

## 【表紙】

|                                      |  |
|--------------------------------------|--|
| 【提出書類】                               | 有価証券届出書  |
| 【提出先】                                | 関東財務局長殿  |
| 【提出日】                                | 平成26年3月10日   |
| 【発行者名】                               | ブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・<br>ジャパン株式会社               |
| 【代表者の役職氏名】                           | 代表取締役社長 新田 恭久                                      |
| 【本店の所在の場所】                           | 東京都千代田区永田町二丁目13番10号<br>ブルデンシャルタワー                  |
| 【事務連絡者氏名】                            | 倉町 総一郎<br>(連絡場所) 東京都千代田区永田町二丁目13番10号<br>ブルデンシャルタワー |
| 【電話番号】                               | 03-6832-7150                                       |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託受<br>益証券に係るファンドの名称】 | PRUグッドライフ2020                                      |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託受<br>益証券の金額】        | 継続募集額 上限1,000億円                                    |
| 【縦覧に供する場所】                           | 該当事項はありません   |

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

PRUグッドライフ2020（以下「当ファンド」といいます。）

当ファンドとともに「PRUグッドライフ2030」、「PRUグッドライフ2040」を総称して「PRUグッドライフ・ファンド」という名称を使用します。また、これらのファンドを総称して、または各ファンドについて「順風満帆」という愛称を用いることがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

当初元本は1口当たり1円です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるプルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社（以下「委託会社」といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

1,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

なお、収益分配金の自動再投資の場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

\* 「基準価額」とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されることがあります。

\* 基準価額は、原則として毎営業日計算されます。

\* 基準価額は、組入有価証券の値動き等により、日々変動します。

基準価額は、委託会社にお問合わせください。なお、委託会社の指定する第一種金融商品取引業者（委託会社の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。）および銀行、保険会社等の登録金融機関（以下総称して「販売会社」といいます。）でも入手できます。また、基準価額は、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」欄に、「グッド20」として掲載されます。

| 委託会社問合わせ先       |  |
|-----------------|--|
| ふる<br>PRUホットライン | 03-6832-7111<br>受付時間：営業日の9:00～17:00<br>土日・祝休日、12月31日～1月3日は休業 |
| ホームページ          | <a href="http://www.pru.co.jp/">http://www.pru.co.jp/</a>    |

**( 5 ) 【申込手数料】**

申込手数料は、3.15%<sup>\*</sup>（税抜3.0%）を上限として販売会社がそれぞれ定める手数料率を、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に乗じて得た額とします。

\* 消費税率が8%になった場合は、3.24%（税込）となります。

各販売会社の申込手数料については、前記「(4) 発行（売出）価格」に記載の委託会社にお問合わせください。

なお、「自動けいぞく投資コース」を選択し、収益分配金（税控除後）の自動再投資により当ファンドを取得する場合には、申込手数料はかかりません。

**( 6 ) 【申込単位】**

申込単位は、販売会社がそれぞれ定める単位とします。

各販売会社の申込単位については、前記「(4) 発行（売出）価格」に記載の委託会社にお問合わせください。

**( 7 ) 【申込期間】**

平成26年3月11日から平成27年3月10日まで

（申込期間は、上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

販売会社の本・支店、営業所等とします。ただし、販売会社によっては一部の店舗で申込みの取扱いを行わない場合があります。

販売会社については、前記「(4) 発行（売出）価格」に記載の委託会社にお問合わせください。

**( 9 ) 【払込期日】**

当ファンドの取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×取得申込口数）に申込手数料ならびに申込手数料に係る消費税相当額および地方消費税相当額（以下「消費税等相当額」といいます。）を加算した額を、販売会社の定める日までに支払うものとします。

各取得申込受付日に係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社より、委託会社の指定する口座を経由して受託銀行である株式会社りそな銀行（以下「受託銀行」といいます。）の指定するファンド口座に払い込まれます。

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

申込みの取扱いを行った販売会社において払込みを取扱います。

販売会社については、前記「(4) 発行（売出）価格」に記載の委託会社にお問合わせください。

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は下記のとおりです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】**

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

PRU国内株式マザーファンド、PRU国内債券マザーファンド、PRU海外株式マザーファンドおよびPRU海外債券マザーファンド（以下総称して、または各々を「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、わが国の株式・公社債等および海外の株式・公社債等への分散投資を行い、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ます。

信託金の限度額

委託会社は、受託銀行と合意のうえ、金3,000億円を限度として信託金を追加することができます。また、委託会社は、受託銀行と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

基本的性格

当ファンドは追加型投信 / 内外 / 資産複合に属します。

当ファンドが該当する商品分類および属性区分を網掛け表示しています。

商品分類表

| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産<br>(収益の源泉) |
|---------|--------|-------------------|
| 単位型投信   | 国内     | 株式<br>債券          |
| 追加型投信   | 海外     | 不動産投信             |
|         | 内外     | その他資産<br>資産複合     |

< 商品分類表（上記網掛け表示部分）の定義 >

[ 単位型・追加型の区分 ]

追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

[ 投資対象地域による区分 ]

内外...目論見書または投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

[ 投資対象資産（収益の源泉）による区分 ]

資産複合...目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

## 属性区分表

| 投資対象資産<br>(組入資産)  | 決算頻度                      | 投資対象地域                    | 投資形態         | 為替ヘッジ |
|---|---------------------------|---------------------------|--------------|-------|
| 株式<br>一般<br>大型株<br>中小型株                                       | 年1回<br>年2回<br>年4回         | グローバル<br>(日本を含む)<br>日本    | ファミリーファンド*   | あり    |
| 債券<br>一般<br>公債<br>社債<br>その他債券<br>クレジット属性                      | 年6回(隔月)<br>年12回(毎月)<br>日々 | 北米<br>欧州<br>アジア<br>オセアニア  | ファンド・オブ・ファンズ | なし    |
| 不動産投信   | その他                       | 中南米                       |              |       |
| その他資産<br>(投資信託証券<br>(資産複合 資産配<br>分変更型(株式、債<br>券、短期金融商<br>品))) |                           | アフリカ<br>中近東(中東)<br>エマージング |              |       |
| 資産複合<br>資産配分固定型<br>資産配分変更型                                    |                           |                           |              |       |

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

## &lt;属性区分表(上記網掛け表示部分)の定義&gt;

## [投資対象資産による属性区分]

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分変更型(株式、債券、短期金融商品)))

…目論見書または投資信託約款において、マザーファンド受益証券(投資信託証券)への投資を通じて、実質的に複数資産(株式、債券、短期金融商品)を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。このため、商品分類表の投資対象資産(収益の源泉)は資産複合に、属性区分表の投資対象資産は「その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分変更型(株式、債券、短期金融商品)))」に分類されます。

## [決算頻度による属性区分]

年1回…目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

## [投資対象地域による属性区分]

グローバル(日本を含む)

…目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

## 〔投資形態による属性区分〕

## ファミリーファンド

…目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

## 〔為替ヘッジによる属性区分〕

なし…目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

前記の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づき記載しております。

前記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のインターネットホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

## ファンドの特色

4種類のマザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の株式・公社債等および海外の株式・公社債等への分散投資を行います。

基本ガイドラインに基づいてポートフォリオを変更します。この基本ガイドラインは、当ファンドの償還時期に向けて、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。これにより、償還日に近づくにしながら株価等の変動リスクを低減させた、安定的な運用に移行します。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

当ファンドの償還日は平成32年（2020年）12月10日です。

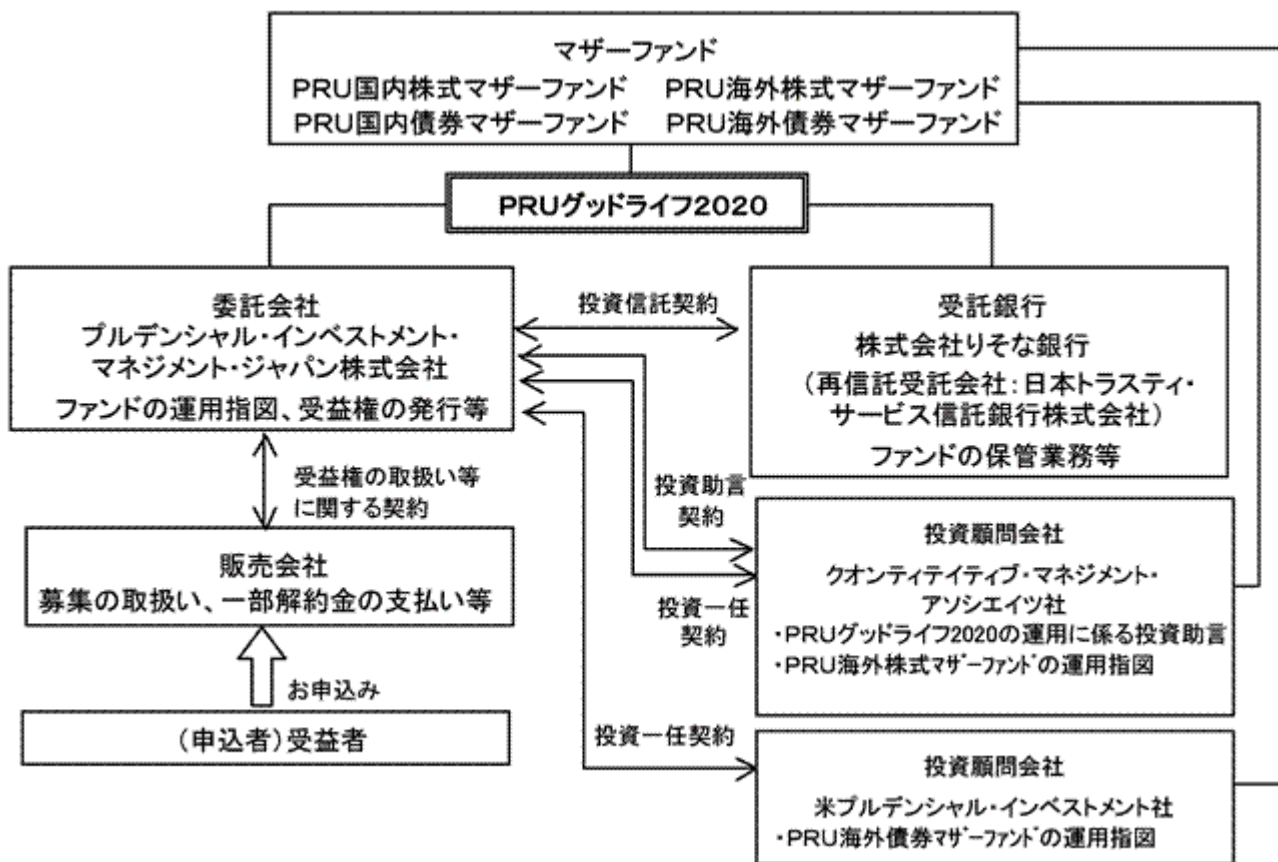
年1回（原則、12月10日。）決算し、収益分配方針に基づいて分配を行います。

## (2) 【ファンドの沿革】

|             |  |
|-------------|--|
| 平成13年3月16日  | ブルデンシャル投信株式会社が当ファンドの設定・運用開始  |
| 平成14年12月31日 | ブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン・インクがブルデンシャル投信株式会社より営業の全部を譲受け、当ファンドの運用を開始                          |
| 平成18年9月1日   | ブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社（委託会社）がブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン・インクより事業の全部を譲受け、当ファンドの運用を開始 |

## (3) 【ファンドの仕組み】

## ファンドの仕組み



## ファンドの関係法人

- 委託会社：投資信託財産の運用指図およびその権限の委託、受益権の発行等を行います。
- 受託銀行：投資信託契約に基づき、投資信託財産の保管・管理業務を行い、収益分配金、償還金および一部解約金の委託会社への交付等を行います。
- 販売会社：受益権の取扱い等に関する契約に基づき、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付け、収益分配金の再投資、ならびに収益分配金、償還金および一部解約金の支払い等を行います。
- 投資顧問会社：
  - 投資助言契約に基づき、当ファンドの運用に関する投資助言を行います。
  - 投資一任契約に基づき、マザーファンドの運用指図を行います。

委託会社等の概況（平成26年1月末現在）

a．資本金の額：219百万円

b．沿革

平成18年4月 ブルデンシャル投信投資顧問準備株式会社設立  
平成18年8月 ブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社に商号変更  
平成18年9月 ブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン・インクより事業の全部を譲受

c．大株主の状況

| 株主名                                 | 住所  | 所有株式数  | 所有比率   |
|-------------------------------------|---|--------|--------|
| ブルデンシャル・インターナショナル・インベストメンツ・コーポレーション | アメリカ合衆国デラウェア州ウィルミントン、スイート1300、ノース・マーケット・ストリート1105 | 7,360株 | 100.0% |

\*ブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社は、「ザ・ブルデンシャル・インシュアランス・カンパニー・オブ・アメリカ」を中核とする北米最大級の総合金融グループの一員です。ブルデンシャルは135年以上の歴史と強固な経営基盤を誇り、アメリカ ニュージャージー州ニューアークの本社を拠点とし、ブルデンシャル・グループの持株会社ブルデンシャル・ファイナンシャル・インクはニューヨーク証券取引所に上場している株式会社です。

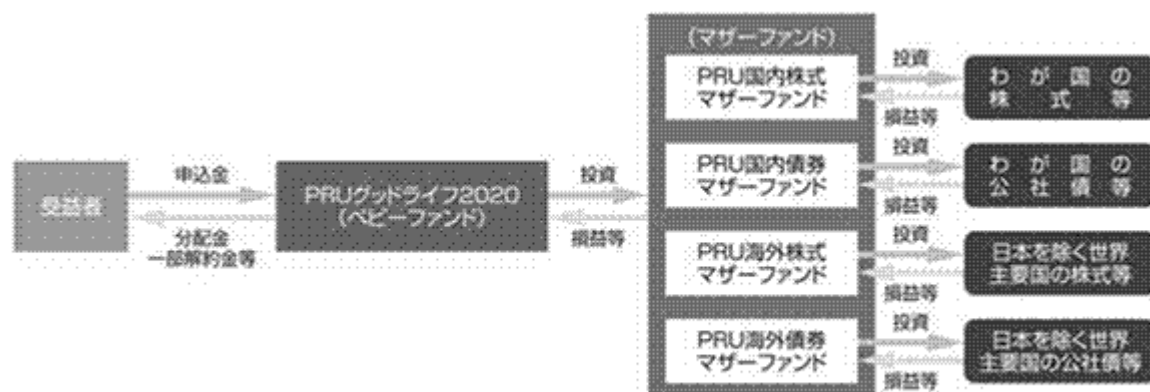
## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

基本方針

当ファンドは、4種類のマザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の株式・公社債等および海外の株式・公社債等への分散投資を行い、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ます。

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。ファミリーファンド方式では、受益者から投資された資金をまとめてベビーファンドとし、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資して、その実質的な運用をマザーファンドで行います。マザーファンドの運用成果は、すべてベビーファンドに反映されます。



(注)「自動けいぞく投資コース」の場合、収益分配金(税控除後)は、原則として、自動的に再投資されます。

運用方法

a．投資対象

「PRU国内株式マザーファンド」受益証券、「PRU国内債券マザーファンド」受益証券、「PRU海外株式マザーファンド」受益証券および「PRU海外債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。

なお、内外の株式・公社債等に直接投資することがあります。

b．投資態度



- (a) 主として、「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・公社債等への分散投資を行い、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ます。
- (b) 当初設定時は、「PRU国内株式マザーファンド」25%、「PRU国内債券マザーファンド」49.5%、「PRU海外株式マザーファンド」15%、「PRU海外債券マザーファンド」7.5%およびコール・ローン等の短期金融商品3%の組入比率を基本ガイドラインとし、この基本ガイドラインに基づいてポートフォリオを構築します。
- (c) 当初設定後の基本ガイドラインは、償還時期に向け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ます。また、この基本ガイドラインに基づいてポートフォリオを変更します。これにより、償還日に近づくにしたがって株価等の変動リスクを低減させる運用を目指します。ただし、市況動向等の変化によっては、基本ガイドラインを見直す場合があります。  
基本ガイドラインは以下のとおりです。

|                | 当初設定時<br>(平成13年3月16日) | 当初設定日から<br>約12年半経過時<br>(平成25年10月1日現在) | 償還直前   |
|----------------|-----------------------|---------------------------------------|--------|
| PRU国内株式マザーファンド | 25.0%                 | 9.375%                                | 0.0%   |
| PRU国内債券マザーファンド | 49.5%                 | 72.000%                               | 0.0%   |
| PRU海外株式マザーファンド | 15.0%                 | 5.625%                                | 0.0%   |
| PRU海外債券マザーファンド | 7.5%                  | 7.500%                                | 0.0%   |
| 短期金融商品         | 3.0%                  | 5.500%                                | 100.0% |

当初設定後の基本ガイドラインは、当ファンドの償還時期に向けて、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。

この基本ガイドラインは、ポートフォリオの基準となる資産配分を意味します。なお、実際のポートフォリオ構築では、基本ガイドラインを基準に一定の範囲内でポートフォリオの構築が行われますので、基本ガイドラインと実際のポートフォリオ（各マザーファンドの組入比率）は必ずしも一致しません。

市況動向等の変化によっては、基本ガイドラインを見直す場合があります。

- (d) 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、市況動向、資金動向等により委託会社が適切と判断した場合には、上記と異なる場合もあります。なお、運用の効率化を図るため、為替のエクスポージャーの調整を行う場合があります。
- (e) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用が行われない場合や当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。
- (f) 当ファンドは、クオンティタティブ・マネジメント・アソシエイツ社より助言を受け、運用を行います。

## (2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- a. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
- (a) 有価証券
- (b) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記「(5) 投資制限」に定めるものに限りません。）

(c) 金銭債権（前記(a)、(b)および後記(d)に掲げるものに該当するものを除きます。以下同じ。）

(d) 約束手形（前記(a)に掲げるものに該当するものを除きます。以下同じ。）

#### 有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主としてプルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社を委託会社とし、株式会社りそな銀行を受託銀行として締結された「PRU国内株式マザーファンド」、「PRU国内債券マザーファンド」、「PRU海外株式マザーファンド」および「PRU海外債券マザーファンド」の受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- a. 株券または新株引受権証券
- b. 国債証券
- c. 地方債証券
- d. 特別の法律により法人の発行する債券
- e. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- f. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- g. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- h. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- i. 資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- j. コマーシャル・ペーパー
- k. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- l. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前記a. からk. の証券または証書の性質を有するもの
- m. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- n. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- o. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- p. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
- q. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- r. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- s. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
- t. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- u. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- v. 外国の者に対する権利で前記u. の有価証券の性質を有するもの

なお、前記a. の証券または証書、l. ならびにq. の証券または証書のうちa. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、b. からf. までの証券およびl. ならびに

q . の証券または証書のうち b . から f . までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、 m . の証券および n . の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

委託会社は、信託金を、前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

- a . 預金
- b . 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- c . コール・ローン
- d . 手形割引市場において売買される手形
- e . 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- f . 外国の者に対する権利で前記 e . の権利の性質を有するもの

前記 にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、前記 a . から f . までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

### （3）【運用体制】

当ファンドは、クオンティテイティブ・マネジメント・アソシエイツ社の助言に基づき、投資運用本部のファンド・マネジャーが各マザーファンドへの投資配分を決定し、運用を行います。

当ファンドの主要投資対象である「PRU国内株式マザーファンド」は、投資運用本部のファンド・マネジャーが運用を行います。投資運用本部は、運用に関わる調査・分析を行い、ポートフォリオ構築に関わる投資判断等を行います。

当ファンドの主要投資対象である「PRU国内債券マザーファンド」は、投資運用本部のファンド・マネジャーが運用を行います。信用リスクの管理については、定量モデル、市場情報の他、投資運用本部に属するクレジット・アナリストの情報を活用します。

当ファンドの主要投資対象である「PRU海外株式マザーファンド」は、投資一任契約に基づき、クオンティテイティブ・マネジメント・アソシエイツ社が運用を行います。

当ファンドの主要投資対象である「PRU海外債券マザーファンド」は、投資一任契約に基づき、米ブルデンシャル・インベストメント社にて運用され、同社のパブリック債券運用グループが運用を担当します。

#### 投資顧問会社の運用体制

##### クオンティテイティブ・マネジメント・アソシエイツ社における株式インデックス運用

クオンティテイティブ・マネジメント・アソシエイツ社は2004年7月に、米ブルデンシャル・インベストメント社のクオンティテイティブ・マネジメント・チームが独立することにより設立されました。なお、同社は米ブルデンシャル・インベストメント社の100%子会社です（以下の説明は、同社の前身である米ブルデンシャル・インベストメント社のクオンティテイティブ・マネジメント・チームに関するものを含みます。）。

1975年よりクオンツ運用を開始し、その運用資産額は約1,040億米ドル（約10.2兆円）にのびります。

1979年より、株式インデックス運用を開始、運用経験豊富な投資プロフェッショナルにより、投資先の市場の特性に合わせた運用が行われています。

（クオンティテイティブ・マネジメント・アソシエイツ社に関する情報は平成25年9月末現在のものです。為替換算レート：1米ドル=98.12円）

**米ブルデンシャル・インベストメント社における債券運用**

債券の運用額は約3,970億米ドル（約39兆円）

運用対象としている債券の種類は米国国債、米国投資適格社債、米国ハイイールド債、米国地方債、グローバル債、エマージング債、短期金融商品（マネー・マーケット）等と多岐にわたっており、専門のマネージャーによる付加価値の高い債券運用サービスをご提供しております。

独自の信用調査と運用モデル、綿密な分析とリスク管理

独自の信用調査と運用モデルを駆使して、資産配分や割安と判断される銘柄選定を行います。さらに、リスク管理の際にも綿密な信用分析および独自のモデルを活用し、徹底したリスク管理を図ります。

効果の高いボトムアップ・アプローチとトップダウン・アプローチの併用

債券の種類ごと、社債の業種ごと等の相対的な価値の分析、銘柄の選定および売買執行等は、より専門的なノウハウの活かせるボトムアップ・アプローチで行います。また、投資戦略、資産配分およびリスク管理等は、グローバルで広範な視点から判断できるトップダウン・アプローチを採用しています。

一貫した投資プロセスで安定した投資成果の獲得

債券の種類ごとにそれぞれ専門に担当する各チームが連携して運用します。チーム運用に徹することで、運用プロセスの一貫性が保たれ、安定した投資成果の獲得につながると考えます。

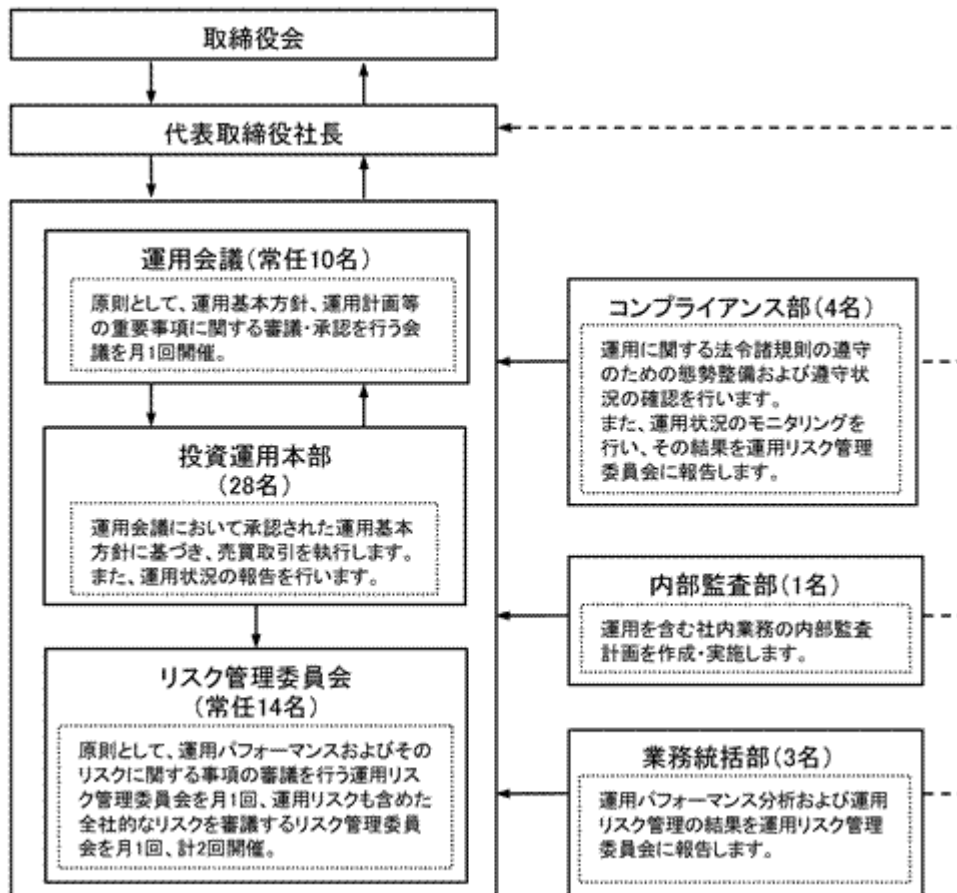
（米ブルデンシャル・インベストメント社に関する情報は平成25年9月末現在のものです。為替換算レート：1米ドル=98.12円）

**委託会社の運用体制**

### 委託会社の運用体制に関する社内規則

委託会社は、資産運用およびリスク管理の基本方針を定める「運用規程」を遵守することにより、運用の適正性を確保することに努めます。

### 委託会社の内部管理および意思決定を監督する組織等



### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く。）に対する管理体制

「受託銀行」に対しては、投資信託財産の管理業務を通じて、受託銀行の信託事務の正確性等を総合的に監視しています。また、財務状況、内部統制の整備および運用状況についての確認を行います。

「投資顧問会社」に対しては、運用計画書の提出を受け、運用会議において審議・承認が行われます。また、定期的に投資顧問会社のモニタリングを行います。

前記の運用体制等は平成26年1月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### (4) 【分配方針】

毎決算時（原則、12月10日。ただし、休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収入および売買益等の全額とします。

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないこともあります。

収益分配にあてず投資信託財産内に留保した利益については、前記「(1) 投資方針」に基づき運用を行います。

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## (5) 【投資制限】

株式への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2．運用方法（3）投資制限、第22条）

株式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。

外貨建資産への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2．運用方法（3）投資制限、第32条）

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50%以下とします。

新株引受権証券等への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2．運用方法（3）投資制限、第22条）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。

同一銘柄の株式への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2．運用方法（3）投資制限、第25条）

同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債等への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2．運用方法（3）投資制限、第26条）

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券等への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2．運用方法（3）投資制限、第25条）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2．運用方法（3）投資制限、第22条）

投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資する株式等の範囲（投資信託約款第24条）

- a．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所をいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- b．前記a．の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

信用取引の運用指図・目的・範囲（投資信託約款第27条）

- a．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- b．前記a．の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  - (a) 投資信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
  - (b) 株式分割により取得する株券
  - (c) 有償増資により取得する株券
  - (d) 売出しにより取得する株券
  - (e) 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券

- (f) 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前記(e)に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### 先物取引等の運用指図（投資信託約款第28条）

- a. 委託会社は、わが国の金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場を「金融商品取引所等」といいます。以下同じ。）における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。
- b. 委託会社は、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- c. 委託会社は、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所等における金利に係るこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### スワップ取引の運用指図・目的・範囲（投資信託約款第29条）

- a. 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（投資信託約款第30条）

- a. 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 有価証券の貸付けの指図・目的・範囲（投資信託約款第31条）

- a. 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
  - (a) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

(b) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

- b. 前記 a. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（投資信託約款第33条）

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約取引の指図・目的・範囲（投資信託約款第34条）

- a. 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. 前記 a. の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- c. 前記 b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内にその超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- d. 前記 b. において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

資金の借入れの指図・目的・範囲（投資信託約款第42条）

- a. 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は投資信託財産中から支弁します。

デリバティブ取引に係る投資制限

（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを内容とした運用を行うことをしないものとします。

同一の法人の発行する株式の投資制限



（投資信託及び投資法人に関する法律第9条、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第20条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が、当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託銀行に指図しないものとします。

## (参考) マザーファンドの投資方針

| P R U国内株式マザーファンド |   |
|------------------|---|
| 基本方針             | この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、東証株価指数（T O P I X）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。   |
| 運用方法             |   |
| 投資対象             | 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。   |
| 投資態度             | 東証株価指数（T O P I X）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。<br>株式の組入比率は、原則として高位を維持します。<br>運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。<br>このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>資金動向、市況動向の急激な変化が生じた時等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記のような運用ができない場合があります。                |
| 投資制限             | 株式への投資には制限を設けません。<br>外貨建資産への投資は行いません。<br>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、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。<br>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 |

東証株価指数（T O P I X = 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。

T O P I Xの指数値およびT O P I Xの商標は、株式会社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T O P I Xに関するすべての権利・ノウハウおよびT O P I Xの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

株式会社東京証券取引所は、T O P I Xの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、T O P I Xの指数値の算出もしくは公表の停止またはT O P I Xの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

株式会社東京証券取引所は、T O P I Xの商標の使用もしくはT O P I Xの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

株式会社東京証券取引所は、T O P I Xの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株式会社東京証券取引所は、T O P I Xの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

マザーファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

株式会社東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、マザーファンドの説明、投資のアドバイスを義務を持ちません。

株式会社東京証券取引所は、委託会社または当ファンドの購入者のニーズを、T O P I Xの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、株式会社東京証券取引所はマザーファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

平成26年1月末現在において、「P R U国内株式マザーファンド」に投資しているファンドは、P R Uグッドライフ2020（当ファンド）、P R Uグッドライフ2030、P R Uグッドライフ2040、P R U国内株式マーケット・パフォーマー、プ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）、P R Uグッドライフ2020（年金）、P R Uグッドライフ2030（年金）、P R Uグッドライフ2040（年金）、P R Uグッドライフ2050（年金）、プ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）です。

なお、この他にも、今後「P R U国内株式マザーファンド」に投資するファンドが設定される場合があります。

| P R U国内債券マザーファンド |  |
|------------------|--|
| 基本方針             | わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA - B P I（総合）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。  |
| 運用方法             |  |
| 投資対象             | わが国の公社債を主要投資対象とします。  |
| 投資態度             | NOMURA - B P I（総合）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。<br>運用の効率化を図るため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>資金動向、市況動向の急激な変化が生じた時等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記のような運用ができない場合があります。   |
| 投資制限             | 外貨建資産への投資は行いません。<br>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>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。<br>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>同一銘柄の株式への投資は、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。<br>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 |

NOMURA - B P I（総合）とは、野村證券株式会社が公表してい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、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、安全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、当ファンドの運用成果等に関し一切責任を負いません。

平成26年1月末現在において、「P R U国内債券マザーファンド」に投資しているファンドは、P R Uグッドライフ2020（当ファンド）、P R Uグッドライフ2030、P R Uグッドライフ2040、P R U国内債券マーケット・パフォーマー、P R Uグッドライフ2020（年金）、P R Uグッドライフ2030（年金）、P R Uグッドライフ2040（年金）、P R Uグッドライフ2050（年金）、プ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）、プルデンシャル私募国内債券マーケット・パフォーマー（適格機関投資家向け）です。  
なお、この他にも、今後「P R U国内債券マザーファンド」に投資するファンドが設定される場合があります。

| P R U海外株式マザーファンド |   |
|------------------|---|
| 基本方針             | 日本を除く世界の主要国の株式を中心に投資を行い、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います。  |
| 運用方法             |   |
| 投資対象             | 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。   |
| 投資態度             | <p>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います。</p> <p>株式の組入比率は、原則として高位を維持します。</p> <p>外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、運用の効率化を図るため、為替のエクスポージャーの調整を行う場合があります。</p> <p>運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じた時等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>運用にあたっては、投資一任契約に基づいてクオンティタティブ・マネジメント・アソシエイツ社に運用の指図に関する権限を委託します。</p> <p>委託する範囲：マザーファンドの運用指図<br/>         委託先所在地：アメリカ合衆国ニュージャージー州ニューアーク、マッカーター・ハイウェイ・アンド・マーケット・ストリート、ゲートウェイ・センター2<br/>         委託に係る費用：後記「4手数料等及び税金（3）信託報酬等」をご参照ください。</p> |
| 投資制限             | <p>株式への投資には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、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。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>  |

「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国で構成されています。

「MSCI KOKUSAIインデックス（円換算ベース）」は、「MSCI KOKUSAIインデックス（米ドルベース）」をもとに、MSCI Inc.の承諾を受けたうえで委託会社で計算したものです。

「MSCI KOKUSAIインデックス」はMSCI Inc.の財産であり、「MSCI」はMSCI Inc.のサービス・マークです。

平成26年1月末現在において、「P R U海外株式マザーファンド」に投資しているファンドは、P R Uグッドライフ2020（当ファンド）、P R Uグッドライフ2030、P R Uグッドライフ2040、P R U海外株式マーケット・パフォーマー、P R Uグッドライフ2020（年金）、P R Uグッドライフ2030（年金）、P R Uグッドライフ2040（年金）、P R Uグッドライフ2050（年金）、ブルデンシャル私募海外株式マーケット・パフォーマー（適格機関投資家向け）です。

なお、この他にも、今後「P R U海外株式マザーファンド」に投資するファンドが設定される場合があります。

| P R U海外債券マザーファンド |  |
|------------------|--|
| 基本方針             | 日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティ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います。   |
| 運用方法             |  |
| 投資対象             | 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。  |
| 投資態度             | <p>シティ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います。</p> <p>外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、運用の効率化を図るため、為替のエクスポージャーの調整を行う場合があります。</p> <p>運用の効率化を図るため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じた時等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>運用にあたっては、投資一任契約に基づいて米プルデンシャル・インベストメント社に運用の指図に関する権限を委託します。</p> <p>委託する範囲：マザーファンドの運用指図<br/>委託先所在地：アメリカ合衆国ニュージャージー州ニューアーク、マッカーター・ハイウェイ・アンド・マーケット・ストリート、ゲートウェイ・センター2<br/>委託に係る費用：後記「4 手数料等及び税金（3）信託報酬等」をご参照ください。</p> |
| 投資制限             | <p>外貨建資産への投資には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、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。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>  |

「シティ世界国債インデックス」とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回り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。

当ファンドでは、シティ世界国債インデックス・データをもとに、シティグループ証券株式会社の承諾を得たうえで、委託会社が円換算ベースに計算したものを使用します。

「シティ世界国債インデックス」に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。 Citigroup Global Markets Inc. All rights reserved.

平成26年1月末現在において、「P R U海外債券マザーファンド」に投資しているファンドは、P R Uグッドライフ2020（当ファンド）、P R Uグッドライフ2030、P R Uグッドライフ2040、P R U海外債券マーケット・パフォーマー、P R Uグッドライフ2020（年金）、P R Uグッドライフ2030（年金）、P R Uグッドライフ2040（年金）、P R Uグッドライフ2050（年金）、プ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）です。

なお、この他にも、今後「P R U海外債券マザーファンド」に投資するファンドが設定される場合があります。

### 3【投資リスク】

#### （１）当ファンドへの投資リスク

当ファンドは値動きのある有価証券に投資しますので基準価額は変動し、これらの運用による損益はすべて受益者のみなさまに帰属します。したがって、当ファンドは元本が保証されているものではありません。

投資信託は預貯金とは異なります。

ファンドが有する主なリスクは以下のとおりです。

##### <資産配分リスク>

当ファンドでは、基本ガイドラインに基づいてポートフォリオを構築し、各マザーファンドへの資産配分を行います。また、この基本ガイドラインは、当ファンドの償還時期が近づくにしたがって、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、時間の経過とともに株価等の変動リスクを低減させる運用を目指します。

この資産配分は当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益の悪い資産で運用するマザーファンドへの配分が大きい場合や複数またはすべての資産価値が下落する場合には、各マザーファンドの投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

##### <株価変動リスク>

株式等の価格動向は、国内外の政治・経済情勢の影響を受けます。このため当ファンドが実質的に組入れている株式の値動きにより基準価額は変動します。また、当ファンドが実質的に組入れている株式を発行する企業が倒産や業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、当ファンドに重大な損失を生じさせることがあります。

##### <金利変動リスク>

一般的に、金利が上昇した場合には、債券の価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

##### <信用リスク>

公社債、コマーシャル・ペーパーおよび短期金融商品の発行体が、経営不振、その他の理由により利息や償還金をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなる（債務不履行）リスクをいいます。一般に債務不履行が生じた場合またはそれが予想される場合には、当該公社債等の価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

##### <カントリー・リスク>

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて海外の有価証券に投資しますが、その国の政治・経済情勢、外国為替規制、資本規制等による影響を受けることにより、基準価額が下がる要因となる可能性があります。

##### <為替変動リスク>

一般的に、外国為替相場が対円で下落した場合には、ファンドの基準価額が下がる要因となります。なお、当ファンドでは、実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。このため、円と投資対象国通貨の為替レートの変化が、ファンドの資産価値に影響を与えます。

##### <同一マザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドによる影響>

当ファンドが投資対象とするマザーファンドについて、当該マザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドにおける資金流入や資産配分の変更等により当該マザーファンド組入有価証券等の売買が発生した場合、その売買による組入有価証券等の価格の変化や売買手数料・税金等の負担が当該マザーファンドの価額に影響を及ぼすことがあります。これにより当該マザーファンドの価額が下落した場合、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

#### （２）分配金に関する留意点

- ・分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

### （３）その他の留意点

- ・ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- ・当ファンドはマザーファンドを通じて株式や債券など値動きのある証券（外貨建証券には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本を下回ることがあります。
- ・投資信託財産に生じた損益は、すべて受益者に帰属します。
- ・投資信託は預金等とは異なり、預金保険機構の保護の対象ではありません。
- ・投資信託は保険契約とは異なり、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
- ・投資信託を登録金融機関で購入した場合は、投資者保護基金の対象にはなりません。
- ・法令・税制および会計基準等は今後変更される可能性があり、これにより、当ファンドがあらかじめ目的としている投資成果を達成できないこともあります。

### （４）投資リスクに対する管理体制

運用状況のモニタリング、運用に関する法令諸規則の遵守状況の確認はコンプライアンス部が行います。全体的な運用状況の管理は投資運用本部が行います。運用に関するリスク管理およびパフォーマンス分析については、業務統括部が行います。これらの各部の情報は、原則として月1回開催される運用リスク管理委員会に報告され、その内容の確認・検討が行われた後に各部にフィードバックされ、その後の業務に反映されます。

## 4【手数料等及び税金】

### （１）【申込手数料】

申込手数料は、3.15%<sup>\*</sup>（税抜3.0%）を上限として販売会社がそれぞれ定める手数料率を、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に乗じて得た額とします。

\*消費税率が8%になった場合は、3.24%（税込）となります。

各販売会社の申込手数料の詳細については、委託会社にお問合わせください。

| 委託会社問合わせ先       |  |
|-----------------|--|
| ふる<br>PRUホットライン | 03-6832-7111<br>受付時間：営業日の9:00～17:00<br>土日・祝休日、12月31日～1月3日は休業 |
| ホームページ          | <a href="http://www.pru.co.jp/">http://www.pru.co.jp/</a>    |

なお、「自動けいぞく投資コース」を選択し、収益分配金（税控除後）の自動再投資により当ファンドを取得する場合には、申込手数料はかかりません。

## (2) 【換金（解約）手数料】

解約時に手数料はかかりません。

## (3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

| 計算期間            | 信託報酬率                | 信託報酬の配分              |                      |                      |
|-----------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
|                 |                      | 委託会社                 | 販売会社                 | 受託銀行                 |
| 第1期計算期～第10期計算期  | 年1.344%<br>(税抜1.28%) | 年0.630%<br>(税抜0.60%) | 年0.630%<br>(税抜0.60%) | 年0.084%<br>(税抜0.08%) |
| 第11期計算期～第20期計算期 | 年1.134%<br>(税抜1.08%) | 年0.525%<br>(税抜0.50%) | 年0.525%<br>(税抜0.50%) |                      |

消費税率が8%になった場合は、以下のとおりとなります。

| 計算期間            | 信託報酬率            | 信託報酬の配分        |                |                  |
|-----------------|------------------|----------------|----------------|------------------|
|                 |                  | 委託会社           | 販売会社           | 受託銀行             |
| 第11期計算期～第20期計算期 | 年1.1664%<br>(税込) | 年0.54%<br>(税込) | 年0.54%<br>(税込) | 年0.0864%<br>(税込) |

前記の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末、または信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

委託会社は、マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬を、前記の委託会社が受ける報酬から支払うものとします。その報酬額は、計算期間を通じて毎日、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に以下に定める率を乗じて得た額とします。

PRU海外株式マザーファンド 年0.10%

PRU海外債券マザーファンド 年0.10%

## (4) 【その他の手数料等】

信託事務の諸費用

a. 投資信託財産に関する租税、次に掲げる諸費用その他の信託事務の処理に要する費用および当該費用に係る消費税等相当額ならびに受託銀行の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、投資信託財産中からその都度支弁します。

(a) 売買委託手数料等の有価証券取引等に要する費用および保管費用等

(b) 借入金の利息

b. 前記a.にかかわらず、委託会社は、信託事務の処理に要する費用のうち、次に掲げる費用および当該費用に係る消費税等相当額については、投資信託財産の純資産総額に年0.05%の率を乗じて得た額を上限に、かつその実費の額以内の額の支払いにつき、後記c.にしたがって、投資信託財産から受けることができます。

(a) 投資信託振替制度に係る費用

(b) 有価証券届出書等開示書類および目論見書（これらの訂正も含まれます。）、投資信託約款および運用報告書等の作成等に要する費用



- (c) この信託の受益者に対して行う公告に要する費用ならびに投資信託約款の変更または投資信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成等に要する費用
- (d) この信託の設定および運営・管理に関し、法務・税務等につき要する費用
- c. 前記b. で定める費用および当該費用に係る消費税等相当額は、投資信託約款に規定する計算期間を通じて、毎日費用計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日ならびに毎計算期間末および信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

#### 監査報酬

- a. 投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、投資信託財産の純資産総額に年0.00525%（税抜0.005%）<sup>\*</sup>の率を乗じて得た額を上限に、かつ当該費用の実費の額以内の額を、当該費用に係る消費税等相当額とともに、投資信託約款に規定する計算期間を通じて、毎日費用計上します。
- <sup>\*</sup>消費税率が8%になった場合は、0.0054%（税込）となります。
- b. 前記a. で定める費用および当該費用に係る消費税等相当額は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日ならびに毎計算期間末および信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

その他の手数料等については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

手数料等の合計額については、保有期間等により異なりますので、表示することができません。

#### (5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

##### 個別元本方式について

- a. 追加型株式投資信託については、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- b. 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- c. 同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に、個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は、当該支店等毎に個別元本の算出が行われる場合があります。
- d. 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります（「元本払戻金（特別分配金）」については、後記「収益分配金の課税について」をご参照ください。）。

##### 収益分配金の課税について

- a. 追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
- b. 受益者が収益分配金を受取る際、（ ）当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、（ ）当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

- c. 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

#### 一部解約時および償還時の課税について

個人の受益者の場合は、一部解約時および償還時の譲渡益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および申込手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益）が課税対象となります。

法人の受益者の場合は、一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

#### 個人、法人別の課税の取扱いについて

##### a. 個人の受益者に対する課税

###### (a) 収益分配時の課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。また、確定申告を行うことにより、総合課税または申告分離課税のいずれかを選択することもできます。

普通分配金については、上場株式等の譲渡損失および他の上場株式等にかかる配当所得の金額（申告分離課税を選択したものに限ります。）との損益通算ができます。なお、配当控除の適用はありません。

###### (b) 一部解約時および償還時の課税

一部解約時および償還時の譲渡益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および申込手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益）は、譲渡所得として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。なお、源泉徴収特定口座においては原則、確定申告の必要はありません。

一部解約時および償還時の譲渡損益は、確定申告をすることにより他の上場株式等譲渡損益および上場株式等の配当所得の金額（申告分離課税を選択したものに限ります。）との損益通算ができます。なお、譲渡損失については、3年間の繰越控除の対象とすることができます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

##### b. 法人の受益者に対する課税

法人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）の税率による源泉徴収が行われます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

- ・前記は、平成26年1月1日現在のものであり、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。
- ・税金の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

(平成26年1月31日現在)

| 投資資産の種類                      |    | 時価(円)      | 投資比率(%) |
|------------------------------|----|------------|---------|
| 投資信託受益証券<br>(PRU国内株式マザーファンド) | 日本 | 3,076,986  | 9.52    |
| 投資信託受益証券<br>(PRU国内債券マザーファンド) | 日本 | 23,187,433 | 71.71   |
| 投資信託受益証券<br>(PRU海外株式マザーファンド) | 日本 | 1,882,024  | 5.82    |
| 投資信託受益証券<br>(PRU海外債券マザーファンド) | 日本 | 2,395,945  | 7.41    |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後)          |    | 1,792,297  | 5.54    |
| 合計(純資産総額)                    |    | 32,334,685 | 100.00  |

(注)投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## (参考情報)

当ファンドが主要投資対象とするPRU国内株式マザーファンドの投資状況は以下の通りです。

(平成26年1月31日現在)

| 投資資産の種類             |    | 時価(円)         | 投資比率(%) |
|---------------------|----|---------------|---------|
| 株式                  | 日本 | 2,369,852,130 | 96.90   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |    | 75,885,988    | 3.10    |
| 合計(純資産総額)           |    | 2,445,738,118 | 100.00  |

(注)投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

当ファンドが主要投資対象とするPRU国内債券マザーファンドの投資状況は以下の通りです。

(平成26年1月31日現在)

| 投資資産の種類             |    | 時価(円)         | 投資比率(%) |
|---------------------|----|---------------|---------|
| 国債証券                | 日本 | 3,244,026,300 | 83.69   |
| 地方債証券               | 日本 | 277,935,733   | 7.17    |
| 特殊債券                | 日本 | 237,347,540   | 6.12    |
| 社債券                 | 日本 | 79,608,900    | 2.05    |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |    | 37,509,751    | 0.97    |
| 合計(純資産総額)           |    | 3,876,428,224 | 100.00  |

(注)投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

当ファンドが主要投資対象とするPRU海外株式マザーファンドの投資状況は以下の通りです。

（平成26年1月31日現在）

| 投資資産の種類 | 時価（円）     | 投資比率（％）       |       |
|---------|-----------|---------------|-------|
| 株式      | アメリカ      | 2,541,379,246 | 53.81 |
|         | イギリス      | 431,453,773   | 9.14  |
|         | スイス       | 206,530,373   | 4.37  |
|         | カナダ       | 197,317,645   | 4.18  |
|         | ドイツ       | 190,015,290   | 4.02  |
|         | フランス      | 187,021,955   | 3.96  |
|         | オーストラリア   | 138,587,289   | 2.93  |
|         | オランダ      | 70,943,374    | 1.50  |
|         | スペイン      | 68,213,961    | 1.44  |
|         | スウェーデン    | 66,063,026    | 1.40  |
|         | 香港        | 48,940,561    | 1.04  |
|         | イタリア      | 43,611,882    | 0.92  |
|         | アイルランド    | 39,474,146    | 0.84  |
|         | シンガポール    | 29,755,850    | 0.63  |
|         | デンマーク     | 24,889,524    | 0.53  |
|         | ベルギー      | 23,336,079    | 0.49  |
|         | ジャージー     | 20,311,181    | 0.43  |
|         | アンティル     | 19,055,602    | 0.40  |
|         | フィンランド    | 18,683,080    | 0.40  |
|         | バミューダ     | 14,716,793    | 0.31  |
|         | ノルウェー     | 12,784,144    | 0.27  |
|         | イスラエル     | 11,342,988    | 0.24  |
|         | ルクセンブルク   | 8,283,941     | 0.18  |
|         | オーストリア    | 6,104,413     | 0.13  |
|         | ケイマン島     | 5,328,873     | 0.11  |
|         | ポルトガル     | 3,869,921     | 0.08  |
|         | パナマ       | 2,594,664     | 0.05  |
|         | ニュージーランド  | 2,472,579     | 0.05  |
|         | 英ヴァージン諸島  | 2,067,228     | 0.04  |
|         | リベリア      | 1,045,674     | 0.02  |
| ガーンジー   | 1,045,235 | 0.02          |       |
| マン島     | 779,562   | 0.02          |       |
| モーリシャス  | 276,962   | 0.01          |       |

| 投資資産の種類             |         | 時価（円）         | 投資比率（％） |
|---------------------|---------|---------------|---------|
| 投資証券                | アメリカ    | 60,391,181    | 1.28    |
|                     | オーストラリア | 8,265,604     | 0.18    |
|                     | フランス    | 5,909,910     | 0.13    |
|                     | イギリス    | 5,419,448     | 0.11    |
|                     | 香港      | 1,394,172     | 0.03    |
|                     | シンガポール  | 1,025,697     | 0.02    |
|                     | カナダ     | 697,841       | 0.01    |
|                     | オランダ    | 485,460       | 0.01    |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） |         | 200,954,914   | 4.25    |
| 合計（純資産総額）           |         | 4,722,841,041 | 100.00  |

（注1）投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）時価は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。

当ファンドが主要投資対象とするPRU海外債券マザーファンドの投資状況は以下の通りです。

（平成26年1月31日現在）

| 投資資産の種類             |         | 時価（円）         | 投資比率（％） |
|---------------------|---------|---------------|---------|
| 国債証券                | アメリカ    | 2,545,439,304 | 38.06   |
|                     | イタリア    | 716,784,693   | 10.72   |
|                     | フランス    | 706,812,127   | 10.57   |
|                     | ドイツ     | 592,923,299   | 8.86    |
|                     | イギリス    | 500,208,274   | 7.48    |
|                     | スペイン    | 386,021,831   | 5.77    |
|                     | ベルギー    | 207,194,725   | 3.10    |
|                     | オランダ    | 182,411,098   | 2.73    |
|                     | カナダ     | 129,842,597   | 1.94    |
|                     | オーストリア  | 115,315,168   | 1.72    |
|                     | オーストラリア | 94,352,737    | 1.41    |
|                     | メキシコ    | 77,274,833    | 1.16    |
|                     | アイルランド  | 60,246,626    | 0.90    |
|                     | デンマーク   | 49,334,619    | 0.74    |
|                     | 南アフリカ   | 37,467,074    | 0.56    |
|                     | マレーシア   | 35,379,637    | 0.53    |
|                     | ポーランド   | 24,294,405    | 0.36    |
|                     | 小計      | 6,461,303,047 | 96.60   |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） |         | 227,153,245   | 3.40    |
| 合計（純資産総額）           |         | 6,688,456,292 | 100.00  |

（注1）投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）時価は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。

## ( 2 ) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

(平成26年1月31日現在)

## 主要銘柄の明細

(単位：円)

| 地域 | 種類           | 銘柄                 | 数量         | 簿価単価   | 簿価金額       | 時価単価   | 時価金額       | 投資比率<br>(%) |
|----|--------------|--------------------|------------|--------|------------|--------|------------|-------------|
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU国内債券<br>マザーファンド | 18,679,959 | 1.2350 | 23,071,127 | 1.2413 | 23,187,433 | 71.71       |
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU国内株式<br>マザーファンド | 2,535,421  | 1.2485 | 3,165,712  | 1.2136 | 3,076,986  | 9.52        |
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU海外債券<br>マザーファンド | 1,188,996  | 2.0175 | 2,398,806  | 2.0151 | 2,395,945  | 7.41        |
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU海外株式<br>マザーファンド | 1,149,328  | 1.6532 | 1,900,080  | 1.6375 | 1,882,024  | 5.82        |

(注1) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

(注2) 投資信託受益証券の簿価単価および時価単価は、1万口当たりの価額です。

## （参考情報）

## P R U国内株式マザーファンド

|    | 地域 | 種類 | 業種         | 銘柄名               | 通貨  | 数量      | 簿価単価<br>（円） | 簿価金額<br>（円） | 時価単価<br>（円） | 時価金額<br>（円） | 投資<br>比率<br>（%） |
|----|----|----|------------|-------------------|-----|---------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------|
| 1  | 日本 | 株式 | 輸送用機器      | トヨタ自動車            | 日本円 | 19,100  | 6,216.74    | 118,739,769 | 5,922.00    | 113,110,200 | 4.62            |
| 2  | 日本 | 株式 | 銀行業        | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 日本円 | 102,100 | 642.94      | 65,644,942  | 623.00      | 63,608,300  | 2.60            |
| 3  | 日本 | 株式 | 情報・通信業     | ソフトバンク            | 日本円 | 6,600   | 8,660.00    | 57,156,000  | 7,563.00    | 49,915,800  | 2.04            |
| 4  | 日本 | 株式 | 銀行業        | 三井住友フィナンシャルグループ   | 日本円 | 10,200  | 4,967.66    | 50,670,220  | 4,824.00    | 49,204,800  | 2.01            |
| 5  | 日本 | 株式 | 輸送用機器      | 本田技研工業            | 日本円 | 12,300  | 4,191.14    | 51,551,095  | 3,893.00    | 47,883,900  | 1.96            |
| 6  | 日本 | 株式 | 銀行業        | みずほフィナンシャルグループ    | 日本円 | 175,000 | 211.03      | 36,930,250  | 219.00      | 38,325,000  | 1.57            |
| 7  | 日本 | 株式 | 情報・通信業     | 日本電信電話            | 日本円 | 5,300   | 5,160.00    | 27,348,000  | 5,561.00    | 29,473,300  | 1.21            |
| 8  | 日本 | 株式 | 食料品        | 日本たばこ産業           | 日本円 | 8,500   | 3,440.00    | 29,240,000  | 3,197.00    | 27,174,500  | 1.11            |
| 9  | 日本 | 株式 | 電気機器       | 日立製作所             | 日本円 | 33,000  | 736.00      | 24,288,000  | 792.00      | 26,136,000  | 1.07            |
| 10 | 日本 | 株式 | 医薬品        | 武田薬品工業            | 日本円 | 5,400   | 4,995.00    | 26,973,000  | 4,793.00    | 25,882,200  | 1.06            |
| 11 | 日本 | 株式 | 電気機器       | ファナック             | 日本円 | 1,500   | 16,360.00   | 24,540,000  | 16,770.00   | 25,155,000  | 1.03            |
| 12 | 日本 | 株式 | 情報・通信業     | KDDI              | 日本円 | 4,200   | 6,140.00    | 25,788,000  | 5,705.00    | 23,961,000  | 0.98            |
| 13 | 日本 | 株式 | 電気機器       | キヤノン              | 日本円 | 7,900   | 3,295.42    | 26,033,818  | 3,006.00    | 23,747,400  | 0.97            |
| 14 | 日本 | 株式 | 小売業        | セブン&アイ・ホールディングス   | 日本円 | 5,700   | 3,740.00    | 21,318,000  | 4,102.00    | 23,381,400  | 0.96            |
| 15 | 日本 | 株式 | 不動産業       | 三菱地所              | 日本円 | 9,000   | 2,742.00    | 24,678,000  | 2,545.00    | 22,905,000  | 0.94            |
| 16 | 日本 | 株式 | 医薬品        | アステラス製薬           | 日本円 | 3,300   | 5,972.42    | 19,709,001  | 6,398.00    | 21,113,400  | 0.86            |
| 17 | 日本 | 株式 | 卸売業        | 三菱商事              | 日本円 | 10,600  | 1,952.00    | 20,691,200  | 1,903.00    | 20,171,800  | 0.82            |
| 18 | 日本 | 株式 | 証券・商品先物取引業 | 野村ホールディングス        | 日本円 | 27,700  | 781.39      | 21,644,571  | 725.00      | 20,082,500  | 0.82            |
| 19 | 日本 | 株式 | 不動産業       | 三井不動産             | 日本円 | 6,000   | 3,372.04    | 20,232,240  | 3,289.00    | 19,734,000  | 0.81            |
| 20 | 日本 | 株式 | 鉄鋼         | 新日鐵住金             | 日本円 | 61,000  | 324.00      | 19,764,000  | 315.00      | 19,215,000  | 0.79            |
| 21 | 日本 | 株式 | 陸運業        | 東日本旅客鉄道           | 日本円 | 2,500   | 8,100.00    | 20,250,000  | 7,632.00    | 19,080,000  | 0.78            |
| 22 | 日本 | 株式 | 電気機器       | パナソニック            | 日本円 | 15,700  | 1,139.00    | 17,882,300  | 1,184.00    | 18,588,800  | 0.76            |
| 23 | 日本 | 株式 | 情報・通信業     | NTTドコモ            | 日本円 | 11,100  | 1,623.00    | 18,015,300  | 1,663.00    | 18,459,300  | 0.75            |
| 24 | 日本 | 株式 | 輸送用機器      | デンソー              | 日本円 | 3,400   | 4,912.37    | 16,702,068  | 5,339.00    | 18,152,600  | 0.74            |
| 25 | 日本 | 株式 | 卸売業        | 三井物産              | 日本円 | 12,600  | 1,371.00    | 17,274,600  | 1,385.00    | 17,451,000  | 0.71            |
| 26 | 日本 | 株式 | 輸送用機器      | 日産自動車             | 日本円 | 19,200  | 880.00      | 16,896,000  | 885.00      | 16,992,000  | 0.69            |
| 27 | 日本 | 株式 | ゴム製品       | ブリヂストン            | 日本円 | 4,500   | 3,670.00    | 16,515,000  | 3,734.00    | 16,803,000  | 0.69            |
| 28 | 日本 | 株式 | 電気機器       | 三菱電機              | 日本円 | 14,000  | 1,142.00    | 15,988,000  | 1,178.00    | 16,492,000  | 0.67            |
| 29 | 日本 | 株式 | 保険業        | 東京海上ホールディングス      | 日本円 | 5,300   | 3,290.96    | 17,442,138  | 3,034.00    | 16,080,200  | 0.66            |
| 30 | 日本 | 株式 | 機械         | 三菱重工              | 日本円 | 24,000  | 619.00      | 14,856,000  | 670.00      | 16,080,000  | 0.66            |

（注）投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

## PRU国内債券マザーファンド

|    | 地域 | 種類   | 銘柄名                               | 利率<br>(%) | 償還期限       | 通貨  | 数量         | 簿価単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円) | 時価単価<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----|------|-----------------------------------|-----------|------------|-----|------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------|
| 1  | 日本 | 国債証券 | 第312回利付国債<br>(10年)                | 1.2       | 2020/12/20 | 日本円 | 40,000,000 | 105.57      | 42,231,200  | 105.84      | 42,338,800  | 1.09            |
| 2  | 日本 | 国債証券 | 第318回利付国債<br>(10年)                | 1         | 2021/9/20  | 日本円 | 40,000,000 | 104.05      | 41,622,400  | 104.24      | 41,698,400  | 1.08            |
| 3  | 日本 | 国債証券 | 第329回利付国債<br>(10年)                | 0.8       | 2023/6/20  | 日本円 | 40,000,000 | 101.71      | 40,684,400  | 102.00      | 40,800,000  | 1.05            |
| 4  | 日本 | 国債証券 | 第115回利付国債<br>(5年)                 | 0.2       | 2018/9/20  | 日本円 | 40,000,000 | 100.04      | 40,018,900  | 100.06      | 40,027,200  | 1.03            |
| 5  | 日本 | 国債証券 | 第325回利付国債<br>(10年)                | 0.8       | 2022/9/20  | 日本円 | 35,000,000 | 102.09      | 35,732,900  | 102.35      | 35,823,550  | 0.92            |
| 6  | 日本 | 国債証券 | 第330回利付国債<br>(10年)                | 0.8       | 2023/9/20  | 日本円 | 35,000,000 | 101.56      | 35,548,100  | 101.86      | 35,653,100  | 0.92            |
| 7  | 日本 | 国債証券 | 第106回利付国債<br>(5年)                 | 0.2       | 2017/9/20  | 日本円 | 35,000,000 | 100.22      | 35,078,750  | 100.21      | 35,075,600  | 0.90            |
| 8  | 日本 | 特殊債券 | 第14回政府保証<br>日本高速道路保有・<br>債務返済機構債券 | 1.9       | 2016/6/22  | 日本円 | 32,000,000 | 104.50      | 33,440,640  | 104.24      | 33,356,800  | 0.86            |
| 9  | 日本 | 特殊債券 | 第19回都市再生<br>債券                    | 2.04      | 2018/3/20  | 日本円 | 30,000,000 | 107.43      | 32,230,200  | 107.21      | 32,163,000  | 0.83            |
| 10 | 日本 | 国債証券 | 第306回利付国債<br>(10年)                | 1.4       | 2020/3/20  | 日本円 | 30,000,000 | 106.84      | 32,052,600  | 106.96      | 32,089,200  | 0.83            |
| 11 | 日本 | 国債証券 | 第301回利付国債<br>(10年)                | 1.5       | 2019/6/20  | 日本円 | 30,000,000 | 107.02      | 32,106,300  | 106.93      | 32,081,400  | 0.83            |
| 12 | 日本 | 国債証券 | 第303回利付国債<br>(10年)                | 1.4       | 2019/9/20  | 日本円 | 30,000,000 | 106.64      | 31,993,200  | 106.61      | 31,984,500  | 0.83            |
| 13 | 日本 | 国債証券 | 第305回利付国債<br>(10年)                | 1.3       | 2019/12/20 | 日本円 | 30,000,000 | 106.14      | 31,842,900  | 106.23      | 31,869,600  | 0.82            |
| 14 | 日本 | 国債証券 | 第296回利付国債<br>(10年)                | 1.5       | 2018/9/20  | 日本円 | 30,000,000 | 106.28      | 31,884,600  | 106.07      | 31,823,400  | 0.82            |
| 15 | 日本 | 国債証券 | 第315回利付国債<br>(10年)                | 1.2       | 2021/6/20  | 日本円 | 30,000,000 | 105.57      | 31,672,800  | 105.76      | 31,729,800  | 0.82            |
| 16 | 日本 | 国債証券 | 第309回利付国債<br>(10年)                | 1.1       | 2020/6/20  | 日本円 | 30,000,000 | 104.98      | 31,496,400  | 105.19      | 31,559,700  | 0.81            |
| 17 | 日本 | 国債証券 | 第285回利付国債<br>(10年)                | 1.7       | 2017/3/20  | 日本円 | 30,000,000 | 105.17      | 31,552,200  | 104.94      | 31,483,200  | 0.81            |
| 18 | 日本 | 国債証券 | 第284回利付国債<br>(10年)                | 1.7       | 2016/12/20 | 日本円 | 30,000,000 | 104.80      | 31,440,300  | 104.57      | 31,371,000  | 0.81            |
| 19 | 日本 | 国債証券 | 第282回利付国債<br>(10年)                | 1.7       | 2016/9/20  | 日本円 | 30,000,000 | 104.42      | 31,326,600  | 104.18      | 31,256,400  | 0.81            |
| 20 | 日本 | 国債証券 | 第278回利付国債<br>(10年)                | 1.8       | 2016/3/20  | 日本円 | 30,000,000 | 103.88      | 31,165,500  | 103.61      | 31,085,700  | 0.80            |
| 21 | 日本 | 国債証券 | 第275回利付国債<br>(10年)                | 1.4       | 2015/12/20 | 日本円 | 30,000,000 | 102.67      | 30,802,500  | 102.46      | 30,740,700  | 0.79            |
| 22 | 日本 | 国債証券 | 第112回利付国債<br>(5年)                 | 0.4       | 2018/6/20  | 日本円 | 30,000,000 | 101.01      | 30,303,000  | 100.97      | 30,292,800  | 0.78            |
| 23 | 日本 | 国債証券 | 第103回利付国債<br>(5年)                 | 0.3       | 2017/3/20  | 日本円 | 30,000,000 | 100.58      | 30,176,100  | 100.57      | 30,172,500  | 0.78            |
| 24 | 日本 | 国債証券 | 第102回利付国債<br>(5年)                 | 0.3       | 2016/12/20 | 日本円 | 30,000,000 | 100.57      | 30,171,900  | 100.55      | 30,167,400  | 0.78            |
| 25 | 日本 | 国債証券 | 第113回利付国債<br>(5年)                 | 0.3       | 2018/6/20  | 日本円 | 30,000,000 | 100.56      | 30,168,300  | 100.54      | 30,162,600  | 0.78            |
| 26 | 日本 | 国債証券 | 第105回利付国債<br>(5年)                 | 0.2       | 2017/6/20  | 日本円 | 30,000,000 | 100.24      | 30,073,500  | 100.23      | 30,070,500  | 0.78            |
| 27 | 日本 | 国債証券 | 第107回利付国債<br>(5年)                 | 0.2       | 2017/12/20 | 日本円 | 30,000,000 | 100.18      | 30,054,000  | 100.19      | 30,057,600  | 0.78            |
| 28 | 日本 | 国債証券 | 第331回利付国債<br>(10年)                | 0.6       | 2023/9/20  | 日本円 | 30,000,000 | 99.72       | 29,916,900  | 100.00      | 30,000,000  | 0.77            |
| 29 | 日本 | 国債証券 | 第288回利付国債<br>(10年)                | 1.7       | 2017/9/20  | 日本円 | 25,000,000 | 105.88      | 26,471,500  | 105.64      | 26,411,000  | 0.68            |
| 30 | 日本 | 国債証券 | 第310回利付国債<br>(10年)                | 1         | 2020/9/20  | 日本円 | 25,000,000 | 104.27      | 26,067,500  | 104.54      | 26,136,500  | 0.67            |

(注) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。



## P R U海外株式マザーファンド

|    | 地域   | 種類 | 業種                     | 銘柄名                         | 通貨  | 数量     | 簿価単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円) | 時価単価<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|----|------------------------|-----------------------------|-----|--------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------|
| 1  | アメリカ | 株式 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | APPLE INC                   | USD | 1,480  | 58,115.90   | 86,011,532  | 51,407.57   | 76,083,213  | 1.61            |
| 2  | アメリカ | 株式 | エネルギー                  | EXXON MOBIL CORPORATION     | USD | 6,927  | 9,737.75    | 67,453,437  | 9,667.81    | 66,968,929  | 1.42            |
| 3  | アメリカ | 株式 | ソフトウェア・サービス            | GOOGLE INC-CL A             | USD | 470    | 108,844.39  | 51,156,865  | 116,786.62  | 54,889,714  | 1.16            |
| 4  | アメリカ | 株式 | ソフトウェア・サービス            | MICROSOFT CORP              | USD | 12,510 | 4,005.36    | 50,107,158  | 3,791.41    | 47,430,659  | 1.00            |
| 5  | アメリカ | 株式 | 資本財                    | GENERAL ELECTRIC CO.        | USD | 16,050 | 2,740.19    | 43,980,055  | 2,622.92    | 42,098,026  | 0.89            |
| 6  | アメリカ | 株式 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | JOHNSON & JOHNSON           | USD | 4,553  | 9,630.78    | 43,848,949  | 9,205.96    | 41,914,781  | 0.89            |
| 7  | スイス  | 株式 | 食品・飲料・タバコ              | NESTLE SA-REGISTERED        | CHF | 5,081  | 7,351.70    | 37,354,038  | 7,516.98    | 38,193,780  | 0.81            |
| 8  | アメリカ | 株式 | エネルギー                  | CHEVRON CORP                | USD | 3,140  | 12,525.26   | 39,329,323  | 11,978.04   | 37,611,067  | 0.80            |
| 9  | アメリカ | 株式 | 銀行                     | WELLS FARGO COMPANY         | USD | 7,934  | 4,500.12    | 35,703,991  | 4,736.70    | 37,581,001  | 0.80            |
| 10 | アメリカ | 株式 | 家庭用品・パーソナル用品           | PROCTER & GAMBLE CO         | USD | 4,354  | 8,573.38    | 37,328,500  | 7,906.84    | 34,426,417  | 0.73            |
| 11 | アメリカ | 株式 | 各種金融                   | JPMORGAN CHASE & CO         | USD | 5,896  | 5,882.56    | 34,683,593  | 5,760.15    | 33,961,903  | 0.72            |
| 12 | アメリカ | 株式 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | PFIZER INC                  | USD | 10,633 | 3,216.43    | 34,200,323  | 3,170.14    | 33,708,153  | 0.71            |
| 13 | スイス  | 株式 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | ROCHE HOLDING AG-GENUSSS    | CHF | 1,116  | 27,879.50   | 31,113,530  | 28,415.21   | 31,711,378  | 0.67            |
| 14 | イギリス | 株式 | 銀行                     | HSBC HOLDINGS PLC           | GBP | 29,341 | 1,118.19    | 32,808,847  | 1,069.32    | 31,375,016  | 0.66            |
| 15 | アメリカ | 株式 | ソフトウェア・サービス            | INTL BUSINESS MACHINES CORP | USD | 1,680  | 18,076.61   | 30,368,715  | 18,243.24   | 30,648,659  | 0.65            |
| 16 | スイス  | 株式 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | NOVARTIS AG-REG SHS         | CHF | 3,664  | 8,052.68    | 29,505,045  | 8,235.05    | 30,173,241  | 0.64            |
| 17 | アメリカ | 株式 | 各種金融                   | BANK OF AMERICA CORP        | USD | 16,951 | 1,607.70    | 27,252,153  | 1,741.41    | 29,518,807  | 0.63            |
| 18 | イギリス | 株式 | 電気通信サービス               | VODAFONE GROUP PLC          | GBP | 76,178 | 380.08      | 28,953,978  | 382.88      | 29,167,253  | 0.62            |
| 19 | アメリカ | 株式 | 電気通信サービス               | AT&T INC                    | USD | 8,438  | 3,558.95    | 30,030,470  | 3,430.38    | 28,945,554  | 0.61            |
| 20 | アメリカ | 株式 | 小売                     | AMAZON.COM INC              | USD | 620    | 39,699.84   | 24,613,904  | 41,453.60   | 25,701,237  | 0.54            |
| 21 | アメリカ | 株式 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | MERCK & CO. INC.            | USD | 4,587  | 5,072.02    | 23,265,386  | 5,504.03    | 25,247,025  | 0.53            |
| 22 | アメリカ | 株式 | 食品・飲料・タバコ              | COCA-COLA COMPANY           | USD | 6,310  | 4,152.45    | 26,202,011  | 3,926.16    | 24,774,108  | 0.52            |
| 23 | イギリス | 株式 | エネルギー                  | BP PLC                      | GBP | 29,982 | 807.67      | 24,215,765  | 810.90      | 24,312,424  | 0.51            |
| 24 | アメリカ | 株式 | 各種金融                   | CITIGROUP INC               | USD | 4,810  | 5,352.83    | 25,747,133  | 4,968.13    | 23,896,743  | 0.51            |
| 25 | アメリカ | 株式 | 電気通信サービス               | VERIZON COMMUNICATIONS INC  | USD | 4,570  | 5,078.19    | 23,207,365  | 4,899.22    | 22,389,443  | 0.47            |
| 26 | イギリス | 株式 | エネルギー                  | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | GBP | 6,075  | 3,419.05    | 20,770,740  | 3,643.87    | 22,136,558  | 0.47            |

|    | 地域   | 種類 | 業種                 | 銘柄名                         | 通貨  | 数量    | 簿価単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円) | 時価単価<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|----|--------------------|-----------------------------|-----|-------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------|
| 27 | アメリカ | 株式 | ソフトウェア・サービス        | ORACLE CORPORATION          | USD | 5,550 | 3,607.30    | 20,020,516  | 3,846.96    | 21,350,650  | 0.45            |
| 28 | アメリカ | 株式 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | QUALCOMM INC                | USD | 2,810 | 7,527.29    | 21,151,698  | 7,535.52    | 21,174,821  | 0.45            |
| 29 | アメリカ | 株式 | 食品・飲料・タバコ          | PEPSICO INC                 | USD | 2,533 | 8,501.37    | 21,533,993  | 8,339.88    | 21,124,938  | 0.45            |
| 30 | アメリカ | 株式 | 食品・飲料・タバコ          | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | USD | 2,570 | 8,836.70    | 22,710,325  | 8,135.19    | 20,907,457  | 0.44            |

(注1) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

(注2) 時価は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。

## P R U海外債券マザーファンド

|    | 地域      | 種類   | 銘柄名                      | 利率 (%) | 償還期限       | 通貨  | 数量        | 簿価単価 (円)  | 簿価金額 (円)    | 時価単価 (円)  | 時価金額 (円)    | 投資比率 (%) |
|----|---------|------|--------------------------|--------|------------|-----|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|----------|
| 1  | アメリカ    | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 3.25   | 2017/3/31  | USD | 5,440,000 | 11,127.36 | 605,328,527 | 11,070.30 | 602,224,728 | 9.00     |
| 2  | アメリカ    | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 3.125  | 2021/5/15  | USD | 2,125,000 | 10,880.65 | 231,213,902 | 10,909.58 | 231,828,760 | 3.47     |
| 3  | アメリカ    | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2.375  | 2015/2/28  | USD | 2,000,000 | 10,560.08 | 211,201,615 | 10,528.68 | 210,573,757 | 3.15     |
| 4  | フランス    | 国債証券 | FRANCE O.A.T.            | 8.5    | 2023/4/25  | EUR | 895,000   | 21,552.76 | 192,897,262 | 21,587.09 | 193,204,516 | 2.89     |
| 5  | イタリア    | 国債証券 | ITALY GOVERNMENT INTERNA | 5.75   | 2016/7/25  | EUR | 1,255,000 | 15,334.21 | 192,444,420 | 15,332.75 | 192,426,045 | 2.88     |
| 6  | アメリカ    | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2.375  | 2018/6/30  | USD | 1,690,000 | 10,784.23 | 182,253,542 | 10,751.27 | 181,696,580 | 2.72     |
| 7  | イタリア    | 国債証券 | ITALY BUONI POLIENNALI D | 3.75   | 2021/3/1   | EUR | 1,120,000 | 14,283.98 | 159,980,605 | 14,503.74 | 162,441,888 | 2.43     |
| 8  | アメリカ    | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 4.75   | 2041/2/15  | USD | 1,250,000 | 11,923.57 | 149,044,628 | 12,441.23 | 155,515,448 | 2.33     |
| 9  | アメリカ    | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 0.25   | 2015/7/15  | USD | 1,430,000 | 10,286.80 | 147,101,273 | 10,290.82 | 147,158,785 | 2.20     |
| 10 | アメリカ    | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2      | 2021/11/15 | USD | 1,380,000 | 9,958.13  | 137,422,245 | 10,019.20 | 138,264,983 | 2.07     |
| 11 | アメリカ    | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 1.375  | 2018/12/31 | USD | 1,330,000 | 10,215.34 | 135,864,037 | 10,222.51 | 135,959,446 | 2.03     |
| 12 | フランス    | 国債証券 | FRANCE O.A.T.            | 4.25   | 2019/4/25  | EUR | 800,000   | 16,219.39 | 129,755,166 | 16,208.31 | 129,666,483 | 1.94     |
| 13 | ドイツ     | 国債証券 | BUNDESBLIGATION          | 0.5    | 2017/4/7   | EUR | 880,000   | 14,004.16 | 123,236,680 | 14,051.43 | 123,652,657 | 1.85     |
| 14 | ドイツ     | 国債証券 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA | 3.25   | 2020/1/4   | EUR | 760,000   | 15,802.73 | 120,100,787 | 15,875.80 | 120,656,093 | 1.80     |
| 15 | アメリカ    | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 4.375  | 2040/5/15  | USD | 950,000   | 11,255.96 | 106,931,713 | 11,742.10 | 111,550,013 | 1.67     |
| 16 | アメリカ    | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 4.5    | 2017/5/15  | USD | 900,000   | 11,575.77 | 104,181,946 | 11,495.40 | 103,458,665 | 1.55     |
| 17 | イギリス    | 国債証券 | UNITED KINGDOM TREASURY  | 4.25   | 2036/3/7   | GBP | 515,000   | 18,779.26 | 96,713,220  | 19,100.11 | 98,365,586  | 1.47     |
| 18 | イタリア    | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 9      | 2023/11/1  | EUR | 485,000   | 19,632.87 | 95,219,434  | 19,938.52 | 96,701,849  | 1.45     |
| 19 | フランス    | 国債証券 | FRENCH TREASURY NOTE BTA | 2      | 2015/7/12  | EUR | 660,000   | 14,345.60 | 94,680,967  | 14,309.06 | 94,439,847  | 1.41     |
| 20 | オーストラリア | 国債証券 | AUSTRALIA GOVERNMENT BON | 4.5    | 2020/4/15  | AUD | 985,000   | 9,440.47  | 92,988,632  | 9,578.95  | 94,352,737  | 1.41     |
| 21 | スペイン    | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.5    | 2017/7/30  | EUR | 565,000   | 15,495.96 | 87,552,214  | 15,692.43 | 88,662,275  | 1.33     |
| 22 | イギリス    | 国債証券 | UNITED KINGDOM GILT      | 4.25   | 2040/12/7  | GBP | 460,000   | 18,834.48 | 86,638,608  | 19,193.72 | 88,291,141  | 1.32     |
| 23 | アメリカ    | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 0.25   | 2015/10/15 | USD | 785,000   | 10,280.37 | 80,700,931  | 10,281.57 | 80,710,379  | 1.21     |
| 24 | スペイン    | 国債証券 | SPAIN GOVERNMENT BOND    | 4      | 2020/4/30  | EUR | 535,000   | 14,485.30 | 77,496,387  | 14,936.95 | 79,912,694  | 1.19     |
| 25 | ベルギー    | 国債証券 | BELGIUM GOVERNMENT BOND  | 3.75   | 2020/9/28  | EUR | 500,000   | 15,850.14 | 79,250,724  | 15,890.81 | 79,454,097  | 1.19     |
| 26 | ドイツ     | 国債証券 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA | 6      | 2016/6/20  | EUR | 500,000   | 15,978.97 | 79,894,867  | 15,876.83 | 79,384,168  | 1.19     |
| 27 | アメリカ    | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 0.875  | 2017/1/31  | USD | 760,000   | 10,348.74 | 78,650,458  | 10,325.37 | 78,472,848  | 1.17     |
| 28 | イタリア    | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5      | 2039/8/1   | EUR | 505,000   | 14,335.82 | 72,395,923  | 14,924.20 | 75,367,247  | 1.13     |
| 29 | アメリカ    | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 3.25   | 2016/12/31 | USD | 665,000   | 11,100.65 | 73,819,330  | 11,044.59 | 73,446,540  | 1.10     |
| 30 | アメリカ    | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 1.375  | 2018/9/30  | USD | 685,000   | 10,281.97 | 70,431,549  | 10,257.87 | 70,266,464  | 1.05     |

(注1) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

(注2) 時価は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。

## 全銘柄の種類別投資比率

| 種類       | 投資比率 (%) |
|----------|----------|
| 投資信託受益証券 | 94.46    |
| 合計       | 94.46    |

(注) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

(参考情報)

## P R U国内株式マザーファンド

|          | 業種         | 投資比率(%) |
|----------|------------|---------|
| 株式       | 電気機器       | 11.65   |
|          | 輸送用機器      | 11.59   |
|          | 銀行業        | 9.49    |
|          | 情報・通信業     | 6.98    |
|          | 機械         | 5.21    |
|          | 化学         | 5.13    |
|          | 医薬品        | 4.41    |
|          | 卸売業        | 4.28    |
|          | 小売業        | 4.21    |
|          | 食料品        | 3.72    |
|          | 陸運業        | 3.54    |
|          | 不動産業       | 3.31    |
|          | 建設業        | 2.52    |
|          | サービス業      | 2.48    |
|          | 保険業        | 2.15    |
|          | 電気・ガス業     | 2.12    |
|          | 証券、商品先物取引業 | 1.72    |
|          | 鉄鋼         | 1.63    |
|          | 精密機器       | 1.36    |
|          | その他製品      | 1.36    |
|          | その他金融業     | 1.34    |
|          | 非鉄金属       | 1.09    |
|          | ガラス・土石製品   | 0.95    |
|          | ゴム製品       | 0.88    |
|          | 繊維製品       | 0.68    |
|          | 金属製品       | 0.65    |
|          | 石油・石炭製品    | 0.58    |
|          | 空運業        | 0.49    |
|          | 鉱業         | 0.42    |
|          | 海運業        | 0.39    |
| パルプ・紙    | 0.27       |         |
| 倉庫・運輸関連業 | 0.22       |         |
| 水産・農林業   | 0.09       |         |
|          | 合計         | 96.90   |

(注) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

## P R U国内債券マザーファンド

| 種類    | 投資比率（％） |
|-------|---------|
| 国債証券  | 83.69   |
| 地方債証券 | 7.17    |
| 特殊債券  | 6.12    |
| 社債券   | 2.05    |
| 合計    | 99.03   |

（注）投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

## P R U海外株式マザーファンド

|             | 業種                     | 投資比率（％） |
|-------------|------------------------|---------|
| 株式          | エネルギー                  | 9.73    |
|             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 8.94    |
|             | 銀行                     | 7.70    |
|             | 資本財                    | 7.43    |
|             | ソフトウェア・サービス            | 6.69    |
|             | 各種金融                   | 5.84    |
|             | 食品・飲料・タバコ              | 5.81    |
|             | 素材                     | 5.40    |
|             | 保険                     | 4.00    |
|             | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 3.85    |
|             | 電気通信サービス               | 3.36    |
|             | 公益事業                   | 3.10    |
|             | 小売                     | 2.99    |
|             | ヘルスケア機器・サービス           | 2.94    |
|             | メディア                   | 2.85    |
|             | 食品・生活必需品小売り            | 2.11    |
|             | 運輸                     | 1.82    |
|             | 家庭用品・パーソナル用品           | 1.76    |
|             | 自動車・自動車部品              | 1.66    |
|             | 消費者サービス                | 1.64    |
| 耐久消費財・アパレル  | 1.46                   |         |
| 半導体・半導体製造装置 | 1.45                   |         |
| 商業・専門サービス   | 0.84                   |         |
| 不動産         | 0.57                   |         |
| 投資証券        | -                      | 1.77    |
|             | 合計                     | 95.75   |

（注）投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

## P R U海外債券マザーファンド

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 国債証券 | 96.60   |
| 合計   | 96.60   |

（注）投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考情報）

## P R U国内株式マザーファンド

（平成26年1月31日現在）

| 種類           | 取引所 | 資産名      | 買建/<br>売建 | 数量<br>(枚) | 通貨  | 簿価金額<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|--------------|-----|----------|-----------|-----------|-----|-------------|-------------|-------------|
| 株価指数<br>先物取引 | 東証  | 東証株価指数先物 | 買建        | 6         | 日本円 | 75,655,300  | 72,900,000  | 2.98        |

（注）投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価比率です。

## P R U海外株式マザーファンド

（平成26年1月31日現在）

| 種類       | 取引所  | 資産名          | 買建/<br>売建 | 数量<br>(枚) | 簿価金額<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|----------|------|--------------|-----------|-----------|-------------|-------------|-------------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | S&P EMINI FU | 買建        | 14        | 128,740,150 | 128,249,962 | 2.72        |
| 株価指数先物取引 | ドイツ  | EURO STOXX50 | 買建        | 11        | 46,309,683  | 46,337,306  | 0.98        |
| 株価指数先物取引 | イギリス | FTSE 100 IDX | 買建        | 3         | 33,141,397  | 33,021,424  | 0.70        |

（注1）投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価比率です。

（注2）簿価金額及び時価金額は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

|               |       | 純資産総額（円）    | 1万口当たりの純資産額<br>（基準価額）（円） |
|---------------|-------|-------------|--------------------------|
| 第1計算期間末       | （分配付） | 138,729,600 | 9,654                    |
| （平成13年12月10日） | （分配落） | 138,729,600 | 9,654                    |
| 第2計算期間末       | （分配付） | 141,653,385 | 9,054                    |
| （平成14年12月10日） | （分配落） | 141,653,385 | 9,054                    |
| 第3計算期間末       | （分配付） | 91,185,812  | 9,450                    |
| （平成15年12月10日） | （分配落） | 91,185,812  | 9,450                    |
| 第4計算期間末       | （分配付） | 84,211,113  | 9,914                    |
| （平成16年12月10日） | （分配落） | 84,211,113  | 9,914                    |
| 第5計算期間末       | （分配付） | 57,165,891  | 11,335                   |
| （平成17年12月12日） | （分配落） | 57,165,891  | 11,335                   |
| 第6計算期間末       | （分配付） | 53,670,503  | 11,592                   |
| （平成18年12月11日） | （分配落） | 53,670,503  | 11,592                   |
| 第7計算期間末       | （分配付） | 48,766,709  | 11,762                   |
| （平成19年12月10日） | （分配落） | 48,766,709  | 11,762                   |
| 第8計算期間末       | （分配付） | 41,731,478  | 9,812                    |
| （平成20年12月10日） | （分配落） | 41,731,478  | 9,812                    |
| 第9計算期間末       | （分配付） | 41,954,634  | 10,329                   |
| （平成21年12月10日） | （分配落） | 41,954,634  | 10,329                   |
| 第10計算期間末      | （分配付） | 48,585,479  | 10,331                   |
| （平成22年12月10日） | （分配落） | 48,585,479  | 10,331                   |
| 第11計算期間末      | （分配付） | 45,815,236  | 10,131                   |
| （平成23年12月12日） | （分配落） | 45,815,236  | 10,131                   |
| 第12計算期間末      | （分配付） | 39,047,859  | 10,576                   |
| （平成24年12月10日） | （分配落） | 39,047,859  | 10,576                   |
| 平成25年1月末日     |       | 40,818,246  | 10,986                   |
| 平成25年2月末日     |       | 41,477,196  | 11,092                   |
| 平成25年3月末日     |       | 42,369,469  | 11,294                   |

|                    | 純資産総額（円）   | 1万口当たりの純資産額<br>（基準価額）（円） |
|--------------------|------------|--------------------------|
| 平成25年4月末日          | 43,337,120 | 11,505                   |
| 平成25年5月末日          | 41,825,031 | 11,430                   |
| 平成25年6月末日          | 41,675,138 | 11,335                   |
| 平成25年7月末日          | 41,140,252 | 11,385                   |
| 平成25年8月末日          | 41,149,682 | 11,373                   |
| 平成25年9月末日          | 38,728,926 | 11,547                   |
| 平成25年10月末日         | 34,446,707 | 11,635                   |
| 平成25年11月末日         | 32,547,922 | 11,763                   |
| 第13計算期間末（分配付）      | 32,511,425 | 11,746                   |
| （平成25年12月10日）（分配落） | 32,511,425 | 11,746                   |
| 平成25年12月末日         | 32,399,540 | 11,804                   |
| 平成26年1月末日          | 32,334,685 | 11,729                   |

## 【分配の推移】

| 決算期                  | 1万口当たりの分配金<br>（円） |
|----------------------|-------------------|
| 第1計算期間末 平成13年12月10日  | 0                 |
| 第2計算期間末 平成14年12月10日  | 0                 |
| 第3計算期間末 平成15年12月10日  | 0                 |
| 第4計算期間末 平成16年12月10日  | 0                 |
| 第5計算期間末 平成17年12月12日  | 0                 |
| 第6計算期間末 平成18年12月11日  | 0                 |
| 第7計算期間末 平成19年12月10日  | 0                 |
| 第8計算期間末 平成20年12月10日  | 0                 |
| 第9計算期間末 平成21年12月10日  | 0                 |
| 第10計算期間末 平成22年12月10日 | 0                 |
| 第11計算期間末 平成23年12月12日 | 0                 |
| 第12計算期間末 平成24年12月10日 | 0                 |
| 第13計算期間末 平成25年12月10日 | 0                 |



## 【収益率の推移】

| 期間                                    | 収益率（％） |
|---------------------------------------|--------|
| 第1計算期間<br>（平成13年3月16日から平成13年12月10日）   | 3.5    |
| 第2計算期間<br>（平成13年12月11日から平成14年12月10日）  | 6.2    |
| 第3計算期間<br>（平成14年12月11日から平成15年12月10日）  | 4.4    |
| 第4計算期間<br>（平成15年12月11日から平成16年12月10日）  | 4.9    |
| 第5計算期間<br>（平成16年12月11日から平成17年12月12日）  | 14.3   |
| 第6計算期間<br>（平成17年12月13日から平成18年12月11日）  | 2.3    |
| 第7計算期間<br>（平成18年12月12日から平成19年12月10日）  | 1.5    |
| 第8計算期間<br>（平成19年12月11日から平成20年12月10日）  | 16.6   |
| 第9計算期間<br>（平成20年12月11日から平成21年12月10日）  | 5.3    |
| 第10計算期間<br>（平成21年12月11日から平成22年12月10日） | 0.0    |
| 第11計算期間<br>（平成22年12月11日から平成23年12月12日） | 1.9    |
| 第12計算期間<br>（平成23年12月13日から平成24年12月10日） | 4.4    |
| 第13計算期間<br>（平成24年12月11日から平成25年12月10日） | 11.1   |

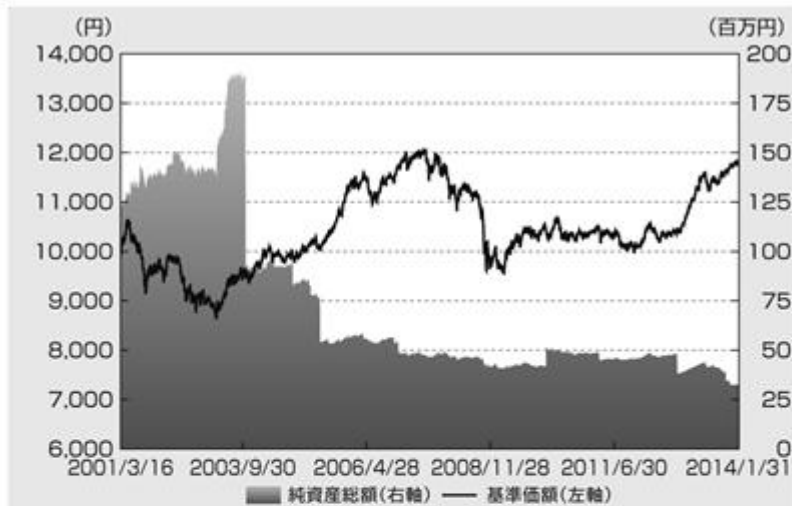
（注） 収益率は、計算期間末の基準価額（分配金込み）から前期末基準価額（当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数をいいます。なお、第1計算期間の収益率については、元本（1万円）を前期末基準価額とみなして計算しています。

## ( 4 ) 【設定及び解約の実績】

| 期間                                    | 設定数量（口）     | 解約数量（口）     |
|---------------------------------------|-------------|-------------|
| 第1計算期間<br>（平成13年3月16日から平成13年12月10日）   | 146,641,985 | 2,938,297   |
| 第2計算期間<br>（平成13年12月11日から平成14年12月10日）  | 13,018,200  | 272,237     |
| 第3計算期間<br>（平成14年12月11日から平成15年12月10日）  | 47,425,194  | 107,383,574 |
| 第4計算期間<br>（平成15年12月11日から平成16年12月10日）  | 8,519,894   | 20,069,205  |
| 第5計算期間<br>（平成16年12月11日から平成17年12月12日）  | 4,169,942   | 38,679,855  |
| 第6計算期間<br>（平成17年12月13日から平成18年12月11日）  | 3,129,654   | 7,262,070   |
| 第7計算期間<br>（平成18年12月12日から平成19年12月10日）  | 5,408,704   | 10,248,705  |
| 第8計算期間<br>（平成19年12月11日から平成20年12月10日）  | 3,498,837   | 2,427,143   |
| 第9計算期間<br>（平成20年12月11日から平成21年12月10日）  | 2,227,489   | 4,141,168   |
| 第10計算期間<br>（平成21年12月11日から平成22年12月10日） | 12,391,058  | 5,981,066   |
| 第11計算期間<br>（平成22年12月11日から平成23年12月12日） | 2,824,213   | 4,627,848   |
| 第12計算期間<br>（平成23年12月13日から平成24年12月10日） | 2,320,770   | 10,623,578  |
| 第13計算期間<br>（平成24年12月11日から平成25年12月10日） | 1,847,419   | 11,090,216  |

（注）本邦外における設定・解約の実績はありません。

## 基準価額・純資産の推移



|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 11,729円 |
| 純資産総額 | 0.32億円  |

## 分配の推移(1万口当たり、税引前)

|             |    |
|-------------|----|
| 2009年12月10日 | 0円 |
| 2010年12月10日 | 0円 |
| 2011年12月12日 | 0円 |
| 2012年12月10日 | 0円 |
| 2013年12月10日 | 0円 |
| 設定来累計       | 0円 |

(注)基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## 主要な資産の状況

## PRUグッドライフ2020

| 資産の種類               | 投資比率    |
|---------------------|---------|
| PRU国内株式マザーファンド      | 9.52%   |
| PRU国内債券マザーファンド      | 71.71%  |
| PRU海外株式マザーファンド      | 5.82%   |
| PRU海外債券マザーファンド      | 7.41%   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | 5.54%   |
| 合計(純資産総額)           | 100.00% |

## PRU国内株式マザーファンド

| 組入上位業種   | 投資比率   |
|----------|--------|
| 1 電気機器   | 11.65% |
| 2 輸送用機器  | 11.59% |
| 3 銀行業    | 9.49%  |
| 4 情報・通信業 | 6.98%  |
| 5 機械     | 5.21%  |
| 6 化学     | 5.13%  |
| 7 医薬品    | 4.41%  |
| 8 卸売業    | 4.28%  |
| 9 小売業    | 4.21%  |
| 10 食料品   | 3.72%  |

| 種類    | 組入上位10銘柄         | 業種     | 投資比率  |
|-------|------------------|--------|-------|
| 1 株式  | トヨタ自動車           | 輸送用機器  | 4.62% |
| 2 株式  | 三菱UFJフィナンシャルグループ | 銀行業    | 2.60% |
| 3 株式  | ソフトバンク           | 情報・通信業 | 2.04% |
| 4 株式  | 三井住友フィナンシャルグループ  | 銀行業    | 2.01% |
| 5 株式  | 本田技研工業           | 輸送用機器  | 1.96% |
| 6 株式  | みずほフィナンシャルグループ   | 銀行業    | 1.57% |
| 7 株式  | 日本電信電話           | 情報・通信業 | 1.21% |
| 8 株式  | 日本たばこ産業          | 食料品    | 1.11% |
| 9 株式  | 日立製作所            | 電気機器   | 1.07% |
| 10 株式 | 武田薬品工業           | 医薬品    | 1.06% |

## PRU国内債券マザーファンド

| 種類別構成                | 投資比率    |
|----------------------|---------|
| 国債証券                 | 83.69%  |
| 地方債証券                | 7.17%   |
| 特殊債券                 | 6.12%   |
| 社債券                  | 2.05%   |
| 現金・その他の資産<br>(負債控除後) | 0.97%   |
| 合計                   | 100.00% |

| 種類      | 組入上位10銘柄                  | 投資比率  |
|---------|---------------------------|-------|
| 1 国債証券  | 第312回利付国債(10年)            | 1.09% |
| 2 国債証券  | 第318回利付国債(10年)            | 1.08% |
| 3 国債証券  | 第329回利付国債(10年)            | 1.05% |
| 4 国債証券  | 第115回利付国債(5年)             | 1.03% |
| 5 国債証券  | 第325回利付国債(10年)            | 0.92% |
| 6 国債証券  | 第330回利付国債(10年)            | 0.92% |
| 7 国債証券  | 第106回利付国債(5年)             | 0.90% |
| 8 特殊債券  | 第14回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.86% |
| 9 特殊債券  | 第19回都市再生債券                | 0.83% |
| 10 国債証券 | 第306回利付国債(10年)            | 0.83% |

### 主要な資産の状況

#### PRU海外債券マザーファンド

| 通貨別構成 | 投資比率    |
|-------|---------|
| 米ドル   | 39.18%  |
| ユーロ   | 43.68%  |
| 英ポンド  | 8.01%   |
| その他   | 9.13%   |
| 合計    | 100.00% |

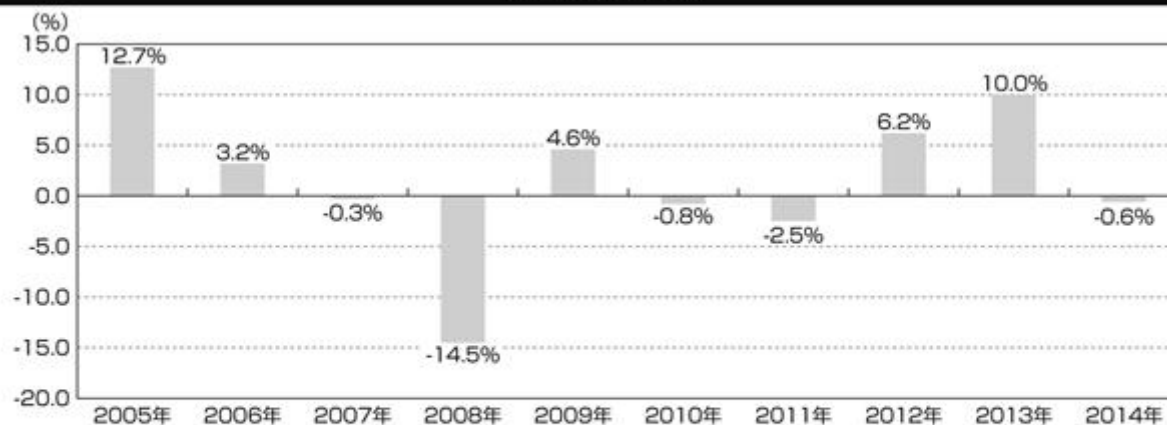
|    | 国    | 種類   | 組入上位10銘柄                 | クーポン   | 償還日         | 投資比率  |
|----|------|------|--------------------------|--------|-------------|-------|
| 1  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 3.250% | 2017年3月31日  | 9.00% |
| 2  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 3.125% | 2021年5月15日  | 3.47% |
| 3  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2.375% | 2015年2月28日  | 3.15% |
| 4  | フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T.            | 8.500% | 2023年4月25日  | 2.89% |
| 5  | イタリア | 国債証券 | ITALY GOVERNMENT INTERNA | 5.750% | 2016年7月25日  | 2.88% |
| 6  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2.375% | 2018年6月30日  | 2.72% |
| 7  | イタリア | 国債証券 | ITALY BUONI POLIENNALI D | 3.750% | 2021年3月1日   | 2.43% |
| 8  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 4.750% | 2041年2月15日  | 2.33% |
| 9  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 0.250% | 2015年7月15日  | 2.20% |
| 10 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2.000% | 2021年11月15日 | 2.07% |

#### PRU海外株式マザーファンド

| 通貨別構成   | 投資比率    |
|---------|---------|
| 米ドル     | 58.60%  |
| ユーロ     | 14.13%  |
| 英ポンド    | 10.12%  |
| 加ドル     | 4.51%   |
| スイス・フラン | 4.24%   |
| その他     | 8.40%   |
| 合計      | 100.00% |

|    | 国    | 組入上位10銘柄                | 業種                     | 投資比率  |
|----|------|-------------------------|------------------------|-------|
| 1  | アメリカ | APPLE INC               | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 1.61% |
| 2  | アメリカ | EXXON MOBIL CORPORATION | エネルギー                  | 1.42% |
| 3  | アメリカ | GOOGLE INC-CL A         | ソフトウェア・サービス            | 1.16% |
| 4  | アメリカ | MICROSOFT CORP          | ソフトウェア・サービス            | 1.00% |
| 5  | アメリカ | GENERAL ELECTRIC CO.    | 資本財                    | 0.89% |
| 6  | アメリカ | JOHNSON & JOHNSON       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 0.89% |
| 7  | スイス  | NESTLE SA-REGISTERED    | 食品・飲料・タバコ              | 0.81% |
| 8  | アメリカ | CHEVRON CORP            | エネルギー                  | 0.80% |
| 9  | アメリカ | WELLS FARGO COMPANY     | 銀行                     | 0.80% |
| 10 | アメリカ | PROCTER & GAMBLE CO     | 家庭用品・パーソナル用品           | 0.73% |

### 年間収益率の推移



(注1) ファンドの年間収益率は、基準価額を使用して計算しております。

(注2) 2014年は1月末までの収益率です。

(注3) 当ファンドにはベンチマークはありません。

※ ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。  
 ※ 最新の運用実績は別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### (1) 申込方法

当ファンドの取得申込者は、販売会社取引口座を開設し、取得の申込みを行うものとし、取得申込みの際には、「一般コース（口数指定）」、「一般コース（金額指定）」および「自動けいぞく投資コース」のいずれかのコースを指定するものとし、なお、販売会社により取扱い可能なコースが異なります。各販売会社の取扱いコースについては、委託会社にお問合わせください。

原則として、毎営業日に取得の申込みができます。ただし、ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所またはニューヨークもしくはロンドンの銀行の休業日の場合には、お申込みの受付はいたしません。

(注1) 申込みの受付は営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合には、翌営業日の取扱いとなります。委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付を中止することができます。

(注2) 平成27年3月末までの日本における営業日でニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所またはニューヨークもしくはロンドンの銀行の休業日に該当する日は以下のとおりです。

なお、現地の事情等により祝日および休業日等が変更される場合がありますので、詳しくは委託会社にお問合わせください。

|             |             |             |             |
|-------------|-------------|-------------|-------------|
| 平成26年4月18日  | 平成26年4月21日  | 平成26年5月26日  | 平成26年7月4日   |
| 平成26年8月25日  | 平成26年9月1日   | 平成26年11月11日 | 平成26年11月27日 |
| 平成26年12月25日 | 平成26年12月26日 | 平成27年1月19日  | 平成27年2月16日  |

| 委託会社問合わせ先       |  |
|-----------------|--|
| ぶる<br>PRUホットライン | 03-6832-7111<br>受付時間：営業日の9:00～17:00<br>土日・祝休日、12月31日～1月3日は休業 |
| ホームページ          | <a href="http://www.pru.co.jp/">http://www.pru.co.jp/</a>    |

#### (2) 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。なお、収益分配金の自動再投資の場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

\* 「基準価額」とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されることがあります。

\* 基準価額は、原則として毎営業日計算されます。

\* 基準価額は、組入有価証券の値動き等により、日々変動します。

基準価額は、前記「(1) 申込方法」に記載の委託会社にお問合わせください。なお、各販売会社でも入手できます。また、基準価額は、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」欄に、「グッド20」として掲載されます。

### （３）申込手数料

申込手数料は、3.15%<sup>\*</sup>（税抜3.0%）を上限として販売会社がそれぞれ定める手数料率を、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に乗じて得た額とします。

\*消費税率が8%になった場合は、3.24%（税込）となります。

申込手数料の詳細については、前記「（１）申込方法」に記載の委託会社にお問合わせください。  
なお、「自動けいぞく投資コース」を選択し、収益分配金（税控除後）の自動再投資により当ファンドを取得する場合には、申込手数料はかかりません。

### （４）申込単位

申込単位は、販売会社がそれぞれ定める単位とします。各販売会社の申込単位については、前記「（１）申込方法」に記載の委託会社にお問合わせください。

### （５）申込取扱場所

販売会社の本・支店、営業所等とします。ただし、販売会社によっては一部の店舗で申込みの取扱いを行わない場合があります。販売会社については、前記「（１）申込方法」に記載の委託会社にお問合わせください。

### （６）申込代金の支払い

当ファンドの取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×取得申込口数）に申込手数料および申込手数料に係る消費税等相当額を加算した額を、販売会社の定める日までに支払うものとします。

（７）取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託銀行は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

## 2【換金（解約）手続等】

### 一部解約

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

前記の規定にかかわらず、ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所またはニューヨークもしくはロンドンの銀行の休業日においては、一部解約の実行の請求を受付けないものとします。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

委託会社は、一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。

一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして前記 に準じて計算された価額とします。

一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において受益者に支払われます。

一部解約の価額は、前記「1申込（販売）手続等（1）申込方法」に記載の委託会社にお問合わせください。

一部解約の実行の請求の受付けは営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合には、翌営業日の取扱いとなります。

一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

受益証券をお手元で保有されている方は、一部解約の実行の請求に際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されることがあります。

当ファンドの主要投資対象の評価方法は以下のとおりです。

マザーファンド受益証券：計算日における基準価額で評価します。

（参考）マザーファンドの主要投資対象の評価方法

株 式：金融商品取引所に上場されている株式は、原則として当該金融商品取引所における計算日の最終相場（外国株式であって外国の金融商品取引市場に上場されている株式は、原則として当該金融商品取引市場における計算時に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。

公 社 債：原則として、日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。

外貨建資産：原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。

基準価額は、原則として毎営業日計算されます。

基準価額は、組入有価証券の値動き等により、日々変動します。

基準価額は、前記「1申込（販売）手続等（1）申込方法」に記載の委託会社にお問合わせください。なお、各販売会社でも入手できます。また、基準価額は、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」欄に、「グッド20」として掲載されます。

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

**(3) 【信託期間】**

当ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日（平成13年3月16日）から平成32年12月10日までとします。ただし、後記「(5) その他 信託の終了」の場合には、当該信託の終了の日までとなります。

**(4) 【計算期間】**

当ファンドの計算期間は、毎年12月11日から翌年12月10日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成13年3月16日から平成13年12月10日までとします。

前記の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

**(5) 【その他】****信託の終了****a. 投資信託契約の解約**

- (a) 委託会社は、信託期間中において、当ファンドの投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託銀行と合意のうえ、当ファンドの投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- (b) 委託会社は、前記(a)の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を当ファンドの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドの投資信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (c) 前記(b)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (d) 前記(c)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記(a)の投資信託契約の解約をしません。
- (e) 委託会社は、当ファンドの投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (f) 前記(c)から(e)までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記(c)の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

**b. 投資信託契約に関する監督官庁の命令**

委託会社は、監督官庁より当ファンドの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、当ファンドの投資信託契約を解約し信託を終了させます。

**c. 委託会社の登録取消等に伴う取扱い**

- (a) 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、当ファンドの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。
- (b) 前記(a)の規定にかかわらず、監督官庁が当ファンドの投資信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、後記「投資信託約款の変更」のd. に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託銀行との間において存続します。

**d. 受託銀行の辞任および解任に伴う取扱い**



- (a) 受託銀行は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託銀行がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託銀行の解任を請求することができます。受託銀行が辞任した場合、または裁判所が受託銀行を解任した場合、委託会社は、後記「投資信託約款の変更」にしたがい、新受託銀行を選任します。
- (b) 委託会社が新受託銀行を選任できないときは、委託会社は当ファンドの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 投資信託約款の変更

- a . 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託銀行と合意のうえ、当ファンドの投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b . 委託会社は、前記 a . の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を当ファンドの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドの投資信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c . 前記 b . の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d . 前記 c . の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記 a . の投資信託約款の変更をしません。
- e . 委託会社は、当ファンドの投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- f . 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて当ファンドの投資信託約款を変更しようとするときは、前記 a . から e . の規定にしたがいます。

#### 運用報告書等の作成

当ファンドについて、法令の定めるところにより、有価証券報告書の提出が計算期間の終了毎に、半期報告書の提出が計算期間開始 6 ヶ月経過毎になされます。また委託会社は、法令の定めるところにより、計算期間の終了毎に運用報告書を作成し、販売会社を経由して知れている受益者に交付します。

#### 投資信託財産に関する報告

- a . 受託銀行は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託会社に提出します。
- b . 受託銀行は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託会社に提出します。

#### 受託銀行による資金の立替え

- a . 投資信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託銀行は資金の立替えをすることができます。
- b . 投資信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託銀行がこれを立替えて投資信託財産に繰入れることができます。
- c . 立替金の決済および利息については、受託銀行と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

#### 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

- a . 委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、当ファンドの投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- b. 委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、当ファンドの投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

#### 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 投資信託約款に関する疑義の取扱い

当ファンドの投資信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託会社と受託銀行との協議により定めます。

#### ファンド資産の保管

##### a. 保管業務の委任

受託銀行は、委託会社と協議のうえ、投資信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

##### b. 有価証券の保管

受託銀行は、投資信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

##### c. 混蔵寄託

金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下c.において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

##### d. 投資信託財産の登記等および記載等の留保等

(a) 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託銀行が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

(b) 前記(a)ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社または受託銀行が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

(c) 投資信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託銀行が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(d) 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

#### 信託事務処理の再信託

受託銀行は、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

#### 関係法人との契約の更新に関する手続き

- a. 販売会社との「投資信託受益権の取扱い等に関する契約書」（別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含みます。）に係る契約の有効期間は、契約締結の日から1年間とします。ただし、期間満了の3カ月前までに委託会社、販売会社のいずれからも別段の意思表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。ただし、期間中において、必要のあるときは、契約の一部を変更することができるものとします。
- b. 投資顧問会社との「投資助言契約」に係る契約の有効期間は、契約締結の日から、当ファンドの信託の終了する日までとします。ただし、期間中において、必要のあるときは、契約の一部を変更することができるものとします。

- c. 前記 a.、b. の契約の一部を変更する場合、その変更の内容が重大であるものに関しては、有価証券届出書の訂正届出書または臨時報告書を提出することにより開示します。

#### 4【受益者の権利等】

当ファンドの投資信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。委託会社は、当初設定に係る信託の受益権については120,188,161口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど追加口数に、それぞれ均等に分割します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生じることはありません。受益者の有する主な権利は次のとおりです。

##### (1) 収益分配金に対する請求権

収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（一般コースの場合は、原則として決算日から起算して5営業日目。）から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、投資信託約款に規定する時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引換えに受益者に支払います。

前記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託銀行が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に支払われます。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、投資信託約款の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。ただし、前記「2 換金（解約）手続等」により信託の一部解約が行われた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、前記の規定に準じて受益者に支払います。

受益者が収益分配金について、前記の支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託銀行から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

- (注) 「別に定める契約」とは、「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合に、自動けいぞく投資約款（別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含みます。）にしたがって、取得申込者と販売会社が締結する契約のことをいいます。

##### (2) 償還金に対する請求権

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目）から信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から受益証券と引換えに当該受益者に支払います。

受益者が償還金について、前記の支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託銀行から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3) 一部解約の実行の請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。詳細については、前記「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4) 反対者の買取請求権

前記「3 資産管理等の概要 (5) その他 信託の終了 a. 投資信託契約の解約」の投資信託契約の解約または「投資信託約款の変更」の投資信託約款の変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を經由して、受託銀行に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。

前記の買取請求の事務取扱い等については、委託会社と受託銀行との協議により定めます。

(5) 受益者集会

受益者集会は開催しません。

### 第3【ファンドの経理状況】

1．当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2．当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間（平成24年12月11日から平成25年12月10日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

【PRUグッドライフ2020】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第12期<br>(平成24年12月10日現在) | 第13期<br>(平成25年12月10日現在) |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                         |                         |
| 流動資産            |                         |                         |
| コール・ローン         | 1,917,116               | 2,047,005               |
| 親投資信託受益証券       | 37,393,988              | 30,696,060              |
| 未収利息            | 2                       | 1                       |
| 流動資産合計          | 39,311,106              | 32,743,066              |
| 資産合計            | 39,311,106              | 32,743,066              |
| <b>負債の部</b>     |                         |                         |
| 流動負債            |                         |                         |
| 未払受託者報酬         | 18,612                  | 16,378                  |
| 未払委託者報酬         | 232,534                 | 204,636                 |
| その他未払費用         | 12,101                  | 10,627                  |
| 流動負債合計          | 263,247                 | 231,641                 |
| 負債合計            | 263,247                 | 231,641                 |
| <b>純資産の部</b>    |                         |                         |
| 元本等             |                         |                         |
| 元本              | 36,921,194              | 27,678,397              |
| 剰余金             |                         |                         |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 2,126,665               | 4,833,028               |
| (分配準備積立金)       | 4,837,623               | 3,946,485               |
| 元本等合計           | 39,047,859              | 32,511,425              |
| 純資産合計           | 39,047,859              | 32,511,425              |
| 負債純資産合計         | 39,311,106              | 32,743,066              |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|   | 第12期 |                              | 第13期 |                              |
|---|------|------------------------------|------|------------------------------|
|   | 自    | 平成23年12月13日<br>至 平成24年12月10日 | 自    | 平成24年12月11日<br>至 平成25年12月10日 |
| <b>営業収益</b>                               |      |                              |      |                              |
| 受取利息                                      |      | 721                          |      | 473                          |
| 有価証券売買等損益                                 |      | 2,438,977                    |      | 4,706,688                    |
| 営業収益合計                                    |      | 2,439,698                    |      | 4,707,161                    |
| <b>営業費用</b>                               |      |                              |      |                              |
| 受託者報酬                                     |      | 38,307                       |      | 33,798                       |
| 委託者報酬                                     |      | 478,689                      |      | 422,318                      |
| その他費用                                     |      | 24,909                       |      | 21,965                       |
| 営業費用合計                                    |      | 541,905                      |      | 478,081                      |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             |      | 1,897,793                    |      | 4,229,080                    |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             |      | 1,897,793                    |      | 4,229,080                    |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           |      | 1,897,793                    |      | 4,229,080                    |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） |      | 295,062                      |      | 1,076,568                    |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           |      | 591,234                      |      | 2,126,665                    |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |      | 80,210                       |      | 219,913                      |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |      | 80,210                       |      | 219,913                      |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |      | 147,510                      |      | 666,062                      |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |      | 147,510                      |      | 666,062                      |
| 分配金                                       |      | -                            |      | -                            |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           |      | 2,126,665                    |      | 4,833,028                    |

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                            |  |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間の取扱い<br>平成23年12月10日が休日のため、当ファンドの前計算期間を平成23年12月13日から平成24年12月10日としております。     |

## (貸借対照表に関する注記)

| 第12期<br>(平成24年12月10日現在)  | 第13期<br>(平成25年12月10日現在)  |
|--|--|
| 1. 投資信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中解約元本額<br><br>期首元本額 45,224,002円<br>期中追加設定元本額 2,320,770円<br>期中解約元本額 10,623,578円<br><br>2. 計算期間末日における受益権の総数<br><br>36,921,194口 | 1. 投資信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中解約元本額<br><br>期首元本額 36,921,194円<br>期中追加設定元本額 1,847,419円<br>期中解約元本額 11,090,216円<br><br>2. 計算期間末日における受益権の総数<br><br>27,678,397口 |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第12期<br>自 平成23年12月13日<br>至 平成24年12月10日  | 第13期<br>自 平成24年12月11日<br>至 平成25年12月10日   |
|---|--|
| 1. 資産運用の権限を再委託又は一部再委託する場合の当該委託費用<br><br>75,695円<br><br>2. 分配金の計算過程<br>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(496,126円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,121,693円)及び分配準備積立金(4,341,497円)より分配対象額は8,959,316円(1万口当たり2,426円)であります、分配を行っておりません。 | 1. 資産運用の権限を再委託又は一部再委託する場合の当該委託費用<br><br>66,254円<br><br>2. 分配金の計算過程<br>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(426,678円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(73,219円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,272,520円)及び分配準備積立金(3,446,588円)より分配対象額は7,219,005円(1万口当たり2,608円)であります、分配を行っておりません。 |



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

| 項目                      | 第12期<br>自 平成23年12月13日<br>至 平成24年12月10日   | 第13期<br>自 平成24年12月11日<br>至 平成25年12月10日 |
|-------------------------|--|--|
| 1.金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を投資信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。   | 同左                                     |
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じて価格変動リスクや為替変動リスク等があります。 | 同左                                     |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | コンプライアンス部では、運用状況のモニタリング、運用に関する法令諸規則の遵守状況の確認を行っております。<br>また、業務統括部では、運用に関するリスク管理を行っております。  | 同左                                     |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                        | 第12期<br>（平成24年12月10日現在）  | 第13期<br>（平成25年12月10日現在）                              |
|---------------------------|--|--|
| 1.貸借対照表計上額、<br>時価及びその差額   | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。  | 同左   |
| 2.時価の算定方法                 | 有価証券<br>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。<br>デリバティブ取引等<br>該当事項はありません。<br>上記以外の金融商品<br>短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。 | 有価証券<br>同左<br><br>デリバティブ取引等<br>同左<br>上記以外の金融商品<br>同左 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価格のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。                                      | 同左   |

（有価証券に関する注記）

第12期（平成24年12月10日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

| 種類        | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 親投資信託受益証券 | 1,825,362         |
| 合計        | 1,825,362         |

第13期（平成25年12月10日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

| 種類        | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 親投資信託受益証券 | 2,677,801         |
| 合計        | 2,677,801         |

（デリバティブ取引等に関する注記）  
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）  
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

| 第12期<br>（平成24年12月10日現在） |          | 第13期<br>（平成25年12月10日現在） |          |
|-------------------------|----------|-------------------------|----------|
| 1口当たり純資産額               | 1.0576円  | 1口当たり純資産額               | 1.1746円  |
| （1万口当たり純資産額             | 10,576円） | （1万口当たり純資産額             | 11,746円） |

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式（平成25年12月10日現在）

該当事項はありません。

株式以外の有価証券（平成25年12月10日現在）

| 種類        | 通貨  | 銘柄             | 口数         | 評価額        |
|-----------|-----|----------------|------------|------------|
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | PRU国内株式マザーファンド | 2,607,970  | 3,256,311  |
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | PRU国内債券マザーファンド | 18,647,887 | 23,033,870 |
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | PRU海外株式マザーファンド | 1,189,003  | 1,965,421  |
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | PRU海外債券マザーファンド | 1,209,585  | 2,440,458  |
|           | 合計  |                | 23,654,445 | 30,696,060 |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考情報)

当ファンドは、「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」受益証券及び「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ており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。同ファンドの状況は次の通りであります。

## 「PRU国内株式マザーファンド」の状況

なお、以下に掲載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

(単位：円)

| 区 分         | 注記<br>番号 | (平成24年12月10日現在) | (平成25年12月10日現在) |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
|             |          | 金 額             | 金 額             |
| 資産の部        |          |                 |                 |
| 流動資産        |          |                 |                 |
| コール・ローン     |          | 56,638,802      | 71,141,124      |
| 株式          |          | 1,864,768,660   | 2,485,780,700   |
| 新株予約権証券     |          | -               | 135,000         |
| 派生商品評価勘定    |          | 3,548,700       | -               |
| 未収入金        |          | 707,900         | 62,000,517      |
| 未収配当金       |          | 1,467,275       | 560,442         |
| 未収利息        |          | 77              | 58              |
| 差入委託証拠金     |          | 990,000         | 2,175,000       |
| 流動資産合計      |          | 1,928,121,414   | 2,621,792,841   |
| 資産合計        |          | 1,928,121,414   | 2,621,792,841   |
| 負債の部        |          |                 |                 |
| 流動負債        |          |                 |                 |
| 派生商品評価勘定    |          | -               | 10,250          |
| 前受金         |          | 4,210,000       | 2,610,000       |
| 未払金         |          | -               | 46,655,440      |
| 未払解約金       |          | 2,270,273       | 13,896,765      |
| 流動負債合計      |          | 6,480,273       | 63,172,455      |
| 負債合計        |          | 6,480,273       | 63,172,455      |
| 純資産の部       |          |                 |                 |
| 元本等         |          |                 |                 |
| 元本          | 1        | 2,495,308,778   | 2,049,151,513   |
| 剰余金         |          |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金( ) | 2        | 573,667,637     | 509,468,873     |
| 元本等合計       |          | 1,921,641,141   | 2,558,620,386   |
| 純資産合計       |          | 1,921,641,141   | 2,558,620,386   |
| 負債純資産合計     |          | 1,928,121,414   | 2,621,792,841   |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                      |   |
|----------------------|---|
| 1．有価証券の評価基準及び評価方法    | 株式及び新株予約権証券<br>移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、または金融商品取引業者から提示される気配相場等に基づいて評価しております。 |
| 2．デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は、最終相場によっております。  |

## （貸借対照表に関する注記）

| (平成24年12月10日現在) |  | (平成25年12月10日現在) |  |
|-----------------|--|-----------------|--|
| 1               | 1 . 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 1               | 1 . 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 |
|                 | 2,481,888,589円                         |                 | 2,495,308,778円                         |
|                 | 同期中における追加設定元本額                         |                 | 同期中における追加設定元本額                         |
|                 | 436,644,616円                           |                 | 496,991,497円                           |
|                 | 同期中における解約元本額                           |                 | 同期中における解約元本額                           |
|                 | 423,224,427円                           |                 | 943,148,762円                           |
|                 | 同期末における元本の内訳                           |                 | 同期末における元本の内訳                           |
|                 | PRU国内株式マーケット・パフォーマー                    |                 | PRU国内株式マーケット・パフォーマー                    |
|                 | 105,801,117円                           |                 | 84,754,501円                            |
|                 | PRUグッドライフ2020                          |                 | PRUグッドライフ2020                          |
|                 | 5,577,983円                             |                 | 2,607,970円                             |
|                 | PRUグッドライフ2030                          |                 | PRUグッドライフ2030                          |
|                 | 5,445,555円                             |                 | 3,492,413円                             |
|                 | PRUグッドライフ2040                          |                 | PRUグッドライフ2040                          |
|                 | 16,143,438円                            |                 | 11,454,773円                            |
|                 | PRUグッドライフ2020（年金）                      |                 | PRUグッドライフ2020（年金）                      |
|                 | 226,225,519円                           |                 | 140,827,698円                           |
|                 | PRUグッドライフ2030（年金）                      |                 | PRUグッドライフ2030（年金）                      |
|                 | 532,428,063円                           |                 | 408,411,068円                           |
|                 | PRUグッドライフ2040（年金）                      |                 | PRUグッドライフ2040（年金）                      |
|                 | 515,545,376円                           |                 | 430,685,952円                           |
|                 | PRUグッドライフ2050（年金）                      |                 | PRUグッドライフ2050（年金）                      |
|                 | 17,915,876円                            |                 | 30,819,255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）   |                 | 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）   |
|                 | 1,033,822,444円                         |                 | 917,611,163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）    |                 | 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）    |
|                 | 36,403,407円                            |                 | 18,486,720円                            |
|                 | 計 2,495,308,778円                       |                 | 計 2,049,151,513円                       |

| (平成24年12月10日現在)   | (平成25年12月10日現在)  |
|---|--|
| <p>2. 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の受益権の総数</p> <p style="text-align: right;">2,495,308,778口</p> <p>2 元本の欠損<br/>貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は573,667,637円であります。</p> | <p>2. 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の受益権の総数</p> <p style="text-align: right;">2,049,151,513口</p> |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 項目                       | 自 平成23年12月13日<br>至 平成24年12月10日   | 自 平成24年12月11日<br>至 平成25年12月10日 |
|--------------------------|--|--------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を投資信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。   | 同左                             |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じて価格変動リスクや為替変動リスク等があります。 | 同左                             |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | コンプライアンス部では、運用状況のモニタリング、運用に関する法令諸規則の遵守状況の確認を行っております。<br>また、業務統括部では、運用に関するリスク管理を行っております。  | 同左                             |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | （平成24年12月10日現在）   | （平成25年12月10日現在）  |
|----------------------------|---|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。   | 同左   |
| 2. 時価の算定方法                 | <p>有価証券<br/>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引等<br/>「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。</p> <p>上記以外の金融商品<br/>短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> | <p>有価証券<br/>同左</p> <p>デリバティブ取引等<br/>同左</p> <p>上記以外の金融商品<br/>同左</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価格のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。   | 同左   |

(有価証券に関する注記)

(平成24年12月10日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

| 種類 | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
|----|-----------------|
| 株式 | 15,583,820      |
| 合計 | 15,583,820      |

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本報告書の開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。



（平成25年12月10日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

| 種類      | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
|---------|-----------------|
| 株式      | 52,259,140      |
| 新株予約権証券 | 12,600          |
| 合計      | 52,246,540      |

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本報告書の開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

株式関連

（単位：円）

| 種類       | （平成24年12月10日現在） |       |            |           |
|----------|-----------------|-------|------------|-----------|
|          | 契約額等            | うち1年超 | 時価         | 評価損益      |
| 市場取引     |                 |       |            |           |
| 株価指数先物取引 |                 |       |            |           |
| 買建       | 43,821,300      | -     | 47,370,000 | 3,548,700 |
| 合計       | 43,821,300      | -     | 47,370,000 | 3,548,700 |

（単位：円）

| 種類       | （平成25年12月10日現在） |       |            |        |
|----------|-----------------|-------|------------|--------|
|          | 契約額等            | うち1年超 | 時価         | 評価損益   |
| 市場取引     |                 |       |            |        |
| 株価指数先物取引 |                 |       |            |        |
| 買建       | 62,835,250      | -     | 62,825,000 | 10,250 |
| 合計       | 62,835,250      | -     | 62,825,000 | 10,250 |

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準じる方法で評価しております。

- 2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3．契約額等には、手数料相当額を含んでおります。
- 4．契約額等及び時価の合計欄の金額は各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

| （平成24年12月10日現在）  | （平成25年12月10日現在）   |
|--|---|
| 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額<br><br>0.7701円<br>（1万口当たり純資産額 7,701円） | 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額<br><br>1.2486円<br>（1万口当たり純資産額 12,486円） |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## 株式

（平成25年12月10日現在）

| 種類     | 通貨    | 銘柄              | 株数        | 評価額単価    | 評価額金額     |
|--------|-------|-----------------|-----------|----------|-----------|
| 株式     | 日本円   | 極洋              | 1,000     | 263.00   | 263,000   |
|        |       | 日本水産            | 2,000     | 228.00   | 456,000   |
|        |       | マルハニチロホールディングス  | 3,000     | 188.00   | 564,000   |
|        |       | サカタのタネ          | 200       | 1,331.00 | 266,200   |
|        |       | ホクト             | 300       | 1,965.00 | 589,500   |
|        |       | 日鉄鉱業            | 1,000     | 514.00   | 514,000   |
|        |       | 三井松島産業          | 1,000     | 161.00   | 161,000   |
|        |       | 国際石油開発帝石        | 7,700     | 1,241.00 | 9,555,700 |
|        |       | 石油資源開発          | 200       | 3,925.00 | 785,000   |
|        |       | ショーボンドホールディングス  | 100       | 4,675.00 | 467,500   |
|        |       | ミライト・ホールディングス   | 600       | 876.00   | 525,600   |
|        |       | 安藤・間            | 1,000     | 320.00   | 320,000   |
|        |       | 東急建設            | 600       | 469.00   | 281,400   |
|        |       | コムシスホールディングス    | 800       | 1,479.00 | 1,183,200 |
|        |       | ミサワホーム          | 200       | 1,561.00 | 312,200   |
|        |       | 高松コンストラクショングループ | 100       | 1,780.00 | 178,000   |
|        |       | 東建コーポレーション      | 60        | 4,945.00 | 296,700   |
|        |       | 大成建設            | 8,000     | 447.00   | 3,576,000 |
|        |       | 大林組             | 5,000     | 545.00   | 2,725,000 |
|        |       | 清水建設            | 5,000     | 476.00   | 2,380,000 |
|        |       | 飛島建設            | 1,500     | 153.00   | 229,500   |
|        |       | 長谷工コーポレーション     | 2,200     | 743.00   | 1,634,600 |
|        |       | 鹿島建設            | 7,000     | 373.00   | 2,611,000 |
|        |       | 不動テトラ           | 1,500     | 173.00   | 259,500   |
|        |       | 鉄建建設            | 1,000     | 284.00   | 284,000   |
|        |       | 西松建設            | 2,000     | 300.00   | 600,000   |
|        |       | 三井住友建設          | 4,500     | 116.00   | 522,000   |
|        |       | 前田建設工業          | 1,000     | 628.00   | 628,000   |
|        |       | 奥村組             | 2,000     | 439.00   | 878,000   |
|        |       | 東鉄工業            | 200       | 1,894.00 | 378,800   |
|        |       | 戸田建設            | 2,000     | 346.00   | 692,000   |
|        |       | 熊谷組             | 1,000     | 237.00   | 237,000   |
|        |       | 北野建設            | 1,000     | 228.00   | 228,000   |
|        |       | 矢作建設工業          | 300       | 777.00   | 233,100   |
|        |       | 大東建託            | 600       | 9,620.00 | 5,772,000 |
|        |       | 東亜建設工業          | 1,000     | 224.00   | 224,000   |
|        |       | 若築建設            | 1,000     | 127.00   | 127,000   |
|        |       | 東洋建設            | 800       | 343.00   | 274,400   |
|        |       | 五洋建設            | 2,000     | 336.00   | 672,000   |
|        |       | 住友林業            | 1,100     | 1,239.00 | 1,362,900 |
|        |       | 巴コーポレーション       | 300       | 474.00   | 142,200   |
|        |       | パナホーム           | 1,000     | 749.00   | 749,000   |
|        |       | 大和ハウス工業         | 4,000     | 1,959.00 | 7,836,000 |
| ライト工業  | 500   | 725.00          | 362,500   |          |           |
| 積水ハウス  | 4,100 | 1,400.00        | 5,740,000 |          |           |
| ユアテック  | 1,000 | 325.00          | 325,000   |          |           |
| 中電工    | 200   | 1,818.00        | 363,600   |          |           |
| 関電工    | 1,000 | 578.00          | 578,000   |          |           |
| きんでん   | 1,000 | 1,051.00        | 1,051,000 |          |           |
| 住友電設   | 100   | 1,576.00        | 157,600   |          |           |
| 協和エクシオ | 700   | 1,278.00        | 894,600   |          |           |
| NDS    | 1,000 | 284.00          | 284,000   |          |           |

| 種類 | 通貨  | 銘柄               | 株数    | 評価額単価    | 評価額金額      |
|----|-----|------------------|-------|----------|------------|
| 株式 | 日本円 | 日揮               | 2,000 | 3,895.00 | 7,790,000  |
|    |     | 中外炉工業            | 1,000 | 263.00   | 263,000    |
|    |     | 高砂熱学工業           | 500   | 836.00   | 418,000    |
|    |     | 大気社              | 200   | 2,171.00 | 434,200    |
|    |     | 日比谷総合設備          | 200   | 1,235.00 | 247,000    |
|    |     | 東洋エンジニアリング       | 1,000 | 398.00   | 398,000    |
|    |     | 千代田化工建設          | 1,000 | 1,489.00 | 1,489,000  |
|    |     | 新興プランテック         | 400   | 768.00   | 307,200    |
|    |     | 日本製粉             | 1,000 | 504.00   | 504,000    |
|    |     | 日清製粉グループ本社       | 1,600 | 1,077.00 | 1,723,200  |
|    |     | 昭和産業             | 1,000 | 310.00   | 310,000    |
|    |     | 鳥越製粉             | 500   | 691.00   | 345,500    |
|    |     | 中部飼料             | 400   | 563.00   | 225,200    |
|    |     | 日本甜菜製糖           | 1,000 | 185.00   | 185,000    |
|    |     | 三井製糖             | 1,000 | 396.00   | 396,000    |
|    |     | 森永製菓             | 2,000 | 210.00   | 420,000    |
|    |     | 中村屋              | 1,000 | 395.00   | 395,000    |
|    |     | 江崎グリコ            | 1,000 | 1,183.00 | 1,183,000  |
|    |     | 不二家              | 1,000 | 202.00   | 202,000    |
|    |     | 山崎製パン            | 1,000 | 1,086.00 | 1,086,000  |
|    |     | 亀田製菓             | 100   | 2,786.00 | 278,600    |
|    |     | カルビー             | 600   | 2,547.00 | 1,528,200  |
|    |     | 森永乳業             | 2,000 | 298.00   | 596,000    |
|    |     | ヤクルト本社           | 900   | 5,120.00 | 4,608,000  |
|    |     | 明治ホールディングス       | 500   | 6,310.00 | 3,155,000  |
|    |     | 雪印メグミルク          | 400   | 1,300.00 | 520,000    |
|    |     | プリマハム            | 1,000 | 201.00   | 201,000    |
|    |     | 日本ハム             | 1,000 | 1,675.00 | 1,675,000  |
|    |     | 伊藤ハム             | 1,000 | 449.00   | 449,000    |
|    |     | 丸大食品             | 1,000 | 305.00   | 305,000    |
|    |     | サッポロホールディングス     | 2,000 | 462.00   | 924,000    |
|    |     | アサヒグループホールディングス  | 3,200 | 2,967.00 | 9,494,400  |
|    |     | キリンホールディングス      | 7,000 | 1,574.00 | 11,018,000 |
|    |     | 宝ホールディングス        | 1,000 | 979.00   | 979,000    |
|    |     | オエノンホールディングス     | 1,000 | 251.00   | 251,000    |
|    |     | コカ・コーラウエスト       | 500   | 2,226.00 | 1,113,000  |
|    |     | コカ・コーライーストジャパン   | 300   | 2,139.00 | 641,700    |
|    |     | サントリー食品インターナショナル | 800   | 3,345.00 | 2,676,000  |
|    |     | ダイトードリンコ         | 100   | 4,350.00 | 435,000    |
|    |     | 伊藤園              | 400   | 2,173.00 | 869,200    |
|    |     | キーコーヒー           | 100   | 1,585.00 | 158,500    |
|    |     | 日清オイリオグループ       | 1,000 | 324.00   | 324,000    |
|    |     | 不二製油             | 400   | 1,635.00 | 654,000    |
|    |     | J・オイルミルズ         | 1,000 | 267.00   | 267,000    |
|    |     | キッコーマン           | 1,000 | 1,951.00 | 1,951,000  |
|    |     | 味の素              | 4,000 | 1,460.00 | 5,840,000  |
|    |     | キューピー            | 800   | 1,415.00 | 1,132,000  |
|    |     | ハウス食品グループ本社      | 600   | 1,566.00 | 939,600    |
|    |     | カゴメ              | 600   | 1,707.00 | 1,024,200  |
|    |     | アリアケジャパン         | 100   | 2,480.00 | 248,000    |
|    |     | ニチレイ             | 2,000 | 517.00   | 1,034,000  |
|    |     | 東洋水産             | 1,000 | 3,015.00 | 3,015,000  |
|    |     | 日清食品ホールディングス     | 600   | 4,195.00 | 2,517,000  |
|    |     | 日本たばこ産業          | 8,700 | 3,525.00 | 30,667,500 |
|    |     | わらべや日洋           | 100   | 1,896.00 | 189,600    |
|    |     | なとり              | 200   | 983.00   | 196,600    |
|    |     | 片倉工業             | 200   | 1,205.00 | 241,000    |

| 種類             | 通貨    | 銘柄            | 株数        | 評価額単価    | 評価額金額      |
|----------------|-------|---------------|-----------|----------|------------|
| 株式             | 日本円   | グンゼ           | 1,000     | 263.00   | 263,000    |
|                |       | 東洋紡           | 6,000     | 196.00   | 1,176,000  |
|                |       | ユニチカ          | 5,000     | 64.00    | 320,000    |
|                |       | 富士紡ホールディングス   | 1,000     | 213.00   | 213,000    |
|                |       | 日清紡ホールディングス   | 1,000     | 928.00   | 928,000    |
|                |       | 倉敷紡績          | 2,000     | 181.00   | 362,000    |
|                |       | シキボウ          | 2,000     | 137.00   | 274,000    |
|                |       | 帝国繊維          | 200       | 1,128.00 | 225,600    |
|                |       | 帝人            | 6,000     | 233.00   | 1,398,000  |
|                |       | 東レ            | 11,000    | 723.00   | 7,953,000  |
|                |       | アツギ           | 3,000     | 128.00   | 384,000    |
|                |       | セーレン          | 500       | 740.00   | 370,000    |
|                |       | ワコールホールディングス  | 1,000     | 1,101.00 | 1,101,000  |
|                |       | ホギメディカル       | 100       | 5,350.00 | 535,000    |
|                |       | T S Iホールディングス | 800       | 632.00   | 505,600    |
|                |       | 三陽商会          | 1,000     | 290.00   | 290,000    |
|                |       | オンワードホールディングス | 1,000     | 814.00   | 814,000    |
|                |       | 特種東海製紙        | 1,000     | 207.00   | 207,000    |
|                |       | 王子ホールディングス    | 6,000     | 494.00   | 2,964,000  |
|                |       | 日本製紙          | 800       | 1,978.00 | 1,582,400  |
|                |       | 三菱製紙          | 3,000     | 93.00    | 279,000    |
|                |       | 北越紀州製紙        | 1,000     | 484.00   | 484,000    |
|                |       | 大王製紙          | 1,000     | 887.00   | 887,000    |
|                |       | レンゴー          | 1,000     | 547.00   | 547,000    |
|                |       | ザ・バック         | 100       | 1,938.00 | 193,800    |
|                |       | クラレ           | 2,300     | 1,251.00 | 2,877,300  |
|                |       | 旭化成           | 9,000     | 806.00   | 7,254,000  |
|                |       | 昭和電工          | 10,000    | 157.00   | 1,570,000  |
|                |       | 住友化学          | 11,000    | 425.00   | 4,675,000  |
|                |       | 日産化学工業        | 1,000     | 1,604.00 | 1,604,000  |
|                |       | クレハ           | 1,000     | 446.00   | 446,000    |
|                |       | テイカ           | 1,000     | 298.00   | 298,000    |
|                |       | 石原産業          | 3,000     | 108.00   | 324,000    |
|                |       | 日本曹達          | 1,000     | 658.00   | 658,000    |
|                |       | 東ソー           | 4,000     | 462.00   | 1,848,000  |
|                |       | トクヤマ          | 2,000     | 382.00   | 764,000    |
|                |       | セントラル硝子       | 1,000     | 344.00   | 344,000    |
|                |       | 東亜合成          | 2,000     | 459.00   | 918,000    |
|                |       | ダイソー          | 1,000     | 337.00   | 337,000    |
|                |       | 電気化学工業        | 3,000     | 429.00   | 1,287,000  |
|                |       | 信越化学工業        | 2,600     | 5,910.00 | 15,366,000 |
|                |       | 日本カーバイド工業     | 1,000     | 324.00   | 324,000    |
|                |       | 堺化学工業         | 1,000     | 314.00   | 314,000    |
|                |       | エア・ウォーター      | 1,000     | 1,412.00 | 1,412,000  |
|                |       | 大陽日酸          | 2,000     | 670.00   | 1,340,000  |
|                |       | ステラ ケミファ      | 100       | 1,665.00 | 166,500    |
|                |       | 日本触媒          | 1,000     | 1,160.00 | 1,160,000  |
|                |       | 大日精化工業        | 1,000     | 438.00   | 438,000    |
|                |       | カネカ           | 2,000     | 659.00   | 1,318,000  |
|                |       | 三菱瓦斯化学        | 2,000     | 872.00   | 1,744,000  |
|                |       | 三井化学          | 7,000     | 255.00   | 1,785,000  |
|                |       | J S R         | 1,300     | 1,862.00 | 2,420,600  |
|                |       | 東京応化工業        | 300       | 2,100.00 | 630,000    |
| 三菱ケミカルホールディングス | 9,000 | 481.00        | 4,329,000 |          |            |
| ダイセル           | 2,000 | 775.00        | 1,550,000 |          |            |
| 住友ベークライト       | 1,000 | 372.00        | 372,000   |          |            |
| 積水化学工業         | 3,000 | 1,240.00      | 3,720,000 |          |            |

| 種類 | 通貨  | 銘柄               | 株数    | 評価額単価      | 評価額金額      |
|----|-----|------------------|-------|------------|------------|
| 株式 | 日本円 | 日本ゼオン            | 1,000 | 1,120.00   | 1,120,000  |
|    |     | アイカ工業            | 400   | 2,027.00   | 810,800    |
|    |     | 宇部興産             | 8,000 | 210.00     | 1,680,000  |
|    |     | 積水樹脂             | 200   | 1,482.00   | 296,400    |
|    |     | 旭有機材工業           | 1,000 | 219.00     | 219,000    |
|    |     | 日立化成             | 600   | 1,630.00   | 978,000    |
|    |     | 積水化成成品工業         | 1,000 | 276.00     | 276,000    |
|    |     | 日本化薬             | 1,000 | 1,459.00   | 1,459,000  |
|    |     | 日本精化             | 300   | 667.00     | 200,100    |
|    |     | A D E K A        | 600   | 1,157.00   | 694,200    |
|    |     | 日油               | 1,000 | 724.00     | 724,000    |
|    |     | 花王               | 3,800 | 3,370.00   | 12,806,000 |
|    |     | 第一工業製薬           | 1,000 | 245.00     | 245,000    |
|    |     | 大日本塗料            | 1,000 | 174.00     | 174,000    |
|    |     | 日本ペイント           | 1,000 | 1,712.00   | 1,712,000  |
|    |     | 関西ペイント           | 2,000 | 1,471.00   | 2,942,000  |
|    |     | 中国塗料             | 1,000 | 557.00     | 557,000    |
|    |     | 藤倉化成             | 600   | 545.00     | 327,000    |
|    |     | 太陽ホールディングス       | 100   | 3,230.00   | 323,000    |
|    |     | D I C            | 5,000 | 305.00     | 1,525,000  |
|    |     | サカタインクス          | 400   | 962.00     | 384,800    |
|    |     | 東洋インキS Cホールディングス | 1,000 | 515.00     | 515,000    |
|    |     | T & K T O K A    | 100   | 2,185.00   | 218,500    |
|    |     | 富士フイルムホールディングス   | 3,300 | 2,882.00   | 9,510,600  |
|    |     | 資生堂              | 2,700 | 1,728.00   | 4,665,600  |
|    |     | ライオン             | 2,000 | 596.00     | 1,192,000  |
|    |     | 高砂香料工業           | 1,000 | 603.00     | 603,000    |
|    |     | マンダム             | 100   | 3,220.00   | 322,000    |
|    |     | ミルボン             | 100   | 4,550.00   | 455,000    |
|    |     | ファンケル            | 300   | 1,127.00   | 338,100    |
|    |     | コーセー             | 200   | 3,315.00   | 663,000    |
|    |     | ドクターシーラボ         | 1     | 318,500.00 | 318,500    |
|    |     | ポーラ・オルビスホールディングス | 200   | 3,760.00   | 752,000    |
|    |     | ノエビアホールディングス     | 100   | 1,904.00   | 190,400    |
|    |     | コニシ              | 100   | 1,971.00   | 197,100    |
|    |     | 長谷川香料            | 200   | 1,428.00   | 285,600    |
|    |     | 小林製薬             | 200   | 5,610.00   | 1,122,000  |
|    |     | 日本高純度化学          | 1     | 209,500.00 | 209,500    |
|    |     | アース製薬            | 100   | 3,775.00   | 377,500    |
|    |     | 大成ラミック           | 100   | 2,492.00   | 249,200    |
|    |     | アキレス             | 2,000 | 148.00     | 296,000    |
|    |     | 有沢製作所            | 200   | 576.00     | 115,200    |
|    |     | 日東電工             | 1,200 | 5,250.00   | 6,300,000  |
|    |     | 藤森工業             | 100   | 2,550.00   | 255,000    |
|    |     | 前澤化成工業           | 100   | 1,037.00   | 103,700    |
|    |     | J S P            | 200   | 1,556.00   | 311,200    |
|    |     | エフピコ             | 100   | 7,550.00   | 755,000    |
|    |     | 天馬               | 100   | 1,354.00   | 135,400    |
|    |     | ニフコ              | 300   | 2,620.00   | 786,000    |
|    |     | 日本バルカー工業         | 1,000 | 278.00     | 278,000    |
|    |     | ユニ・チャーム          | 900   | 6,650.00   | 5,985,000  |
|    |     | 協和発酵キリン          | 2,000 | 1,166.00   | 2,332,000  |
|    |     | 武田薬品工業           | 5,500 | 5,120.00   | 28,160,000 |
|    |     | アステラス製薬          | 3,400 | 6,050.00   | 20,570,000 |
|    |     | 大日本住友製薬          | 1,000 | 1,493.00   | 1,493,000  |
|    |     | 塩野義製薬            | 2,300 | 2,247.00   | 5,168,100  |
|    |     | 田辺三菱製薬           | 1,200 | 1,430.00   | 1,716,000  |

| 種類           | 通貨    | 銘柄              | 株数        | 評価額単価    | 評価額金額      |
|--------------|-------|-----------------|-----------|----------|------------|
| 株式           | 日本円   | 中外製薬            | 1,500     | 2,388.00 | 3,582,000  |
|              |       | 科研製薬            | 1,000     | 1,547.00 | 1,547,000  |
|              |       | エーザイ            | 1,800     | 4,045.00 | 7,281,000  |
|              |       | ロート製薬           | 1,000     | 1,666.00 | 1,666,000  |
|              |       | 小野薬品工業          | 700       | 8,320.00 | 5,824,000  |
|              |       | 久光製薬            | 500       | 5,350.00 | 2,675,000  |
|              |       | 持田製薬            | 100       | 6,030.00 | 603,000    |
|              |       | 参天製薬            | 500       | 4,885.00 | 2,442,500  |
|              |       | 扶桑薬品工業          | 1,000     | 337.00   | 337,000    |
|              |       | 日本ケミファ          | 1,000     | 461.00   | 461,000    |
|              |       | ツムラ             | 400       | 2,752.00 | 1,100,800  |
|              |       | 日医工             | 300       | 1,616.00 | 484,800    |
|              |       | キッセイ薬品工業        | 300       | 2,326.00 | 697,800    |
|              |       | 生化学工業           | 300       | 1,284.00 | 385,200    |
|              |       | 栄研化学            | 100       | 1,880.00 | 188,000    |
|              |       | 鳥居薬品            | 100       | 2,911.00 | 291,100    |
|              |       | 東和薬品            | 100       | 4,825.00 | 482,500    |
|              |       | 沢井製薬            | 200       | 7,170.00 | 1,434,000  |
|              |       | ゼリア新薬工業         | 200       | 2,075.00 | 415,000    |
|              |       | 第一三共            | 4,600     | 1,889.00 | 8,689,400  |
|              |       | キョーリン製薬ホールディングス | 400       | 2,221.00 | 888,400    |
|              |       | 大幸薬品            | 100       | 2,149.00 | 214,900    |
|              |       | ダイト             | 100       | 1,423.00 | 142,300    |
|              |       | 大塚ホールディングス      | 2,900     | 2,942.00 | 8,531,800  |
|              |       | 大正製薬ホールディングス    | 300       | 7,070.00 | 2,121,000  |
|              |       | 日本コークス工業        | 2,400     | 130.00   | 312,000    |
|              |       | 昭和シェル石油         | 1,400     | 1,115.00 | 1,561,000  |
|              |       | コスモ石油           | 4,000     | 188.00   | 752,000    |
|              |       | 東燃ゼネラル石油        | 2,000     | 976.00   | 1,952,000  |
|              |       | ユシロ化学工業         | 200       | 966.00   | 193,200    |
|              |       | 富士石油            | 600       | 317.00   | 190,200    |
|              |       | 出光興産            | 200       | 9,210.00 | 1,842,000  |
|              |       | JXホールディングス      | 16,300    | 533.00   | 8,687,900  |
|              |       | 横浜ゴム            | 2,000     | 1,019.00 | 2,038,000  |
|              |       | 東洋ゴム工業          | 1,000     | 616.00   | 616,000    |
|              |       | ブリヂストン          | 4,600     | 3,790.00 | 17,434,000 |
|              |       | 住友ゴム工業          | 1,200     | 1,467.00 | 1,760,400  |
|              |       | オカモト            | 1,000     | 320.00   | 320,000    |
|              |       | ニッタ             | 200       | 2,258.00 | 451,600    |
|              |       | 東海ゴム工業          | 300       | 993.00   | 297,900    |
|              |       | バンドー化学          | 1,000     | 411.00   | 411,000    |
|              |       | 日東紡績            | 1,000     | 547.00   | 547,000    |
|              |       | 旭硝子             | 7,000     | 652.00   | 4,564,000  |
|              |       | 日本板硝子           | 7,000     | 125.00   | 875,000    |
|              |       | 日本山村硝子          | 1,000     | 185.00   | 185,000    |
|              |       | 日本電気硝子          | 3,000     | 549.00   | 1,647,000  |
|              |       | 住友大阪セメント        | 3,000     | 393.00   | 1,179,000  |
|              |       | 太平洋セメント         | 9,000     | 400.00   | 3,600,000  |
|              |       | 東海カーボン          | 2,000     | 349.00   | 698,000    |
|              |       | 日本カーボン          | 1,000     | 198.00   | 198,000    |
|              |       | 東洋炭素            | 100       | 2,098.00 | 209,800    |
|              |       | ノリタケカンパニーリミテド   | 1,000     | 265.00   | 265,000    |
|              |       | TOTO            | 2,000     | 1,537.00 | 3,074,000  |
| 日本碍子         | 2,000 | 1,886.00        | 3,772,000 |          |            |
| 日本特殊陶業       | 1,000 | 2,309.00        | 2,309,000 |          |            |
| 品川リフラクトリーズ   | 1,000 | 225.00          | 225,000   |          |            |
| フジインコーポレーテッド | 200   | 1,290.00        | 258,000   |          |            |

| 種類      | 通貨    | 銘柄                 | 株数        | 評価額単価    | 評価額金額      |
|---------|-------|--------------------|-----------|----------|------------|
| 株式      | 日本円   | ニチアス               | 1,000     | 716.00   | 716,000    |
|         |       | ニチハ                | 200       | 1,575.00 | 315,000    |
|         |       | 新日鐵住金              | 62,000    | 335.00   | 20,770,000 |
|         |       | 神戸製鋼所              | 21,000    | 175.00   | 3,675,000  |
|         |       | 合同製鐵               | 1,000     | 185.00   | 185,000    |
|         |       | ジェイ エフ イー ホールディングス | 3,700     | 2,321.00 | 8,587,700  |
|         |       | 日新製鋼ホールディングス       | 600       | 1,294.00 | 776,400    |
|         |       | 東京製鐵               | 1,000     | 529.00   | 529,000    |
|         |       | 共英製鋼               | 100       | 2,011.00 | 201,100    |
|         |       | 大和工業               | 300       | 3,345.00 | 1,003,500  |
|         |       | 大阪製鐵               | 100       | 1,806.00 | 180,600    |
|         |       | 淀川製鋼所              | 1,000     | 441.00   | 441,000    |
|         |       | 丸一鋼管               | 500       | 2,507.00 | 1,253,500  |
|         |       | 大同特殊鋼              | 2,000     | 555.00   | 1,110,000  |
|         |       | 日本冶金工業             | 1,000     | 346.00   | 346,000    |
|         |       | 山陽特殊製鋼             | 1,000     | 480.00   | 480,000    |
|         |       | 愛知製鋼               | 1,000     | 465.00   | 465,000    |
|         |       | 日立金属               | 1,000     | 1,470.00 | 1,470,000  |
|         |       | 大平洋金属              | 1,000     | 370.00   | 370,000    |
|         |       | 日本電工               | 1,000     | 296.00   | 296,000    |
|         |       | 栗本鐵工所              | 1,000     | 249.00   | 249,000    |
|         |       | 三菱製鋼               | 1,000     | 275.00   | 275,000    |
|         |       | 日本軽金属ホールディングス      | 4,000     | 135.00   | 540,000    |
|         |       | 三井金属鉱業             | 4,000     | 308.00   | 1,232,000  |
|         |       | 東邦亜鉛               | 1,000     | 335.00   | 335,000    |
|         |       | 三菱マテリアル            | 9,000     | 384.00   | 3,456,000  |
|         |       | 住友金属鉱山             | 4,000     | 1,302.00 | 5,208,000  |
|         |       | DOWAホールディングス       | 2,000     | 989.00   | 1,978,000  |
|         |       | 古河機械金属             | 3,000     | 201.00   | 603,000    |
|         |       | 大阪チタニウムテクノロジーズ     | 200       | 1,868.00 | 373,600    |
|         |       | 東邦チタニウム            | 300       | 735.00   | 220,500    |
|         |       | UACJ               | 2,000     | 334.00   | 668,000    |
|         |       | 古河電気工業             | 5,000     | 242.00   | 1,210,000  |
|         |       | 住友電気工業             | 5,400     | 1,608.00 | 8,683,200  |
|         |       | フジクラ               | 2,000     | 480.00   | 960,000    |
|         |       | 昭和電線ホールディングス       | 2,000     | 102.00   | 204,000    |
|         |       | リョービ               | 1,000     | 391.00   | 391,000    |
|         |       | アサヒホールディングス        | 300       | 1,783.00 | 534,900    |
|         |       | 稲葉製作所              | 100       | 1,255.00 | 125,500    |
|         |       | 宮地エンジニアリンググループ     | 1,000     | 277.00   | 277,000    |
|         |       | SUMCO              | 1,000     | 950.00   | 950,000    |
|         |       | 川田テクノロジーズ          | 100       | 2,697.00 | 269,700    |
|         |       | 東洋製罐グループホールディングス   | 1,100     | 2,096.00 | 2,305,600  |
|         |       | ホッカンホールディングス       | 1,000     | 340.00   | 340,000    |
|         |       | 三和ホールディングス         | 1,000     | 655.00   | 655,000    |
|         |       | 三協立山               | 200       | 2,147.00 | 429,400    |
|         |       | LIXILグループ          | 2,000     | 2,784.00 | 5,568,000  |
|         |       | ノーリツ               | 300       | 2,223.00 | 666,900    |
|         |       | 長府製作所              | 200       | 2,402.00 | 480,400    |
|         |       | リンナイ               | 200       | 7,970.00 | 1,594,000  |
| 岡部      | 300   | 1,226.00           | 367,800   |          |            |
| 東プレ     | 300   | 1,553.00           | 465,900   |          |            |
| 高周波熱錬   | 300   | 866.00             | 259,800   |          |            |
| 東京製鋼    | 1,000 | 167.00             | 167,000   |          |            |
| パイオラックス | 100   | 3,875.00           | 387,500   |          |            |
| 日本発條    | 1,200 | 1,153.00           | 1,383,600 |          |            |
| 三益半導体工業 | 200   | 894.00             | 178,800   |          |            |



| 種類            | 通貨    | 銘柄          | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額      |
|---------------|-------|-------------|-----------|-----------|------------|
| 株式            | 日本円   | 日本製鋼所       | 2,000     | 564.00    | 1,128,000  |
|               |       | 三浦工業        | 300       | 2,569.00  | 770,700    |
|               |       | ツガミ         | 1,000     | 621.00    | 621,000    |
|               |       | オークマ        | 1,000     | 1,098.00  | 1,098,000  |
|               |       | 東芝機械        | 1,000     | 518.00    | 518,000    |
|               |       | アマダ         | 2,000     | 883.00    | 1,766,000  |
|               |       | アイダエンジニアリング | 400       | 1,072.00  | 428,800    |
|               |       | 富士機械製造      | 500       | 880.00    | 440,000    |
|               |       | 牧野フライス製作所   | 1,000     | 837.00    | 837,000    |
|               |       | オーエスジー      | 600       | 1,679.00  | 1,007,400  |
|               |       | 旭ダイヤモンド工業   | 400       | 1,032.00  | 412,800    |
|               |       | D M G 森精機   | 800       | 1,714.00  | 1,371,200  |
|               |       | ディスコ        | 200       | 6,840.00  | 1,368,000  |
|               |       | 日東工器        | 100       | 1,855.00  | 185,500    |
|               |       | 豊和工業        | 200       | 893.00    | 178,600    |
|               |       | 大阪機工        | 1,000     | 142.00    | 142,000    |
|               |       | 島精機製作所      | 200       | 1,980.00  | 396,000    |
|               |       | やまびこ        | 100       | 2,955.00  | 295,500    |
|               |       | ナブテスコ       | 700       | 2,422.00  | 1,695,400  |
|               |       | 三井海洋開発      | 100       | 3,025.00  | 302,500    |
|               |       | S M C       | 400       | 25,030.00 | 10,012,000 |
|               |       | オイレス工業      | 200       | 2,105.00  | 421,000    |
|               |       | サトーホールディングス | 200       | 2,217.00  | 443,400    |
|               |       | 小松製作所       | 6,900     | 2,079.00  | 14,345,100 |
|               |       | 住友重機械工業     | 4,000     | 487.00    | 1,948,000  |
|               |       | 日立建機        | 800       | 2,189.00  | 1,751,200  |
|               |       | 巴工業         | 100       | 1,524.00  | 152,400    |
|               |       | 井関農機        | 2,000     | 309.00    | 618,000    |
|               |       | 北川鉄工所       | 1,000     | 191.00    | 191,000    |
|               |       | クボタ         | 8,000     | 1,699.00  | 13,592,000 |
|               |       | 新東工業        | 400       | 784.00    | 313,600    |
|               |       | 澁谷工業        | 100       | 1,624.00  | 162,400    |
|               |       | 小森コーポレーション  | 400       | 1,643.00  | 657,200    |
|               |       | 荏原製作所       | 3,000     | 648.00    | 1,944,000  |
|               |       | 西島製作所       | 200       | 977.00    | 195,400    |
|               |       | ダイキン工業      | 1,900     | 6,410.00  | 12,179,000 |
|               |       | オルガノ        | 1,000     | 473.00    | 473,000    |
|               |       | トーヨーカネツ     | 1,000     | 307.00    | 307,000    |
|               |       | 栗田工業        | 900       | 2,193.00  | 1,973,700  |
|               |       | 椿本チエイン      | 1,000     | 796.00    | 796,000    |
|               |       | ダイフク        | 500       | 1,286.00  | 643,000    |
|               |       | タダノ         | 1,000     | 1,359.00  | 1,359,000  |
|               |       | C K D       | 500       | 1,060.00  | 530,000    |
|               |       | キトー         | 100       | 1,857.00  | 185,700    |
|               |       | 平和          | 300       | 1,660.00  | 498,000    |
|               |       | 理想科学工業      | 100       | 2,084.00  | 208,400    |
|               |       | S A N K Y O | 400       | 4,810.00  | 1,924,000  |
|               |       | 日本金銭機械      | 100       | 2,041.00  | 204,100    |
|               |       | マースエンジニアリング | 100       | 1,913.00  | 191,300    |
|               |       | ダイコク電機      | 100       | 2,033.00  | 203,300    |
|               |       | アマノ         | 500       | 997.00    | 498,500    |
|               |       | J U K I     | 1,000     | 210.00    | 210,000    |
|               |       | サンデン        | 1,000     | 447.00    | 447,000    |
| 蛇の目マシン工業      | 2,000 | 85.00       | 170,000   |           |            |
| グローリー         | 400   | 2,717.00    | 1,086,800 |           |            |
| セガサミーホールディングス | 1,500 | 2,717.00    | 4,075,500 |           |            |
| 日本ピストンリング     | 1,000 | 192.00      | 192,000   |           |            |

| 種類           | 通貨     | 銘柄                | 株数         | 評価額単価    | 評価額金額      |
|--------------|--------|-------------------|------------|----------|------------|
| 株式           | 日本円    | リケン               | 1,000      | 445.00   | 445,000    |
|              |        | T P R             | 200        | 1,613.00 | 322,600    |
|              |        | ホシザキ電機            | 300        | 3,515.00 | 1,054,500  |
|              |        | 大豊工業              | 200        | 1,150.00 | 230,000    |
|              |        | 日本精工              | 3,000      | 1,230.00 | 3,690,000  |
|              |        | N T N             | 3,000      | 468.00   | 1,404,000  |
|              |        | ジェイテクト            | 1,500      | 1,663.00 | 2,494,500  |
|              |        | 不二越               | 1,000      | 516.00   | 516,000    |
|              |        | 日本トムソン            | 1,000      | 528.00   | 528,000    |
|              |        | T H K             | 900        | 2,500.00 | 2,250,000  |
|              |        | ユーシン精機            | 100        | 2,089.00 | 208,900    |
|              |        | キッツ               | 800        | 480.00   | 384,000    |
|              |        | 日立工機              | 500        | 748.00   | 374,000    |
|              |        | マキタ               | 900        | 5,360.00 | 4,824,000  |
|              |        | 日立造船              | 1,000      | 795.00   | 795,000    |
|              |        | 三菱重工業             | 25,000     | 642.00   | 16,050,000 |
|              |        | I H I             | 9,000      | 449.00   | 4,041,000  |
|              |        | イビデン              | 900        | 1,873.00 | 1,685,700  |
|              |        | コニカミノルタ           | 3,500      | 1,032.00 | 3,612,000  |
|              |        | ブラザー工業            | 1,800      | 1,282.00 | 2,307,600  |
|              |        | ミネベア              | 2,000      | 713.00   | 1,426,000  |
|              |        | 日立製作所             | 34,000     | 759.00   | 25,806,000 |
|              |        | 東芝                | 28,000     | 436.00   | 12,208,000 |
|              |        | 三菱電機              | 14,000     | 1,206.00 | 16,884,000 |
|              |        | 富士電機              | 4,000      | 477.00   | 1,908,000  |
|              |        | 東洋電機製造            | 1,000      | 315.00   | 315,000    |
|              |        | 安川電機              | 2,000      | 1,473.00 | 2,946,000  |
|              |        | シンフォニアテクノロジー      | 1,000      | 163.00   | 163,000    |
|              |        | 明電舎               | 1,000      | 376.00   | 376,000    |
|              |        | デンヨー              | 100        | 1,291.00 | 129,100    |
|              |        | 東芝テック             | 1,000      | 667.00   | 667,000    |
|              |        | マブチモーター           | 200        | 6,250.00 | 1,250,000  |
|              |        | 日本電産              | 800        | 9,690.00 | 7,752,000  |
|              |        | 東光高岳ホールディングス      | 100        | 2,001.00 | 200,100    |
|              |        | ダイヘン              | 1,000      | 465.00   | 465,000    |
|              |        | J V C ケンウッド       | 1,200      | 193.00   | 231,600    |
|              |        | オムロン              | 1,600      | 4,205.00 | 6,728,000  |
|              |        | 日東工業              | 200        | 1,620.00 | 324,000    |
|              |        | I D E C           | 200        | 864.00   | 172,800    |
|              |        | ジーエス・ユアサ コーポレーション | 3,000      | 588.00   | 1,764,000  |
|              |        | メルコホールディングス       | 200        | 1,320.00 | 264,000    |
|              |        | テクノメディカ           | 100        | 2,202.00 | 220,200    |
|              |        | 日本電気              | 19,000     | 226.00   | 4,294,000  |
|              |        | 富士通               | 14,000     | 483.00   | 6,762,000  |
|              |        | 沖電気工業             | 5,000      | 237.00   | 1,185,000  |
|              |        | サンケン電気            | 1,000      | 703.00   | 703,000    |
|              |        | アイホン              | 100        | 1,660.00 | 166,000    |
| ルネサスエレクトロニクス | 800    | 683.00            | 546,400    |          |            |
| セイコーエプソン     | 1,000  | 2,472.00          | 2,472,000  |          |            |
| ワコム          | 1,100  | 730.00            | 803,000    |          |            |
| アルバック        | 200    | 1,398.00          | 279,600    |          |            |
| E I Z O      | 100    | 2,580.00          | 258,000    |          |            |
| 日本信号         | 400    | 759.00            | 303,600    |          |            |
| パナソニック       | 16,000 | 1,175.00          | 18,800,000 |          |            |
| シャープ         | 10,000 | 340.00            | 3,400,000  |          |            |
| アンリツ         | 900    | 1,166.00          | 1,049,400  |          |            |
| ソニー          | 7,700  | 1,826.00          | 14,060,200 |          |            |

| 種類         | 通貨    | 銘柄                  | 株数         | 評価額単価     | 評価額金額      |
|------------|-------|---------------------|------------|-----------|------------|
| 株式         | 日本円   | T D K               | 900        | 4,720.00  | 4,248,000  |
|            |       | ミツミ電機               | 600        | 947.00    | 568,200    |
|            |       | タムラ製作所              | 1,000      | 281.00    | 281,000    |
|            |       | アルプス電気              | 1,000      | 1,155.00  | 1,155,000  |
|            |       | パイオニア               | 2,000      | 221.00    | 442,000    |
|            |       | ローランド ディー・ジー・       | 100        | 3,290.00  | 329,000    |
|            |       | フォスター電機             | 200        | 1,983.00  | 396,600    |
|            |       | 東光                  | 1,000      | 350.00    | 350,000    |
|            |       | ホシデン                | 400        | 544.00    | 217,600    |
|            |       | ヒロセ電機               | 200        | 15,770.00 | 3,154,000  |
|            |       | T O A               | 200        | 930.00    | 186,000    |
|            |       | ユニデン                | 1,000      | 408.00    | 408,000    |
|            |       | アルパイン               | 300        | 1,373.00  | 411,900    |
|            |       | アイコム                | 100        | 2,447.00  | 244,700    |
|            |       | 船井電機                | 200        | 1,249.00  | 249,800    |
|            |       | 横河電機                | 1,500      | 1,573.00  | 2,359,500  |
|            |       | アズビル                | 400        | 2,390.00  | 956,000    |
|            |       | 日本光電工業              | 300        | 3,620.00  | 1,086,000  |
|            |       | 堀場製作所               | 300        | 3,530.00  | 1,059,000  |
|            |       | アドバンテスト             | 1,000      | 1,255.00  | 1,255,000  |
|            |       | 小野測器                | 1,000      | 436.00    | 436,000    |
|            |       | エスペック               | 300        | 816.00    | 244,800    |
|            |       | キーエンス               | 300        | 41,600.00 | 12,480,000 |
|            |       | シスメックス              | 600        | 6,550.00  | 3,930,000  |
|            |       | メガチップス              | 100        | 1,527.00  | 152,700    |
|            |       | O B A R A G R O U P | 100        | 3,155.00  | 315,500    |
|            |       | コーセル                | 200        | 1,144.00  | 228,800    |
|            |       | オプテックス              | 100        | 1,750.00  | 175,000    |
|            |       | レーザーテック             | 200        | 940.00    | 188,000    |
|            |       | スタンレー電気             | 1,000      | 2,309.00  | 2,309,000  |
|            |       | ウシオ電機               | 800        | 1,343.00  | 1,074,400  |
|            |       | 遠藤照明                | 100        | 2,169.00  | 216,900    |
|            |       | 日本デジタル研究所           | 200        | 1,381.00  | 276,200    |
|            |       | 日本電子                | 1,000      | 489.00    | 489,000    |
|            |       | カシオ計算機              | 1,500      | 1,151.00  | 1,726,500  |
|            |       | ファナック               | 1,600      | 16,920.00 | 27,072,000 |
|            |       | 日本シイエムケイ            | 600        | 277.00    | 166,200    |
|            |       | エンプラス               | 100        | 6,900.00  | 690,000    |
|            |       | ローム                 | 700        | 4,420.00  | 3,094,000  |
|            |       | 浜松ホトニクス             | 600        | 4,080.00  | 2,448,000  |
|            |       | 三井ハイテック             | 300        | 763.00    | 228,900    |
|            |       | 新光電気工業              | 600        | 860.00    | 516,000    |
|            |       | 京セラ                 | 2,500      | 5,300.00  | 13,250,000 |
|            |       | 太陽誘電                | 700        | 1,309.00  | 916,300    |
|            |       | 村田製作所               | 1,500      | 9,090.00  | 13,635,000 |
|            |       | ユーシン                | 300        | 721.00    | 216,300    |
|            |       | 双葉電子工業              | 300        | 1,296.00  | 388,800    |
|            |       | 北陸電気工業              | 1,000      | 147.00    | 147,000    |
|            |       | ニチコン                | 500        | 1,021.00  | 510,500    |
|            |       | 日本ケミコン              | 1,000      | 389.00    | 389,000    |
|            |       | K O A               | 200        | 1,087.00  | 217,400    |
|            |       | 小糸製作所               | 1,000      | 1,924.00  | 1,924,000  |
|            |       | ミツバ                 | 300        | 1,718.00  | 515,400    |
| スター精密      | 300   | 1,174.00            | 352,200    |           |            |
| 大日本スクリーン製造 | 1,000 | 567.00              | 567,000    |           |            |
| キャノン電子     | 200   | 1,956.00            | 391,200    |           |            |
| キャノン       | 8,100 | 3,305.00            | 26,770,500 |           |            |

| 種類        | 通貨    | 銘柄         | 株数        | 評価額単価    | 評価額金額       |
|-----------|-------|------------|-----------|----------|-------------|
| 株式        | 日本円   | リコー        | 4,000     | 1,180.00 | 4,720,000   |
|           |       | 東京エレクトロン   | 1,300     | 5,500.00 | 7,150,000   |
|           |       | トヨタ紡織      | 500       | 1,326.00 | 663,000     |
|           |       | ユニプレス      | 300       | 1,830.00 | 549,000     |
|           |       | 豊田自動織機     | 1,300     | 4,535.00 | 5,895,500   |
|           |       | 三櫻工業       | 200       | 747.00   | 149,400     |
|           |       | デンソー       | 3,500     | 5,140.00 | 17,990,000  |
|           |       | 東海理化電機製作所  | 400       | 2,026.00 | 810,400     |
|           |       | 三井造船       | 5,000     | 214.00   | 1,070,000   |
|           |       | 川崎重工業      | 11,000    | 422.00   | 4,642,000   |
|           |       | 名村造船所      | 200       | 1,258.00 | 251,600     |
|           |       | 日本車輛製造     | 1,000     | 508.00   | 508,000     |
|           |       | 日産自動車      | 19,700    | 910.00   | 17,927,000  |
|           |       | いすゞ自動車     | 8,000     | 637.00   | 5,096,000   |
|           |       | トヨタ自動車     | 19,500    | 6,270.00 | 122,265,000 |
|           |       | 日野自動車      | 2,000     | 1,542.00 | 3,084,000   |
|           |       | 三菱自動車工業    | 3,300     | 1,095.00 | 3,613,500   |
|           |       | エフテック      | 100       | 1,565.00 | 156,500     |
|           |       | 武蔵精密工業     | 200       | 2,173.00 | 434,600     |
|           |       | 日産車体       | 1,000     | 1,526.00 | 1,526,000   |
|           |       | 新明和工業      | 1,000     | 803.00   | 803,000     |
|           |       | 極東開発工業     | 300       | 1,307.00 | 392,100     |
|           |       | 日信工業       | 300       | 2,100.00 | 630,000     |
|           |       | トピー工業      | 1,000     | 198.00   | 198,000     |
|           |       | ティラド       | 1,000     | 274.00   | 274,000     |
|           |       | 曙ブレーキ工業    | 900       | 483.00   | 434,700     |
|           |       | タチエス       | 200       | 1,474.00 | 294,800     |
|           |       | NOK        | 700       | 1,687.00 | 1,180,900   |
|           |       | フタバ産業      | 600       | 397.00   | 238,200     |
|           |       | カヤバ工業      | 1,000     | 532.00   | 532,000     |
|           |       | プレス工業      | 1,000     | 450.00   | 450,000     |
|           |       | カルソニックカンセイ | 1,000     | 517.00   | 517,000     |
|           |       | 太平洋工業      | 300       | 707.00   | 212,100     |
|           |       | ケーヒン       | 300       | 1,598.00 | 479,400     |
|           |       | アイシン精機     | 1,300     | 4,180.00 | 5,434,000   |
|           |       | マツダ        | 21,000    | 483.00   | 10,143,000  |
|           |       | ダイハツ工業     | 1,500     | 1,821.00 | 2,731,500   |
|           |       | 今仙電機製作所    | 100       | 1,454.00 | 145,400     |
|           |       | 本田技研工業     | 12,600    | 4,250.00 | 53,550,000  |
|           |       | スズキ        | 2,900     | 2,625.00 | 7,612,500   |
|           |       | 富士重工業      | 4,800     | 2,812.00 | 13,497,600  |
|           |       | ヤマハ発動機     | 2,100     | 1,593.00 | 3,345,300   |
|           |       | ショーワ       | 400       | 1,502.00 | 600,800     |
|           |       | エクセディ      | 200       | 3,135.00 | 627,000     |
|           |       | 豊田合成       | 400       | 2,392.00 | 956,800     |
|           |       | 愛三工業       | 200       | 989.00   | 197,800     |
|           |       | ヨロズ        | 100       | 1,849.00 | 184,900     |
| エフ・シー・シー  | 300   | 2,015.00   | 604,500   |          |             |
| シマノ       | 600   | 9,060.00   | 5,436,000 |          |             |
| タカタ       | 200   | 2,875.00   | 575,000   |          |             |
| ティ・エス テック | 300   | 3,570.00   | 1,071,000 |          |             |
| テルモ       | 1,100 | 5,270.00   | 5,797,000 |          |             |
| 島津製作所     | 2,000 | 954.00     | 1,908,000 |          |             |
| バイ・テクノロジー | 1     | 289,000.00 | 289,000   |          |             |
| 東京計器      | 1,000 | 300.00     | 300,000   |          |             |
| 東京精密      | 300   | 2,127.00   | 638,100   |          |             |
| ニコン       | 2,600 | 2,004.00   | 5,210,400 |          |             |

| 種類         | 通貨    | 銘柄                | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額      |
|------------|-------|-------------------|-----------|-----------|------------|
| 株式         | 日本円   | トプコン              | 400       | 1,545.00  | 618,000    |
|            |       | オリンパス             | 2,100     | 3,380.00  | 7,098,000  |
|            |       | タムロン              | 100       | 2,285.00  | 228,500    |
|            |       | H O Y A           | 3,400     | 2,949.00  | 10,026,600 |
|            |       | シチズンホールディングス      | 1,700     | 828.00    | 1,407,600  |
|            |       | リズム時計工業           | 1,000     | 140.00    | 140,000    |
|            |       | 大研医器              | 100       | 1,701.00  | 170,100    |
|            |       | セイコーホールディングス      | 1,000     | 520.00    | 520,000    |
|            |       | ニプロ               | 800       | 938.00    | 750,400    |
|            |       | パラマウントベッドホールディングス | 200       | 3,355.00  | 671,000    |
|            |       | バンダイナムコホールディングス   | 1,500     | 2,030.00  | 3,045,000  |
|            |       | フランスベッドホールディングス   | 1,000     | 198.00    | 198,000    |
|            |       | パイロットコーポレーション     | 100       | 3,625.00  | 362,500    |
|            |       | トッパン・フォームズ        | 300       | 935.00    | 280,500    |
|            |       | フジシールインターナショナル    | 200       | 3,300.00  | 660,000    |
|            |       | タカラトミー            | 500       | 468.00    | 234,000    |
|            |       | アーク               | 500       | 314.00    | 157,000    |
|            |       | 凸版印刷              | 4,000     | 796.00    | 3,184,000  |
|            |       | 大日本印刷             | 4,000     | 1,064.00  | 4,256,000  |
|            |       | 共同印刷              | 1,000     | 285.00    | 285,000    |
|            |       | 日本写真印刷            | 200       | 1,690.00  | 338,000    |
|            |       | アシックス             | 1,400     | 1,634.00  | 2,287,600  |
|            |       | ツツミ               | 100       | 2,311.00  | 231,100    |
|            |       | ローランド             | 100       | 1,289.00  | 128,900    |
|            |       | ヤマハ               | 1,000     | 1,570.00  | 1,570,000  |
|            |       | クリナップ             | 300       | 870.00    | 261,000    |
|            |       | ピジョン              | 200       | 5,060.00  | 1,012,000  |
|            |       | リンテック             | 400       | 1,871.00  | 748,400    |
|            |       | イトーキ              | 400       | 617.00    | 246,800    |
|            |       | 任天堂               | 900       | 12,890.00 | 11,601,000 |
|            |       | 三菱鉛筆              | 100       | 2,428.00  | 242,800    |
|            |       | コクヨ               | 800       | 779.00    | 623,200    |
|            |       | グローブライド           | 1,000     | 153.00    | 153,000    |
|            |       | 岡村製作所             | 1,000     | 876.00    | 876,000    |
|            |       | 美津濃               | 1,000     | 521.00    | 521,000    |
|            |       | アデランス             | 300       | 1,157.00  | 347,100    |
|            |       | 東京電力              | 11,900    | 536.00    | 6,378,400  |
|            |       | 中部電力              | 4,600     | 1,352.00  | 6,219,200  |
|            |       | 関西電力              | 5,700     | 1,220.00  | 6,954,000  |
|            |       | 中国電力              | 2,000     | 1,519.00  | 3,038,000  |
|            |       | 北陸電力              | 1,400     | 1,370.00  | 1,918,000  |
|            |       | 東北電力              | 3,500     | 1,140.00  | 3,990,000  |
|            |       | 四国電力              | 1,300     | 1,559.00  | 2,026,700  |
|            |       | 九州電力              | 3,100     | 1,335.00  | 4,138,500  |
|            |       | 北海道電力             | 1,300     | 1,195.00  | 1,553,500  |
|            |       | 沖縄電力              | 100       | 3,435.00  | 343,500    |
|            |       | 電源開発              | 900       | 3,205.00  | 2,884,500  |
|            |       | 東京瓦斯              | 16,000    | 500.00    | 8,000,000  |
|            |       | 大阪瓦斯              | 14,000    | 409.00    | 5,726,000  |
|            |       | 東邦瓦斯              | 4,000     | 496.00    | 1,984,000  |
|            |       | 北海道瓦斯             | 1,000     | 271.00    | 271,000    |
|            |       | 西部瓦斯              | 2,000     | 249.00    | 498,000    |
|            |       | 静岡瓦斯              | 500       | 604.00    | 302,000    |
| 東武鉄道       | 8,000 | 504.00            | 4,032,000 |           |            |
| 相鉄ホールディングス | 3,000 | 357.00            | 1,071,000 |           |            |
| 東京急行電鉄     | 8,000 | 663.00            | 5,304,000 |           |            |
| 京浜急行電鉄     | 4,000 | 844.00            | 3,376,000 |           |            |

| 種類                | 通貨  | 銘柄                      | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額      |
|-------------------|-----|-------------------------|-----------|-----------|------------|
| 株式                | 日本円 | 小田急電鉄                   | 4,000     | 914.00    | 3,656,000  |
|                   |     | 京王電鉄                    | 4,000     | 657.00    | 2,628,000  |
|                   |     | 京成電鉄                    | 2,000     | 952.00    | 1,904,000  |
|                   |     | 東日本旅客鉄道                 | 2,600     | 8,250.00  | 21,450,000 |
|                   |     | 西日本旅客鉄道                 | 1,300     | 4,400.00  | 5,720,000  |
|                   |     | 東海旅客鉄道                  | 1,200     | 12,210.00 | 14,652,000 |
|                   |     | 鴻池運輸                    | 100       | 1,537.00  | 153,700    |
|                   |     | 西日本鉄道                   | 2,000     | 379.00    | 758,000    |
|                   |     | ハマキョウレックス               | 100       | 2,800.00  | 280,000    |
|                   |     | 近畿日本鉄道                  | 14,000    | 357.00    | 4,998,000  |
|                   |     | 阪急阪神ホールディングス            | 9,000     | 559.00    | 5,031,000  |
|                   |     | 南海電気鉄道                  | 3,000     | 363.00    | 1,089,000  |
|                   |     | 京阪電気鉄道                  | 3,000     | 392.00    | 1,176,000  |
|                   |     | 名古屋鉄道                   | 5,000     | 293.00    | 1,465,000  |
|                   |     | 山陽電気鉄道                  | 1,000     | 407.00    | 407,000    |
|                   |     | 日本通運                    | 5,000     | 507.00    | 2,535,000  |
|                   |     | ヤマトホールディングス             | 2,600     | 2,112.00  | 5,491,200  |
|                   |     | 山九                      | 2,000     | 399.00    | 798,000    |
|                   |     | 丸全昭和運輸                  | 1,000     | 355.00    | 355,000    |
|                   |     | センコー                    | 1,000     | 539.00    | 539,000    |
|                   |     | 日本梱包運輸倉庫                | 400       | 1,772.00  | 708,800    |
|                   |     | 福山通運                    | 1,000     | 586.00    | 586,000    |
|                   |     | セイノーホールディングス            | 1,000     | 1,090.00  | 1,090,000  |
|                   |     | 日立物流                    | 300       | 1,593.00  | 477,900    |
|                   |     | 日本郵船                    | 12,000    | 315.00    | 3,780,000  |
|                   |     | 商船三井                    | 8,000     | 449.00    | 3,592,000  |
|                   |     | 川崎汽船                    | 6,000     | 237.00    | 1,422,000  |
|                   |     | N S ユナイテッド海運            | 1,000     | 296.00    | 296,000    |
|                   |     | 乾汽船                     | 400       | 383.00    | 153,200    |
|                   |     | 飯野海運                    | 700       | 627.00    | 438,900    |
|                   |     | 第一中央汽船                  | 2,000     | 116.00    | 232,000    |
|                   |     | 日本航空                    | 1,200     | 5,150.00  | 6,180,000  |
|                   |     | A N A ホールディングス          | 27,000    | 210.00    | 5,670,000  |
|                   |     | 日新                      | 1,000     | 294.00    | 294,000    |
|                   |     | 三菱倉庫                    | 1,000     | 1,587.00  | 1,587,000  |
|                   |     | 三井倉庫                    | 1,000     | 475.00    | 475,000    |
|                   |     | 住友倉庫                    | 1,000     | 582.00    | 582,000    |
|                   |     | 安田倉庫                    | 200       | 1,136.00  | 227,200    |
|                   |     | 上組                      | 2,000     | 934.00    | 1,868,000  |
|                   |     | 郵船ロジスティクス               | 200       | 1,356.00  | 271,200    |
|                   |     | 近鉄エクスプレス                | 100       | 4,060.00  | 406,000    |
|                   |     | N E C ネットエスアイ           | 100       | 2,444.00  | 244,400    |
|                   |     | システナ                    | 300       | 717.00    | 215,100    |
|                   |     | 新日鉄住金ソリューションズ           | 100       | 2,317.00  | 231,700    |
|                   |     | I T ホールディングス            | 500       | 1,590.00  | 795,000    |
|                   |     | グリーン                    | 800       | 1,139.00  | 911,200    |
|                   |     | コーエーテクモホールディングス         | 300       | 1,264.00  | 379,200    |
|                   |     | ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス | 100       | 3,120.00  | 312,000    |
|                   |     | ネクソン                    | 1,200     | 1,017.00  | 1,220,400  |
|                   |     | ブロードリーフ                 | 200       | 2,002.00  | 400,400    |
| ダウンゴ              | 100 | 3,045.00                | 304,500   |           |            |
| マクロミル             | 300 | 674.00                  | 202,200   |           |            |
| G M O ペイメントゲートウェイ | 100 | 4,470.00                | 447,000   |           |            |
| インターネットイニシアティブ    | 200 | 3,100.00                | 620,000   |           |            |
| ビットアイル            | 300 | 815.00                  | 244,500   |           |            |
| 朝日ネット             | 400 | 492.00                  | 196,800   |           |            |
| 野村総合研究所           | 800 | 3,305.00                | 2,644,000 |           |            |

| 種類                  | 通貨    | 銘柄                   | 株数      | 評価額単価     | 評価額金額      |
|---------------------|-------|----------------------|---------|-----------|------------|
| 株式                  | 日本円   | インテージホールディングス        | 200     | 1,259.00  | 251,800    |
|                     |       | フジ・メディア・ホールディングス     | 1,300   | 2,241.00  | 2,913,300  |
|                     |       | オービック                | 500     | 2,953.00  | 1,476,500  |
|                     |       | ヤフー                  | 10,000  | 559.00    | 5,590,000  |
|                     |       | トレンドマイクロ             | 600     | 3,870.00  | 2,322,000  |
|                     |       | 日本オラクル               | 300     | 3,960.00  | 1,188,000  |
|                     |       | シーエーシー               | 200     | 959.00    | 191,800    |
|                     |       | オービックビジネスコンサルタント     | 100     | 3,335.00  | 333,500    |
|                     |       | 伊藤忠テクノソリューションズ       | 200     | 4,080.00  | 816,000    |
|                     |       | アイティフォー              | 400     | 438.00    | 175,200    |
|                     |       | 大塚商会                 | 100     | 12,690.00 | 1,269,000  |
|                     |       | 電通国際情報サービス           | 100     | 1,105.00  | 110,500    |
|                     |       | ウェザーニューズ             | 100     | 2,164.00  | 216,400    |
|                     |       | WOWOW                | 100     | 3,425.00  | 342,500    |
|                     |       | ネットワンシステムズ           | 600     | 635.00    | 381,000    |
|                     |       | アルゴグラフィックス           | 100     | 1,665.00  | 166,500    |
|                     |       | マーベラスAQL             | 200     | 829.00    | 165,800    |
|                     |       | エイベックス・グループ・ホールディングス | 300     | 2,280.00  | 684,000    |
|                     |       | 日本ユニシス               | 300     | 876.00    | 262,800    |
|                     |       | 東京放送ホールディングス         | 700     | 1,278.00  | 894,600    |
|                     |       | 日本テレビホールディングス        | 1,400   | 1,826.00  | 2,556,400  |
|                     |       | テレビ朝日                | 400     | 2,300.00  | 920,000    |
|                     |       | スカパーJ S A Tホールディングス  | 1,200   | 548.00    | 657,600    |
|                     |       | テレビ東京ホールディングス        | 100     | 1,665.00  | 166,500    |
|                     |       | 日本電信電話               | 5,400   | 5,210.00  | 28,134,000 |
|                     |       | KDDI                 | 4,300   | 6,350.00  | 27,305,000 |
|                     |       | 光通信                  | 100     | 8,020.00  | 802,000    |
|                     |       | NTTドコモ               | 11,400  | 1,648.00  | 18,787,200 |
|                     |       | GMOインターネット           | 500     | 1,336.00  | 668,000    |
|                     |       | 学研ホールディングス           | 1,000   | 304.00    | 304,000    |
|                     |       | ゼンリン                 | 200     | 983.00    | 196,600    |
|                     |       | KADOKAWA             | 100     | 3,610.00  | 361,000    |
|                     |       | 松竹                   | 1,000   | 954.00    | 954,000    |
|                     |       | 東宝                   | 1,000   | 2,191.00  | 2,191,000  |
|                     |       | 東映                   | 1,000   | 597.00    | 597,000    |
|                     |       | エヌ・ティ・ティ・データ         | 1,000   | 3,615.00  | 3,615,000  |
|                     |       | DTS                  | 100     | 1,845.00  | 184,500    |
|                     |       | スクウェア・エニックス・ホールディングス | 500     | 1,845.00  | 922,500    |
|                     |       | カプコン                 | 400     | 1,951.00  | 780,400    |
|                     |       | ジャステック               | 200     | 774.00    | 154,800    |
|                     |       | SCSK                 | 300     | 2,574.00  | 772,200    |
|                     |       | TKC                  | 100     | 1,709.00  | 170,900    |
|                     |       | 富士ソフト                | 200     | 2,301.00  | 460,200    |
|                     |       | NSD                  | 300     | 1,219.00  | 365,700    |
|                     |       | コナミ                  | 600     | 2,522.00  | 1,513,200  |
|                     |       | ソフトバンク               | 6,800   | 8,900.00  | 60,520,000 |
|                     |       | 伊藤忠食品                | 100     | 3,305.00  | 330,500    |
|                     |       | エレマテック               | 100     | 1,703.00  | 170,300    |
|                     |       | 双日                   | 9,900   | 186.00    | 1,841,400  |
|                     |       | アルフレッサホールディングス       | 400     | 5,220.00  | 2,088,000  |
|                     |       | 横浜冷凍                 | 300     | 776.00    | 232,800    |
| アルコニックス             | 100   | 2,186.00             | 218,600 |           |            |
| あいホールディングス          | 200   | 1,290.00             | 258,000 |           |            |
| ダイワボウホールディングス       | 2,000 | 213.00               | 426,000 |           |            |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 300   | 701.00               | 210,300 |           |            |
| UKCホールディングス         | 100   | 1,694.00             | 169,400 |           |            |
| TOKAIホールディングス       | 800   | 343.00               | 274,400 |           |            |

| 種類 | 通貨  | 銘柄                | 株数     | 評価額単価    | 評価額金額      |
|----|-----|-------------------|--------|----------|------------|
| 株式 | 日本円 | シップヘルスケアホールディングス  | 200    | 4,200.00 | 840,000    |
|    |     | 小野建               | 200    | 1,384.00 | 276,800    |
|    |     | 伯東                | 300    | 1,027.00 | 308,100    |
|    |     | コンドーテック           | 300    | 702.00   | 210,600    |
|    |     | ナガイレーベン           | 200    | 1,649.00 | 329,800    |
|    |     | 三菱食品              | 200    | 2,547.00 | 509,400    |
|    |     | 松田産業              | 200    | 1,368.00 | 273,600    |
|    |     | メディカルホールディングス     | 1,400  | 1,356.00 | 1,898,400  |
|    |     | アドヴァン             | 200    | 1,200.00 | 240,000    |
|    |     | アズワン              | 200    | 2,342.00 | 468,400    |
|    |     | シモジマ              | 200    | 956.00   | 191,200    |
|    |     | ドウシシャ             | 200    | 1,448.00 | 289,600    |
|    |     | 黒田電気              | 300    | 1,545.00 | 463,500    |
|    |     | 丸文                | 400    | 513.00   | 205,200    |
|    |     | トーマンエレクトロニクス      | 200    | 1,167.00 | 233,400    |
|    |     | エクセル              | 100    | 1,187.00 | 118,700    |
|    |     | ガリバーインターナショナル     | 600    | 568.00   | 340,800    |
|    |     | 進和                | 200    | 1,157.00 | 231,400    |
|    |     | シークス              | 100    | 1,250.00 | 125,000    |
|    |     | マクニカ              | 100    | 2,788.00 | 278,800    |
|    |     | 伊藤忠商事             | 11,100 | 1,276.00 | 14,163,600 |
|    |     | 丸紅                | 12,000 | 724.00   | 8,688,000  |
|    |     | 高島                | 1,000  | 253.00   | 253,000    |
|    |     | 長瀬産業              | 700    | 1,238.00 | 866,600    |
|    |     | 蝶理                | 200    | 1,178.00 | 235,600    |
|    |     | 豊田通商              | 1,500  | 2,563.00 | 3,844,500  |
|    |     | 三共生興              | 600    | 343.00   | 205,800    |
|    |     | 兼松                | 3,000  | 159.00   | 477,000    |
|    |     | 三井物産              | 12,700 | 1,397.00 | 17,741,900 |
|    |     | 日立ハイテクノロジーズ       | 400    | 2,505.00 | 1,002,000  |
|    |     | カメイ               | 300    | 766.00   | 229,800    |
|    |     | 山善                | 600    | 621.00   | 372,600    |
|    |     | 住友商事              | 8,200  | 1,260.00 | 10,332,000 |
|    |     | 内田洋行              | 1,000  | 280.00   | 280,000    |
|    |     | 三菱商事              | 10,800 | 1,997.00 | 21,567,600 |
|    |     | キャノンマーケティングジャパン   | 400    | 1,506.00 | 602,400    |
|    |     | 西華産業              | 1,000  | 240.00   | 240,000    |
|    |     | 菱洋エレクトロ           | 200    | 1,053.00 | 210,600    |
|    |     | ユアサ商事             | 1,000  | 208.00   | 208,000    |
|    |     | 阪和興業              | 1,000  | 514.00   | 514,000    |
|    |     | 岩谷産業              | 2,000  | 539.00   | 1,078,000  |
|    |     | すてきなイスグループ        | 1,000  | 255.00   | 255,000    |
|    |     | 稲畑産業              | 400    | 1,136.00 | 454,400    |
|    |     | 東邦ホールディングス        | 400    | 1,717.00 | 686,800    |
|    |     | サンゲツ              | 200    | 2,554.00 | 510,800    |
|    |     | ミツウロコグループホールディングス | 300    | 542.00   | 162,600    |
|    |     | サンリオ              | 400    | 4,670.00 | 1,868,000  |
|    |     | リョーサン             | 200    | 2,134.00 | 426,800    |
|    |     | 新光商事              | 200    | 854.00   | 170,800    |
|    |     | 東陽テクニカ            | 200    | 1,084.00 | 216,800    |
|    |     | モスフードサービス         | 300    | 1,930.00 | 579,000    |
|    |     | 加賀電子              | 100    | 1,185.00 | 118,500    |
|    |     | 立花エレテック           | 100    | 1,190.00 | 119,000    |
|    |     | P a l t a c       | 200    | 1,333.00 | 266,600    |
|    |     | ヤマタネ              | 1,000  | 179.00   | 179,000    |
|    |     | 日鉄住金物産            | 1,000  | 378.00   | 378,000    |
|    |     | トラスコ中山            | 200    | 2,219.00 | 443,800    |



| 種類            | 通貨  | 銘柄                | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額      |
|---------------|-----|-------------------|-----------|-----------|------------|
| 株式            | 日本円 | オートボックスセブン        | 500       | 1,596.00  | 798,000    |
|               |     | 加藤産業              | 200       | 1,903.00  | 380,600    |
|               |     | イエローハット           | 100       | 1,991.00  | 199,100    |
|               |     | J Kホールディングス       | 400       | 564.00    | 225,600    |
|               |     | 日伝                | 100       | 2,236.00  | 223,600    |
|               |     | 因幡電機産業            | 200       | 3,075.00  | 615,000    |
|               |     | ミスミグループ本社         | 600       | 3,070.00  | 1,842,000  |
|               |     | スズケン              | 600       | 3,345.00  | 2,007,000  |
|               |     | ローソン              | 600       | 7,540.00  | 4,524,000  |
|               |     | サンエー              | 100       | 2,779.00  | 277,900    |
|               |     | カワチ薬品             | 100       | 1,862.00  | 186,200    |
|               |     | エービーシー・マート        | 200       | 4,630.00  | 926,000    |
|               |     | アスクル              | 100       | 3,395.00  | 339,500    |
|               |     | ゲオホールディングス        | 300       | 921.00    | 276,300    |
|               |     | アダストリアホールディングス    | 100       | 4,060.00  | 406,000    |
|               |     | くらコーポレーション        | 100       | 1,631.00  | 163,100    |
|               |     | パル                | 100       | 2,805.00  | 280,500    |
|               |     | エディオン             | 800       | 608.00    | 486,400    |
|               |     | アルペン              | 100       | 1,879.00  | 187,900    |
|               |     | ジェイアイエヌ           | 100       | 4,270.00  | 427,000    |
|               |     | ビックカメラ            | 5         | 52,800.00 | 264,000    |
|               |     | DCMホールディングス       | 700       | 687.00    | 480,900    |
|               |     | MonotaRO          | 200       | 2,053.00  | 410,600    |
|               |     | J .フロント リテイリング    | 3,000     | 780.00    | 2,340,000  |
|               |     | ドトール・日レスホールディングス  | 200       | 1,682.00  | 336,400    |
|               |     | マツモトキヨシホールディングス   | 300       | 3,240.00  | 972,000    |
|               |     | スタートトゥデイ          | 400       | 2,782.00  | 1,112,800  |
|               |     | ココカラファイン          | 100       | 2,718.00  | 271,800    |
|               |     | 三越伊勢丹ホールディングス     | 2,800     | 1,447.00  | 4,051,600  |
|               |     | ウエルシアホールディングス     | 100       | 5,240.00  | 524,000    |
|               |     | クリエイトSDホールディングス   | 100       | 3,785.00  | 378,500    |
|               |     | 丸善CHIホールディングス     | 200       | 309.00    | 61,800     |
|               |     | あさひ               | 100       | 1,522.00  | 152,200    |
|               |     | コスモス薬品            | 100       | 10,710.00 | 1,071,000  |
|               |     | セブン&アイ・ホールディングス   | 5,800     | 3,775.00  | 21,895,000 |
|               |     | ツルハホールディングス       | 100       | 9,150.00  | 915,000    |
|               |     | サンマルクホールディングス     | 100       | 4,920.00  | 492,000    |
|               |     | トリドール             | 200       | 962.00    | 192,400    |
|               |     | 総合メディカル           | 100       | 3,865.00  | 386,500    |
|               |     | カップ・クリエイトホールディングス | 100       | 1,895.00  | 189,500    |
|               |     | 良品計画              | 200       | 10,740.00 | 2,148,000  |
|               |     | 三城ホールディングス        | 100       | 459.00    | 45,900     |
|               |     | コナカ               | 200       | 910.00    | 182,000    |
|               |     | コーナン商事            | 400       | 1,057.00  | 422,800    |
|               |     | ワタミ               | 200       | 1,407.00  | 281,400    |
|               |     | ドンキホーテホールディングス    | 400       | 5,850.00  | 2,340,000  |
|               |     | 西松屋チェーン           | 300       | 802.00    | 240,600    |
|               |     | ゼンショーホールディングス     | 600       | 1,080.00  | 648,000    |
|               |     | サイゼリヤ             | 200       | 1,230.00  | 246,000    |
|               |     | ユナイテッドアローズ        | 200       | 4,160.00  | 832,000    |
|               |     | ハイデイ日高            | 100       | 2,080.00  | 208,000    |
|               |     | コロワイド             | 500       | 1,055.00  | 527,500    |
|               |     | スギホールディングス        | 300       | 4,070.00  | 1,221,000  |
| ヨンドシーホールディングス | 100 | 1,496.00          | 149,600   |           |            |
| ファミリーマート      | 500 | 4,570.00          | 2,285,000 |           |            |
| 木曽路           | 100 | 1,812.00          | 181,200   |           |            |
| サトレストランシステムズ  | 400 | 687.00            | 274,800   |           |            |

| 種類 | 通貨  | 銘柄                | 株数      | 評価額単価     | 評価額金額      |
|----|-----|-------------------|---------|-----------|------------|
| 株式 | 日本円 | 千趣会               | 300     | 882.00    | 264,600    |
|    |     | ケーヨー              | 400     | 460.00    | 184,000    |
|    |     | 日本瓦斯              | 200     | 1,029.00  | 205,800    |
|    |     | マルエツ              | 1,000   | 342.00    | 342,000    |
|    |     | ロイヤルホールディングス      | 300     | 1,560.00  | 468,000    |
|    |     | いなげや              | 300     | 989.00    | 296,700    |
|    |     | 島忠                | 300     | 2,342.00  | 702,600    |
|    |     | チヨダ               | 200     | 2,068.00  | 413,600    |
|    |     | ライフコーポレーション       | 100     | 1,600.00  | 160,000    |
|    |     | リンガーハット           | 200     | 1,479.00  | 295,800    |
|    |     | A O K Iホールディングス   | 100     | 3,365.00  | 336,500    |
|    |     | コメリ               | 200     | 2,698.00  | 539,600    |
|    |     | 青山商事              | 400     | 2,690.00  | 1,076,000  |
|    |     | しまむら              | 200     | 10,380.00 | 2,076,000  |
|    |     | 高島屋               | 2,000   | 987.00    | 1,974,000  |
|    |     | 松屋                | 300     | 1,090.00  | 327,000    |
|    |     | エイチ・ツー・オー リテイリング  | 1,000   | 853.00    | 853,000    |
|    |     | 近鉄百貨店             | 1,000   | 342.00    | 342,000    |
|    |     | ニッセンホールディングス      | 500     | 408.00    | 204,000    |
|    |     | パルコ               | 200     | 931.00    | 186,200    |
|    |     | 丸井グループ            | 1,800   | 1,021.00  | 1,837,800  |
|    |     | アクシアル リテイリング      | 100     | 1,545.00  | 154,500    |
|    |     | ダイエー              | 950     | 334.00    | 317,300    |
|    |     | イズミヤ              | 1,000   | 462.00    | 462,000    |
|    |     | イオン               | 5,400   | 1,387.00  | 7,489,800  |
|    |     | ユニーグループ・ホールディングス  | 1,400   | 658.00    | 921,200    |
|    |     | イズミ               | 300     | 3,105.00  | 931,500    |
|    |     | 平和堂               | 200     | 1,487.00  | 297,400    |
|    |     | フジ                | 200     | 1,755.00  | 351,000    |
|    |     | ヤオコー              | 100     | 4,185.00  | 418,500    |
|    |     | ゼビオ               | 200     | 2,028.00  | 405,600    |
|    |     | ケーズホールディングス       | 300     | 3,245.00  | 973,500    |
|    |     | アインファーマシーズ        | 100     | 4,990.00  | 499,000    |
|    |     | ヤマダ電機             | 5,500   | 355.00    | 1,952,500  |
|    |     | アークランドサカモト        | 100     | 1,698.00  | 169,800    |
|    |     | ニトリホールディングス       | 300     | 9,550.00  | 2,865,000  |
|    |     | 吉野家ホールディングス       | 500     | 1,215.00  | 607,500    |
|    |     | 関西スーパーマーケット       | 200     | 900.00    | 180,000    |
|    |     | 王将フードサービス         | 100     | 3,160.00  | 316,000    |
|    |     | プレナス              | 200     | 2,353.00  | 470,600    |
|    |     | ミニストップ            | 200     | 1,565.00  | 313,000    |
|    |     | アークス              | 200     | 1,932.00  | 386,400    |
|    |     | パロー               | 300     | 1,348.00  | 404,400    |
|    |     | ベルク               | 200     | 1,825.00  | 365,000    |
|    |     | ファーストリテイリング       | 300     | 38,150.00 | 11,445,000 |
|    |     | サンドラッグ            | 300     | 4,535.00  | 1,360,500  |
|    |     | 東京デリカ             | 100     | 1,437.00  | 143,700    |
|    |     | ベルーナ              | 500     | 497.00    | 248,500    |
|    |     | じもとホールディングス       | 1,100   | 206.00    | 226,600    |
|    |     | 新生銀行              | 12,000  | 249.00    | 2,988,000  |
|    |     | あおぞら銀行            | 7,000   | 289.00    | 2,023,000  |
|    |     | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 104,700 | 651.00    | 68,159,700 |
|    |     | りそなホールディングス       | 13,200  | 512.00    | 6,758,400  |
|    |     | 三井住友トラスト・ホールディングス | 27,000  | 509.00    | 13,743,000 |
|    |     | 三井住友フィナンシャルグループ   | 10,500  | 5,030.00  | 52,815,000 |
|    |     | 第四銀行              | 2,000   | 354.00    | 708,000    |
|    |     | 北越銀行              | 2,000   | 207.00    | 414,000    |

| 種類    | 通貨    | 銘柄              | 株数      | 評価額単価    | 評価額金額      |
|-------|-------|-----------------|---------|----------|------------|
| 株式    | 日本円   | 西日本シティ銀行        | 5,000   | 265.00   | 1,325,000  |
|       |       | 千葉銀行            | 5,000   | 700.00   | 3,500,000  |
|       |       | 横浜銀行            | 9,000   | 544.00   | 4,896,000  |
|       |       | 常陽銀行            | 5,000   | 519.00   | 2,595,000  |
|       |       | 群馬銀行            | 3,000   | 570.00   | 1,710,000  |
|       |       | 武蔵野銀行           | 200     | 3,445.00 | 689,000    |
|       |       | 千葉興業銀行          | 400     | 751.00   | 300,400    |
|       |       | 筑波銀行            | 700     | 357.00   | 249,900    |
|       |       | 東京都民銀行          | 300     | 1,071.00 | 321,300    |
|       |       | 七十七銀行           | 2,000   | 496.00   | 992,000    |
|       |       | 青森銀行            | 1,000   | 267.00   | 267,000    |
|       |       | 秋田銀行            | 1,000   | 277.00   | 277,000    |
|       |       | 山形銀行            | 1,000   | 437.00   | 437,000    |
|       |       | 岩手銀行            | 100     | 5,170.00 | 517,000    |
|       |       | 東邦銀行            | 1,000   | 314.00   | 314,000    |
|       |       | 東北銀行            | 2,000   | 146.00   | 292,000    |
|       |       | みちのく銀行          | 1,000   | 204.00   | 204,000    |
|       |       | ふくおかフィナンシャルグループ | 5,000   | 444.00   | 2,220,000  |
|       |       | 静岡銀行            | 4,000   | 1,132.00 | 4,528,000  |
|       |       | 十六銀行            | 2,000   | 373.00   | 746,000    |
|       |       | スルガ銀行           | 1,000   | 1,669.00 | 1,669,000  |
|       |       | 八十二銀行           | 3,000   | 599.00   | 1,797,000  |
|       |       | 山梨中央銀行          | 1,000   | 453.00   | 453,000    |
|       |       | 大垣共立銀行          | 2,000   | 278.00   | 556,000    |
|       |       | 福井銀行            | 1,000   | 241.00   | 241,000    |
|       |       | 北國銀行            | 1,000   | 356.00   | 356,000    |
|       |       | 清水銀行            | 100     | 2,763.00 | 276,300    |
|       |       | 滋賀銀行            | 1,000   | 535.00   | 535,000    |
|       |       | 南都銀行            | 1,000   | 388.00   | 388,000    |
|       |       | 百五銀行            | 1,000   | 409.00   | 409,000    |
|       |       | 京都銀行            | 3,000   | 845.00   | 2,535,000  |
|       |       | 紀陽銀行            | 600     | 1,395.00 | 837,000    |
|       |       | ほくほくフィナンシャルグループ | 9,000   | 204.00   | 1,836,000  |
|       |       | 広島銀行            | 4,000   | 417.00   | 1,668,000  |
|       |       | 山陰合同銀行          | 1,000   | 732.00   | 732,000    |
|       |       | 中国銀行            | 1,000   | 1,332.00 | 1,332,000  |
|       |       | 鳥取銀行            | 1,000   | 190.00   | 190,000    |
|       |       | 伊予銀行            | 1,500   | 1,017.00 | 1,525,500  |
|       |       | 百十四銀行           | 1,000   | 358.00   | 358,000    |
|       |       | 四国銀行            | 1,000   | 231.00   | 231,000    |
|       |       | 阿波銀行            | 1,000   | 511.00   | 511,000    |
|       |       | 鹿児島銀行           | 1,000   | 656.00   | 656,000    |
|       |       | 大分銀行            | 1,000   | 385.00   | 385,000    |
|       |       | 宮崎銀行            | 1,000   | 293.00   | 293,000    |
|       |       | 肥後銀行            | 1,000   | 560.00   | 560,000    |
|       |       | 佐賀銀行            | 2,000   | 224.00   | 448,000    |
|       |       | 十八銀行            | 1,000   | 237.00   | 237,000    |
|       |       | 沖縄銀行            | 100     | 3,820.00 | 382,000    |
|       |       | 琉球銀行            | 300     | 1,172.00 | 351,600    |
|       |       | 八千代銀行           | 100     | 2,671.00 | 267,100    |
|       |       | セブン銀行           | 5,300   | 379.00   | 2,008,700  |
|       |       | みずほフィナンシャルグループ  | 179,200 | 214.00   | 38,348,800 |
|       |       | 山口フィナンシャルグループ   | 1,000   | 928.00   | 928,000    |
| 長野銀行  | 1,000 | 179.00          | 179,000 |          |            |
| 名古屋銀行 | 1,000 | 343.00          | 343,000 |          |            |
| 北洋銀行  | 2,000 | 392.00          | 784,000 |          |            |
| 第三銀行  | 1,000 | 174.00          | 174,000 |          |            |

| 種類             | 通貨    | 銘柄                       | 株数        | 評価額単価    | 評価額金額      |
|----------------|-------|--------------------------|-----------|----------|------------|
| 株式             | 日本円   | 中京銀行                     | 1,000     | 176.00   | 176,000    |
|                |       | 愛媛銀行                     | 1,000     | 227.00   | 227,000    |
|                |       | 京葉銀行                     | 1,000     | 494.00   | 494,000    |
|                |       | 関西アーバン銀行                 | 2,000     | 118.00   | 236,000    |
|                |       | 栃木銀行                     | 1,000     | 399.00   | 399,000    |
|                |       | 北日本銀行                    | 100       | 2,532.00 | 253,200    |
|                |       | 東和銀行                     | 2,000     | 92.00    | 184,000    |
|                |       | 福島銀行                     | 2,000     | 87.00    | 174,000    |
|                |       | トモニホールディングス              | 1,200     | 400.00   | 480,000    |
|                |       | フィデアホールディングス             | 1,100     | 197.00   | 216,700    |
|                |       | 池田泉州ホールディングス             | 1,100     | 474.00   | 521,400    |
|                |       | S B Iホールディングス            | 1,700     | 1,499.00 | 2,548,300  |
|                |       | ジャフコ                     | 200       | 5,730.00 | 1,146,000  |
|                |       | 大和証券グループ本社               | 14,000    | 989.00   | 13,846,000 |
|                |       | 野村ホールディングス               | 28,400    | 787.00   | 22,350,800 |
|                |       | 岡三証券グループ                 | 1,000     | 957.00   | 957,000    |
|                |       | 丸三証券                     | 600       | 856.00   | 513,600    |
|                |       | 東洋証券                     | 1,000     | 353.00   | 353,000    |
|                |       | 東海東京フィナンシャル・ホールディングス     | 1,600     | 922.00   | 1,475,200  |
|                |       | 水戸証券                     | 1,000     | 493.00   | 493,000    |
|                |       | いちよし証券                   | 300       | 1,557.00 | 467,100    |
|                |       | 松井証券                     | 700       | 1,189.00 | 832,300    |
|                |       | マネックスグループ                | 1,800     | 419.00   | 754,200    |
|                |       | カブドットコム証券                | 600       | 568.00   | 340,800    |
|                |       | 極東証券                     | 200       | 1,909.00 | 381,800    |
|                |       | 岩井コスモホールディングス            | 200       | 1,402.00 | 280,400    |
|                |       | N K S Jホールディングス          | 3,100     | 2,853.00 | 8,844,300  |
|                |       | M S & A Dインシュアランスグループホール | 4,100     | 2,725.00 | 11,172,500 |
|                |       | ソニーフィナンシャルホールディングス       | 1,300     | 1,867.00 | 2,427,100  |
|                |       | 第一生命保険                   | 7,000     | 1,608.00 | 11,256,000 |
|                |       | 東京海上ホールディングス             | 5,400     | 3,365.00 | 18,171,000 |
|                |       | T & Dホールディングス            | 4,800     | 1,371.00 | 6,580,800  |
|                |       | 全国保証                     | 200       | 4,690.00 | 938,000    |
|                |       | クレディセゾン                  | 1,100     | 2,815.00 | 3,096,500  |
|                |       | 芙蓉総合リース                  | 200       | 4,115.00 | 823,000    |
|                |       | 興銀リース                    | 300       | 3,015.00 | 904,500    |
|                |       | 東京センチュリーリース              | 300       | 3,495.00 | 1,048,500  |
|                |       | 日本証券金融                   | 700       | 779.00   | 545,300    |
|                |       | アイフル                     | 2,500     | 447.00   | 1,117,500  |
|                |       | ポケットカード                  | 200       | 876.00   | 175,200    |
|                |       | リコーリース                   | 100       | 3,090.00 | 309,000    |
|                |       | イオンフィナンシャルサービス           | 800       | 2,697.00 | 2,157,600  |
|                |       | アコム                      | 3,000     | 369.00   | 1,107,000  |
|                |       | ジャックス                    | 1,000     | 467.00   | 467,000    |
|                |       | オリエントコーポレーション            | 3,000     | 247.00   | 741,000    |
|                |       | 日立キャピタル                  | 300       | 2,917.00 | 875,100    |
|                |       | オリックス                    | 8,500     | 1,859.00 | 15,801,500 |
|                |       | 三菱UFJリース                 | 3,600     | 625.00   | 2,250,000  |
|                |       | 日本取引所グループ                | 2,000     | 2,901.00 | 5,802,000  |
|                |       | N E Cキャピタルソリューション        | 100       | 2,977.00 | 297,700    |
|                |       | 日本駐車場開発                  | 28        | 7,600.00 | 212,800    |
|                |       | ヒューリック                   | 2,300     | 1,732.00 | 3,983,600  |
|                |       | 野村不動産ホールディングス            | 900       | 2,307.00 | 2,076,300  |
| 常和ホールディングス     | 100   | 2,799.00                 | 279,900   |          |            |
| フージャースホールディングス | 300   | 727.00                   | 218,100   |          |            |
| オープンハウス        | 100   | 2,492.00                 | 249,200   |          |            |
| 東急不動産ホールディングス  | 3,100 | 922.00                   | 2,858,200 |          |            |

| 種類           | 通貨  | 銘柄             | 株数      | 評価額単価      | 評価額金額      |
|--------------|-----|----------------|---------|------------|------------|
| 株式           | 日本円 | 飯田グループホールディングス | 600     | 1,949.00   | 1,169,400  |
|              |     | パーク24          | 800     | 1,926.00   | 1,540,800  |
|              |     | 三井不動産          | 7,000   | 3,415.00   | 23,905,000 |
|              |     | 三菱地所           | 10,000  | 2,808.00   | 28,080,000 |
|              |     | 平和不動産          | 300     | 1,730.00   | 519,000    |
|              |     | 東京建物           | 3,000   | 1,023.00   | 3,069,000  |
|              |     | ダイビル           | 500     | 1,173.00   | 586,500    |
|              |     | 京阪神ビルディング      | 400     | 540.00     | 216,000    |
|              |     | 住友不動産          | 3,000   | 4,750.00   | 14,250,000 |
|              |     | 大京             | 2,000   | 275.00     | 550,000    |
|              |     | テーオーシー         | 500     | 784.00     | 392,000    |
|              |     | レオパレス21        | 1,400   | 564.00     | 789,600    |
|              |     | フジ住宅           | 300     | 669.00     | 200,700    |
|              |     | 空港施設           | 200     | 838.00     | 167,600    |
|              |     | 住友不動産販売        | 100     | 3,115.00   | 311,500    |
|              |     | ゴールドクレスト       | 100     | 2,574.00   | 257,400    |
|              |     | 日神不動産          | 400     | 391.00     | 156,400    |
|              |     | タカラレーベン        | 800     | 353.00     | 282,400    |
|              |     | サンヨーハウジング名古屋   | 100     | 1,189.00   | 118,900    |
|              |     | イオンモール         | 900     | 2,849.00   | 2,564,100  |
|              |     | トーセイ           | 200     | 773.00     | 154,600    |
|              |     | エヌ・ティ・ティ都市開発   | 800     | 1,117.00   | 893,600    |
|              |     | サンフロンティア不動産    | 100     | 1,407.00   | 140,700    |
|              |     | 日本空港ビルデング      | 500     | 2,228.00   | 1,114,000  |
|              |     | 日本工営           | 1,000   | 420.00     | 420,000    |
|              |     | 日本M&Aセンター      | 100     | 6,700.00   | 670,000    |
|              |     | アコーディア・ゴルフ     | 700     | 1,238.00   | 866,600    |
|              |     | タケエイ           | 100     | 1,259.00   | 125,900    |
|              |     | エス・エム・エス       | 100     | 2,249.00   | 224,900    |
|              |     | テンプホールディングス    | 300     | 2,711.00   | 813,300    |
|              |     | クックパッド         | 100     | 3,225.00   | 322,500    |
|              |     | スタジオアリス        | 100     | 1,417.00   | 141,700    |
|              |     | NECフィールディング    | 100     | 1,156.00   | 115,600    |
|              |     | 総合警備保障         | 500     | 1,989.00   | 994,500    |
|              |     | カカクコム          | 900     | 1,853.00   | 1,667,700  |
|              |     | 新日本科学          | 100     | 1,353.00   | 135,300    |
|              |     | ツクイ            | 200     | 899.00     | 179,800    |
|              |     | エムスリー          | 5       | 259,100.00 | 1,295,500  |
|              |     | ディー・エヌ・エー      | 800     | 2,417.00   | 1,933,600  |
|              |     | 博報堂DYホールディングス  | 2,000   | 808.00     | 1,616,000  |
|              |     | ぐるなび           | 100     | 3,180.00   | 318,000    |
|              |     | 一休             | 1       | 146,400.00 | 146,400    |
|              |     | PGMホールディングス    | 200     | 1,010.00   | 202,000    |
|              |     | バリューコマース       | 100     | 1,420.00   | 142,000    |
|              |     | J Pホールディングス    | 400     | 418.00     | 167,200    |
|              |     | イーピーエス         | 2       | 115,700.00 | 231,400    |
|              |     | ケネディクス         | 1,900   | 511.00     | 970,900    |
|              |     | 電通             | 1,400   | 4,310.00   | 6,034,000  |
|              |     | テイクアンドギヴ・ニーズ   | 100     | 2,284.00   | 228,400    |
|              |     | みらかホールディングス    | 400     | 4,775.00   | 1,910,000  |
|              |     | サニックス          | 200     | 1,065.00   | 213,000    |
|              |     | オリエンタルランド      | 400     | 14,920.00  | 5,968,000  |
|              |     | ダスキン           | 500     | 1,907.00   | 953,500    |
| 明光ネットワークジャパン | 100 | 1,082.00       | 108,200 |            |            |
| ラウンドワン       | 500 | 882.00         | 441,000 |            |            |
| リゾートトラスト     | 200 | 3,825.00       | 765,000 |            |            |
| ビー・エム・エル     | 100 | 3,405.00       | 340,500 |            |            |

| 種類    | 通貨  | 銘柄           | 株数      | 評価額単価    | 評価額金額         |
|-------|-----|--------------|---------|----------|---------------|
| 株式    | 日本円 | もしもしホットライン   | 300     | 1,117.00 | 335,100       |
|       |     | ユー・エス・エス     | 1,800   | 1,379.00 | 2,482,200     |
|       |     | セントラルスポーツ    | 200     | 1,502.00 | 300,400       |
|       |     | リロ・ホールディング   | 100     | 5,000.00 | 500,000       |
|       |     | エイチ・アイ・エス    | 100     | 5,620.00 | 562,000       |
|       |     | 共立メンテナンス     | 100     | 3,775.00 | 377,500       |
|       |     | イチネンホールディングス | 300     | 755.00   | 226,500       |
|       |     | 建設技術研究所      | 300     | 968.00   | 290,400       |
|       |     | 東京都競馬        | 1,000   | 403.00   | 403,000       |
|       |     | 東京ドーム        | 1,000   | 703.00   | 703,000       |
|       |     | 西尾レントオール     | 100     | 2,529.00 | 252,900       |
|       |     | トランス・コスモス    | 200     | 1,951.00 | 390,200       |
|       |     | 乃村工藝社        | 300     | 863.00   | 258,900       |
|       |     | 藤田観光         | 1,000   | 401.00   | 401,000       |
|       |     | 日本管財         | 100     | 1,956.00 | 195,600       |
|       |     | セコム          | 1,500   | 6,090.00 | 9,135,000     |
|       |     | メイテック        | 200     | 2,805.00 | 561,000       |
|       |     | アサツー ディ・ケイ   | 300     | 2,386.00 | 715,800       |
|       |     | 応用地質         | 200     | 1,616.00 | 323,200       |
|       |     | ベネッセホールディングス | 500     | 3,900.00 | 1,950,000     |
|       |     | イオンディライト     | 200     | 2,077.00 | 415,400       |
| ニチイ学館 | 300 | 858.00       | 257,400 |          |               |
| ダイセキ  | 300 | 1,952.00     | 585,600 |          |               |
| 小計    |     |              |         |          | 2,485,780,700 |
|       |     | 銘柄数：         | 1,101   |          |               |
|       |     | 組入時価比率：      | 97.2%   |          | 100.0%        |
| 合計    |     |              |         |          | 2,485,780,700 |

（注）比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

#### 株式以外の有価証券

（平成25年12月10日現在）

| 種類          | 通貨  | 銘柄            | 銘柄数比率 | 券面総額 | 評価額     |
|-------------|-----|---------------|-------|------|---------|
| 新株予約<br>権証券 | 日本円 | 日医工株式会社 新株予約権 |       | 300  | 135,000 |
|             | 小計  |               |       | 300  | 135,000 |
|             |     | 銘柄数：          | 1     |      |         |
|             |     | 組入時価比率：       | 0.0%  |      | 100.0%  |
| 合計          |     |               |       |      | 135,000 |

（注）比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 「PRU国内債券マザーファンド」の状況

なお、以下に掲載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

(単位：円)

| 区 分         | 注記<br>番号 | (平成24年12月10日現在) | (平成25年12月10日現在) |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
|             |          | 金 額             | 金 額             |
| 資産の部        |          |                 |                 |
| 流動資産        |          |                 |                 |
| コール・ローン     |          | 21,525,542      | 28,380,483      |
| 国債証券        |          | 2,599,964,300   | 3,171,426,650   |
| 地方債証券       |          | 274,057,591     | 277,773,493     |
| 特殊債券        |          | 206,198,030     | 247,497,460     |
| 社債券         |          | 147,091,570     | 79,806,800      |
| 未収利息        |          | 13,946,876      | 15,174,089      |
| 前払費用        |          | 434,289         | 529,689         |
| 流動資産合計      |          | 3,263,218,198   | 3,820,588,664   |
| 資産合計        |          | 3,263,218,198   | 3,820,588,664   |
| 負債の部        |          |                 |                 |
| 流動負債        |          |                 |                 |
| 未払解約金       |          | 3,465,072       | 5,379,532       |
| 流動負債合計      |          | 3,465,072       | 5,379,532       |
| 負債合計        |          | 3,465,072       | 5,379,532       |
| 純資産の部       |          |                 |                 |
| 元本等         |          |                 |                 |
| 元本          | 1        | 2,682,632,676   | 3,088,649,837   |
| 剰余金         |          |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金( ) |          | 577,120,450     | 726,559,295     |
| 元本等合計       |          | 3,259,753,126   | 3,815,209,132   |
| 純資産合計       |          | 3,259,753,126   | 3,815,209,132   |
| 負債純資産合計     |          | 3,263,218,198   | 3,820,588,664   |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                 |  |
|-----------------|--|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券<br>個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、または価格情報会社の提供する価額に基づいて評価しております。 |
|-----------------|--|



## （貸借対照表に関する注記）

| （平成24年12月10日現在） |   | （平成25年12月10日現在） |   |
|-----------------|---|-----------------|---|
| 1               | 1 . 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額    | 1               | 1 . 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額    |
|                 | 2,534,463,297円                            |                 | 2,682,632,676円                            |
|                 | 同期中における追加設定元本額                            |                 | 同期中における追加設定元本額                            |
|                 | 539,366,715円                              |                 | 971,964,499円                              |
|                 | 同期中における解約元本額                              |                 | 同期中における解約元本額                              |
|                 | 391,197,336円                              |                 | 565,947,338円                              |
|                 | 同期末における元本の内訳                              |                 | 同期末における元本の内訳                              |
|                 | PRU国内債券マーケット・パフォーマー                       |                 | PRU国内債券マーケット・パフォーマー                       |
|                 | 520,124,599円                              |                 | 528,578,849円                              |
|                 | PRUグッドライフ2020                             |                 | PRUグッドライフ2020                             |
|                 | 22,360,513円                               |                 | 18,647,887円                               |
|                 | PRUグッドライフ2030                             |                 | PRUグッドライフ2030                             |
|                 | 7,343,582円                                |                 | 7,966,805円                                |
|                 | PRUグッドライフ2040                             |                 | PRUグッドライフ2040                             |
|                 | 9,101,314円                                |                 | 11,227,359円                               |
|                 | PRUグッドライフ2020（年金）                         |                 | PRUグッドライフ2020（年金）                         |
|                 | 906,878,175円                              |                 | 1,006,960,991円                            |
|                 | PRUグッドライフ2030（年金）                         |                 | PRUグッドライフ2030（年金）                         |
|                 | 718,068,008円                              |                 | 931,645,754円                              |
|                 | PRUグッドライフ2040（年金）                         |                 | PRUグッドライフ2040（年金）                         |
|                 | 290,643,684円                              |                 | 422,098,099円                              |
|                 | PRUグッドライフ2050（年金）                         |                 | PRUグッドライフ2050（年金）                         |
|                 | 3,341,478円                                |                 | 8,913,535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）       |                 | 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）       |
|                 | 22,886,782円                               |                 | 18,647,919円                               |
|                 | ブルデンシャル私募国内債券マーケット・パフォーマー（適格機関投資家向け）      |                 | ブルデンシャル私募国内債券マーケット・パフォーマー（適格機関投資家向け）      |
|                 | 181,884,541円                              |                 | 133,962,639円                              |
|                 | 計 2,682,632,676円                          |                 | 計 3,088,649,837円                          |
|                 | 2 . 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の受益権の総数 |                 | 2 . 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の受益権の総数 |
|                 | 2,682,632,676円                            |                 | 3,088,649,837円                            |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

| 項目                      | 自 平成23年12月13日<br>至 平成24年12月10日   | 自 平成24年12月11日<br>至 平成25年12月10日 |
|-------------------------|--|--------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を投資信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。   | 同左                             |
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じて価格変動リスクや為替変動リスク等があります。 | 同左                             |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | コンプライアンス部では、運用状況のモニタリング、運用に関する法令諸規則の遵守状況の確認を行っております。<br>また、業務統括部では、運用に関するリスク管理を行っております。  | 同左                             |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                        | （平成24年12月10日現在）  | （平成25年12月10日現在）  |
|---------------------------|--|--|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。  | 同左   |
| 2.時価の算定方法                 | <p>有価証券<br/>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引等<br/>該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品<br/>短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> | <p>有価証券<br/>同左</p> <p>デリバティブ取引等<br/>同左</p> <p>上記以外の金融商品<br/>同左</p> |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価格のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。  | 同左   |

（有価証券に関する注記）

（平成24年12月10日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

| 種類    | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
|-------|-----------------|
| 国債証券  | 4,519,400       |
| 地方債証券 | 140,879         |
| 特殊債券  | 90,730          |
| 社債券   | 15,900          |
| 合計    | 4,766,909       |

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本報告書の開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（平成25年12月10日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

| 種類    | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
|-------|-----------------|
| 国債証券  | 5,844,500       |
| 地方債証券 | 243,308         |
| 特殊債券  | 125,740         |
| 社債券   | 43,000          |
| 合計    | 6,256,548       |

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本報告書の開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

| （平成24年12月10日現在）                          |          | （平成25年12月10日現在）                          |          |
|--|----------|--|----------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 |          | 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 |          |
|  | 1.2151円  |  | 1.2352円  |
| （1万口当たり純資産額                              | 12,151円） | （1万口当たり純資産額                              | 12,352円） |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株式（平成25年12月10日現在）

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

（平成25年12月10日現在）

| 種類             | 通貨  | 銘柄            | 銘柄数比率      | 券面総額       | 評価額        |
|----------------|-----|---------------|------------|------------|------------|
| 国債証券           | 日本円 | 第326回利付国債（2年） |            | 10,000,000 | 10,002,500 |
|                |     | 第328回利付国債（2年） |            | 10,000,000 | 10,002,800 |
|                |     | 第329回利付国債（2年） |            | 15,000,000 | 15,027,000 |
|                |     | 第330回利付国債（2年） |            | 10,000,000 | 10,018,200 |
|                |     | 第331回利付国債（2年） |            | 15,000,000 | 15,003,750 |
|                |     | 第332回利付国債（2年） |            | 20,000,000 | 20,005,200 |
|                |     | 第334回利付国債（2年） |            | 20,000,000 | 20,005,600 |
|                |     | 第88回利付国債（5年）  |            | 30,000,000 | 30,159,600 |
|                |     | 第89回利付国債（5年）  |            | 20,000,000 | 20,097,000 |
|                |     | 第90回利付国債（5年）  |            | 10,000,000 | 10,033,400 |
|                |     | 第91回利付国債（5年）  |            | 20,000,000 | 20,111,400 |
|                |     | 第92回利付国債（5年）  |            | 20,000,000 | 20,076,000 |
|                |     | 第93回利付国債（5年）  |            | 20,000,000 | 20,165,400 |
|                |     | 第94回利付国債（5年）  |            | 10,000,000 | 10,102,900 |
|                |     | 第95回利付国債（5年）  |            | 10,000,000 | 10,114,300 |
|                |     | 第96回利付国債（5年）  |            | 10,000,000 | 10,091,600 |
|                |     | 第97回利付国債（5年）  |            | 20,000,000 | 20,150,800 |
|                |     | 第98回利付国債（5年）  |            | 10,000,000 | 10,050,200 |
|                |     | 第99回利付国債（5年）  |            | 20,000,000 | 20,163,000 |
|                |     | 第100回利付国債（5年） |            | 10,000,000 | 10,053,900 |
|                |     | 第101回利付国債（5年） |            | 20,000,000 | 20,171,600 |
|                |     | 第102回利付国債（5年） |            | 30,000,000 | 30,167,100 |
|                |     | 第103回利付国債（5年） |            | 30,000,000 | 30,170,700 |
|                |     | 第104回利付国債（5年） |            | 20,000,000 | 20,048,800 |
|                |     | 第105回利付国債（5年） |            | 30,000,000 | 30,068,100 |
|                |     | 第106回利付国債（5年） |            | 35,000,000 | 35,065,450 |
|                |     | 第107回利付国債（5年） |            | 30,000,000 | 30,047,700 |
|                |     | 第108回利付国債（5年） |            | 15,000,000 | 14,964,000 |
|                |     | 第109回利付国債（5年） |            | 20,000,000 | 19,936,400 |
|                |     | 第110回利付国債（5年） |            | 15,000,000 | 15,079,350 |
|                |     | 第111回利付国債（5年） |            | 25,000,000 | 25,238,250 |
|                |     | 第112回利付国債（5年） |            | 30,000,000 | 30,288,900 |
|                |     | 第113回利付国債（5年） |            | 30,000,000 | 30,154,500 |
|                |     | 第114回利付国債（5年） |            | 15,000,000 | 15,074,400 |
| 第115回利付国債（5年）  |     | 30,000,000    | 30,006,900 |            |            |
| 第2回利付国債（40年）   |     | 10,000,000    | 11,201,200 |            |            |
| 第3回利付国債（40年）   |     | 5,000,000     | 5,598,550  |            |            |
| 第4回利付国債（40年）   |     | 10,000,000    | 11,204,600 |            |            |
| 第5回利付国債（40年）   |     | 10,000,000    | 10,646,100 |            |            |
| 第6回利付国債（40年）   |     | 5,000,000     | 5,174,550  |            |            |
| 第268回利付国債（10年） |     | 10,000,000    | 10,179,900 |            |            |
| 第269回利付国債（10年） |     | 10,000,000    | 10,154,500 |            |            |
| 第270回利付国債（10年） |     | 10,000,000    | 10,185,200 |            |            |
| 第271回利付国債（10年） |     | 20,000,000    | 20,340,000 |            |            |
| 第272回利付国債（10年） |     | 10,000,000    | 10,232,700 |            |            |

| 種類 | 通貨 | 銘柄             | 銘柄数比率 | 券面総額       | 評価額        |
|----|----|----------------|-------|------------|------------|
|    |    | 第273回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 20,500,800 |
|    |    | 第274回利付国債（10年） |       | 15,000,000 | 15,428,400 |
|    |    | 第275回利付国債（10年） |       | 30,000,000 | 30,796,200 |
|    |    | 第276回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 20,611,400 |
|    |    | 第278回利付国債（10年） |       | 30,000,000 | 31,157,700 |
|    |    | 第279回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 20,862,400 |
|    |    | 第280回利付国債（10年） |       | 10,000,000 | 10,452,500 |
|    |    | 第281回利付国債（10年） |       | 15,000,000 | 15,716,550 |
|    |    | 第282回利付国債（10年） |       | 30,000,000 | 31,322,700 |
|    |    | 第283回利付国債（10年） |       | 10,000,000 | 10,468,500 |
|    |    | 第284回利付国債（10年） |       | 30,000,000 | 31,431,900 |
|    |    | 第285回利付国債（10年） |       | 30,000,000 | 31,543,200 |
|    |    | 第286回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 21,170,400 |
|    |    | 第287回利付国債（10年） |       | 10,000,000 | 10,620,200 |
|    |    | 第288回利付国債（10年） |       | 25,000,000 | 26,458,500 |
|    |    | 第289回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 21,070,800 |
|    |    | 第290回利付国債（10年） |       | 10,000,000 | 10,521,200 |
|    |    | 第291回利付国債（10年） |       | 10,000,000 | 10,478,800 |
|    |    | 第292回利付国債（10年） |       | 10,000,000 | 10,648,300 |
|    |    | 第293回利付国債（10年） |       | 10,000,000 | 10,726,400 |
|    |    | 第294回利付国債（10年） |       | 10,000,000 | 10,681,500 |
|    |    | 第295回利付国債（10年） |       | 10,000,000 | 10,591,800 |
|    |    | 第296回利付国債（10年） |       | 30,000,000 | 31,866,300 |
|    |    | 第297回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 21,188,000 |
|    |    | 第298回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 21,088,400 |
|    |    | 第299回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 21,130,400 |
|    |    | 第300回利付国債（10年） |       | 10,000,000 | 10,669,400 |
|    |    | 第301回利付国債（10年） |       | 30,000,000 | 32,076,900 |
|    |    | 第302回利付国債（10年） |       | 15,000,000 | 15,956,700 |
|    |    | 第303回利付国債（10年） |       | 30,000,000 | 31,963,200 |
|    |    | 第304回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 21,195,000 |
|    |    | 第305回利付国債（10年） |       | 30,000,000 | 31,821,300 |
|    |    | 第306回利付国債（10年） |       | 30,000,000 | 32,020,500 |
|    |    | 第307回利付国債（10年） |       | 15,000,000 | 15,918,000 |
|    |    | 第308回利付国債（10年） |       | 15,000,000 | 15,923,550 |
|    |    | 第309回利付国債（10年） |       | 30,000,000 | 31,464,300 |
|    |    | 第310回利付国債（10年） |       | 25,000,000 | 26,040,500 |
|    |    | 第311回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 20,568,200 |
|    |    | 第312回利付国債（10年） |       | 40,000,000 | 42,200,000 |
|    |    | 第313回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 21,233,800 |
|    |    | 第314回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 20,951,800 |
|    |    | 第315回利付国債（10年） |       | 30,000,000 | 31,625,100 |
|    |    | 第316回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 20,938,000 |
|    |    | 第317回利付国債（10年） |       | 10,000,000 | 10,464,500 |
|    |    | 第318回利付国債（10年） |       | 40,000,000 | 41,558,400 |
|    |    | 第319回利付国債（10年） |       | 15,000,000 | 15,694,050 |
|    |    | 第320回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 20,771,200 |
|    |    | 第321回利付国債（10年） |       | 10,000,000 | 10,380,500 |
|    |    | 第322回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 20,594,200 |
|    |    | 第323回利付国債（10年） |       | 10,000,000 | 10,289,000 |
|    |    | 第324回利付国債（10年） |       | 25,000,000 | 25,519,000 |
|    |    | 第325回利付国債（10年） |       | 35,000,000 | 35,672,350 |
|    |    | 第326回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 20,188,400 |
|    |    | 第327回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 20,359,600 |

| 種類 | 通貨 | 銘柄             | 銘柄数比率 | 券面総額       | 評価額        |
|----|----|----------------|-------|------------|------------|
|    |    | 第328回利付国債（10年） |       | 20,000,000 | 19,982,400 |
|    |    | 第329回利付国債（10年） |       | 40,000,000 | 40,628,800 |
|    |    | 第330回利付国債（10年） |       | 35,000,000 | 35,482,300 |
|    |    | 第331回利付国債（10年） |       | 30,000,000 | 29,862,000 |
|    |    | 第6回利付国債（30年）   |       | 10,000,000 | 11,608,600 |
|    |    | 第8回利付国債（30年）   |       | 10,000,000 | 10,535,800 |
|    |    | 第10回利付国債（30年）  |       | 5,000,000  | 4,666,150  |
|    |    | 第13回利付国債（30年）  |       | 10,000,000 | 10,769,800 |
|    |    | 第15回利付国債（30年）  |       | 5,000,000  | 5,807,300  |
|    |    | 第17回利付国債（30年）  |       | 10,000,000 | 11,438,400 |
|    |    | 第18回利付国債（30年）  |       | 5,000,000  | 5,631,350  |
|    |    | 第20回利付国債（30年）  |       | 5,000,000  | 5,815,850  |
|    |    | 第21回利付国債（30年）  |       | 5,000,000  | 5,634,150  |
|    |    | 第22回利付国債（30年）  |       | 5,000,000  | 5,820,050  |
|    |    | 第23回利付国債（30年）  |       | 5,000,000  | 5,822,050  |
|    |    | 第25回利付国債（30年）  |       | 10,000,000 | 11,272,500 |
|    |    | 第26回利付国債（30年）  |       | 10,000,000 | 11,473,100 |
|    |    | 第27回利付国債（30年）  |       | 5,000,000  | 5,845,450  |
|    |    | 第28回利付国債（30年）  |       | 10,000,000 | 11,706,200 |
|    |    | 第29回利付国債（30年）  |       | 10,000,000 | 11,521,400 |
|    |    | 第30回利付国債（30年）  |       | 15,000,000 | 16,996,350 |
|    |    | 第31回利付国債（30年）  |       | 10,000,000 | 11,135,500 |
|    |    | 第32回利付国債（30年）  |       | 10,000,000 | 11,347,100 |
|    |    | 第33回利付国債（30年）  |       | 20,000,000 | 21,419,000 |
|    |    | 第34回利付国債（30年）  |       | 10,000,000 | 11,139,100 |
|    |    | 第35回利付国債（30年）  |       | 15,000,000 | 16,060,950 |
|    |    | 第36回利付国債（30年）  |       | 15,000,000 | 16,058,400 |
|    |    | 第37回利付国債（30年）  |       | 15,000,000 | 15,716,250 |
|    |    | 第38回利付国債（30年）  |       | 10,000,000 | 10,245,500 |
|    |    | 第39回利付国債（30年）  |       | 10,000,000 | 10,475,400 |
|    |    | 第40回利付国債（30年）  |       | 10,000,000 | 10,238,100 |
|    |    | 第33回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,023,000 |
|    |    | 第46回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,198,200 |
|    |    | 第49回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,193,700 |
|    |    | 第55回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,186,900 |
|    |    | 第60回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 10,712,100 |
|    |    | 第61回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 10,351,200 |
|    |    | 第63回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,075,700 |
|    |    | 第66回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,102,900 |
|    |    | 第68回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,514,100 |
|    |    | 第70回利付国債（20年）  |       | 20,000,000 | 23,481,000 |
|    |    | 第72回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,454,000 |
|    |    | 第75回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,480,200 |
|    |    | 第76回利付国債（20年）  |       | 5,000,000  | 5,632,550  |
|    |    | 第78回利付国債（20年）  |       | 5,000,000  | 5,636,600  |
|    |    | 第79回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,379,800 |
|    |    | 第82回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,497,600 |
|    |    | 第84回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,391,000 |
|    |    | 第85回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,510,200 |
|    |    | 第86回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,747,900 |
|    |    | 第88回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,747,100 |
|    |    | 第90回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,629,100 |
|    |    | 第91回利付国債（20年）  |       | 10,000,000 | 11,751,800 |
|    |    | 第92回利付国債（20年）  |       | 5,000,000  | 5,752,950  |

| 種類    | 通貨  | 銘柄             | 銘柄数比率 | 券面総額          | 評価額           |
|-------|-----|----------------|-------|---------------|---------------|
|       |     | 第93回利付国債（20年）  |       | 10,000,000    | 11,371,200    |
|       |     | 第94回利付国債（20年）  |       | 15,000,000    | 17,245,950    |
|       |     | 第96回利付国債（20年）  |       | 20,000,000    | 22,962,000    |
|       |     | 第99回利付国債（20年）  |       | 10,000,000    | 11,458,400    |
|       |     | 第100回利付国債（20年） |       | 20,000,000    | 23,155,800    |
|       |     | 第101回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 11,844,200    |
|       |     | 第102回利付国債（20年） |       | 20,000,000    | 23,670,200    |
|       |     | 第105回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 11,415,800    |
|       |     | 第106回利付国債（20年） |       | 5,000,000     | 5,775,950     |
|       |     | 第107回利付国債（20年） |       | 5,000,000     | 5,699,650     |
|       |     | 第108回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 11,124,500    |
|       |     | 第109回利付国債（20年） |       | 5,000,000     | 5,551,900     |
|       |     | 第110回利付国債（20年） |       | 5,000,000     | 5,690,800     |
|       |     | 第111回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 11,504,000    |
|       |     | 第112回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 11,363,300    |
|       |     | 第113回利付国債（20年） |       | 15,000,000    | 17,016,000    |
|       |     | 第114回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 11,331,200    |
|       |     | 第115回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 11,474,800    |
|       |     | 第116回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 11,454,600    |
|       |     | 第117回利付国債（20年） |       | 15,000,000    | 16,964,400    |
|       |     | 第118回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 11,133,600    |
|       |     | 第119回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 10,834,700    |
|       |     | 第120回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 10,536,900    |
|       |     | 第121回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 10,954,400    |
|       |     | 第122回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 10,807,500    |
|       |     | 第123回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 11,232,400    |
|       |     | 第124回利付国債（20年） |       | 5,000,000     | 5,541,850     |
|       |     | 第125回利付国債（20年） |       | 5,000,000     | 5,678,650     |
|       |     | 第127回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 10,899,900    |
|       |     | 第128回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 10,863,900    |
|       |     | 第129回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 10,713,500    |
|       |     | 第130回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 10,683,200    |
|       |     | 第131回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 10,524,300    |
|       |     | 第132回利付国債（20年） |       | 5,000,000     | 5,246,050     |
|       |     | 第133回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 10,652,200    |
|       |     | 第134回利付国債（20年） |       | 5,000,000     | 5,310,250     |
|       |     | 第135回利付国債（20年） |       | 5,000,000     | 5,229,600     |
|       |     | 第136回利付国債（20年） |       | 5,000,000     | 5,149,200     |
|       |     | 第137回利付国債（20年） |       | 5,000,000     | 5,212,900     |
|       |     | 第138回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 10,102,400    |
|       |     | 第139回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 10,263,900    |
|       |     | 第140回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 10,391,900    |
|       |     | 第141回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 10,357,200    |
|       |     | 第142回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 10,521,800    |
|       |     | 第143回利付国債（20年） |       | 20,000,000    | 20,329,200    |
|       |     | 第144回利付国債（20年） |       | 10,000,000    | 10,000,000    |
|       |     | 第145回利付国債（20年） |       | 20,000,000    | 20,603,800    |
|       |     | 第146回利付国債（20年） |       | 20,000,000    | 20,547,200    |
|       | 小計  |                |       | 3,005,000,000 | 3,171,426,650 |
|       |     | 銘柄数：           | 201   |               |               |
|       |     | 組入時価比率：        | 83.1% |               | 84.0%         |
| 地方債証券 | 日本円 | 第619回東京都公募公債   |       | 10,000,000    | 10,177,900    |
|       |     | 第650回東京都公募公債   |       | 10,000,000    | 10,622,700    |
|       |     | 第715回東京都公募公債   |       | 20,000,000    | 20,191,600    |



| 種類   | 通貨  | 銘柄   | 銘柄数比率      | 券面総額  | 評価額   |
|------|-----|--|------------|---|---|
|      |     | 第153回神奈川県公募公債<br>平成21年度第1回静岡県公募公債<br>平成17年度第1回愛知県公募公債（10年）<br>平成21年度第12回愛知県公募公債（10年）<br>平成23年度第5回広島県公募公債<br>平成16年度第1回埼玉県公募公債<br>平成16年度第1回千葉県公募公債<br>第33回共同発行市場公募地方債<br>第85回共同発行市場公募地方債<br>平成20年度第1回浜松市公募公債<br>平成24年度第1回静岡市公募公債<br>第12回せ号名古屋市公募公債<br>平成23年度第4回京都市公募公債<br>平成16年度第3回横浜市公募公債<br>平成20年度第4回横浜市公募公債<br>平成23年度第9回福岡市公募公債<br>第4回さいたま市公募公債 |            | 20,000,000<br>12,000,000<br>10,000,000<br>10,000,000<br>20,000,000<br>10,000,000<br>10,000,000<br>10,000,000<br>10,000,000<br>16,800,000<br>20,000,000<br>17,150,000<br>10,000,000<br>10,000,000<br>10,000,000<br>10,000,000<br>10,000,000<br>11,500,000<br>267,450,000 | 21,384,800<br>12,841,200<br>10,173,900<br>10,583,200<br>20,628,600<br>10,053,200<br>10,079,000<br>10,296,200<br>21,338,400<br>18,002,712<br>20,284,400<br>17,537,761<br>10,369,700<br>10,105,300<br>10,716,900<br>10,323,900<br>12,062,120<br>277,773,493 |
|      | 小計  | 銘柄数：<br>組入時価比率：  | 20<br>7.3% |   | 7.4%  |
| 特殊債券 | 日本円 | 第14回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券<br>第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券<br>第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券<br>第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券<br>第15回政府保証日本政策金融公庫債券<br>第188回政府保証中小企業債券<br>第190回政府保証中小企業債券<br>第19回都市再生債券<br>第2回本州四国連絡橋債券<br>第342回東京交通債券<br>第46回政府保証関西国際空港債券<br>い第728号農林債<br>い第745号農林債<br>第8回政府保証東日本高速道路債券<br>第16回政府保証東日本高速道路債券                                |            | 32,000,000<br>17,000,000<br>11,000,000<br>10,000,000<br>20,000,000<br>10,000,000<br>13,000,000<br>30,000,000<br>10,000,000<br>10,000,000<br>20,000,000<br>10,000,000<br>20,000,000<br>14,000,000<br>10,000,000<br>237,000,000   | 33,429,120<br>17,797,130<br>11,788,480<br>10,011,100<br>21,049,000<br>10,457,500<br>13,662,610<br>32,216,100<br>10,004,200<br>11,428,100<br>20,153,800<br>10,078,600<br>20,077,200<br>14,796,320<br>10,548,200<br>247,497,460                             |
|      | 小計  | 銘柄数：<br>組入時価比率：  | 15<br>6.5% |   | 6.6%  |
| 社債券  | 日本円 | 第1回成田国際空港株式会社社債<br>（一般担保付）<br>第7回東日本旅客鉄道株式会社社債<br>第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債<br>（社債間限定同順位特約付）<br>第405回中部電力株式会社社債<br>（一般担保付）<br>第375回東北電力株式会社社債<br>（一般担保付）   |            | 10,000,000<br>20,000,000<br>5,000,000<br>10,000,000<br>20,000,000   | 10,138,500<br>22,256,800<br>5,661,000<br>10,521,500<br>21,008,000   |

| 種類 | 通貨 | 銘柄                       | 銘柄数比率     | 券面総額       | 評価額                |
|----|----|--------------------------|-----------|------------|--------------------|
|    | 小計 | 第9回沖縄電力株式会社社債<br>（一般担保付） |           | 10,000,000 | 10,221,000         |
|    |    | 銘柄数：<br>組入時価比率：          | 6<br>2.1% | 75,000,000 | 79,806,800<br>2.1% |
|    | 合計 |                          |           |            | 3,776,504,403      |

（注）比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

## 「PRU海外株式マザーファンド」の状況

なお、以下に掲載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

(単位：円)

| 区 分         | 注記<br>番号 | (平成24年12月10日現在) | (平成25年12月10日現在) |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
|             |          | 金 額             | 金 額             |
| 資産の部        |          |                 |                 |
| 流動資産        |          |                 |                 |
| 預金          |          | 94,669,730      | 149,229,863     |
| 金銭信託        |          | 624,301         | 127,073         |
| コール・ローン     |          | 25,910,818      | 85,688,175      |
| 株式          |          | 5,001,924,938   | 4,874,696,137   |
| 投資証券        |          | 111,647,460     | 91,128,509      |
| 派生商品評価勘定    |          | 995,632         | 4,310,314       |
| 未収入金        |          | 56,485,361      | 17,829,537      |
| 未収配当金       |          | 14,337,540      | 11,202,656      |
| 未収利息        |          | 35              | 70              |
| 前払金         |          | 11,352,336      | 12,803,388      |
| 差入委託証拠金     |          | 7,433,893       | 19,265,285      |
| 流動資産合計      |          | 5,325,382,044   | 5,266,281,007   |
| 資産合計        |          | 5,325,382,044   | 5,266,281,007   |
| 負債の部        |          |                 |                 |
| 流動負債        |          |                 |                 |
| 派生商品評価勘定    |          | 2,356,989       | 324,283         |
| 未払金         |          | 2,508,764       | 1,182,624       |
| 未払解約金       |          | 40,213,114      | 73,777,231      |
| 流動負債合計      |          | 45,078,867      | 75,284,138      |
| 負債合計        |          | 45,078,867      | 75,284,138      |
| 純資産の部       |          |                 |                 |
| 元本等         |          |                 |                 |
| 元本          | 1        | 4,982,255,745   | 3,140,255,032   |
| 剰余金         |          |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金( ) |          | 298,047,432     | 2,050,741,837   |
| 元本等合計       |          | 5,280,303,177   | 5,190,996,869   |
| 純資産合計       |          | 5,280,303,177   | 5,190,996,869   |
| 負債純資産合計     |          | 5,325,382,044   | 5,266,281,007   |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                           |   |
|---------------------------|---|
| 1．有価証券の評価基準及び評価方法         | 株式及び投資証券<br>移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、または金融商品取引業者等から提示される気配相場等に基づいて評価しております。               |
| 2．デリバティブ等の評価基準及び評価方法      | 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は、最終相場によっております。<br>為替予約取引<br>原則としてわが国における計算期間末日の対顧客先物売買の仲値で評価しております。 |
| 3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br>外貨建取引については「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令133号）第60条及び第61条に基づき処理しております。  |

## （貸借対照表に関する注記）

| （平成24年12月10日現在） |   | （平成25年12月10日現在） |   |
|-----------------|---|-----------------|---|
| 1               | 1．本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額    | 1               | 1．本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額    |
|                 | 5,936,909,157円                          |                 | 4,982,255,745円                          |
|                 | 同期中における追加設定元本額                          |                 | 同期中における追加設定元本額                          |
|                 | 308,544,287円                            |                 | 266,684,540円                            |
|                 | 同期中における解約元本額                            |                 | 同期中における解約元本額                            |
|                 | 1,263,197,699円                          |                 | 2,108,685,253円                          |
|                 | 同期末における元本の内訳                            |                 | 同期末における元本の内訳                            |
|                 | PRU海外株式マーケット・パフォーマー                     |                 | PRU海外株式マーケット・パフォーマー                     |
|                 | 3,861,544,760円                          |                 | 2,211,305,252円                          |
|                 | PRUグッドライフ2020                           |                 | PRUグッドライフ2020                           |
|                 | 2,457,487円                              |                 | 1,189,003円                              |
|                 | PRUグッドライフ2030                           |                 | PRUグッドライフ2030                           |
|                 | 2,397,829円                              |                 | 1,592,296円                              |
|                 | PRUグッドライフ2040                           |                 | PRUグッドライフ2040                           |
|                 | 7,110,986円                              |                 | 5,221,875円                              |
|                 | PRUグッドライフ2020（年金）                       |                 | PRUグッドライフ2020（年金）                       |
|                 | 99,677,833円                             |                 | 64,218,475円                             |
|                 | PRUグッドライフ2030（年金）                       |                 | PRUグッドライフ2030（年金）                       |
|                 | 234,502,598円                            |                 | 186,175,458円                            |
|                 | PRUグッドライフ2040（年金）                       |                 | PRUグッドライフ2040（年金）                       |
|                 | 227,107,698円                            |                 | 196,350,958円                            |
|                 | PRUグッドライフ2050（年金）                       |                 | PRUグッドライフ2050（年金）                       |
|                 | 7,892,687円                              |                 | 14,045,996円                             |
|                 | プルデンシャル私募海外株式マーケット・パフォーマー（適格機関投資家向け）    |                 | プルデンシャル私募海外株式マーケット・パフォーマー（適格機関投資家向け）    |
|                 | 539,563,867円                            |                 | 460,155,719円                            |
|                 | 計 4,982,255,745円                        |                 | 計 3,140,255,032円                        |
|                 | 2．本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の受益権の総数 |                 | 2．本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の受益権の総数 |
|                 | 4,982,255,745口                          |                 | 3,140,255,032口                          |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

| 項目                      | 自 平成23年12月13日<br>至 平成24年12月10日   | 自 平成24年12月11日<br>至 平成25年12月10日 |
|-------------------------|--|--------------------------------|
| 1．金融商品に対する<br>取組方針      | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を投資信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。   | 同左                             |
| 2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じて価格変動リスクや為替変動リスク等があります。 | 同左                             |
| 3．金融商品に係るリスク管理体制        | コンプライアンス部では、運用状況のモニタリング、運用に関する法令諸規則の遵守状況の確認を行っております。<br>また、業務統括部では、運用に関するリスク管理を行っております。  | 同左                             |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | （平成24年12月10日現在）   | （平成25年12月10日現在）  |
|----------------------------|---|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。   | 同左   |
| 2. 時価の算定方法                 | <p>有価証券<br/>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引等<br/>「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。</p> <p>上記以外の金融商品<br/>短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> | <p>有価証券<br/>同左</p> <p>デリバティブ取引等<br/>同左</p> <p>上記以外の金融商品<br/>同左</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価格のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。   | 同左   |

(有価証券に関する注記)

(平成24年12月10日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

| 種類   | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
|------|-----------------|
| 株式   | 37,958,419      |
| 投資証券 | 1,000,499       |
| 合計   | 38,958,918      |

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本報告書の開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（平成25年12月10日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

| 種類   | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
|------|-----------------|
| 株式   | 24,058,693      |
| 投資証券 | 900,199         |
| 合計   | 24,958,892      |

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本報告書の開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

株式関連

（単位：円）

| 種類       | （平成24年12月10日現在） |       |             |           |
|----------|-----------------|-------|-------------|-----------|
|          | 契約額等            | うち1年超 | 時価          | 評価損益      |
|          |                 |       |             |           |
| 市場取引     |                 |       |             |           |
| 株価指数先物取引 |                 |       |             |           |
| 買建       | 143,625,368     | -     | 142,315,806 | 1,309,562 |
| 合計       | 143,625,368     | -     | 142,315,806 | 1,309,562 |

（単位：円）

| 種類       | （平成25年12月10日現在） |       |             |           |
|----------|-----------------|-------|-------------|-----------|
|          | 契約額等            | うち1年超 | 時価          | 評価損益      |
|          |                 |       |             |           |
| 市場取引     |                 |       |             |           |
| 株価指数先物取引 |                 |       |             |           |
| 買建       | 253,039,978     | -     | 257,077,765 | 4,037,787 |
| 合計       | 253,039,978     | -     | 257,077,765 | 4,037,787 |

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準じる方法で評価しております。

- 2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3．契約額等には、手数料相当額を含んでおりません。
- 4．契約額等及び時価の合計欄の金額は各々の合計金額であります。



## 通貨関連

(単位：円)

| 種類                  | (平成24年12月10日現在) |       |            |        |
|---------------------|-----------------|-------|------------|--------|
|                     | 契約額等            | うち1年超 | 時価         | 評価損益   |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |                 |       |            |        |
| 買建                  |                 |       |            |        |
| アメリカドル              | 4,959,731       | -     | 4,952,400  | 7,331  |
| 売建                  |                 |       |            |        |
| アメリカドル              | 14,801,400      | -     | 14,857,200 | 55,800 |
| ユーロ                 | 2,480,518       | -     | 2,471,242  | 9,276  |
| イギリスポンド             | 2,479,213       | -     | 2,477,153  | 2,060  |
| 合計                  | 24,720,862      | -     | 24,757,995 | 51,795 |

(単位：円)

| 種類                  | (平成25年12月10日現在) |       |            |        |
|---------------------|-----------------|-------|------------|--------|
|                     | 契約額等            | うち1年超 | 時価         | 評価損益   |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |                 |       |            |        |
| 買建                  |                 |       |            |        |
| アメリカドル              | 15,454,369      | -     | 15,501,000 | 46,631 |
| 売建                  |                 |       |            |        |
| アメリカドル              | 15,473,550      | -     | 15,501,000 | 27,450 |
| ユーロ                 | 5,149,010       | -     | 5,174,161  | 25,151 |
| イギリスポンド             | 5,137,783       | -     | 5,178,675  | 40,892 |
| スイスフラン              | 1,030,910       | -     | 1,035,460  | 4,550  |
| スウェーデンクローネ          | 1,035,394       | -     | 1,034,086  | 1,308  |
| オーストラリアドル           | 3,101,272       | -     | 3,102,924  | 1,652  |
| 合計                  | 46,382,288      | -     | 46,527,306 | 51,756 |

(注) 1. 時価の算定方法  
為替予約の時価

(1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該対顧客先物相場の仲値により評価しております。

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

イ）計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートにより評価しております。

ロ）計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値により評価しております。

(2) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値により評価しております。

2．換算においては円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

| （平成24年12月10日現在）                          |          | （平成25年12月10日現在）                          |          |
|--|----------|--|----------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 |          | 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 |          |
|  | 1.0598円  |  | 1.6530円  |
| （1万口当たり純資産額                              | 10,598円） | （1万口当たり純資産額                              | 16,530円） |

[次へ](#)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## 株式

（平成25年12月10日現在）

| 種類                           | 通貨         | 銘柄                              | 株数         | 評価額単価  | 評価額金額      |
|------------------------------|------------|---------------------------------|------------|--------|------------|
| 株式                           | アメリカ<br>ドル | ANADARKO PETROLEUM CORP         | 860        | 86.19  | 74,123.40  |
|                              |            | APACHE CORP                     | 644        | 88.98  | 57,303.12  |
|                              |            | BAKER HUGHES INC                | 730        | 53.74  | 39,230.20  |
|                              |            | CABOT OIL & GAS CORPORATION     | 700        | 36.82  | 25,774.00  |
|                              |            | CAMERON INTERNATIONAL CORP      | 410        | 55.40  | 22,714.00  |
|                              |            | CHENIERE ENERGY INC             | 100        | 44.78  | 4,478.00   |
|                              |            | CHESAPEAKE ENERGY CO            | 920        | 26.38  | 24,269.60  |
|                              |            | CHEVRON CORP                    | 3,340      | 123.34 | 411,955.60 |
|                              |            | CIMAREX ENERGY CO               | 120        | 94.57  | 11,348.40  |
|                              |            | COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC | 400        | 16.99  | 6,796.00   |
|                              |            | CONCHO RRESOURCES INC           | 150        | 98.99  | 14,848.50  |
|                              |            | CONOCOPHILLIPS                  | 2,080      | 70.44  | 146,515.20 |
|                              |            | CONSOL ENERGY INC               | 460        | 37.10  | 17,066.00  |
|                              |            | CONTINENTAL RESOURCES INC/OK    | 100        | 102.26 | 10,226.00  |
|                              |            | CORE LABORATORIES N.V.          | 80         | 187.72 | 15,017.60  |
|                              |            | DENBURY RESOURCES INC           | 700        | 16.17  | 11,319.00  |
|                              |            | DEVON ENERGY CORPORATION        | 660        | 60.70  | 40,062.00  |
|                              |            | DIAMOND OFFSHORE DRILLING INC   | 150        | 58.85  | 8,827.50   |
|                              |            | ENERGEN CORPORATION             | 140        | 68.15  | 9,541.00   |
|                              |            | ENSCO PLC                       | 400        | 59.78  | 23,912.00  |
|                              |            | EOG RESOURCES INC               | 470        | 158.14 | 74,325.80  |
|                              |            | EQT CORPORATION                 | 240        | 87.67  | 21,040.80  |
|                              |            | EXXON MOBIL CORPORATION         | 7,527      | 95.84  | 721,387.68 |
|                              |            | FMC TECHNOLOGIES INC            | 450        | 50.98  | 22,941.00  |
|                              |            | HALLIBURTON CO                  | 1,450      | 49.91  | 72,369.50  |
|                              |            | HELMERICH & PAYNE INC           | 150        | 79.49  | 11,923.50  |
|                              |            | HESS CORP                       | 550        | 80.51  | 44,280.50  |
|                              |            | HOLLYFRONTIER CORP              | 300        | 46.37  | 13,911.00  |
|                              |            | KINDER MORGAN INC               | 1,171      | 33.35  | 39,052.85  |
|                              |            | KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC    | 133        | 73.91  | 9,830.03   |
|                              |            | MARATHON OIL CORP               | 1,250      | 36.41  | 45,512.50  |
|                              |            | MARATHON PETROLEUM CORP         | 520        | 85.55  | 44,486.00  |
|                              |            | MURPHY OIL CORPORATION          | 350        | 64.12  | 22,442.00  |
|                              |            | NABORS INDUSTRIES LTD           | 500        | 15.93  | 7,965.00   |
|                              |            | NATIONAL OILWELL VARCO INC      | 687        | 80.19  | 55,090.53  |
|                              |            | NOBLE CORPORATION PLC           | 450        | 38.21  | 17,194.50  |
|                              |            | NOBLE ENERGY INC                | 580        | 68.59  | 39,782.20  |
|                              |            | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP       | 1,350      | 93.14  | 125,739.00 |
|                              |            | OCEANEERING INTL INC            | 100        | 79.04  | 7,904.00   |
|                              |            | PEABODY ENERGY CORP             | 460        | 19.08  | 8,776.80   |
|                              |            | PHILLIPS 66                     | 945        | 71.83  | 67,879.35  |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 230        | 177.44                          | 40,811.20  |        |            |
| QEP RESOURCES INC            | 360        | 30.96                           | 11,145.60  |        |            |
| RANGE RESOURCES CORPORATION  | 300        | 82.08                           | 24,624.00  |        |            |
| ROWAN COMPANIES PLC          | 250        | 34.26                           | 8,565.00   |        |            |
| SCHLUMBERGER LTD             | 2,296      | 88.03                           | 202,116.88 |        |            |
| SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY  | 600        | 39.38                           | 23,628.00  |        |            |
| SPECTRA ENERGY CORP          | 1,209      | 34.16                           | 41,299.44  |        |            |
| SUPERIOR ENERGY SERVICES INC | 300        | 25.41                           | 7,623.00   |        |            |
| TESORO CORP                  | 80         | 57.99                           | 4,639.20   |        |            |
| VALERO ENERGY CORP           | 976        | 46.14                           | 45,032.64  |        |            |

| 種類                   | 通貨         | 銘柄  | 株数         | 評価額単価  | 評価額金額      |
|----------------------|------------|---|------------|--------|------------|
| 株式                   | アメリカ<br>ドル | WEATHERFORD INTL LTD                        | 1,224      | 15.09  | 18,470.16  |
|                      |            | WHITING PETROLEUM CORP                      | 230        | 58.22  | 13,390.60  |
|                      |            | WILLIAMS COMPANIES INC                      | 1,250      | 35.84  | 44,800.00  |
|                      |            | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC                | 350        | 109.18 | 38,213.00  |
|                      |            | AIRGAS INC                                  | 100        | 110.23 | 11,023.00  |
|                      |            | ALBEMARLE CORP                              | 150        | 69.55  | 10,432.50  |
|                      |            | ALCOA INC                                   | 1,600      | 9.48   | 15,168.00  |
|                      |            | ASHLAND INC                                 | 50         | 94.90  | 4,745.00   |
|                      |            | AVERY DENNISON CORP                         | 140        | 49.33  | 6,906.20   |
|                      |            | BALL CORP                                   | 200        | 50.36  | 10,072.00  |
|                      |            | CELANESE CORPORATION                        | 300        | 56.84  | 17,052.00  |
|                      |            | CF INDUSTRIES HOLDINGS INC                  | 100        | 231.59 | 23,159.00  |
|                      |            | CROWN HOLDINGS INC                          | 300        | 43.84  | 13,152.00  |
|                      |            | DOW CHEMICAL                                | 2,150      | 40.80  | 87,720.00  |
|                      |            | DU PONT (E.I.)DE NEMOURS                    | 1,590      | 61.39  | 97,610.10  |
|                      |            | EASTMAN CHEMICAL COMPANY                    | 270        | 75.36  | 20,347.20  |
|                      |            | ECOLAB INC                                  | 470        | 105.76 | 49,707.20  |
|                      |            | FMC CORP                                    | 200        | 74.85  | 14,970.00  |
|                      |            | FREEPORT-MCMORAN COPPER-B                   | 1,806      | 34.63  | 62,541.78  |
|                      |            | INTERNATIONAL PAPER CO                      | 690        | 46.82  | 32,305.80  |
|                      |            | INTL FLAVORS & FRAGRANCES                   | 100        | 86.29  | 8,629.00   |
|                      |            | LYONDELLBASELL INDU-CL A                    | 740        | 76.80  | 56,832.00  |
|                      |            | MARTIN MARIETTA MATERIALS INC               | 70         | 98.41  | 6,888.70   |
|                      |            | MEADWESTVACO CORP                           | 350        | 35.65  | 12,477.50  |
|                      |            | MONSANTO CO                                 | 936        | 111.65 | 104,504.40 |
|                      |            | NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO.            | 860        | 23.60  | 20,296.00  |
|                      |            | NUCOR CORP                                  | 520        | 52.51  | 27,305.20  |
|                      |            | OWENS-ILLINOIS INC                          | 250        | 33.98  | 8,495.00   |
|                      |            | PPG INDUSTRIES INC                          | 240        | 186.71 | 44,810.40  |
|                      |            | PRAXAIR INC                                 | 490        | 125.41 | 61,450.90  |
|                      |            | ROCK-TEN COMPANY -CL A                      | 130        | 95.95  | 12,473.50  |
|                      |            | SEALED AIR CORP                             | 340        | 32.13  | 10,924.20  |
|                      |            | SHERWIN-WILLIAMS CO                         | 150        | 185.52 | 27,828.00  |
|                      |            | SIGMA-ALDRICH                               | 150        | 89.56  | 13,434.00  |
|                      |            | THE MOSAIC COMPANY PRODUCES &<br>DISTRIB-WI | 520        | 46.00  | 23,920.00  |
|                      |            | VULCAN MATERIALS CO                         | 240        | 55.61  | 13,346.40  |
|                      |            | 3M CO                                       | 1,060      | 128.57 | 136,284.20 |
|                      |            | AGCO CORPORATION                            | 150        | 60.29  | 9,043.50   |
|                      |            | ALLEGION PLC                                | 165        | 41.18  | 6,794.70   |
|                      |            | AMETEK INC                                  | 400        | 49.38  | 19,752.00  |
|                      |            | B/E AEROSPACE INC                           | 50         | 86.85  | 4,342.50   |
|                      |            | BOEING CO                                   | 1,250      | 134.68 | 168,350.00 |
|                      |            | CATERPILLAR INC                             | 1,130      | 86.09  | 97,281.70  |
|                      |            | CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV                 | 70         | 78.61  | 5,502.70   |
|                      |            | CUMMINS INC                                 | 250        | 131.66 | 32,915.00  |
|                      |            | DANAHER CORP                                | 980        | 75.38  | 73,872.40  |
|                      |            | DEERE & CO                                  | 670        | 87.20  | 58,424.00  |
|                      |            | DOVER CORP                                  | 320        | 91.35  | 29,232.00  |
|                      |            | EATON CORP PLC                              | 766        | 72.30  | 55,381.80  |
|                      |            | EMERSON ELECTRIC CO                         | 1,260      | 67.64  | 85,226.40  |
|                      |            | FASTENAL CO                                 | 520        | 47.50  | 24,700.00  |
|                      |            | FLOWSERVE CORPORATION                       | 260        | 71.82  | 18,673.20  |
|                      |            | FLUOR CORP (NEW)                            | 300        | 76.86  | 23,058.00  |
|                      |            | GENERAL DYNAMICS CORP                       | 560        | 90.53  | 50,696.80  |
| GENERAL ELECTRIC CO. | 17,350     | 27.19                                       | 471,746.50 |        |            |
| GRAINGER (W.W.) INC  | 90         | 257.18                                      | 23,146.20  |        |            |

| 種類                          | 通貨         | 銘柄                             | 株数         | 評価額単価  | 評価額金額      |
|-----------------------------|------------|--------------------------------|------------|--------|------------|
| 株式                          | アメリカ<br>ドル | HONEYWELL INTERNATIONAL INC    | 1,240      | 87.87  | 108,958.80 |
|                             |            | ILLINOIS TOOL WORKS            | 690        | 79.84  | 55,089.60  |
|                             |            | INGERSOLL-RAND PLC             | 495        | 56.81  | 28,120.95  |
|                             |            | JACOBS ENGINEERING GROUP INC   | 250        | 58.38  | 14,595.00  |
|                             |            | JOY GLOBAL INC                 | 220        | 55.93  | 12,304.60  |
|                             |            | KBR INC                        | 250        | 32.39  | 8,097.50   |
|                             |            | L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS    | 160        | 101.95 | 16,312.00  |
|                             |            | LOCKHEED MARTIN CORPORATION    | 510        | 138.93 | 70,854.30  |
|                             |            | MASCO CORP                     | 650        | 21.51  | 13,981.50  |
|                             |            | NORTHROP GRUMMAN CORP          | 310        | 109.94 | 34,081.40  |
|                             |            | PACCAR INC                     | 625        | 56.87  | 35,543.75  |
|                             |            | PALL CORP                      | 140        | 83.85  | 11,739.00  |
|                             |            | PARKER HANNIFIN CORP           | 230        | 120.79 | 27,781.70  |
|                             |            | PENTAIR LTD                    | 335        | 71.24  | 23,865.40  |
|                             |            | PRECISION CASTPARTS CORP       | 220        | 253.64 | 55,800.80  |
|                             |            | QUANTA SERVICES INC            | 400        | 29.67  | 11,868.00  |
|                             |            | RAYTHEON COMPANY               | 520        | 86.85  | 45,162.00  |
|                             |            | ROCKWELL COLLINS               | 220        | 73.40  | 16,148.00  |
|                             |            | ROCKWELL INTL CORP             | 250        | 111.96 | 27,990.00  |
|                             |            | ROPER INDUSTRIES INC           | 150        | 130.15 | 19,522.50  |
|                             |            | SENSATA TECHNOLOGIES HOLDIN    | 100        | 37.39  | 3,739.00   |
|                             |            | SPX CORP                       | 60         | 95.05  | 5,703.00   |
|                             |            | STANLEY BLACK & DECKER INC     | 259        | 80.90  | 20,953.10  |
|                             |            | TEXTRON INC                    | 490        | 32.41  | 15,880.90  |
|                             |            | TRANSDIGM CROUP INC            | 100        | 154.78 | 15,478.00  |
|                             |            | UNITED TECHNOLOGIES CORP       | 1,510      | 111.18 | 167,881.80 |
|                             |            | XYLEM INC                      | 360        | 33.63  | 12,106.80  |
|                             |            | ADT CORP/THE                   | 337        | 39.69  | 13,375.53  |
|                             |            | CINTAS CORP                    | 210        | 54.81  | 11,510.10  |
|                             |            | DUN&BRADSTREET CORP            | 80         | 118.29 | 9,463.20   |
|                             |            | EQUIFAX INC                    | 200        | 68.09  | 13,618.00  |
|                             |            | IHS INC-CLASS A                | 70         | 116.01 | 8,120.70   |
|                             |            | IRON MOUNTAIN INCORPORATED     | 308        | 28.67  | 8,830.36   |
|                             |            | MANPOWER GROUP                 | 70         | 81.37  | 5,695.90   |
|                             |            | NIELSEN HOLDINGS NV            | 150        | 43.65  | 6,547.50   |
|                             |            | REPUBLIC SERVICES INC          | 490        | 34.54  | 16,924.60  |
|                             |            | ROBERT HALF INTL INC           | 270        | 40.28  | 10,875.60  |
|                             |            | STERICYCLE INC                 | 160        | 116.10 | 18,576.00  |
|                             |            | TYCO INTERNATIONAL LTD         | 775        | 37.74  | 29,248.50  |
|                             |            | VERISK ANALYTICS INC-CLASS A   | 250        | 66.52  | 16,630.00  |
|                             |            | WASTE MANAGEMENT INC           | 810        | 44.65  | 36,166.50  |
|                             |            | C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC    | 300        | 57.91  | 17,373.00  |
|                             |            | CSX CORP                       | 1,790      | 28.08  | 50,263.20  |
|                             |            | DELTA AIR LINES INC            | 100        | 28.88  | 2,888.00   |
|                             |            | EXPEDITORS INTL WASH INC       | 340        | 43.41  | 14,759.40  |
|                             |            | FEDEX CORPORATION              | 520        | 139.81 | 72,701.20  |
|                             |            | HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC      | 500        | 24.86  | 12,430.00  |
|                             |            | HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST  | 6,000      | 0.64   | 3,870.00   |
|                             |            | JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 170        | 76.86  | 13,066.20  |
|                             |            | KANSAS CITY SOUTHERN           | 200        | 119.88 | 23,976.00  |
| NORFOLK SOUTHERN CORP       | 510        | 90.49                          | 46,149.90  |        |            |
| SOUTHWEST AIRLINES          | 350        | 18.50                          | 6,475.00   |        |            |
| UNION PACIFIC CORP          | 770        | 164.50                         | 126,665.00 |        |            |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS | 200        | 37.55                          | 7,510.00   |        |            |
| UNITED PARCEL SERVICE       | 1,220      | 102.34                         | 124,854.80 |        |            |
| AUTOLIV INC                 | 160        | 91.74                          | 14,678.40  |        |            |

| 種類                             | 通貨         | 銘柄                             | 株数        | 評価額単価  | 評価額金額      |
|--------------------------------|------------|--------------------------------|-----------|--------|------------|
| 株式                             | アメリカ<br>ドル | BORWARNER INC                  | 130       | 107.92 | 14,029.60  |
|                                |            | DELPHI AUTOMOTIVE PLC          | 550       | 58.24  | 32,032.00  |
|                                |            | FORD MOTOR COMPANY             | 6,400     | 16.56  | 105,984.00 |
|                                |            | GENERAL MOTORS CO              | 1,400     | 40.90  | 57,260.00  |
|                                |            | HARLEY-DAVIDSON INC            | 380       | 68.95  | 26,201.00  |
|                                |            | JOHNSON CONTROLS INC           | 1,240     | 50.91  | 63,128.40  |
|                                |            | TESLA MOTORS INC               | 70        | 141.60 | 9,912.00   |
|                                |            | TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP   | 200       | 75.72  | 15,144.00  |
|                                |            | COACH INC                      | 480       | 56.06  | 26,908.80  |
|                                |            | DR HORTON INC                  | 400       | 19.45  | 7,780.00   |
|                                |            | FOSSIL GROUP INC               | 90        | 122.30 | 11,007.00  |
|                                |            | GARMIN LTD                     | 170       | 49.02  | 8,333.40   |
|                                |            | HASBRO INC                     | 150       | 52.41  | 7,861.50   |
|                                |            | LEGGETT & PLATT INC            | 250       | 29.86  | 7,465.00   |
|                                |            | LENNAR CORP-CL A               | 200       | 35.24  | 7,048.00   |
|                                |            | LULULEMON ATHLETICA INC        | 160       | 70.34  | 11,254.40  |
|                                |            | MATTEL INC                     | 560       | 46.15  | 25,846.80  |
|                                |            | MICHAEL KORS HOLDINGS LTD      | 250       | 80.61  | 20,152.50  |
|                                |            | MOHAWK INDUSTRIES INC          | 80        | 143.27 | 11,461.60  |
|                                |            | NEWELL RUBBERMAID INC          | 500       | 30.93  | 15,465.00  |
|                                |            | NIKE INC -CL B                 | 1,250     | 79.78  | 99,725.00  |
|                                |            | POLARIS INDUSTRIES INC         | 100       | 138.80 | 13,880.00  |
|                                |            | POLO RALPH LAUREN CORPORATION  | 90        | 171.18 | 15,406.20  |
|                                |            | PULTE GROUP INC                | 500       | 18.33  | 9,165.00   |
|                                |            | PVH CORP                       | 70        | 127.43 | 8,920.10   |
|                                |            | TOLL BROTHERS INC              | 300       | 33.58  | 10,074.00  |
|                                |            | VF CORP                        | 140       | 232.94 | 32,611.60  |
|                                |            | WHIRLPOOL CORP                 | 150       | 149.99 | 22,498.50  |
|                                |            | BLOCK H & R INC                | 500       | 29.02  | 14,510.00  |
|                                |            | CARNIVAL CORP                  | 730       | 35.60  | 25,988.00  |
|                                |            | CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC     | 50        | 527.32 | 26,366.00  |
|                                |            | DARDEN RESTAURANTS INC         | 250       | 52.28  | 13,070.00  |
|                                |            | INTL GAME TECHNOLOGY           | 450       | 18.11  | 8,149.50   |
|                                |            | LAS VEGAS SANDS CORP           | 680       | 76.88  | 52,278.40  |
|                                |            | MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A    | 399       | 46.56  | 18,577.44  |
|                                |            | MCDONALD'S CORPORATION         | 1,680     | 95.72  | 160,809.60 |
|                                |            | MGM RESORTS INTERNATIONAL      | 700       | 20.73  | 14,511.00  |
|                                |            | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD    | 300       | 44.01  | 13,203.00  |
|                                |            | STARBUCKS CORP                 | 1,260     | 79.73  | 100,459.80 |
|                                |            | STARWOOD HOTELS & RESORTS      | 350       | 74.31  | 26,008.50  |
|                                |            | WYNDHAM WORLDWIDE CORP         | 230       | 72.46  | 16,665.80  |
|                                |            | WYNN RESORTS LTD               | 150       | 178.53 | 26,779.50  |
|                                |            | YUM! BRANDS INC                | 760       | 74.30  | 56,468.00  |
|                                |            | CABLEVISION SYSTEMS            | 300       | 16.36  | 4,908.00   |
|                                |            | CBS CORP-CL B                  | 975       | 58.95  | 57,476.25  |
|                                |            | CHARTER COMMUNICATION-A        | 40        | 128.16 | 5,126.40   |
|                                |            | COMCAST CORP-CL A              | 3,757     | 49.14  | 184,618.98 |
|                                |            | COMCAST CORP-SPECIAL CL A      | 875       | 47.34  | 41,422.50  |
|                                |            | DIRECTV                        | 870       | 67.90  | 59,073.00  |
|                                |            | DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A | 185       | 85.41  | 15,800.85  |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C | 155        | 78.92                          | 12,232.60 |        |            |
| DISH NETWORK CORPORATION-A     | 410        | 54.64                          | 22,402.40 |        |            |
| INTERPUBLIC GROUP COS INC      | 700        | 17.11                          | 11,977.00 |        |            |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A           | 362        | 85.50                          | 30,951.00 |        |            |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C    | 200        | 80.44                          | 16,088.00 |        |            |
| LIBERTY MEDIA CORP             | 180        | 149.30                         | 26,874.00 |        |            |

| 種類                        | 通貨         | 銘柄                                   | 株数         | 評価額単価    | 評価額金額      |
|---------------------------|------------|--------------------------------------|------------|----------|------------|
| 株式                        | アメリカ<br>ドル | NEWS CORP NEW-CL A-W/I               | 631        | 17.52    | 11,055.12  |
|                           |            | OMNICOM GROUP                        | 470        | 71.11    | 33,421.70  |
|                           |            | SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A          | 160        | 74.74    | 11,958.40  |
|                           |            | SIRIUS XM HOLDINGS INC               | 4,500      | 3.67     | 16,537.50  |
|                           |            | TIME WARNER CABLE INC                | 453        | 130.44   | 59,089.32  |
|                           |            | TIME WARNER INC                      | 1,596      | 65.49    | 104,522.04 |
|                           |            | TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A | 2,626      | 33.10    | 86,920.60  |
|                           |            | TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B | 752        | 32.09    | 24,131.68  |
|                           |            | VIACOM INC-CL B                      | 725        | 82.17    | 59,573.25  |
|                           |            | WALT DISNEY CO                       | 2,935      | 71.11    | 208,707.85 |
|                           |            | ADVANCE AUTO PARTS                   | 60         | 104.33   | 6,259.80   |
|                           |            | AMAZON.COM INC                       | 640        | 384.89   | 246,329.60 |
|                           |            | AUTOZONE INC                         | 60         | 457.34   | 27,440.40  |
|                           |            | BED BATH & BEYOND INC                | 370        | 77.68    | 28,741.60  |
|                           |            | BEST BUY COMPANY INC                 | 470        | 41.36    | 19,439.20  |
|                           |            | CARMAX INC                           | 338        | 51.95    | 17,559.10  |
|                           |            | DICK'S SPORTING GOODS INC            | 200        | 55.60    | 11,120.00  |
|                           |            | DOLLAR GENERAL CORP                  | 580        | 61.08    | 35,426.40  |
|                           |            | DOLLAR TREE INC                      | 400        | 55.28    | 22,112.00  |
|                           |            | EXPEDIA INC                          | 227        | 63.50    | 14,414.50  |
|                           |            | FAMILY DOLLAR STORES                 | 150        | 65.69    | 9,853.50   |
|                           |            | GAMESTOP CORPORATION                 | 250        | 45.58    | 11,395.00  |
|                           |            | GAP INC                              | 500        | 39.59    | 19,795.00  |
|                           |            | GENUINE PARTS CO                     | 250        | 82.42    | 20,605.00  |
|                           |            | HOME DEPOT INC                       | 2,430      | 79.60    | 193,428.00 |
|                           |            | KOHL'S CORP                          | 400        | 54.99    | 21,996.00  |
|                           |            | L BRANDS INC                         | 370        | 62.09    | 22,973.30  |
|                           |            | LIBERTY INTERACTIVE CORP-A           | 887        | 27.38    | 24,286.06  |
|                           |            | LKQ CORP                             | 300        | 33.66    | 10,098.00  |
|                           |            | LOWE'S COMPANIES                     | 1,820      | 47.76    | 86,923.20  |
|                           |            | MACY'S INC                           | 684        | 52.19    | 35,697.96  |
|                           |            | NETFLIX INC                          | 70         | 355.67   | 24,896.90  |
|                           |            | NORDSTROM INC                        | 300        | 60.70    | 18,210.00  |
|                           |            | O'REILLY AUTOMOTIVE INC              | 170        | 123.86   | 21,056.20  |
|                           |            | PETSMART INC                         | 200        | 72.84    | 14,568.00  |
|                           |            | PRICELINE.COM INC                    | 80         | 1,178.68 | 94,294.40  |
|                           |            | ROSS STORES INC                      | 410        | 71.88    | 29,470.80  |
|                           |            | STAPLES INC                          | 1,100      | 16.04    | 17,644.00  |
|                           |            | TARGET CORP                          | 1,010      | 63.24    | 63,872.40  |
|                           |            | TIFFANY & CO                         | 210        | 90.33    | 18,969.30  |
|                           |            | TJX COMPANIES INC                    | 1,230      | 62.06    | 76,333.80  |
|                           |            | TRACTOR SUPPLY COMPANY               | 260        | 72.50    | 18,850.00  |
|                           |            | TRIPADVISOR INC                      | 90         | 84.77    | 7,629.30   |
|                           |            | ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC | 120        | 90.21    | 10,825.20  |
|                           |            | URBAN OUTFITTERS INC                 | 250        | 36.04    | 9,010.00   |
|                           |            | COSTCO WHOLESALE CORP                | 680        | 121.66   | 82,728.80  |
|                           |            | CVS CAREMARK CORPORATION             | 2,153      | 66.73    | 143,669.69 |
|                           |            | KROGER CO                            | 900        | 40.42    | 36,378.00  |
|                           |            | SAFEWAY INC                          | 400        | 32.74    | 13,096.00  |
|                           |            | SYSCO CORP                           | 1,000      | 37.62    | 37,620.00  |
| WAL-MART STORES INC       | 2,850      | 79.95                                | 227,857.50 |          |            |
| WALGREEN CO               | 1,520      | 56.66                                | 86,123.20  |          |            |
| WHOLE FOODS MARKET INC    | 560        | 55.69                                | 31,186.40  |          |            |
| ALTRIA GROUP INC          | 3,470      | 37.69                                | 130,784.30 |          |            |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 1,195      | 42.48                                | 50,763.60  |          |            |
| BEAM INC                  | 210        | 67.45                                | 14,164.50  |          |            |

| 種類                           | 通貨         | 銘柄                             | 株数        | 評価額単価  | 評価額金額      |
|------------------------------|------------|--------------------------------|-----------|--------|------------|
| 株式                           | アメリカ<br>ドル | BROWN-FORMAN CORP-CLASS B      | 185       | 76.16  | 14,089.60  |
|                              |            | BUNGE LIMITED                  | 270       | 82.02  | 22,145.40  |
|                              |            | CAMPBELL SOUP CO               | 400       | 42.55  | 17,020.00  |
|                              |            | COCA-COLA COMPANY              | 6,810     | 40.40  | 275,124.00 |
|                              |            | COCA-COLA ENTERPRISES INC      | 450       | 42.33  | 19,048.50  |
|                              |            | CONAGRA FOODS INC              | 700       | 33.12  | 23,184.00  |
|                              |            | CONSTELLATION BRANDS INC       | 230       | 70.61  | 16,240.30  |
|                              |            | DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I    | 404       | 48.74  | 19,690.96  |
|                              |            | GENERAL MILLS INC              | 1,150     | 51.44  | 59,156.00  |
|                              |            | GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE   | 190       | 71.81  | 13,643.90  |
|                              |            | HORMEL FOODS CORPORATION       | 300       | 46.00  | 13,800.00  |
|                              |            | JM SMUCKER CO/THE-NEW COM      | 190       | 104.88 | 19,927.20  |
|                              |            | KELLOGG CO                     | 410       | 61.94  | 25,395.40  |
|                              |            | KRAFT FOODS GROUP INC          | 1,032     | 54.50  | 56,244.00  |
|                              |            | LORILLARD INC                  | 650       | 50.90  | 33,085.00  |
|                              |            | MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS    | 230       | 69.88  | 16,072.40  |
|                              |            | MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY | 290       | 85.49  | 24,792.10  |
|                              |            | MOLSON COORS BREWING CO-B      | 300       | 55.06  | 16,518.00  |
|                              |            | MONDELEZ INTERNATIONAL INC     | 2,948     | 34.69  | 102,266.12 |
|                              |            | MONSTER BEVERAGE CORPORATION   | 200       | 63.11  | 12,622.00  |
|                              |            | PEPSICO INC                    | 2,693     | 82.69  | 222,684.17 |
|                              |            | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL    | 2,730     | 86.35  | 235,735.50 |
|                              |            | REYNOLDS AMERICAN INC          | 590       | 51.36  | 30,302.40  |
|                              |            | THE HERSHEY COMPANY            | 200       | 96.97  | 19,394.00  |
|                              |            | TYSON FOODS INC                | 500       | 33.79  | 16,895.00  |
|                              |            | AVON PRODUCTS INC              | 750       | 17.91  | 13,432.50  |
|                              |            | CHURCH & DWIGHT CO INC         | 250       | 66.90  | 16,725.00  |
|                              |            | CLOROX COMPANY                 | 170       | 95.78  | 16,282.60  |
|                              |            | COLGATE-PALMOLIVE COMPANY      | 1,550     | 65.69  | 101,819.50 |
|                              |            | ENERGIZER HOLDINGS INC         | 100       | 112.51 | 11,251.00  |
|                              |            | ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A    | 400       | 73.89  | 29,556.00  |
|                              |            | HERBALIFE LTD                  | 120       | 72.78  | 8,733.60   |
|                              |            | KIMBERLY-CLARK CORP            | 670       | 105.83 | 70,906.10  |
|                              |            | PROCTER & GAMBLE CO            | 4,754     | 84.78  | 403,044.12 |
|                              |            | ABBOTT LABORATORIES            | 2,770     | 37.20  | 103,044.00 |
|                              |            | AETNA INC                      | 604       | 66.82  | 40,359.28  |
|                              |            | AMERISOURCEBERGEN CORP         | 360       | 70.63  | 25,426.80  |
|                              |            | BARD C R INC                   | 140       | 137.83 | 19,296.20  |
|                              |            | BAXTER INTERNATIONAL INC       | 970       | 67.79  | 65,756.30  |
|                              |            | BECTON DICKINSON & CO          | 330       | 108.61 | 35,841.30  |
|                              |            | BOSTON SCIENTIFIC CORP         | 2,321     | 11.72  | 27,202.12  |
|                              |            | CARDINAL HEALTH INC            | 570       | 64.27  | 36,633.90  |
|                              |            | CAREFUSION CORP                | 435       | 40.24  | 17,504.40  |
|                              |            | CERNER CORP                    | 540       | 56.71  | 30,623.40  |
|                              |            | CIGNA CORP                     | 480       | 87.15  | 41,832.00  |
|                              |            | COVIDIEN PLC                   | 775       | 68.13  | 52,800.75  |
|                              |            | DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC | 340       | 62.17  | 21,137.80  |
| DENTSPLY INTL INC            | 270        | 47.57                          | 12,843.90 |        |            |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | 140        | 62.73                          | 8,782.20  |        |            |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO   | 1,374      | 67.16                          | 92,277.84 |        |            |
| HCA HOLDINGS INC             | 500        | 46.98                          | 23,490.00 |        |            |
| HENRY SCHEIN INC             | 120        | 113.48                         | 13,617.60 |        |            |
| HOLOGIC INC                  | 408        | 22.12                          | 9,024.96  |        |            |
| HUMANA INC                   | 200        | 104.42                         | 20,884.00 |        |            |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 60         | 376.59                         | 22,595.40 |        |            |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 100        | 100.30                         | 10,030.00 |        |            |



| 種類                            | 通貨         | 銘柄                           | 株数         | 評価額単価  | 評価額金額      |
|-------------------------------|------------|------------------------------|------------|--------|------------|
| 株式                            | アメリカ<br>ドル | MCKESSON HBOC INC            | 370        | 163.03 | 60,321.10  |
|                               |            | MEDTRONIC INC                | 1,770      | 57.87  | 102,429.90 |
|                               |            | OMNICARE INC                 | 140        | 58.91  | 8,247.40   |
|                               |            | PATTERSON COS INC            | 150        | 41.53  | 6,229.50   |
|                               |            | QUEST DIAGNOSTICS INC        | 290        | 60.33  | 17,495.70  |
|                               |            | RESMED INC                   | 150        | 48.13  | 7,219.50   |
|                               |            | ST JUDE MEDICAL INC          | 450        | 59.11  | 26,599.50  |
|                               |            | STRYKER CORP                 | 490        | 74.61  | 36,558.90  |
|                               |            | UNITEDHEALTH GROUP INC       | 1,700      | 73.72  | 125,324.00 |
|                               |            | UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 100        | 83.00  | 8,300.00   |
|                               |            | VARIAN MEDICAL SYSTEMS       | 150        | 79.25  | 11,887.50  |
|                               |            | WELLPOINT INC                | 480        | 90.98  | 43,670.40  |
|                               |            | ZIMMER HOLDINGS INC          | 250        | 92.44  | 23,110.00  |
|                               |            | ABBVIE INC                   | 2,770      | 51.21  | 141,851.70 |
|                               |            | ACTAVIS PLC                  | 294        | 166.16 | 48,851.04  |
|                               |            | AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 520        | 55.06  | 28,631.20  |
|                               |            | ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 320        | 125.84 | 40,268.80  |
|                               |            | ALLERGAN INC                 | 450        | 98.04  | 44,118.00  |
|                               |            | AMGEN INC                    | 1,318      | 113.98 | 150,225.64 |
|                               |            | BIOGEN IDEC INC              | 439        | 286.18 | 125,633.02 |
|                               |            | BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 110        | 70.00  | 7,700.00   |
|                               |            | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 2,861      | 51.21  | 146,511.81 |
|                               |            | CELGENE CORP                 | 720        | 170.01 | 122,407.20 |
|                               |            | FOREST LABORATORIES INC      | 450        | 56.44  | 25,398.00  |
|                               |            | GILEAD SCIENCES INC          | 2,650      | 75.19  | 199,253.50 |
|                               |            | HOSPIRA INC                  | 350        | 42.19  | 14,766.50  |
|                               |            | ILLUMINA INC                 | 180        | 101.33 | 18,239.40  |
|                               |            | JOHNSON & JOHNSON            | 4,913      | 94.44  | 463,983.72 |
|                               |            | LIFE TECHNOLOGIES CORP       | 321        | 75.64  | 24,280.44  |
|                               |            | LILLY (ELI) & CO             | 1,800      | 50.79  | 91,422.00  |
|                               |            | MERCK & CO. INC.             | 5,087      | 49.56  | 252,111.72 |
|                               |            | METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 20         | 245.44 | 4,908.80   |
|                               |            | MYLAN INC                    | 700        | 43.86  | 30,702.00  |
|                               |            | PERRIGO COMPANY              | 150        | 154.51 | 23,176.50  |
|                               |            | PFIZER INC                   | 11,433     | 31.58  | 361,054.14 |
|                               |            | REGENERON PHARMACEUTICALS    | 120        | 279.49 | 33,538.80  |
|                               |            | THERMO ELECTRON CORP         | 580        | 102.02 | 59,171.60  |
|                               |            | VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 400        | 66.75  | 26,700.00  |
|                               |            | WATERS CORP                  | 100        | 98.49  | 9,849.00   |
|                               |            | ZOETIS INC                   | 600        | 31.75  | 19,050.00  |
|                               |            | BB&T CORPORATION             | 1,250      | 34.84  | 43,550.00  |
|                               |            | CIT GROUP INC                | 300        | 50.50  | 15,150.00  |
|                               |            | COMERICA INC                 | 300        | 46.07  | 13,821.00  |
|                               |            | FIFTH THIRD BANCORP          | 1,400      | 20.24  | 28,336.00  |
|                               |            | FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 200        | 51.13  | 10,226.00  |
|                               |            | HUDSON CITY BANCORP          | 800        | 9.29   | 7,432.00   |
|                               |            | KEYCORP                      | 1,350      | 12.88  | 17,388.00  |
| M&T BANK CORP                 | 190        | 114.82                       | 21,815.80  |        |            |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP    | 700        | 16.38                        | 11,466.00  |        |            |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC | 600        | 14.83                        | 8,898.00   |        |            |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP  | 880        | 76.28                        | 67,126.40  |        |            |
| REGIONS FINANCIAL CORP        | 2,391      | 9.63                         | 23,025.33  |        |            |
| SUNTRUST BANKS INC            | 990        | 35.55                        | 35,194.50  |        |            |
| US BANCORP                    | 3,200      | 39.74                        | 127,168.00 |        |            |
| WELLS FARGO COMPANY           | 8,734      | 44.32                        | 387,090.88 |        |            |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP     | 100        | 205.10                       | 20,510.00  |        |            |

| 種類                         | 通貨         | 銘柄                                   | 株数        | 評価額単価  | 評価額金額      |
|----------------------------|------------|--------------------------------------|-----------|--------|------------|
| 株式                         | アメリカ<br>ドル | AMERICAN EXPRESS COMPANY             | 1,620     | 85.75  | 138,915.00 |
|                            |            | AMERIPRISE FINANCIAL INC             | 290       | 108.99 | 31,607.10  |
|                            |            | BANK OF AMERICA CORP                 | 18,551    | 15.58  | 289,024.58 |
|                            |            | BANK OF NEW YORK MELLON CORP         | 2,018     | 33.65  | 67,905.70  |
|                            |            | BERKSHIRE HATHAWAY INC               | 1,850     | 117.14 | 216,709.00 |
|                            |            | BLACKROCK INC                        | 260       | 302.71 | 78,704.60  |
|                            |            | CAPITAL ONE FINANCIAL CORP           | 1,008     | 73.00  | 73,584.00  |
|                            |            | CITIGROUP INC                        | 5,210     | 52.11  | 271,493.10 |
|                            |            | CME GROUP INC                        | 510       | 81.03  | 41,325.30  |
|                            |            | DISCOVER FINANCIAL SERVICES-W/I      | 820       | 53.47  | 43,845.40  |
|                            |            | EATON VANCE CORP                     | 200       | 41.80  | 8,360.00   |
|                            |            | FRANKLIN RESOURCES INC               | 690       | 55.70  | 38,433.00  |
|                            |            | GOLDMAN SACHS GROUP INC              | 700       | 167.67 | 117,369.00 |
|                            |            | INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP INC   | 172       | 217.37 | 37,387.64  |
|                            |            | INVESCO LTD                          | 838       | 35.67  | 29,891.46  |
|                            |            | JPMORGAN CHASE & CO                  | 6,496     | 56.51  | 367,088.96 |
|                            |            | LEGG MASON INC                       | 250       | 40.20  | 10,050.00  |
|                            |            | LEUCADIA NATIONAL CORPORATION        | 450       | 28.04  | 12,618.00  |
|                            |            | MCGRAW HILL FINANCIAL INC            | 500       | 74.29  | 37,145.00  |
|                            |            | MOODY'S CORPORATION                  | 350       | 73.42  | 25,697.00  |
|                            |            | MORGAN ST DEAN WITTER & CO           | 2,490     | 30.39  | 75,671.10  |
|                            |            | NASDAQ OMX GROUP                     | 250       | 38.91  | 9,727.50   |
|                            |            | NORTHERN TRUST CORP                  | 370       | 58.95  | 21,811.50  |
|                            |            | RAYMOND JAMES FINANCIAL INC          | 100       | 49.02  | 4,902.00   |
|                            |            | SCHWAB (CHARELES) CORP               | 1,950     | 25.04  | 48,828.00  |
|                            |            | SEI INVESTMENT COMPANY               | 300       | 33.94  | 10,182.00  |
|                            |            | SLM CORP                             | 750       | 26.66  | 19,995.00  |
|                            |            | STATE STREET CORP                    | 785       | 71.82  | 56,378.70  |
|                            |            | T ROWE PRICE GROUP INC               | 410       | 80.06  | 32,824.60  |
|                            |            | TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION    | 400       | 29.15  | 11,660.00  |
|                            |            | ACE LTD                              | 590       | 101.60 | 59,944.00  |
|                            |            | AFLAC INC                            | 750       | 66.45  | 49,837.50  |
|                            |            | ALLSTATE CORP                        | 770       | 54.11  | 41,664.70  |
|                            |            | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP         | 2,400     | 49.56  | 118,944.00 |
|                            |            | AON PLC                              | 550       | 82.90  | 45,595.00  |
|                            |            | ARCH CAPITAL GROUP LTD               | 180       | 58.63  | 10,553.40  |
|                            |            | ASSURANT INC                         | 165       | 65.21  | 10,759.65  |
|                            |            | AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD            | 150       | 48.46  | 7,269.00   |
|                            |            | CHUBB CORP                           | 490       | 94.77  | 46,437.30  |
|                            |            | CINCINNATI FINANCIAL CORP            | 310       | 52.24  | 16,194.40  |
|                            |            | EVEREST RE GROUP LTD                 | 80        | 153.89 | 12,311.20  |
|                            |            | FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-CL A | 400       | 29.54  | 11,816.00  |
|                            |            | HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP          | 800       | 36.15  | 28,920.00  |
|                            |            | LINCOLN NATIONAL CORP                | 429       | 51.70  | 22,179.30  |
|                            |            | LOEWS CORP                           | 550       | 47.57  | 26,163.50  |
|                            |            | MARSH & MCLENNAN COS                 | 950       | 48.31  | 45,894.50  |
|                            |            | METLIFE INC                          | 1,650     | 51.70  | 85,305.00  |
|                            |            | PARTNERRE LTD                        | 20        | 101.20 | 2,024.00   |
|                            |            | PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC        | 500       | 49.39  | 24,695.00  |
|                            |            | PROGRESSIVE CORP                     | 980       | 27.51  | 26,959.80  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC   | 800        | 88.98                                | 71,184.00 |        |            |
| RENAISSANCEWE HOLDINGS LTD | 100        | 94.67                                | 9,467.00  |        |            |
| THE TRAVELERS COS INC      | 616        | 88.45                                | 54,485.20 |        |            |
| TORCHMARK CORP             | 140        | 76.94                                | 10,771.60 |        |            |
| UNUM GROUP                 | 500        | 34.30                                | 17,150.00 |        |            |
| WILLIS GROUP HOLDINGS PLC  | 340        | 45.04                                | 15,313.60 |        |            |

| 種類                   | 通貨         | 銘柄                                | 株数        | 評価額単価    | 評価額金額      |
|----------------------|------------|-----------------------------------|-----------|----------|------------|
| 株式                   | アメリカ<br>ドル | WR BERKLEY CORP                   | 175       | 43.49    | 7,610.75   |
|                      |            | XL GROUP PLC                      | 500       | 30.94    | 15,470.00  |
|                      |            | CBRE GROUP INC                    | 500       | 25.41    | 12,705.00  |
|                      |            | REALOGY HOLDINGS CORP             | 100       | 48.05    | 4,805.00   |
|                      |            | ACCENTURE PLC-CL A                | 1,050     | 75.13    | 78,886.50  |
|                      |            | ACTIVISION BLIZZARD INC           | 800       | 17.30    | 13,840.00  |
|                      |            | ADOBE SYSTEMS INC                 | 820       | 55.44    | 45,460.80  |
|                      |            | AKAMAI TECHNOLOGIES               | 270       | 44.35    | 11,974.50  |
|                      |            | ALLIANCE DATA SYSTEMS CORPORATION | 70        | 245.84   | 17,208.80  |
|                      |            | ANSYS INC                         | 100       | 85.93    | 8,593.00   |
|                      |            | AUTODESK INC                      | 420       | 46.78    | 19,647.60  |
|                      |            | AUTOMATIC DATA PROCESSING         | 850       | 79.01    | 67,158.50  |
|                      |            | CA INC                            | 520       | 32.83    | 17,071.60  |
|                      |            | CITRIX SYSTEMS INC                | 350       | 59.33    | 20,765.50  |
|                      |            | COGNIZANT TECH SOLUTIONS          | 480       | 94.80    | 45,504.00  |
|                      |            | COMPUTER SCIENCES CORP            | 220       | 53.34    | 11,734.80  |
|                      |            | EBAY INC                          | 2,040     | 51.69    | 105,447.60 |
|                      |            | ELECTRONIC ARTS INC               | 500       | 22.19    | 11,095.00  |
|                      |            | EQUINIX INC                       | 80        | 168.36   | 13,468.80  |
|                      |            | FACEBOOK INC-A                    | 2,900     | 48.84    | 141,636.00 |
|                      |            | FIDELITY NATIONAL INFORMATION     | 520       | 50.86    | 26,447.20  |
|                      |            | FISERV INC                        | 240       | 111.12   | 26,668.80  |
|                      |            | GOOGLE INC-CL A                   | 510       | 1,078.14 | 549,851.40 |
|                      |            | INTL BUSINESS MACHINES CORP       | 1,780     | 177.46   | 315,878.80 |
|                      |            | INTUIT INC                        | 450       | 74.40    | 33,480.00  |
|                      |            | LEIDOS HOLDINGS INC               | 150       | 41.57    | 6,235.50   |
|                      |            | LINKEDIN CORP - A                 | 150       | 234.81   | 35,221.50  |
|                      |            | MASTERCARD INC-CLASS A            | 200       | 758.86   | 151,772.00 |
|                      |            | MICROSOFT CORP                    | 13,710    | 38.70    | 530,645.55 |
|                      |            | NUANCE COMMUNICATIONS INC         | 500       | 14.19    | 7,095.00   |
|                      |            | ORACLE CORPORATION                | 6,050     | 35.60    | 215,380.00 |
|                      |            | PAYCHEX INC                       | 600       | 43.50    | 26,100.00  |
|                      |            | RACKSPACE HOSTING INC             | 200       | 33.25    | 6,650.00   |
|                      |            | RED HAT INC                       | 300       | 47.47    | 14,241.00  |
|                      |            | SALESFORCE.COM INC                | 960       | 53.68    | 51,532.80  |
|                      |            | SYMANTEC CORP                     | 1,100     | 22.58    | 24,838.00  |
|                      |            | SYNOPSIS INC                      | 260       | 37.75    | 9,815.00   |
|                      |            | TERADATA CORPORATION              | 270       | 41.97    | 11,331.90  |
|                      |            | TOTAL SYSTEM SERVICES INC         | 338       | 30.92    | 10,450.96  |
|                      |            | VERISIGN INC                      | 200       | 56.77    | 11,354.00  |
|                      |            | VISA INC                          | 890       | 201.59   | 179,415.10 |
|                      |            | VMWARC INC-CLASS A                | 150       | 87.10    | 13,065.00  |
|                      |            | WESTERN UNION COMPANY-W/I         | 831       | 16.71    | 13,886.01  |
|                      |            | YAHOO! INC                        | 1,750     | 38.87    | 68,022.50  |
|                      |            | AMPHENOL CORP-CL A                | 240       | 86.59    | 20,781.60  |
|                      |            | APPLE INC                         | 1,570     | 566.43   | 889,295.10 |
|                      |            | ARROW ELECTRONICS INC             | 220       | 52.60    | 11,572.00  |
|                      |            | AVNET INC                         | 300       | 41.39    | 12,417.00  |
|                      |            | CISCO SYSTEMS INC                 | 9,200     | 21.22    | 195,224.00 |
|                      |            | CORNING INC                       | 2,450     | 17.02    | 41,699.00  |
| EMC CORP/MASS        | 3,600      | 23.68                             | 85,248.00 |          |            |
| F5 NETWORKS INC      | 160        | 85.18                             | 13,628.80 |          |            |
| FLEXTRONICS INTL LTD | 842        | 7.32                              | 6,163.44  |          |            |
| FLIR SYSTEMS INC     | 250        | 28.98                             | 7,245.00  |          |            |
| HARRIS CORPORATION   | 210        | 66.63                             | 13,992.30 |          |            |
| HEWLETT-PACKARD CO.  | 3,350      | 27.25                             | 91,287.50 |          |            |

| 種類                 | 通貨         | 銘柄                           | 株数        | 評価額単価 | 評価額金額      |
|--------------------|------------|------------------------------|-----------|-------|------------|
| 株式                 | アメリカ<br>ドル | JUNIPER NETWORKS INC         | 900       | 21.68 | 19,512.00  |
|                    |            | MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 428       | 65.79 | 28,158.12  |
|                    |            | NETAPP INC                   | 570       | 41.26 | 23,518.20  |
|                    |            | QUALCOMM INC                 | 3,070     | 73.37 | 225,245.90 |
|                    |            | SANDISK CORP                 | 440       | 69.07 | 30,390.80  |
|                    |            | SEAGATE TECHNOLOGY           | 600       | 50.71 | 30,426.00  |
|                    |            | TE CONNECTIVITY LTD          | 725       | 53.45 | 38,751.25  |
|                    |            | TRIMBLE NAVIGATION LTD       | 400       | 32.39 | 12,956.00  |
|                    |            | WESTERN DIGITAL CORPORATION  | 400       | 78.80 | 31,520.00  |
|                    |            | XEROX CORP                   | 1,980     | 11.44 | 22,651.20  |
|                    |            | AT&T INC                     | 9,238     | 34.69 | 320,466.22 |
|                    |            | CENTURYLINK INC              | 1,054     | 31.52 | 33,222.08  |
|                    |            | CROWN CASTLE INTL CO         | 500       | 75.34 | 37,670.00  |
|                    |            | FRONTIER COMMUNICATIONS CORP | 1,008     | 4.56  | 4,601.52   |
|                    |            | LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC   | 100       | 30.48 | 3,048.00   |
|                    |            | SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A | 200       | 87.32 | 17,464.00  |
|                    |            | SPRINT CORP-W/I              | 1,597     | 7.99  | 12,760.03  |
|                    |            | T-MOBILE US INC              | 250       | 26.61 | 6,652.50   |
|                    |            | VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 4,970     | 49.57 | 246,362.90 |
|                    |            | WINDSTREAM HOLDINGS INC      | 800       | 8.05  | 6,440.00   |
|                    |            | AES CORPORATION              | 1,000     | 14.71 | 14,710.00  |
|                    |            | ALLIANT ENERGY CORPORATION   | 150       | 52.24 | 7,836.00   |
|                    |            | AMEREN CORPORATION           | 430       | 35.72 | 15,359.60  |
|                    |            | AMERICAN ELECTRIC POWER      | 850       | 46.72 | 39,712.00  |
|                    |            | AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 350       | 41.10 | 14,385.00  |
|                    |            | CALPINE CORP                 | 500       | 19.50 | 9,750.00   |
|                    |            | CENTERPOINT ENERGY INC       | 750       | 23.29 | 17,467.50  |
|                    |            | CMS ENERGY CORP              | 500       | 26.49 | 13,245.00  |
|                    |            | CONSOLIDATED EDISON INC      | 500       | 55.56 | 27,780.00  |
|                    |            | DOMINION RESOURCES INC/VA    | 1,010     | 63.74 | 64,377.40  |
|                    |            | DTE ENERGY COMPANY           | 240       | 67.22 | 16,132.80  |
|                    |            | DUKE ENERGY CORP             | 1,222     | 69.81 | 85,307.82  |
|                    |            | EDISON INTERNATIONAL         | 500       | 46.22 | 23,110.00  |
|                    |            | ENTERGY CORP                 | 320       | 62.40 | 19,968.00  |
|                    |            | EXELON CORPORATION           | 1,484     | 28.47 | 42,249.48  |
|                    |            | FIRSTENERGY CORP             | 686       | 32.48 | 22,281.28  |
|                    |            | INTEGRYS ENERGY GROUP INC    | 100       | 54.52 | 5,452.00   |
|                    |            | MDU RESOURCES GROUP INC      | 300       | 29.60 | 8,880.00   |
|                    |            | NEXTERA ENERGY INC           | 700       | 84.11 | 58,877.00  |
|                    |            | NISOURCE INC                 | 500       | 31.46 | 15,730.00  |
|                    |            | NORTHEAST UTILITIES          | 593       | 41.34 | 24,514.62  |
|                    |            | NRG ENERGY INC               | 500       | 28.73 | 14,365.00  |
|                    |            | OGE ENERGY CORP              | 200       | 34.35 | 6,870.00   |
|                    |            | ONEOK INC                    | 300       | 58.96 | 17,688.00  |
|                    |            | P G & E CORPORATION          | 770       | 41.16 | 31,693.20  |
|                    |            | PEPCO HOLDINGS INC           | 480       | 19.00 | 9,120.00   |
|                    |            | PINNACLE WEST CAPITAL        | 200       | 53.35 | 10,670.00  |
|                    |            | PPL CORPORATION              | 1,070     | 30.06 | 32,164.20  |
|                    |            | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 860       | 32.41 | 27,872.60  |
|                    |            | SCANA CORP                   | 260       | 47.37 | 12,316.20  |
| SEMPRA ENERGY      | 390        | 87.74                        | 34,218.60 |       |            |
| SOUTHERN CO        | 1,550      | 41.04                        | 63,612.00 |       |            |
| WISCONSIN ENERGY   | 400        | 41.61                        | 16,644.00 |       |            |
| XCEL ENERGY INC    | 900        | 28.18                        | 25,362.00 |       |            |
| ALTERA CORPORATION | 550        | 31.85                        | 17,517.50 |       |            |
| ANALOG DEVICES     | 550        | 49.01                        | 26,955.50 |       |            |

| 種類                           | 通貨     | 銘柄                        | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額      |  |                                  |
|------------------------------|--------|---------------------------|-----------|-----------|------------|--|----------------------------------|
| 株式                           | アメリカドル | APPLIED MATERIALS INC     | 2,000     | 16.83     | 33,660.00  |  |                                  |
|                              |        | AVAGO TECHNOLOGIES LTD    | 400       | 47.37     | 18,948.00  |  |                                  |
|                              |        | BROADCOM CORP-CL A        | 905       | 27.88     | 25,231.40  |  |                                  |
|                              |        | CREE INC                  | 250       | 58.05     | 14,512.50  |  |                                  |
|                              |        | INTEL CORP                | 8,650     | 24.93     | 215,644.50 |  |                                  |
|                              |        | KLA-TENCOR CORPORATION    | 230       | 62.78     | 14,439.40  |  |                                  |
|                              |        | LAM RESEARCH CORP         | 250       | 51.66     | 12,915.00  |  |                                  |
|                              |        | LINEAR TECHNOLOGY CORP    | 450       | 43.98     | 19,791.00  |  |                                  |
|                              |        | LSI CORP                  | 700       | 8.10      | 5,670.00   |  |                                  |
|                              |        | MARVELL TECHNOLOGY        | 510       | 13.42     | 6,844.20   |  |                                  |
|                              |        | MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 500       | 28.28     | 14,140.00  |  |                                  |
|                              |        | MICROCHIP TECHNOLOGY INC  | 400       | 43.31     | 17,324.00  |  |                                  |
|                              |        | MICRON TECHNOLOGY INC     | 1,700     | 23.12     | 39,304.00  |  |                                  |
|                              |        | NVIDIA CORP               | 1,050     | 15.20     | 15,965.25  |  |                                  |
|                              |        | TEXAS INSTRUMENTS INC     | 1,950     | 43.58     | 84,981.00  |  |                                  |
|                              |        | XILINX INC                | 450       | 44.24     | 19,908.00  |  |                                  |
|                              |        | 小計                        |           |           |            |  | 28,123,941.27<br>(2,906,609,330) |
|                              |        |                           |           | 銘柄数：      | 571        |  |                                  |
|                              |        |                           |           | 組入時価比率：   | 56.0%      |  | 59.6%                            |
|                              | カナダドル  | ARC RESOURCES LTD         | 558       | 28.82     | 16,081.56  |  |                                  |
| ATHABASCA OIL CORPORATION    |        | 600                       | 6.52      | 3,912.00  |            |  |                                  |
| BAYTEX ENERGY CORPORAION     |        | 230                       | 41.61     | 9,570.30  |            |  |                                  |
| CAMECO CORP                  |        | 636                       | 22.16     | 14,093.76 |            |  |                                  |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES   |        | 1,886                     | 34.58     | 65,217.88 |            |  |                                  |
| CANADIAN OIL SANDS LTD       |        | 800                       | 20.09     | 16,072.00 |            |  |                                  |
| CENOVUS ENERGY INC           |        | 1,354                     | 31.40     | 42,515.60 |            |  |                                  |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP   |        | 700                       | 40.28     | 28,196.00 |            |  |                                  |
| ENBRIDGE INC                 |        | 1,412                     | 43.93     | 62,029.16 |            |  |                                  |
| ENCANA CORP                  |        | 1,204                     | 20.53     | 24,718.12 |            |  |                                  |
| ENERPLUS CORP                |        | 350                       | 19.35     | 6,772.50  |            |  |                                  |
| HUSKY ENERGY INC             |        | 690                       | 31.08     | 21,445.20 |            |  |                                  |
| IMPERIAL OIL LTD             |        | 519                       | 46.52     | 24,143.88 |            |  |                                  |
| MEG ENERGY CORP              |        | 250                       | 29.47     | 7,367.50  |            |  |                                  |
| PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP |        | 450                       | 18.45     | 8,302.50  |            |  |                                  |
| PEMBINA PIPELINE CORP        |        | 600                       | 34.00     | 20,400.00 |            |  |                                  |
| PENGROWTH ENERGY CORPORATION |        | 600                       | 6.62      | 3,972.00  |            |  |                                  |
| PENN WEST PETROLEUM LTD      |        | 666                       | 9.30      | 6,193.80  |            |  |                                  |
| SUNCOR ENERGY INC            |        | 2,697                     | 35.81     | 96,579.57 |            |  |                                  |
| TALISMAN ENERGY INC          |        | 1,753                     | 12.41     | 21,754.73 |            |  |                                  |
| TOURMALINE OIL CORP          |        | 200                       | 44.40     | 8,880.00  |            |  |                                  |
| TRANSCANADA CORP             |        | 1,268                     | 47.08     | 59,697.44 |            |  |                                  |
| VERMILION ENERGY INC         |        | 210                       | 60.50     | 12,705.00 |            |  |                                  |
| AGNICO EAGLE MINES           |        | 361                       | 27.58     | 9,956.38  |            |  |                                  |
| AGRIUM INC                   |        | 269                       | 96.25     | 25,891.25 |            |  |                                  |
| BARRICK GOLD CORP            |        | 1,893                     | 17.01     | 32,199.93 |            |  |                                  |
| ELDORADO GOLD CORP           |        | 800                       | 6.07      | 4,856.00  |            |  |                                  |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD   |        | 1,044                     | 17.55     | 18,322.20 |            |  |                                  |
| FRANCO-NEVADA CORP           |        | 250                       | 40.78     | 10,195.00 |            |  |                                  |
| GOLDCORP INC                 |        | 1,473                     | 22.40     | 32,995.20 |            |  |                                  |
| KINROSS GOLD CORP            |        | 1,511                     | 4.86      | 7,343.46  |            |  |                                  |
| NEW GOLD INC                 |        | 100                       | 5.21      | 521.00    |            |  |                                  |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN  |        | 1,564                     | 33.25     | 52,003.00 |            |  |                                  |
| SILVER WHEATON CORP          | 700    | 21.72                     | 15,204.00 |           |            |  |                                  |
| TECK RESOURCES LTD-CL B      | 1,054  | 25.21                     | 26,571.34 |           |            |  |                                  |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 650    | 3.57                      | 2,320.50  |           |            |  |                                  |

| 種類 | 通貨    | 銘柄   | 株数    | 評価額単価   | 評価額金額      |  |                               |
|----|-------|--|-------|---------|------------|--|-------------------------------|
| 株式 | カナダドル | TURQUOISE HILL RESOURCES LTD RIGHTS        | 650   | 1.08    | 702.00     |  |                               |
|    |       | YAMANA GOLD INC                            | 1,300 | 9.34    | 12,142.00  |  |                               |
|    |       | BOMBARDIER INC 'B'                         | 1,679 | 4.66    | 7,824.14   |  |                               |
|    |       | CAE INC                                    | 400   | 12.25   | 4,900.00   |  |                               |
|    |       | FINNING INTERNATIONAL INC                  | 370   | 25.30   | 9,361.00   |  |                               |
|    |       | SNC-LAVALIN GROUP INC                      | 277   | 46.00   | 12,742.00  |  |                               |
|    |       | CANADIAN NATL RAILWAY CO                   | 1,448 | 59.87   | 86,691.76  |  |                               |
|    |       | CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD               | 291   | 162.70  | 47,345.70  |  |                               |
|    |       | MAGNA INTERNATIONAL INC                    | 414   | 85.88   | 35,554.32  |  |                               |
|    |       | GILDAN ACTIVIWEAR                          | 210   | 55.15   | 11,581.50  |  |                               |
|    |       | TIM HORTONS INC                            | 280   | 62.20   | 17,416.00  |  |                               |
|    |       | SHAW COMMUNICATIONS INC-B                  | 624   | 25.36   | 15,824.64  |  |                               |
|    |       | THOMSON REUTERS CORP                       | 667   | 39.69   | 26,473.23  |  |                               |
|    |       | CANADIAN TIRE CORP -CL A                   | 134   | 98.95   | 13,259.30  |  |                               |
|    |       | ALIMENTATION COUCHE-TARD INC               | 250   | 76.78   | 19,195.00  |  |                               |
|    |       | EMPIRE COMPANY LTD                         | 50    | 73.80   | 3,690.00   |  |                               |
|    |       | LOBLAW COMPANIES LTD                       | 239   | 43.14   | 10,310.46  |  |                               |
|    |       | METRO INC                                  | 160   | 62.68   | 10,028.80  |  |                               |
|    |       | SHOPPERS DRUG MART CORP                    | 334   | 58.42   | 19,512.28  |  |                               |
|    |       | WESTON (GEORGE) LTD                        | 65    | 78.94   | 5,131.10   |  |                               |
|    |       | SAPUTO INC                                 | 240   | 47.97   | 11,512.80  |  |                               |
|    |       | CATAMARAN CORPORATION                      | 400   | 47.35   | 18,940.00  |  |                               |
|    |       | VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL      | 550   | 114.79  | 63,134.50  |  |                               |
|    |       | BANK OF MONTREAL                           | 1,078 | 70.35   | 75,837.30  |  |                               |
|    |       | BANK OF NOVA SCOTIA                        | 2,109 | 64.21   | 135,418.89 |  |                               |
|    |       | CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE                | 656   | 90.84   | 59,591.04  |  |                               |
|    |       | NATIONAL BANK OF CANADA                    | 213   | 89.91   | 19,150.83  |  |                               |
|    |       | ROYAL BANK OF CANADA                       | 2,482 | 69.75   | 173,119.50 |  |                               |
|    |       | TORONTO-DOMINION BANK                      | 1,596 | 96.33   | 153,742.68 |  |                               |
|    |       | CI FINANCIAL CORP                          | 350   | 33.83   | 11,840.50  |  |                               |
|    |       | IGM FINANCIAL INC                          | 187   | 53.75   | 10,051.25  |  |                               |
|    |       | ONEX CORPORATION                           | 115   | 56.92   | 6,545.80   |  |                               |
|    |       | GREAT-WEST LIFECO INC                      | 590   | 32.20   | 18,998.00  |  |                               |
|    |       | INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FIN      | 200   | 48.76   | 9,752.00   |  |                               |
|    |       | INTACT FINANCIAL CORP                      | 250   | 68.36   | 17,090.00  |  |                               |
|    |       | MANULIFE FINANCIAL CORP                    | 3,130 | 20.20   | 63,226.00  |  |                               |
|    |       | POWER CORP OF CANADA                       | 664   | 31.50   | 20,916.00  |  |                               |
|    |       | POWER FINANCIAL CORP                       | 422   | 35.65   | 15,044.30  |  |                               |
|    |       | SUN LIFE FINANCIAL INC                     | 1,068 | 36.81   | 39,313.08  |  |                               |
|    |       | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC-CLASS<br>A | 1,010 | 41.07   | 41,480.70  |  |                               |
|    |       | BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC           | 488   | 20.57   | 10,038.16  |  |                               |
|    |       | CGI GROUP INC                              | 399   | 35.97   | 14,352.03  |  |                               |
|    |       | OPEN TEXT CORP                             | 100   | 94.30   | 9,430.00   |  |                               |
|    |       | BLACKBERRY LIMITED                         | 350   | 6.11    | 2,138.50   |  |                               |
|    |       | BCE INC                                    | 494   | 46.80   | 23,119.20  |  |                               |
|    |       | BELL ALIANT INC                            | 100   | 27.35   | 2,735.00   |  |                               |
|    |       | ROGERS COMMUNICATIONS -CL B                | 670   | 48.28   | 32,347.60  |  |                               |
|    |       | TELUS CORP                                 | 400   | 36.67   | 14,668.00  |  |                               |
|    |       | CANADIAN UTILITIES LTD                     | 260   | 36.50   | 9,490.00   |  |                               |
|    |       | FORTIS INC                                 | 400   | 31.48   | 12,592.00  |  |                               |
|    |       | TRANSALTA CORP                             | 517   | 13.71   | 7,088.07   |  |                               |
|    |       | 小計   |       |         |            |  | 2,291,388.72<br>(222,516,758) |
|    |       |  |       | 銘柄数：    | 87         |  |                               |
|    |       |  |       | 組入時価比率： | 4.3%       |  | 4.6%                          |

| 種類                                  | 通貨    | 銘柄                            | 株数         | 評価額単価  | 評価額金額      |
|-------------------------------------|-------|-------------------------------|------------|--------|------------|
| 株式                                  | ユーロ   | CGG                           | 235        | 14.34  | 3,369.90   |
|                                     |       | ENI SPA                       | 4,436      | 17.09  | 75,811.24  |
|                                     |       | FUGRO NV-CVA                  | 108        | 43.00  | 4,644.54   |
|                                     |       | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHARES | 522        | 11.61  | 6,060.42   |
|                                     |       | KONINKLIJKE VOPAK NV          | 111        | 42.64  | 4,733.04   |
|                                     |       | NESTE OIL OYJ                 | 150        | 13.33  | 1,999.50   |
|                                     |       | OMV AG                        | 294        | 35.11  | 10,323.81  |
|                                     |       | REPSOL SA                     | 1,515      | 18.27  | 27,679.05  |
|                                     |       | SAIPEM SPA                    | 451        | 16.40  | 7,396.40   |
|                                     |       | TECHNIP SA                    | 195        | 72.16  | 14,071.20  |
|                                     |       | TENARIS SA                    | 854        | 16.25  | 13,877.50  |
|                                     |       | TOTAL SA                      | 3,730      | 42.96  | 160,240.80 |
|                                     |       | AIR LIQUIDE                   | 529        | 98.16  | 51,926.64  |
|                                     |       | AKZO NOBEL                    | 432        | 53.12  | 22,947.84  |
|                                     |       | ARCELORMITTAL                 | 1,813      | 12.42  | 22,526.52  |
|                                     |       | ARKEMA                        | 109        | 79.47  | 8,662.23   |
|                                     |       | BASF SE                       | 1,602      | 75.62  | 121,143.24 |
|                                     |       | CRH PLC                       | 1,309      | 17.58  | 23,012.22  |
|                                     |       | HEIDELBERGCEMENT AG           | 249        | 53.65  | 13,358.85  |
|                                     |       | IMERYS SA                     | 58         | 59.29  | 3,438.82   |
|                                     |       | K+S AG                        | 319        | 20.99  | 6,695.81   |
|                                     |       | KONINKLIJKE DSM NV            | 271        | 56.42  | 15,289.82  |
|                                     |       | LAFARGE SA                    | 348        | 49.67  | 17,286.90  |
|                                     |       | LANXESS AG                    | 168        | 45.82  | 7,698.60   |
|                                     |       | LINDE AG                      | 318        | 148.35 | 47,175.30  |
|                                     |       | SOLVAY SA                     | 109        | 108.55 | 11,831.95  |
|                                     |       | STORA ENSO OYJ-R SHS          | 823        | 6.98   | 5,744.54   |
|                                     |       | THYSSEN KRUPP AG              | 706        | 17.29  | 12,206.74  |
|                                     |       | UMICORE                       | 217        | 32.42  | 7,035.14   |
|                                     |       | UPM-KYMMENE OYJ               | 884        | 11.97  | 10,581.48  |
|                                     |       | VOESTALPINE AG                | 195        | 33.94  | 6,618.30   |
|                                     |       | ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV   | 304        | 22.50  | 6,840.00   |
|                                     |       | ALSTOM RGPT                   | 340        | 25.87  | 8,795.80   |
|                                     |       | ANDRITZ AG                    | 118        | 44.62  | 5,265.75   |
|                                     |       | BOUYGUES                      | 368        | 25.93  | 9,542.24   |
|                                     |       | BRENTAG AG                    | 80         | 129.10 | 10,328.00  |
|                                     |       | CNH INDUSTRIAL NV             | 1,831      | 7.69   | 14,080.39  |
|                                     |       | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN     | 745        | 36.89  | 27,486.77  |
|                                     |       | EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE   | 1,001      | 50.49  | 50,540.49  |
|                                     |       | FERROVIAL SA                  | 740        | 13.95  | 10,323.00  |
|                                     |       | FINMECCANICA SPA              | 923        | 5.15   | 4,758.06   |
|                                     |       | GEA GROUP AG                  | 338        | 33.25  | 11,240.19  |
|                                     |       | HOCHTIEF AG                   | 40         | 59.71  | 2,388.40   |
|                                     |       | KONE OYJ                      | 558        | 32.55  | 18,162.90  |
| KONINKLIJKE BOSKALIS WESTMINSTER NV | 140   | 36.84                         | 5,157.60   |        |            |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV              | 1,686 | 25.29                         | 42,638.94  |        |            |
| LEGRAND SA                          | 495   | 39.84                         | 19,720.80  |        |            |
| MAN SE                              | 57    | 89.05                         | 5,075.85   |        |            |
| METSO OYJ                           | 223   | 28.39                         | 6,330.97   |        |            |
| OSRAM LICHT AG                      | 169   | 41.18                         | 6,960.26   |        |            |
| PRYSMIAN SPA                        | 317   | 18.63                         | 5,905.71   |        |            |
| SAFRAN S.A.                         | 463   | 48.59                         | 22,497.17  |        |            |
| SCHNEIDER ELECTRIC SA               | 940   | 60.00                         | 56,400.00  |        |            |
| SIEMENS AG                          | 1,383 | 94.60                         | 130,831.80 |        |            |
| THALES                              | 152   | 43.35                         | 6,589.96   |        |            |
| VALLOUREC                           | 167   | 39.73                         | 6,635.74   |        |            |

| 種類                          | 通貨    | 銘柄   | 株数        | 評価額単価  | 評価額金額      |
|-----------------------------|-------|--|-----------|--------|------------|
| 株式                          | ユーロ   | VINCI S.A.                                 | 850       | 45.53  | 38,700.50  |
|                             |       | WARTSILA OYJ                               | 339       | 34.08  | 11,553.12  |
|                             |       | ZARDOYA OTIS SA                            | 337       | 12.34  | 4,158.58   |
|                             |       | ZODIAC AEROSPACE                           | 51        | 123.65 | 6,306.15   |
|                             |       | BIC  | 41        | 86.00  | 3,526.00   |
|                             |       | BUREAU VERITAS SA                          | 402       | 20.77  | 8,351.55   |
|                             |       | EDENRED                                    | 378       | 25.38  | 9,593.64   |
|                             |       | RANDSTAD HOLDING                           | 207       | 43.83  | 9,073.84   |
|                             |       | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA                | 756       | 15.64  | 11,823.84  |
|                             |       | AEROPORTS DE PARIS                         | 62        | 80.70  | 5,003.40   |
|                             |       | ATLANTIA SPA                               | 607       | 16.23  | 9,851.61   |
|                             |       | DEUTSCHE LUFTHANSA-REG                     | 380       | 15.36  | 5,836.80   |
|                             |       | DEUTSCHE POST AG                           | 1,540     | 25.30  | 38,969.70  |
|                             |       | FRAPORT AG                                 | 57        | 54.11  | 3,084.27   |
|                             |       | GROUPE EUROTUNNEL SA                       | 639       | 7.12   | 4,554.79   |
|                             |       | INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES<br>GRP | 1,082     | 4.37   | 4,734.83   |
|                             |       | RYANAIR HOLDINGS PLC                       | 644       | 6.10   | 3,933.55   |
|                             |       | TNT EXPRESS NV - W/I                       | 500       | 6.30   | 3,150.00   |
|                             |       | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG                | 565       | 82.11  | 46,392.15  |
|                             |       | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG                | 101       | 61.20  | 6,181.20   |
|                             |       | CONTINENTAL AG                             | 190       | 154.95 | 29,440.50  |
|                             |       | DAIMLER AG-REG                             | 1,683     | 59.64  | 100,374.12 |
|                             |       | FIAT SPA                                   | 1,621     | 5.41   | 8,777.71   |
|                             |       | MICHELIN (CGDE)-B                          | 336       | 77.12  | 25,912.32  |
|                             |       | NOKIAN RENKAAT OYJ                         | 211       | 34.75  | 7,332.25   |
|                             |       | PIRELLI & C                                | 485       | 11.39  | 5,524.15   |
|                             |       | PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE               | 280       | 73.16  | 20,484.80  |
|                             |       | RENAULT SA                                 | 330       | 60.45  | 19,948.50  |
|                             |       | VALEO SA                                   | 82        | 76.89  | 6,304.98   |
|                             |       | VOLKSWAGEN AG                              | 56        | 186.85 | 10,463.60  |
|                             |       | VOLKSWAGEN AG PFD                          | 256       | 193.70 | 49,587.20  |
|                             |       | ADIDAS AG                                  | 353       | 87.76  | 30,979.28  |
|                             |       | CHRISTIAN DIOR                             | 87        | 134.00 | 11,658.00  |
|                             |       | KERING                                     | 129       | 152.65 | 19,691.85  |
|                             |       | LUXOTTICA GROUP SPA                        | 286       | 36.74  | 10,507.64  |
|                             |       | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI               | 443       | 131.00 | 58,033.00  |
|                             |       | ACCOR SA                                   | 283       | 32.94  | 9,323.43   |
|                             |       | SODEXO                                     | 170       | 72.54  | 12,331.80  |
|                             |       | AXEL SPRINGER SE                           | 80        | 44.60  | 3,568.40   |
|                             |       | EUTELSAT COMMUNICATIONS                    | 269       | 21.67  | 5,829.23   |
|                             |       | JC DECAUX SA                               | 80        | 28.01  | 2,241.20   |
|                             |       | KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG               | 42        | 96.52  | 4,053.84   |
|                             |       | LAGARDERE S.C.A.                           | 206       | 24.53  | 5,054.21   |
|                             |       | PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG                   | 61        | 33.46  | 2,041.36   |
|                             |       | PUBLICIS GROUPE                            | 305       | 64.04  | 19,532.20  |
|                             |       | REED ELSEVIER NV                           | 1,194     | 15.22  | 18,178.65  |
|                             |       | SES  | 491       | 21.95  | 10,779.90  |
|                             |       | WOLTERS KLUWER-CVA                         | 543       | 20.34  | 11,044.62  |
|                             |       | INDITEX                                    | 374       | 115.95 | 43,365.30  |
|                             |       | CARREFOUR SA                               | 1,065     | 27.40  | 29,181.00  |
| CASINO GUICHARD PERRACHON   | 111   | 80.01                                      | 8,881.11  |        |            |
| COLRUYT SA                  | 136   | 39.69                                      | 5,398.52  |        |            |
| DELHAIZE 'LE LION'          | 142   | 41.19                                      | 5,849.69  |        |            |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL | 1,090 | 6.28                                       | 6,852.83  |        |            |
| JERONIMO MARTINS            | 399   | 14.52                                      | 5,795.47  |        |            |
| KONINKLIJKE AHOLD NV        | 1,780 | 12.79                                      | 22,766.20 |        |            |



| 種類               | 通貨    | 銘柄                               | 株数         | 評価額単価  | 評価額金額      |
|------------------|-------|----------------------------------|------------|--------|------------|
| 株式               | ユーロ   | METRO AG                         | 225        | 34.92  | 7,857.00   |
|                  |       | ANHEUSER-BUSCH INBEV NV          | 1,401      | 74.42  | 104,262.42 |
|                  |       | DANONE                           | 970        | 52.23  | 50,663.10  |
|                  |       | HEINEKEN HOLDING NV              | 168        | 45.72  | 7,681.80   |
|                  |       | HEINEKEN NV                      | 386        | 49.20  | 18,991.20  |
|                  |       | KERRY GROUP PLC-A                | 257        | 48.73  | 12,523.61  |
|                  |       | PERNOD-RICARD                    | 383        | 80.96  | 31,007.68  |
|                  |       | SUEDZUCKER AG                    | 180        | 19.03  | 3,426.30   |
|                  |       | UNILEVER NV-CVA                  | 2,841      | 28.94  | 82,218.54  |
|                  |       | BEIERSDORF AG                    | 161        | 74.39  | 11,976.79  |
|                  |       | HENKEL AG & CO KGAA              | 211        | 71.22  | 15,027.42  |
|                  |       | HENKEL AG & CO KGAA              | 305        | 80.54  | 24,564.70  |
|                  |       | L'OREAL                          | 409        | 127.25 | 52,045.25  |
|                  |       | ESSILOR INTERNATIONAL            | 344        | 74.41  | 25,597.04  |
|                  |       | FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO   | 370        | 51.35  | 18,999.50  |
|                  |       | FRESENIUS SE & CO KGAA           | 207        | 106.05 | 21,952.35  |
|                  |       | BAYER AG                         | 1,402      | 96.98  | 135,965.96 |
|                  |       | ELAN CORPORATION PLC             | 995        | 13.27  | 13,208.62  |
|                  |       | GRIFOLS SA                       | 273        | 32.96  | 8,999.44   |
|                  |       | MERCK KGAA                       | 113        | 128.00 | 14,464.00  |
|                  |       | ORION OYJ                        | 236        | 19.53  | 4,609.08   |
|                  |       | QIAGEN N.V.                      | 376        | 17.01  | 6,395.76   |
|                  |       | SANOFI                           | 2,048      | 73.66  | 150,855.68 |
|                  |       | UCB SA                           | 210        | 49.33  | 10,360.35  |
|                  |       | BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA     | 2,509      | 0.17   | 429.03     |
|                  |       | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA  | 10,067     | 8.47   | 85,307.75  |
|                  |       | BANCO DE SABADELL SA             | 4,006      | 1.78   | 7,162.72   |
|                  |       | BANCO ESPIRITO SANTO-REG         | 4,184      | 1.01   | 4,234.20   |
|                  |       | BANCO POPULAR ESPANOL            | 1,647      | 4.14   | 6,831.75   |
|                  |       | BANCO SANTANDER SA               | 19,419     | 6.28   | 122,048.41 |
|                  |       | BANK OF IRELAND                  | 6,780      | 0.26   | 1,762.80   |
|                  |       | BNP PARIBAS                      | 1,736      | 53.38  | 92,667.68  |
|                  |       | CAIXABANK                        | 1,387      | 3.53   | 4,900.27   |
|                  |       | CAIXABANK-RTS                    | 1,387      | 0.05   | 72.12      |
|                  |       | COMMERZBANK AG                   | 1,442      | 10.70  | 15,436.61  |
|                  |       | CREDIT AGRICOLE SA               | 1,721      | 9.08   | 15,628.40  |
|                  |       | ERSTE GROUP BANK AG              | 487        | 25.00  | 12,177.43  |
|                  |       | INTESA SANPAOLO                  | 19,537     | 1.70   | 33,212.90  |
|                  |       | KBC GROUPE                       | 357        | 40.26  | 14,372.82  |
|                  |       | NATIXIS                          | 1,260      | 3.93   | 4,951.80   |
|                  |       | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | 7          | 25.24  | 176.68     |
|                  |       | SOCIETE GENERALE-A               | 1,257      | 40.65  | 51,103.33  |
|                  |       | UNICREDIT SPA                    | 7,589      | 5.20   | 39,500.74  |
|                  |       | UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA   | 1,426      | 4.80   | 6,850.50   |
|                  |       | DEUTSCHE BANK AG-REG             | 1,778      | 34.10  | 60,629.80  |
|                  |       | DEUTSCHE BOERSE AG               | 313        | 55.65  | 17,418.45  |
|                  |       | EURAZEO                          | 42         | 55.10  | 2,314.20   |
|                  |       | EXOR SPA                         | 116        | 27.56  | 3,196.96   |
|                  |       | GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA      | 128        | 64.22  | 8,220.16   |
|                  |       | ING GROEP N.V.                   | 6,542      | 9.28   | 60,722.84  |
| MEDIOBANCA SPA   | 1,159 | 6.11                             | 7,087.28   |        |            |
| POHJOLA BANK PLC | 300   | 14.16                            | 4,248.00   |        |            |
| WENDEL           | 65    | 104.70                           | 6,805.50   |        |            |
| AEGON NV         | 2,989 | 6.41                             | 19,174.43  |        |            |
| AGEAS            | 387   | 30.05                            | 11,631.28  |        |            |
| ALLIANZ SE-REG   | 808   | 126.00                           | 101,808.00 |        |            |

| 種類                       | 通貨    | 銘柄  | 株数        | 評価額単価  | 評価額金額                         |
|--------------------------|-------|---|-----------|--------|-------------------------------|
| 株式                       | ユーロ   | ASSICURAZIONI GENERALI                      | 2,018     | 16.46  | 33,216.28                     |
|                          |       | AXA SA                                      | 3,039     | 18.45  | 56,069.55                     |
|                          |       | CNP ASSURANCES                              | 272       | 13.05  | 3,550.96                      |
|                          |       | DELTA LLOYDS NV                             | 200       | 17.62  | 3,524.00                      |
|                          |       | HANNOVER RUECK SE                           | 105       | 60.58  | 6,360.90                      |
|                          |       | MAPFRE SA                                   | 717       | 2.83   | 2,029.11                      |
|                          |       | MUENCHENER RUECKVER AG-REG                  | 310       | 157.35 | 48,778.50                     |
|                          |       | SAMPO OYJ                                   | 684       | 33.20  | 22,708.80                     |
|                          |       | SCOR SE                                     | 247       | 24.82  | 6,130.54                      |
|                          |       | VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER<br>VERSICH | 80        | 34.60  | 2,768.00                      |
|                          |       | IMMOFINANZ AG                               | 1,673     | 3.38   | 5,668.12                      |
|                          |       | AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS                 | 670       | 27.59  | 18,488.65                     |
|                          |       | ATOS  | 113       | 62.07  | 7,013.91                      |
|                          |       | CAP GEMINI SA                               | 261       | 46.99  | 12,264.39                     |
|                          |       | DASSAULT SYSTEMES SA                        | 119       | 85.32  | 10,153.08                     |
|                          |       | SAP AG                                      | 1,607     | 59.74  | 96,002.18                     |
|                          |       | UNITED INTERNET AG                          | 152       | 29.34  | 4,459.68                      |
|                          |       | ALCATEL-LUCENT                              | 3,854     | 3.36   | 12,961.00                     |
|                          |       | GEMALTO NV                                  | 100       | 76.17  | 7,617.00                      |
|                          |       | NOKIA                                       | 6,396     | 5.91   | 37,800.36                     |
|                          |       | BELGACOM SA                                 | 274       | 20.25  | 5,549.87                      |
|                          |       | DEUTSCHE TELEKOM REGD                       | 4,886     | 11.57  | 56,531.02                     |
|                          |       | ELISA CORP-A SHARES                         | 285       | 17.95  | 5,115.75                      |
|                          |       | ILIAD SA                                    | 33        | 172.55 | 5,694.15                      |
|                          |       | KONINKLIJKE KPN NV                          | 2,216     | 2.31   | 5,127.82                      |
|                          |       | ORANGE S.A.                                 | 3,178     | 8.99   | 28,589.28                     |
|                          |       | PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG                | 1,426     | 3.25   | 4,634.50                      |
|                          |       | TELECOM ITALIA SPA                          | 16,184    | 0.67   | 10,908.01                     |
|                          |       | TELECOM ITALIA-RNC                          | 8,306     | 0.53   | 4,422.94                      |
|                          |       | TELEFONICA S.A.                             | 7,142     | 11.50  | 82,133.00                     |
|                          |       | TELEKOM AUSTRIA AG                          | 300       | 5.86   | 1,760.40                      |
|                          |       | VIVENDI SA                                  | 1,997     | 17.58  | 35,107.26                     |
|                          |       | ZIGGO NV                                    | 156       | 30.88  | 4,817.28                      |
|                          |       | E.ON SE                                     | 3,093     | 13.60  | 42,064.80                     |
|                          |       | ELECTRICITE DE FRANCE                       | 392       | 26.64  | 10,442.88                     |
|                          |       | ENAGAS                                      | 358       | 19.05  | 6,819.90                      |
|                          |       | ENEL GREEN POWER SPA                        | 2,379     | 1.70   | 4,065.71                      |
|                          |       | ENEL SPA                                    | 11,515    | 3.12   | 35,995.89                     |
|                          |       | ENERGIAS DE PORTUGAL SA                     | 3,085     | 2.69   | 8,298.65                      |
|                          |       | FORTUM OYJ                                  | 790       | 16.88  | 13,335.20                     |
|                          |       | GAS NATURAL SDG SA                          | 577       | 17.59  | 10,152.31                     |
|                          |       | GDF SUEZ                                    | 2,192     | 16.81  | 36,858.48                     |
|                          |       | IBERDROLA SA                                | 7,692     | 4.47   | 34,429.39                     |
|                          |       | RED ELECTRICA CORPORATION SA                | 211       | 45.09  | 9,513.99                      |
|                          |       | RWE AG                                      | 846       | 27.10  | 22,926.60                     |
|                          |       | SNAM SPA                                    | 3,488     | 3.77   | 13,163.71                     |
|                          |       | SUEZ ENVIRONNEMENT SA                       | 460       | 12.47  | 5,738.50                      |
| TERNA SPA                | 2,096 | 3.47  | 7,273.12  |        |                               |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT     | 475   | 11.24                                       | 5,341.37  |        |                               |
| ASML HOLDING NV          | 623   | 67.13                                       | 41,821.99 |        |                               |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 1,695 | 7.53  | 12,771.82 |        |                               |
| STMICROELECTRONICS NV    | 1,003 | 5.45  | 5,466.35  |        |                               |
| 小計                       |       |   |           |        | 4,751,928.89<br>(674,583,825) |
|                          |       | 銘柄数：  | 220       |        |                               |
|                          |       | 組入時価比率：                                     | 13.0%     |        | 13.8%                         |

| 種類                        | 通貨          | 銘柄                              | 株数        | 評価額単価 | 評価額金額      |
|---------------------------|-------------|---------------------------------|-----------|-------|------------|
| 株式                        | イギリス<br>ポンド | AMEC PLC                        | 650       | 11.03 | 7,169.50   |
|                           |             | BG GROUP PLC                    | 5,937     | 12.37 | 73,470.37  |
|                           |             | BP PLC                          | 32,516    | 4.76  | 155,036.28 |
|                           |             | PETROFAC LIMITED                | 539       | 11.74 | 6,327.86   |
|                           |             | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS     | 6,664     | 20.72 | 138,111.40 |
|                           |             | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS     | 4,341     | 21.66 | 94,047.76  |
|                           |             | TULLOW OIL PLC                  | 1,572     | 8.69  | 13,668.54  |
|                           |             | ANGLO AMERICAN PLC              | 2,530     | 13.24 | 33,509.85  |
|                           |             | ANTOFAGASTA PLC                 | 855       | 7.61  | 6,510.82   |
|                           |             | BILLITON PLC                    | 3,650     | 18.44 | 67,306.00  |
|                           |             | CRODA INTERNATIONAL PLC         | 212       | 23.02 | 4,880.24   |
|                           |             | FRESNILLO PLC                   | 291       | 7.42  | 2,159.22   |
|                           |             | GLENCORE XSTRATA PLC            | 18,079    | 3.07  | 55,665.24  |
|                           |             | JOHNSON MATTHEY PLC             | 375       | 31.49 | 11,808.75  |
|                           |             | RANDGOLD RESOURCES LTD          | 174       | 39.77 | 6,919.98   |
|                           |             | REXAM PLC                       | 985       | 4.82  | 4,750.65   |
|                           |             | RIO TINTO PLC                   | 2,217     | 32.90 | 72,950.38  |
|                           |             | BAE SYSTEMS PLC                 | 5,527     | 4.16  | 23,008.90  |
|                           |             | BUNZL PLC                       | 591       | 13.66 | 8,073.06   |
|                           |             | COBHAM PLC                      | 911       | 2.61  | 2,384.99   |
|                           |             | IMI PLC                         | 300       | 14.55 | 4,365.00   |
|                           |             | INVENSYS PLC                    | 968       | 4.99  | 4,831.28   |
|                           |             | MEGGITT PLC                     | 918       | 4.98  | 4,572.55   |
|                           |             | MELROSE INDUSTRIES PLC          | 1,000     | 2.89  | 2,891.00   |
|                           |             | ROLLS-ROYCE HOLDINGS C-SHARE    | 310,030   | 0.00  | 310.03     |
|                           |             | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC        | 3,239     | 12.06 | 39,062.34  |
|                           |             | SMITHS GROUP PLC                | 702       | 13.78 | 9,673.56   |
|                           |             | TRAVIS PERKINS PLC              | 213       | 17.41 | 3,708.33   |
|                           |             | WEIR GROUP PLC                  | 406       | 20.72 | 8,412.32   |
|                           |             | WOLSELEY PLC                    | 499       | 31.58 | 15,758.42  |
|                           |             | AGGREKO PLC                     | 470       | 16.00 | 7,520.00   |
|                           |             | BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC | 608       | 12.82 | 7,794.56   |
|                           |             | CAPITA PLC                      | 1,238     | 10.05 | 12,441.90  |
|                           |             | EXPERIAN PLC                    | 1,882     | 11.13 | 20,946.66  |
|                           |             | G4S PLC                         | 2,004     | 2.60  | 5,228.43   |
|                           |             | INTERTEK GROUP PLC              | 288       | 29.57 | 8,516.16   |
|                           |             | SERCO GROUP PLC                 | 564       | 4.40  | 2,484.42   |
|                           |             | GKN PLC                         | 2,235     | 3.64  | 8,135.40   |
|                           |             | BURBERRY GROUP PLC              | 765       | 14.96 | 11,444.40  |
|                           |             | PERSIMMON PLC                   | 334       | 11.83 | 3,951.22   |
|                           |             | CARNIVAL PLC                    | 386       | 21.49 | 8,295.14   |
|                           |             | COMPASS GROUP PLC               | 3,125     | 9.21  | 28,796.87  |
|                           |             | INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP   | 478       | 19.00 | 9,082.00   |
|                           |             | TUI TRAVEL PLC                  | 137       | 3.84  | 526.08     |
|                           |             | WHITBREAD PLC                   | 348       | 35.25 | 12,267.00  |
|                           |             | WILLIAM HILL PLC-W/I            | 806       | 3.78  | 3,046.68   |
|                           |             | BRITISH SKY BROADCASTING PLC    | 1,788     | 8.00  | 14,304.00  |
|                           |             | ITV PLC                         | 5,295     | 1.83  | 9,721.62   |
|                           |             | PEARSON PLC                     | 1,414     | 12.86 | 18,184.04  |
|                           |             | REED ELSEVIER PLC               | 2,034     | 8.69  | 17,675.46  |
| WPP PLC                   | 2,422       | 13.18                           | 31,921.96 |       |            |
| KINGFISHER PLC            | 3,473       | 3.65                            | 12,690.34 |       |            |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC | 2,583       | 4.61                            | 11,907.63 |       |            |
| NEXT PLC                  | 256         | 54.50                           | 13,952.00 |       |            |
| MORRISON(WM) SUPERMARKETS | 3,082       | 2.60                            | 8,022.44  |       |            |
| SAINSBURY (J) PLC         | 1,775       | 3.86                            | 6,853.27  |       |            |

| 種類                   | 通貨                 | 銘柄                              | 株数         | 評価額単価    | 評価額金額                         |
|----------------------|--------------------|---------------------------------|------------|----------|-------------------------------|
| 株式                   | イギリス<br>ポンド        | TESCO PLC                       | 13,585     | 3.33     | 45,326.35                     |
|                      |                    | ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC    | 624        | 22.65    | 14,133.60                     |
|                      |                    | BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC    | 3,318      | 31.81    | 105,562.17                    |
|                      |                    | DIAGEO PLC                      | 4,378      | 19.25    | 84,276.50                     |
|                      |                    | IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC      | 1,675      | 22.75    | 38,106.25                     |
|                      |                    | SABMILLER PLC                   | 1,662      | 30.84    | 51,264.39                     |
|                      |                    | TATE & LYLE PLC                 | 806        | 7.79     | 6,282.77                      |
|                      |                    | UNILEVER PLC                    | 2,238      | 24.75    | 55,390.50                     |
|                      |                    | RECKITT BENCKISER GROUP PLC     | 1,124      | 47.81    | 53,738.44                     |
|                      |                    | SMITH & NEPHEW PLC              | 1,567      | 8.50     | 13,319.50                     |
|                      |                    | ASTRAZENECA PLC                 | 2,184      | 34.74    | 75,883.08                     |
|                      |                    | GLAXOSMITHKLINE PLC             | 8,465      | 15.99    | 135,397.67                    |
|                      |                    | SHIRE PLC                       | 974        | 27.31    | 26,599.94                     |
|                      |                    | BARCLAYS PLC                    | 24,154     | 2.65     | 64,213.40                     |
|                      |                    | HSBC HOLDINGS PLC               | 32,531     | 6.57     | 213,956.38                    |
|                      |                    | LLOYDS BANKING GROUP PLC        | 80,025     | 0.78     | 62,579.55                     |
|                      |                    | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP    | 3,036      | 3.36     | 10,225.24                     |
|                      |                    | STANDARD CHARTERED PLC          | 4,299      | 13.14    | 56,488.86                     |
|                      |                    | 3I GROUP PLC                    | 1,497      | 3.70     | 5,541.89                      |
|                      |                    | ABERDEEN ASSET MGMT PLC         | 1,414      | 4.71     | 6,661.35                      |
|                      |                    | ICAP PLC                        | 741        | 4.31     | 3,198.89                      |
|                      |                    | INVESTEC PLC                    | 523        | 4.20     | 2,198.16                      |
|                      |                    | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 284        | 16.18    | 4,595.12                      |
|                      |                    | SCHRODERS PLC                   | 161        | 24.41    | 3,930.01                      |
|                      |                    | ADMIRAL GROUP PLC               | 352        | 12.15    | 4,276.80                      |
|                      |                    | AVIVA PLC                       | 4,664      | 4.28     | 20,003.89                     |
|                      |                    | LEGAL & GENERAL GROUP PLC       | 9,645      | 2.06     | 19,916.92                     |
|                      |                    | OLD MUTUAL PLC                  | 7,344      | 1.87     | 13,755.31                     |
|                      |                    | PRUDENTIAL PLC                  | 4,563      | 12.66    | 57,767.58                     |
|                      |                    | RESOLUTION LTD                  | 1,753      | 3.29     | 5,772.62                      |
|                      |                    | RSA INSURANCE GROUP PLC         | 5,063      | 1.00     | 5,088.31                      |
|                      |                    | STANDARD LIFE PLC               | 3,445      | 3.41     | 11,754.34                     |
|                      | SAGE GROUP PLC/THE | 1,653                           | 3.71       | 6,145.85 |                               |
| BT GROUP PLC         | 13,537             | 3.71                            | 50,249.34  |          |                               |
| INMARSAT PLC         | 737                | 7.30                            | 5,383.78   |          |                               |
| VODAFONE GROUP PLC   | 81,563             | 2.33                            | 190,408.82 |          |                               |
| CENTRICA PLC         | 8,607              | 3.27                            | 28,187.92  |          |                               |
| NATIONAL GRID PLC    | 6,504              | 7.50                            | 48,812.52  |          |                               |
| SEVERN TRENT PLC     | 423                | 16.65                           | 7,042.95   |          |                               |
| SSE PLC              | 1,666              | 13.00                           | 21,658.00  |          |                               |
| UNITED UTILITIES PLC | 939                | 6.46                            | 6,070.63   |          |                               |
| ARM HOLDINGS PLC     | 2,537              | 10.11                           | 25,649.07  |          |                               |
|                      | 小計                 |                                 |            |          | 2,843,868.96<br>(482,633,001) |
|                      |                    | 銘柄数 :                           | 98         |          |                               |
|                      |                    | 組入時価比率 :                        | 9.3%       |          | 9.9%                          |
| 株式                   | スイス<br>フラン         | TRANSOCEAN LTD                  | 649        | 44.04    | 28,581.96                     |
|                      |                    | GIVAUDAN-REG                    | 15         | 1,231.00 | 18,465.00                     |
|                      |                    | HOLCIM LTD-REG                  | 379        | 64.75    | 24,540.25                     |
|                      |                    | SIKA AG                         | 4          | 2,909.00 | 11,636.00                     |
|                      |                    | SYNGENTA AG-REGISTERED          | 161        | 347.80   | 55,995.80                     |
|                      |                    | ABB LTD                         | 3,834      | 22.60    | 86,648.40                     |
|                      |                    | GEBERIT AG-REG                  | 65         | 259.10   | 16,841.50                     |
|                      |                    | SCHINDLER HOLDING AG-REG        | 51         | 126.40   | 6,446.40                      |
|                      |                    | SCHINDLER HOLDING-PART CERT     | 89         | 124.80   | 11,107.20                     |
|                      |                    | SULZER AG-REG                   | 48         | 137.20   | 6,585.60                      |

| 種類                           | 通貨                  | 銘柄                                   | 株数      | 評価額単価      | 評価額金額      |                               |
|------------------------------|---------------------|--------------------------------------|---------|------------|------------|-------------------------------|
| 株式                           | スイス<br>フラン          | ADECCO SA-REG                        | 227     | 67.00      | 15,209.00  |                               |
|                              |                     | SGS SA                               | 9       | 2,010.00   | 18,090.00  |                               |
|                              |                     | KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG           | 100     | 115.10     | 11,510.00  |                               |
|                              |                     | CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-(REGD) A | 897     | 88.45      | 79,339.65  |                               |
|                              |                     | THE SWATCH GROUP AG-B                | 52      | 584.00     | 30,368.00  |                               |
|                              |                     | THE SWATCH GROUP AG-REG              | 86      | 99.90      | 8,591.40   |                               |
|                              |                     | ARYZTA AG                            | 139     | 65.70      | 9,132.30   |                               |
|                              |                     | LINDT & SPRUENGLI AG                 | 2       | 3,962.00   | 7,924.00   |                               |
|                              |                     | NESTLE SA-REGISTERED                 | 5,444   | 65.45      | 356,309.80 |                               |
|                              |                     | SONOVA HOLDING AG                    | 79      | 122.90     | 9,709.10   |                               |
|                              |                     | ACTELION LTD                         | 202     | 72.65      | 14,675.30  |                               |
|                              |                     | LONZA AG-REG                         | 81      | 81.90      | 6,633.90   |                               |
|                              |                     | NOVARTIS AG-REG SHS                  | 3,968   | 69.90      | 277,363.20 |                               |
|                              |                     | ROCHE HOLDING AG-GENUSSS             | 1,213   | 243.00     | 294,759.00 |                               |
|                              |                     | CREDIT SUISSE GROUP-REG AG           | 2,617   | 26.13      | 68,382.21  |                               |
|                              |                     | JULIUS BAER GROUP LTD                | 393     | 42.00      | 16,506.00  |                               |
|                              |                     | PARGESA HOLDING SA                   | 37      | 69.20      | 2,560.40   |                               |
|                              |                     | UBS AG REG                           | 6,360   | 16.73      | 106,402.80 |                               |
|                              |                     | BALOISE HOLDINGS AG                  | 85      | 104.60     | 8,891.00   |                               |
|                              |                     | SWISS LIFE HOLDING AG                | 53      | 180.80     | 9,582.40   |                               |
|                              |                     | SWISS RE LTD                         | 609     | 78.65      | 47,897.85  |                               |
|                              |                     | ZURICH INSURANCE GROUP AG            | 260     | 250.20     | 65,052.00  |                               |
|                              | SWISS PRIME SITE AG | 46                                   | 68.40   | 3,146.40   |            |                               |
|                              | SWISSCOM AG-REG     | 44                                   | 452.90  | 19,927.60  |            |                               |
|                              | 小計                  |                                      |         |            |            | 1,754,811.42<br>(203,680,961) |
|                              |                     |                                      | 銘柄数：    | 34         |            |                               |
|                              |                     |                                      | 組入時価比率： | 3.9%       |            | 4.2%                          |
|                              | スウェーデ<br>ンクローネ      | LUNDIN PETROLEUM AB                  | 463     | 130.20     | 60,282.60  |                               |
|                              |                     | BOLIDEN AB                           | 572     | 92.50      | 52,910.00  |                               |
|                              |                     | ALFA LAVAL AB                        | 623     | 148.90     | 92,764.70  |                               |
|                              |                     | ASSA ABLOY AB-B                      | 549     | 324.00     | 177,876.00 |                               |
|                              |                     | ATLAS COPCO AB-A SHS                 | 1,251   | 175.80     | 219,925.80 |                               |
|                              |                     | ATLAS COPCO AB-B SHS                 | 674     | 159.50     | 107,503.00 |                               |
|                              |                     | SANDVIK AB                           | 1,716   | 87.15      | 149,549.40 |                               |
| SCANIA AB-B SHS              |                     | 663                                  | 126.30  | 83,736.90  |            |                               |
| SKANSKA AB-B SHS             |                     | 652                                  | 123.90  | 80,782.80  |            |                               |
| SKF AB-B SHS                 |                     | 700                                  | 175.80  | 123,060.00 |            |                               |
| VOLVO AB-B SHS               |                     | 2,613                                | 84.10   | 219,753.30 |            |                               |
| SECURITAS AB-B SHS           |                     | 319                                  | 66.90   | 21,341.10  |            |                               |
| ELECTROLUX AB-SER B          |                     | 478                                  | 157.00  | 75,046.00  |            |                               |
| HUSQVARNA AB-B SHS           |                     | 499                                  | 37.48   | 18,702.52  |            |                               |
| HENNES & MAURITZ             |                     | 1,641                                | 279.60  | 458,823.60 |            |                               |
| SWEDISH MATCH AB             |                     | 360                                  | 200.30  | 72,108.00  |            |                               |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS   |                     | 1,033                                | 188.20  | 194,410.60 |            |                               |
| ELEKTA AB-B SHS              |                     | 696                                  | 94.95   | 66,085.20  |            |                               |
| GETINGE AB-B SHS             |                     | 384                                  | 209.00  | 80,256.00  |            |                               |
| NORDEA BANK AB               |                     | 5,219                                | 82.95   | 432,916.05 |            |                               |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A |                     | 2,462                                | 79.80   | 196,467.60 |            |                               |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  |                     | 848                                  | 298.90  | 253,467.20 |            |                               |
| SWEDBANK AB                  |                     | 1,565                                | 167.80  | 262,607.00 |            |                               |
| INDUSTRIVARDEN AB-C          |                     | 147                                  | 119.40  | 17,551.80  |            |                               |
| INVESTOR AB                  |                     | 780                                  | 210.30  | 164,034.00 |            |                               |
| KINNEVIK INVESTMENT AB-B     |                     | 373                                  | 255.00  | 95,115.00  |            |                               |
| ERICSSON LM TEL, SEK1 SER B  |                     | 5,246                                | 80.00   | 419,680.00 |            |                               |
| HEXAGON AB-B SHS             |                     | 415                                  | 197.00  | 81,755.00  |            |                               |

| 種類                   | 通貨             | 銘柄                                 | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額                        |  |                              |
|----------------------|----------------|------------------------------------|-----------|-----------|------------------------------|--|------------------------------|
| 株式                   | スウェーデン<br>クローネ | MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA | 99        | 587.00    | 58,113.00                    |  |                              |
|                      |                | TELE2 AB-B SHS                     | 532       | 74.10     | 39,421.20                    |  |                              |
|                      |                | TELIASONERA AB                     | 3,925     | 51.45     | 201,941.25                   |  |                              |
|                      | 小計             |                                    |           |           | 4,577,986.62<br>(72,423,748) |  |                              |
|                      |                | 銘柄数:                               | 31        |           |                              |  |                              |
|                      |                | 組入時価比率:                            | 1.4%      |           | 1.5%                         |  |                              |
| 株式                   | ノルウェー<br>クローネ  | AKER SOLUTIONS ASA                 | 372       | 105.10    | 39,097.20                    |  |                              |
|                      |                | SEADRILL LTD                       | 654       | 252.60    | 165,200.40                   |  |                              |
|                      |                | STATOIL ASA                        | 1,929     | 141.00    | 271,989.00                   |  |                              |
|                      |                | SUBSEA 7 SA                        | 571       | 117.00    | 66,807.00                    |  |                              |
|                      |                | NORSK HYDRO ASA                    | 1,069     | 25.22     | 26,960.18                    |  |                              |
|                      |                | YARA INTERNATIONAL ASA             | 294       | 272.60    | 80,144.40                    |  |                              |
|                      |                | ORKLA ASA                          | 863       | 47.13     | 40,673.19                    |  |                              |
|                      |                | DNB ASA                            | 1,748     | 104.60    | 182,840.80                   |  |                              |
|                      |                | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA          | 305       | 112.00    | 34,160.00                    |  |                              |
|                      |                | TELENOR ASA                        | 1,130     | 142.40    | 160,912.00                   |  |                              |
|                      |                |                                    | 小計        |           |                              |  | 1,068,784.17<br>(17,998,325) |
|                      |                |                                    |           | 銘柄数:      | 10                           |  |                              |
|                      |                | 組入時価比率:                            | 0.3%      |           | 0.4%                         |  |                              |
| 株式                   | デンマーク<br>クローネ  | A P MOLLER - MAERSK A/S            | 2         | 54,750.00 | 109,500.00                   |  |                              |
|                      |                | A P MOLLER - MAERSK A/S - A        | 1         | 51,400.00 | 51,400.00                    |  |                              |
|                      |                | DSV AS                             | 345       | 167.80    | 57,891.00                    |  |                              |
|                      |                | CARLSBERG AS-B                     | 199       | 594.00    | 118,206.00                   |  |                              |
|                      |                | COLOPLAST-B                        | 172       | 351.00    | 60,372.00                    |  |                              |
|                      |                | WILLIAM DEMANT HOLDING             | 39        | 524.00    | 20,436.00                    |  |                              |
|                      |                | NOVO NORDISK A/S-B                 | 694       | 975.00    | 676,650.00                   |  |                              |
|                      |                | NOVOZYMES A/S-B SHARES             | 370       | 206.70    | 76,479.00                    |  |                              |
|                      |                | DANSKE BANK A/S                    | 1,167     | 121.70    | 142,023.90                   |  |                              |
|                      |                | TDC A/S                            | 800       | 50.40     | 40,320.00                    |  |                              |
|                      | 小計             |                                    |           |           | 1,353,277.90<br>(25,752,878) |  |                              |
|                      |                | 銘柄数:                               | 10        |           |                              |  |                              |
|                      |                | 組入時価比率:                            | 0.5%      |           | 0.5%                         |  |                              |
| 株式                   | オーストラ<br>リアドル  | CATLEX AUSTRALIA LTD               | 282       | 18.53     | 5,225.46                     |  |                              |
|                      |                | ORIGIN ENERGY LIMITED              | 1,897     | 13.48     | 25,571.56                    |  |                              |
|                      |                | SANTOS LIMITED                     | 1,755     | 14.43     | 25,324.65                    |  |                              |
|                      |                | WOODSIDE PETROLEUM LTD             | 1,139     | 37.40     | 42,598.60                    |  |                              |
|                      |                | WORLEY PERSONS LIMITED             | 513       | 15.85     | 8,131.05                     |  |                              |
|                      |                | ALUMINA LIMITED                    | 3,400     | 1.03      | 3,502.00                     |  |                              |
|                      |                | AMCOR LIMITED                      | 2,329     | 11.04     | 25,712.16                    |  |                              |
|                      |                | BHP BILLITON LTD                   | 5,600     | 36.77     | 205,912.00                   |  |                              |
|                      |                | BORAL LIMITED                      | 762       | 4.61      | 3,512.82                     |  |                              |
|                      |                | FORTESCUE METALS GROUP LIMITED     | 2,289     | 5.72      | 13,093.08                    |  |                              |
|                      |                | ILUKA RESOURCES LTD                | 513       | 8.72      | 4,473.36                     |  |                              |
|                      |                | INCITEC PIVOT LIMITED              | 1,192     | 2.37      | 2,825.04                     |  |                              |
|                      |                | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI    | 1,030     | 11.58     | 11,927.40                    |  |                              |
|                      |                | NEWCREST MINING LIMITED            | 1,270     | 7.20      | 9,144.00                     |  |                              |
|                      |                | ORICA LIMITED                      | 661       | 22.65     | 14,971.65                    |  |                              |
|                      |                | RIO TINTO LIMITED                  | 787       | 66.53     | 52,359.11                    |  |                              |
|                      |                | LEIGHTON HOLDINGS LIMITED          | 440       | 15.49     | 6,815.60                     |  |                              |
|                      |                | ALS LIMITED                        | 603       | 8.28      | 4,992.84                     |  |                              |
|                      |                | BRAMBLES LIMITED                   | 2,762     | 9.28      | 25,631.36                    |  |                              |
|                      |                | ASCIANO LTD                        | 1,317     | 5.57      | 7,335.69                     |  |                              |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 3,237          | 4.69                               | 15,181.53 |           |                              |  |                              |

| 種類 | 通貨          | 銘柄                                | 株数                             | 評価額単価 | 評価額金額      |                               |
|----|-------------|-----------------------------------|--------------------------------|-------|------------|-------------------------------|
| 株式 | オーストラリアドル   | QANTAS AIRWAYS LIMITED            | 1,000                          | 0.99  | 995.00     |                               |
|    |             | TOLL HOLDINGS LIMITED             | 422                            | 5.54  | 2,337.88   |                               |
|    |             | TRANSURBAN GROUP                  | 2,494                          | 6.84  | 17,058.96  |                               |
|    |             | CROWN RESORTS LTD                 | 792                            | 16.29 | 12,901.68  |                               |
|    |             | ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD      | 966                            | 2.40  | 2,318.40   |                               |
|    |             | TABCORP HOLDINGS LIMITED          | 914                            | 3.36  | 3,071.04   |                               |
|    |             | TATTS GROUP LTD                   | 897                            | 2.93  | 2,628.21   |                               |
|    |             | METCASH LTD                       | 979                            | 3.15  | 3,083.85   |                               |
|    |             | WESFARMERS LIMITED                | 1,718                          | 41.64 | 71,537.52  |                               |
|    |             | WOOLWORTHS LIMITED                | 2,180                          | 32.90 | 71,722.00  |                               |
|    |             | COCA-COLA AMATIL LIMITED          | 1,089                          | 12.00 | 13,068.00  |                               |
|    |             | COCHLEAR LTD                      | 77                             | 57.46 | 4,424.42   |                               |
|    |             | RAMSAY HEALTH CARE LTD            | 300                            | 39.02 | 11,706.00  |                               |
|    |             | SONIC HEALTHCARE LTD              | 852                            | 15.66 | 13,342.32  |                               |
|    |             | CSL LIMITED                       | 893                            | 66.82 | 59,670.26  |                               |
|    |             | AUST AND NZ BANKING GROUP LT      | 4,784                          | 30.75 | 147,108.00 |                               |
|    |             | BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED | 951                            | 10.79 | 10,261.29  |                               |
|    |             | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA    | 2,811                          | 74.90 | 210,543.90 |                               |
|    |             | NATIONAL AUSTRALIA BANK & LTD     | 4,096                          | 33.17 | 135,864.32 |                               |
|    |             | WESTPAC BANKING CORPORATION       | 5,423                          | 31.09 | 168,601.07 |                               |
|    |             | ASX LIMITED                       | 340                            | 36.04 | 12,253.60  |                               |
|    |             | MACQUARIE GROUP LIMITED           | 582                            | 51.55 | 30,002.10  |                               |
|    |             | AMP LIMITED                       | 4,783                          | 4.35  | 20,806.05  |                               |
|    |             | INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT      | 2,993                          | 5.72  | 17,119.96  |                               |
|    |             | QBE INSURANCE GROUP LIMITED       | 2,297                          | 12.00 | 27,564.00  |                               |
|    |             | SUNCORP GROUP LTD                 | 2,223                          | 12.50 | 27,787.50  |                               |
|    |             | LEND LEASE CORP LIMITED           | 1,094                          | 10.66 | 11,662.04  |                               |
|    |             | COMPUTERSHARE LIMITED             | 597                            | 10.86 | 6,483.42   |                               |
|    |             | TELSTRA CORPORATION LTD           | 7,552                          | 5.01  | 37,835.52  |                               |
|    |             | AGL ENERGY LTD                    | 958                            | 14.57 | 13,958.06  |                               |
|    |             | APA GROUP                         | 644                            | 6.12  | 3,941.28   |                               |
|    |             | SP AUSNET                         | 1,000                          | 1.12  | 1,120.00   |                               |
|    | 小計          |                                   |                                |       |            | 1,687,018.61<br>(158,444,787) |
|    |             |                                   | 銘柄数：                           | 53    |            |                               |
|    |             |                                   | 組入時価比率：                        | 3.1%  |            | 3.3%                          |
|    | ニューージーランドドル | 小計                                | FLETCHER BUILDING LTD          | 1,238 | 8.85       | 10,956.30                     |
|    |             |                                   | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD      | 1,776 | 3.54       | 6,287.04                      |
|    |             |                                   | TELECOM CORP OF NEW ZEALAND    | 4,231 | 2.33       | 9,858.23                      |
|    |             |                                   | CONTACT ENERGY LTD             | 408   | 5.05       | 2,060.40                      |
|    |             |                                   |                                |       |            |                               |
|    |             |                                   | 銘柄数：                           | 4     |            |                               |
|    |             |                                   | 組入時価比率：                        | 0.0%  |            | 0.1%                          |
|    | 香港ドル        |                                   | HOPEWELL HOLDINGS              | 1,000 | 26.10      | 26,100.00                     |
|    |             |                                   | HUTCHISON WHAMPOA              | 4,000 | 102.10     | 408,400.00                    |
|    |             |                                   | NWS HOLDINGS LIMITED           | 2,000 | 12.08      | 24,160.00                     |
|    |             |                                   | CATHAY PACIFIC AIRWAYS         | 1,000 | 16.26      | 16,260.00                     |
|    |             |                                   | MTR CORPORATION                | 2,500 | 29.90      | 74,750.00                     |
|    |             |                                   | LI & FUNG LTD                  | 8,600 | 10.30      | 88,580.00                     |
|    |             |                                   | YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG       | 1,000 | 24.10      | 24,100.00                     |
|    |             |                                   | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD | 4,000 | 63.95      | 255,800.00                    |
|    |             |                                   | SANDS CHINA LTD                | 4,000 | 62.90      | 251,600.00                    |
|    |             |                                   | SHANGRI-LA ASIA LTD            | 2,000 | 15.54      | 31,080.00                     |
|    |             |                                   | SJM HOLDINGS LTD               | 2,000 | 25.70      | 51,400.00                     |
|    |             | WYNN MACAU LTD                    | 2,400                          | 33.30 | 79,920.00  |                               |

| 種類                             | 通貨                           | 銘柄                          | 株数       | 評価額単価                   | 評価額金額      |           |                              |
|--------------------------------|------------------------------|-----------------------------|----------|-------------------------|------------|-----------|------------------------------|
| 株式                             | 香港ドル                         | BANK OF EAST ASIA           | 2,400    | 33.70                   | 80,880.00  |           |                              |
|                                |                              | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD  | 6,000    | 25.65                   | 153,900.00 |           |                              |
|                                |                              | HANG SENG BANK              | 1,700    | 126.60                  | 215,220.00 |           |                              |
|                                |                              | FIRST PACIFIC CO            | 2,000    | 8.70                    | 17,400.00  |           |                              |
|                                |                              | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 2,000    | 137.90                  | 275,800.00 |           |                              |
|                                |                              | AIA GROUP LTD               | 21,000   | 38.75                   | 813,750.00 |           |                              |
|                                |                              | CHEUNG KONG LTD             | 2,500    | 122.50                  | 306,250.00 |           |                              |
|                                |                              | HANG LUNG PROPERTIES LTD    | 4,000    | 25.25                   | 101,000.00 |           |                              |
|                                |                              | HENDERSON LAND DEVELOPMENT  | 2,250    | 43.80                   | 98,550.00  |           |                              |
|                                |                              | HYSAN DEVELOPMENT CO        | 1,500    | 34.50                   | 51,750.00  |           |                              |
|                                |                              | KERRY PROPERTIES            | 1,500    | 27.75                   | 41,625.00  |           |                              |
|                                |                              | NEW WORLD DEVELOPMENT       | 5,056    | 10.12                   | 51,166.72  |           |                              |
|                                |                              | SINO LAND CO                | 2,860    | 10.38                   | 29,686.80  |           |                              |
|                                |                              | SUN HUNG KAI PROPERTIES     | 3,000    | 97.40                   | 292,200.00 |           |                              |
|                                |                              | SWIRE PACIFIC LTD 'A'       | 1,500    | 92.45                   | 138,675.00 |           |                              |
|                                |                              | SWIRE PROPERTIES LTD        | 1,000    | 20.10                   | 20,100.00  |           |                              |
|                                |                              | THE WHARF HOLDINGS          | 2,500    | 61.85                   | 154,625.00 |           |                              |
|                                |                              | WHEELLOCK & CO LTD          | 2,000    | 35.95                   | 71,900.00  |           |                              |
|                                |                              | PCCW LIMITED                | 4,000    | 3.38                    | 13,520.00  |           |                              |
|                                |                              | CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE  | 1,000    | 50.90                   | 50,900.00  |           |                              |
|                                |                              | CLP HOLDINGS LIMITED        | 2,700    | 62.60                   | 169,020.00 |           |                              |
|                                |                              | HONG KONG & CHINA GAS       | 8,606    | 18.12                   | 155,940.72 |           |                              |
|                                |                              | POWER ASSETS HOLDINGS LTD   | 2,500    | 62.00                   | 155,000.00 |           |                              |
|                                |                              | ASM PACIFIC TECHNOLOGY      | 500      | 63.45                   | 31,725.00  |           |                              |
|                                |                              | 小計                          |          |                         |            |           | 4,822,734.24<br>(64,287,047) |
|                                |                              |                             |          | 銘柄数：                    | 36         |           |                              |
|                                |                              |                             |          | 組入時価比率：                 | 1.2%       |           | 1.3%                         |
|                                |                              | 株式                          | シンガポールドル | KEPPEL CORP             | 2,500      | 11.03     | 27,575.00                    |
|                                |                              |                             |          | NOBLE GROUP LTD         | 4,054      | 1.04      | 4,236.43                     |
|                                |                              |                             |          | SEBACORP INDUSTRIES LTD | 2,380      | 5.27      | 12,542.60                    |
|                                |                              |                             |          | SEBACORP MARINE LTD     | 2,400      | 4.30      | 10,320.00                    |
|                                | SINGAPORE TECH ENGINEERING   |                             |          | 3,000                   | 3.87       | 11,610.00 |                              |
|                                | YANGZIJIANG SHIPBUILDING     |                             |          | 2,000                   | 1.16       | 2,320.00  |                              |
|                                | COMFORTDELGRO CORP LTD       |                             |          | 2,000                   | 1.92       | 3,850.00  |                              |
|                                | SINGAPORE AIRLINES LTD       |                             |          | 940                     | 10.23      | 9,616.20  |                              |
|                                | GENTING SINGAPORE PLC        |                             |          | 7,000                   | 1.47       | 10,325.00 |                              |
|                                | SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD |                             |          | 3,000                   | 4.04       | 12,120.00 |                              |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD   | 9                            |                             |          | 34.50                   | 310.50     |           |                              |
| OLAM INTERNATIONAL LTD         | 2,000                        |                             |          | 1.47                    | 2,950.00   |           |                              |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LIMITED  | 6,600                        |                             |          | 0.55                    | 3,663.00   |           |                              |
| WILMAR INTERNATIONAL LIMITED   | 4,000                        |                             |          | 3.46                    | 13,840.00  |           |                              |
| DBS GROUP HLDG LTD             | 3,000                        |                             |          | 16.75                   | 50,250.00  |           |                              |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP   | 4,728                        |                             |          | 10.04                   | 47,469.12  |           |                              |
| UNITED OVERSEAS BANK           | 2,500                        |                             |          | 20.82                   | 52,050.00  |           |                              |
| SINGAPORE EXCHANGE             | 2,000                        |                             |          | 7.09                    | 14,180.00  |           |                              |
| CAPITALAND LIMITED             | 3,000                        |                             |          | 3.01                    | 9,030.00   |           |                              |
| CAPITAMALLS ASIA LTD           | 1,000                        |                             |          | 1.91                    | 1,915.00   |           |                              |
| CITY DEVELOPMENTS              | 500                          |                             |          | 9.79                    | 4,895.00   |           |                              |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD | 4,000                        |                             |          | 2.94                    | 11,760.00  |           |                              |
| KEPPEL LAND LTD                | 2,000                        |                             |          | 3.46                    | 6,920.00   |           |                              |
| UOL GROUP LTD                  | 1,100                        |                             |          | 5.95                    | 6,545.00   |           |                              |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS   | 14,020                       |                             |          | 3.62                    | 50,752.40  |           |                              |
| 小計                             |                              |                             |          |                         |            |           | 381,045.25<br>(31,504,821)   |
|                                |                              |                             |          | 銘柄数：                    | 25         |           |                              |
|                                |                              |                             |          | 組入時価比率：                 | 0.6%       |           | 0.6%                         |



| 種類 | 通貨            | 銘柄                          | 株数    | 評価額単価    | 評価額金額                            |
|----|---------------|-----------------------------|-------|----------|----------------------------------|
| 株式 | イスラエル<br>シュケル | DELEK GROUP LIMITED         | 10    | 1,290.00 | 12,900.00                        |
|    |               | ISLAEL CORPORATION LTD      | 5     | 1,875.00 | 9,375.00                         |
|    |               | ISRAEL CHEMICALS LTD        | 1,100 | 29.50    | 32,450.00                        |
|    |               | TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD | 1,500 | 138.50   | 207,750.00                       |
|    |               | BANK HAPOLIM BM             | 2,200 | 19.95    | 43,890.00                        |
|    |               | BANK LEUMI LE-ISRAEL        | 3,000 | 14.47    | 43,410.00                        |
|    |               | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD    | 300   | 44.30    | 13,290.00                        |
|    |               | NICE SYSTEM LTD             | 140   | 140.70   | 19,698.00                        |
|    |               | BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP  | 2,500 | 6.02     | 15,050.00                        |
|    |               | 小計                          |       |          |                                  |
|    |               | 銘柄数:                        | 9     |          |                                  |
|    |               | 組入時価比率:                     | 0.2%  |          | 0.2%                             |
| 合計 |               |                             |       |          | 4,874,696,137<br>(4,874,696,137) |

(注1) 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注2) 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 株式以外の有価証券

（平成25年12月10日現在）

| 種類   | 通貨              | 銘柄                                  | 銘柄数比率  | 口数                         | 評価額金額                    |
|------|-----------------|-------------------------------------|--------|----------------------------|--------------------------|
| 投資証券 | アメリカドル          | AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP        |        | 650                        | 12,870.00                |
|      |                 | AMERICAN TOWER CORP                 |        | 690                        | 54,399.60                |
|      |                 | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC       |        | 1,500                      | 15,015.00                |
|      |                 | AVALONBAY COMMUNITIES INC           |        | 207                        | 25,276.77                |
|      |                 | BOSTON PROPERTIES INC               |        | 220                        | 22,440.00                |
|      |                 | CAMDEN PROPERTY TRUST               |        | 100                        | 5,940.00                 |
|      |                 | DIGITAL REALTY TRUST INC            |        | 250                        | 11,407.50                |
|      |                 | DUKE REALTY CORP                    |        | 600                        | 9,024.00                 |
|      |                 | EQUITY RESIDENTIAL PROPS TR         |        | 620                        | 33,157.60                |
|      |                 | FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST     |        | 40                         | 4,159.20                 |
|      |                 | GENERAL GROWTH PROPERTIES INC       |        | 717                        | 15,178.89                |
|      |                 | HCP INC                             |        | 850                        | 31,339.50                |
|      |                 | HEALTH CARE REIT INC                |        | 530                        | 29,351.40                |
|      |                 | HOST HOTELS & RESORTS INC           |        | 1,196                      | 22,185.80                |
|      |                 | KIMCO REALTY CORP                   |        | 750                        | 15,832.50                |
|      |                 | LIBERTY PROPERTY TRUST              |        | 300                        | 10,107.00                |
|      |                 | MACERICH CO                         |        | 250                        | 15,085.00                |
|      |                 | PLUM CREEK TIMBER CO                |        | 350                        | 15,694.00                |
|      |                 | PROLOGIS INC                        |        | 887                        | 33,643.91                |
|      |                 | PUBLIC STORAGE                      |        | 230                        | 35,696.00                |
|      |                 | RAYONIER INC                        |        | 200                        | 8,780.00                 |
|      |                 | REALTY INCOME CORPORATION           |        | 200                        | 7,466.00                 |
|      |                 | REGENCY CENTERS CORPORATION         |        | 180                        | 8,735.40                 |
|      |                 | SIMON PROPERTY GROUP INC            |        | 546                        | 83,942.04                |
|      |                 | SL GREEN REALTY CORP                |        | 120                        | 11,218.80                |
|      |                 | UDR INC                             |        | 400                        | 9,724.00                 |
|      |                 | VENTAS INC                          |        | 500                        | 28,630.00                |
|      |                 | VORNADO REALITY TRUST               |        | 296                        | 26,785.04                |
|      | WEYERHAEUSER CO |                                     | 1,030  | 30,982.40                  |                          |
| 小計   |                 |                                     | 14,409 | 634,067.35<br>(65,530,860) |                          |
|      |                 | 銘柄数 :                               | 29     |                            |                          |
|      |                 | 組入時価比率 :                            | 1.3%   |                            | 71.9%                    |
|      | カナダドル<br>小計     | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST |        | 304                        | 7,520.96                 |
|      |                 |                                     |        | 304                        | 7,520.96<br>(730,360)    |
|      |                 | 銘柄数 :                               | 1      |                            |                          |
|      |                 | 組入時価比率 :                            | 0.0%   |                            | 0.8%                     |
|      | ユーロ             | CORIO NV                            |        | 152                        | 4,829.80                 |
|      |                 | FONCIERE DES REGIONS                |        | 48                         | 2,983.68                 |
|      |                 | GECINA SA                           |        | 50                         | 4,750.00                 |
|      |                 | ICADE                               |        | 35                         | 2,325.40                 |
|      |                 | KLEPIERRE                           |        | 196                        | 6,580.70                 |
|      |                 | UNIBAIL-RODAMCO SE                  |        | 168                        | 31,525.20                |
|      | 小計              |                                     |        | 649                        | 52,994.78<br>(7,523,138) |
|      |                 | 銘柄数 :                               | 6      |                            |                          |
|      |                 | 組入時価比率 :                            | 0.1%   |                            | 8.3%                     |
|      | ポンド             | BRITISH LAND COMPANY PLC            |        | 1,408                      | 8,511.36                 |
|      |                 | HAMMERSON PLC                       |        | 1,162                      | 5,850.67                 |
|      |                 | INTU PROPERTIES PLC                 |        | 353                        | 1,114.77                 |
|      |                 | LAND SECURITIES GROUP               |        | 1,415                      | 13,407.12                |

| 種類   | 通貨                  | 銘柄                              | 銘柄数比率     | 口数              | 評価額金額                      |
|------|---------------------|---------------------------------|-----------|-----------------|----------------------------|
| 投資証券 | ポンド<br>小計           | SEGR0 PLC                       |           | 782             | 2,593.11                   |
|      |                     |                                 |           | 5,120           | 31,477.03<br>(5,341,966)   |
|      |                     | 銘柄数：<br>組入時価比率：                 | 5<br>0.1% |                 | 5.9%                       |
|      | オーストラリアドル<br><br>小計 | CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP |           | 1,971           | 3,794.17                   |
|      |                     | DEXUS PROPERTY GROUP            |           | 4,811           | 4,883.16                   |
|      |                     | GOODMAN GROUP                   |           | 2,623           | 12,065.80                  |
|      |                     | GPT GROUP                       |           | 1,674           | 5,708.34                   |
|      |                     | MIRVAC GROUP                    |           | 4,668           | 7,515.48                   |
|      |                     | STOCKLAND                       |           | 2,859           | 10,492.53                  |
|      |                     | WESTFIELD GROUP                 |           | 3,784           | 39,050.88                  |
|      |                     | WESTFIELD RETAIL TRUST          |           | 3,908           | 11,372.28                  |
|      |                     |                                 |           | 26,298          | 94,882.64<br>(8,911,377)   |
|      |                     |                                 |           | 銘柄数：<br>組入時価比率： | 8<br>0.2%                  |
|      | 香港ドル<br>小計          | LINK REIT                       |           | 4,000           | 152,600.00                 |
|      |                     |                                 |           | 4,000           | 152,600.00<br>(2,034,158)  |
|      |                     | 銘柄数：<br>組入時価比率：                 | 1<br>0.0% |                 | 2.2%                       |
|      | シンガポールドル<br><br>小計  | ASCENDAS REAL ESTATE            |           | 2,000           | 4,360.00                   |
|      |                     | CAPITACOMMERCIAL TRUST          |           | 2,000           | 2,810.00                   |
|      |                     | CAPITAMALL TRUST                |           | 3,000           | 5,610.00                   |
|      |                     |                                 |           | 7,000           | 12,780.00<br>(1,056,650)   |
|      |                     | 銘柄数：<br>組入時価比率：                 | 3<br>0.0% |                 | 1.2%                       |
|      | 合計                  |                                 |           |                 | 91,128,509<br>(91,128,509) |

（注1）通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

（注2）合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

（注3）比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

## 「PRU海外債券マザーファンド」の状況

なお、以下に掲載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

(単位：円)

| 区 分         | 注記<br>番号 | (平成24年12月10日現在) | (平成25年12月10日現在) |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
|             |          | 金 額             | 金 額             |
| 資産の部        |          |                 |                 |
| 流動資産        |          |                 |                 |
| 預金          |          | 83,601,296      | -               |
| コール・ローン     |          | 76,621,641      | 88,943,189      |
| 国債証券        |          | 9,320,768,309   | 6,921,157,586   |
| 派生商品評価勘定    |          | 28,712,281      | 41,167,802      |
| 未収入金        |          | -               | 59,235,570      |
| 未収利息        |          | 83,510,307      | 69,557,024      |
| 前払費用        |          | 4,273,009       | 9,986,715       |
| 流動資産合計      |          | 9,597,486,843   | 7,190,047,886   |
| 資産合計        |          | 9,597,486,843   | 7,190,047,886   |
| 負債の部        |          |                 |                 |
| 流動負債        |          |                 |                 |
| 派生商品評価勘定    |          | 28,500,283      | 36,924,040      |
| 未払金         |          | 17,388,567      | 12,598,325      |
| 未払解約金       |          | 39,484,856      | 49,674,823      |
| 流動負債合計      |          | 85,373,706      | 99,197,188      |
| 負債合計        |          | 85,373,706      | 99,197,188      |
| 純資産の部       |          |                 |                 |
| 元本等         |          |                 |                 |
| 元本          | 1        | 6,026,327,475   | 3,514,453,950   |
| 剰余金         |          |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金( ) |          | 3,485,785,662   | 3,576,396,748   |
| 元本等合計       |          | 9,512,113,137   | 7,090,850,698   |
| 純資産合計       |          | 9,512,113,137   | 7,090,850,698   |
| 負債純資産合計     |          | 9,597,486,843   | 7,190,047,886   |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                           |  |
|---------------------------|--|
| 1．有価証券の評価基準及び評価方法         | 国債証券<br>個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、または価格情報会社の提供する価額に基づいて評価しております。 |
| 2．デリバティブ等の評価基準及び評価方法      | 為替予約取引<br>原則としてわが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。<br>直物為替先渡取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。                             |
| 3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br>外貨建取引については「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令133号）第60条及び第61条に基づき処理しております。   |

## （貸借対照表に関する注記）

| （平成24年12月10日現在）  | （平成25年12月10日現在）  |
|--|--|
| 1 1. 本報告書における開示対象ファンドの<br>期首における当該親投資信託の元本額<br>6,269,266,505円      | 1 1. 本報告書における開示対象ファンドの<br>期首における当該親投資信託の元本額<br>6,026,327,475円      |
| 同期中における追加設定元本額<br>303,650,657円                                     | 同期中における追加設定元本額<br>276,942,543円                                     |
| 同期中における解約元本額<br>546,589,687円                                       | 同期中における解約元本額<br>2,788,816,068円                                     |
| 同期末における元本の内訳<br>PRU海外債券マーケット・パフォーマー<br>5,659,678,579円              | 同期末における元本の内訳<br>PRU海外債券マーケット・パフォーマー<br>3,228,284,894円              |
| PRUグッドライフ2020<br>2,105,728円  | PRUグッドライフ2020<br>1,209,585円  |
| PRUグッドライフ2030<br>875,260円  | PRUグッドライフ2030<br>622,091円  |
| PRUグッドライフ2040<br>1,150,029円  | PRUグッドライフ2040<br>466,166円  |
| PRUグッドライフ2020（年金）<br>85,406,422円                                   | PRUグッドライフ2020（年金）<br>65,327,445円                                   |
| PRUグッドライフ2030（年金）<br>85,584,559円                                   | PRUグッドライフ2030（年金）<br>72,770,293円                                   |
| PRUグッドライフ2040（年金）<br>36,733,770円                                   | PRUグッドライフ2040（年金）<br>17,523,966円                                   |
| PRUグッドライフ2050（年金）<br>505,884円                                      | PRUグッドライフ2050（年金）<br>884,488円                                      |
| ブルデンシャル私募海外債券マーケット・パ<br>フォーマー（適格機関投資家向け）<br>154,287,244円           | ブルデンシャル私募海外債券マーケット・パ<br>フォーマー（適格機関投資家向け）<br>127,365,022円           |
| 計 6,026,327,475円   | 計 3,514,453,950円   |
| 2. 本報告書における開示対象ファンドの<br>期末における当該親投資信託の受益権の<br>総数<br>6,026,327,475口 | 2. 本報告書における開示対象ファンドの<br>期末における当該親投資信託の受益権の<br>総数<br>3,514,453,950口 |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

| 項目                      | 自 平成23年12月13日<br>至 平成24年12月10日   | 自 平成24年12月11日<br>至 平成25年12月10日 |
|-------------------------|--|--------------------------------|
| 1．金融商品に対する<br>取組方針      | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を投資信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。   | 同左                             |
| 2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じて価格変動リスクや為替変動リスク等があります。 | 同左                             |
| 3．金融商品に係るリスク管理体制        | コンプライアンス部では、運用状況のモニタリング、運用に関する法令諸規則の遵守状況の確認を行っております。<br>また、業務統括部では、運用に関するリスク管理を行っております。  | 同左                             |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | （平成24年12月10日現在）   | （平成25年12月10日現在）  |
|----------------------------|---|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。   | 同左   |
| 2. 時価の算定方法                 | <p>有価証券<br/>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引等<br/>「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。</p> <p>上記以外の金融商品<br/>短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> | <p>有価証券<br/>同左</p> <p>デリバティブ取引等<br/>同左</p> <p>上記以外の金融商品<br/>同左</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価格のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。   | 同左   |



（有価証券に関する注記）

（平成24年12月10日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

| 種類   | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
|------|-----------------|
| 国債証券 | 2,208,238       |
| 合計   | 2,208,238       |

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本報告書の開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（平成25年12月10日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

| 種類   | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
|------|-----------------|
| 国債証券 | 7,410,532       |
| 合計   | 7,410,532       |

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本報告書の開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

通貨関連

(単位：円)

| 種類         | (平成24年12月10日現在) |       |               |            |
|------------|-----------------|-------|---------------|------------|
|            | 契約額等            | うち1年超 | 時価            | 評価損益       |
| 市場取引以外の取引  |                 |       |               |            |
| 為替予約取引     |                 |       |               |            |
| 買建         |                 |       |               |            |
| アメリカドル     | 516,693,445     | -     | 532,849,486   | 16,156,041 |
| カナダドル      | 7,124,454       | -     | 7,358,315     | 233,861    |
| メキシコペソ     | 17,477,565      | -     | 18,665,179    | 1,187,614  |
| ユーロ        | 259,785,682     | -     | 262,850,986   | 3,065,304  |
| イギリスポンド    | 62,313,789      | -     | 65,220,190    | 2,906,401  |
| スイスフラン     | 6,406,126       | -     | 6,715,698     | 309,572    |
| スウェーデンクローネ | 2,857,776       | -     | 2,860,821     | 3,045      |
| デンマーククローネ  | 27,231,977      | -     | 28,387,689    | 1,155,712  |
| ポーランドズロチ   | 4,484,207       | -     | 4,674,384     | 190,177    |
| オーストラリアドル  | 8,021,146       | -     | 8,364,284     | 343,138    |
| シンガポールドル   | 1,880,205       | -     | 1,986,520     | 106,315    |
| 南アフリカランド   | 60,077,920      | -     | 61,359,856    | 1,281,936  |
| 売建         |                 |       |               |            |
| アメリカドル     | 581,534,508     | -     | 600,119,934   | 18,585,426 |
| カナダドル      | 19,414,538      | -     | 20,129,324    | 714,786    |
| メキシコペソ     | 11,804,453      | -     | 12,264,367    | 459,914    |
| ユーロ        | 157,266,917     | -     | 162,225,184   | 4,958,267  |
| イギリスポンド    | 29,165,103      | -     | 30,349,779    | 1,184,676  |
| スウェーデンクローネ | 10,218,639      | -     | 10,474,437    | 255,798    |
| ノルウェークローネ  | 3,118,788       | -     | 3,301,040     | 182,252    |
| デンマーククローネ  | 10,424,139      | -     | 10,431,439    | 7,300      |
| ポーランドズロチ   | 17,945,050      | -     | 18,678,021    | 732,971    |
| オーストラリアドル  | 7,418,137       | -     | 7,472,759     | 54,622     |
| 南アフリカランド   | 60,474,159      | -     | 60,028,560    | 445,599    |
| 合計         | 1,883,138,723   | -     | 1,936,768,252 | 248,703    |

| 種類         | （平成25年12月10日現在） |       |               |            |
|------------|-----------------|-------|---------------|------------|
|            | 契約額等            | うち1年超 | 時価            | 評価損益       |
| 市場取引以外の取引  |                 |       |               |            |
| 為替予約取引     |                 |       |               |            |
| 買建         |                 |       |               |            |
| アメリカドル     | 462,670,281     | -     | 485,261,806   | 22,591,525 |
| カナダドル      | 17,294,964      | -     | 17,626,164    | 331,200    |
| ユーロ        | 287,406,668     | -     | 301,789,833   | 14,383,165 |
| イギリスポンド    | 23,915,080      | -     | 24,339,231    | 424,151    |
| スイスフラン     | 28,149,049      | -     | 29,831,747    | 1,682,698  |
| デンマーククローネ  | 16,126,303      | -     | 16,961,324    | 835,021    |
| ポーランドズロチ   | 21,609,594      | -     | 22,470,389    | 860,795    |
| オーストラリアドル  | 14,228,396      | -     | 14,193,691    | 34,705     |
| 売建         |                 |       |               |            |
| アメリカドル     | 427,828,662     | -     | 445,628,796   | 17,800,134 |
| カナダドル      | 4,260,438       | -     | 4,285,632     | 25,194     |
| メキシコペソ     | 5,482,613       | -     | 5,718,194     | 235,581    |
| ユーロ        | 339,968,418     | -     | 356,087,779   | 16,119,361 |
| イギリスポンド    | 9,047,359       | -     | 9,436,461     | 389,102    |
| スウェーデンクローネ | 2,661,367       | -     | 2,737,654     | 76,287     |
| デンマーククローネ  | 25,904,827      | -     | 26,954,889    | 1,050,062  |
| ポーランドズロチ   | 20,152,274      | -     | 21,147,989    | 995,715    |
| オーストラリアドル  | 4,839,984       | -     | 4,885,920     | 45,936     |
| シンガポールドル   | 3,630,177       | -     | 3,782,140     | 151,963    |
| 南アフリカランド   | 7,361,385       | -     | 7,302,138     | 59,247     |
| 合計         | 1,722,537,839   | -     | 1,800,441,777 | 4,243,762  |

（注）1．時価の算定方法

為替予約の時価

（1）計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該対顧客先物相場の仲値により評価しております。

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

イ) 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートにより評価しております。

ロ) 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値により評価しております。

(2) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値により評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は各々の合計金額であります。

(単位：アメリカドル)

| 種類  | (平成24年12月10日現在)            |          |                            |                    |
|---|----------------------------|----------|----------------------------|--------------------|
|   | 契約額等                       | うち1年超    | 時価                         | 評価損益               |
| 市場取引以外の取引<br>直物為替先渡取引<br>売建<br>マレーシアリングット | 243,788.39<br>(20,124,732) | -<br>(-) | 244,233.04<br>(20,161,437) | 444.65<br>(36,705) |
| 合計<br>(邦貨換算額)                             | 243,788.39<br>(20,124,732) | -<br>(-) | 244,233.04<br>(20,161,437) | 444.65<br>(36,705) |

(注) 時価の算定方法

1. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額により評価しております。

2. ( )内の金額は邦貨換算額であります。

邦貨換算額は計算期間末日の対顧客相場の仲値で換算しております。

(平成25年12月10日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| (平成24年12月10日現在)                          |          | (平成25年12月10日現在)                          |          |
|--|----------|--|----------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 |          | 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 |          |
|  | 1.5784円  |  | 2.0176円  |
| (1万口当たり純資産額)                             | 15,784円) | (1万口当たり純資産額)                             | 20,176円) |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株式（平成25年12月10日現在）

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

（平成25年12月10日現在）

| 種類     | 通貨     | 銘柄                       | 銘柄数<br>比率     | 券面総額                             | 評価額                           |
|--------|--------|--------------------------|---------------|----------------------------------|-------------------------------|
| 国債証券   | アメリカドル | US TREASURY N/B          |               | 2,955,000.00                     | 3,033,029.73                  |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 1,430,000.00                     | 1,429,776.92                  |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 285,000.00                       | 284,922.19                    |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 785,000.00                       | 784,417.53                    |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 590,000.00                       | 590,783.52                    |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 340,000.00                       | 364,304.56                    |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 665,000.00                       | 716,589.37                    |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 870,000.00                       | 874,282.03                    |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 5,440,000.00                     | 5,875,624.32                  |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 900,000.00                       | 1,011,023.10                  |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 1,690,000.00                     | 1,767,635.22                  |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 100,000.00                       | 100,429.68                    |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 685,000.00                       | 683,019.66                    |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 1,045,000.00                     | 1,037,815.62                  |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 2,125,000.00                     | 2,243,037.10                  |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 1,380,000.00                     | 1,333,425.00                  |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 462,000.00                       | 432,366.85                    |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 635,000.00                       | 584,200.00                    |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 985,000.00                       | 1,080,421.87                  |
|        |        | US TREASURY N/B          |               | 1,280,000.00                     | 1,487,000.32                  |
| 小計     |        |                          | 24,647,000.00 | 25,714,104.59<br>(2,657,552,709) |                               |
|        |        | 銘柄数：<br>組入時価比率：          | 20<br>37.5%   |                                  | 38.4%                         |
| カナダドル  | カナダドル  | CANADIAN GOVERNMENT      |               | 140,000.00                       | 155,311.80                    |
|        |        | CANADIAN GOVERNMENT      |               | 190,000.00                       | 297,543.80                    |
|        |        | CANADIAN GOVERNMENT      |               | 300,000.00                       | 412,602.00                    |
|        |        | CANADIAN GOVERNMENT BOND |               | 755,000.00                       | 757,680.25                    |
|        |        | CANADIAN GOVERNMENT BOND |               | 45,000.00                        | 51,021.00                     |
| 小計     |        |                          | 1,430,000.00  | 1,674,158.85<br>(162,577,565)    |                               |
|        |        | 銘柄数：<br>組入時価比率：          | 5<br>2.3%     |                                  | 2.3%                          |
| メキシコペソ | メキシコペソ | MEXICAN BONOS            |               | 4,160,000.00                     | 4,616,751.36                  |
|        |        | MEXICAN BONOS            |               | 4,580,000.00                     | 4,778,625.44                  |
|        |        | MEXICAN BONOS            |               | 830,000.00                       | 841,475.58                    |
|        |        | 小計                       |               | 9,570,000.00                     | 10,236,852.38<br>(82,304,293) |
|        |        | 銘柄数：<br>組入時価比率：          | 3<br>1.2%     |                                  | 1.2%                          |
| ユーロ    | ユーロ    | AUSTRIA GOVERNMENT BOND  |               | 220,000.00                       | 241,908.48                    |
|        |        | AUSTRIA GOVERNMENT BOND  |               | 110,000.00                       | 110,607.97                    |
|        |        | AUSTRIA GOVERNMENT BOND  |               | 5,000.00                         | 5,639.25                      |
|        |        | AUSTRIA GOVERNMENT BOND  |               | 360,000.00                       | 408,759.12                    |
|        |        | AUSTRIA GOVERNMENT BOND  |               | 100,000.00                       | 121,054.00                    |
|        |        | BELGIUM GOVERNMENT BOND  |               | 305,000.00                       | 324,346.15                    |
|        |        | BELGIUM GOVERNMENT BOND  |               | 230,000.00                       | 259,311.20                    |

| 種類                       | 通貨                       | 銘柄                       | 銘柄数<br>比率  | 券面総額          | 評価額                              |
|--------------------------|--------------------------|--------------------------|------------|---------------|----------------------------------|
| 国債証券                     | ユーロ                      | BELGIUM GOVERNMENT BOND  |            | 535,000.00    | 605,860.75                       |
|                          |                          | BELGIUM GOVERNMENT BOND  |            | 120,000.00    | 141,589.20                       |
|                          |                          | BELGIUM GOVERNMENT BOND  |            | 160,000.00    | 185,238.40                       |
|                          |                          | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO |            | 470,000.00    | 489,082.00                       |
|                          |                          | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO |            | 630,000.00    | 700,465.50                       |
|                          |                          | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO |            | 410,000.00    | 462,767.00                       |
|                          |                          | BUNDESobligation         |            | 880,000.00    | 882,230.79                       |
|                          |                          | BUNDESREPUB DEUTSCHLAND  |            | 345,000.00    | 485,204.55                       |
|                          |                          | BUNDESREPUB DEUTSCHLAND  |            | 90,000.00     | 134,691.30                       |
|                          |                          | BUNDESREPUB DEUTSCHLAND  |            | 344,000.00    | 484,284.57                       |
|                          |                          | BUNDESREPUB DEUTSCHLAND  |            | 345,000.00    | 459,297.46                       |
|                          |                          | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA |            | 500,000.00    | 572,019.00                       |
|                          |                          | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA |            | 760,000.00    | 858,845.60                       |
|                          |                          | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA |            | 135,000.00    | 143,212.99                       |
|                          |                          | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA |            | 185,000.00    | 205,269.52                       |
|                          |                          | BUONI POLIENNALI DEL TES |            | 440,000.00    | 467,500.00                       |
|                          |                          | BUONI POLIENNALI DEL TES |            | 365,000.00    | 396,152.38                       |
|                          |                          | BUONI POLIENNALI DEL TES |            | 485,000.00    | 682,492.00                       |
|                          |                          | BUONI POLIENNALI DEL TES |            | 570,000.00    | 586,872.00                       |
|                          |                          | FINLAND GOVERNMENT BOND  |            | 120,000.00    | 134,251.92                       |
|                          |                          | FINLAND GOVERNMENT BOND  |            | 180,000.00    | 203,437.80                       |
|                          |                          | FINLAND GOVERNMENT BOND  |            | 10,000.00     | 9,613.14                         |
|                          |                          | FRANCE GOVERNMENT BOND O |            | 130,000.00    | 147,303.00                       |
|                          |                          | FRANCE GOVERNMENT BOND O |            | 235,000.00    | 330,811.85                       |
|                          |                          | FRANCE GOVERNMENT BOND O |            | 200,000.00    | 217,313.20                       |
|                          |                          | FRANCE GOVERNMENT BOND O |            | 295,000.00    | 333,426.11                       |
|                          |                          | FRANCE GOVERNMENT BOND O |            | 75,000.00     | 84,847.72                        |
|                          |                          | FRANCE O.A.T.            |            | 800,000.00    | 927,291.20                       |
|                          |                          | FRANCE O.A.T.            |            | 895,000.00    | 1,376,523.42                     |
|                          |                          | FRANCE O.A.T.            |            | 340,000.00    | 472,254.22                       |
|                          |                          | FRENCH TREASURY NOTE BTA |            | 660,000.00    | 678,392.22                       |
|                          |                          | FRENCH TREASURY NOTE BTA |            | 475,000.00    | 494,981.35                       |
|                          |                          | IRELAND GOVERNMENT BOND  |            | 150,000.00    | 166,194.00                       |
|                          |                          | IRELAND GOVERNMENT BOND  |            | 235,000.00    | 255,716.66                       |
|                          |                          | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 85,000.00     | 89,403.00                        |
|                          |                          | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 1,120,000.00  | 1,148,434.56                     |
|                          |                          | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 135,000.00    | 147,001.50                       |
|                          |                          | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 140,000.00    | 144,060.00                       |
|                          |                          | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 105,000.00    | 126,236.25                       |
|                          |                          | ITALY GOVERNMENT INTERNA |            | 1,255,000.00  | 1,379,890.07                     |
|                          |                          | NETHERLANDS GOVERNMENT   |            | 275,000.00    | 370,856.20                       |
|                          |                          | NETHERLANDS GOVERNMENT B |            | 285,000.00    | 298,626.13                       |
|                          | NETHERLANDS GOVERNMENT B |                          | 505,000.00 | 573,274.48    |                                  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT B |                          | 35,000.00                | 42,080.32  |               |                                  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT B |                          | 110,000.00               | 129,621.47 |               |                                  |
| SPAIN GOVERNMENT BOND    |                          | 235,000.00               | 245,105.00 |               |                                  |
| SPAIN GOVERNMENT BOND    |                          | 535,000.00               | 556,651.45 |               |                                  |
| SPAIN GOVERNMENT BOND    |                          | 320,000.00               | 329,702.40 |               |                                  |
| 小計                       |                          |                          |            | 19,039,000.00 | 21,828,001.82<br>(3,098,703,138) |
|                          |                          | 銘柄数 :                    | 55         |               |                                  |
|                          |                          | 組入時価比率 :                 | 43.7%      |               | 44.8%                            |
|                          | イギリスポンド                  | UNITED KINGDOM GILT      |            | 160,000.00    | 164,470.08                       |
|                          |                          | UNITED KINGDOM GILT      |            | 290,000.00    | 314,940.58                       |
|                          |                          | UNITED KINGDOM GILT      |            | 265,000.00    | 270,773.02                       |
|                          |                          | UNITED KINGDOM GILT      |            | 400,000.00    | 392,620.00                       |

| 種類               | 通貨   | 銘柄                      | 銘柄数<br>比率                                    | 券面総額   | 評価額  |
|------------------|--|-------------------------|--|--|--|
| 国債証券             | イギリスポンド  | UNITED KINGDOM GILT     |  | 90,000.00  | 106,592.67                                   |
|                  |  | UNITED KINGDOM GILT     |  | 470,000.00   | 524,137.89                                   |
|                  |  | UNITED KINGDOM TREASURY |  | 95,000.00  | 105,076.36                                   |
|                  |  | UNITED KINGDOM TREASURY |  | 270,000.00   | 356,105.70                                   |
|                  |  | UNITED KINGDOM TREASURY |  | 335,000.00   | 370,700.61                                   |
|                  |  | UNITED KINGDOM TREASURY |  | 515,000.00   | 571,279.71                                   |
|                  | 小計   |                         |  | 2,890,000.00   | 3,176,696.62<br>(539,117,183)                |
|                  |  | 銘柄数：<br>組入時価比率：         | 10<br>7.6%                                   |  | 7.8%   |
|                  | スウェーデンクローネ<br>小計                                   | SWEDISH GOVERNMENT      |  | 2,245,000.00<br>2,245,000.00                                 | 2,683,693.20<br>2,683,693.20<br>(42,456,026) |
|                  |  | 銘柄数：<br>組入時価比率：         | 1<br>0.6%                                    |  | 0.6%   |
| ノルウェークローネ<br>小計  | NORWAY GOVERNMENT BOND<br>NORWEGIAN GOVERNMENT     |                         | 520,000.00<br>636,000.00<br>1,156,000.00     | 559,312.00<br>667,259.40<br>1,226,571.40<br>(20,655,462)     |  |
|                  | 銘柄数：<br>組入時価比率：                                    | 2<br>0.3%               |  | 0.3%   |  |
| デンマーククローネ<br>小計  | DENMARK GOVERNMENT BOND<br>DENMARK GOVERNMENT BOND |                         | 840,000.00<br>1,435,000.00<br>2,275,000.00   | 955,159.80<br>1,678,939.95<br>2,634,099.75<br>(50,126,918)   |  |
|                  | 銘柄数：<br>組入時価比率：                                    | 2<br>0.7%               |  | 0.7%   |  |
| ポーランドズロチ<br>小計   | POLAND GOVERNMENT BOND<br>POLAND GOVERNMENT BOND   |                         | 1,000,000.00<br>700,000.00<br>1,700,000.00   | 1,060,164.00<br>746,080.30<br>1,806,244.30<br>(61,213,619)   |  |
|                  | 銘柄数：<br>組入時価比率：                                    | 2<br>0.9%               |  | 0.9%   |  |
| オーストラリアドル<br>小計  | AUSTRALIA GOVERNMENT BON                           |                         | 985,000.00<br>985,000.00                     | 1,022,450.68<br>1,022,450.68<br>(96,028,567)                 |  |
|                  | 銘柄数：<br>組入時価比率：                                    | 1<br>1.4%               |  | 1.4%   |  |
| シンガポールドル<br>小計   | SINGAPORE GOVERNMENT BON                           |                         | 360,000.00<br>360,000.00                     | 378,100.08<br>378,100.08<br>(31,261,314)                     |  |
|                  | 銘柄数：<br>組入時価比率：                                    | 1<br>0.4%               |  | 0.5%   |  |
| マレーシアリンギット<br>小計 | MALAYSIA GOVERNMENT BOND                           |                         | 1,160,000.00<br>1,160,000.00                 | 1,152,146.80<br>1,152,146.80<br>(37,145,212)                 |  |
|                  | 銘柄数：<br>組入時価比率：                                    | 1<br>0.5%               |  | 0.5%   |  |
| 南アフリカランド<br>小計   | SOUTH AFRICA GOVERNMENT<br>SOUTH AFRICA GOVERNMENT |                         | 1,500,000.00<br>2,715,000.00<br>4,215,000.00 | 1,558,746.00<br>2,663,925.42<br>4,222,671.42<br>(42,015,580) |  |
|                  | 銘柄数：<br>組入時価比率：                                    | 2<br>0.6%               |  | 0.6%   |  |
|                  | 合計   |                         |  | 6,921,157,586<br>(6,921,157,586)                             |  |

(注1) 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注2) 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

（注3）比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。



## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成26年1月31日現在

|                |             |
|----------------|-------------|
| 資産総額           | 32,389,570円 |
| 負債総額           | 54,885円     |
| 純資産総額（ - ）     | 32,334,685円 |
| 発行済数量          | 27,567,197口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.1729円     |

（参考情報）

## P R U国内株式マザーファンド

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 2,519,449,142円 |
| 負債総額           | 73,711,024円    |
| 純資産総額（ - ）     | 2,445,738,118円 |
| 発行済数量          | 2,015,230,785口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.2136円        |

## P R U国内債券マザーファンド

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 3,915,349,212円 |
| 負債総額           | 38,920,988円    |
| 純資産総額（ - ）     | 3,876,428,224円 |
| 発行済数量          | 3,123,001,604口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.2413円        |

## P R U海外株式マザーファンド

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 4,740,258,015円 |
| 負債総額           | 17,416,974円    |
| 純資産総額（ - ）     | 4,722,841,041円 |
| 発行済数量          | 2,884,151,800口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.6375円        |

## P R U 海外債券マザーファンド

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 6,699,601,914円 |
| 負債総額           | 11,145,622円    |
| 純資産総額（ - ）     | 6,688,456,292円 |
| 発行済数量          | 3,319,227,434口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.0151円        |

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

### (1) 名義書換等

該当事項はありません。

### (2) 受益者名簿の閉鎖の時期

受益者名簿は作成しません。したがって、該当事項はありません。

### (3) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

### (4) 譲渡制限

該当事項はありません。ただし、受益権の譲渡等は以下によるものとします。

#### 受益権の譲渡

- a. 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 前記 a. の申請のある場合には、前記 a. の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記 a. の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 前記 a. の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託銀行に対抗することができません。

### (5) 受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

### (6) 受益権の再分割

委託会社は、受託銀行と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、投資信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

平成26年1月末現在の資本金の額：219百万円

会社が発行する株式総数：30,000株

発行済株式総数：7,360株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2) 委託会社等の機構

取締役会はその決議によって委託会社の経営に関するすべての重要事項並びに法令もしくは定款によって定められた事項を決定します。

3名以上の取締役が、株主総会の決議によって選任されます。取締役の選任は、法令または会社定款に別段の定めがない限り、議決権を行使することができる株主の議決権の過半数を有する株主またはその代理人が出席し、その議決権の過半数をもってこれを行います。なお、取締役の選任は、累積投票によらないものとします。

取締役の任期は選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとし、補欠または増員のために選任された取締役の任期は、他の取締役の残存任期と同一とします。

取締役会は、その決議によって代表取締役1名以上を選定します。また、その決議によって役付取締役1名以上を定めることができます。

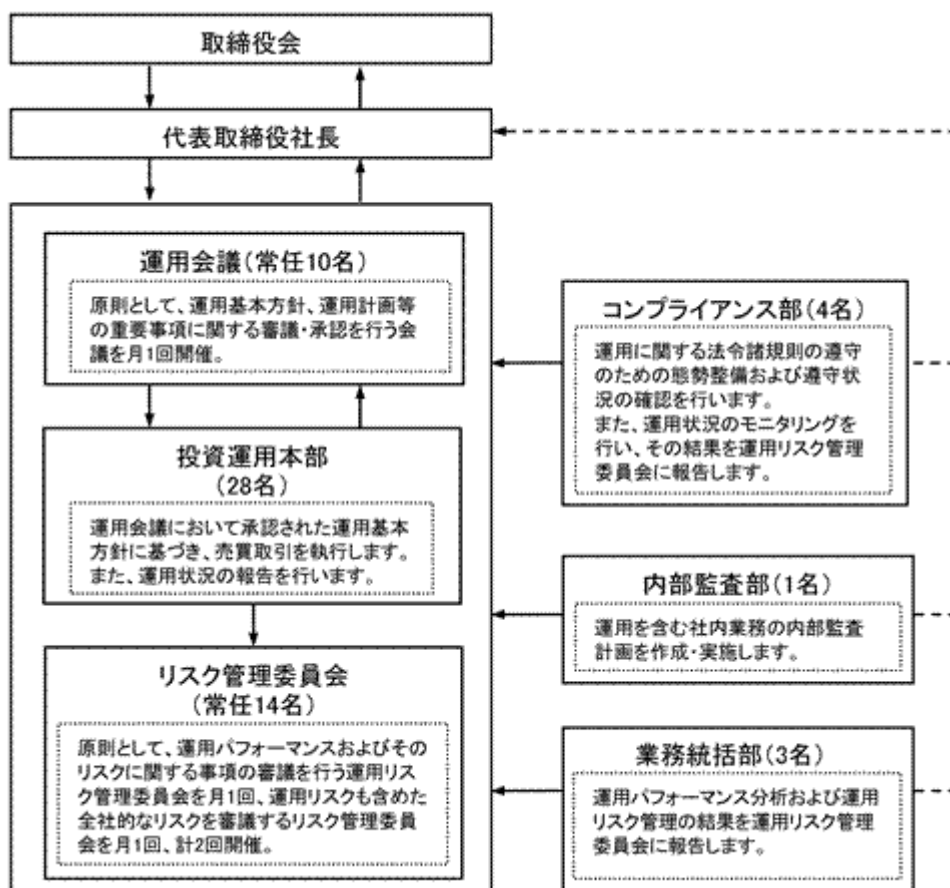
取締役会を招集するには、各取締役及び監査役に対し、会日の少なくとも1週間前に招集通知を發します。ただし、取締役及び監査役全員の同意を得て、招集期間を短縮または招集手続を省略することができます。法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会は代表取締役の1名が招集し、議長となります。代表取締役のいずれにも事故ある場合には、予め取締役会の決議によって定められた順序に従って他の取締役がこの任にあたります。

法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会の決議は、議決に加わることができる取締役の過半数が出席のうえ、出席取締役の過半数の議決によって行います。

#### 委託会社の運用体制



## 委託会社の内部管理及び意思決定を監督する組織等



前記の運用体制等は平成26年1月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

委託会社は、1875年に設立された米プルデンシャル保険を中核とする大手総合金融グループの一員です。グループ全体の運用資産は約105兆円（10,762億米ドル、円換算レート1米ドル=98.12円、平成25年9月末現在）にのびります。グループの運用部門は、ポートフォリオ・マネージャーとアナリストを世界に配し、グローバルな運用を行っています。

なお、平成26年1月末現在、委託会社が運用を行っている証券投資信託（親投資信託は除きます。）は29本、純資産総額の合計金額は約724,978百万円です。以下はその種類別の内訳です。

|            |     |
|------------|-----|
| 追加型株式投資信託  | 26本 |
| 単位型株式投資信託  | 3本  |
| 追加型公社債投資信託 | 0本  |
| 単位型公社債投資信託 | 0本  |

### 3【委託会社等の経理状況】

1．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。）並びに同規則第38条及び第57条に基づき「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表に記載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期事業年度（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人により中間監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：千円 )

|            | 第 6 期<br>( 平成24年 3 月31日 ) | 第 7 期<br>( 平成25年 3 月31日 ) |
|------------|---------------------------|---------------------------|
| ( 資産の部 )   |                           |                           |
| 流動資産       |                           |                           |
| 現金及び預金     | 1,906,860                 | 2,459,775                 |
| 前払費用       | 27,512                    | 36,835                    |
| 未収入金       | 2,981                     | 3,027                     |
| 立替金        | 822                       | 343                       |
| 未収委託者報酬    | 70,686                    | 66,014                    |
| 未収運用受託報酬   | 1,447,241                 | 1,842,346                 |
| 未収収益       | 73,355                    | 49,868                    |
| 繰延税金資産     | 65,264                    | 66,167                    |
| 流動資産計      | 3,594,724                 | 4,524,378                 |
| 固定資産       |                           |                           |
| 有形固定資産     | 86,700                    | 108,250                   |
| 建物附属設備 * 2 | 65,564                    | 85,386                    |
| 器具備品 * 2   | 21,136                    | 22,863                    |
| 無形固定資産     | 135,633                   | 167,205                   |
| ソフトウェア     | 135,633                   | 167,205                   |
| 投資その他の資産   | 100,704                   | 135,660                   |
| 長期差入保証金    | 1,113                     | 4,496                     |
| 繰延税金資産     | 99,590                    | 131,164                   |
| 固定資産計      | 323,037                   | 411,117                   |
| 資産合計       | 3,917,761                 | 4,935,496                 |



|            | 第6期<br>(平成24年3月31日) | 第7期<br>(平成25年3月31日) |
|------------|---------------------|---------------------|
| (負債の部)     |                     |                     |
| 流動負債       |                     |                     |
| 未払金        | 27,001              | 49,304              |
| 未払手数料      | 18,287              | 18,300              |
| その他未払金     | 8,713               | 31,004              |
| 未払費用 * 1   | 900,826             | 1,474,723           |
| 未払法人税等     | 453,976             | 300,262             |
| 未払消費税等     | 98,210              | 64,420              |
| 預り金        | 17,432              | 20,065              |
| 賞与引当金      | 44,609              | 59,436              |
| 役員賞与引当金    | 4,200               | 5,000               |
| その他流動負債    | 2                   | -                   |
| 流動負債計      | 1,546,259           | 1,973,212           |
| 固定負債       |                     |                     |
| 長期未払費用 * 1 | 33,203              | 48,039              |
| 退職給付引当金    | 265,821             | 331,297             |
| 役員退職慰労引当金  | 10,294              | 13,535              |
| 資産除去債務     | 42,973              | 61,113              |
| 固定負債計      | 352,292             | 453,986             |
| 負債合計       | 1,898,552           | 2,427,198           |

|          | 第6期<br>(平成24年3月31日) | 第7期<br>(平成25年3月31日) |
|----------|---------------------|---------------------|
| (純資産の部)  |                     |                     |
| 株主資本     |                     |                     |
| 資本金      | 219,000             | 219,000             |
| 資本剰余金    | 149,000             | 149,000             |
| 資本準備金    | 149,000             | 149,000             |
| 利益剰余金    | 1,651,209           | 2,140,297           |
| 利益準備金    | 14,720              | 54,750              |
| その他利益剰余金 | 1,636,489           | 2,085,547           |
| 繰越利益剰余金  | 1,636,489           | 2,085,547           |
| 株主資本合計   | 2,019,209           | 2,508,297           |
| 純資産合計    | 2,019,209           | 2,508,297           |
| 負債・純資産合計 | 3,917,761           | 4,935,496           |

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：千円 )

|         | 第 6 期<br>( 自 平成23年 4 月 1 日<br>至 平成24年 3 月31日 ) | 第 7 期<br>( 自 平成24年 4 月 1 日<br>至 平成25年 3 月31日 ) |
|---------|--|--|
| 営業収益    |  |  |
| 委託者報酬   | 471,147  | 423,987  |
| 運用受託報酬  | 5,290,463                                      | 6,067,148                                      |
| その他営業収益 | 282,690  | 218,791  |
| 営業収益計   | 6,044,301                                      | 6,709,927                                      |
| 営業費用    |  |  |
| 支払手数料   | 85,593   | 77,177   |
| 広告宣伝費   | -  | 3,732  |
| 受益証券発行費 | 348  | 354  |
| 調査費     | 2,993,098                                      | 3,422,444                                      |
| 調査費     | 215,124  | 247,658  |
| 委託調査費   | 2,774,120                                      | 3,171,455                                      |
| 図書費     | 3,853  | 3,330  |
| 営業雑経費   | 36,724   | 40,629   |
| 通信費     | 5,584  | 6,641  |
| 印刷費     | 21,926   | 20,934   |
| 協会費     | 4,066  | 10,969   |
| 諸会費     | 5,147  | 2,084  |
| 営業費用計   | 3,115,765                                      | 3,544,337                                      |

|             | 第6期<br>(自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日) | 第7期<br>(自 平成24年4月1日<br>至 平成25年3月31日) |
|-------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 一般管理費       |                                      |                                      |
| 給料          | 872,099                              | 988,906                              |
| 役員報酬        | 23,000                               | 23,125                               |
| 給料・手当       | 653,435                              | 750,877                              |
| 賞与          | 132,304                              | 134,666                              |
| 賞与引当金繰入     | 44,609                               | 59,436                               |
| 役員賞与        | 14,550                               | 15,800                               |
| 役員賞与引当金繰入   | 4,200                                | 5,000                                |
| 福利厚生費       | 101,114                              | 104,633                              |
| 交際費         | 4,933                                | 3,660                                |
| 旅費交通費       | 30,032                               | 34,711                               |
| 水道光熱費       | 6,388                                | 6,966                                |
| 租税公課        | 14,569                               | 14,723                               |
| 不動産賃借料      | 140,036                              | 161,883                              |
| 退職給付費用      | 57,517                               | 70,636                               |
| 役員退職慰労引当金繰入 | 2,846                                | 3,240                                |
| 退職金         | 2,600                                | 24,024                               |
| 募集費         | 16,725                               | 17,790                               |
| 固定資産減価償却費   | 36,291                               | 60,831                               |
| 業務委託費       | 37,217                               | 36,102                               |
| 専門家報酬       | 89,829                               | 46,147                               |
| 消耗器具備品費     | 20,635                               | 16,057                               |
| 修繕維持費       | 13,690                               | 17,979                               |
| 諸経費         | 18,068                               | 26,937                               |
| 一般管理費計      | 1,464,597                            | 1,635,233                            |

|              | 第6期<br>(自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日) | 第7期<br>(自 平成24年4月1日<br>至 平成25年3月31日) |
|--------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 営業利益         | 1,463,938                            | 1,530,356                            |
| 営業外収益        |                                      |                                      |
| 受取利息         | 203                                  | 304                                  |
| その他営業外収益     | 5                                    | 1,387                                |
| 営業外収益計       | 209                                  | 1,691                                |
| 営業外費用        |                                      |                                      |
| 為替差損         | 57,753                               | 57,919                               |
| 投資有価証券売却損    | 9                                    | -                                    |
| その他営業外費用     | 25                                   | 43                                   |
| 営業外費用計       | 57,788                               | 57,962                               |
| 経常利益         | 1,406,358                            | 1,474,085                            |
| 特別損失         |                                      |                                      |
| 固定資産除却損      | 3,033                                | 548                                  |
| 特別損失計        | 3,033                                | 548                                  |
| 税引前当期純利益     | 1,403,324                            | 1,473,537                            |
| 法人税、住民税及び事業税 | 623,452                              | 604,764                              |
| 法人税等調整額      | 118,598                              | 32,476                               |
| 当期純利益        | 898,471                              | 901,248                              |

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

( 単位：千円 )

|                 |                | 第 6 期                               | 第 7 期                               |
|-----------------|----------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|                 |                | (自 平成23年 4 月 1 日<br>至 平成24年 3 月31日) | (自 平成24年 4 月 1 日<br>至 平成25年 3 月31日) |
| <b>株主資本</b>     |                |                                     |                                     |
| 資本金             | 当期首残高          | 219,000                             | 219,000                             |
|                 | 当期変動額          | -                                   | -                                   |
|                 | 当期末残高          | 219,000                             | 219,000                             |
| <b>資本剰余金</b>    |                |                                     |                                     |
| 資本準備金           | 当期首残高          | 149,000                             | 149,000                             |
|                 | 当期変動額          | -                                   | -                                   |
|                 | 当期末残高          | 149,000                             | 149,000                             |
| 資本剰余金合計         | 当期首残高          | 149,000                             | 149,000                             |
|                 | 当期変動額          | -                                   | -                                   |
|                 | 当期末残高          | 149,000                             | 149,000                             |
| <b>利益剰余金</b>    |                |                                     |                                     |
| 利益準備金           | 当期首残高          | -                                   | 14,720                              |
|                 | 当期変動額          | 14,720                              | 40,030                              |
|                 | 当期末残高          | 14,720                              | 54,750                              |
| <b>その他利益剰余金</b> |                |                                     |                                     |
| 繰越利益剰余金         | 当期首残高          | 899,937                             | 1,636,489                           |
|                 | 当期変動額 利益準備金の積立 | 14,720                              | 40,030                              |
|                 | 当期変動額 剰余金の配当   | 147,200                             | 412,160                             |
|                 | 当期変動額 当期純利益    | 898,471                             | 901,248                             |
|                 | 当期末残高          | 1,636,489                           | 2,085,547                           |
| 利益剰余金合計         | 当期首残高          | 899,937                             | 1,651,209                           |
|                 | 当期変動額 剰余金の配当   | 147,200                             | 412,160                             |
|                 | 当期変動額 当期純利益    | 898,471                             | 901,248                             |
|                 | 当期末残高          | 1,651,209                           | 2,140,297                           |
| 株主資本合計          | 当期首残高          | 1,267,937                           | 2,019,209                           |
|                 | 当期変動額 剰余金の配当   | 147,200                             | 412,160                             |
|                 | 当期変動額 当期純利益    | 898,471                             | 901,248                             |
|                 | 当期末残高          | 2,019,209                           | 2,508,297                           |

|              |           | 第6期                           | 第7期                           |
|--------------|-----------|-------------------------------|-------------------------------|
|              |           | (自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日) | (自 平成24年4月1日<br>至 平成25年3月31日) |
| 評価・換算差額等     |           |                               |                               |
| その他有価証券評価差額金 | 当期首残高     | 27                            | -                             |
|              | 当期変動額(純額) | 27                            | -                             |
|              | 当期末残高     | -                             | -                             |
| 評価・換算差額等合計   | 当期首残高     | 27                            | -                             |
|              | 当期変動額     | 27                            | -                             |
|              | 当期末残高     | -                             | -                             |
| 純資産合計        | 当期首残高     | 1,267,964                     | 2,019,209                     |
|              | 当期変動額     | 751,244                       | 489,088                       |
|              | 当期末残高     | 2,019,209                     | 2,508,297                     |

## 重要な会計方針

|  |  |
|--|--|
| <p>1．固定資産の減価償却方法</p> <p>2．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準</p> <p>3．引当金の計上基準</p> <p>4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> | <p>(1) 有形固定資産（リース資産を除く）<br/>定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く）<br/>ソフトウェア（自社利用）については、社内における利用可能期間（5年）による定額法、それ以外の無形固定資産については、5年間にわたる定額法を採用しております。</p> <p>外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p> <p>(1) 賞与引当金<br/>従業員に対する賞与の支給に備えるため、次回支給見込み額のうち当会計期間対応分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金<br/>役員に対する賞与の支給に備えるため、次回支給見込み額のうち当会計期間対応分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金<br/>従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。<br/>なお、当社は従業員数300人未満の企業に該当することから、簡便法を適用し、退職一時金制度について退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法によっております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金<br/>役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づき当会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>消費税等の会計処理<br/>消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。</p> |
|--|--|



## 注記事項

(貸借対照表関係)

| 第6期<br>(平成24年3月31日) |                  | 第7期<br>(平成25年3月31日) |                  |
|---------------------|------------------|---------------------|------------------|
| * 1                 | 関係会社項目           | * 1                 | 関係会社項目           |
|                     | 未払費用 3,576千円     |                     | 未払費用 18,246千円    |
|                     | 長期未払費用 33,203千円  |                     | 長期未払費用 46,389千円  |
| * 2                 | 減価償却累計額 85,750千円 | * 2                 | 減価償却累計額 99,756千円 |
|                     | 有形固定資産           |                     | 有形固定資産           |
|                     | 建物附属設備 54,557千円  |                     | 建物附属設備 66,184千円  |
|                     | 器具備品 31,192千円    |                     | 器具備品 33,571千円    |

## （株主資本等変動計算書関係）

| 第6期<br>（自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日） |         |         |         |        |
|--------------------------------------|---------|---------|---------|--------|
| 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項                |         |         |         |        |
| 株式の種類                                | 当事業年度期首 | 当事業年度増加 | 当事業年度減少 | 当事業年度末 |
|                                      | （株）     | （株）     | （株）     | （株）    |
| 普通株式                                 | 7,360   | -       | -       | 7,360  |

| 2. 配当に関する事項         |       |                |                      |                |                 |
|---------------------|-------|----------------|----------------------|----------------|-----------------|
| 決議                  | 株式の種類 | 配当金の総額<br>（千円） | 1株当たり<br>配当額<br>（千円） | 基準日            | 効力発生日           |
| 平成23年12月20日<br>取締役会 | 普通株式  | 147,200        | 20                   | 平成23年<br>9月30日 | 平成23年<br>12月21日 |

| 第7期<br>（自 平成24年4月1日<br>至 平成25年3月31日） |         |         |         |        |
|--------------------------------------|---------|---------|---------|--------|
| 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項                |         |         |         |        |
| 株式の種類                                | 当事業年度期首 | 当事業年度増加 | 当事業年度減少 | 当事業年度末 |
|                                      | （株）     | （株）     | （株）     | （株）    |
| 普通株式                                 | 7,360   | -       | -       | 7,360  |

| 2. 配当に関する事項        |       |                |                      |                |                |
|--------------------|-------|----------------|----------------------|----------------|----------------|
| 決議                 | 株式の種類 | 配当金の総額<br>（千円） | 1株当たり<br>配当額<br>（千円） | 基準日            | 効力発生日          |
| 平成24年6月28日<br>株主総会 | 普通株式  | 412,160        | 56                   | 平成24年<br>3月31日 | 平成24年<br>6月28日 |

## （金融商品関係）

| 第6期<br>（自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日）  |                  |            |            | 第7期<br>（自 平成24年4月1日<br>至 平成25年3月31日）  |                  |            |            |
|---|------------------|------------|------------|---|------------------|------------|------------|
| <p>1．金融商品の状況に関する事項</p> <p>(1) 金融商品に対する取組方針</p> <p>当社は主として国内の機関投資家を顧客とする投資一任業務を行っております。財務体質を毀損させようおそれのある投機的な金融商品取引を行わないこととしております。</p> <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制</p> <p>現金及び預金並びに営業債権である未収運用受託報酬は、預入先金融機関および顧客の信用リスクに晒されております。また、それらのうち外貨建てのものは為替の変動リスクに晒されております。</p> <p>営業債務である未払費用のうち外貨建てのものは為替の変動リスクに晒されております。</p> <p>顧客の信用リスクについては、顧客からの預り資産残高の推移等に基づいてモニターしております。</p> <p>外貨建債権・債務については、その残高および為替相場の変動による影響を定期的にモニターしております。</p> <p>2．金融商品の時価等に関する事項</p> <p>平成24年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。</p> |                  |            |            | <p>1．金融商品の状況に関する事項</p> <p>(1) 金融商品に対する取組方針</p> <p>当社は主として国内の機関投資家を顧客とする投資一任業務を行っております。財務体質を毀損させようおそれのある投機的な金融商品取引を行わないこととしております。</p> <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制</p> <p>現金及び預金並びに営業債権である未収運用受託報酬は、預入先金融機関および顧客の信用リスクに晒されております。また、それらのうち外貨建てのものは為替の変動リスクに晒されております。</p> <p>営業債務である未払費用のうち外貨建てのものは為替の変動リスクに晒されております。</p> <p>顧客の信用リスクについては、顧客からの預り資産残高の推移等に基づいてモニターしております。</p> <p>外貨建債権・債務については、その残高および為替相場の変動による影響を定期的にモニターしております。</p> <p>2．金融商品の時価等に関する事項</p> <p>平成25年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。</p> |                  |            |            |
|   | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 時価<br>(千円) | 差額<br>(千円) |   | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 時価<br>(千円) | 差額<br>(千円) |
| (1) 現金及び預金  | 1,906,860        | 1,906,860  | -          | (1) 現金及び預金  | 2,459,775        | 2,459,775  | -          |
| (2) 未収運用受託報酬  | 1,447,241        | 1,447,241  | -          | (2) 未収運用受託報酬  | 1,842,346        | 1,842,346  | -          |
| 資産計   | 3,354,101        | 3,354,101  | -          | 資産計   | 4,302,121        | 4,302,121  | -          |
| (1) 未払費用  | 900,826          | 900,826    | -          | (1) 未払費用  | 1,474,723        | 1,474,723  | -          |
| 負債計   | 900,826          | 900,826    | -          | 負債計   | 1,474,723        | 1,474,723  | -          |

| 第6期<br>(自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日)   |           | 第7期<br>(自 平成24年4月1日<br>至 平成25年3月31日)   |           |
|--|-----------|--|-----------|
| <p>(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項</p> <p><u>資産</u></p> <p>(1) 現金及び預金、(2) 未収運用受託報酬</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p><u>負債</u></p> <p>(1) 未払費用</p> <p>これは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>(注2) 金銭債権の決算日後の回収予定額</p> |           | <p>(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項</p> <p><u>資産</u></p> <p>(1) 現金及び預金、(2) 未収運用受託報酬</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p><u>負債</u></p> <p>(1) 未払費用</p> <p>これは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>(注2) 金銭債権の決算日後の回収予定額</p> |           |
|  | 1年以内(千円)  |  | 1年以内(千円)  |
| 現金及び預金   | 1,906,860 | 現金及び預金   | 2,459,775 |
| 未収運用受託報酬   | 1,447,241 | 未収運用受託報酬   | 1,842,346 |
| 合計   | 3,354,101 | 合計   | 4,302,121 |

## （退職給付関係）

| 第6期<br>(自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日)  | 第7期<br>(自 平成24年4月1日<br>至 平成25年3月31日) |         |             |         |      |        |   |            |         |             |         |      |        |
|---|--------------------------------------|---------|-------------|---------|------|--------|---|------------|---------|-------------|---------|------|--------|
| <p>1．採用している退職給付制度の概要<br/>当社は確定給付型の制度として、退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2．退職給付債務及びその内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>(1) 退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">265,821</td> </tr> <tr> <td>(2) 退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">265,821</td> </tr> </table> <p>3．退職給付費用の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>勤務費用</td> <td style="text-align: right;">60,117</td> </tr> </table> | (1) 退職給付債務                           | 265,821 | (2) 退職給付引当金 | 265,821 | 勤務費用 | 60,117 | <p>1．採用している退職給付制度の概要<br/>当社は確定給付型の制度として、退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2．退職給付債務及びその内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>(1) 退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">331,297</td> </tr> <tr> <td>(2) 退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">331,297</td> </tr> </table> <p>3．退職給付費用の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>勤務費用</td> <td style="text-align: right;">70,636</td> </tr> </table> | (1) 退職給付債務 | 331,297 | (2) 退職給付引当金 | 331,297 | 勤務費用 | 70,636 |
| (1) 退職給付債務  | 265,821                              |         |             |         |      |        |   |            |         |             |         |      |        |
| (2) 退職給付引当金   | 265,821                              |         |             |         |      |        |   |            |         |             |         |      |        |
| 勤務費用  | 60,117                               |         |             |         |      |        |   |            |         |             |         |      |        |
| (1) 退職給付債務  | 331,297                              |         |             |         |      |        |   |            |         |             |         |      |        |
| (2) 退職給付引当金   | 331,297                              |         |             |         |      |        |   |            |         |             |         |      |        |
| 勤務費用  | 70,636                               |         |             |         |      |        |   |            |         |             |         |      |        |

## （税効果会計関係）

| 第 6 期<br>(平成24年 3月31日)  | 第 7 期<br>(平成25年 3月31日)  |
|---|---|
| 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生<br>の主な原因別内訳  | 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生<br>の主な原因別内訳  |
| 繰延税金資産  | 繰延税金資産  |
| 未払事業税   | 未払事業税   |
| 32,234 千円   | 24,634 千円   |
| 未払費用  | 未払費用  |
| 15,995 千円   | 18,358 千円   |
| 賞与引当金   | 賞与引当金   |
| 16,956 千円   | 22,591 千円   |
| 長期未払費用  | 長期未払費用  |
| 8,809 千円  | 13,765 千円   |
| 退職給付引当金   | 退職給付引当金   |
| 76,642 千円   | 99,978 千円   |
| 資産除去債務  | 資産除去債務  |
| 15,315 千円   | 21,783 千円   |
| その他   | その他   |
| 5,108 千円  | 6,693 千円  |
| 繰延税金資産小計  | 繰延税金資産小計  |
| 171,062 千円  | 207,806 千円  |
| 評価性引当額  | 評価性引当額  |
| -   | -   |
| 繰延税金資産合計  | 繰延税金資産合計  |
| 171,062 千円  | 207,806 千円  |
| 繰延税金負債  | 繰延税金負債  |
| 資産除去債務  | 資産除去債務  |
| 5,955 千円  | 10,474 千円   |
| その他   | その他   |
| 250 千円  | -   |
| 繰延税金負債合計  | 繰延税金負債合計  |
| 6,206 千円  | 10,474 千円   |
| 繰延税金資産の純額   | 繰延税金資産の純額   |
| 164,855 千円  | 197,331 千円  |
| 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等<br>の負担率との間に重要な差異があるときの、<br>当該差異の原因となった主要な項目別の内訳 | 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等<br>の負担率との間に重要な差異があるときの、<br>当該差異の原因となった主要な項目別の内訳     |
| 法定実効税率  | 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等<br>の負担率との間の差異が法定実効税率の100<br>分の5以下であるため注記を省略しておりま<br>す。 |
| 40.7 %  |   |
| (調整)  |   |
| 交際費等永久に損金に算<br>入されない項目  |   |
| 1.0 %   |   |
| 評価性引当額  |   |
| 7.0 %   |   |
| 税率変更による期末繰延<br>税金資産の減額修正  |   |
| 1.3 %   |   |
| その他   |   |
| 0.1 %   |   |
| 税効果会計適用後の法人税<br>等の負担率   |   |
| 36.0 %  |   |

| 第6期<br>(平成24年3月31日)  | 第7期<br>(平成25年3月31日) |
|--|---------------------|
| <p>3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度からの法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来40.7%から平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、35.6%となります。</p> <p>この税率変更により、繰延税金資産（繰延税金負債控除後）は18,713千円減少し、法人税等調整額が18,713千円増加しております。</p> |                     |

## （資産除去債務関係）

## 資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## 1. 当該資産除去債務の概要

本社として使用する事務所の定期建物賃貸借契約（契約期間15年）に伴う原状回復義務等があります。

## 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から5年から15年と見積り、割引率は0.5%から1.9%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

## 3. 当該資産除去債務の総額の増減

|                 | 第6期<br>(自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日) | 第7期<br>(自 平成24年4月1日<br>至 平成25年3月31日) |
|-----------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 期首残高            | 37,979千円                             | 42,973千円                             |
| 有形固定資産の取得に伴う増加額 | 4,257千円                              | 17,343千円                             |
| 時の経過による調整額      | 735千円                                | 803千円                                |
| 資産除去債務の履行による減少額 | - 千円                                 | - 千円                                 |
| その他増減額（は減少）     | - 千円                                 | 6千円                                  |
| 期末残高            | 42,973千円                             | 61,113千円                             |



## （セグメント情報等）

## 〔セグメント情報〕

第6期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

なお、前事業年度についても当社は資産運用業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

## 〔関連情報〕

第6期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

## 1．製品及びサービスごとの情報

資産運用業のサービスに関する外部顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

(単位：千円)

| 日本        | ケイマン    | その他     | 合計        |
|-----------|---------|---------|-----------|
| 5,112,739 | 646,398 | 285,162 | 6,044,301 |

## (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 3．主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

| 顧客の名称又は氏名       | 営業収益      | 関連するセグメント名 |
|-----------------|-----------|------------|
| ジブラルタ生命保険株式会社   | 3,700,445 | 資産運用業      |
| プルデンシャル生命保険株式会社 | 858,098   | 資産運用業      |
| A社              | 646,398   | 資産運用業      |

上記のジブラルタ生命保険株式会社の金額には、A I Gエジソン生命保険株式会社、エイアイジー・スター生命保険株式会社との取引金額が含まれております。

A I Gエジソン生命保険株式会社及びエイアイジー・スター生命保険株式会社は、平成24年1月1日付で、ジブラルタ生命保険株式会社と合併しております。

なお、A社に関しては、同社との守秘義務契約遵守のため、顧客の名称の開示を省略しております。

## 〔セグメント情報〕

第7期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

なお、前事業年度についても当社は資産運用業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

## 〔関連情報〕

第7期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

## 1．製品及びサービスごとの情報

資産運用業のサービスに関する外部顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

(単位：千円)

| 日本        | ケイマン    | その他     | 合計        |
|-----------|---------|---------|-----------|
| 5,617,793 | 870,951 | 221,182 | 6,709,927 |

## (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 3．主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

| 顧客の名称又は氏名       | 営業収益      | 関連するセグメント名 |
|-----------------|-----------|------------|
| ジブラルタ生命保険株式会社   | 4,159,003 | 資産運用業      |
| プルデンシャル生命保険株式会社 | 900,583   | 資産運用業      |
| A社              | 870,951   | 資産運用業      |

なお、A社に関しては、同社との守秘義務契約遵守のため、顧客の名称の開示を省略しております。

## （関連当事者情報）

第6期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

## 1．関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

| 種類  | 会社等の名称                     | 所在地                                   | 資本金又は出資金 | 事業の内容   | 議決権等の所有〔被所有〕割合 | 関連当事者との関係               | 取引の内容 | 取引金額（千円） | 科目     | 期末残高（千円） |
|-----|----------------------------|---------------------------------------|----------|---------|----------------|-------------------------|-------|----------|--------|----------|
| 親会社 | Prudential Financial, Inc. | Broad Street, Newark, New Jersey, USA | 6百万米ドル   | 金融サービス業 | 〔被所有〕間接100%    | 親会社株式によるストック・オプション等（注1） | 福利厚生費 | 18,315   | 未払費用   | 3,576    |
|     |                            |                                       |          |         |                |                         |       |          | 長期未払費用 | 33,203   |

## (2) 兄弟会社等

| 種類      | 会社等の名称                                 | 所在地   | 資本金又は出資金  | 事業の内容    | 議決権等の所有〔被所有〕割合 | 関連当事者との関係     | 取引の内容         | 取引金額（千円）  | 科目       | 期末残高（千円）  |
|---------|--|---|-----------|----------|----------------|---------------|---------------|-----------|----------|-----------|
| 親会社の子会社 | ブルデンシャル生命保険株式会社                        | 東京都千代田区永田町  | 29,000百万円 | 生命保険業    | 無し             | 投資顧問契約        | 運用受託報酬の受取（注2） | 858,098   | 未収運用受託報酬 | 253,078   |
| 親会社の子会社 | ジブラルタ生命保険株式会社                          | 東京都千代田区永田町  | 75,500百万円 | 生命保険業    | 無し             | 投資顧問契約        | 運用受託報酬の受取（注2） | 3,700,445 | 未収運用受託報酬 | 1,003,835 |
| 親会社の子会社 | Prudential Investment Management, Inc. | Mulberry Street Gateway Center Three, Newark, New Jersey, USA | 98米ドル     | 投信・投資顧問業 | 無し             | 投資顧問業務の再委託契約等 | 投資顧問報酬の支払（注2） | 2,720,834 | 未払費用     | 790,171   |
|         |  |   |           |          |                | サービス契約        | サービス料         | 282,690   | 未収収益     | 73,355    |

上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

上記のジブラルタ生命保険株式会社の取引金額には、A I Gエジソン生命保険株式会社、エイアイジー・スター生命保険株式会社との取引金額が含まれております。

A I Gエジソン生命保険株式会社及びエイアイジー・スター生命保険株式会社は、平成24年1月1日付で、ジブラルタ生命保険株式会社と合併しております。

取引の条件及び取引条件の決定方針等

（注1）親会社株式によるストック・オプション等とは、過年度におけるストック・オプション行使コスト等及び制限株式費用と同様の内容であります。

（注2）運用受託報酬及び投資顧問報酬の収受については、各ファンドの契約毎に契約運用資産に対する各社の運用資産の割合に応じた一定の比率により決定しております。

## 2．親会社に関する注記

Prudential Financial, Inc.（ニューヨーク証券取引所に上場）

Prudential International Investments Corporation

## 第7期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

| 種類  | 会社等の名称                     | 所在地                                   | 資本金又は出資金 | 事業の内容   | 議決権等の所有〔被所有〕割合 | 関連当事者との関係               | 取引の内容 | 取引金額（千円） | 科目     | 期末残高（千円） |
|-----|----------------------------|---------------------------------------|----------|---------|----------------|-------------------------|-------|----------|--------|----------|
| 親会社 | Prudential Financial, Inc. | Broad Street, Newark, New Jersey, USA | 6百万米ドル   | 金融サービス業 | 〔被所有〕間接100%    | 親会社株式によるストック・オプション等（注1） | 福利厚生費 | 23,310   | 未払費用   | 18,246   |
|     |                            |                                       |          |         |                |                         |       |          | 長期未払費用 | 46,389   |

## (2) 兄弟会社等

| 種類      | 会社等の名称                                 | 所在地   | 資本金又は出資金  | 事業の内容    | 議決権等の所有〔被所有〕割合 | 関連当事者との関係     | 取引の内容         | 取引金額（千円）  | 科目       | 期末残高（千円）  |
|---------|--|---|-----------|----------|----------------|---------------|---------------|-----------|----------|-----------|
| 親会社の子会社 | ブルデンシャル生命保険株式会社                        | 東京都千代田区永田町  | 29,000百万円 | 生命保険業    | 無し             | 投資顧問契約        | 運用受託報酬の受取（注2） | 900,583   | 未収運用受託報酬 | 275,071   |
| 親会社の子会社 | ジブラルタ生命保険株式会社                          | 東京都千代田区永田町  | 75,500百万円 | 生命保険業    | 無し             | 投資顧問契約        | 運用受託報酬の受取（注2） | 4,159,003 | 未収運用受託報酬 | 1,194,184 |
| 親会社の子会社 | Prudential Investment Management, Inc. | Mulberry Street Gateway Center Three, Newark, New Jersey, USA | 98米ドル     | 投信・投資顧問業 | 無し             | 投資顧問業務の再委託契約等 | 投資顧問報酬の支払（注2） | 3,108,864 | 未払費用     | 1,368,924 |
|         |  |   |           |          |                | サービス契約        | サービス料         | 218,791   | 未収収益     | 49,868    |

上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

取引の条件及び取引条件の決定方針等

（注1）親会社株式によるストック・オプション等とは、過年度におけるストック・オプション行使コスト等及び制限株式費用と同様の内容であります。

（注2）運用受託報酬及び投資顧問報酬の収受については、各ファンドの契約毎に契約運用資産に対する各社の運用資産の割合に応じた一定の比率により決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

Prudential Financial, Inc.（ニューヨーク証券取引所に上場）

Prudential International Investments Corporation

## （ 1株当たり情報）

| 第6期<br>（自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日）                     |             | 第7期<br>（自 平成24年4月1日<br>至 平成25年3月31日）                     |             |
|--|-------------|--|-------------|
| 1株当たり純資産額  | 274,349.06円 | 1株当たり純資産額  | 340,801.32円 |
| 1株当たり当期純利益   | 122,074.96円 | 1株当たり当期純利益   | 122,452.26円 |
| 損益計算書上の当期純利益   | 898,471千円   | 損益計算書上の当期純利益   | 901,248千円   |
| 1株当たり当期純利益の算定に用<br>いられた普通株式に係る当期純利<br>益                  | 898,471千円   | 1株当たり当期純利益の算定に用<br>いられた普通株式に係る当期純利<br>益                  | 901,248千円   |
| 差額   | - 千円        | 差額   | - 千円        |
| 期中平均株式数・普通株式   | 7,360株      | 期中平均株式数・普通株式   | 7,360株      |
| なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益につ<br>いては、潜在株式が存在しないため記載しており<br>ません。 |             | なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益につ<br>いては、潜在株式が存在しないため記載しており<br>ません。 |             |

## 中間財務諸表

## ( 1 ) 中間貸借対照表

( 単位：千円 )

|            |    | 第 8 期中間会計期間<br>(平成25年 9 月30日) |
|------------|----|-------------------------------|
| 資産の部       |    |                               |
| 流動資産       |    |                               |
| 現金及び預金     |    | 2,172,700                     |
| 前払費用       |    | 39,358                        |
| 未収入金       |    | 3,395                         |
| 立替金        |    | 360                           |
| 未収委託者報酬    |    | 55,348                        |
| 未収運用受託報酬   |    | 1,849,843                     |
| 未収収益       |    | 44,248                        |
| 繰延税金資産     |    | 117,864                       |
| その他流動資産    |    | 43                            |
| 流動資産合計     |    | 4,283,163                     |
| 固定資産       |    |                               |
| 有形固定資産     |    |                               |
| 建物附属設備     | *1 | 79,029                        |
| 器具備品       | *1 | 19,818                        |
| 有形固定資産合計   |    | 98,847                        |
| 無形固定資産     |    | 165,387                       |
| 投資その他の資産   |    |                               |
| 差入保証金      |    | 4,496                         |
| 長期繰延税金資産   |    | 154,085                       |
| 投資その他の資産合計 |    | 158,581                       |
| 固定資産合計     |    | 422,817                       |
| 資産合計       |    | 4,705,980                     |

(単位：千円)

第8期中間会計期間  
(平成25年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

|         |    |           |
|---------|----|-----------|
| 未払金     |    | 37,008    |
| 未払費用    |    | 1,510,759 |
| 未払法人税等  |    | 432,211   |
| 未払消費税等  | *2 | 55,276    |
| 預り金     |    | 14,642    |
| 賞与引当金   |    | 168,020   |
| 役員賞与引当金 |    | 15,000    |
| その他流動負債 |    | 38        |

---

|        |  |           |
|--------|--|-----------|
| 流動負債合計 |  | 2,232,956 |
|--------|--|-----------|

---

## 固定負債

|           |  |         |
|-----------|--|---------|
| 長期末払費用    |  | 62,215  |
| 退職給付引当金   |  | 379,685 |
| 役員退職慰労引当金 |  | 15,486  |
| 資産除去債務    |  | 61,541  |

---

|        |  |         |
|--------|--|---------|
| 固定負債合計 |  | 518,927 |
|--------|--|---------|

---

|      |  |           |
|------|--|-----------|
| 負債合計 |  | 2,751,884 |
|------|--|-----------|

---

(単位：千円)

第8期中間会計期間  
(平成25年9月30日)

## 純資産の部

## 株主資本

資本金 219,000

## 資本剰余金

資本準備金 149,000

資本剰余金合計 149,000

## 利益剰余金

利益準備金 54,750

## その他利益剰余金

繰越利益剰余金 1,531,346

利益剰余金合計 1,586,096

株主資本合計 1,954,096

純資産合計 1,954,096

負債純資産合計 4,705,980

## ( 2 ) 中間損益計算書

( 単位：千円 )

|              |    | 第 8 期中間会計期間<br>( 自 平成25年 4 月 1 日<br>至 平成25年 9 月30日 ) |
|--------------|----|--|
| <hr/>        |    |  |
| 営業収益         |    |  |
| 委託者報酬        |    | 226,841  |
| 運用受託報酬       |    | 3,527,086  |
| その他の営業収益     |    | 94,681   |
| 営業収益合計       |    | <hr/> 3,848,609 <hr/>                                |
| 営業費用及び一般管理費  | *1 | 2,957,530  |
| 営業利益         |    | <hr/> 891,079 <hr/>                                  |
| 営業外収益        |    |  |
| 受取利息         |    | 216  |
| 為替差益         |    | 10,829   |
| 営業外収益合計      |    | <hr/> 11,045 <hr/>                                   |
| 経常利益         |    | <hr/> 902,125 <hr/>                                  |
| 特別損失         |    |  |
| 固定資産除却損      |    | 149  |
| 特別損失合計       |    | <hr/> 149 <hr/>                                      |
| 税引前中間純利益     |    | <hr/> 901,975 <hr/>                                  |
| 法人税、住民税及び事業税 |    | 426,795  |
| 法人税等調整額      |    | 74,618   |
| 法人税等合計       |    | <hr/> 352,177 <hr/>                                  |
| 中間純利益        |    | <hr/> 549,798 <hr/>                                  |



## 重要な会計方針

|                              | 第8期中間会計期間<br>(自 平成25年4月1日<br>至 平成25年9月30日)   |
|------------------------------|--|
| 1. 固定資産の減価償却の方法              | (1) 有形固定資産（リース資産を除く）<br>定率法を採用しております。<br>(2) 無形固定資産（リース資産を除く）<br>定額法を採用しております。<br>なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づいております。   |
| 2. 引当金の計上基準                  | (1) 賞与引当金<br>従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、賞与支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。<br>(2) 役員賞与引当金<br>役員賞与の支出に備えて、当事業年度における支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。<br>(3) 退職給付引当金<br>従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。<br>なお、当社は従業員300人未満の企業に該当することから、簡便法を適用し、退職一時金制度について退職給付に係る当中間会計期間末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法によっております。<br>(4) 役員退職慰労引当金<br>役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づく中間期末要支給額を計上しております。 |
| 3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準     | 外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。   |
| 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 消費税等の会計処理<br>消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。   |

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

| 第8期中間会計期間<br>(平成25年9月30日) |   |           |
|---------------------------|---|-----------|
| * 1                       | 減価償却累計額   | 106,046千円 |
|                           | 有形固定資産  |           |
|                           | 建物附属設備  | 72,542千円  |
|                           | 器具備品  | 33,504千円  |
| * 2                       | 消費税等の取扱い  |           |
|                           | 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺の<br>うえ、未払消費税等として表示しており<br>ます。 |           |

(中間損益計算書関係)

| 第8期中間会計期間<br>(自平成25年4月1日<br>至平成25年9月30日) |         |          |
|--|---------|----------|
| * 1                                      | 減価償却実施額 | 33,071千円 |
|  | 有形固定資産  | 9,680千円  |
|  | 無形固定資産  | 23,391千円 |

## （金融商品関係）

第8期中間会計期間  
（平成25年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成25年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

|              | 中間貸借対照表計上額（千円） | 時価（千円）    | 差額（千円） |
|--------------|----------------|-----------|--------|
| (1) 現金及び預金   | 2,172,700      | 2,172,700 | -      |
| (2) 未収運用受託報酬 | 1,849,843      | 1,849,843 | -      |
| 資産計          | 4,022,543      | 4,022,543 | -      |
| (1) 未払費用     | 1,510,759      | 1,510,759 | -      |
| 負債計          | 1,510,759      | 1,510,759 | -      |

## （注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

資産

## (1) 現金及び預金、(2) 未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

負債

## (1) 未払費用

これは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## （資産除去債務関係）

| 第8期中間会計期間<br>（自 平成25年4月1日<br>至 平成25年9月30日） |                 |
|--|-----------------|
| 資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの                  |                 |
| 当該資産除去債務の総額の増減                             |                 |
| 当事業年度期首残高                                  | 61,113千円        |
| 有形固定資産の取得に伴う増加額                            | - 千円            |
| 時の経過による調整額                                 | 427千円           |
| 資産除去債務の履行による減少額                            | - 千円            |
| その他増減額（ は減少）                               | - 千円            |
| 当中間会計期間末残高                                 | <u>61,541千円</u> |

## (セグメント情報等)

## 〔セグメント情報〕

第8期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 〔関連情報〕

第8期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

資産運用業のサービスに関する外部顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

(単位：千円)

| 日本        | ケイマン    | その他    | 合計        |
|-----------|---------|--------|-----------|
| 3,136,199 | 616,146 | 96,263 | 3,848,608 |

## (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

| 顧客の名称又は氏名       | 営業収益      | 関連するセグメント名 |
|-----------------|-----------|------------|
| ジブラルタ生命保険株式会社   | 2,235,811 | 資産運用業      |
| プルデンシャル生命保険株式会社 | 523,006   | 資産運用業      |
| A社              | 616,146   | 資産運用業      |

なお、A社に関しては、同社との守秘義務契約遵守のため、顧客の名称の開示を省略しております。

## （ 1株当たり情報）

| 第8期中間会計期間<br>(自 平成25年4月1日<br>至 平成25年9月30日)                 |             |
|--|-------------|
| 1株当たり純資産額  | 265,502.20円 |
| 1株当たり中間純利益金額   | 74,700.87円  |
| (注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎<br>は、以下のとおりであります。                  |             |
| 中間純利益  | 549,798千円   |
| 普通株主に帰属しない金額   | - 千円        |
| 普通株式に係る中間純利益   | 549,798千円   |
| 期中平均株式数  | 7,360株      |
| なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額<br>については、潜在株式が存在しないため記載して<br>おりません。 |             |

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- ( 1 ) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。 ）。
- ( 2 ) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。 ）。
- ( 3 ) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（ 4 ））、（ 5 ）において同じ。 ）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。 ）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ( 4 ) 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ( 5 ) 上記（ 3 ））、（ 4 ））に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

- ( 1 ) 定款の変更  
定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- ( 2 ) 訴訟事件その他の重要事項  
委託会社および当ファンドに重要な影響を及ぼした事実および重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託銀行

名称：株式会社りそな銀行

資本金の額：279,928百万円（平成25年9月末現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<参考>再信託受託会社の概要

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成25年9月末現在）

業務の概要：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原投資信託契約に係る信託事務の処理の一部（投資信託財産の管理）を原信託受託会社（株式会社りそな銀行）から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原投資信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

#### (2) 販売会社

| 名称               | 資本金の額<br>(平成25年9月末現在) | 事業の内容                         |
|------------------|-----------------------|-------------------------------|
| 株式会社りそな銀行        | 279,928百万円            | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。            |
| 株式会社近畿大阪銀行       | 38,971百万円             |                               |
| 株式会社埼玉りそな銀行      | 70,000百万円             |                               |
| S M B C 日興証券株式会社 | 10,000百万円             | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 楽天証券株式会社         | 7,495百万円              |                               |
| 株式会社S B I証券      | 47,937百万円             |                               |

株式会社りそな銀行、株式会社近畿大阪銀行、株式会社埼玉りそな銀行は受益権の募集の取扱いは行いません。

#### (3) 投資顧問会社

名称：クオンティテイティブ・マネジメント・アソシエイツ社

(Quantitative Management Associates LLC)

資本金の額：24,782千米ドル（約2,100百万円、1米ドル=86.46円、平成24年12月末現在）

事業の内容：同社は、米国証券取引委員会に登録された投資顧問業者であり、米国でミューチュアルファンド業務および投資一任業務を行っています。



## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託銀行における関係業務の概要

投資信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の処理の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。

### (2) 販売会社における関係業務の概要

受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付け、収益分配金の再投資ならびに収益分配金、一部解約金および償還金の支払い等を行います。

### (3) 投資顧問会社における関係業務の概要

委託会社との投資助言契約に基づき、当ファンドの運用に関する投資助言を行います。

## 3【資本関係】

委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

### 第3【その他】

- (1) 有価証券届出書第一部「証券情報」および第二部「ファンド情報」の主要な内容を要約し、目論見書の当該関連箇所に記載することがあります。
- (2) 目論見書の表紙等にロゴ・マークおよび図案を採用し、ファンドの形態等を記載することがあります。また、以下の事項を記載することがあります。
- ・ 金融商品取引法の規定に基づく目論見書である旨
  - ・ 委託会社の金融商品取引業者登録番号
  - ・ ファンドに関する詳細な情報（請求目論見書を含む。）の入手方法
  - ・ 目論見書の使用開始日
  - ・ 届出の効力発生に関する事項
  - ・ 商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
  - ・ 投資信託財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
  - ・ 請求目論見書は投資者の請求により販売会社より交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
  - ・ 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
- (3) 目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。
- (4) 目論見書の別称として「投資信託説明書」の名称を使用する場合があります。
- (5) 目論見書に委託会社の略称およびサービスマークを使用し、以下の記載をすることがあります。
- “ Prudential ” および “ ロックマーク (The Rock) ” は、プルデンシャル・ファイナンシャル（本社：米国ニュージャージー州ニューアーク）およびその関連会社のサービスマークです。
- 「プルデンシャル・インベストメント」は、プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社の略です。
- 英国プルデンシャル社とはなんら関係はありません。
- (6) 請求目論見書の巻末に、投資信託約款を掲載することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

平成26年2月5日

ブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社

取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているPRUグッドライフ2020の平成24年12月11日から平成25年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、PRUグッドライフ2020の平成25年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

ブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

( ) 1. 上記は、当社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. 財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成25年6月10日

ブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社

取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員指定社員 公認会計士 男澤 顕  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第7期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

( ) 上記は、当社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月6日

プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社

取締役会 御中

## あらた監査法人

指定社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員指定社員 公認会計士 男澤 顕  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているプルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第8期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社の平成25年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

( ) 上記は、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。