

●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グッドライフ2040（年金）	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あります。
	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、ありがたく厚く御礼申し上げます。

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.pgimjp.com/>

<お問い合わせ先>

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

### \* 最近 5 期の運用実績 \*

決 算 期	基 準 価 額			参 考 指 数		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	債 券 組 入 率	投資信託証券比率	純資産総額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
16期 (2016年12月15日)	17,270	0	3.0	18,292.66	3.8	49.1	1.6	45.0	0.5	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 組 入 率	株 式 先 物 率	債 券 組 入 率	投資信託証券比率
		騰 落 率		騰 落 率				
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%
2019年12月16日	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) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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。

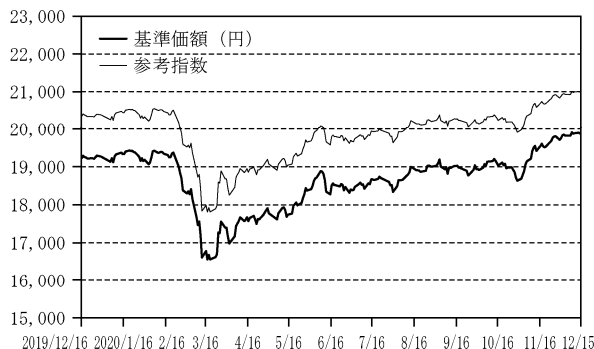
(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率を記載しております。

※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）

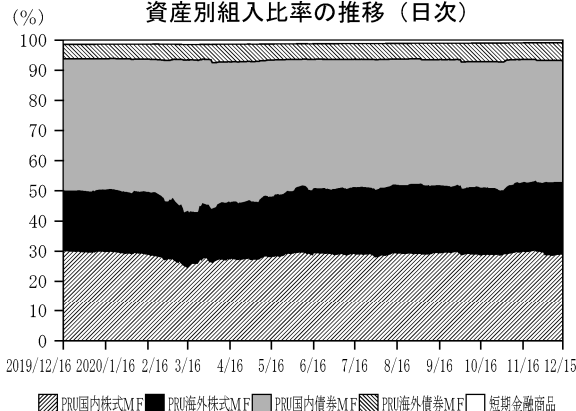


※参考指数は設定日（2001年9月28日）を10,000としています。

#### 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

#### 資産別組入比率の推移（日次）



※MF：マザーファンド

#### <PRUグッドライフ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、人々の生活が再び始めると、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漸増させることにより、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



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、米国を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月に入っても、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）の追加的な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」への警戒感が強まったことから、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ったこと、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劣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、欧州諸国の一部でロックダウン（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月に入っても、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。

### ＜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、

## 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、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ヵ月

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、国債市場の流動性が低下していき、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、カーブはスティーピ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月からのスティーピ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が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えました。

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、多くの主要指数が高値から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、各主要指数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感し上昇した後、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緩和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。

円相場（仲値）の推移



が7月に復興基金の創設に関する合意に達したことも好感され、ユーロを始めとする欧州通貨は騰勢を維持しています。ユーロは1ユーロ=126円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

#### <為替市場>

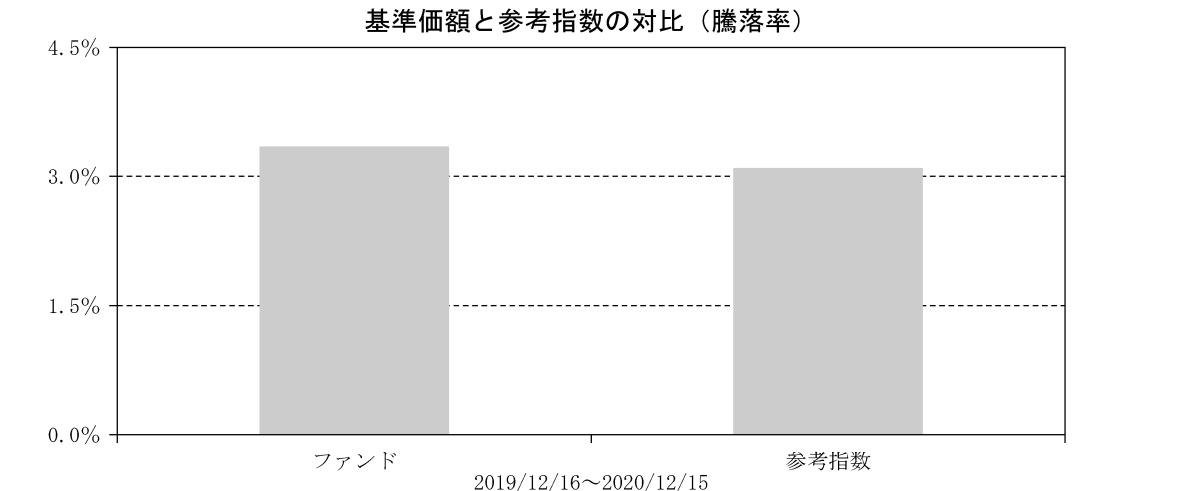
当期の為替市場では、米ドルが対円で下落する一方、ユーロを中心とする欧州通貨は対円で上昇しました。

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。



### Ⅳ 分配金

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

分配原資の内訳  
(単位：円・％、1 万口当たり・税引前)

項目	第20期
	2019年12月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、ファンドの収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。

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、お願い申し上げます。

#### <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。

#### <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ち込みには留意を要するものの、米中貿易戦争の一段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。

**\* 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。
(投信会社)	(10)	(0.055)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(72)	(0.384)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価
(受託会社)	(10)	(0.055)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
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わる費用等が含ま 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。

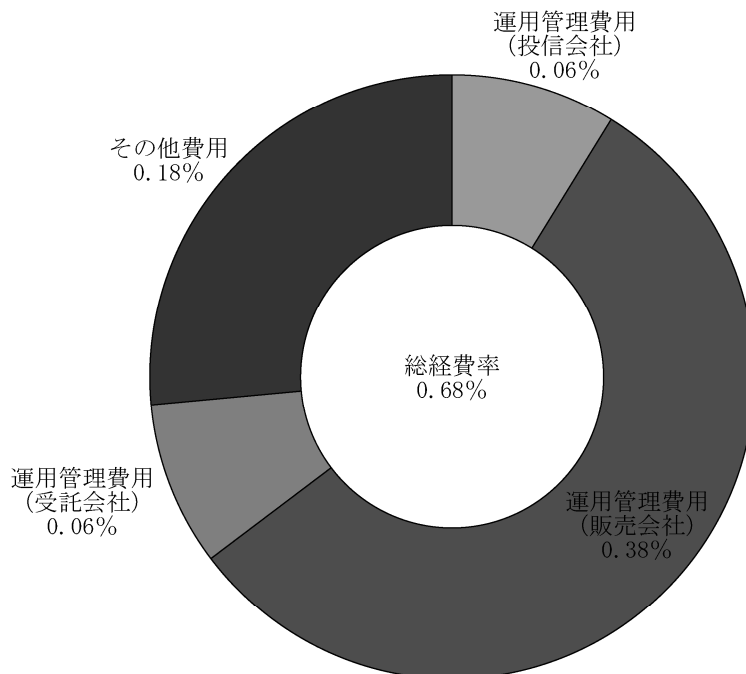
(注2) 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

■総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.68%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	－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	－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リンクです。

**\* 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
	千円	%
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す。なお、当期末における邦貨換算レートは、1アメリカドル=104.12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 繰 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 収 益	△ 28,148円
支 払 利 息	△ 28,148
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	99,927,959
売 買 益	125,301,576
売 買 損	△ 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 繰 越 損 益 金	446,021,217
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	688,142,510
(配 当 等 相 当 額)	( 945,083,868)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 256,941,358)
(G) 計 (D+E+F)	1,221,507,473
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	1,221,507,473
追 加 信 託 差 損 益 金	688,142,510
(配 当 等 相 当 額)	( 945,490,270)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 257,347,760)
分 配 準 備 積 立 金	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いません。

# <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 (TOPIX)		株式組入 比 率	株式先物 比 率	純 資 産 総 額
	円	騰落率 %		騰落率 %			
16期（2016年12月 5 日）	15,358	△ 5.7	1,466.96	△ 7.5	96.6	3.2	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 (TOPIX)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰落率 %		騰落率 %		
(期 首) 2019年12月 5 日	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の指数値およびTOPIXの商標は、㈱東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標または標章に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数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。㈱東京証券取引所は、当ファンドの運用成果等に関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あります。

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

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

**(1) 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				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
	千株	千円	円		千株	千円	円
NTTドコモ	4.1	15,153	3,695	NTTドコモ	13.3	50,617	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
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>				
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	—	—	
<b>鉱業 (0.1%)</b>				
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	—	—	
<b>建設業 (2.4%)</b>				
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	
日本アーク	—	0.1	63	
TATERU	0.5	—	—	
スペースバ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	0.3	0.4	95	
大東建託	0.5	0.4	3,812	
新日本建設	0.2	0.2	171	
N I P P O	0.4	0.3	822	
前田道路	0.4	0.4	681	
日本道路	0.1	—	—	
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	
東京エネシス	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	
大気社	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	—	—	
OSJB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	
<b>食料品 (3.6%)</b>				
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
	千株	千株	千円
中部飼料	0.1	0.1	140
フィード・ワン	1	0.2	177
日本甜菜製糖	0.1	0.1	160
三井製糖	0.1	0.1	178
塩水港精糖	—	0.4	89
日新製糖	0.1	0.1	185
森永製菓	0.3	0.3	1,155
江崎グリコ	0.4	0.4	1,770
名糖産業	0.1	—	—
井村屋グループ	0.1	0.1	255
不二家	0.1	—	—
山崎製パン	0.9	1	1,760
亀田製菓	0.1	0.1	483
寿スビリッツ	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
ブリハム	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 F o o d s	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	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	—	—
ユニカフェ	—	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ーオイルミルズ	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
キュービー	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
	千株	千株	千円
イートアンドホールディングス	0.1	—	—
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
フジッコ	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
なとり	0.1	0.1	191
北の達人コーポレーション	0.5	0.5	246
ユウグレナ	0.6	0.5	398
理研ビタミン	0.1	0.1	139
<b>繊維製品 (0.5%)</b>			
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
トーア紡コーポレーション	—	0.1	48
帝国繊維	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
ゴールドウイン	0.2	0.2	1,346
デサント	0.3	0.3	505
キング	—	0.2	104
ヤマトインターナショナル	—	0.2	68
<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>			
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
三菱製紙	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
トーモク	0.1	0.1	173
ザ・バック	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
テイカ	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
東亜合成	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
日本パーカライジング	0.7	0.6	664
高压ガス工業	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
三菱ケミカルホールディングス	8.4	8.3	5,355
KH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
ダイキョーニシカワ	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
ADEKA	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
コーセー	0.2	0.2	3,238
コタ	0.1	0.1	137
ポーラ・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PMC	—	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
	千株	千株	千円
デクセリアルズ	0.4	0.3	393
アース製薬	0.1	0.1	590
北興化学工業	—	0.1	110
クミアイ化学工業	0.5	0.6	636
日本農薬	0.2	0.3	162
アキレス	0.1	0.1	143
有沢製作所	0.2	0.2	187
日東電工	0.9	0.9	7,812
レック	0.2	0.2	308
三光合成	—	0.3	118
きもと	—	0.3	61
藤森工業	0.1	0.1	475
前澤化成工業	0.1	—	—
未来工業	0.1	0.1	178
J S P	0.1	0.1	157
エフピコ	0.1	0.3	1,218
天馬	0.1	0.1	197
信越ポリマー	0.2	0.3	291
東リ	0.5	—	—
ニフコ	0.5	0.5	1,950
バルカー	0.1	0.1	199
ユニ・チャーム	2.5	2.7	12,546
<b>医薬品 (6.1%)</b>			
協和キリン	1.3	1.3	3,755
武田薬品工業	10.8	10.4	40,248
アステラス製薬	11.4	10.9	16,431
大日本住友製薬	0.9	0.9	1,181
塩野義製薬	1.6	1.6	9,048
田辺三菱製薬	1.6	—	—
わかもと製薬	—	0.2	51
あすか製薬	0.2	0.2	379
日本新薬	0.3	0.3	2,178
バイオフェルミン製薬	—	0.1	243
中外製薬	1.3	3.9	19,648
科研製薬	0.2	0.2	773
エーザイ	1.5	1.5	11,422
ロート製薬	0.7	0.7	2,233
小野薬品工業	3	2.9	9,230
久光製薬	0.4	0.3	1,839
持田製薬	0.2	0.2	787
参天製薬	2.4	2.3	3,942
扶桑薬品工業	0.1	—	—
ツムラ	0.4	0.4	1,248
日医工	0.3	0.4	400
キッセイ薬品工業	0.2	0.2	420
生化学工業	0.3	0.2	207
栄研化学	0.2	0.2	392
鳥居薬品	0.1	0.1	320
J C R ファーマ	0.1	0.4	993
東和薬品	0.2	0.1	186
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
	千株	千株	千円
ゼリア新薬工業	0.3	0.2	377
第一三共	3.7	10.7	37,278
キョーリン製薬ホールディングス	0.3	0.3	561
大幸薬品	0.1	0.2	322
ダイト	0.1	0.1	365
大塚ホールディングス	2.5	2.6	11,432
大正製薬ホールディングス	0.3	0.3	1,965
ベプチドリーム	0.6	0.6	3,192
<b>石油・石炭製品 (0.4%)</b>			
日本コークス工業	1	1.5	108
ニチレキ	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
<b>ゴム製品 (0.5%)</b>			
横浜ゴム	0.7	0.7	1,116
TOYO TIRE	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
バンドー化学	0.2	0.2	118
<b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b>			
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
MARUWA	0.1	—	—
品川リフレクトリーズ	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
<b>鉄鋼 (0.6%)</b>			
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	—	—
合同製鐵	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
大太平洋金属	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	—	—
<b>非鉄金属 (0.7%)</b>			
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
UACJ	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
アーレスティ	0.2	—	—
アサヒホールディングス	0.2	0.2	647
<b>金属製品 (0.6%)</b>			
稲葉製作所	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
東ブレ	0.2	0.2	283
高周波熱錬	0.3	0.2	94
東京製網	0.1	0.1	89
サンコー	—	0.2	90
パイオラックス	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
<b>機械 (5.8%)</b>			
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
オプトラン	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
	千株	千株	千円
やまびこ	0.3	0.2	270
平田機工	0.1	0.1	827
ベガサスミシン製造	0.3	—	—
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
ローツェ	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
帝国電機製作所	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
トーヨーカネツ	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
	千株	千株	千円
日本金銭機械	0.2	0.2	108
マースグループホールディングス	0.1	—	—
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
JUK I	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
T P R	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
ユーション精機	0.1	0.1	83
前澤給装工業	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
I H I	0.9	0.9	1,523
スター精密	0.2	—	—
<b>電気機器 (17.0%)</b>			
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
	千株	千株		千円
マブチモーター	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	
J V C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	—	—	
テクノメディカ	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	
アルバック	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
	千株	千株		千円
日本航空電子工業	0.3	0.3	443	
T O A	0.1	0.1	85	
マクセルホールディングス	0.3	0.3	381	
古野電気	0.2	0.2	229	
ユニデンホールディングス	0.1	—	—	
スミダコーポレーション	0.1	0.1	109	
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	—	—	
レーザーテック	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	
エンブラス	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
	千株	千株		千円
双葉電子工業	0.2	0.2		174
ニチコン	0.4	0.4		444
日本ケミコン	0.1	0.1		167
KOA	0.2	0.2		296
市光工業	0.2	0.2		119
小糸製作所	0.8	0.7	4,886	
ミツバ	0.3	0.2		97
SCREENホールディングス	0.2	0.2	1,424	
キャノン電子	0.2	0.2		300
キャノン	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	
<b>輸送用機器 (7.3%)</b>				
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	1	1	1,586	
名村造船所	0.5	0.9		144
日本車輛製造	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	
武蔵精密工業	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	—		—
トビー工業	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
プレス工業	0.7	0.6		197
ミクニ	—	0.2		59
太平洋工業	0.3	0.2		216
ケーヒン	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
	千株	千株		千円
スズキ	2.6	2.5		13,777
SUBARU	4	3.9		8,275
安永	0.1	0.1		136
ヤマハ発動機	1.7	1.8		3,891
ショーワ	0.3	—		—
TBK	0.3	0.1		44
エクセディ	0.2	0.2		266
豊田合成	0.4	0.4		1,158
愛三工業	0.2	0.2		92
日本ブラスト	0.2	0.1		48
ヨロズ	0.1	0.1		119
エフ・シー・シー	0.2	0.2		413
シマノ	0.5	0.5		12,200
ティ・エス テック	0.3	0.3		948
ジャムコ	0.1	—		—
<b>精密機器 (2.7%)</b>				
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
インターアクション	0.1	0.1		200
東京精密	0.2	0.2		996
マニ	0.5	0.5		1,293
ニコン	2.1	1.9		1,257
トプコン	0.7	0.6		789
オリンパス	7.3	6.9		15,469
理研計器	0.1	0.1		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	0.1	0.1		171
セイコーホールディングス	0.2	0.2		277
ニプロ	0.8	0.8		924
<b>その他製品 (2.8%)</b>				
中本バックス	—	0.1		156
スノーピーク	0.1	0.1		165
バラムウントベッドホールディングス	0.1	0.1		432
トランザクシオン	0.1	0.1		91
ニホンフラッシュ	0.1	0.1		135
前田工繊	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
	千株	千株	千円
SHOEI	0.1	0.1	365
フランスベッドホールディングス	0.2	0.3	257
パイロットコーポレーション	0.2	0.2	603
萩原工業	0.1	0.1	153
トップバン・フォームズ	0.3	0.3	327
フジシールインターナショナル	0.3	0.3	612
タカラトミー	0.5	0.5	480
タカノ	—	0.1	59
プロネクス	0.1	0.1	103
ホクシン	—	0.5	54
大建工業	0.1	0.1	192
凸版印刷	1.9	1.8	2,894
大日本印刷	1.7	1.6	3,049
NISSHA	0.3	0.3	411
TAKARA & COMPANY	0.1	0.1	192
アシックス	1	1.1	2,246
ツツミ	0.1	0.1	206
小松ウオール工業	0.1	0.1	171
ヤマハ	0.8	0.8	5,144
河合楽器製作所	0.1	—	—
ビジョン	0.8	0.8	3,544
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	—	—
グローブライド	0.1	0.1	418
オカムラ	0.4	0.5	463
美津濃	0.1	0.1	201
<b>電気・ガス業 (1.3%)</b>			
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	1.2	1.3	491
沖縄電力	0.3	0.3	416
電源開発	1	1	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	182

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
西部瓦斯	0.1	0.1	327
静岡ガス	0.4	0.4	401
メタウォーター	0.1	0.1	224
<b>陸運業 (3.5%)</b>			
SBS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
SGホールディングス	1.3	2.5	7,212
<b>海運業 (0.2%)</b>			
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
<b>空運業 (0.3%)</b>			
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
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>			
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
澁澤倉庫	0.1	0.1	231
東陽倉庫	0.3	0.2	62
日本トランスシティ	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	—	—
宇徳	—	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
<b>情報・通信業 (9.0%)</b>			
NECネットエスアイ	0.1	0.4	687
システナ	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
キューブシステム	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
コエーテッ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
A G S	—	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
ポルトウウィン・ビッドクルーホールディ	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
コロブラ	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
メディアドゥ	0.1	—	—
じげん	0.2	0.3	98
ブイキューブ	—	0.1	325
フィックスターズ	0.1	0.2	198
CARTA HOLDINGS	0.1	0.1	126
オブティム	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	0.1	0.1	179
日本アジアグループ	—	0.1	78
豆蔵ホールディングス	0.1	—	—
テクマトリックス	0.1	0.2	417
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	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
マークラインズ	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・テクノロジー	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
チェンジ	—	0.1	716
オークネット	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
東邦システムサイエンス	—	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	—
C A C H o l d i n g s	0.1	—	—	—
S B テクノロジー	0.1	—	—	—
トーセ	—	0.1	85	—
オービ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	—
A C C E S S	—	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 ウェイブ	—	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BS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	—
N T T 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	—
K A D O K A W A	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
シーイーシー	0.2	0.1	149	—
カプコン	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	—
日本システムウェア	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	—
NSD	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	—
ミロク情報サービス	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	—
ディーブイエックス	—	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・エスケー・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	—
ウイン・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
	千株	千株	千円
萩原電気ホールディングス	0.1	0.1	245
アズワン	0.1	0.1	1,477
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
タカショー	—	0.1	78
エクセル	0.1	—	—
I D O M	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
日本紙バルブ商事	0.1	0.1	352
日立ハイテク	0.4	—	—
カメイ	0.2	0.2	237
OUG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
キャノンマーケティングジャパン	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
稲畑産業	0.3	0.3	430

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
クワザワホールディングス	—	0.2	114
ヤマエ久野	—	0.1	122
ワキタ	0.3	0.3	336
東邦ホールディングス	0.4	0.4	761
サンゲツ	0.4	0.4	582
ミツウロコグループホールディングス	0.2	0.2	265
シナネンホールディングス	0.1	0.1	292
伊藤忠エネクス	0.3	0.3	298
サンリオ	0.4	0.3	463
サンワテクノス	—	0.1	95
リョーサン	0.1	0.1	190
新光商事	0.2	0.2	146
トーホー	0.1	—	—
三信電気	0.1	0.1	216
東陽テクニカ	0.2	0.2	215
モスフードサービス	0.2	0.2	541
加賀電子	0.1	0.1	212
ソーダニッカ	—	0.2	107
立花エレテック	0.1	0.1	162
フォーバル	—	0.1	87
P A L T A C	0.2	0.2	1,116
三谷産業	—	0.2	81
国際紙バルブ商事	0.5	—	—
ヤマタネ	0.1	0.1	135
日鉄物産	0.1	0.1	365
トラスコ中山	0.3	0.3	816
オートバックスセブン	0.5	0.5	667
モリト	0.1	0.1	60
加藤産業	0.2	0.2	687
イノテック	0.1	0.1	95
イエローハット	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
キャンドウ	0.1	0.1	186
バ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
	千株	千株		千円
エディオン	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
ビックカメラ	0.7	0.8		888
DCMホールディングス	0.6	0.8		900
ベ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
ブロンコビリー	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
ウエ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
シュッピン	—	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
鳥貴族	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
ユニテッド・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
	千株	千株		千円
パロックジャパンリミテッド	0.1	0.1		66
クスリのアオキホールディングス	0.1	0.1		869
ス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
バン・パシフィック・インターナショナルホ	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
VT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
ハイデイ日高	0.2	0.2		345
コロワイド	0.4	0.4		642
ピーシーデポコーポレーション	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
ヨンドシーホールディングス	0.1	0.1		190
ファミリーマート	1.4	—		—
木曽路	0.2	0.2		479
SRS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
リンガーハット	0.2	0.1		225
MrMaxHD	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 DrugStores	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
アークス	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
<b>銀行業 (4.6%)</b>			
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
コンソルディア・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
	千株	千株	千円
名古屋銀行	0.1	0.1	268
北洋銀行	1.8	1.5	349
愛知銀行	0.1	0.1	305
中京銀行	0.1	—	—
大光銀行	0.1	0.1	120
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
<b>証券・商品先物取引業 (0.8%)</b>			
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
マネックスグループ	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
<b>保険業 (2.0%)</b>			
かんぽ生命保険	0.4	0.5	929
SOMPO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インシュアランスグループホール	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
<b>その他金融業 (1.1%)</b>			
全国保証	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
	千株	千株	千円
日本証券金融	0.5	0.6	312
アイフル	2	1.9	495
リコーリース	0.1	0.1	300
イオンフィナンシャルサービス	0.8	0.8	956
アコム	2.6	2.5	1,252
ジャックス	0.1	0.1	183
オリエントコーポレーション	3.4	3.6	406
日立キャピタル	0.3	0.3	715
オリックス	8.1	7.7	12,393
三菱UFJリース	3.1	3.2	1,529
日本取引所グループ	3.5	3.6	9,338
イー・ギャランティ	0.1	0.1	206
NECキャピタルソリューション	0.1	—	—
<b>不動産業 (2.0%)</b>			
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
プ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
オープンハウス	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
イーグルランド	—	0.1	76
ビーロッド	—	0.1	68
ハウスドゥ	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 2 4	0.7	0.7	1,154
パラカ	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
	千株	千株		千円
ゴールドクレスト	0.1	0.1	154	
エスリード	0.1	—	—	
日神グループホールディングス	0.2	0.2	81	
日本エスコン	0.2	0.2	180	
タカラレーベン	0.7	0.4	122	
A V A N T I A	0.1	—	—	
イオンモール	0.6	0.6	994	
毎日コムネット	—	0.1	69	
ファースト住建	0.1	0.1	103	
ランド	—	7.7	69	
カチタス	0.1	0.3	921	
トーセイ	0.2	0.2	239	
サンフロンティア不動産	0.2	0.2	177	
エフ・ジェー・ネクスト	0.1	0.1	100	
グランディハウス	—	0.2	75	
日本空港ビルデング	0.4	0.4	2,564	
サービス業 (5.8%)				
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	
ビ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	
C D S	—	0.1	134	
リンクアンドモチベーション	0.3	0.2	118	
G C A	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	
エプコ	—	0.1	101	
総合警備保障	0.5	0.5	2,640	
カカコム	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
	千株	千株		千円
アウトソーシング	0.7	0.7	999	
ウェルネット	0.2	0.2	96	
ワールドホールディングス	0.1	—	—	
ディー・エヌ・エー	0.6	0.5	952	
博報堂DYホールディングス	1.7	1.7	2,618	
ぐるなび	0.2	0.2	104	
タカミヤ	0.1	0.2	110	
ジャパンベストレスキューシステム	0.1	0.1	89	
ファンコミュニケーションズ	0.4	0.3	130	
ライク	0.1	—	—	
ビジネス・ブレイクスルー	—	0.1	41	
エスプール	0.4	0.3	215	
WDBホールディングス	0.1	0.1	268	
バリューコマース	0.1	0.1	339	
インフォマート	0.7	1.2	1,170	
J Pホールディングス	0.6	0.4	112	
E P Sホールディングス	0.2	0.2	198	
プレステージ・インターナショナル	0.4	0.5	481	
アミューズ	0.1	0.1	255	
クイック	0.1	0.1	114	
ケネディクス	1.2	1	750	
電通グループ	1.3	1.3	4,569	
シーティーエス	0.2	0.1	94	
H. U. グループホールディングス	0.3	0.4	1,140	
アルプス技研	0.1	0.1	216	
サニックス	0.3	0.2	55	
日本空調サービス	0.1	—	—	
オリエンタルランド	1.4	1.3	23,237	
ダスキン	0.3	0.3	820	
明光ネットワークジャパン	0.2	0.2	111	
ファルコホールディングス	0.1	0.1	164	
ラウンドワン	0.4	0.3	279	
リゾートトラスト	0.5	0.6	994	
ビー・エム・エル	0.2	0.2	662	
りらいあコミュニケーションズ	0.2	0.2	257	
リソー教育	0.7	0.7	214	
早稲田アカデミー	—	0.1	96	
ユー・エス・エス	1.4	1.3	2,697	
サイバーエージェント	0.7	0.7	4,774	
楽天	5.6	5.6	5,583	
クリーク・アンド・リバー社	0.1	0.1	102	
モーニングスター	—	0.1	44	
テー・オー・ダブリュー	0.1	—	—	
山田コンサルティンググループ	0.1	0.1	97	
セントラルスポーツ	0.1	—	—	
フルキャストホールディングス	0.1	0.1	173	
エン・ジャパン	0.2	0.2	684	
テクノプロ・ホールディングス	0.2	0.2	1,646	
アイ・アールジャパンホールディングス	0.1	—	—	
K e e P e r 技研	0.1	0.1	208	
G u n o s y	0.1	0.1	73	
イー・ガーディアン	0.1	0.1	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
シグマックス	0.1	0.1	174
ウィルグループ	—	0.1	99
エスクロー・エージェント・ジャパン	—	0.2	61
メドピア	—	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
ベйка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
MS-Japan	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	0.1	0.1	461
グリーンズ	0.1	—	—
GameWith	—	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	—	—
RPAホールディングス	0.1	0.1	63
スブリックス	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
燦ホールディングス	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-CT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
メイテック	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	千株	千株	千円
株 数 ・ 金 額	1,510	1,317	3,050,689
銘柄数 <比 率>	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	
	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) ー印は組み入れなし。

## \* 投資信託財産の構成 \*

(2020年12月7日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
株式	千円 3,050,689	% 96.3
コール・ローン等、その他	115,992	3.7
投資信託財産総額	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 ル ・ 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 総 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 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 (E＋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えによるものを含みます。

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

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

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

# 〈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 比	純 資 産 額
		期 騰 落 率		期 騰 落 率		
	円	%		%	%	百万円
16期 (2016年12月 5 日)	13,424	4.2	381.70	4.2	99.4	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)		債 券 組 入 率 比
		騰 落 率		騰 落 率	
(期 首)	円	%		%	%
2019年12月 5 日	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) 騰落率は期首比です。

※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
		千円	千円
国    内	国 債 証 券	420,193	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
千円		千円	
第359回 利付国債 (10年)	50,336	第139回 利付国債 (5年)	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)

区 分	当 期			未			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B 格 組 以 入 比	B 下 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率	
						5 年 以 上	2 年 以 上 2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	3,655,000 ( 30,000)	4,002,355 ( 34,641)	81.3 ( 0.7)	— (—)	57.5 ( 0.7)	19.7 ( —)	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 証 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 証 券	10,000 ( 10,000)	9,999 ( 9,999)	0.2 ( 0.2)	— (—)	— ( —)	— ( —)	0.2 (0.2)
普 通 社 債 証 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) ー印は組み入れなし。

(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			未		
	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413回	利付国債（2年）	0.1	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		末	
種 類	銘 柄 名		利 率	償還年月日	額 面 金 額	評 価 額
国債証券			%		千円	千円
	第 4 回	利付国債 (40年)	2. 2	2051/ 3 /20	10, 000	14, 245
	第 5 回	利付国債 (40年)	2. 0	2052/ 3 /20	10, 000	13, 796
	第 6 回	利付国債 (40年)	1. 9	2053/ 3 /20	10, 000	13, 607
	第 7 回	利付国債 (40年)	1. 7	2054/ 3 /20	10, 000	13, 087
	第 8 回	利付国債 (40年)	1. 4	2055/ 3 /20	10, 000	12, 239
	第 9 回	利付国債 (40年)	0. 4	2056/ 3 /20	20, 000	18, 302
	第10回	利付国債 (40年)	0. 9	2057/ 3 /20	15, 000	16, 100
	第11回	利付国債 (40年)	0. 8	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	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)	2.5	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
国債証券				%		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			未	
種 類		銘 柄 名		利 率	償還年月日	額 面 金 額	評 価 額	
国債証券				%		千円	千円	
	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 種 類	当 期 銘 柄 名	期 末			
		利 率	償還年月日	額 面 金 額	評 価 額
国債証券		%		千円	千円
	第146回 利付国債 (20年)	1. 7	2033/ 9 /20	35, 000	41, 962
	第147回 利付国債 (20年)	1. 6	2033/12/20	5, 000	5, 941
	第148回 利付国債 (20年)	1. 5	2034/ 3 /20	20, 000	23, 546
	第149回 利付国債 (20年)	1. 5	2034/ 6 /20	25, 000	29, 476
	第150回 利付国債 (20年)	1. 4	2034/ 9 /20	25, 000	29, 180
	第151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 種 類	当 柄 名	期 末			
		利 率	償還年月日	額 面 金 額	評 価 額
地方債証券		%		千円	千円
	平成25年度第10回 千葉県公募公債	0.75	2024/ 1 /25	10,000	10,232
	平成25年度第 1 回 新潟県公募公債	0.65	2023/11/29	10,000	10,190
	平成30年度第 1 回 岐阜県公募公債 (10年)	0.289	2028/10/31	10,000	10,165
	平成26年度第 1 回 大分県公募公債	0.539	2024/10/31	10,000	10,206
	第149回 共同発行市場公募地方債	0.5	2025/ 8 /25	10,000	10,230
	第153回 共同発行市場公募地方債	0.469	2025/12/25	10,000	10,226
	第201回 共同発行市場公募地方債	0.115	2029/12/25	10,000	9,999
	平成25年度第 2 回 島根県公募公債	0.67	2023/11/27	10,000	10,196
	平成24年度第 1 回 静岡市公募公債	0.82	2022/11/22	20,000	20,319
	第488回 名古屋市公募公債 (10年)	0.598	2024/ 9 /20	10,000	10,222
	平成23年度第 4 回 京都市公募公債	1.067	2021/12/22	10,000	10,110
	第12回 横浜市公募公債 (20年)	2.22	2027/ 3 /19	10,000	11,351
	第89回 川崎市公募公債	0.16	2026/12/18	10,000	10,060
	平成22年度第 2 回 北九州市公募公債	1.26	2020/12/24	11,000	11,006
	平成23年度第 9 回 福岡市公募公債	1.01	2022/ 3 /28	10,000	10,130
	平成26年度第 2 回 広島市公募公債	0.456	2024/12/25	12,000	12,216
	平成22年度第 2 回 福井県公募公債	1.4	2021/ 4 /23	10,000	10,052
	平成27年度第 1 回 岡山市公募公債 (10年)	0.395	2026/ 1 /29	10,000	10,179
	第50回 地方公共団体金融機構債券 (20年)	0.53	2036/ 3 /28	10,000	10,261
	第51回 地方公共団体金融機構債券	0.841	2023/ 8 /28	10,000	10,223
	第122回 地方公共団体金融機構債券	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構債券	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構債券	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構債券	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構債券	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 種 類	当 期 銘 柄 名	期 末			
		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	%		千円	千円
	第146回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	2022/ 6 /20	10,000	10,127
	第172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342回 東京交通債券	0.288	2036/ 6 /20	10,000	9,879
	第3回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.4	2022/ 6 /21	10,000	10,363
	第62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。

\* 投資信託財産の構成 \*

(2020年12月 7 日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 4,892,879	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	39,858	0.8
投 資 信 託 財 産 総 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 総 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 権 総 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グッドライフ2020 (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  
ブルデンシャル私塾国内債券マーケット・パフォーマー (適格機関投資家向け) 1,091,139,894円  
ブルデンシャル私塾国内株式・債券バランスファンド (適格機関投資家向け) 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 金 (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) 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。



## &lt;PRU海外株式マザーファンド&gt;

## 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				
	円	%		%	%	%	%	百万円
16期 (2016年12月 5 日)	20,462	△ 4.4	20,414.39	△ 4.9	92.9	3.8	2.6	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)	円	%		%	%	%	%
2019年12月 5 日	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＝ $\frac{\text{〔期中の売買委託手数料〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}}$ 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
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＝ $\frac{\text{〔期中の有価証券取引税〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}}$ 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)	$\text{その他費用} = \frac{\text{〔期中のその他費用〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}}$ 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わ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あります。

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

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

## (1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 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)
	ユ ー ロ	ド イ ツ	千ユーロ 105 ( 4)	123 ( 0.45)	千ユーロ 484 ( 9)
		イ タ リ ア	23	342	97
		フ ラ ン ス	36 ( 1)	75 ( 2)	148 ( 0.3)
		オ ラ ン ダ	25 (△ 8)	55 (△ 43)	109
		ス ペ イ ン	52 ( 253)	21 (4)	329 ( 144)
		ベ ル ギ ー	0.79	6	8
		オ ー ス ト リ ア	2	4	7
		ルクセンブルク	9 ( 0.63)	8 ( ー)	18
		フィンランド	7	11	48
		アイルランド	0.95 ( 0.01)	7 ( ー)	19
		ポ ル ト ガ ル	1 ( 14)	0.83929 (0.12261)	29 ( ー)
		そ の 他	ー ( 8)	ー ( 43)	ー
	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 ( ー)	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	千ノルウェークローネ 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	千ニューージーランドドル 4	32	千ニューージーランドドル 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		百万円	百万円	百万円	百万円
		S&P EMINI FU	614	637	—	—
		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
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC(アメリカ)	0.48	10,468	21,810	APPLE INC(アメリカ)	3	82,495	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
		千口 千円			千口 千円
iShares Core S&P 500 ETF(アメリカ)		0.73 25,659	iShares Core S&P 500 ETF(アメリカ)		0.88 29,583
AMERICAN TOWER CORP(アメリカ)		0.045 1,198	AMERICAN TOWER CORP(アメリカ)		0.23 5,954
PROLOGIS INC(アメリカ)		0.115 1,045	PROLOGIS INC(アメリカ)		0.44 4,137
DIGITAL REALTY TRUST INC(アメリカ)		0.055 857	CROWN CASTLE INTL CORP(アメリカ)		0.23 3,866
EQUINIX INC(アメリカ)		0.01 775	EQUINIX INC(アメリカ)		0.04 2,962
CROWN CASTLE INTL CORP(アメリカ)		0.045 774	SBA COMMUNICATIONS CORP(アメリカ)		0.07 2,255
SBA COMMUNICATIONS CORP(アメリカ)		0.02 655	DIGITAL REALTY TRUST INC(アメリカ)		0.125 1,913
REALTY INCOME CORPORATION(アメリカ)		0.08 613	AVALONBAY COMMUNITIES INC(アメリカ)		0.085 1,533
VICINITY CENTRES(オーストラリア)		5 610	REALTY INCOME CORPORATION(アメリカ)		0.23 1,481
VICI PROPERTIES INC(アメリカ)		0.21 575	EQUITY RESIDENTIAL PROPS TR(アメリカ)		0.2 1,466

(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
		百万円	百万円	百万円
株	式	0.16914	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 千アメリカドル		邦貨換算金額 千円
(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)	当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額 外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
	百株	百株	千アメリカドル	千円
BAXTER INTERNATIONAL INC	4	2	21	2,273
BECTON DICKINSON & CO	2	1	38	3,992
WR BERKLEY CORP	1	0.87	5	612
BERKSHIRE HATHAWAY INC	13	7	182	19,022
BEST BUY COMPANY INC	2	1	13	1,428
BIO-RAD LABORATORIES-A	0.1	0.12	6	698
BLACK KNIGHT INC	1	0.8	7	739
BLACKROCK INC	1	0.88	61	6,443
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	6	3	23	2,453
BOEING CO	5	2	68	7,145
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1	0.8	7	736
BORGWARNER INC	1	1	5	622
BOSTON SCIENTIFIC CORP	14	8	27	2,904
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	23	12	78	8,177
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1	0.65	9	1,009
BROWN & BROWN INC	2	1	5	606
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3	1	13	1,428
BURLINGTON STORES INC	0.6	0.4	9	962
CBS CORP-CL B	3	—	—	—
CBRE GROUP INC	3	2	13	1,368
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2	1	5	535
CIGNA CORP	3	2	45	4,779
CMS ENERGY CORP	2	1	10	1,057
CSX CORP	7	4	40	4,206
CVS HEALTH CORPORATION	13	7	55	5,792
CABLE ONE INC	—	0.02	4	439
CABOT OIL & GAS CORPORATION	4	2	4	427
CAMPBELL SOUP CO	1	0.9	4	454
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	4	2	23	2,476
CARDINAL HEALTH INC	2	1	10	1,067
CARMAX INC	1	1	9	1,034
CARNIVAL CORP	4	2	6	707
CARRIER GLOBAL CORP	—	4	17	1,793
CARVANA CO	—	0.35	8	885
CATALENT INC	—	0.95	9	943
CATERPILLAR INC	5	3	56	5,878
CELANESE CORPORATION	1	0.65	8	897
CENTENE CORP	4	3	21	2,212
CENTERPOINT ENERGY INC	5	2	6	642
CENTURYLINK INC	8	5	5	575
CERIDIAN HCM HOLDING INC	—	0.6	5	608
CHEVRON CORP	19	10	101	10,582
CHEWY INC - CLASS A	—	0.2	1	155
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	0.25	0.15	20	2,083
CHURCH & DWIGHT CO INC	2	1	12	1,258
CITIGROUP INC	22	11	68	7,095
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5	2	8	921
CLOROX COMPANY	1	0.7	13	1,456
CLOUDFLARE INC - CLASS A	—	0.7	5	563
COCA-COLA COMPANY	40	22	122	12,778
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	8	4	38	3,982
COMERICA INC	1	—	—	—
CONAGRA BRANDS INC	5	2	8	923



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	
		百株	百株	千アメリカドル	千円	
CONCHO RRESOURCES INC	2	1	8	871	エネルギー	
CONOCOPHILLIPS	11	6	27	2,810	エネルギー	
CONSOLIDATED EDISON INC	3	1	14	1,489	公益事業	
CONSTELLATION BRANDS INC	1	0.9	19	2,002	食品・飲料・タバコ	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1	—	—	—	エネルギー	
COOPER COS INC/THE	0.5	0.3	10	1,079	ヘルスケア機器・サービス	
CORNING INC	8	4	17	1,777	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CORTEVA INC	8	4	16	1,729	素材	
COTY INC-CL A	2	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
CROWN HOLDINGS INC	1	0.7	6	715	素材	
CUMMINS INC	1	0.8	17	1,831	資本財	
DR HORTON INC	3	1	13	1,409	耐久消費財・アパレル	
DTE ENERGY COMPANY	1	1	13	1,441	公益事業	
DXC TECHNOLOGY CO	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
DANAHER CORP	6	3	80	8,409	ヘルスケア機器・サービス	
DARDEN RESTAURANTS INC	1	0.75	8	896	消費者サービス	
DAVITA INC	1	0.5	5	568	ヘルスケア機器・サービス	
DEERE & CO	3	1	43	4,483	資本財	
DELL TECHNOLOGIES INC-C	1	1	9	968	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DELTA AIR LINES INC	1	1	4	462	運輸	
DEVON ENERGY CORPORATION	3	—	—	—	エネルギー	
WALT DISNEY CO	18	10	157	16,379	メディア・娯楽	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES-W/I	3	1	14	1,463	各種金融	
DOLLAR GENERAL CORP	2	1	29	3,109	小売	
DOMINION ENERGY INC	8	4	36	3,790	公益事業	
DOMINO'S PIZZA INC	0.4	0.25	9	996	消費者サービス	
DOVER CORP	1	0.8	9	1,028	資本財	
DOW INC	7	4	23	2,480	素材	
DUKE ENERGY CORP	7	4	38	4,003	公益事業	
DUPONT DE NEMOURS INC	7	4	27	2,817	素材	
DYNATRACE INC	—	1	4	493	ソフトウェア・サービス	
EOG RESOURCES INC	5	3	18	1,930	エネルギー	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	1	0.7	7	745	素材	
EATON VANCE CORP	1	—	—	—	各種金融	
ECOLAB INC	2	1	33	3,522	素材	
EDISON INTERNATIONAL	3	2	14	1,480	公益事業	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2	3	30	3,213	ヘルスケア機器・サービス	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	4	2	7	795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
EMERSON ELECTRIC CO	6	3	26	2,751	資本財	
ENTERGY CORP	2	1	11	1,221	公益事業	
EPAM SYSTEMS INC	0.6	0.33	10	1,116	ソフトウェア・サービス	
EQUIFAX INC	1	0.7	11	1,213	商業・専門サービス	
EQUITABLE HOLDINGS INC	—	2	5	620	各種金融	
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	1	6	693	公益事業	
EVERGY INC	2	1	7	800	公益事業	
EVERSOURCE ENERGY	3	1	15	1,629	公益事業	
EXELON CORPORATION	9	5	22	2,317	公益事業	
EXXON MOBIL CORPORATION	42	23	98	10,233	エネルギー	
FMC CORP	1	0.7	8	886	素材	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	0.3	0.2	7	730	各種金融	
FAIR ISAAC CORP	—	0.15	7	772	ソフトウェア・サービス	
FEDEX CORPORATION	2	1	41	4,296	運輸	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	6	3	52	5,412	ソフトウェア・サービス	
FNF GROUP	3	1	5	581	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	
	百株	百株	千アメリカドル	千円	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1	1	12	1,347	銀行
FIRSTENERGY CORP	5	3	9	982	公益事業
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	0.9	0.5	13	1,394	ソフトウェア・サービス
FLOWERVE 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 INDUSTRIE	0.4	0.25	4	436	資本財
IDEX 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)	当		期		業	種	等		
		株	数	株	数	評				価	額
						外貨建金額				邦貨換算金額	
		百株		百株		千アメリカドル		千円			
INTERPUBLIC GROUP COS INC		4		2		4		498	メディア・娯楽		
IQIVA HOLDINGS INC		1		1		19		2,006	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		21,837	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 IN		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		
KOHL'S CORP		1		—		—		—	小売		
KROGER CO		8		4		13		1,432	食品・生活必需品小売り		
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 IN		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)	当		末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	百株	千アメリカドル	千円	
MOLINA HEALTHCARE INC	—	0.35	1	7	778	ヘルスケア機器・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY - B	1	1	1	6	643	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	14	7	47	4,902	4,902	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORPORATION	1	1	28	2,973	2,973	各種金融
MORGAN ST DEAN WITTER & CO	12	7	49	5,114	5,114	各種金融
THE MOSAIC COMPANY PRODUCES & DISTRIB-WI	3	1	3	379	379	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1	0.98	16	1,738	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	574	公益事業
NVR INC	0.03	0.02	7	832	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	447	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORPORATION	8	4	27	2,845	2,845	素材
NEXTERA ENERGY INC	4	10	79	8,227	8,227	公益事業
NIKE INC -CL B	12	7	96	10,066	10,066	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	4	1	4	449	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	3,599	運輸
NORTHROP GRUMMAN CORP	1	0.9	27	2,877	2,877	資本財
NUCOR CORP	3	1	9	998	998	素材
OGE ENERGY CORP	2	1	3	342	342	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	9	5	9	1,006	1,006	エネルギー
OMNICOM GROUP	2	1	9	946	946	メディア・娯楽
ONEOK INC	4	2	10	1,057	1,057	エネルギー
OTIS WORLDWIDE CORP	—	2	16	1,681	1,681	資本財
OWENS CORNING	1	0.6	4	463	463	資本財
P G & E CORP	—	8	10	1,078	1,078	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4	2	34	3,634	3,634	銀行
PPG INDUSTRIES INC	2	1	19	1,988	1,988	素材
PPL CORPORATION	7	4	12	1,339	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	831	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	0.9	0.6	18	1,900	1,900	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	1	0.7	19	2,008	2,008	資本財
PAYCOM SOFTWARE INC	0.5	0.3	13	1,364	1,364	ソフトウェア・サービス
PEPSICO INC	14	7	112	11,734	11,734	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	1	0.7	9	1,032	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	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	7,311	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	4	2	16	1,767	1,767	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	1	0.6	4	514	514	公益事業
PINTEREST INC- CLASS A	—	2	17	1,821	1,821	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1	0.9	10	1,068	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	870	保険
PROCTER & GAMBLE CO	25	13	192	20,016	20,016	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	5	3	29	3,074	3,074	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	3	2	18	1,945	1,945	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	5	2	16	1,679	1,679	公益事業
PULTE GROUP INC	3	1	6	700	700	耐久消費財・アパレル
QUEST DIAGNOSTICS INC	1	0.7	8	898	898	ヘルスケア機器・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	1	0.8	6	724	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	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	
		百株	百株	千アメリカドル	千円	
RAYTHEON COMPANY	2	—	—	—	—	資本財
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	—	8	64	6,692	資本財	
REGIONS FINANCIAL CORP	9	5	8	859	銀行	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	0.6	0.4	4	517	保険	
REPUBLIC SERVICES INC	2	1	12	1,294	商業・専門サービス	
RESMED INC	1	0.8	16	1,745	ヘルスケア機器・サービス	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	0.5	0.45	14	1,558	ソフトウェア・サービス	
ROBERT HALF INTL INC	1	0.7	4	480	商業・専門サービス	
ROCKWELL INTL CORP	1	0.65	16	1,677	資本財	
ROLLINS INC	1	1	5	578	商業・専門サービス	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1	0.6	25	2,610	資本財	
S&P GLOBAL INC	2	1	47	4,946	各種金融	
SALESFORCE.COM INC	8	5	116	12,176	ソフトウェア・サービス	
SCHLUMBERGER LTD	13	8	18	1,967	エネルギー	
SEALED AIR CORP	1	1	4	478	素材	
SEMPRA ENERGY	2	1	20	2,134	公益事業	
SERVICENOW INC	1	1	57	6,018	ソフトウェア・サービス	
SHERWIN-WILLIAMS CO	0.8	0.44	31	3,232	素材	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	—	2	8	890	ソフトウェア・サービス	
SMITH (A.O.) CORP	1	0.7	3	401	資本財	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	1	0.65	7	793	食品・飲料・タバコ	
SNAP-ON INC	0.5	0.3	5	565	資本財	
SNAP INC - A	7	5	25	2,603	メディア・娯楽	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	—	0.15	5	605	ソフトウェア・サービス	
SOUTHERN CO	10	5	36	3,777	公益事業	
SOUTHWEST AIRLINES	1	0.7	3	346	運輸	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	1	—	—	—	資本財	
SPRINT CORP-W/I	8	—	—	—	電気通信サービス	
SQUARE INC - A	3	2	44	4,657	ソフトウェア・サービス	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1	0.89	16	1,675	資本財	
STATE STREET CORP	3	2	16	1,709	各種金融	
STRYKER CORP	3	1	44	4,613	ヘルスケア機器・サービス	
SUNTRUST BANKS INC	4	—	—	—	銀行	
SYNCHRONY FINANCIAL	6	2	9	1,019	各種金融	
SYSCO CORP	5	2	20	2,113	食品・生活必需品小売り	
TJX COMPANIES INC	12	6	44	4,646	小売	
T-MOBILE US INC	3	—	—	—	電気通信サービス	
TAPESTRY INC	3	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
TARGET CORP	5	2	49	5,100	小売	
TARGA RESOURCES CORP	2	—	—	—	エネルギー	
TELADOC HEALTH INC	—	0.55	11	1,165	ヘルスケア機器・サービス	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	0.3	0.2	7	817	資本財	
TELEFLEX INC	0.5	0.25	9	1,006	ヘルスケア機器・サービス	
TEXAS INSTRUMENTS INC	9	5	84	8,839	半導体・半導体製造装置	
TEXTRON INC	1	1	5	597	資本財	
THERMO ELECTRON CORP	4	2	104	10,867	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
3M CO	5	3	55	5,743	資本財	
TIFFANY & CO	1	0.6	7	819	小売	
TRANSDIGM CROUP INC	0.5	0.3	18	1,891	資本財	
TRANSUNION	1	1	10	1,081	商業・専門サービス	
THE TRAVELERS COS INC	2	1	19	1,998	保険	
TRUIST FINANCIAL CORP	—	7	37	3,860	銀行	
TWILIO INC - A	1	0.7	22	2,327	ソフトウェア・サービス	
TWITTER INC	7	4	21	2,235	メディア・娯楽	

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		
	百株	百株	千アメリカドル	千円	
TYLER TECHNOLOGIES INC	0.3	0.25	10	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
ZOTETIS 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		業	種	等		
		株	数	株	数	評				価	額
						外貨建金額				邦貨換算金額	
		百株		百株		千アメリカドル		千円			
AON PLC		—		1		26		2,752	保険		
AON PLC		2		—		—		—	保険		
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A		2		1		4		477	保険		
AXALTA COATING SYSTEMS LTD		2		1		4		427	素材		
ACCENTURE PLC-CL A		6		3		89		9,364	ソフトウェア・サービス		
BUNGE LIMITED		1		0.9		5		575	食品・飲料・タバコ		
CAPRI HOLDINGS LIMITED		1		—		—		—	耐久消費財・アパレル		
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS INC		2		1		4		493	食品・飲料・タバコ		
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		
APTIV 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 (アメリカ…アメリカン市場)		1		1		9		947	消費者サービス		
CHENIERE ENERGY INC (アメリカ…米国店頭市場)		2		1		8		871	エネルギー		
ABIOMED 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)	当	期		業	種	等			
		株	数	株	数				評	価	額
									外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカドル	千円						
BROADCOM INC		4	2	91	9,555	半導体・半導体製造装置					
CBOE GLOBAL MARKETS INC		1	0.6	5	581	各種金融					
CDK GLOBAL INC		1	—	—	—	ソフトウェア・サービス					
CDW CORP/DE		1	0.8	10	1,111	テクノロジー・ハードウェアおよび機器					
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC		1	0.7	6	677	運輸					
CME GROUP INC		3	1	35	3,734	各種金融					
CADENCE DESIGN SYSTEM INC		3	1	18	1,909	ソフトウェア・サービス					
CARLYLE GROUP INC/THE		—	0.8	2	242	各種金融					
CERNER CORP		3	1	12	1,314	ヘルスケア機器・サービス					
CHARTER COMMUNICATION-A		1	0.8	53	5,584	メディア・娯楽					
CINCINNATI FINANCIAL CORP		1	1	8	863	保険					
CISCO SYSTEMS INC		43	23	106	11,039	テクノロジー・ハードウェアおよび機器					
CINTAS CORP		0.9	0.5	18	1,891	商業・専門サービス					
CITRIX SYSTEMS INC		1	0.65	8	883	ソフトウェア・サービス					
COGNEX CORP		2	1	7	795	テクノロジー・ハードウェアおよび機器					
COGNIZANT TECH SOLUTIONS		5	3	25	2,615	ソフトウェア・サービス					
COMCAST CORP-CL A		45	25	131	13,686	メディア・娯楽					
COPART INC		2	1	13	1,399	商業・専門サービス					
COSTCO WHOLESALE CORP		4	2	94	9,794	食品・生活必需品小売り					
COSTAR GROUP INC		0.35	0.23	20	2,138	商業・専門サービス					
COUPA SOFTWARE INC		—	0.35	11	1,158	ソフトウェア・サービス					
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A		—	0.85	14	1,479	ソフトウェア・サービス					
DATADOG INC - CLASS A		—	0.8	8	845	ソフトウェア・サービス					
DENTSPLY SIRONA INC		2	1	5	615	ヘルスケア機器・サービス					
DEXCOM INC		1	0.55	19	1,992	ヘルスケア機器・サービス					
DIAMONDBACK ENERGY INC		1	—	—	—	エネルギー					
DISCOVERY INC-A		1	1	3	340	メディア・娯楽					
DISCOVERY INC-C		3	1	4	433	メディア・娯楽					
DISH NETWORK CORPORATION-A		2	1	5	549	メディア・娯楽					
DISH NETWORK CORP-A-RIGHTS		0.15	—	—	—	メディア・娯楽					
DOCUSIGN INC		1	1	24	2,531	ソフトウェア・サービス					
DOLLAR TREE INC		2	1	15	1,569	小売					
DRAFTKINGS INC - CL A		—	0.85	4	435	消費者サービス					
DROPBOX INC-CLASS A		2	2	4	423	ソフトウェア・サービス					
E*TRADE FINANCIAL CORP		2	—	—	—	各種金融					
EAST WEST BANCORP INC		1	—	—	—	銀行					
EBAY INC		7	4	20	2,175	小売					
ELECTRONIC ARTS INC		3	1	20	2,143	メディア・娯楽					
ENPHASE ENERGY INC		—	0.65	8	882	半導体・半導体製造装置					
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A		0.3	0.1	2	231	保険					
ETSY INC		—	0.7	10	1,129	小売					
EXACT SCIENCES CORP		1	0.95	12	1,313	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス					
EXPEDIA GROUP INC		1	0.77	9	1,030	小売					
EXPEDITORS INTL WASH INC		1	0.9	8	843	運輸					
FLIR SYSTEMS INC		1	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器					
FACEBOOK INC-A		24	13	378	39,445	メディア・娯楽					
FASTENAL CO		6	3	16	1,700	資本財					
F5 NETWORKS INC		0.6	0.3	4	518	テクノロジー・ハードウェアおよび機器					
FIFTH THIRD BANCORP		7	4	10	1,140	銀行					
FISERV INC		5	3	37	3,852	ソフトウェア・サービス					
FORTINET INC		1	0.8	10	1,064	ソフトウェア・サービス					
FOX CORPORATION CLASS A		3	1	5	596	メディア・娯楽					
FOX CORPORATION CLASS B		1	0.9	2	274	メディア・娯楽					
GILEAD SCIENCES INC		12	7	44	4,613	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス					



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	
		百株	百株	千アメリカドル	千円	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1	1	6	639	資本財	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	0.8	0.4	6	659	ソフトウェア・サービス	
HOLOGIC INC	2	1	10	1,050	ヘルスケア機器・サービス	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	0.9	0.5	6	714	運輸	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	10	5	7	750	銀行	
IAC/INTERACTIVECORP	—	0.5	7	756	メディア・娯楽	
IAC/INTERACTIVECORP	0.7	—	—	—	メディア・娯楽	
IPG PHOTONICS CORP	0.4	0.2	4	441	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
IDEXX LABORATORIES INC	0.9	0.5	22	2,379	ヘルスケア機器・サービス	
ILLUMINA INC	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	
INCYTE 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	
INSULET CORP	0.4	0.35	9	943	ヘルスケア機器・サービス	
INTEL CORP	44	23	124	12,931	半導体・半導体製造装置	
INTUIT INC	2	1	53	5,562	ソフトウェア・サービス	
INTUITIVE SURGICAL INC	1	0.66	51	5,360	ヘルスケア機器・サービス	
IONIS PHARMACEUTICALS 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	
JUNIPER NETWORKS INC	3	2	4	480	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KLA CORPORATION	1	0.9	23	2,470	半導体・半導体製造装置	
KRAFT HEINZ COMPANY	6	3	13	1,392	食品・飲料・タバコ	
LKQ CORP	3	1	6	656	小売	
LAM RESEARCH CORP	1	0.8	39	4,163	半導体・半導体製造装置	
LIBERTY BROADBAND-A	—	0.15	2	251	メディア・娯楽	
LIBERTY BROADBAND-CORP-C	1	0.6	9	1,018	メディア・娯楽	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	0.8	0.4	1	172	メディア・娯楽	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP C	1	0.8	3	344	メディア・娯楽	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2	1	4	450	メディア・娯楽	
LULULEMON ATHLETICA INC	1	0.7	26	2,747	耐久消費財・アパレル	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	0.4	0.2	10	1,122	各種金融	
MASIMO CORP	—	0.25	6	690	ヘルスケア機器・サービス	
MATCH GROUP INC	—	1	20	2,148	メディア・娯楽	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2	1	13	1,438	半導体・半導体製造装置	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	2	1	1	204	消費者サービス	
MERCADOLIBRE INC	0.45	0.25	38	4,052	小売	
MICROSOFT CORP	73	40	866	90,134	ソフトウェア・サービス	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2	1	20	2,101	半導体・半導体製造装置	
MIDDLEBY CORP	0.5	—	—	—	資本財	
MODERNA INC	—	1	24	2,539	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MONGODB INC	0.5	0.3	8	866	ソフトウェア・サービス	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	0.22	7	735	半導体・半導体製造装置	
MONSTER BEVERAGE CORP	4	2	19	2,002	食品・飲料・タバコ	
NASDAQ INC	1	0.65	8	847	各種金融	
NETAPP INC	2	1	7	749	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NETFLIX INC	4	2	124	12,966	メディア・娯楽	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	0.9	0.5	4	502	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NEWS CORP NEW-CL A-W/I	4	1	3	351	メディア・娯楽	
NORDSON CORP	—	0.3	6	625	資本財	
NORTHERN TRUST CORP	2	1	10	1,085	各種金融	
NORTONLIFELOCK INC	6	3	6	681	ソフトウェア・サービス	
NVIDIA CORP	5	3	187	19,473	半導体・半導体製造装置	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	0.8	0.4	18	1,873	小売	
OKTA INC	1	0.65	15	1,630	ソフトウェア・サービス	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	0.7	0.55	11	1,197	運輸	
ON SEMICONDUCTOR CORP	4	2	7	778	半導体・半導体製造装置	
ORACLE CORPORATION	24	11	68	7,114	ソフトウェア・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	
	百株	百株	千アメリカドル 千円	
PPD INC	—	0.7	2	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 (CHARELES) 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	株数	期首(前期末)	当期		業種等
			株数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
XILINX INC	2	1	千アメリカドル 20	千円 2,155	半導体・半導体製造装置
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL 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 - A	—	0.35	3	402	メディア・娯楽
ZILLOW GROUP INC - C	1	0.75	8	835	メディア・娯楽
ZIONS BANCORPORATION	2	—	—	—	銀行
ZSCALER INC	—	0.4	7	752	ソフトウェア・サービス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	0.95	38	4,054	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 銘柄数<比率>	3,026 608	1,757 594	18,309 —	1,905,634 <65.7%>
(カナダ…トロント市場)			千カナダドル		
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 BK 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)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額 邦貨換算金額		
	百株	百株	千カナダドル	千円	
YAMANA GOLD INC	—	5	3	314	素材
GILDAN ACTIVIWEAR	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 LIFE CO 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
		百株	百株	千カナダドル	千円	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		5	2	12	1,044	素材
SSR MINING INC		—	1	3	302	素材
BAUSCH HEALTH COMPANISE INC		3	1	3	290	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
THOMSON REUTERS CORP		1	0.97	10	822	商業・専門サービス
WSP GLOBAL INC		1	0.5	5	464	資本財
CGI INC		2	1	10	868	ソフトウェア・サービス
IA FINANCIAL CORPORATION INC		1	0.5	2	236	保険
FIRSTSERVICE CORP		—	0.1	1	137	不動産
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 405	株 数 228	1,160	94,552	
銘 柄 数<比 率>		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	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
SARTORIUS AG-VORZUG		0.4	0.2	7	911	ヘルスケア機器・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		12	7	21	2,766	半導体・半導体製造装置
RATIONAL AG		—	0.02	1	178	資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		0.42	0.22	2	309	ヘルスケア機器・サービス
BECHTLE AG		—	0.1	1	219	ソフトウェア・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG		1	1	14	1,844	各種金融
PORSCHЕ AUTOMOBIL HOLDING SE		1	0.85	4	599	自動車・自動車部品
FRAPORT AG		0.54	—	—	—	運輸
WIRECARD AG		1	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LANXESS AG		0.98	0.55	3	408	素材
MTU AERO ENGINES AG		0.5	0.3	6	787	資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE-BEARER		3	2	8	1,055	不動産
SYMRISE AG		1	0.82	8	1,068	素材
BRENNTAG AG		1	0.86	5	676	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG		1	1	3	384	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		—	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・生活必需品小売り
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 銘 柄 数<比 率>	228 57	144 61	655 —	82,753 <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
MEDIABANCA 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	株 数	株 数	期 末		業 種 等
			評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
UNICREDIT SPA	20	12	千ユーロ	千円	銀行
POSTE ITALIANE SPA	5	2	10	1,331	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	—	1	2	312	電気通信サービス
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	6	—	1	198	食品・飲料・タバコ
小 計	526	321	138	17,488	
株 数 ・ 金 額	19	20	—	<0.6%>	
銘 柄 数 < 比 率 >					
(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
THALES	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
EURAZEO	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
		百株	百株	千ユーロ	千円	
EIFFAGE		0.89	0.44	3	468	資本財
TOTAL SE		23	14	53	6,737	エネルギー
AEROPORTS DE PARIS		0.34	0.17	1	231	運輸
NATIXIS		9	6	1	225	各種金融
UBISOFT ENTERTAINMENT		0.94	0.5	3	493	メディア・娯楽
SCOR SE		1	1	3	466	保険
VINCI S. A.		5	3	26	3,395	資本財
DANONE		6	3	18	2,389	食品・飲料・タバコ
AIR LIQUIDE		4	2	35	4,435	素材
BUREAU VERITAS SA		2	1	3	461	商業・専門サービス
GETLINK SE		4	3	4	549	運輸
SUEZ		3	1	3	382	公益事業
EDENRED		2	1	6	820	ソフトウェア・サービス
VALEO SA		2	1	4	547	自動車・自動車部品
BIOMERIEUX		0.48	0.28	3	413	ヘルスケア機器・サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		—	0.49	1	216	消費者サービス
ALSTOM SA-RIGHTS		—	1	0.4664	58	資本財
WORLDLINE SA		0.85	1	10	1,313	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		0.3	0.2	5	731	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA		0.71	0.34	2	283	各種金融
小 計		株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	266 64	155 66	753 —	95,116 <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・生活必需品小売り
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 銘 柄 数 < 比 率 >	185 24	107 28	358 —	45,251 <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	公益事業
BANKINTER SA		6	—	—	—	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA		67	37	16	2,034	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		3	1	3	396	公益事業
REPSOL SA		14	7	6	851	エネルギー
BANCO SANTANDER SA		169	92	26	3,344	銀行
TELEFONICA S.A.		48	28	10	1,346	電気通信サービス
ENAGAS		2	1	2	347	公益事業
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY		2	1	4	568	資本財
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		2	1	5	649	資本財
FERROVIAL SA		4	2	6	816	資本財
MAPFRE SA		10	—	—	—	保険
BANCO DE SABADELL SA		56	—	—	—	銀行
CAIXABANK		36	21	4	611	銀行
IBERDROLA SA		60	34	38	4,840	公益事業
AMADEUS IT GROUP SA-A		4	2	17	2,165	ソフトウェア・サービス
RED ELECTRICA CORPORATION SA		4	2	3	498	公益事業
BANCO SANTANDER SA-RIGHTS		—	98	1	130	銀行
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA (INDITEX)		11	6	18	2,311	小売
AENA SME SA		0.67	0.37	5	662	運輸
CELLNEX TELECOM SA		2	1	9	1,244	電気通信サービス
GRIFOLS SA		2	1	3	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 銘 柄 数<比 率>	516 21	347 19	188 —	23,821 <0.8%>	
(ユーロ…ベルギー)						
KBC GROUPE		2	1	8	1,086	銀行
SOFINA		—	0.07	1	239	各種金融
SOLVAY SA		0.82	0.36	3	444	素材
UCB SA		1	0.7	6	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	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		0.82	0.66	5	687	各種金融
PROXIMUS SA		1	1	2	294	電気通信サービス
GALAPAGOS NV		0.4	0.2	2	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	公益事業
AGEAS		1	0.99	4	525	保険
UMICORE		1	1	4	513	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		7	4	24	3,113	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	19 10	11 12	66 —	8,402 <0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG		1	0.82	2	327	エネルギー
VERBUND AG		0.76	0.38	2	281	公益事業
VOESTALPINE AG		1	0.68	1	240	素材
ERSTE GROUP BANK AG		2	1	4	530	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		1	—	—	—	銀行
ANDRITZ AG		0.85	—	—	—	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	8 6	3 4	10 —	1,379 <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	エネルギー
SES		3	2	1	200	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA		8	6	3	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 ARCELORMITTAL		百株 — 5	百株 0.7 3	千ユーロ 4 6	千円 556 816	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス 素材
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	23 5	15 5	18 —	2,314 <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 12	51 11	75 —	9,578 <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 6	8 5	51 —	6,488 <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 3	20 3	11 —	1,510 <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 1	39 —	4,938 <0.2%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	1,929 227	1,195 235	2,368 —	299,044 <10.3%>	
(イギリス…英国市場)				千イギリスポンド		
ANTOFAGASTA PLC		3	2	4	585	素材
ASHTAD 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	株数	期首(前期末)	当期末		業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額	
IMPERIAL BRANDS PLC	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
HSBC HOLDINGS PLC	9	5	7	1,080	食品・飲料・タバコ
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	204	113	48	6,708	銀行
MEGGITT PLC	60	33	8	1,213	保険
MORRISON(WM) SUPERMARKETS	8	—	—	—	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24	14	2	347	食品・生活必需品小売り
PEARSON PLC	4	1	4	652	食品・飲料・タバコ
PERSIMMON PLC	6	4	2	385	メディア・娯楽
PRUDENTIAL PLC	3	1	5	709	耐久消費財・アパレル
RIO TINTO PLC	25	15	19	2,709	保険
ST JAMES' S PLACE PLC	11	6	34	4,767	素材
SSE PLC	6	2	3	453	各種金融
BP PLC	10	5	7	1,115	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	204	112	31	4,372	エネルギー
TAYLOR WIMPEY PLC	713	387	15	2,113	銀行
TESCO PLC	33	20	3	460	耐久消費財・アパレル
SMITH & NEPHEW PLC	99	59	13	1,890	食品・生活必需品小売り
GLAXOSMITHKLINE PLC	8	4	7	1,036	ヘルスケア機器・サービス
WEIR GROUP 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
ASTRAZENECA PLC	2	—	—	—	資本財
BT GROUP 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
MARKS & SPENCER GROUP PLC	85	48	6	907	電気通信サービス
BARCLAYS PLC	19	—	—	—	小売
INTERTEK GROUP PLC	174	97	14	2,023	銀行
BURBERRY GROUP PLC	1	0.9	5	711	商業・専門サービス
NEXT PLC	4	2	4	571	耐久消費財・アパレル
KINGFISHER PLC	1	0.74	5	700	小売
ITV PLC	21	11	3	440	小売
SAINSBURY (J) PLC	36	—	—	—	メディア・娯楽
G4S PLC	17	9	2	297	食品・生活必需品小売り
ADMIRAL GROUP PLC	15	—	—	—	商業・専門サービス
BERKLEY GRP HOLDINGS	2	1	3	419	保険
CENTRICA PLC	1	0.67	3	446	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	45	—	—	—	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	43	22	32	4,481	エネルギー
BUNZL PLC	37	21	29	4,124	エネルギー
RENTOKIL INITIAL PLC	3	1	4	610	資本財
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18	10	5	711	商業・専門サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP 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
UNILEVER PLC	3	1	15	2,111	各種金融
TUI AG-DI	11	6	28	3,941	家庭用品・パーソナル用品
EXPERIAN PLC	3	—	—	—	消費者サービス
MONDI PLC	9	5	14	2,041	商業・専門サービス
SEVERN TRENT PLC	4	2	4	634	素材
WHITBREAD PLC	2	1	3	422	公益事業
HARGREAVES LANSDOWN PLC	1	1	4	568	消費者サービス
SMITHS GROUP PLC	2	1	2	325	各種金融
ANGLO AMERICAN PLC	4	2	3	485	資本財
3I GROUP PLC	10	7	17	2,504	素材
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	10	5	6	850	各種金融
RELX PLC	7	4	26	3,714	家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES PLC	19	11	20	2,807	商業・専門サービス
OCADO GROUP PLC	6	3	3	481	公益事業
GLENCORE PLC	4	2	5	782	小売
	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
		百株	百株	千イギリスポンド	千円	
GVC HOLDINGS PLC		4	3	3	459	消費者サービス
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		16	50	6	912	資本財
EVRAZ PLC		—	4	1	238	素材
NMC HEALTH PLC		1	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
NATWEST GROUP PLC		48	27	4	649	銀行
SAGE GROUP PLC/THE		11	6	3	485	ソフトウェア・サービス
WPP PLC		13	7	5	769	メディア・娯楽
COCA-COLA HBC AG-CDI		2	1	3	449	食品・飲料・タバコ
AVEVA GROUP PLC		—	0.71	2	319	ソフトウェア・サービス
COMPASS GROUP PLC		16	10	15	2,154	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC		35	20	17	2,468	公益事業
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		24	16	4	660	各種金融
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC		—	2	1	210	保険
BHP GROUP PLC		21	12	24	3,388	素材
VODAFONE GROUP PLC		265	150	19	2,740	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP		1	0.96	4	667	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL		4	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		1	0.72	4	617	素材
FERGUSON PLC		2	1	11	1,539	資本財
M&G PLC		25	13	2	368	各種金融
RSA INSURANCE GROUP PLC		10	5	3	542	保険
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C ENTITLEMENT		898	—	—	—	資本財
INFORMA PLC		12	8	4	669	メディア・娯楽
AUTO TRADER GROUP PLC		9	5	3	420	メディア・娯楽
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		0.7	0.4	4	609	資本財
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC		10	10	3	454	保険
JD SPORTS FASHION PLC		2	2	1	253	小売
MELROSE INDUSTRIES PLC		49	27	4	625	資本財
JOHNSON MATTHEY PLC		1	1	2	351	素材
(イギリス…ロンドンインターナショナル市場)						
CARNIVAL PLC		1	—	—	—	消費者サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	3,911 91	1,659 84	891 —	124,639 <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
		百株	百株	千スイスフラン	千円	
TEMENOS AG		0.7	0.45	5	622	ソフトウェア・サービス
SONOVA HOLDING AG		0.62	0.27	6	704	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG-REG		0.1	0.07	7	849	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP-REG AG		25	13	16	1,919	各種金融
THE SWATCH GROUP AG-B		0.35	0.2	4	523	耐久消費財・アパレル
LONZA AG-REG		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
SWISS LIFE HOLDING AG		0.37	0.18	7	859	保険
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		0.08	0.03	2	282	素材
DUFRY AG-REG		0.44	—	—	—	小売
PARTNERS GROUP HOLDING AG		0.17	0.1	9	1,140	各種金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		0.38	0.18	4	500	資本財
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		0.5	0.25	4	567	運輸
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		—	0.95	7	854	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEBERIT AG-REG		0.37	0.22	11	1,348	資本財
JULIUS BAER GROUP LTD		2	1	6	742	各種金融
SWISS RE LTD		3	1	14	1,671	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-(REGD) A		5	3	22	2,606	耐久消費財・アパレル
SIKA AG-REG		1	0.8	17	2,085	素材
ALCON INC		4	2	16	1,923	ヘルスケア機器・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG		—	0.18	1	195	銀行
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG WRT		—	6	0.09664	11	耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG		38	20	27	3,155	各種金融
VIFOR PHARMA AG REG		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 銘 柄 数 < 比 率 >	175 38	105 38	735 —	85,904 <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・生活必需品小売り
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 3	百株 2	千スウェーデンクローナ 28	千円 349	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B		5	3	88	1,085	家庭用品・パーソナル用品
EQT AB		—	1	25	318	各種金融
BOLIDEN AB		2	1	44	551	素材
EVOLUTION GAMING GROUP		—	0.9	66	813	消費者サービス
KINNEVIK AB-B SHS		2	—	—	—	各種金融
KINNEVIK AB-B SHS		—	1	53	663	各種金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		15	8	77	951	銀行
ASSA ABLOY AB-B		10	5	112	1,389	資本財
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		—	1	44	553	資本財
NORDEA BANK ABP		32	18	135	1,664	銀行
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		—	0.85	16	197	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	249 32	147 38	2,490 —	30,680 <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 9	34 10	447 —	5,295 <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 PANALPINA 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
DEMANT 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 17	23 17	1,258 —	21,341 <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)	当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
	百株	百株	千オーストラリアドル 千円	
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	12	9	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
LENLEASE 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・生活必需品小売り
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	株 数	株 数	期 末		業 種 等
			評 価 額	外 貨 建 金 額	
			千円	千円	
AUSNET SERVICES	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	公益事業
MEDIBANK PRIVATE LTD	—	10	1	142	保険
AGL ENERGY LTD	21	21	6	480	公益事業
SOUTH32 LTD	7	3	4	381	素材
COLES GROUP LIMITED	50	28	7	584	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	12	7	13	1,048	ソフトウェア・サービス
—	—	0.84	2	199	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	712	407	755	58,439
		55	55	—	<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	39	39	2,902
		7	7	—	<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
WHEELLOCK & 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	436	2,000	26,869
		30	29	—	<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	千シンガポールドル	千円	
SINGAPORE TECH ENGINEERING		20	9	3	273	資本財
DBS GROUP HLDG LTD		19	10	25	2,002	銀行
CITY DEVELOPMENTS		5	5	4	313	不動産
SATS LTD		12	—	—	—	運輸
SINGAPORE EXCHANGE		9	5	4	355	各種金融
CAPITALAND LIMITED		28	15	4	371	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD		30	—	—	—	運輸
SINGAPORE AIRLINES LTD		8	8	3	275	運輸
UNITED OVERSEAS BANK		14	7	16	1,259	銀行
UOL GROUP LTD		8	3	2	179	不動産
VENTURE CORP LTD		2	2	3	295	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		88	46	10	843	電気通信サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		32	18	19	1,492	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LIMITED		19	11	4	362	食品・飲料・タバコ
KEPPEL CORP		17	8	4	328	資本財
GENTING SINGAPORE LTD		49	34	2	225	消費者サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	361 16	182 14	109 —	8,577 <0.3%>	
(イスラエル…テルアビブ市場)				千イスラエルシェケル		
BANK HAPOLIM BM		13	6	14	447	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		15	8	15	507	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD		0.3	0.13	5	164	資本財
ISRAEL DISCOUNT BANK		8	9	10	342	銀行
ISRAEL CHEMICALS LTD		7	3	6	196	素材
NICE LTD		0.63	0.35	27	889	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		1	1	8	273	銀行
AZRIELI GROUP		0.43	—	—	—	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	47 8	29 7	88 —	2,820 <0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	11,837 1,216	6,248 1,213	— —	2,666,702 <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国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。

## (2) 外国投資信託証券

(2020年12月7日現在)

銘柄	期首 (前期末)	当	期 末	
			評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円
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 REALTY 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 ・ 金 額	14	8	694
	銘 柄 数 < 比 率 >	43	38	—
				<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	0.204	0.05	2	205
	銘 柄 数<比 率>	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	0.507	0.262	14	1,856
	銘 柄 数<比 率>	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	2	1	12	1,690
	銘 柄 数<比 率>	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	19	11	53	4,100
	銘 柄 数<比 率>	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	2	1	84	1,141
	銘 柄 数<比 率>	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	8	9	20	1,577
	銘 柄 数<比 率>	3	5	—	<0.1%>
合 計	証 券 数 ・ 金 額	48	32	—	82,811
	銘 柄 数<比 率>	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国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) —印は組み入れなし。

## (3) 先物取引の銘柄別期末残高

(2020年12月7日現在)

銘 柄 別			当 期 末	評 価 額
			買 建 額	売 建 額
外 国	株 式 先 物 取 引		百万円	百万円
		S&P EMINI FU	115	—
		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。

\* 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 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売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1アメリカドル=104.08円、1カナダドル=81.45円、1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イスラエルシェケル=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 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グッドライフ2020(年金)	18,242,840円
PRUグッドライフ2030(年金)	171,641,704円
PRUグッドライフ2040(年金)	185,452,484円
PRUグッドライフ2050(年金)	31,945,752円
ブルデンシヤル私塾海外株式マーケット・パフォーマー(適格機関投資家向け)	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 収 益 金	156,502
支 払 利 息	△ 184,773
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	84,357,668
売 買 益 損	619,635,474
売 買 損 益	△ 535,277,806
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	5,670,430
取 引 益 損	55,574,775
取 引 損 益	△ 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 (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えによるものを含みます。

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

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

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

# <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 比	純 資 産 総 額
		期中騰落率		期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
16期（2016年12月 5 日）	21,541	△8.0	21,916.40	△7.9	98.4	6,565
17期（2017年12月 5 日）	23,069	7.1	23,457.64	7.0	98.7	5,498
18期（2018年12月 5 日）	22,457	△2.7	22,836.93	△2.6	98.7	5,234
19期（2019年12月 5 日）	23,358	4.0	23,765.39	4.1	97.4	5,106
20期（2020年12月 7 日）	24,630	5.4	25,065.84	5.5	98.6	5,080

## \* 当期中の基準価額と市況推移 \*

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

（注）騰落率は期首比です。

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

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

## \* 1 万口当たりの費用明細 \*

項目	当期		項目の概要
	2019/12/6～2020/12/7		
	金額	比率	
その他費用 (保管費用)	19円 (19)	0.079% (0.079)	期中の平均基準価額は24,173円です。 その他費用＝ $\frac{\text{〔期中のその他費用〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}}$ 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あります。

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

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

## (1) 公社債

		種 類	買 付 額	売 付 額
外 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
	オーストリア	国 債 証 券	117	72
	フィンランド	国 債 証 券	84	—
	アイルランド	国 債 証 券	64	— (135)
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 927	千イギリスポンド 827
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 118	千スウェーデンクローナ 430
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 422	千ノルウェークローネ —

		種 類	買 付 額	売 付 額
外 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	千マレーシアリングgit 941	千マレーシアリングgit —
	イスラエル	国債証券	千シェケイ 768	千シェケイ —
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド —	千南アフリカランド 5,163

(注1) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切り捨て。

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

## (2) スワップ及び先渡取引状況

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

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

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

### 公社債

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

(注1) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 現先取引によるものは含まれておりません。

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

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

当期における利害関係人との取引はありません。

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



## \* 組入資産の明細 \*

## 債券種類別開示

## 外国（外貨建）公社債

（2020年12月7日現在）

作 成 期	当 期 末							
区 分	額面金額	評 価 額		組 入 率	うちB B 格 以 下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千アメリカドル 18,025	千アメリカドル 20,294	千円 2,112,302	% 41.6	% —	% 19.2	% 12.9	% 9.5
カ ナ ダ	千カナダドル 575	千カナダドル 822	66,973	1.3	—	1.3	0.0	0.0
メ キ シ コ	千メキシカンペソ 5,910	千メキシカンペソ 6,751	35,514	0.7	—	0.6	—	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	2,284	2,960	373,763	7.4	—	4.2	2.5	0.7
イ タ リ ア	3,245	4,068	513,601	10.1	—	6.6	1.7	1.9
フ ラ ン ス	3,270	4,287	541,276	10.7	—	7.9	2.5	0.2
オ ラ ン ダ	615	766	96,751	1.9	—	1.6	0.3	—
ス ペ イ ン	1,730	2,359	297,849	5.9	—	3.9	1.8	0.1
ベ ル ギ ー	755	947	119,659	2.4	—	1.9	0.1	0.3
オーストリア	395	537	67,921	1.3	—	1.3	0.0	—
フィンランド	350	376	47,544	0.9	—	0.7	—	0.2
アイルランド	315	368	46,536	0.9	—	0.6	0.3	—
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 1,645	千イギリスポンド 2,246	313,955	6.2	—	5.8	0.1	0.3
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ 935	千スウェーデンクローナ 1,130	13,922	0.3	—	0.1	0.2	—
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 1,205	千ノルウェークローネ 1,275	15,093	0.3	—	0.1	0.2	—
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 1,645	千デンマーククローネ 2,058	34,911	0.7	—	0.2	0.5	—
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 1,655	千ポーランドズロチ 1,784	50,423	1.0	—	—	0.6	0.4
オーストラリア	千オーストラリアドル 1,735	千オーストラリアドル 2,047	158,335	3.1	—	2.2	0.9	—
シンガポール	千シンガポールドル 255	千シンガポールドル 292	22,852	0.4	—	0.3	0.2	—
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 2,140	千マレーシアリンギット 2,218	56,533	1.1	—	0.1	1.0	—
イ ス ラ エ ル	千シェケイ 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 種類	当 銘柄名	利 率	期 償還年月日	額 面 金 額	末 評 価 額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ) 国債証券		%		千アメリカドル	千アメリカドル	千円
	US TREASURY N/B	3.125	2021/5/15	575	582	60,643
	US TREASURY N/B	2.0	2021/10/31	375	381	39,691
	US TREASURY N/B	2.0	2021/11/15	1,130	1,150	119,696
	US TREASURY N/B	1.75	2022/3/31	890	908	94,592
	US TREASURY N/B	1.625	2022/8/15	610	625	65,068
	US TREASURY N/B	1.75	2022/9/30	325	334	34,806
	US TREASURY N/B	1.875	2022/10/31	335	345	35,999
	US TREASURY N/B	2.0	2022/11/30	285	295	30,745
	US TREASURY N/B	1.75	2023/1/31	110	113	11,841
	US TREASURY N/B	2.875	2023/10/31	400	430	44,834
	US TREASURY N/B	2.5	2024/5/15	1,335	1,437	149,595
	US TREASURY N/B	2.25	2024/11/15	2,260	2,431	253,101
	US TREASURY N/B	2.625	2025/3/31	290	318	33,120
	US TREASURY N/B	2.125	2025/5/15	915	985	102,584
	US TREASURY N/B	2.0	2025/8/15	165	177	18,455
	US TREASURY N/B	2.25	2025/11/15	350	381	39,683
	US TREASURY N/B	1.625	2026/2/15	195	206	21,518
	US TREASURY N/B	1.625	2026/5/15	155	164	17,117
	US TREASURY N/B	6.75	2026/8/15	145	195	20,373
	US TREASURY N/B	1.75	2026/12/31	250	267	27,846
	US TREASURY N/B	1.5	2027/1/31	190	200	20,865
	US TREASURY N/B	2.25	2027/2/15	90	99	10,315
	US TREASURY N/B	6.375	2027/8/15	640	880	91,671
	US TREASURY N/B	0.375	2027/9/30	275	269	28,031
	US TREASURY N/B	2.875	2028/8/15	390	451	46,979
	US TREASURY N/B	5.25	2028/11/15	520	699	72,835
	US TREASURY N/B	5.25	2029/2/15	210	284	29,597
	US TREASURY N/B	2.625	2029/2/15	310	354	36,875
	US TREASURY N/B	0.625	2030/5/15	170	165	17,195
	US TREASURY N/B	0.625	2030/8/15	295	285	29,758
	US TREASURY N/B	4.375	2040/5/15	140	210	21,931
	US TREASURY N/B	4.25	2040/11/15	10	14	1,549
	US TREASURY N/B	1.375	2040/11/15	195	190	19,781
	US TREASURY N/B	4.75	2041/2/15	325	514	53,544
	US TREASURY N/B	3.125	2043/2/15	200	259	26,959
	US TREASURY N/B	2.875	2043/5/15	275	342	35,690
	US TREASURY N/B	3.625	2043/8/15	90	125	13,059
	US TREASURY N/B	3.375	2044/5/15	360	485	50,531
	US TREASURY N/B	2.5	2045/2/15	410	481	50,067

作 成 期	当			期			未	
種 類	銘 柄 名	利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(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	3.0	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)				千カナダドル	千カナダドル			
国債証券	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)				千メキシカンペソ	千メキシカンペソ			
国債証券	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)				千ユーロ	千ユーロ			
(ドイツ)	国債証券	BUNDESOBLIGATION	—	2022/ 4 / 8	260	262	33,148	
		BUNDESREPUB DEUTSCHLAND	6.25	2024/ 1 / 4	170	207	26,177	
		BUNDESREPUB DEUTSCHLAND	5.5	2031/ 1 / 4	174	283	35,841	
		BUNDESREPUB 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	
		(イタリア)	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	
	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	種 類	銘 柄 名	利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	末 価 額	
						評 価	額
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(ユーロ)			%		千ユーロ	千ユーロ	千円
(イタリア)	国債証券	ITALY BUONI POLIENNALI D	2.05	2027/ 8 / 1	80	89	11,302
		ITALY BUONI POLIENNALI D	6.5	2027/11/ 1	315	448	56,622
		ITALY BUONI POLIENNALI D	0.95	2030/ 8 / 1	330	342	43,243
		ITALY BUONI POLIENNALI D	5.0	2034/ 8 / 1	10	15	1,927
		ITALY BUONI POLIENNALI D	3.1	2040/ 3 / 1	30	39	5,006
		ITALY BUONI POLIENNALI D	4.75	2044/ 9 / 1	85	143	18,124
		ITALY BUONI POLIENNALI D	2.7	2047/ 3 / 1	5	6	808
		ITALY BUONI POLIENNALI D	3.45	2048/ 3 / 1	140	203	25,691
		ITALY BUONI POLIENNALI D	2.8	2067/ 3 / 1	20	26	3,327
		REPUBLIC OF ITALY GOVERN	5.125	2024/ 7 /31	535	634	80,045
(フランス)	国債証券	FRANCE GOVERNMENT BOND O	—	2021/ 5 /25	70	70	8,864
		FRANCE GOVERNMENT BOND O	0.5	2025/ 5 /25	55	57	7,311
		FRANCE GOVERNMENT BOND O	3.5	2026/ 4 /25	335	410	51,859
		FRANCE GOVERNMENT BOND O	0.5	2026/ 5 /25	260	276	34,851
		FRANCE GOVERNMENT BOND O	4.0	2038/10/25	215	368	46,585
		FRANCE GOVERNMENT BOND O	1.75	2066/ 5 /25	160	243	30,795
		FRANCE O. A. T.	8.5	2023/ 4 /25	715	873	110,263
		FRANCE O. A. T.	5.75	2032/10/25	390	672	84,955
		FRENCH REPUBLIC GOVERNME	—	2025/ 3 /25	85	87	11,039
		FRENCH REPUBLIC GOVERNME	0.25	2026/11/25	50	52	6,630
		FRENCH REPUBLIC GOVERNME	1.0	2027/ 5 /25	95	104	13,219
		FRENCH REPUBLIC GOVERNME	2.75	2027/10/25	265	326	41,196
		FRENCH REPUBLIC GOVERNME	0.75	2028/ 5 /25	55	60	7,599
		FRENCH REPUBLIC GOVERNME	2.5	2030/ 5 /25	45	57	7,248
		FRENCH REPUBLIC GOVERNME	—	2030/11/25	70	72	9,112
		FRENCH REPUBLIC GOVERNME	1.5	2031/ 5 /25	30	35	4,509
		FRENCH REPUBLIC GOVERNME	1.25	2034/ 5 /25	210	249	31,466
		FRENCH REPUBLIC GOVERNME	3.25	2045/ 5 /25	105	180	22,789
		FRENCH REPUBLIC GOVERNME	2.0	2048/ 5 /25	60	86	10,975
(オランダ)	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT B	7.5	2023/ 1 /15	115	135	17,066
		NETHERLANDS GOVERNMENT B	0.5	2026/ 7 /15	260	277	35,008
		NETHERLANDS GOVERNMENT B	0.75	2028/ 7 /15	10	11	1,393
		NETHERLANDS GOVERNMENT B	—	2030/ 7 /15	100	104	13,201
		NETHERLANDS GOVERNMENT B	3.75	2042/ 1 /15	90	167	21,121
		NETHERLANDS GOVERNMENT B	2.75	2047/ 1 /15	40	70	8,960
(スペイン)	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0	2029/ 1 /31	15	22	2,837
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.75	2032/ 7 /30	285	468	59,108
		SPAIN GOVERNMENT BOND	0.05	2021/ 1 /31	45	45	5,686
		SPAIN GOVERNMENT BOND	3.8	2024/ 4 /30	230	264	33,343
		SPAIN GOVERNMENT BOND	2.75	2024/10/31	25	28	3,558
		SPAIN GOVERNMENT BOND	4.65	2025/ 7 /30	360	446	56,323

作 成 期 種 類	銘 柄 名	利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	末 価 額	
					評 価	額
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(ユーロ)		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
(スペイン) 国債証券	SPAIN GOVERNMENT BOND	5.9	2026/7/30	110	149	18,840
	SPAIN GOVERNMENT BOND	5.15	2028/10/31	110	155	19,694
	SPAIN GOVERNMENT BOND	1.95	2030/7/30	50	59	7,473
	SPAIN GOVERNMENT BOND	1.25	2030/10/31	225	250	31,677
	SPAIN GOVERNMENT BOND	2.35	2033/7/30	35	44	5,561
	SPAIN GOVERNMENT BOND	4.7	2041/7/30	120	214	27,026
	SPAIN GOVERNMENT BOND	5.15	2044/10/31	30	58	7,438
	SPAIN GOVERNMENT BOND	2.9	2046/10/31	30	44	5,641
	SPAIN GOVERNMENT BOND	3.45	2066/7/30	60	108	13,637
(ベルギー) 国債証券	BELGIUM GOVERNMENT BOND	4.0	2022/3/28	115	122	15,418
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	0.8	2025/6/22	45	48	6,065
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	1.0	2026/6/22	240	261	33,052
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	4.25	2041/3/28	115	208	26,350
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	2.15	2066/6/22	65	109	13,824
	KINGDOM OF BELGIUM GOVER	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
(フィンランド) 国債証券	FINLAND GOVERNMENT BOND	3.5	2021/4/15	90	91	11,531
	FINLAND GOVERNMENT BOND	0.5	2026/4/15	195	207	26,169
	FINLAND GOVERNMENT BOND	—	2030/9/15	20	20	2,620
	FINLAND GOVERNMENT BOND	1.125	2034/4/15	35	41	5,220
	FINLAND GOVERNMENT BOND	2.625	2042/7/4	10	15	2,002
(アイルランド) 国債証券	IRELAND GOVERNMENT BOND	3.9	2023/3/20	50	55	6,980
	IRELAND GOVERNMENT BOND	5.4	2025/3/13	45	56	7,159
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.0	2026/5/15	25	27	3,427
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.9	2028/5/15	135	148	18,743
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.3	2033/5/15	5	5	745
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.7	2037/5/15	20	25	3,212
	IRELAND GOVERNMENT BOND	2.0	2045/2/18	35	49	6,266
小 計						2,104,902
(イギリス) 国債証券				千イギリスポンド	千イギリスポンド	
	UNITED KINGDOM GILT	1.5	2021/1/22	110	110	15,403
	UNITED KINGDOM GILT	0.75	2023/7/22	35	35	4,992
	UNITED KINGDOM GILT	0.125	2026/1/30	235	235	32,913

作 成 期 種 類	銘 柄 名	利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	末	
					評 価 額	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(イギリス) 国債証券	UNITED KINGDOM GILT	%		千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円
	UNITED KINGDOM GILT	1.5	2026/7/22	10	10	1,511
	UNITED KINGDOM GILT	1.75	2037/9/7	30	34	4,846
	UNITED KINGDOM GILT	4.25	2039/9/7	15	24	3,364
	UNITED KINGDOM GILT	4.25	2040/12/7	210	342	47,909
	UNITED KINGDOM GILT	4.5	2042/12/7	10	17	2,416
	UNITED KINGDOM GILT	3.25	2044/1/22	15	22	3,125
	UNITED KINGDOM GILT	3.5	2045/1/22	220	343	48,015
	UNITED KINGDOM GILT	4.25	2046/12/7	170	301	42,118
	UNITED KINGDOM GILT	1.5	2047/7/22	10	11	1,589
	UNITED KINGDOM GILT	1.75	2049/1/22	330	398	55,695
	UNITED KINGDOM GILT	3.5	2068/7/22	15	30	4,277
	UNITED KINGDOM TREASURY	4.25	2032/6/7	230	327	45,776
小 計						313,955
(スウェーデン) 国債証券	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
	SWEDEN GOVERNMENT BOND			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
	NORWAY GOVERNMENT BOND			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
	DENMARK GOVERNMENT BOND			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
	POLAND GOVERNMENT BOND			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 種 類	当 期 銘 柄 名	利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	末 期	
					評 価 額	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(オーストラリア) 国債証券	AUSTRALIA GOVERNMENT BON	%		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円
	AUSTRALIA GOVERNMENT BON	3.25	2039/ 6 /21	35	43	3,391
	AUSTRALIA GOVERNMENT BON	3.0	2047/ 3 /21	45	54	4,244
	AUSTRALIA GOVERNMENT BON	1.75	2051/ 6 /21	20	18	1,454
小 計						158,335
(シンガポール) 国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT BON	3.0	2024/ 9 / 1	100	109	8,555
	SINGAPORE GOVERNMENT BON	2.875	2030/ 9 / 1	135	159	12,481
	SINGAPORE GOVERNMENT BON	2.25	2036/ 8 / 1	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	1,955	2,023	51,564
	MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.844	2033/ 4 /15	185	195	4,969
小 計						56,533
(イスラエル) 国債証券	ISRAEL GOVERNMENT BOND -	1.5	2023/11/30	千シェケイ	千シェケイ	
	ISRAEL GOVERNMENT BOND -	2.25	2028/ 9 /28	425	441	14,056
	ISRAEL GOVERNMENT BOND -			110	123	3,943
	ISRAEL GOVERNMENT BOND -	5.5	2042/ 1 /31	115	200	6,388
小 計						24,388
合 計						5,010,107

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

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

スワップ及び先渡取引残高

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

## \* 投資信託財産の構成 \*

(2020年12月7日現在)

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

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

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

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

## \* 特定資産の価格等の調査 \*

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

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

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



# \* 資産、負債、元本および基準価額の状況 \*

(2020年12月 7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	5,654,395,952円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	35,485,019
公 社 債(評価額)	5,010,108,048
未 収 入 金	571,179,285
未 収 利 息	36,794,267
前 払 費 用	829,333
(B) 負 債	573,867,692
未 払 金	571,995,301
未 払 解 約 金	1,872,306
未 払 利 息	85
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	5,080,528,260
元 本	2,062,725,454
次 期 繰 越 損 益 金	3,017,802,806
(D) 受 益 権 総 口 数	2,062,725,454口
1 万口当たり基準価額 (C／D)	24,630円

(注) 当期

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

# \* 損益の状況 \*

当期 (自2019年12月 6日 至2020年12月 7日)

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

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

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

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

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