2	—	—	—		銀行	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	0.4	7	752		ソフトウェア・サービス	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3	2	8	853		保険	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	—	1	8	895		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	0.6	0.3	4	470		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1	0.82	2	213		電気通信サービス	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	4	2	5	606		電気通信サービス	
MARVELL TECHNOLOGY	6	4	17	1,805		半導体・半導体製造装置	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2	—	—	—		消費者サービス	
NOVOCURE LTD	—	0.45	6	690		ヘルスケア機器・サービス	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	—	0.6	2	268		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEAGATE TECHNOLOGY	2	1	9	1,000		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1	0.67	14	1,495		保険	
PERRIGO CO PLC	1	0.7	3	363		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GARMIN LTD	1	0.9	10	1,136		耐久消費財・アパレル	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1	0.7	8	875		ソフトウェア・サービス	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	0.4	0.2	2	237		ソフトウェア・サービス	
WIX. COM LTD	0.5	0.3	7	798		ソフトウェア・サービス	
MYLAN INC	5	—	—	—		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NXP SEMICONDUCTORS NV	3	1	25	2,645		半導体・半導体製造装置	
FLEX LTD	4	—	—	—		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
(アメリカ…シンガポール市場)							
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	12	7	2	309		不動産	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2	1	7	732		資本財	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2	1	2	264		資本財	
小計	株数	金額	1,757	18,309	1,905,634		
銘柄	株数(比率)		608	594	(65.7%)		
(カナダ…トロント市場)							
AGNICO EAGLE MINES	2	1	12	1,012		素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	8	5	22	1,831		食品・生活必需品小売り	
BARRICK GOLD CORP	17	10	31	2,564		素材	
ATCO LTD -CLASS I	1	0.5	1	157		公益事業	
BANK OF MONTREAL	6	3	36	2,978		銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	12	7	47	3,897		銀行	
NATIONAL BANK OF CANADA	3	2	14	1,205		銀行	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC-CLASS A	8	7	40	3,276		各種金融	
BOMBARDIER INC 'B'	21	—	—	—		資本財	
SAPUTO INC	2	1	6	514		食品・飲料・タバコ	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1	0.7	4	335		素材	
CAE INC	2	1	4	403		資本財	
CAMECO CORP	3	1	2	213		エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	3	2	13	1,094		電気通信サービス	
CAN IMPERIAL BN OF COMMERCE	4	2	27	2,219		銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	12	6	22	1,796		エネルギー	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	0.64	0.39	6	524		小売	
CANADIAN UTILITIES LTD	1	1	4	341		公益事業	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	6	3	55	4,505		運輸	
FIRST CAPITAL REALTY INC	2	—	—	—		不動産	

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
YAMANA GOLD INC	百株 —	百株 5	千カナダドル 3	千円 314	素材	
GILDAN ACTIVWEAR	2	1	4	343	耐久消費財・アパレル	
OPEN TEXT CORP	2	1	10	858	ソフトウェア・サービス	
EMPIRE COMPANY LTD	2	1	3	291	食品・生活必需品小売り	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	—	0.5	4	359	商業・専門サービス	
FORTIS INC	4	2	14	1,192	公益事業	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	7	3	7	585	素材	
TELUS CORP	2	2	5	414	電気通信サービス	
GREAT-WEST LIFECO INC	2	1	5	460	保険	
IMPERIAL OIL LTD	3	2	5	412	エネルギー	
ENBRIDGE INC	20	11	49	4,070	エネルギー	
IGM FINANCIAL INC	—	0.5	1	142	各種金融	
MANULIFE FINANCIAL CORP	20	11	25	2,087	保険	
LOBLAW COMPANIES LTD	2	1	7	595	食品・生活必需品小売り	
MAGNA INTERNATIONAL INC	2	1	12	979	自動車・自動車部品	
SUN LIFE FINANCIAL INC	5	3	19	1,620	保険	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	0.3	0.16	7	602	保険	
METRO INC	2	1	7	630	食品・生活必需品小売り	
EMERA INC	2	1	6	530	公益事業	
ONEX CORPORATION	1	0.55	3	319	各種金融	
PAN AMERICAN SILVER CORP	—	1	3	318	素材	
POWER CORP OF CANADA	3	2	8	703	保険	
POWER FINANCIAL CORP	3	—	—	—	保険	
QUEBECOR INC -CL B	2	1	3	265	メディア・娯楽	
ROYAL BANK OF CANADA	14	7	83	6,783	銀行	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1	0.75	31	2,603	運輸	
ENCANA CORP	13	—	—	—	エネルギー	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	5	3	7	610	メディア・娯楽	
LUNDIN MINING CORP	7	3	3	300	素材	
TECK RESOURCES LTD-CL B	6	2	6	489	素材	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	—	0.3	2	223	資本財	
TORONTO-DOMINION BANK	18	10	73	5,959	銀行	
WESTON (GEORGE) LTD	0.95	0.45	4	356	食品・生活必需品小売り	
KINROSS GOLD CORP	13	7	6	562	素材	
INTACT FINANCIAL CORP	1	0.8	12	1,022	保険	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	0.2	0.11	17	1,423	ソフトウェア・サービス	
BCE INC	1	1	5	485	電気通信サービス	
FRANCO-NEVADA CORP	2	1	19	1,561	素材	
B2GOLD CORP	—	6	4	347	素材	
CI FINANCIAL CORP	3	2	3	278	各種金融	
SUNCOR ENERGY INC	15	8	19	1,622	エネルギー	
KEYERA CORP	2	2	4	389	エネルギー	
ALTAGAS LTD	2	1	2	231	公益事業	
PEMBINA PIPELINE CORP	5	3	10	864	エネルギー	
DOLLARAMA INC	2	1	10	835	小売	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	5	3	6	501	公益事業	
CENOVUS ENERGY INC	11	7	5	412	エネルギー	
NORTHLAND POWER INC	—	0.5	2	178	公益事業	
TMX GROUP LTD	—	0.4	5	417	各種金融	
BLACKBERRY LTD	5	5	5	442	ソフトウェア・サービス	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	2	1	7	631	素材	
INTER PIPELINE LTD	5	2	2	222	エネルギー	
STARS GROUP INC/THE	2	—	—	—	消費者サービス	
NUTRIEN LTD	6	3	22	1,849	素材	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	百株	百株	千カナダドル	千円			
SSB MINING INC	5	2	12	1,044	素材		
BAUSCH HEALTH COMPANISE INC	—	1	3	302	素材		
THOMSON REUTERS CORP	3	1	3	290	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
WSP GLOBAL INC	1	0.97	10	822	商業・専門サービス		
CGI INC	1	0.5	5	464	資本財		
IA FINANCIAL CORPORATION INC	2	1	10	868	ソフトウェア・サービス		
FIRSTSERVICE CORP	—	0.5	2	236	保険		
TC ENERGY CORPORATION	9	5	32	2,636	エネルギー		
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	—	0.5	1	147	商業・専門サービス		
PARKLAND CORP	—	0.6	2	204	エネルギー		
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	—	0.5	4	379	公益事業		
AIR CANADA	1	—	—	—	運輸		
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	2	1	11	970	消費者サービス		
SHOPIFY INC - CLASS A	1	0.61	82	6,691	ソフトウェア・サービス		
CANOPY GROWTH CORP	2	1	3	296	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
HYDRO ONE LTD	4	2	5	478	公益事業		
小計	株数	金額	405	228	1,160	94,552	
	銘柄	比	78	85	—	<3.3%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ			
ADIDAS AG	1	1	29	3,684	耐久消費財・アパレル		
FRESENIUS SE & CO KGAA	4	2	8	1,105	ヘルスケア機器・サービス		
UNITED INTERNET AG	1	0.63	2	263	電気通信サービス		
FUCHS PETROLUB SE -PREF	0.7	0.33	1	198	素材		
HANNOVER RUECK SE	0.6	0.3	4	524	保険		
GEA GROUP AG	1	0.85	2	310	資本財		
CONTINENTAL AG	1	0.61	7	901	自動車・自動車部品		
DEUTSCHE POST AG	10	5	21	2,763	運輸		
MERCK KGAA	1	0.69	9	1,190	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
RWE AG	5	3	12	1,604	公益事業		
SAP SE	9	5	59	7,564	ソフトウェア・サービス		
E.ON SE	22	14	12	1,595	公益事業		
HENKEL AG & CO KGAA	1	0.58	4	575	家庭用品・パーソナル用品		
PUMA SE	1	0.59	5	643	耐久消費財・アパレル		
BAYER AG	9	5	26	3,396	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
HENKEL AG & CO KGAA	1	0.99	8	1,116	家庭用品・パーソナル用品		
BASF SE	9	5	31	3,945	素材		
BEIERSDORF AG	0.99	0.59	5	684	家庭用品・パーソナル用品		
HOCHTIEF AG	0.2	—	—	—	資本財		
HEIDELBERGCEMENT AG	1	0.83	4	630	素材		
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	2	1	9	1,181	ヘルスケア機器・サービス		
ALLIANZ SE-REG	4	2	45	5,716	保険		
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	2	2	2	305	運輸		
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1	0.84	20	2,561	保険		
VOLKSWAGEN AG	0.32	0.12	1	243	自動車・自動車部品		
VOLKSWAGEN AG PFD	1	1	15	1,909	自動車・自動車部品		
DAIMLER AG-REG	8	4	27	3,505	自動車・自動車部品		
NEMETSCHEK SE	—	0.33	1	241	ソフトウェア・サービス		
THYSSEN KRUPP AG	4	—	—	—	素材		
SIEMENS AG	7	4	48	6,122	資本財		
DEUTSCHE BANK AG-REG	18	10	10	1,344	各種金融		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3	1	13	1,750	自動車・自動車部品		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	0.63	0.55	3	385	自動車・自動車部品		
DEUTSCHE TELEKOM REGD	33	19	29	3,757	電気通信サービス		

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
SARTORIUS AG-VORZUG	百株	百株	千ユーロ	千円		ヘルスケア機器・サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	0.4	0.2	7	911		半導体・半導体製造装置	
RATIONAL AG	12	7	21	2,766		資本財	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	—	0.02	1	178		ヘルスケア機器・サービス	
BECHTLE AG	0.42	0.22	2	309		ソフトウェア・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	—	0.1	1	219		各種金融	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	1	1	14	1,844		自動車・自動車部品	
FRAPORT AG	1	0.85	4	599		運輸	
WIRECARD AG	0.54	—	—	—		ソフトウェア・サービス	
LANXESS AG	1	—	—	—		素材	
MTU AERO ENGINES AG	0.98	0.55	3	408		資本財	
DEUTSCHE WOHNEN SE-BEARER	0.5	0.3	6	787		不動産	
SYMRISE AG	3	2	8	1,055		素材	
BRENTAG AG	1	0.82	8	1,068		資本財	
EVONIK INDUSTRIES AG	1	0.86	5	676		資本財	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING	—	9	2	275		電気通信サービス	
COMMERZBANK AG	7	4	2	320		銀行	
LEG IMMOBILIEN AG	—	0.4	4	589		不動産	
KION GROUP AG	0.83	0.36	2	308		資本財	
VONOVIA SE	5	2	16	2,021		不動産	
KNORR-BREMSE AG	0.5	0.42	4	556		資本財	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1	1	6	783		ヘルスケア機器・サービス	
METRO AG	1	—	—	—		食品・生活必需品小売	
TEAMVIEWER AG	—	0.75	2	369		ソフトウェア・サービス	
AXEL SPRINGER SE-NEW	0.45	—	—	—		メディア・娯楽	
KION GROUP AG-RIGHTS	—	0.36	0.01681	2		資本財	
SIEMENS ENERGY AG	—	2	5	719		資本財	
ZALANDO SE	1	0.99	7	984		小売	
SCOUT24 AG	—	0.62	3	493		メディア・娯楽	
COVESTRO AG	1	0.97	4	561		素材	
HELLOFRESH SE	—	0.73	3	441		小売	
UNIPER SE	2	1	3	396		公益事業	
DELIVERY HERO SE	1	0.79	7	994		小売	
小計	株数	金額	228	144	655	82,753	
	銘柄	数(比率)	57	61	—	<2.9%>	
(ユーロ…イタリア)							
ASSICURAZIONI GENERALI	11	6	8	1,125		保険	
INTESA SANPAOLO	150	92	18	2,317		銀行	
MEDIOBANCA SPA	6	3	2	293		銀行	
ENEL SPA	80	45	37	4,699		公益事業	
ENI SPA	26	15	13	1,732		エネルギー	
SNAM SPA	20	11	5	652		公益事業	
TELECOM ITALIA SPA	92	60	2	300		電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RNC	60	50	2	266		電気通信サービス	
ATLANTIA SPA	4	2	4	544		運輸	
TERNA SPA	14	7	4	602		公益事業	
RECORDATI SPA	1	0.77	3	425		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LEONARDO SPA	4	—	—	—		資本財	
AMPLIFON SPA	—	0.5	1	204		ヘルスケア機器・サービス	
PRYSMIAN SPA	2	1	3	461		資本財	
DIASORIN SPA	—	0.22	3	467		ヘルスケア機器・サービス	
MONCLER SPA	2	1	4	550		耐久消費財・アパレル	
NEXI SPA	—	2	3	435		ソフトウェア・サービス	
FINECOBANK SPA	5	3	4	566		銀行	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	10	—	—	—		自動車・自動車部品	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
UNICREDIT SPA	百株	百株	千ユーロ	千円			
POSTE ITALIANE SPA	20	12	10	1,331	銀行		
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	5	2	2	312	保険		
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	—	1	1	198	電気通信サービス		
	6	—	—	—	食品・飲料・タバコ		
小計	株数	金額	526	321	138	17,488	
銘柄	銘柄数	比	19	20	—	<0.6%>	
(ユーロ…フランス)							
BOUYGUES	2	1	4	560	資本財		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	5	3	6	765	公益事業		
L'OREAL	2	1	41	5,297	家庭用品・パーソナル用品		
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2	1	75	9,570	耐久消費財・アパレル		
DASSAULT AVIATION SA	0.02	0.02	1	238	資本財		
TALES	1	0.59	4	604	資本財		
CAPGEMINI SA	1	0.88	10	1,305	ソフトウェア・サービス		
INGENICO GROUP	0.6	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
PUBLICIS GROUPE	2	1	4	600	メディア・娯楽		
FAURECIA	0.89	0.42	1	221	自動車・自動車部品		
BOLLORE	5	4	1	178	メディア・娯楽		
MICHELIN (CGDE)-B	1	0.95	10	1,268	自動車・自動車部品		
PERNOD-RICARD	2	1	18	2,389	食品・飲料・タバコ		
RENAULT SA	1	1	3	482	自動車・自動車部品		
REMY COINTREAU	0.3	0.2	2	357	食品・飲料・タバコ		
SEB SA	0.3	0.1	1	180	耐久消費財・アパレル		
SCHNEIDER ELECTRIC SE	5	3	35	4,459	資本財		
VIVENDI SA	9	5	12	1,637	メディア・娯楽		
ORANGE S.A.	20	12	13	1,641	電気通信サービス		
HERMES INTERNATIONAL	0.32	0.17	14	1,773	耐久消費財・アパレル		
DASSAULT SYSTEMES SA	1	0.75	11	1,449	ソフトウェア・サービス		
KERING	0.75	0.45	27	3,419	耐久消費財・アパレル		
CNP ASSURANCES	1	1	1	219	保険		
CARREFOUR SA	6	3	4	574	食品・生活必需品小売り		
ATOS SE	1	0.55	4	520	ソフトウェア・サービス		
SANOFI	11	6	52	6,670	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ACCOR SA	1	0.98	3	390	消費者サービス		
SOCIETE GENERALE-A	7	4	8	1,041	銀行		
TELEPERFORMANCE	0.5	0.3	8	1,033	商業・専門サービス		
EURAZEOT	0.54	0.31	1	215	各種金融		
SODEXO	0.84	0.49	3	471	消費者サービス		
AXA SA	19	11	23	2,913	保険		
PSA PEUGEOT CITROEN	5	3	6	854	自動車・自動車部品		
ESSILORLUXOTTICA	2	1	19	2,513	耐久消費財・アパレル		
CREDIT AGRICOLE SA	11	6	7	895	銀行		
BNP PARIBAS	11	6	28	3,620	銀行		
ORPEA	—	0.3	3	400	ヘルスケア機器・サービス		
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	4	3	12	1,604	資本財		
WENDEL	0.3	0.2	1	244	各種金融		
ILIAD SA	—	0.1	1	220	電気通信サービス		
SAFRAN S.A.	3	1	22	2,858	資本財		
ENGIE	18	10	12	1,608	公益事業		
ALSTOM	1	1	4	593	資本財		
EUTELSAT COMMUNICATIONS	1	—	—	—	メディア・娯楽		
ELECTRICITE DE FRANCE	6	3	4	564	公益事業		
IPSEN	0.5	0.34	2	295	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ARKEMA	0.69	0.38	3	452	素材		
LEGRAND SA	2	1	10	1,310	資本財		

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
EIFFAGE	百株	百株	千ユーロ	千円			
TOTAL SE	0.89	0.44	3	468		資本財	
AEROPORTS DE PARIS	23	14	53	6,737		エネルギー	
NATIXIS	0.34	0.17	1	231		運輸	
UBISOFT ENTERTAINMENT	9	6	1	225		各種金融	
SCOR SE	0.94	0.5	3	493		メディア・娯楽	
VINCI S.A.	1	1	3	466		保険	
DANONE	5	3	26	3,395		資本財	
AIR LIQUIDE	6	3	18	2,389		食品・飲料・タバコ	
BUREAU VERITAS SA	4	2	35	4,435		素材	
GETLINK SE	2	1	3	461		商業・専門サービス	
SUEZ	4	3	4	547		運輸	
EDENRED	3	1	3	549		公益事業	
VALEO SA	2	1	6	382		ソフトウェア・サービス	
BIOMERIEUX	0.48	0.28	1	820		自動車・自動車部品	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	—	0.49	0.4664	547		ヘルスケア機器・サービス	
ALSTOM SA-RIGHTS	—	1	1	216		消費者サービス	
WORLDLINE SA	0.85	1	10	58		資本財	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	0.3	0.2	5	1,313		ソフトウェア・サービス	
AMUNDI SA	0.71	0.34	2	731		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
				283		各種金融	
小計	株数	金額	753	95,116			
銘柄	数	比					
	64	66	—	<3.3%>			
(ユーロ…オランダ)							
AIRBUS SE	5	3	31	3,973		資本財	
RANDSTAD NV	1	0.57	3	379		商業・専門サービス	
WOLTERS KLUWER-CVA	2	1	10	1,314		商業・専門サービス	
KONINKLIJKE VOPAK NV	0.85	0.39	1	215		エネルギー	
AEGON NV	18	10	3	439		保険	
KONINKLIJKE KPN NV	36	20	5	638		電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV	7	3	12	1,634		半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	9	5	22	2,814		ヘルスケア機器・サービス	
HEINEKEN NV	2	1	13	1,668		食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	1	0.64	5	646		食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	1	1	13	1,702		素材	
UNILEVER NV	14	—	—	—		家庭用品・パーソナル用品	
ASML HOLDING NV	4	2	90	11,366		半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	11	6	14	1,770		食品・生活必需品小売	
FERRARI NV	1	0.7	12	1,539		自動車・自動車部品	
CNH INDUSTRIAL NV	10	5	5	669		資本財	
AKZO NOBEL	2	1	10	1,283		素材	
PROSUS	4	2	25	3,194		小売	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	—	3	3	386		食品・飲料・タバコ	
NN GROUP NV	3	1	5	756		保険	
ARGENX SE	—	0.3	7	899		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	—	6	8	1,045		自動車・自動車部品	
JUST EAT TAKEAWAY	—	0.8	6	861		小売	
ABN AMRO BANK NV-CVA	3	1	1	203		銀行	
EXOR NV	1	0.6	3	453		各種金融	
ALTICE EUROPE NV	—	2	1	152		電気通信サービス	
QIAGEN N.V.	2	1	5	632		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADYEN NV	0.11	0.11	18	2,303		ソフトウェア・サービス	
ING GROEP N.V.	38	21	18	2,304		銀行	
小計	株数	金額	358	45,251			
銘柄	数	比					
	24	28	—	<1.6%>			

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円		
ENDESA SA	3	1	4	505	505	公益事業	
BANKINTER SA	6	—	—	—	—	銀行	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	67	37	16	2,034	2,034	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	3	1	3	396	396	公益事業	
REPSOL SA	14	7	6	851	851	エネルギー	
BANCO SANTANDER SA	169	92	26	3,344	3,344	銀行	
TELEFONICA S.A.	48	28	10	1,346	1,346	電気通信サービス	
ENAGAS	2	1	2	347	347	公益事業	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	2	1	4	568	568	資本財	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2	1	5	649	649	資本財	
FERROVIAL SA	4	2	6	816	816	資本財	
MAPFRE SA	10	—	—	—	—	保険	
BANCO DE SABADELL SA	56	—	—	—	—	銀行	
CAIXABANK	36	21	4	611	611	銀行	
IBERDROLA SA	60	34	38	4,840	4,840	公益事業	
AMADEUS IT GROUP SA-A	4	2	17	2,165	2,165	ソフトウェア・サービス	
RED ELECTRICA CORPORATION SA	4	2	3	498	498	公益事業	
BANCO SANTANDER SA-RIGHTS	—	98	1	130	130	銀行	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA(INDITEX)	11	6	18	2,311	2,311	小売	
AENA SME SA	0.67	0.37	5	662	662	運輸	
CELLNEX TELECOM SA	2	1	9	1,244	1,244	電気通信サービス	
GRIFOLIS SA	2	1	3	495	495	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	株数	：金額	516	347	188	23,821	
	銘柄	数	21	19	—	<0.8%>	
(ユーロ…ベルギー)							
KBC GROUPE	2	1	8	1,086	1,086	銀行	
SOFINA	—	0.07	1	239	239	各種金融	
SOLVAY SA	0.82	0.36	3	444	444	素材	
UCB SA	1	0.7	6	783	783	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLRUYT SA	0.73	0.37	1	227	227	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	0.82	0.66	5	687	687	各種金融	
PROXIMUS SA	1	1	2	294	294	電気通信サービス	
GALAPAGOS NV	0.4	0.2	2	253	253	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ELIA GROUP SA/NV	—	0.2	1	232	232	公益事業	
AGEAS	1	0.99	4	525	525	保険	
UMICORE	1	1	4	513	513	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	7	4	24	3,113	3,113	食品・飲料・タバコ	
小計	株数	：金額	19	11	66	8,402	
	銘柄	数	10	12	—	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)							
OMV AG	1	0.82	2	327	327	エネルギー	
VERBUND AG	0.76	0.38	2	281	281	公益事業	
VOESTALPINE AG	1	0.68	1	240	240	素材	
ERSTE GROUP BANK AG	2	1	4	530	530	銀行	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	1	—	—	—	—	銀行	
ANDRITZ AG	0.85	—	—	—	—	資本財	
小計	株数	：金額	8	3	10	1,379	
	銘柄	数	6	4	—	<0.0%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)							
EUROFINS SCIENTIFIC	0.1	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TENARIS SA	5	3	2	276	276	エネルギー	
SES	3	2	1	200	200	メディア・娯楽	
AROUNDOWN SA	8	6	3	465	465	不動産	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
EUROFINS SCIENTIFIC ARCELOMITAL		百株	百株	千ユーロ	千円		
		—	0.7	4	556	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
		5	3	6	816	素材	
小計	株数・金額 銘柄数×比率	23	15	18	2,314		
		5	5	—	<0.1%>		
(ユーロ…フィンランド)							
KESKO OYJ-B SHS		—	1	3	390	食品・生活必需品小売り	
WARTSILA OYJ		4	2	2	255	資本財	
UPM-KYMMENE OYJ		5	2	8	1,060	素材	
STORA ENSO OYJ-R SHS		5	4	5	717	素材	
SAMPO OYJ		4	2	10	1,282	保険	
FORTUM OYJ		4	2	4	575	公益事業	
ELISA CORP-A SHARES		1	0.79	3	441	電気通信サービス	
METSO OYJ		1	—	—	—	資本財	
NOKIA		56	30	9	1,247	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NESTE OYJ		3	2	13	1,742	エネルギー	
NOKIAN RENKAAT OYJ		1	—	—	—	自動車・自動車部品	
KONE OYJ		3	1	12	1,578	資本財	
ORION OYJ		1	0.57	2	288	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	株数・金額 銘柄数×比率	93	51	75	9,578		
		12	11	—	<0.3%>		
(ユーロ…アイルランド)							
CRH PLC		8	4	15	1,929	素材	
KINGSPAN GROUP PLC		1	0.86	5	746	資本財	
KERRY GROUP PLC-A		1	0.87	10	1,323	食品・飲料・タバコ	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		2	1	4	578	素材	
BANK OF IRELAND GROUP PUBLIC LIMITED CO		11	—	—	—	銀行	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		0.71	0.92	15	1,910	消費者サービス	
小計	株数・金額 銘柄数×比率	26	8	51	6,488		
		6	5	—	<0.2%>		
(ユーロ…ポルトガル)							
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		25	16	7	940	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHARES		5	2	2	321	エネルギー	
JERONIMO MARTINS		2	1	1	248	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額 銘柄数×比率	34	20	11	1,510		
		3	3	—	<0.1%>		
(ユーロ…その他)							
UNILEVER PLC		—	8	39	4,938	家庭用品・パーソナル用品	
小計	株数・金額 銘柄数×比率	—	8	39	4,938		
		—	1	—	<0.2%>		
ユーロ計	株数・金額 銘柄数×比率	1,929	1,195	2,368	299,044		
		227	235	—	<10.3%>		
(イギリス…英国市場)							
ANTOFAGASTA PLC		3	2	4	585	素材	
ASHTEAD GROUP PLC		4	2	8	1,142	資本財	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		11	5	3	517	耐久消費財・アパレル	
AVIVA PLC		39	21	7	1,030	保険	
DIAGEO PLC		24	13	38	5,339	食品・飲料・タバコ	
SCHRODERS PLC		0.96	0.96	3	442	各種金融	
DCC PLC		1	0.55	3	443	資本財	
BAE SYSTEMS PLC		32	20	10	1,492	資本財	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		23	12	34	4,863	食品・飲料・タバコ	
HALMA PLC		3	2	4	667	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STANDARD CHARTERED PLC		28	15	7	1,035	銀行	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
IMPERIAL BRANDS PLC	9	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
HSBC HOLDINGS PLC	204		5	7	1,080	食品・飲料・タバコ	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	60		113	48	6,708	銀行	
MEGGITT PLC	8		33	8	1,213	保険	
MORRISON (WM) SUPERMARKETS	24		14	2	347	資本財	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4		1	4	652	食品・飲料・タバコ	
PEARSON PLC	6		4	2	385	メディア・娯楽	
PERSIMMON PLC	3		1	5	709	耐久消費財・アパレル	
PRUDENTIAL PLC	25		15	19	2,709	保険	
RIO TINTO PLC	11		6	34	4,767	素材	
ST JAMES'S PLACE PLC	6		2	3	453	各種金融	
SSE PLC	10		5	7	1,115	公益事業	
BP PLC	204		112	31	4,372	エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	713		387	15	2,113	銀行	
TAYLOR WIMPEY PLC	33		20	3	460	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC	99		59	13	1,890	食品・生活必需品小売り	
SMITH & NEPHEW PLC	8		4	7	1,036	ヘルスケア機器・サービス	
GLAXOSMITHKLINE PLC	50		28	39	5,568	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WEIR GROUP PLC	2		—	—	—	資本財	
ASTRAZENECA PLC	13		7	58	8,151	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BT GROUP PLC	85		48	6	907	電気通信サービス	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	19		—	—	—	小売	
BARCLAYS PLC	174		97	14	2,023	銀行	
INTERTEK GROUP PLC	1		0.9	5	711	商業・専門サービス	
BURBERRY GROUP PLC	4		2	4	571	耐久消費財・アパレル	
NEXT PLC	1		0.74	5	700	小売	
KINGFISHER PLC	21		11	3	440	小売	
ITV PLC	36		—	—	—	メディア・娯楽	
SAINSBURY (J) PLC	17		9	2	297	食品・生活必需品小売り	
G4S PLC	15		—	—	—	商業・専門サービス	
ADMIRAL GROUP PLC	2		1	3	419	保険	
BERKLEY GRP HOLDINGS	1		0.67	3	446	耐久消費財・アパレル	
CENTRICA PLC	45		—	—	—	公益事業	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	43		22	32	4,481	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	37		21	29	4,124	エネルギー	
BUNZL PLC	3		1	4	610	資本財	
RENTOKIL INITIAL PLC	18		10	5	711	商業・専門サービス	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—		0.82	2	291	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	3		1	15	2,111	各種金融	
UNILEVER PLC	11		6	28	3,941	家庭用品・パーソナル用品	
TUI AG-DI	3		—	—	—	消費者サービス	
EXPERIAN PLC	9		5	14	2,041	商業・専門サービス	
MONDI PLC	4		2	4	634	素材	
SEVERN TRENT PLC	2		1	3	422	公益事業	
WHITBREAD PLC	1		1	4	568	消費者サービス	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	2		1	2	325	各種金融	
SMITHS GROUP PLC	4		2	3	485	資本財	
ANGLO AMERICAN PLC	10		7	17	2,504	素材	
3I GROUP PLC	10		5	6	850	各種金融	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	7		4	26	3,714	家庭用品・パーソナル用品	
RELX PLC	19		11	20	2,807	商業・専門サービス	
UNITED UTILITIES PLC	6		3	3	481	公益事業	
OCADO GROUP PLC	4		2	5	782	小売	
GLENCORE PLC	110		57	13	1,903	素材	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
GVC HOLDINGS PLC	百株	百株	千イギリスポンド	千円			
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	4	3	3	459		消費者サービス	
EVRAZ PLC	16	50	6	912		資本財	
NMC HEALTH PLC	—	4	1	238		素材	
NATWEST GROUP PLC	1	—	—	—		ヘルスケア機器・サービス	
SAGE GROUP PLC/THE	48	27	4	649		銀行	
WPP PLC	11	6	3	485		ソフトウェア・サービス	
COCA-COLA HBC AG-CDI	13	7	5	769		メディア・娯楽	
AVEVA GROUP PLC	2	1	3	449		食品・飲料・タバコ	
COMPASS GROUP PLC	—	0.71	2	319		ソフトウェア・サービス	
NATIONAL GRID PLC	16	10	15	2,154		消費者サービス	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	35	20	17	2,468		公益事業	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	24	16	4	660		各種金融	
BHP GROUP PLC	—	2	1	210		保険	
VODAFONE GROUP PLC	21	12	24	3,388		素材	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	265	150	19	2,740		電気通信サービス	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	1	0.96	4	667		消費者サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	4	—	—	—		ソフトウェア・サービス	
FERGUSON PLC	1	0.72	4	617		素材	
M&G PLC	2	1	11	1,539		資本財	
RSA INSURANCE GROUP PLC	25	13	2	368		各種金融	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C ENTITLEMENT	10	5	3	542		保険	
INFORMA PLC	898	—	—	—		資本財	
AUTO TRADER GROUP PLC	12	8	4	669		メディア・娯楽	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	9	5	3	420		メディア・娯楽	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	0.7	0.4	4	609		資本財	
JD SPORTS FASHION PLC	10	10	3	454		保険	
MELROSE INDUSTRIES PLC	2	2	1	253		小売	
JOHNSON MATTHEY PLC	49	27	4	625		資本財	
(イギリス…ロンドンインターナショナル市場)	1	1	2	351		素材	
CARNIVAL PLC	1	—	—	—		消費者サービス	
小計	株数・金額 銘柄数×比率	3,911	1,659	891	124,639		
		91	84	—	<4.3%>		
(スイス…チューリッヒ市場)			千スイスフラン				
LINDT & SPRUENGLI AG	0.02	0.01	7	933		食品・飲料・タバコ	
SWISS PRIME SITE AG	0.85	0.42	3	401		不動産	
(スイス…スイス電子市場)							
THE SWATCH GROUP AG-REG	0.6	—	—	—		耐久消費財・アパレル	
PARGESA HOLDING SA	0.41	—	—	—		各種金融	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	0.18	0.13	3	354		資本財	
(スイス…スイス証券取引所)							
SGS SA	0.06	0.03	7	889		商業・専門サービス	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.03	0.01	1	230		食品・飲料・タバコ	
SWISSCOM AG-REG	0.26	0.16	7	888		電気通信サービス	
GIVAUDAN-REG	0.09	0.05	17	2,067		素材	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1	0.86	31	3,655		保険	
NOVARTIS AG-REG SHS	21	12	100	11,740		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABB LTD	18	10	24	2,886		資本財	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	7	3	117	13,766		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	1	1	6	734		商業・専門サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	4	3	15	1,758		素材	
CLARIANT AG-REG	1	1	2	306		素材	
NESTLE SA-REGISTERED	30	16	162	18,938		食品・飲料・タバコ	
BALOISE HOLDINGS AG	0.5	0.3	4	546		保険	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
TEMENOS AG	百株	百株	千スイスフラン	千円			
SONOVA HOLDING AG	0.7	0.45	5	622	ソフトウェア・サービス		
STRAUMANN HOLDING AG-REG	0.62	0.27	6	704	ヘルスケア機器・サービス		
CREDIT SUISSE GROUP-REG AG	0.1	0.07	7	849	ヘルスケア機器・サービス		
THE SWATCH GROUP AG-B	25	13	16	1,919	各種金融		
LONZA AG-REG	0.35	0.2	4	523	耐久消費財・アパレル		
SWISS LIFE HOLDING AG	0.77	0.44	23	2,795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	0.37	0.18	7	859	保険		
DUFRY AG-REG	0.08	0.03	2	282	素材		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	0.44	—	—	—	小売		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	0.17	0.1	9	1,140	各種金融		
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	0.38	0.18	4	500	資本財		
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	0.5	0.25	4	567	運輸		
GEBERIT AG-REG	—	0.95	7	854	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
JULIUS BAER GROUP LTD	0.37	0.22	11	1,348	資本財		
SWISS RE LTD	2	1	6	742	各種金融		
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-(REGD) A	3	1	14	1,671	保険		
SIKA AG-REG	5	3	22	2,606	耐久消費財・アパレル		
ALCON INC	1	0.8	17	2,085	素材		
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	4	2	16	1,923	ヘルスケア機器・サービス		
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG WRT	—	0.18	1	195	銀行		
UBS GROUP AG	—	6	0.09664	11	耐久消費財・アパレル		
VIFOR PHARMA AG REG	38	20	27	3,155	各種金融		
	0.48	0.28	3	441	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
小計	株数	金額	175	105	735	85,904	
	銘柄	株数(比率)	38	38	—	<3.0%>	
(スウェーデン…ストックホルム市場)			千スウェーデンクローナ				
LUNDBERGS AB-B SHS	0.6	0.6	25	319	各種金融		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	15	9	83	1,026	銀行		
SWEDBANK AB	8	5	79	980	銀行		
SWEDISH MATCH AB	1	0.95	63	777	食品・飲料・タバコ		
SECURITAS AB-B SHS	3	1	25	308	商業・専門サービス		
INVESTOR AB	4	2	150	1,850	各種金融		
HENNES & MAURITZ	7	4	83	1,034	小売		
ERICSSON LM TEL, SEK1 SER B	31	17	178	2,199	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
TELIA CO AB	27	14	51	632	電気通信サービス		
SKANSKA AB-B SHS	4	1	39	483	資本財		
LUNDIN ENERGY AB	2	1	26	329	エネルギー		
ALFA LAVAL AB	3	1	36	454	資本財		
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	1	—	—	—	電気通信サービス		
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	—	0.37	15	196	不動産		
ICA GRUPPEN AB	0.9	0.5	20	253	食品・生活必需品小売		
HUSQVARNA AB-B SHS	4	2	20	257	耐久消費財・アパレル		
ELECTROLUX AB-SER B	2	1	25	311	耐久消費財・アパレル		
SKF AB-B SHS	3	2	45	558	資本財		
VOLVO AB-B SHS	15	8	161	1,993	資本財		
SANDVIK AB	11	6	120	1,486	資本財		
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	—	0.3	8	99	各種金融		
INDUSTRIVARDEN AB-C	1	0.93	24	299	各種金融		
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	—	3	47	582	素材		
HEXAGON AB-B SHS	2	1	123	1,523	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
TELE2 AB-B SHS	5	3	39	487	電気通信サービス		
ATLAS COPCO AB-A SHS	6	3	164	2,026	資本財		
ATLAS COPCO AB-B SHS	3	2	82	1,019	資本財		
EPIROC AB-A	6	3	52	647	資本財		

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
EPIROC AB-B	百株	百株	千円			資本財	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	3	2	349			家庭用品・パーソナル用品	
EQT AB	5	3	88	1,085		各種金融	
BOLIDEN AB	—	1	25	318		素材	
EVOLUTION GAMING GROUP	2	1	44	551		消費者サービス	
KINNEVIK AB-B SHS	—	0.9	66	813		各種金融	
KINNEVIK AB-B SHS	2	—	—	—		各種金融	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	—	1	53	663		各種金融	
ASSA ABLOY AB-B	15	8	77	951		銀行	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	10	5	112	1,389		資本財	
NORDEA BANK ABP	—	1	44	553		資本財	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	32	18	135	1,664		銀行	
	—	0.85	16	197		資本財	
小計	株数・金額 銘柄数(比率)	249	147	2,490	30,680		
		32	38	—	<1.1%>		
(ノルウェー…オスロ市場)			千ノルウェークローネ				
DNB ASA	10	5	86	1,021		銀行	
TELENOR ASA	7	4	60	719		電気通信サービス	
EQUINOR ASA	10	5	83	992		エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	1	1	43	509		素材	
MOWI ASA	4	2	44	521		食品・飲料・タバコ	
NORSK HYDRO ASA	13	7	29	354		素材	
AKER BP ASA	1	—	—	—		エネルギー	
ORKLA ASA	7	4	36	428		食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2	1	21	254		保険	
ADEVINTA ASA	—	1	21	254		メディア・娯楽	
SCHIBSTED ASA-B SHS	—	0.64	20	239		メディア・娯楽	
小計	株数・金額 銘柄数(比率)	58	34	447	5,295		
		9	10	—	<0.2%>		
(デンマーク…コペンハーゲン市場)			千デンマーククローネ				
CARLSBERG AS-B	1	0.58	54	926		食品・飲料・タバコ	
A P MOLLER - MAERSK A/S	0.06	0.04	50	860		運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	0.04	0.02	23	405		運輸	
GN STORE NORD A/S	—	0.76	36	610		ヘルスケア機器・サービス	
DANSKE BANK A/S	6	3	37	635		銀行	
GENMAB A/S	0.69	0.39	91	1,549		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1	1	129	2,199		資本財	
H LUNDBECK A/S	0.86	—	—	—		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DSV PANALPIN A/S	2	1	122	2,084		運輸	
PANDORA A/S	1	0.5	30	514		耐久消費財・アパレル	
CHR HANSEN HOLDING A/S	1	0.6	36	611		素材	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	2	1	41	702		素材	
COLOPLAST-B	1	0.63	55	945		ヘルスケア機器・サービス	
AMBU A/S-B	—	0.96	18	307		ヘルスケア機器・サービス	
NOVO NORDISK A/S-B	17	9	398	6,758		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ISS A/S	1	—	—	—		商業・専門サービス	
TRYG A/S	1	0.68	11	201		保険	
DONG ENERGY A/S	1	1	109	1,861		公益事業	
DEMANIT AS	1	0.45	9	165		ヘルスケア機器・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数(比率)	42	23	1,258	21,341		
		17	17	—	<0.7%>		
(オーストラリア…オーストラリア市場)			千オーストラリアドル				
RAMSAY HEALTH CARE LTD	1	1	6	495		ヘルスケア機器・サービス	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	29	15	36	2,850		銀行	
WESTPAC BANKING CORPORATION	34	20	40	3,156		銀行	

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	百株 12	百株 9	千円 20	1,553	素材	
TELSTRA CORPORATION LTD	42	23	7	555	電気通信サービス	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	4	—	—	—	銀行	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	4	2	3	271	食品・飲料・タバコ	
ASX LIMITED	1	1	8	654	各種金融	
BHP GROUP LIMITED	30	16	68	5,272	素材	
CATLEX AUSTRALIA LTD	2	—	—	—	エネルギー	
COMPUTERSHARE LIMITED	5	2	3	304	ソフトウェア・サービス	
CSL LIMITED	4	2	73	5,657	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REA GROUP LTD	0.66	0.3	4	335	メディア・娯楽	
TRANSURBAN GROUP	26	15	21	1,660	運輸	
COCHLEAR LTD	0.69	0.44	9	730	ヘルスケア機器・サービス	
ORIGIN ENERGY LIMITED	17	9	5	402	エネルギー	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	17	9	79	6,119	銀行	
BORAL LIMITED	11	—	—	—	素材	
RIO TINTO LIMITED	3	2	23	1,838	素材	
APA GROUP	12	6	6	525	公益事業	
ARISTOCRAT LEISURE LIMITED	5	3	10	800	消費者サービス	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	23	13	6	517	保険	
ORICA LIMITED	4	2	3	285	素材	
LENDLEASE GROUP	6	3	5	415	不動産	
BLUESCOPE STEEL LTD	7	2	5	389	素材	
WORLEY LIMITED	3	—	—	—	エネルギー	
SUNCORP GROUP LTD	14	7	7	560	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK & LTD	28	17	41	3,189	銀行	
NEWCREST MINING LIMITED	7	5	14	1,096	素材	
OIL SEARCH LTD	14	13	4	382	エネルギー	
INCITEC PIVOT LIMITED	16	—	—	—	素材	
AMP LIMITED	28	11	2	155	各種金融	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	7	6	3	251	運輸	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	12	8	8	634	保険	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	—	4	5	422	素材	
CHALLENGER LTD	5	—	—	—	各種金融	
SANTOS LIMITED	17	10	6	492	エネルギー	
SONIC HEALTHCARE LTD	4	2	8	639	ヘルスケア機器・サービス	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	19	11	4	343	消費者サービス	
WESFARMERS LIMITED	11	6	31	2,416	小売	
ALUMINA LIMITED	17	—	—	—	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	9	5	12	947	エネルギー	
WOOLWORTHS GROUP LTD	12	7	26	2,053	食品・生活必需品小売	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1	0.72	4	320	各種金融	
SEEK LTD	3	1	4	379	メディア・娯楽	
BRAMBLES LIMITED	14	8	9	740	商業・専門サービス	
MACQUARIE GROUP LIMITED	3	1	26	2,083	各種金融	
CROWN RESORTS LTD	3	—	—	—	消費者サービス	
EVOLUTION MINING LTD	—	9	4	363	素材	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	5	2	9	727	素材	
TREASURY WINE ESTATES LTD	8	4	3	285	食品・飲料・タバコ	
SYDNEY AIRPORT	11	6	4	321	運輸	
AURIZON HOLDINGS LTD	20	11	4	369	運輸	
XERO LTD	—	0.2	2	205	ソフトウェア・サービス	
AFTERPAY LTD	—	1	11	898	ソフトウェア・サービス	
AMPOL LTD	—	1	4	335	エネルギー	
TPG TELECOM LTD	—	3	2	191	電気通信サービス	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
AUSNET SERVICES	百株	百株	千オーストラリアドル	千円			
MEDIBANK PRIVATE LTD	—	10	1	142		公益事業	
AGL ENERGY LTD	21	21	6	480		保険	
SOUTH32 LTD	7	3	4	381		公益事業	
COLES GROUP LIMITED	50	28	7	584		素材	
WISETECH GLOBAL LTD	12	7	13	1,048		食品・生活必需品小売り	
	—	0.84	2	199		ソフトウェア・サービス	
小計	株数：金額 銘柄数<比率>	712 55	407 55	755 —	58,439 <2.0%>		
(ニュージーランド…ウエリントン市場)			千ニュージーランドドル				
RYMAN HEALTHCARE LTD	4	2	3	238		ヘルスケア機器・サービス	
A2 MILK CO LTD	7	4	5	426		食品・飲料・タバコ	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	5	3	12	918		ヘルスケア機器・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD	9	—	—	—		素材	
SPARK NEW ZEALAND LIMITED	19	10	4	338		電気通信サービス	
MERCURY NZ LTD	—	4	3	228		公益事業	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	7	7	5	411		運輸	
MERIDIAN ENERGY LTD	12	7	4	339		公益事業	
小計	株数：金額 銘柄数<比率>	66 7	39 7	39 —	2,902 <0.1%>		
(香港…香港市場)			千香港ドル				
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	3	3	29	401		半導体・半導体製造装置	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	25	15	28	380		不動産	
BANK OF EAST ASIA	14	8	13	182		銀行	
CLP HOLDINGS LIMITED	16	11	78	1,056		公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	12	7	274	3,685		各種金融	
MTR CORPORATION	18	8	34	459		運輸	
HANG SENG BANK	8	5	68	915		銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	15	5	17	237		不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	15	10	41	553		公益事業	
HONG KONG & CHINA GAS	106	58	69	938		公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	24	10	62	834		消費者サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	40	20	49	668		銀行	
NEW WORLD DEVELOPMENT	60	—	—	—		不動産	
SINO LAND CO	38	18	19	258		不動産	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	17	9	92	1,247		不動産	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	6	1	4	60		不動産	
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	10	—	—	—		食品・飲料・タバコ	
WHEELOCK & CO LTD	10	—	—	—		不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	15	10	96	1,296		資本財	
WYNN MACAU LTD	17	9	12	167		消費者サービス	
AIA GROUP LTD	122	68	605	8,127		保険	
HKT TRUST AND HKD LTD	34	24	24	328		電気通信サービス	
SANDS CHINA LTD	27	15	52	699		消費者サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	16	8	18	252		不動産	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	14	8	30	412		不動産	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	—	15	11	155		公益事業	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	13	13	35	472		食品・飲料・タバコ	
WH GROUP LTD	95	32	21	290		食品・飲料・タバコ	
NEW WORLD DEVELOPMENT	—	10	37	505		不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	25	15	87	1,170		資本財	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	8	3	12	161		公益事業	
CK ASSET HOLDINGS LTD	26	16	70	946		不動産	
小計	株数：金額 銘柄数<比率>	851 30	436 29	2,000 —	26,869 <0.9%>		

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール…シンガポール市場)	百株	百株	千円				
SINGAPORE TECH ENGINEERING	20	9	273			資本財	
DBS GROUP HDG LTD	19	10	2,002			銀行	
CITY DEVELOPMENTS	5	5	313			不動産	
SATS LTD	12	—	—			運輸	
SINGAPORE EXCHANGE	9	5	355			各種金融	
CAPITALAND LIMITED	28	15	371			不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	30	—	—			運輸	
SINGAPORE AIRLINES LTD	8	8	275			運輸	
UNITED OVERSEAS BANK	14	7	1,259			銀行	
UOL GROUP LTD	8	3	179			不動産	
VENTURE CORP LTD	2	2	295			テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	88	46	843			電気通信サービス	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	32	18	1,492			銀行	
WILMAR INTERNATIONAL LIMITED	19	11	362			食品・飲料・タバコ	
KEPPEL CORP	17	8	328			資本財	
GENTING SINGAPORE LTD	49	34	225			消費者サービス	
小計	株数・金額 銘柄数×比率	361	182	109	8,577		
		16	14		<0.3%>		
(イスラエル…テルアビブ市場)		チイスラエル・シユケル					
BANK HAPOALIM BM	13	6	447			銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	15	8	507			銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD	0.3	0.13	164			資本財	
ISRAEL DISCOUNT BANK	8	9	342			銀行	
ISRAEL CHEMICALS LTD	7	3	196			素材	
NICE LTD	0.63	0.35	889			ソフトウェア・サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1	1	273			銀行	
AZRIELI GROUP	0.43	—	—			不動産	
小計	株数・金額 銘柄数×比率	47	29	88	2,820		
		8	7		<0.1%>		
合計	株数・金額 銘柄数×比率	11,837	6,248	—	2,666,702		
		1,216	1,213		<92.0%>		

(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) 邦貨換算金額欄の<>内は、純資産総額に対する各國別株式評価額の比率。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載。

(注4) 一印は組み入れなし。

(2020年12月7日現在)

(2) 外国投資信託証券

銘 柄	期首(前期末) 口 数	当 期 末		
		口 数	評 価 額	外貨建 金額 邦貨換算 金額
			千円	千円
(アメリカ)				
AGNC INVESTMENT CORPORATION	0.55	0.3	4	485
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.12	0.075	12	1,334
AMERICAN TOWER CORP	0.44	0.255	58	6,068
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	1	0.79	6	687
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.147	0.077	13	1,393
BOSTON PROPERTIES INC	0.15	0.08	8	876
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.1	0.05	5	524
CROWN CASTLE INTL CORP	0.43	0.245	40	4,169
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.22	0.15	20	2,114
DUKE REALTY CORP	0.4	0.2	7	802
EQUINIX INC	0.082	0.052	36	3,833
Equity LifeStyle Properties Inc	0.18	0.11	6	686
EQUITY RESIDENTIAL PROPS TR	0.39	0.22	13	1,451
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.07	0.04	10	1,052
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.14	0.07	8	833
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	0.08	—	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	0.45	0.3	9	955
HOST HOTELS & RESORTS INC	0.696	0.396	6	645
INVITATION HOMES INC	0.5	0.3	9	944
IRON MOUNTAIN INCORPORATED	0.263	0.183	5	555
iShares Core S&P 500 ETF	0.7	0.55	204	21,248
KIMCO REALTY CORP	0.45	—	—	—
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.15	—	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	0.525	0.275	5	588
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	0.11	0.06	7	781
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	0.15	—	—	—
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	0.2	0.11	4	432
PROLOGIS INC	0.637	0.413	40	4,240
PUBLIC STORAGE	0.15	0.09	20	2,102
REALTY INCOME CORPORATION	0.34	0.19	11	1,211
REGENCY CENTERS CORPORATION	0.19	0.1	4	510
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.11	0.06	17	1,788
SL GREEN REALTY CORP	0.06	—	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.306	0.186	17	1,817
SUN COMMUNITIES INC	0.09	0.05	7	769
UDR INC	0.3	0.16	6	677
VENTAS INC	0.34	0.22	10	1,132
VEREIT INC	0.979	0.609	4	484
VICI PROPERTIES INC	0.3	0.31	8	835
VORNADO REALITY TRUST	0.156	0.106	4	459
WP CAREY INC	0.15	0.1	7	730
WELLTOWER INC	0.4	0.25	16	1,670
WEYERHAEUSER CO	0.77	0.42	12	1,342
小計	証券数 銘柄	金額 数(比率)	14 43	8 38 694 — 72,239 <2.5%

銘柄		期首(前期末)		当期末	
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		0.05	0.05	2	205
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		0.154	—	—	—
小計	証券数・金額 銘柄数(比率)	0.204	0.05	2	205
		2	1	—	<0.0%>
(ユーロ…フランス)				千ユーロ	
ICADE		0.03	—	—	—
KLEPIERRE		0.232	0.11	2	282
GECINA SA		0.055	0.035	4	577
COVIVIO		0.04	0.04	3	388
UNIBAIL RODAMCO WESTFIELD		0.15	0.077	4	608
小計	証券数・金額 銘柄数(比率)	0.507	0.262	14	1,856
		5	4	—	<0.1%>
(イギリス)				千イギリスポンド	
BRITISH LAND COMPANY PLC		0.949	0.49	2	349
SEGRO PLC		1	0.747	6	944
LAND SECURITIES GROUP		0.839	0.392	2	397
小計	証券数・金額 銘柄数(比率)	2	1	12	1,690
		3	3	—	<0.1%>
(オーストラリア)				千オーストラリアドル	
MIRVAC GROUP		3	2	6	479
GPT GROUP		1	1	5	409
STOCKLAND		2	1	6	472
DEXUS		1	0.62	6	466
GOODMAN GROUP		1	0.918	16	1,309
SCENTRE GROUP		5	3	9	707
VICINITY CENTRES		3	1	3	255
小計	証券数・金額 銘柄数(比率)	19	11	53	4,100
		7	7	—	<0.1%>
(香港)				千香港ドル	
LINK REIT		2	1	84	1,141
小計	証券数・金額 銘柄数(比率)	2	1	84	1,141
		1	1	—	<0.0%>
(シンガポール)				千シンガポールドル	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		2	3	6	496
ASCENDAS REAL ESTATE		3	1	4	370
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		3	—	—	—
SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		—	1	2	161
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		—	1	2	227
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		—	2	4	321
小計	証券数・金額 銘柄数(比率)	8	9	20	1,577
		3	5	—	<0.1%>
合計	証券数・金額 銘柄数(比率)	48	32	—	82,811
		64	59	—	<2.9%>

(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) 邦貨換算金額欄の<>内は、純資産総額に対する各國別株式評価額の比率。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載。

(注4) 一印は組み入れなし。

(2020年12月7日現在)

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別		当 期 末		評 価 額	
		買 建 額	売 建 額		
外 国	株 式 先 物 取 引	S&P EMINI FU	百万円 115	百万円 —	
		EURO STOXX50	13	—	
		FTSE 100 IDX	9	—	

(注1) 単位未満は切り捨て。

(注2) 邦貨換算金額は、期首、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3) 一印は組み入れなし。

(2020年12月7日現在)

投資信託財産の構成

項 目	当 期		比 率 %
	評 価 額	千円	
株式		2,666,703	90.8
投資証券		82,811	2.8
コール・ローン等、その他		185,861	6.4
投資信託財産総額		2,935,375	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(2,828,754千円)の投資信託財産総額(2,935,375千円)に対する比率は96.4%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買賣相場の仲値により邦貨換算したもので、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オーストラリアドル=77.33円、1ニュージーランドドル=73.32円、1香港ドル=13.43円、1シンガポールドル=78.03円、1イスラエル・シユケル=31.87円です。

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	3,007,589,041円
コール・ローン等	154,391,928
株式(評価額)	2,666,703,362
投資証券(評価額)	82,811,060
未収入金	80,203,461
未収配当金	3,760,870
差入委託証拠金	19,718,360
(B) 負債	108,508,702
未払資金	104,832,915
未払解約金	3,675,585
未払利息	202
(C) 純資産総額(A-B)	2,899,080,339
元本	918,004,743
次期繰越損益金	1,981,075,596
(D) 受益権総口数	918,004,743口
1万口当たり基準価額(C/D)	31,580円

(注) 当期

期首元本額	1,624,669,333円
期中追加設定元本額	250,756,681円
期中一部解約元本額	957,421,271円
計算口数当たり純資産額	3,1580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グッドラиф2020(年金)	18,242,840円
PRUグッドラиф2030(年金)	171,641,704円
PRUグッドラиф2040(年金)	185,452,484円
PRUグッドラиф2050(年金)	31,945,752円
ブルデンシャル私募海外株式マーケット・パフォーマー(道格機関投資家向け)	510,721,963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	59,422,842円
受取配当金	59,420,008
受取利息	31,105
その他の収益	156,502
支払利息	△ 184,773
(B) 有価証券売買損益	84,357,668
売買益	619,635,474
売買損	△ 535,277,806
(C) 先物取引等取引損益	5,670,430
取引益	55,574,775
取引損	△ 49,904,345
(D) 信託報酬等	△ 15,246,405
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	134,204,535
(F) 前期繰越損益金	2,921,252,220
(G) 追加信託差損益金	433,563,645
(H) 解約差損益金	△ 1,507,944,804
(I) 計	1,981,075,596
(E+F+G+H)	1,981,075,596
次期繰越損益金(I)	1,981,075,596

(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算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。

〈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グッドライフ2040（年金）」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	純資産額
		期中騰落率	期中騰落率		
16期（2016年12月5日）	円 21,541	% △8.0	21,916.40	% △7.9	% 98.4 百万円 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
		騰落率	騰落率	
(期首) 2019年12月5日	円 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) 謄落率は期首比です。

※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す。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の一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

※外債資産のリスク・リターンの数字は、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)	期中の平均基準価額は24,173円です。 その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]}$ 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	
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おります。

(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 国	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
イギリス	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)
	ノルウェー 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	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ナ 422	千ノルウェークローナ —

		種類	買付額	売付額
外 国	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 —
	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			
銘柄	金額	銘柄	金額
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA(ユーロ・ドイツ)	千円 45,668	US TREASURY N/B(アメリカ)	千円 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)

作成期	区分	当期						末			
		評価額		組入率	うちB格以下組入比率	残存期間別組入比率			5年以上	2年以上	2年未満
額面金額	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	千シェケイ 650	千シェケイ 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)

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

作成期		当期					末	
種類	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額			千円
					外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ)		%		千ユーロ	千ユーロ			
(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 0	—	2021/5/25	70	70	8,864		
	FRANCE GOVERNMENT BOND 0	0.5	2025/5/25	55	57	7,311		
	FRANCE GOVERNMENT BOND 0	3.5	2026/4/25	335	410	51,859		
	FRANCE GOVERNMENT BOND 0	0.5	2026/5/25	260	276	34,851		
	FRANCE GOVERNMENT BOND 0	4.0	2038/10/25	215	368	46,585		
	FRANCE GOVERNMENT BOND 0	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 GOVERNMENT	—	2025/3/25	85	87	11,039		
	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT	0.25	2026/11/25	50	52	6,630		
	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT	1.0	2027/5/25	95	104	13,219		
	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT	2.75	2027/10/25	265	326	41,196		
	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT	0.75	2028/5/25	55	60	7,599		
	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT	2.5	2030/5/25	45	57	7,248		
	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT	—	2030/11/25	70	72	9,112		
	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT	1.5	2031/5/25	30	35	4,509		
	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT	1.25	2034/5/25	210	249	31,466		
	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT	3.25	2045/5/25	105	180	22,789		
	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT	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	当 期					末	
種類	銘柄名	利 率	償還年月日	額面金額	評 價 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	千円
(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	0.8	2028/6/22	40	43	5,554	
	KINGDOM OF BELGIUM GOVER	1.0	2031/6/22	135	153	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	1.5	2047/2/20	35	48	6,065	
	REPUBLIC OF AUSTRIA GOVE	2.1	2117/9/20	10	21	2,771	
	FINLAND GOVERNMENT BOND	3.5	2021/4/15	90	91	11,531	
(フィンランド) 国債証券	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	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	3.9	2023/3/20	50	55	6,980	
(アイルランド) 国債証券	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	UNITED KINGDOM GILT	1.5	2021/1/22	千イギリスポンド	千イギリスポンド		
	UNITED KINGDOM GILT	0.75	2023/7/22	110	110	15,403	
	UNITED KINGDOM GILT	0.125	2026/1/30	35	35	4,992	
				235	235	32,913	

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

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

*(2020年12月7日現在)

投資信託財産の構成

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、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
コード・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
未払資金	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
その他の収益	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算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。