

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年3月10日
【計算期間】	第16期 (自平成27年12月11日 至 平成28年12月12日)
【ファンド名】	P R U国内株式マーケット・パフォーマー
【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・ 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 ブルデンシャルタワー
【事務連絡者氏名】	小林 雅彦
【連絡場所】	東京都千代田区永田町二丁目13番10号 ブルデンシャルタワー
【電話番号】	03-6832-7150
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません

第一部【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

当ファンドは、PRU国内株式マザーファンド（以下「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を中心に投資を行い、東証株価指数（TOPIX）の動きに追随する投資成果を目標として運用を行います。

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 / 国内 / 株式に属します。

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 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式 債券
	海外	不動産投信
追加型投信	内外	その他資産
		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]

国内...目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

[投資対象資産（収益の源泉）による区分]

株式...目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を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 (組入資産)	決算頻度	投資対象地域	投資形態
株式 一般	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリーファンド
大型株	年2回		
中小型株	年4回	日本	
債券		北米	
一般	年6回(隔月)		ファンド・オブ・ファンズ
公債		欧州	
社債	年12回(毎月)		
その他債券		アジア	
クレジット属性	日々		
不動産投信	その他	オセアニア	
		中南米	
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))		アフリカ	
		中近東(中東)	
資産複合 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング	

<属性区分表(上記網掛け表示部分)の定義>

[投資対象資産による属性区分]

その他資産(投資信託証券(株式 一般))

...目論見書または投資信託約款において、投資信託証券を通じて、主として株式に投資する旨の記載があるものをいいます。当ファンドは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、実質的に株式 一般(大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。)へ投資しております。このため、商品分類表の投資対象資産(収益の源泉)は株式に、属性区分表の投資対象資産は「その他資産(投資信託証券(株式 一般))」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]

日本...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。

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

マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本の株式を中心に投資を行います。
東証株価指数（TOPIX）の動きに追随する投資成果を目標として運用を行います。
当ファンドの信託期間は無期限です。
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。

東証株価指数（TOPIX = Tokyo Stock Price Index）とは、わが国の代表的な株価指数で、東京証券取引所第一部銘柄の基準時（1968年1月4日終値）の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。

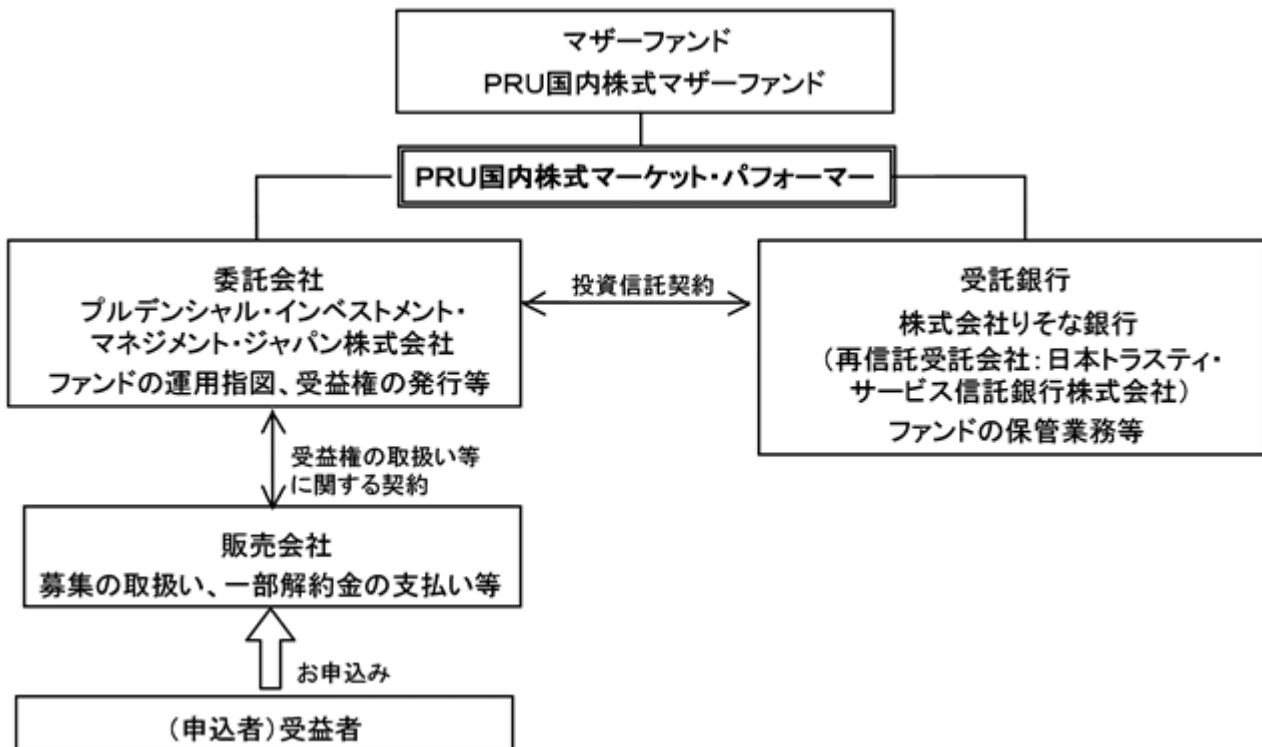
- a. TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。
- b. 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- c. 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- d. 株式会社東京証券取引所は、TOPIX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、TOPIX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。
- e. 当ファンドおよび当ファンドが投資対象とするマザーファンドは、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。
- f. 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、当ファンドおよび当ファンドが投資対象とするマザーファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
- g. 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、TOPIX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。
- h. 以上の項目に限らず、株式会社東京証券取引所は当ファンドおよび当ファンドが投資対象とする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。

（２）【ファンドの沿革】

平成13年3月8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

- a. 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。
- b. 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。
- c. 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。

委託会社等の概況（平成29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
プルデンシャル・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%

* プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社は、世界的な総合金融グループである『プルデンシャル・ファイナンシャル』の一員として、日本国内において機関投資家、個人投資家向け資産運用ビジネス及びプルデンシャル・ファイナンシャルグループの資産運用ビジネスを展開しています。プルデンシャル・ファイナンシャルは、1875年に「プルデンシャル・フレンドリー・ソサエティー」として創業しました。創立以後、140年の時を経るなかで、プルデンシャル・ファイナンシャルはその関連会社を通して、世界40カ国以上の法人及び個人のお客様に幅広い金融商品とサービスを提供しています。

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

当ファンドは、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を中心に投資を行い、東証株価指数（TOPIX）の動きに追随する投資成果を目標として運用を行います。

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せん。

運用方法

a．投資対象

「PRU国内株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。

なお、国内の株式・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」受益証券への投資を通じ、東証株価指数（TOPIX）の動きに追随する投資成果を目標として運用を行います。
- (b) 株式の実質組入比率は、原則として高位を維持します。
- (c) 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、株式の実質組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質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。
- (d) 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。

（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書
- 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す。）
- 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】

当ファンドの主要な投資対象である「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。

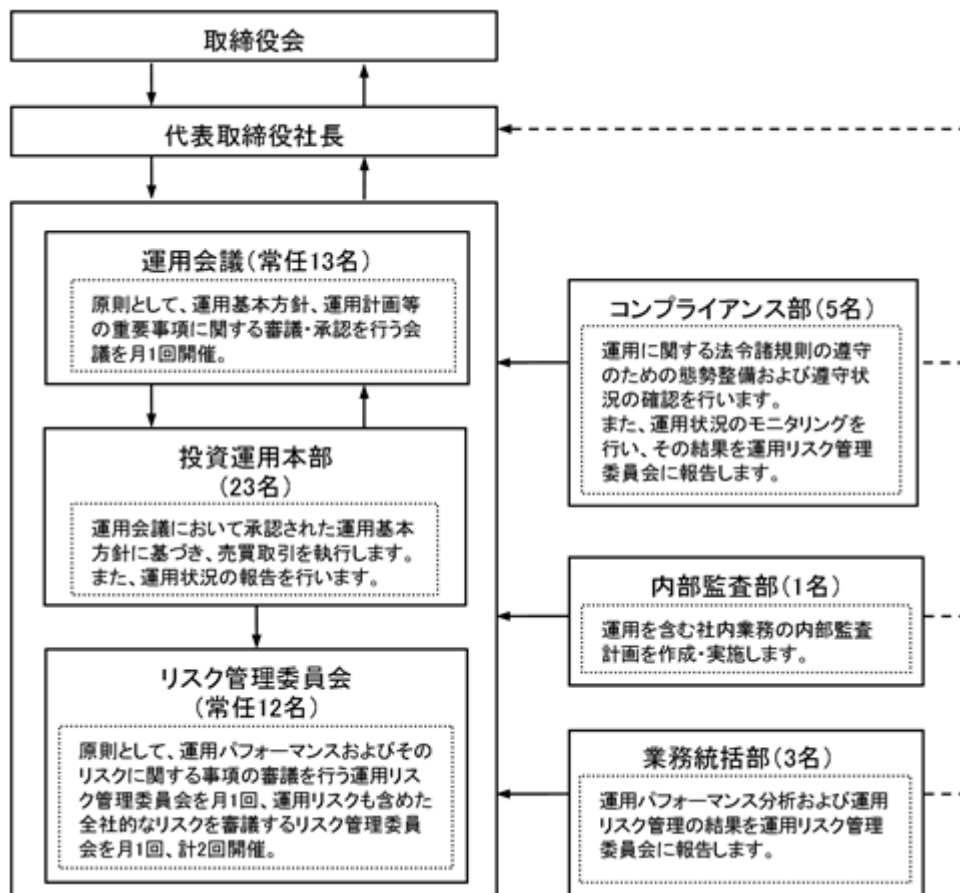
委託会社の運用体制



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。

前記の運用体制等は平成29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）

株式への実質投資割合には制限を設けません。

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）

外貨建資産への投資は行いません。

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。

デリバティブ取引等（一般社団法人投資信託協会の定める「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」に定義するデリバティブ取引等をいう。）について、その取引の目的に応じて、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出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。（投資信託約款第22条）

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券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わが国の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金利にかか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わが国の金利にかか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を回避するため、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を回避するため、金利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、金利先渡し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。

資金の借入れの指図・目的・範囲（投資信託約款第39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。 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。 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。 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。 外貨建資産への投資は行いません。 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。 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。 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。 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。 デリバティブ取引等（一般社団法人投資信託協会の定める「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」に定義するデリバティブ取引等をいう。）について、その取引の目的に応じて、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出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。

平成29年2月1日現在において、「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国内株式マーケット・パフォーマー（当ファンド）、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）、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。

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。

< 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。

< 当ファンドの投資成果 >

当ファンドの投資成果は、必ずしも東証株価指数（TOPIX）の動きに追随するとは限りません。その主な要因としては、次のものが考えられます。

a. 当ファンドが信託報酬等を負担することによる影響

b. 当ファンドの主要投資対象であるマザーファンドの投資成果が、次の要因などにより東証株価指数（TOPIX）の動きに連動しない場合があること

(a) 指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法通りに組入れない場合があること

(b) 売買委託手数料等を負担することによる影響

(c) 追加設定および解約に対応した株式の約定価格と指数の算出に使用する価格の差による影響

(d) 株価指数先物取引等を利用した場合の指数との値動きの差、コストなどによる影響

(e) 株式および株価指数先物取引等の最低取引単位の影響

(f) 株式または株価指数先物取引等の流動性が低下した場合における売買対応の影響

< 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る有価証券等の売買が発生した場合、その売買による組入る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率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など値動きのある証券に投資しますので、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。

(参考情報)**ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移**

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されており、実際の基準価額と異なる場合があります。

※年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

**ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較**

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2012年2月から2017年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

●各資産クラスの指数

- 日本株…… 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
 - 先進国株… MSCI KOKUSAIインデックス(配当込み)
 - 新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)
 - 日本国債… NOMURA-BPI国債
 - 先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本)
 - 新興国債… JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド指数
- (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

●東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

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

●MSCI KOKUSAIインデックス (配当込み)

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

●MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み)

「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc. が開発した指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み)に対する著作権及びその他知的財産権は、全てMSCI Inc. に帰属します。MSCIでは、かかるデータに基づく投資による損失に一切責任を負いません。

●NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が作成している国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算され、当該指数に関する一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

●シティ世界国債インデックス(除く日本)

「シティ世界国債インデックス」は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

●JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド指数

「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド指数」とは、JPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド指数」は、「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド指数(ドルベース)」をもとに委託会社が円換算ベースに計算したものです。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料は、2.16%（税抜2.0%）を上限として販売会社がそれぞれ定める手数料率を、取得申込受付日の基準価額に乗じて得た額とします。

申込手数料は、商品および投資環境の説明や情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等の対価です。

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	
ぶる PRUホットライン	03-6832-7111 受付時間：営業日の9:00～17:00 土日・祝休日、12月31日～1月3日は休業
ホームページ	http://www.pru.co.jp/

当ファンドは、販売会社により、償還乗換えおよび償還前乗換え等の手数料優遇制度の対象となる場合があります。詳しくは、委託会社にご照会のうえ、各販売会社にお問合わせください。

「償還乗換え」とは、取得申込日の属する月の前3ヵ月以内に償還となった証券投資信託の償還金（信託期間を延長した単位型証券投資信託および延長前の信託終了日以降、収益分配金の再投資以外の追加信託を行わない追加型証券投資信託にあっては、延長前の信託終了日以降でかつ取得申込日の属する月の前3ヵ月以内における受益権の買取請求による売却代金および一部解約金を含みます。）をもって、その支払いを行った販売会社で当ファンドの取得申込みを行う場合をいいます。

「償還前乗換え」とは、追加型証券投資信託の受益権を保有する受益者が、当該受益権の取得申込みを行った販売会社で、当該信託の信託終了日の1年前以内で当該販売会社が別に定める期間以降、当該信託の受益権の買取請求に係る売却代金または一部解約金ををもって、当該販売会社が別に定める期間以内に、当該販売会社で当ファンドの取得申込みを行う場合をいいます。

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。

ただし、一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た額）を控除した価額とします。

* 「信託財産留保額」とは、信託期間の途中で解約する場合に、ファンド運用の安定性を図るとともに、引き続きファンドを保有する受益者との公平性を確保するため、解約される方にご負担いただく一定の金額であり、投資信託財産中に留保されます。

(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年0.702%（税抜0.65%）の率を乗じて得た額とします。

運用管理費用（信託報酬）＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

信託報酬の配分

委託会社	年0.3456%（税抜0.32%）	委託した資金の運用の対価
販売会社	年0.2808%（税抜0.26%）	運用報告書等各種書類の送付、 口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価
受託銀行	年0.0756%（税抜0.07%）	運用財産の管理、 委託会社からの指図の実行の対価

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。

(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0.0054%（税抜0.005%）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。
- 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）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。

確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限り、）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限り、）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

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）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」の適用対象です。これらの制度をご利用の場合、毎年、一定額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一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、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。なお、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。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。

- ・前記は、平成29年1月末現在のものであり、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29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 (PRU国内株式マザーファンド)	日本	81,681,910	100.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		89,399	0.11
合計(純資産総額)		81,592,511	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29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	3,937,749,300	96.72
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		133,583,262	3.28
合計(純資産総額)		4,071,332,562	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。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

(平成29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(%)
日本	投資信託 受益証券	PRU国内株式 マザーファンド	51,214,440	1.6037	82,132,598	1.5949	81,681,910	100.11

(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	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	日本	株式	輸送用機器	トヨタ自動車	21,600	6,628.00	143,164,800	6,584.00	142,214,400	3.49
2	日本	株式	銀行業	三菱UFJフィナンシャル・グループ	133,900	708.70	94,894,930	730.90	97,867,510	2.40
3	日本	株式	情報・通信業	日本電信電話	14,200	4,565.00	64,823,000	4,979.00	70,701,800	1.74
4	日本	株式	情報・通信業	ソフトバンクグループ	7,900	6,802.00	53,735,800	8,701.00	68,737,900	1.69
5	日本	株式	銀行業	三井住友フィナンシャルグループ	14,200	4,403.00	62,522,600	4,451.00	63,204,200	1.55
6	日本	株式	輸送用機器	本田技研工業	16,100	3,302.00	53,162,200	3,387.00	54,530,700	1.34
7	日本	株式	情報・通信業	K D D I	17,500	2,962.00	51,835,000	3,030.00	53,025,000	1.30
8	日本	株式	銀行業	みずほフィナンシャルグループ	239,600	208.30	49,908,680	210.30	50,387,880	1.24
9	日本	株式	電気機器	ソニー	12,600	3,160.00	39,816,000	3,423.00	43,129,800	1.06
10	日本	株式	食料品	日本たばこ産業	11,100	3,818.00	42,379,800	3,640.00	40,404,000	0.99
11	日本	株式	電気機器	ファナック	1,800	19,370.00	34,866,000	22,165.00	39,897,000	0.98
12	日本	株式	陸運業	東日本旅客鉄道	3,500	9,611.00	33,638,500	10,230.00	35,805,000	0.88
13	日本	株式	情報・通信業	N T T ドコモ	13,200	2,580.00	34,056,000	2,706.50	35,725,800	0.88
14	日本	株式	電気機器	キーエンス	800	37,900.00	30,320,000	43,870.00	35,096,000	0.86
15	日本	株式	卸売業	三菱商事	13,200	2,557.50	33,759,000	2,549.50	33,653,400	0.83
16	日本	株式	保険業	東京海上ホールディングス	7,100	5,011.00	35,578,100	4,731.00	33,590,100	0.83
17	日本	株式	医薬品	武田薬品工業	7,100	4,622.00	32,816,200	4,724.00	33,540,400	0.82
18	日本	株式	小売業	セブン&アイ・ホールディングス	7,400	4,299.00	31,812,600	4,509.00	33,366,600	0.82
19	日本	株式	化学	信越化学工業	3,400	8,591.00	29,209,400	9,747.00	33,139,800	0.81
20	日本	株式	電気機器	三菱電機	19,100	1,579.50	30,168,450	1,721.50	32,880,650	0.81
21	日本	株式	電気機器	キヤノン	9,700	3,288.00	31,893,600	3,345.00	32,446,500	0.80
22	日本	株式	医薬品	アステラス製薬	19,200	1,542.00	29,606,400	1,513.50	29,059,200	0.71
23	日本	株式	電気機器	村田製作所	1,900	14,870.00	28,253,000	15,255.00	28,984,500	0.71
24	日本	株式	不動産業	三菱地所	13,000	2,283.00	29,679,000	2,162.50	28,112,500	0.69
25	日本	株式	機械	ダイキン工業	2,500	10,580.00	26,450,000	11,225.00	28,062,500	0.69
26	日本	株式	電気機器	日立製作所	43,000	617.30	26,543,900	647.60	27,846,800	0.68
27	日本	株式	陸運業	東海旅客鉄道	1,500	18,100.00	27,150,000	18,270.00	27,405,000	0.67
28	日本	株式	化学	花王	4,800	5,187.00	24,897,600	5,583.00	26,798,400	0.66
29	日本	株式	卸売業	三井物産	16,000	1,618.00	25,888,000	1,656.50	26,504,000	0.65
30	日本	株式	不動産業	三井不動産	10,000	2,689.00	26,890,000	2,616.50	26,165,000	0.64

(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。

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	100.11
合計	100.11

（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	水産・農林業	0.10
	鉱業	0.34
	建設業	2.79
	食料品	4.19
	繊維製品	0.70
	パルプ・紙	0.24
	化学	6.54
	医薬品	4.52
	石油・石炭製品	0.54
	ゴム製品	0.87
	ガラス・土石製品	0.95
	鉄鋼	1.29
	非鉄金属	0.91
	金属製品	0.66
	機械	4.98
	電気機器	12.30
	輸送用機器	9.15
	精密機器	1.46
	その他製品	1.65
	電気・ガス業	1.74
	陸運業	4.12
	海運業	0.24
	空運業	0.56
	倉庫・運輸関連業	0.16
	情報・通信業	7.75
	卸売業	4.21
	小売業	4.43
	銀行業	8.33
	証券、商品先物取引業	1.22
	保険業	2.62
	その他金融業	1.23
不動産業	2.44	
サービス業	3.49	
	合計	96.72

(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29年1月31日現在）

種類	取引所	資産名	買建/ 売建	数量 (枚)	通貨	簿価金額 (円)	時価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数 先物取引	大証	東証株価指数先物	買建	8	日本円	120,258,640	121,360,000	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。

(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 （基準価額）（円）
第1計算期間末	（分配付）	2,290,038,787	8,372
（平成13年12月10日）	（分配落）	2,290,038,787	8,372
第2計算期間末	（分配付）	1,940,242,065	7,041
（平成14年12月10日）	（分配落）	1,940,242,065	7,041
第3計算期間末	（分配付）	45,784,575	8,405
（平成15年12月10日）	（分配落）	45,784,575	8,405
第4計算期間末	（分配付）	41,860,397	9,305
（平成16年12月10日）	（分配落）	41,860,397	9,305
第5計算期間末	（分配付）	49,500,322	14,029
（平成17年12月12日）	（分配落）	49,500,322	14,029
第6計算期間末	（分配付）	42,990,524	14,164
（平成18年12月11日）	（分配落）	42,990,524	14,164
第7計算期間末	（分配付）	50,064,704	13,651
（平成19年12月10日）	（分配落）	50,064,704	13,651
第8計算期間末	（分配付）	73,383,148	7,458
（平成20年12月10日）	（分配落）	73,383,148	7,458
第9計算期間末	（分配付）	93,607,821	7,910
（平成21年12月10日）	（分配落）	93,607,821	7,910
第10計算期間末	（分配付）	94,600,350	8,144
（平成22年12月10日）	（分配落）	94,600,350	8,144
第11計算期間末	（分配付）	78,997,450	6,944
（平成23年12月12日）	（分配落）	78,997,450	6,944
第12計算期間末	（分配付）	81,477,440	7,459
（平成24年12月10日）	（分配落）	81,477,440	7,459
第13計算期間末	（分配付）	105,824,469	12,025
（平成25年12月10日）	（分配落）	105,824,469	12,025
第14計算期間末	（分配付）	92,925,270	13,625
（平成26年12月10日）	（分配落）	92,925,270	13,625
第15計算期間末	（分配付）	89,636,412	15,055
（平成27年12月10日）	（分配落）	89,636,412	15,055
平成28年1月末日		83,504,277	14,007
平成28年2月末日		76,910,793	12,685
平成28年3月末日		81,065,497	13,273

	純資産総額（円）	1万口当たりの純資産額 （基準価額）（円）
平成28年4月末日	79,367,046	13,190
平成28年5月末日	82,178,512	13,575
平成28年6月末日	74,272,952	12,261
平成28年7月末日	79,496,206	13,014
平成28年8月末日	80,437,807	13,078
平成28年9月末日	79,914,596	13,113
平成28年10月末日	84,525,331	13,799
平成28年11月末日	87,766,146	14,535
第16計算期間末（分配付）	91,270,452	15,150
（平成28年12月12日）（分配落）	91,270,452	15,150
平成28年12月末日	83,950,060	15,038
平成29年1月末日	81,592,511	15,052

【分配の推移】

決算期	1万口当たりの分配金 （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
第14計算期間末 平成26年12月10日	0
第15計算期間末 平成27年12月10日	0
第16計算期間末 平成28年12月12日	0

【収益率の推移】

期間	収益率（％）
第1計算期間 （平成13年3月8日から平成13年12月10日）	16.3
第2計算期間 （平成13年12月11日から平成14年12月10日）	15.9
第3計算期間 （平成14年12月11日から平成15年12月10日）	19.4
第4計算期間 （平成15年12月11日から平成16年12月10日）	10.7
第5計算期間 （平成16年12月11日から平成17年12月12日）	50.8
第6計算期間 （平成17年12月13日から平成18年12月11日）	1.0
第7計算期間 （平成18年12月12日から平成19年12月10日）	3.6
第8計算期間 （平成19年12月11日から平成20年12月10日）	45.4
第9計算期間 （平成20年12月11日から平成21年12月10日）	6.1
第10計算期間 （平成21年12月11日から平成22年12月10日）	3.0
第11計算期間 （平成22年12月11日から平成23年12月12日）	14.7
第12計算期間 （平成23年12月13日から平成24年12月10日）	7.4
第13計算期間 （平成24年12月11日から平成25年12月10日）	61.2
第14計算期間 （平成25年12月11日から平成26年12月10日）	13.3
第15計算期間 （平成26年12月11日から平成27年12月10日）	10.5
第16計算期間 （平成27年12月11日から平成28年12月12日）	0.6

- (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 （平成13年3月8日から平成13年12月10日）	3,044,422,471	308,967,412
第2計算期間 （平成13年12月11日から平成14年12月10日）	31,387,588	11,293,710
第3計算期間 （平成14年12月11日から平成15年12月10日）	1,510,640,965	4,211,715,606
第4計算期間 （平成15年12月11日から平成16年12月10日）	-	9,485,385
第5計算期間 （平成16年12月11日から平成17年12月12日）	-	9,703,438
第6計算期間 （平成17年12月13日から平成18年12月11日）	172,770	5,106,409
第7計算期間 （平成18年12月12日から平成19年12月10日）	13,959,482	7,637,771
第8計算期間 （平成19年12月11日から平成20年12月10日）	91,756,365	30,039,742
第9計算期間 （平成20年12月11日から平成21年12月10日）	78,599,156	58,643,248
第10計算期間 （平成21年12月11日から平成22年12月10日）	46,758,869	48,948,599
第11計算期間 （平成22年12月11日から平成23年12月12日）	35,960,237	38,345,605
第12計算期間 （平成23年12月13日から平成24年12月10日）	27,264,298	31,805,950
第13計算期間 （平成24年12月11日から平成25年12月10日）	42,461,828	63,688,893
第14計算期間 （平成25年12月11日から平成26年12月10日）	33,783,809	53,586,261
第15計算期間 （平成26年12月11日から平成27年12月10日）	9,169,050	17,828,814
第16計算期間 （平成27年12月11日から平成28年12月12日）	6,286,401	5,580,100

（注）本邦外における設定・解約の実績はありません。

(参考情報)

(基準日:2017年1月31日)

基準価額・純資産の推移



基準価額	15,052円
純資産総額	0.8億円

分配の推移 (1万口当たり、税引前)

2012年12月10日	0円
2013年12月10日	0円
2014年12月10日	0円
2015年12月10日	0円
2016年12月12日	0円
設定来累計	0円

(注1) 基準価額は、1万口当たりです。

(注2) 基準価額は、信託報酬控除後の値です。

主要な資産の状況 (マザーファンド)

組入上位業種	投資比率	種類	組入上位10銘柄	業種	投資比率		
1	電気機器	12.30%	1	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.49%
2	輸送用機器	9.15%	2	株式	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.40%
3	銀行業	8.33%	3	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.74%
4	情報・通信業	7.75%	4	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.69%
5	化学	6.54%	5	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.55%
6	機械	4.98%	6	株式	本田技研工業	輸送用機器	1.34%
7	医薬品	4.52%	7	株式	KDDI	情報・通信業	1.30%
8	小売業	4.43%	8	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.24%
9	卸売業	4.21%	9	株式	ソニー	電気機器	1.06%
10	食料品	4.19%	10	株式	日本たばこ産業	食料品	0.99%

※マザーファンドの運用状況です。

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) 2017年は1月末までの収益率です。

※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ます。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ます。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。

（注）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、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。

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

（2）申込価額

取得申込受付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1万口当たり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、「MP日株」として掲載されます。

（3）申込手数料

申込手数料は、2.16%（税抜2.0%）を上限として販売会社がそれぞれ定める手数料率を、取得申込受付日の基準価額に乗じて得た額とします。

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。当ファンドは、販売会社により、償還乗換えおよび償還前乗換え等の手数料優遇制度の対象となる場合があります。詳しくは、委託会社にご照会のうえ、各販売会社にお問合わせください。

「償還乗換え」とは、取得申込日の属する月の前3ヵ月以内に償還となった証券投資信託の償還金（信託期間を延長した単位型証券投資信託および延長前の信託終了日以降、収益分配金の再投資以外の追加信託を行わない追加型証券投資信託にあつては、延長前の信託終了日以降でかつ取得申込日の属する月の前3ヵ月以内における受益権の買取請求による売却代金および一部解約金を含みます。）をもって、その支払いを行った販売会社で当ファンドの取得申込みを行う場合をいいます。

「償還前乗換え」とは、追加型証券投資信託の受益権を保有する受益者が、当該受益権の取得申込みを行った販売会社で、当該信託の信託終了日の1年前以内で当該販売会社が別に定める期間以降、当該信託の

受益権の買取請求に係る売却代金または一部解約金をもって、当該販売会社が別に定める期間以内に、当該販売会社で当ファンドの取得申込みを行う場合をいいます。

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。

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基準価額から当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、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け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け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、4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で評価します。

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、「MP日株」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8日）から無期限とします。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8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、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

委託会社は毎決算時および償還時に期中の運用経過、信託財産の内容、有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

- ・ 交付運用報告書は、販売会社を通して受益者に交付します。
- ・ 運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページ(<http://www.pru.co.jp/>)に掲載します。

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商業ル・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、

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、
- (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、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ヵ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、
- b. 前記a.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30億口に、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る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16期計算期間（平成27年12月11日から平成28年12月12日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【PRU国内株式マーケット・パフォーマー】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第15期 (平成27年12月10日現在)	第16期 (平成28年12月12日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	89,636,412	91,270,452
未収入金	364,467	308,617
流動資産合計	90,000,879	91,579,069
資産合計	90,000,879	91,579,069
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	36,402	30,823
未払委託者報酬	301,511	255,337
その他未払費用	26,554	22,457
流動負債合計	364,467	308,617
負債合計	364,467	308,617
純資産の部		
元本等		
元本	59,540,045	60,246,346
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	30,096,367	31,024,106
（分配準備積立金）	25,969,761	25,406,315
元本等合計	89,636,412	91,270,452
純資産合計	89,636,412	91,270,452
負債純資産合計	90,000,879	91,579,069

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自 至	平成26年12月11日 平成27年12月10日	自 至	平成27年12月11日 平成28年12月12日
営業収益				
有価証券売買等損益		10,160,398		1,574,305
営業収益合計		10,160,398		1,574,305
営業費用				
受託者報酬		72,681		61,484
委託者報酬		602,104		509,349
その他費用		53,022		44,810
営業費用合計		727,807		615,643
営業利益又は営業損失（ ）		9,432,591		958,662
経常利益又は経常損失（ ）		9,432,591		958,662
当期純利益又は当期純損失（ ）		9,432,591		958,662
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（ ）		2,122,380		748,387
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		24,725,461		30,096,367
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,645,509		1,960,451
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,645,509		1,960,451
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,584,814		2,739,761
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,584,814		2,739,761
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		30,096,367		31,024,106

(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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 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 平成28年12月10日が休日のため、当ファンドの当計算期間を平成27年12月11日から平成28年12月12日としております。

(貸借対照表に関する注記)

第15期 (平成27年12月10日現在)	第16期 (平成28年12月12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	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
期首元本額 68,199,809円	期首元本額 59,540,045円
期中追加設定元本額 9,169,050円	期中追加設定元本額 6,286,401円
期中解約元本額 17,828,814円	期中解約元本額 5,580,100円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2. 計算期間末日における受益権の総数
59,540,045口	60,246,346口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自 平成26年12月11日 至 平成27年12月10日	第16期 自 平成27年12月11日 至 平成28年12月12日
1. 分配金の計算過程 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(1,472,875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(5,837,336円)、投資信託約款に規定される収益調整金(55,895,977円)及び分配準備積立金(18,659,550円)より分配対象額は81,865,738円(1万口当たり13,749円)ですが、分配を行っておりません。	1. 分配金の計算過程 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(1,252,683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(454,366円)、投資信託約款に規定される収益調整金(59,165,047円)及び分配準備積立金(23,699,266円)より分配対象額は84,571,362円(1万口当たり14,037円)ですが、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15期	第16期
	自 平成26年12月11日 至 平成27年12月10日	自 平成27年12月11日 至 平成28年12月12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。 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15期 (平成27年12月10日現在)	第16期 (平成28年12月12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	有価証券 「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。 デリバティブ取引等 該当事項はありません。 上記以外の金融商品 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 同左 デリバティブ取引等 同左 上記以外の金融商品 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15期（平成27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	8,008,010
合計	8,008,010

第16期（平成28年12月12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	2,424,166
合計	2,424,166

（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15期 （平成27年12月10日現在）		第16期 （平成28年12月12日現在）	
1口当たり純資産額	1.5055円	1口当たり純資産額	1.5150円
（1万口当たり純資産額	15,055円）	（1万口当たり純資産額	15,150円）

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式（平成28年12月12日現在）

該当事項はありません。

株式以外の有価証券（平成28年12月12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	56,905,326	91,270,452
	合計		56,905,326	91,270,452

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、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 番号	(平成27年12月10日現在)	(平成28年12月12日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		83,188,393	136,014,469
株式		2,338,540,440	4,110,132,720
派生商品評価勘定		-	4,471,360
未収入金		44,149,352	36,540,238
未収配当金		554,135	1,069,600
未収利息		22	-
前払金		1,585,000	-
差入委託証拠金		2,625,000	5,160,000
流動資産合計		2,470,642,342	4,293,388,387
資産合計		2,470,642,342	4,293,388,387
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,365,400	-
前受金		-	3,680,000
未払金		21,102,586	-
未払解約金		25,432,418	46,946,519
未払利息		-	372
流動負債合計		48,900,404	50,626,891
負債合計		48,900,404	50,626,891
純資産の部			
元本等			
元本	1	1,530,097,258	2,645,353,474
剰余金			
剰余金又は欠損金()		891,644,680	1,597,408,022
元本等合計		2,421,741,938	4,242,761,496
純資産合計		2,421,741,938	4,242,761,496
負債純資産合計		2,470,642,342	4,293,388,387

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 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。 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 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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27年12月10日現在)	(平成28年12月12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
1,813,560,300円	1,530,097,258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
290,452,822円	1,632,533,101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
573,915,864円	517,276,885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
56,635,125円	56,905,326円
PRUグッドライフ2020	PRUグッドライフ2020
882,302円	779,283円
PRUグッドライフ2030	PRUグッドライフ2030
1,933,876円	1,934,254円
PRUグッドライフ2040	PRUグッドライフ2040
8,346,721円	7,279,898円
PRUグッドライフ2020（年金）	PRUグッドライフ2020（年金）
80,882,038円	73,427,771円
PRUグッドライフ2030（年金）	PRUグッドライフ2030（年金）
310,646,524円	319,817,405円
PRUグッドライフ2040（年金）	PRUグッドライフ2040（年金）
357,621,420円	372,209,658円
PRUグッドライフ2050（年金）	PRUグッドライフ2050（年金）
31,247,897円	33,155,723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）
674,099,794円	1,772,505,097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）
7,801,561円	7,339,059円
計 1,530,097,258円	計 2,645,353,474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
1,530,097,258円	2,645,353,474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26年12月11日 至 平成27年12月10日	自 平成27年12月11日 至 平成28年12月12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。 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27年12月10日現在）	（平成28年12月12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 「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 「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 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 同左</p> <p>デリバティブ取引等 同左</p> <p>上記以外の金融商品 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27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	67,740,266
合計	67,740,266

（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28年12月12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	173,086,500
合計	173,086,500

（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27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	79,340,400	-	76,975,000	2,365,400
合計	79,340,400	-	76,975,000	2,365,400

（単位：円）

種類	（平成28年12月12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	118,408,640	-	122,880,000	4,471,360
合計	118,408,640	-	122,880,000	4,471,360

（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27年12月10日現在）		（平成28年12月12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	
	1.5827円		1.6039円
（1万口当たり純資産額	15,827円）	（1万口当たり純資産額	16,039円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

（平成28年12月12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	200	2,696.00	539,200
		日本水産	2,700	526.00	1,420,200
		マルハニチロ	400	2,930.00	1,172,000
		サカタのタネ	300	3,190.00	957,000
		ホクト	200	2,027.00	405,400
		日鉄鉱業	100	5,920.00	592,000
		三井松島産業	100	1,404.00	140,400
		国際石油開発帝石	10,900	1,257.50	13,706,750
		日本海洋掘削	100	2,628.00	262,800
		石油資源開発	300	2,894.00	868,200
		K&Oエナジーグループ	100	1,871.00	187,100
		ショーボンドホールディングス	200	5,040.00	1,008,000
		ミライト・ホールディングス	600	1,094.00	656,400
		タマホーム	100	544.00	54,400
		ダイセキ環境ソリューション	100	1,416.00	141,600
		安藤・間	1,500	797.00	1,195,500
		東急建設	700	922.00	645,400
		コムシスホールディングス	800	2,062.00	1,649,600
		ミサワホーム	300	1,031.00	309,300
		高松コンストラクショングループ	100	2,494.00	249,400
		東建コーポレーション	100	8,130.00	813,000
		大成建設	11,000	837.00	9,207,000
		大林組	6,200	1,128.00	6,993,600
		清水建設	6,000	1,076.00	6,456,000
		飛鳥建設	2,100	199.00	417,900
		長谷工コーポレーション	2,400	1,237.00	2,968,800
		松井建設	200	1,078.00	215,600
		鹿島建設	9,000	827.00	7,443,000
		不動テトラ	1,700	216.00	367,200
		大末建設	100	938.00	93,800
		鉄建建設	1,000	365.00	365,000
		西松建設	3,000	574.00	1,722,000
		三井住友建設	8,400	129.00	1,083,600
		大豊建設	1,000	567.00	567,000
		前田建設工業	1,000	1,048.00	1,048,000
		ナカノフドー建設	200	657.00	131,400
		奥村組	2,000	655.00	1,310,000
		東鉄工業	200	2,957.00	591,400
		浅沼組	1,000	363.00	363,000
		戸田建設	2,000	639.00	1,278,000
		熊谷組	3,000	305.00	915,000
		三井ホーム	1,000	466.00	466,000
		矢作建設工業	300	1,031.00	309,300
日本ハウスホールディングス	400	425.00	170,000		
大東建託	800	16,960.00	13,568,000		
新日本建設	200	936.00	187,200		
NIPPO	1,000	2,165.00	2,165,000		
東亜道路工業	1,000	339.00	339,000		
前田道路	1,000	1,938.00	1,938,000		
東亜建設工業	200	1,944.00	388,800		
若築建設	1,000	162.00	162,000		
東洋建設	800	412.00	329,600		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	五洋建設	2,400	570.00	1,368,000
		大林道路	200	743.00	148,600
		世紀東急工業	300	513.00	153,900
		住友林業	1,400	1,565.00	2,191,000
		日本基礎技術	600	339.00	203,400
		日成ビルド工業	1,000	524.00	524,000
		巴コーポレーション	400	361.00	144,400
		パナホーム	1,000	836.00	836,000
		大和ハウス工業	6,100	3,275.00	19,977,500
		ライト工業	400	1,221.00	488,400
		積水ハウス	6,500	1,914.50	12,444,250
		日特建設	300	485.00	145,500
		中電工	300	2,475.00	742,500
		関電工	1,000	1,045.00	1,045,000
		きんでん	1,500	1,487.00	2,230,500
		住友電設	200	1,294.00	258,800
		日本電設工業	300	1,908.00	572,400
		協和エクシオ	700	1,700.00	1,190,000
		九電工	400	2,943.00	1,177,200
		三機工業	600	978.00	586,800
		日揮	1,900	2,173.00	4,128,700
		中外炉工業	1,000	220.00	220,000
		ヤマト	300	577.00	173,100
		高砂熱学工業	600	1,568.00	940,800
		朝日工業社	100	2,954.00	295,400
		明星工業	500	580.00	290,000
		大気社	200	2,863.00	572,600
		日比谷総合設備	200	1,639.00	327,800
		東芝プラントシステム	300	1,714.00	514,200
		OSJBホールディングス	1,000	239.00	239,000
		東洋エンジニアリング	1,000	310.00	310,000
		千代田化工建設	2,000	892.00	1,784,000
		新興プランテック	500	841.00	420,500
		日本製粉	600	1,587.00	952,200
		日清製粉グループ本社	2,300	1,697.00	3,903,100
		昭和産業	1,000	597.00	597,000
		中部飼料	300	988.00	296,400
		日本甜菜製糖	100	2,295.00	229,500
		三井製糖	200	2,427.00	485,400
		日新製糖	100	1,631.00	163,100
		森永製菓	400	4,530.00	1,812,000
		中村屋	100	4,770.00	477,000
		江崎グリコ	500	5,060.00	2,530,000
		名糖産業	100	1,382.00	138,200
		不二家	2,000	217.00	434,000
		山崎製パン	1,500	2,212.00	3,318,000
		モロゾフ	1,000	459.00	459,000
		亀田製菓	100	5,120.00	512,000
		寿スピリッツ	200	2,647.00	529,400
		カルビー	800	3,535.00	2,828,000
森永乳業	2,000	783.00	1,566,000		
六甲バター	100	2,442.00	244,200		
ヤクルト本社	1,100	5,240.00	5,764,000		
明治ホールディングス	1,200	8,810.00	10,572,000		
雪印メグミルク	400	3,100.00	1,240,000		
プリマハム	1,000	395.00	395,000		
日本ハム	1,000	3,035.00	3,035,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	林兼産業	100	868.00	86,800
		丸大食品	1,000	470.00	470,000
		S Foods	100	2,855.00	285,500
		伊藤ハム米久ホールディングス	1,200	979.00	1,174,800
		サッポロホールディングス	700	2,986.00	2,090,200
		アサヒグループホールディングス	3,900	3,666.00	14,297,400
		キリンホールディングス	9,000	1,959.50	17,635,500
		宝ホールディングス	1,500	1,033.00	1,549,500
		養命酒製造	100	1,818.00	181,800
		コカ・コーラウエスト	700	3,290.00	2,303,000
		コカ・コーライーストジャパン	800	2,446.00	1,956,800
		サントリー食品インターナショナル	1,400	4,770.00	6,678,000
		ダイトードリンコ	100	5,680.00	568,000
		伊藤園	600	3,630.00	2,178,000
		キーコーヒー	200	2,106.00	421,200
		日清オイリオグループ	1,000	491.00	491,000
		不二製油グループ本社	500	2,216.00	1,108,000
		J-オイルミルズ	100	3,720.00	372,000
		キッコーマン	1,000	3,765.00	3,765,000
		味の素	4,300	2,335.00	10,040,500
		キューピー	1,100	2,636.00	2,899,600
		ハウス食品グループ本社	800	2,256.00	1,804,800
		カゴメ	700	2,677.00	1,873,900
		焼津水産化学工業	300	1,050.00	315,000
		アリアケジャパン	200	5,930.00	1,186,000
		エバラ食品工業	100	1,989.00	198,900
		ニチレイ	1,000	2,278.00	2,278,000
		東洋水産	1,000	4,155.00	4,155,000
		日清食品ホールディングス	800	5,810.00	4,648,000
		一正蒲鉾	100	1,097.00	109,700
		フジッコ	200	2,298.00	459,600
		ロック・フィールド	200	1,509.00	301,800
		日本たばこ産業	11,400	3,898.00	44,437,200
		ケンコーマヨネーズ	100	3,170.00	317,000
		わらべや日洋ホールディングス	100	2,340.00	234,000
		なとり	200	1,796.00	359,200
		ユーグレナ	800	1,291.00	1,032,800
		ミヨシ油脂	2,000	143.00	286,000
		理研ビタミン	100	4,495.00	449,500
		片倉工業	100	1,296.00	129,600
		グンゼ	2,000	377.00	754,000
		東洋紡	8,000	176.00	1,408,000
		ユニチカ	5,000	88.00	440,000
		富士紡ホールディングス	100	3,315.00	331,500
		倉敷紡績	2,000	229.00	458,000
		シキボウ	2,000	140.00	280,000
		日本毛織	600	857.00	514,200
ダイドーリミテッド	700	404.00	282,800		
帝国繊維	200	1,677.00	335,400		
帝人	1,600	2,344.00	3,750,400		
東レ	14,000	940.00	13,160,000		
サカイオーベックス	100	1,743.00	174,300		
アツギ	1,000	125.00	125,000		
セーレン	500	1,514.00	757,000		
小松精練	300	712.00	213,600		
ワコールホールディングス	1,000	1,374.00	1,374,000		
ホギメディカル	100	6,760.00	676,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	レナウン	1,500	119.00	178,500
		T S Iホールディングス	800	716.00	572,800
		三陽商会	1,000	179.00	179,000
		オンワードホールディングス	1,000	829.00	829,000
		ゴールドウイン	100	5,320.00	532,000
		デサント	400	1,330.00	532,000
		特種東海製紙	100	3,965.00	396,500
		王子ホールディングス	8,000	491.00	3,928,000
		日本製紙	900	2,052.00	1,846,800
		三菱製紙	200	778.00	155,600
		北越紀州製紙	1,200	674.00	808,800
		中越パルプ工業	1,000	246.00	246,000
		大王製紙	700	1,290.00	903,000
		レンゴー	1,800	650.00	1,170,000
		ザ・バック	100	2,675.00	267,500
		クラレ	3,300	1,716.00	5,662,800
		旭化成	12,000	1,058.50	12,702,000
		昭和電工	1,300	1,707.00	2,219,100
		住友化学	14,000	589.00	8,246,000
		住友精化	100	4,385.00	438,500
		日産化学工業	1,100	3,855.00	4,240,500
		クレハ	200	4,615.00	923,000
		石原産業	400	990.00	396,000
		日東エフシー	100	895.00	89,500
		日本曹達	1,000	540.00	540,000
		東ソー	6,000	866.00	5,196,000
		トクヤマ	3,000	481.00	1,443,000
		セントラル硝子	2,000	517.00	1,034,000
		東亜合成	1,300	1,155.00	1,501,500
		デンカ	4,000	527.00	2,108,000
		信越化学工業	3,500	9,096.00	31,836,000
		日本カーバイド工業	1,000	160.00	160,000
		堺化学工業	1,000	378.00	378,000
		エア・ウォーター	1,500	2,068.00	3,102,000
		大陽日酸	1,500	1,372.00	2,058,000
		日本化学工業	1,000	252.00	252,000
		日本パーカライジング	1,000	1,367.00	1,367,000
		高圧ガス工業	400	735.00	294,000
		ステラ ケミファ	100	2,904.00	290,400
		保土谷化学工業	100	2,743.00	274,300
		日本触媒	300	7,300.00	2,190,000
		大日精化学工業	1,000	637.00	637,000
		カネカ	3,000	948.00	2,844,000
		三菱瓦斯化学	1,800	1,947.00	3,504,600
		三井化学	9,000	551.00	4,959,000
		J S R	2,000	1,795.00	3,590,000
		東京応化工業	400	3,770.00	1,508,000
		大阪有機化学工業	100	874.00	87,400
		三菱ケミカルホールディングス	13,000	782.40	10,171,200
		K Hネオケム	200	1,240.00	248,000
		ダイセル	2,700	1,302.00	3,515,400
住友ベークライト	2,000	654.00	1,308,000		
積水化学工業	4,400	1,808.00	7,955,200		
日本ゼオン	2,000	1,106.00	2,212,000		
アイカ工業	600	3,095.00	1,857,000		
宇部興産	10,000	260.00	2,600,000		
積水樹脂	300	1,820.00	546,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	日立化成	1,100	2,815.00	3,096,500
		リケンテクノス	500	546.00	273,000
		大倉工業	1,000	479.00	479,000
		積水化成工業	400	830.00	332,000
		群栄化学工業	100	3,195.00	319,500
		ダイキョーニシカワ	300	1,416.00	424,800
		日本化薬	1,000	1,383.00	1,383,000
		扶桑化学工業	200	2,339.00	467,800
		A D E K A	800	1,628.00	1,302,400
		日油	2,000	1,062.00	2,124,000
		ハリマ化成グループ	200	786.00	157,200
		花王	4,900	5,353.00	26,229,700
		三洋化成工業	100	4,945.00	494,500
		大日本塗料	1,000	221.00	221,000
		日本ペイントホールディングス	1,500	3,230.00	4,845,000
		関西ペイント	2,100	2,076.00	4,359,600
		中国塗料	700	843.00	590,100
		日本特殊塗料	100	1,653.00	165,300
		藤倉化成	300	639.00	191,700
		太陽ホールディングス	100	4,520.00	452,000
		D I C	800	3,765.00	3,012,000
		サカティンクス	400	1,525.00	610,000
		東洋インキS Cホールディングス	2,000	541.00	1,082,000
		富士フイルムホールディングス	3,800	4,391.00	16,685,800
		資生堂	3,700	2,901.00	10,733,700
		ライオン	2,000	1,841.00	3,682,000
		高砂香料工業	100	3,135.00	313,500
		マンダム	200	4,935.00	987,000
		ミルボン	100	4,425.00	442,500
		ファンケル	400	1,583.00	633,200
		コーセー	300	9,160.00	2,748,000
		コタ	100	1,278.00	127,800
		シーズ・ホールディングス	300	2,879.00	863,700
		ポーラ・オルビスホールディングス	200	8,790.00	1,758,000
		ノエビアホールディングス	100	3,570.00	357,000
		エステー	300	1,492.00	447,600
		アグロ カネショウ	100	1,239.00	123,900
		コニシ	300	1,283.00	384,900
		長谷川香料	300	1,992.00	597,600
		小林製薬	600	4,905.00	2,943,000
		荒川化学工業	200	1,648.00	329,600
		メック	200	894.00	178,800
		日本高純度化学	100	2,478.00	247,800
		タカラバイオ	400	1,425.00	570,000
		J C U	100	5,210.00	521,000
		新田ゼラチン	300	721.00	216,300
		デクセリアルズ	500	1,041.00	520,500
アース製薬	100	4,775.00	477,500		
イハラケミカル工業	300	1,177.00	353,100		
クミアイ化学工業	400	713.00	285,200		
日本農薬	400	659.00	263,600		
アキレス	200	1,632.00	326,400		
有沢製作所	300	671.00	201,300		
日東電工	1,400	8,801.00	12,321,400		
レック	100	3,320.00	332,000		
きもと	500	251.00	125,500		
藤森工業	100	2,914.00	291,400		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	前澤化成工業	200	1,166.00	233,200
		J S P	100	2,830.00	283,000
		エフピコ	200	5,290.00	1,058,000
		天馬	100	2,007.00	200,700
		信越ポリマー	300	863.00	258,900
		東リ	300	372.00	111,600
		ニフコ	300	5,950.00	1,785,000
		日本バルカー工業	200	1,508.00	301,600
		ユニ・チャーム	4,000	2,473.50	9,894,000
		協和発酵キリン	2,300	1,570.00	3,611,000
		武田薬品工業	7,300	4,748.00	34,660,400
		アステラス製薬	19,900	1,561.50	31,073,850
		大日本住友製薬	1,400	1,831.00	2,563,400
		塩野義製薬	2,600	5,004.00	13,010,400
		田辺三菱製薬	2,300	2,157.00	4,961,100
		あすか製薬	200	1,617.00	323,400
		日本新薬	400	5,480.00	2,192,000
		中外製薬	1,900	3,185.00	6,051,500
		科研製薬	400	5,890.00	2,356,000
		エーザイ	2,400	6,804.00	16,329,600
		ロート製薬	900	1,685.00	1,516,500
		小野薬品工業	4,400	2,423.00	10,661,200
		久光製薬	600	5,310.00	3,186,000
		持田製薬	100	7,780.00	778,000
		参天製薬	3,600	1,316.00	4,737,600
		扶桑薬品工業	100	2,708.00	270,800
		ツムラ	600	3,085.00	1,851,000
		日医工	500	1,603.00	801,500
		キッセイ薬品工業	300	2,749.00	824,700
		生化学工業	400	1,582.00	632,800
		栄研化学	200	2,880.00	576,000
		日水製薬	200	1,267.00	253,400
		鳥居薬品	100	2,543.00	254,300
		J C Rファーマ	200	2,622.00	524,400
		東和薬品	100	4,270.00	427,000
		富士製薬工業	100	2,577.00	257,700
		沢井製薬	300	6,020.00	1,806,000
		ゼリア新薬工業	400	1,832.00	732,800
		第一三共	5,700	2,416.00	13,771,200
		キョーリン製薬ホールディングス	500	2,378.00	1,189,000
		大幸薬品	200	1,798.00	359,600
		ダイト	100	2,176.00	217,600
		大塚ホールディングス	4,200	4,615.00	19,383,000
		大正製薬ホールディングス	400	9,300.00	3,720,000
		ペプチドリーム	300	5,240.00	1,572,000
		日本コークス工業	1,700	111.00	188,700
		昭和シェル石油	1,800	1,158.00	2,084,400
		ニチレキ	200	924.00	184,800
		東燃ゼネラル石油	3,000	1,278.00	3,834,000
		ユシロ化学工業	200	1,460.00	292,000
		富士石油	500	433.00	216,500
		出光興産	900	3,100.00	2,790,000
		J Xホールディングス	21,200	514.00	10,896,800
		コスモエネルギーホールディングス	600	1,719.00	1,031,400
		横浜ゴム	1,200	2,119.00	2,542,800
		東洋ゴム工業	1,000	1,576.00	1,576,000
ブリヂストン	6,500	4,283.00	27,839,500		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	住友ゴム工業	1,800	1,890.00	3,402,000
		藤倉ゴム工業	200	697.00	139,400
		オカモト	1,000	1,033.00	1,033,000
		ニッタ	200	3,135.00	627,000
		住友理工	400	1,094.00	437,600
		バンドー化学	300	1,042.00	312,600
		日東紡績	2,000	471.00	942,000
		旭硝子	9,000	806.00	7,254,000
		日本板硝子	900	903.00	812,700
		日本山村硝子	1,000	206.00	206,000
		日本電気硝子	4,000	654.00	2,616,000
		住友大阪セメント	4,000	431.00	1,724,000
		太平洋セメント	12,000	374.00	4,488,000
		日本コンクリート工業	400	356.00	142,400
		三谷セキサン	100	2,611.00	261,100
		アジアパイルホールディングス	300	534.00	160,200
		東海カーボン	2,000	405.00	810,000
		日本カーボン	1,000	259.00	259,000
		東洋炭素	100	1,839.00	183,900
		ノリタケカンパニーリミテド	100	2,691.00	269,100
		TOTO	1,400	4,460.00	6,244,000
		日本碍子	2,400	2,391.00	5,738,400
		日本特殊陶業	1,700	2,671.00	4,540,700
		MARUWA	100	3,970.00	397,000
		品川リフラクトリーズ	1,000	257.00	257,000
		フジミインコーポレーテッド	200	2,202.00	440,400
		ニチアス	1,000	1,085.00	1,085,000
		ニチハ	300	2,751.00	825,300
		新日鐵住金	8,700	2,720.00	23,664,000
		神戸製鋼所	3,400	1,254.00	4,263,600
		中山製鋼所	300	767.00	230,100
		合同製鐵	100	2,223.00	222,300
		ジェイ エフ イー ホールディングス	5,300	1,917.50	10,162,750
		日新製鋼	900	1,499.00	1,349,100
		東京製鐵	1,000	903.00	903,000
		共英製鋼	200	2,139.00	427,800
		大和工業	400	3,380.00	1,352,000
		東京鐵鋼	1,000	485.00	485,000
		大阪製鐵	100	2,128.00	212,800
		淀川製鋼所	300	3,220.00	966,000
		東洋鋼鈑	600	404.00	242,400
		丸一鋼管	700	3,705.00	2,593,500
		モリ工業	100	2,028.00	202,800
		大同特殊鋼	3,000	503.00	1,509,000
		日本冶金工業	2,200	215.00	473,000
		山陽特殊製鋼	1,000	601.00	601,000
		愛知製鋼	100	5,390.00	539,000
		日立金属	2,000	1,602.00	3,204,000
		大平洋金属	1,000	406.00	406,000
		新日本電工	900	249.00	224,100
栗本鐵工所	100	2,423.00	242,300		
三菱製鋼	2,000	238.00	476,000		
日本輕金属ホールディングス	4,500	262.00	1,179,000		
三井金属鉱業	5,000	321.00	1,605,000		
東邦亜鉛	1,000	517.00	517,000		
三菱マテリアル	1,200	3,905.00	4,686,000		
住友金属鉱山	5,000	1,615.50	8,077,500		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	DOWAホールディングス	2,000	934.00	1,868,000
		古河機械金属	3,000	226.00	678,000
		大阪チタニウムテクノロジーズ	200	1,809.00	361,800
		東邦チタニウム	300	871.00	261,300
		UACJ	3,000	312.00	936,000
		古河電気工業	700	3,535.00	2,474,500
		住友電気工業	7,200	1,687.00	12,146,400
		フジクラ	2,500	647.00	1,617,500
		昭和電線ホールディングス	2,000	91.00	182,000
		タツタ電線	500	473.00	236,500
		リョービ	1,000	489.00	489,000
		アーレスティ	200	1,201.00	240,200
		アサヒホールディングス	300	2,060.00	618,000
		稲葉製作所	100	1,344.00	134,400
		トーカロ	100	2,612.00	261,200
		SUMCO	2,000	1,549.00	3,098,000
		東洋製罐グループホールディングス	1,400	2,152.00	3,012,800
		ホッカンホールディングス	1,000	425.00	425,000
		コロナ	100	1,170.00	117,000
		横河ブリッジホールディングス	400	1,361.00	544,400
		三和ホールディングス	2,000	1,123.00	2,246,000
		文化シャッター	500	912.00	456,000
		三協立山	200	1,696.00	339,200
		アルインコ	300	1,039.00	311,700
		LIXILグループ	2,700	2,553.00	6,893,100
		ノーリツ	400	2,088.00	835,200
		長府製作所	200	2,625.00	525,000
		リンナイ	300	9,260.00	2,778,000
		ダイニチ工業	300	720.00	216,000
		岡部	300	1,008.00	302,400
		ジーテクト	200	2,166.00	433,200
		東プレ	400	2,884.00	1,153,600
		高周波熱錬	300	908.00	272,400
		東京製綱	100	2,061.00	206,100
		パイオラックス	100	7,060.00	706,000
		日本発條	1,800	1,063.00	1,913,400
		三益半導体工業	100	1,693.00	169,300
		日本製鋼所	600	2,137.00	1,282,200
		三浦工業	800	1,719.00	1,375,200
		タクマ	1,000	923.00	923,000
		ツガミ	1,000	691.00	691,000
		オークマ	1,000	1,117.00	1,117,000
		東芝機械	1,000	483.00	483,000
		アマダホールディングス	2,700	1,304.00	3,520,800
		アイダエンジニアリング	600	1,085.00	651,000
		滝澤鉄工所	1,000	168.00	168,000
		富士機械製造	500	1,360.00	680,000
		牧野フライス製作所	1,000	987.00	987,000
		オーエスジー	900	2,337.00	2,103,300
		旭ダイヤモンド工業	500	873.00	436,500
DMG森精機	1,100	1,553.00	1,708,300		
ソディック	500	1,021.00	510,500		
ディスコ	200	13,120.00	2,624,000		
日東工器	100	2,595.00	259,500		
豊和工業	200	643.00	128,600		
島精機製作所	300	3,625.00	1,087,500		
日阪製作所	200	827.00	165,400		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	やまびこ	300	1,403.00	420,900
		ペガサスミシン製造	200	700.00	140,000
		ナブテスコ	1,000	2,829.00	2,829,000
		三井海洋開発	200	1,917.00	383,400
		レオン自動機	100	886.00	88,600
		S M C	600	29,495.00	17,697,000
		新川	100	794.00	79,400
		オイレス工業	200	2,106.00	421,200
		日精エー・エス・ビー機械	100	2,498.00	249,800
		サトーホールディングス	300	2,610.00	783,000
		ワイエイシイ	100	1,189.00	118,900
		小松製作所	8,900	2,706.50	24,087,850
		住友重機械工業	6,000	724.00	4,344,000
		日立建機	900	2,531.00	2,277,900
		井関農機	2,000	234.00	468,000
		T O W A	200	1,308.00	261,600
		丸山製作所	1,000	195.00	195,000
		北川鉄工所	100	2,362.00	236,200
		ローツェ	100	1,598.00	159,800
		クボタ	9,300	1,774.00	16,498,200
		三菱化工機	1,000	232.00	232,000
		月島機械	400	1,250.00	500,000
		帝国電機製作所	200	926.00	185,200
		新東工業	400	996.00	398,400
		澁谷工業	200	2,269.00	453,800
		アイチ コーポレーション	300	894.00	268,200
		小森コーポレーション	500	1,542.00	771,000
		鶴見製作所	100	1,759.00	175,900
		荏原製作所	800	3,195.00	2,556,000
		西島製作所	100	1,162.00	116,200
		北越工業	300	815.00	244,500
		ダイキン工業	2,500	10,840.00	27,100,000
		トーヨーカネツ	1,000	324.00	324,000
		栗田工業	1,100	2,436.00	2,679,600
		椿本チエイン	1,000	963.00	963,000
		木村化工機	400	354.00	141,600
		アネスト岩田	300	1,133.00	339,900
		ダイフク	900	2,407.00	2,166,300
		加藤製作所	100	3,025.00	302,500
		油研工業	1,000	220.00	220,000
		タダノ	1,000	1,518.00	1,518,000
		フジテック	500	1,308.00	654,000
		C K D	600	1,343.00	805,800
		キトー	200	1,173.00	234,600
		平和	500	2,621.00	1,310,500
		理想科学工業	200	2,039.00	407,800
		S A N K Y O	500	3,805.00	1,902,500
		日本金銭機械	200	1,487.00	297,400
		マースエンジニアリング	100	2,206.00	220,600
		福島工業	100	3,195.00	319,500
		ダイコク電機	100	1,771.00	177,100
		竹内製作所	300	2,602.00	780,600
		アマノ	600	1,999.00	1,199,400
J U K I	300	1,165.00	349,500		
サンデンホールディングス	1,000	391.00	391,000		
蛇の目ミシン工業	200	856.00	171,200		
グローリー	600	3,725.00	2,235,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	新晃工業	100	1,389.00	138,900
		大和冷機工業	300	917.00	275,100
		セガサミーホールディングス	1,900	1,816.00	3,450,400
		リケン	100	4,380.00	438,000
		T P R	200	3,365.00	673,000
		ツバキ・ナカシマ	200	1,724.00	344,800
		ホシザキ	400	8,760.00	3,504,000
		大豊工業	200	1,688.00	337,600
		日本精工	3,800	1,379.00	5,240,200
		N T N	4,000	502.00	2,008,000
		ジェイテクト	2,000	1,936.00	3,872,000
		不二越	2,000	507.00	1,014,000
		日本トムソン	700	505.00	353,500
		T H K	1,300	2,584.00	3,359,200
		ユーシン精機	100	2,649.00	264,900
		前澤給装工業	400	1,526.00	610,400
		イーグル工業	200	1,617.00	323,400
		日本ピラー工業	200	1,266.00	253,200
		キッツ	1,000	670.00	670,000
		日立工機	500	1,113.00	556,500
		マキタ	1,200	7,470.00	8,964,000
		日立造船	1,500	624.00	936,000
		三菱重工業	31,000	557.90	17,294,900
		I H I	14,000	349.00	4,886,000
		スター精密	300	1,609.00	482,700
		日清紡ホールディングス	1,000	1,137.00	1,137,000
		イビデン	1,300	1,657.00	2,154,100
		コニカミノルタ	4,400	1,136.00	4,998,400
		ブラザー工業	2,400	2,043.00	4,903,200
		ミネベア	3,000	1,193.00	3,579,000
		日立製作所	44,000	643.60	28,318,400
		東芝	41,000	453.80	18,605,800
		三菱電機	19,800	1,654.00	32,749,200
		富士電機	6,000	607.00	3,642,000
		安川電機	2,100	1,845.00	3,874,500
		シンフォニアテクノロジー	1,000	283.00	283,000
		明電舎	2,000	390.00	780,000
		山洋電気	1,000	776.00	776,000
		デンヨー	200	1,540.00	308,000
		東芝テック	1,000	581.00	581,000
		マブチモーター	500	6,410.00	3,205,000
		日本電産	2,400	9,888.00	23,731,200
		東光高岳	100	1,981.00	198,100
		ダブル・スコープ	200	1,653.00	330,600
		ダイヘン	1,000	741.00	741,000
		田淵電機	400	404.00	161,600
		J V C ケンウッド	1,300	305.00	396,500
		ミマキエンジニアリング	200	701.00	140,200
		日新電機	400	1,221.00	488,400
		オムロン	2,000	4,560.00	9,120,000
		日東工業	300	1,686.00	505,800
		I D E C	300	1,050.00	315,000
		ジーエス・ユアサ コーポレーション	4,000	494.00	1,976,000
サクサホールディングス	1,000	229.00	229,000		
メルコホールディングス	100	3,060.00	306,000		
日本電気	26,000	323.00	8,398,000		
富士通	18,000	706.10	12,709,800		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	沖電気工業	800	1,692.00	1,353,600
		電気興業	1,000	584.00	584,000
		サンケン電気	1,000	570.00	570,000
		アイホン	100	1,926.00	192,600
		ルネサスエレクトロニクス	1,000	967.00	967,000
		セイコーエプソン	2,800	2,443.00	6,840,400
		ワコム	1,400	319.00	446,600
		アルバック	400	3,315.00	1,326,000
		E I Z O	200	3,525.00	705,000
		ジャパンディスプレイ	3,600	320.00	1,152,000
		日本信号	600	965.00	579,000
		能美防災	200	1,707.00	341,400
		ホーチキ	200	1,297.00	259,400
		エレコム	100	1,896.00	189,600
		日本無線	100	1,370.00	137,000
		パナソニック	20,900	1,271.50	26,574,350
		アンリツ	1,300	635.00	825,500
		富士通ゼネラル	1,000	2,155.00	2,155,000
		日立国際電気	500	2,149.00	1,074,500
		ソニー	13,100	3,366.00	44,094,600
		T D K	1,000	8,340.00	8,340,000
		ミツミ電機	700	699.00	489,300
		タムラ製作所	1,000	451.00	451,000
		アルプス電気	1,700	2,952.00	5,018,400
		パイオニア	2,800	245.00	686,000
		日本電波工業	200	911.00	182,200
		ローランド ディー・ジー・	100	3,110.00	311,000
		フォスター電機	200	2,182.00	436,400
		クラリオン	1,000	420.00	420,000
		S M K	1,000	441.00	441,000
		ヨコオ	100	817.00	81,700
		ホシデン	600	918.00	550,800
		ヒロセ電機	300	13,950.00	4,185,000
		日本航空電子工業	1,000	1,601.00	1,601,000
		T O A	200	1,050.00	210,000
		日立マクセル	300	2,026.00	607,800
		古野電気	300	909.00	272,700
		ユニデンホールディングス	1,000	178.00	178,000
		アルパイン	400	1,618.00	647,200
		スミダコーポレーション	100	998.00	99,800
		アイコム	100	2,158.00	215,800
		船井電機	200	999.00	199,800
		横河電機	2,000	1,616.00	3,232,000
		新電元工業	1,000	434.00	434,000
		アズビル	500	3,200.00	1,600,000
		日本光電工業	800	2,531.00	2,024,800
		チノー	100	1,107.00	110,700
共和電業	400	409.00	163,600		
堀場製作所	400	5,140.00	2,056,000		
アドバンテスト	1,300	1,579.00	2,052,700		
エスペック	200	1,322.00	264,400		
パナソニック デバイス S U N X	200	704.00	140,800		
キーエンス	400	73,120.00	29,248,000		
シスメックス	1,400	6,390.00	8,946,000		
日本マイクロニクス	300	1,053.00	315,900		
メガチップス	200	2,533.00	506,600		
O B A R A G R O U P	100	5,480.00	548,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	コーセル	300	1,239.00	371,700
		イリソ電子工業	100	6,940.00	694,000
		オプテックス	200	2,375.00	475,000
		千代田インテグレ	100	2,461.00	246,100
		レーザーテック	200	1,961.00	392,200
		スタンレー電気	1,300	3,090.00	4,017,000
		岩崎電気	1,000	185.00	185,000
		ウシオ電機	1,100	1,452.00	1,597,200
		ヘリオス テクノ ホールディング	300	467.00	140,100
		日本セラミック	100	2,171.00	217,100
		日本デジタル研究所	100	2,414.00	241,400
		山一電機	200	1,156.00	231,200
		日本電子	1,000	505.00	505,000
		カシオ計算機	1,600	1,666.00	2,665,600
		ファナック	1,900	20,465.00	38,883,500
		日本シイエムケイ	400	665.00	266,000
		エンプラス	100	3,570.00	357,000
		ローム	900	6,680.00	6,012,000
		浜松ホトニクス	1,400	3,080.00	4,312,000
		三井ハイテック	300	789.00	236,700
		新光電気工業	800	757.00	605,600
		京セラ	3,000	5,760.00	17,280,000
		太陽誘電	900	1,270.00	1,143,000
		村田製作所	1,900	15,615.00	29,668,500
		ユーシン	400	752.00	300,800
		双葉電子工業	400	1,899.00	759,600
		北陸電気工業	1,000	134.00	134,000
		ニチコン	600	1,047.00	628,200
		日本ケミコン	2,000	264.00	528,000
		K O A	200	1,082.00	216,400
		市光工業	1,000	380.00	380,000
		小糸製作所	1,100	6,040.00	6,644,000
		ミツバ	300	1,765.00	529,500
		S C R E E Nホールディングス	400	6,480.00	2,592,000
		キャノン電子	200	1,811.00	362,200
		キャノン	10,000	3,417.00	34,170,000
		リコー	5,400	1,038.00	5,605,200
		東京エレクトロン	1,200	10,060.00	12,072,000
		トヨタ紡織	700	2,633.00	1,843,100
		ユニプレス	400	2,291.00	916,400
		豊田自動織機	1,700	5,730.00	9,741,000
		モリタホールディングス	400	1,634.00	653,600
		三櫻工業	200	762.00	152,400
		デンソー	4,500	5,053.00	22,738,500
		東海理化電機製作所	500	2,398.00	1,199,000
		三井造船	7,000	187.00	1,309,000
		川崎重工業	14,000	395.00	5,530,000
		名村造船所	600	841.00	504,600
		日本車輛製造	1,000	285.00	285,000
		ニチュ三菱フォークリフト	300	850.00	255,000
		日産自動車	22,200	1,131.00	25,108,200
		いすゞ自動車	5,400	1,505.50	8,129,700
		トヨタ自動車	22,800	7,001.00	159,622,800
		日野自動車	2,600	1,227.00	3,190,200
		三菱自動車工業	6,800	637.00	4,331,600
		エフテック	100	1,338.00	133,800
		武蔵精密工業	200	2,980.00	596,000

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	日産車体	900	1,126.00	1,013,400
		新明和工業	1,000	1,046.00	1,046,000
		極東開発工業	300	1,556.00	466,800
		日信工業	400	1,813.00	725,200
		トピー工業	100	2,956.00	295,600
		ティラド	1,000	287.00	287,000
		曙ブレーキ工業	900	312.00	280,800
		タチエス	300	1,900.00	570,000
		N O K	900	2,375.00	2,137,500
		フタバ産業	600	700.00	420,000
		K Y B	2,000	536.00	1,072,000
		大同メタル工業	300	1,197.00	359,100
		プレス工業	900	532.00	478,800
		カルソニックカンセイ	1,000	1,743.00	1,743,000
		太平洋工業	400	1,430.00	572,000
		ケーヒン	400	1,967.00	786,800
		河西工業	200	1,385.00	277,000
		アイシン精機	1,700	5,000.00	8,500,000
		富士機工	200	464.00	92,800
		マツダ	5,800	1,985.50	11,515,900
		今仙電機製作所	200	1,015.00	203,000
		本田技研工業	16,500	3,466.00	57,189,000
		スズキ	3,600	3,997.00	14,389,200
		富士重工業	5,700	4,867.00	27,741,900
		ヤマハ発動機	2,600	2,779.00	7,225,400
		ショーワ	500	783.00	391,500
		T B K	200	493.00	98,600
		エクセディ	300	3,265.00	979,500
		豊田合成	600	2,655.00	1,593,000
		愛三工業	300	1,001.00	300,300
		ヨロズ	200	1,699.00	339,800
		エフ・シー・シー	300	2,110.00	633,000
		シマノ	700	17,980.00	12,586,000
		タカタ	400	617.00	246,800
		テイ・エス テック	500	3,085.00	1,542,500
		ジャムコ	100	2,500.00	250,000
		テルモ	2,800	4,125.00	11,550,000
		日機装	700	1,105.00	773,500
		島津製作所	2,000	1,777.00	3,554,000
		J M S	1,000	298.00	298,000
		長野計器	300	682.00	204,600
		東京計器	1,000	210.00	210,000
		東京精密	300	3,195.00	958,500
		マニー	300	2,632.00	789,600
		ニコン	3,300	1,755.00	5,791,500
		トプコン	900	1,768.00	1,591,200
		オリンパス	3,000	4,210.00	12,630,000
		理研計器	100	1,530.00	153,000
		タムロン	200	2,062.00	412,400
		H O Y A	3,800	4,487.00	17,050,600
ノーリツ鋼機	200	811.00	162,200		
エー・アンド・デイ	400	472.00	188,800		
シチズン時計	2,200	731.00	1,608,200		
リズム時計工業	1,000	185.00	185,000		
大研医器	100	813.00	81,300		
メニコン	100	2,947.00	294,700		
松風	100	1,350.00	135,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	セイコーホールディングス	1,000	445.00	445,000
		ニプロ	1,300	1,235.00	1,605,500
		パラマウントベッドホールディングス	200	4,365.00	873,000
		前田工織	200	1,232.00	246,400
		アートネイチャー	200	654.00	130,800
		バンダイナムコホールディングス	2,000	3,150.00	6,300,000
		共立印刷	1,300	317.00	412,100
		S H O E I	100	2,307.00	230,700
		フランスベッドホールディングス	300	906.00	271,800
		パイロットコーポレーション	300	4,800.00	1,440,000
		萩原工業	100	2,447.00	244,700
		トッパン・フォームズ	300	1,127.00	338,100
		フジシールインターナショナル	200	4,515.00	903,000
		タカラトミー	700	1,155.00	808,500
		アーク	1,700	127.00	215,900
		プロネクサス	200	1,051.00	210,200
		大建工業	100	2,020.00	202,000
		凸版印刷	5,000	1,096.00	5,480,000
		大日本印刷	5,000	1,150.00	5,750,000
		日本写真印刷	300	2,816.00	844,800
		宝印刷	300	1,487.00	446,100
		アシックス	1,800	2,484.00	4,471,200
		ツツミ	100	1,863.00	186,300
		小松ウオール工業	100	1,917.00	191,700
		ヤマハ	1,300	3,555.00	4,621,500
		河合楽器製作所	100	2,190.00	219,000
		クリナップ	300	994.00	298,200
		ピジョン	1,100	2,813.00	3,094,300
		リンテック	400	2,502.00	1,000,800
		イトーキ	400	830.00	332,000
		任天堂	1,100	29,400.00	32,340,000
		三菱鉛筆	200	6,300.00	1,260,000
		タカラスタANDARD	400	2,013.00	805,200
		コクヨ	1,000	1,359.00	1,359,000
		グローブライド	100	2,006.00	200,600
		岡村製作所	600	1,005.00	603,000
		美津濃	1,000	561.00	561,000
		アデランス	300	622.00	186,600
		東京電力ホールディングス	15,500	513.00	7,951,500
		中部電力	6,100	1,708.00	10,418,800
		関西電力	7,600	1,289.50	9,800,200
		中国電力	2,500	1,408.00	3,520,000
		北陸電力	1,700	1,353.00	2,300,100
		東北電力	4,600	1,503.00	6,913,800
		四国電力	1,700	1,200.00	2,040,000
		九州電力	4,000	1,287.00	5,148,000
		北海道電力	1,700	924.00	1,570,800
		沖縄電力	300	2,544.00	763,200
		電源開発	1,500	2,902.00	4,353,000
		イーレックス	100	2,875.00	287,500
東京瓦斯	20,000	527.20	10,544,000		
大阪瓦斯	18,000	447.60	8,056,800		
東邦瓦斯	5,000	934.00	4,670,000		
広島ガス	300	378.00	113,400		
西部瓦斯	2,000	253.00	506,000		
静岡ガス	700	809.00	566,300		
メタウォーター	100	2,895.00	289,500		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	SBSホールディングス	200	873.00	174,600
		東武鉄道	10,000	561.00	5,610,000
		相鉄ホールディングス	3,000	563.00	1,689,000
		東京急行電鉄	10,000	881.00	8,810,000
		京浜急行電鉄	5,000	1,290.00	6,450,000
		小田急電鉄	2,900	2,253.00	6,533,700
		京王電鉄	5,000	923.00	4,615,000
		京成電鉄	1,400	2,715.00	3,801,000
		富士急行	1,000	1,032.00	1,032,000
		新京成電鉄	1,000	411.00	411,000
		東日本旅客鉄道	3,600	9,995.00	35,982,000
		西日本旅客鉄道	1,800	7,131.00	12,835,800
		東海旅客鉄道	1,500	18,870.00	28,305,000
		西武ホールディングス	2,600	2,083.00	5,415,800
		鴻池運輸	200	1,595.00	319,000
		西日本鉄道	2,000	525.00	1,050,000
		ハマキョウレックス	100	2,128.00	212,800
		サカイ引越センター	100	2,432.00	243,200
		近鉄グループホールディングス	19,000	445.00	8,455,000
		阪急阪神ホールディングス	2,400	3,690.00	8,856,000
		南海電気鉄道	4,000	585.00	2,340,000
		京阪ホールディングス	4,000	768.00	3,072,000
		神戸電鉄	2,000	370.00	740,000
		名古屋鉄道	7,000	563.00	3,941,000
		山陽電気鉄道	1,000	581.00	581,000
		日本通運	7,000	606.00	4,242,000
		ヤマトホールディングス	3,300	2,361.50	7,792,950
		山九	3,000	706.00	2,118,000
		センコー	800	819.00	655,200
		ニッコンホールディングス	600	2,387.00	1,432,200
		日本石油輸送	200	2,435.00	487,000
		福山通運	1,000	663.00	663,000
		セイノーホールディングス	1,400	1,282.00	1,794,800
		日立物流	400	2,403.00	961,200
		丸和運輸機関	100	2,859.00	285,900
		C&Fロジホールディングス	200	1,331.00	266,200
		九州旅客鉄道	600	3,035.00	1,821,000
		日本郵船	16,000	239.00	3,824,000
		商船三井	10,000	337.00	3,370,000
		川崎汽船	7,000	281.00	1,967,000
		NSユナイテッド海運	1,000	205.00	205,000
		飯野海運	800	468.00	374,400
		乾汽船	200	940.00	188,000
		日本航空	3,300	3,488.00	11,510,400
		ANAホールディングス	34,000	316.70	10,767,800
		トランコム	100	5,430.00	543,000
日新	1,000	352.00	352,000		
三菱倉庫	1,000	1,620.00	1,620,000		
三井倉庫ホールディングス	1,000	363.00	363,000		
住友倉庫	1,000	628.00	628,000		
日本トランスシティ	1,000	416.00	416,000		
中央倉庫	100	1,065.00	106,500		
安田倉庫	200	774.00	154,800		
東洋埠頭	1,000	199.00	199,000		
上組	2,000	1,113.00	2,226,000		
キューソー流通システム	100	2,323.00	232,300		
郵船ロジスティクス	200	1,244.00	248,800		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	近鉄エクスプレス	300	1,758.00	527,400
		エーアイティー	100	1,053.00	105,300
		NEC ネットエスアイ	100	2,074.00	207,400
		システナ	200	1,547.00	309,400
		デジタルアーツ	100	2,544.00	254,400
		新日鉄住金ソリューションズ	300	2,094.00	628,200
		コア	100	1,158.00	115,800
		T I S	600	2,420.00	1,452,000
		グリー	1,100	617.00	678,700
		コーエーテクモホールディングス	400	1,907.00	762,800
		三菱総合研究所	100	3,190.00	319,000
		ファインデックス	100	878.00	87,800
		ヒト・コミュニケーションズ	100	1,454.00	145,400
		K L a b	400	653.00	261,200
		ネクソン	2,000	1,633.00	3,266,000
		アイスタイル	300	753.00	225,900
		エイチーム	100	2,159.00	215,900
		テクノスジャパン	100	2,468.00	246,800
		コロブラ	500	960.00	480,000
		ブロードリーフ	300	1,428.00	428,400
		ハーツユニテッドグループ	100	1,515.00	151,500
		ブイキューブ	100	665.00	66,500
		ティーガイア	200	1,807.00	361,400
		テクマトリックス	100	1,890.00	189,000
		ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,900	243.00	947,700
		GMO ペイメントゲートウェイ	100	4,165.00	416,500
		インターネットイニシアティブ	300	1,696.00	508,800
		さくらインターネット	200	929.00	185,800
		S R A ホールディングス	100	2,400.00	240,000
		朝日ネット	700	489.00	342,300
		g u m i	200	880.00	176,000
		L I N E	300	4,115.00	1,234,500
		フェイス	100	1,222.00	122,200
		野村総合研究所	1,200	3,905.00	4,686,000
		サイバネットシステム	200	627.00	125,400
		インテージホールディングス	100	1,957.00	195,700
		ティー・ワイ・オー	600	150.00	90,000
		フジ・メディア・ホールディングス	1,900	1,659.00	3,152,100
		オービック	600	4,920.00	2,952,000
		ジャストシステム	400	1,073.00	429,200
		T D C ソフトウェアエンジニアリング	100	1,085.00	108,500
		ヤフー	13,100	442.00	5,790,200
		トレンドマイクロ	1,000	4,140.00	4,140,000
		日本オラクル	300	5,560.00	1,668,000
		フューチャー	200	738.00	147,600
		C A C H o l d i n g s	200	927.00	185,400
		ソフトバンク・テクノロジー	100	3,285.00	328,500
		オービックビジネスコンサルタント	100	4,950.00	495,000
		伊藤忠テクノソリューションズ	400	2,940.00	1,176,000
		アイティフォー	200	620.00	124,000
		大塚商会	500	5,340.00	2,670,000
		サイボウズ	200	458.00	91,600
		電通国際情報サービス	100	1,826.00	182,600
		デジタルガレージ	300	1,945.00	583,500
		ウェザーニューズ	100	3,480.00	348,000
		C I J	800	530.00	424,000
		WOWOW	100	3,175.00	317,500

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	スカラ	100	1,021.00	102,100
		イマジカ・ロボット ホールディングス	100	667.00	66,700
		ネットワンシステムズ	800	748.00	598,400
		マーベラス	400	780.00	312,000
		エイベックス・グループ・ホールディングス	300	1,695.00	508,500
		日本ユニシス	600	1,412.00	847,200
		兼松エレクトロニクス	100	2,338.00	233,800
		東京放送ホールディングス	1,200	1,887.00	2,264,400
		日本テレビホールディングス	1,700	2,048.00	3,481,600
		テレビ朝日ホールディングス	500	2,206.00	1,103,000
		スカパー J S A Tホールディングス	1,200	552.00	662,400
		テレビ東京ホールディングス	200	2,282.00	456,400
		ワイヤレスゲート	100	1,700.00	170,000
		コネクシオ	100	1,451.00	145,100
		日本通信	1,700	195.00	331,500
		日本電信電話	14,700	4,705.00	69,163,500
		K D D I	18,000	2,977.50	53,595,000
		光通信	200	10,550.00	2,110,000
		N T T ドコモ	13,700	2,638.00	36,140,600
		エムティーアイ	400	765.00	306,000
		G M O インターネット	700	1,464.00	1,024,800
		カドカワ	500	1,572.00	786,000
		ゼンリン	200	1,830.00	366,000
		松竹	1,000	1,231.00	1,231,000
		東宝	1,200	3,250.00	3,900,000
		東映	1,000	930.00	930,000
		エヌ・ティ・ティ・データ	1,100	5,670.00	6,237,000
		D T S	100	2,509.00	250,900
		スクウェア・エニックス・ホールディングス	700	3,000.00	2,100,000
		シーイーシー	100	1,682.00	168,200
		カプコン	400	2,552.00	1,020,800
		ジャステック	300	1,066.00	319,800
		S C S K	500	3,815.00	1,907,500
		日本システムウエア	100	1,408.00	140,800
		アイネス	200	1,242.00	248,400
		T K C	200	3,080.00	616,000
		富士ソフト	300	2,768.00	830,400
		N S D	400	1,788.00	715,200
		コナミホールディングス	800	4,115.00	3,292,000
		福井コンピュータホールディングス	100	2,405.00	240,500
		ミロク情報サービス	100	1,821.00	182,100
		ソフトバンクグループ	8,200	7,782.00	63,812,400
		エレマテック	100	1,846.00	184,600
		J A L U X	100	1,885.00	188,500
		あらた	100	2,517.00	251,700
		トーメンデバイス	100	2,049.00	204,900
		フィールズ	100	1,463.00	146,300
		双日	11,000	299.00	3,289,000
		アルフレッサ ホールディングス	2,100	1,848.00	3,880,800
		横浜冷凍	400	1,030.00	412,000
		ラサ商事	100	620.00	62,000
		アルコニックス	100	1,803.00	180,300
		神戸物産	100	3,490.00	349,000
あい ホールディングス	300	2,307.00	692,100		
ディーブイエックス	100	1,329.00	132,900		
ダイワボウホールディングス	2,000	298.00	596,000		
マクニカ・富士エレホールディングス	300	1,383.00	414,900		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	バイタルケーエスケー・ホールディングス	300	981.00	294,300
		八洲電機	400	598.00	239,200
		UKCホールディングス	200	2,087.00	417,400
		TOKAIホールディングス	900	767.00	690,300
		三洋貿易	100	1,532.00	153,200
		シップヘルスケアホールディングス	400	2,942.00	1,176,800
		コメダホールディングス	200	1,729.00	345,800
		小野建	200	1,331.00	266,200
		佐島電機	300	733.00	219,900
		コンドーテック	300	835.00	250,500
		中山福	200	809.00	161,800
		ナガイレーベン	300	2,440.00	732,000
		三菱食品	200	3,270.00	654,000
		松田産業	100	1,498.00	149,800
		第一興商	300	4,450.00	1,335,000
		メディカルホールディングス	1,800	1,758.00	3,164,400
		アズワン	100	4,950.00	495,000
		スズデン	100	1,022.00	102,200
		シモジマ	200	1,114.00	222,800
		ドウシシャ	200	2,000.00	400,000
		高速	300	1,043.00	312,900
		たけびし	300	1,150.00	345,000
		黒田電気	200	2,359.00	471,800
		丸文	300	703.00	210,900
		ハピネット	200	1,306.00	261,200
		日本ライフライン	200	2,320.00	464,000
		エクセル	100	1,500.00	150,000
		マルカキカイ	100	1,528.00	152,800
		IDOM	500	615.00	307,500
		日本エム・ディ・エム	200	826.00	165,200
		進和	200	1,754.00	350,800
		シークス	100	3,845.00	384,500
		オーハシテクニカ	100	1,394.00	139,400
		伊藤忠商事	13,300	1,649.00	21,931,700
		丸紅	17,800	681.40	12,128,920
		高島	1,000	197.00	197,000
		長瀬産業	1,100	1,507.00	1,657,700
		蝶理	100	1,730.00	173,000
		豊田通商	2,000	3,055.00	6,110,000
		兼松	4,000	202.00	808,000
		三井物産	16,500	1,692.00	27,918,000
		日本紙パルプ商事	1,000	376.00	376,000
		日立ハイテクノロジー	600	4,270.00	2,562,000
		カメイ	200	1,175.00	235,000
		スターゼン	100	4,620.00	462,000
		山善	700	947.00	662,900
		椿本興業	1,000	344.00	344,000
		住友商事	11,400	1,417.50	16,159,500
		三菱商事	13,600	2,550.00	34,680,000
		キャノンマーケティングジャパン	600	1,886.00	1,131,600
		西華産業	1,000	343.00	343,000
		菱洋エレクトロ	200	1,407.00	281,400
		東京産業	300	491.00	147,300
		ユアサ商事	100	2,950.00	295,000
		阪和興業	2,000	771.00	1,542,000
		菱電商事	1,000	740.00	740,000
フルサト工業	100	1,645.00	164,500		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	岩谷産業	2,000	629.00	1,258,000
		すてきなイスグループ	1,000	160.00	160,000
		イワキ	1,000	214.00	214,000
		三愛石油	500	877.00	438,500
		稲畑産業	400	1,278.00	511,200
		ワキタ	400	982.00	392,800
		東邦ホールディングス	600	2,310.00	1,386,000
		サンゲツ	600	2,049.00	1,229,400
		ミツウロコグループホールディングス	400	711.00	284,400
		伊藤忠エネクス	400	897.00	358,800
		サンリオ	600	2,280.00	1,368,000
		サンワテクノス	100	951.00	95,100
		リョーサン	300	3,485.00	1,045,500
		新光商事	200	1,220.00	244,000
		トーホー	100	2,496.00	249,600
		三信電気	200	1,100.00	220,000
		東陽テクニカ	100	1,007.00	100,700
		モスフードサービス	200	3,435.00	687,000
		加賀電子	200	1,840.00	368,000
		ソーダニッカ	600	509.00	305,400
		立花エレテック	200	1,321.00	264,200
		PALTA C	300	2,514.00	754,200
		日鉄住金物産	200	4,685.00	937,000
		トラスコ中山	200	4,895.00	979,000
		オートバックスセブン	700	1,692.00	1,184,400
		加藤産業	300	2,583.00	774,900
		イエローハット	100	2,387.00	238,700
		J Kホールディングス	400	599.00	239,600
		日伝	100	3,150.00	315,000
		因幡電機産業	300	4,065.00	1,219,500
		ミスミグループ本社	2,000	1,952.00	3,904,000
		スズケン	800	3,620.00	2,896,000
		ジェコス	100	1,032.00	103,200
		ルネサスイーストン	400	509.00	203,600
		ローソン	600	8,020.00	4,812,000
		サンエー	100	5,450.00	545,000
		カワチ薬品	200	2,757.00	551,400
		エービーシー・マート	300	6,390.00	1,917,000
		ハードオフコーポレーション	100	1,198.00	119,800
		アスクル	200	4,080.00	816,000
		ゲオホールディングス	400	1,311.00	524,400
		アダストリア	300	3,185.00	955,500
		くらコーポレーション	100	4,780.00	478,000
		キャンドウ	100	1,775.00	177,500
		パルグループホールディングス	100	2,875.00	287,500
		エディオン	600	1,133.00	679,800
		サーラコーポレーション	200	649.00	129,800
ワッツ	100	1,054.00	105,400		
ハローズ	100	2,254.00	225,400		
ひらまつ	300	654.00	196,200		
ハニーズ	200	1,171.00	234,200		
アルペン	100	2,277.00	227,700		
クオール	200	1,456.00	291,200		
ジェイアイエヌ	100	4,850.00	485,000		
ビックカメラ	1,000	1,055.00	1,055,000		
DCMホールディングス	1,000	1,001.00	1,001,000		
MonotaRO	600	2,324.00	1,394,400		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	アークランドサービスホールディングス	100	2,895.00	289,500
		J・フロント リテイリング	2,300	1,735.00	3,990,500
		ドトール・日レスホールディングス	300	2,129.00	638,700
		マツモトキヨシホールディングス	400	5,740.00	2,296,000
		ブロンコビリー	100	2,942.00	294,200
		スタートトゥデイ	1,700	1,837.00	3,122,900
		物語コーポレーション	200	4,235.00	847,000
		ココカラファイン	200	4,300.00	860,000
		三越伊勢丹ホールディングス	3,700	1,354.00	5,009,800
		ウエルシアホールディングス	200	6,620.00	1,324,000
		クリエイティブSDホールディングス	300	2,419.00	725,700
		丸善CHIホールディングス	400	370.00	148,000
		ジョイフル本田	300	3,030.00	909,000
		鳥貴族	100	2,298.00	229,800
		ホットランド	100	1,182.00	118,200
		すかいらーく	800	1,587.00	1,269,600
		綿半ホールディングス	100	1,617.00	161,700
		ユニテッド・スーパーマーケット・ホール	800	966.00	772,800
		あさひ	200	1,324.00	264,800
		日本調剤	100	4,470.00	447,000
		コスモス薬品	100	20,140.00	2,014,000
		セブン&アイ・ホールディングス	7,600	4,484.00	34,078,400
		クリエイティブ・レストランツ・ホールディング	400	1,007.00	402,800
		ツルハホールディングス	400	10,730.00	4,292,000
		サンマルクホールディングス	100	3,475.00	347,500
		トリドールホールディングス	200	2,408.00	481,600
		クスリのアオキホールディングス	200	4,730.00	946,000
		総合メディカル	100	3,805.00	380,500
		ノジマ	200	1,300.00	260,000
		カッパ・クリエイティブ	200	1,290.00	258,000
		ライトオン	200	1,045.00	209,000
		良品計画	200	22,520.00	4,504,000
		三城ホールディングス	500	454.00	227,000
		アドヴァン	200	1,094.00	218,800
		コナカ	500	586.00	293,000
		ハウス オブ ローゼ	300	1,504.00	451,200
		G-7ホールディングス	100	1,410.00	141,000
		コジマ	600	285.00	171,000
		コーナン商事	300	2,241.00	672,300
		ワタミ	200	1,091.00	218,200
		ドンキホーテホールディングス	1,200	4,200.00	5,040,000
		西松屋チェーン	300	1,446.00	433,800
		ゼンショーホールディングス	1,000	1,908.00	1,908,000
		幸楽苑ホールディングス	500	1,627.00	813,500
		サイゼリヤ	300	2,592.00	777,600
		VTホールディングス	600	562.00	337,200
		魚力	100	1,252.00	125,200
ユニテッドアローズ	200	3,125.00	625,000		
ハイデイ日高	200	2,633.00	526,600		
京都きもの友禅	100	937.00	93,700		
コロワイド	600	1,852.00	1,111,200		
ピーシーデポコーポレーション	300	617.00	185,100		
壱番屋	100	3,720.00	372,000		
スギホールディングス	400	5,320.00	2,128,000		
スクロール	400	356.00	142,400		
ヨンドシーホールディングス	100	2,417.00	241,700		
ユニー・ファミリーマートホールディングス	800	7,320.00	5,856,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	木曽路	200	2,317.00	463,400
		サトレストランシステムズ	200	815.00	163,000
		千趣会	500	740.00	370,000
		日本瓦斯	300	3,570.00	1,071,000
		ベスト電器	1,100	161.00	177,100
		ロイヤルホールディングス	400	1,935.00	774,000
		いなげや	200	1,425.00	285,000
		島忠	500	3,100.00	1,550,000
		チヨダ	200	2,676.00	535,200
		ライフコーポレーション	100	3,340.00	334,000
		リンガーハット	200	2,111.00	422,200
		MrMax	200	417.00	83,400
		テンアライド	1,100	378.00	415,800
		AOKIホールディングス	400	1,407.00	562,800
		コメリ	300	2,735.00	820,500
		青山商事	400	3,970.00	1,588,000
		しまむら	200	13,590.00	2,718,000
		はせがわ	300	443.00	132,900
		高島屋	3,000	992.00	2,976,000
		松屋	400	1,093.00	437,200
		エイチ・ツー・オー リテイリング	1,000	1,829.00	1,829,000
		近鉄百貨店	1,000	351.00	351,000
		パルコ	200	1,025.00	205,000
		丸井グループ	1,900	1,736.00	3,298,400
		アクシアル リテイリング	200	3,830.00	766,000
		イオン	7,500	1,659.00	12,442,500
		イズミ	400	4,825.00	1,930,000
		東武ストア	100	2,828.00	282,800
		平和堂	400	2,451.00	980,400
		フジ	200	2,288.00	457,600
		ヤオコー	200	4,335.00	867,000
		ゼビオホールディングス	300	1,862.00	558,600
		ケーズホールディングス	800	2,145.00	1,716,000
		日産東京販売ホールディングス	700	309.00	216,300
		アインホールディングス	200	7,920.00	1,584,000
		元気寿司	100	2,074.00	207,400
		ヤマダ電機	6,100	634.00	3,867,400
		アークランドサカモト	300	1,376.00	412,800
		ニトリホールディングス	800	11,920.00	9,536,000
		吉野家ホールディングス	600	1,550.00	930,000
		松屋フーズ	100	3,610.00	361,000
		サガミチェーン	400	1,261.00	504,400
		関西スーパーマーケット	200	1,449.00	289,800
		王将フードサービス	100	4,130.00	413,000
		プレナス	200	2,225.00	445,000
		ミニストップ	100	1,969.00	196,900
		アークス	400	2,581.00	1,032,400
		パローホールディングス	400	2,883.00	1,153,200
		ベルク	100	4,215.00	421,500
		大庄	100	1,567.00	156,700
		ファーストリテイリング	300	43,130.00	12,939,000
		サンドラッグ	300	7,800.00	2,340,000
		サックスパー ホールディングス	200	1,181.00	236,200
ヤマザワ	100	1,733.00	173,300		
ベルーナ	500	629.00	314,500		
じもとホールディングス	1,700	201.00	341,700		
めぶきフィナンシャルグループ	9,000	440.00	3,960,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	東京ＴＹフィナンシャルグループ	300	4,265.00	1,279,500
		九州フィナンシャルグループ	2,900	813.00	2,357,700
		ゆうちょ銀行	5,200	1,470.00	7,644,000
		富山第一銀行	400	542.00	216,800
		コンコルディア・フィナンシャルグループ	12,000	574.40	6,892,800
		西日本フィナンシャルホールディングス	1,200	1,136.00	1,363,200
		新生銀行	17,000	208.00	3,536,000
		あおぞら銀行	12,000	424.00	5,088,000
		三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	137,600	752.60	103,557,760
		りそなホールディングス	21,300	613.40	13,065,420
		三井住友トラスト・ホールディングス	3,800	4,444.00	16,887,200
		三井住友フィナンシャルグループ	14,500	4,683.00	67,903,500
		第四銀行	2,000	528.00	1,056,000
		北越銀行	200	2,687.00	537,400
		千葉銀行	7,000	744.00	5,208,000
		群馬銀行	4,100	668.00	2,738,800
		武蔵野銀行	300	3,395.00	1,018,500
		千葉興業銀行	400	599.00	239,600
		筑波銀行	700	362.00	253,400
		七十七銀行	3,000	606.00	1,818,000
		青森銀行	1,000	389.00	389,000
		秋田銀行	1,000	382.00	382,000
		山形銀行	1,000	491.00	491,000
		岩手銀行	100	4,835.00	483,500
		東邦銀行	2,000	440.00	880,000
		みちのく銀行	1,000	227.00	227,000
		ふくおかフィナンシャルグループ	8,000	550.00	4,400,000
		静岡銀行	5,000	1,021.00	5,105,000
		十六銀行	2,000	419.00	838,000
		スルガ銀行	1,900	2,755.00	5,234,500
		八十二銀行	3,500	689.00	2,411,500
		山梨中央銀行	1,000	553.00	553,000
		大垣共立銀行	2,000	451.00	902,000
		福井銀行	1,000	297.00	297,000
		北國銀行	2,000	412.00	824,000
		清水銀行	100	3,620.00	362,000
		滋賀銀行	2,000	646.00	1,292,000
		南都銀行	200	4,510.00	902,000
		百五銀行	1,000	489.00	489,000
		京都銀行	3,000	929.00	2,787,000
		紀陽銀行	700	1,899.00	1,329,300
		三重銀行	100	2,410.00	241,000
		ほくほくフィナンシャルグループ	1,200	2,052.00	2,462,400
		広島銀行	5,000	567.00	2,835,000
		山陰合同銀行	1,100	980.00	1,078,000
		中国銀行	1,200	1,716.00	2,059,200
		伊予銀行	2,000	812.00	1,624,000
		百十四銀行	2,000	398.00	796,000
		四国銀行	2,000	288.00	576,000
		阿波銀行	2,000	723.00	1,446,000
		大分銀行	1,000	434.00	434,000
		宮崎銀行	1,000	371.00	371,000
		佐賀銀行	1,000	302.00	302,000
十八銀行	1,000	356.00	356,000		
沖縄銀行	200	4,290.00	858,000		
琉球銀行	400	1,556.00	622,400		
セブン銀行	6,800	343.00	2,332,400		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	みずほフィナンシャルグループ	246,100	220.70	54,314,270
		高知銀行	1,000	140.00	140,000
		山口フィナンシャルグループ	2,000	1,293.00	2,586,000
		長野銀行	100	2,029.00	202,900
		名古屋銀行	100	4,230.00	423,000
		北洋銀行	3,100	493.00	1,528,300
		愛知銀行	100	6,860.00	686,000
		第三銀行	100	1,870.00	187,000
		中京銀行	100	2,370.00	237,000
		大光銀行	1,000	264.00	264,000
		愛媛銀行	300	1,408.00	422,400
		みなと銀行	200	1,980.00	396,000
		京葉銀行	1,000	527.00	527,000
		関西アーバン銀行	300	1,376.00	412,800
		栃木銀行	1,100	572.00	629,200
		東和銀行	3,000	114.00	342,000
		福島銀行	2,000	99.00	198,000
		大東銀行	1,000	169.00	169,000
		トモニホールディングス	1,500	627.00	940,500
		フィデアホールディングス	2,100	212.00	445,200
		池田泉州ホールディングス	2,000	544.00	1,088,000
		F P G	600	941.00	564,600
		S B Iホールディングス	2,000	1,543.00	3,086,000
		ジャフコ	300	3,965.00	1,189,500
		大和証券グループ本社	17,000	758.00	12,886,000
		野村ホールディングス	37,500	751.30	28,173,750
		岡三証券グループ	2,000	745.00	1,490,000
		丸三証券	600	1,043.00	625,800
		東洋証券	1,000	287.00	287,000
		東海東京フィナンシャル・ホールディングス	2,100	659.00	1,383,900
		水戸証券	800	353.00	282,400
		いちよし証券	400	958.00	383,200
		松井証券	900	1,014.00	912,600
		マネックスグループ	1,800	335.00	603,000
		カブドットコム証券	900	407.00	366,300
		極東証券	300	1,824.00	547,200
		岩井コスモホールディングス	200	1,134.00	226,800
		藍澤證券	200	681.00	136,200
		マネーパートナーズグループ	300	518.00	155,400
		かんぽ生命保険	700	2,576.00	1,803,200
		S O M P Oホールディングス	3,700	4,153.00	15,366,100
		アニコムホールディングス	100	2,436.00	243,600
		M S & A Dインシュアランスグループホール	5,400	3,802.00	20,530,800
		ソニーフィナンシャルホールディングス	1,700	1,851.00	3,146,700
		第一生命ホールディングス	10,900	2,015.00	21,963,500
		東京海上ホールディングス	7,300	5,381.00	39,281,300
		T & Dホールディングス	6,700	1,557.50	10,435,250
		全国保証	500	3,770.00	1,885,000
		クレディセゾン	1,400	2,187.00	3,061,800
		芙蓉総合リース	200	5,620.00	1,124,000
興銀リース	300	2,600.00	780,000		
東京センチュリー	400	3,870.00	1,548,000		
日本証券金融	800	631.00	504,800		
アイフル	3,000	375.00	1,125,000		
ポケットカード	200	564.00	112,800		
リコーリース	200	3,595.00	719,000		
イオンフィナンシャルサービス	1,200	2,092.00	2,510,400		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	アコム	3,900	569.00	2,219,100
		ジャックス	1,000	545.00	545,000
		オリエントコーポレーション	3,600	225.00	810,000
		日立キャピタル	400	2,974.00	1,189,600
		オリックス	12,900	1,895.00	24,445,500
		三菱UFJリース	4,600	618.00	2,842,800
		日本取引所グループ	5,700	1,770.00	10,089,000
		イー・ギャランティ	100	2,434.00	243,400
		アサックス	100	1,649.00	164,900
		いちご	1,800	445.00	801,000
		日本駐車場開発	2,400	170.00	408,000
		ヒューリック	3,800	1,080.00	4,104,000
		三栄建築設計	100	1,651.00	165,100
		野村不動産ホールディングス	1,200	2,029.00	2,434,800
		三重交通グループホールディングス	400	394.00	157,600
		サムティ	100	1,074.00	107,400
		日本商業開発	100	1,949.00	194,900
		プレサンスコーポレーション	300	1,494.00	448,200
		ユニゾホールディングス	200	3,310.00	662,000
		日本管理センター	200	1,348.00	269,600
		オープンハウス	300	2,745.00	823,500
		東急不動産ホールディングス	4,400	710.00	3,124,000
		飯田グループホールディングス	1,500	2,237.00	3,355,500
		パーク24	900	3,015.00	2,713,500
		三井不動産	10,000	2,818.00	28,180,000
		三菱地所	13,000	2,414.00	31,382,000
		平和不動産	300	1,687.00	506,100
		東京建物	2,200	1,545.00	3,399,000
		ダイビル	500	1,077.00	538,500
		住友不動産	4,000	3,244.00	12,976,000
		大京	3,000	240.00	720,000
		テーオーシー	700	883.00	618,100
		レオパレス21	2,300	616.00	1,416,800
		スターツコーポレーション	200	2,061.00	412,200
		フジ住宅	400	758.00	303,200
		空港施設	300	587.00	176,100
		住友不動産販売	200	2,872.00	574,400
		ゴールドクレスト	100	2,202.00	220,200
		タカラレーベン	800	715.00	572,000
		サンヨーハウジング名古屋	200	1,067.00	213,400
		イオンモール	1,200	1,695.00	2,034,000
		トーセイ	300	856.00	256,800
		エヌ・ティ・ティ都市開発	1,000	1,035.00	1,035,000
		サンフロンティア不動産	300	1,021.00	306,300
		日本空港ビルデング	600	4,140.00	2,484,000
		日本工営	1,000	534.00	534,000
		ネクスト	500	800.00	400,000
ジェイエイシーリクルートメント	100	1,296.00	129,600		
日本M&Aセンター	600	2,952.00	1,771,200		
アコーディア・ゴルフ	600	1,194.00	716,400		
タケエイ	100	892.00	89,200		
トラスト・テック	100	1,572.00	157,200		
コシダカホールディングス	500	2,000.00	1,000,000		
パソナグループ	200	759.00	151,800		
リンクアンドモチベーション	500	382.00	191,000		
GCA	300	943.00	282,900		
エス・エム・エス	300	2,637.00	791,100		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	テンブホールディングス	1,500	1,648.00	2,472,000
		リニカル	100	1,238.00	123,800
		クックパッド	400	1,048.00	419,200
		アイ・ケイ・ケイ	100	630.00	63,000
		スタジオアリス	100	2,196.00	219,600
		シミックホールディングス	100	1,500.00	150,000
		総合警備保障	700	4,520.00	3,164,000
		カカクコム	1,400	1,793.00	2,510,200
		ルネサンス	200	1,422.00	284,400
		ディップ	300	2,315.00	694,500
		新日本科学	200	561.00	112,200
		ツクイ	500	676.00	338,000
		エムスリー	1,700	2,721.00	4,625,700
		ツカダ・グローバルホールディング	200	729.00	145,800
		アウトソーシング	100	3,475.00	347,500
		ウェルネット	100	1,252.00	125,200
		ディー・エヌ・エー	900	3,150.00	2,835,000
		博報堂D Yホールディングス	2,800	1,330.00	3,724,000
		ぐるなび	300	2,297.00	689,100
		ファンコミュニケーションズ	500	729.00	364,500
		WDBホールディングス	100	1,178.00	117,800
		インフォマート	500	1,185.00	592,500
		J Pホールディングス	600	262.00	157,200
		E P Sホールディングス	300	1,344.00	403,200
		プレステージ・インターナショナル	300	737.00	221,100
		アミューズ	100	1,670.00	167,000
		ドリームインキュベータ	100	2,125.00	212,500
		クイック	200	943.00	188,600
		ケネディクス	2,600	449.00	1,167,400
		電通	2,100	5,260.00	11,046,000
		イオンファンタジー	100	3,005.00	300,500
		みらかホールディングス	500	4,935.00	2,467,500
		アルプス技研	100	2,441.00	244,100
		日本空調サービス	200	576.00	115,200
		オリエンタルランド	2,100	6,481.00	13,610,100
		ダスキン	500	2,303.00	1,151,500
		明光ネットワークジャパン	200	1,016.00	203,200
		ラウンドワン	600	748.00	448,800
		リゾートトラスト	700	2,219.00	1,553,300
		ビー・エム・エル	200	2,762.00	552,400
		りらいあコミュニケーションズ	400	1,095.00	438,000
		リソー教育	300	576.00	172,800
		ユー・エス・エス	2,400	1,762.00	4,228,800
		サイバーエージェント	1,000	2,698.00	2,698,000
		楽天	9,900	1,173.00	11,612,700
		セントラルスポーツ	100	2,795.00	279,500
		フルキャストホールディングス	200	914.00	182,800
		テクノプロ・ホールディングス	300	3,580.00	1,074,000
		ジャパンマテリアル	100	3,390.00	339,000
		ベクトル	200	1,077.00	215,400
I B J	200	640.00	128,000		
N・フィールド	100	1,285.00	128,500		
リクルートホールディングス	4,200	4,380.00	18,396,000		
日本郵政	4,800	1,554.00	7,459,200		
ベルシステム24ホールディングス	300	940.00	282,000		
リログループ	100	14,820.00	1,482,000		
東祥	100	4,835.00	483,500		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	エイチ・アイ・エス	300	3,275.00	982,500
		共立メンテナンス	200	6,820.00	1,364,000
		建設技術研究所	200	1,033.00	206,600
		スペース	300	1,303.00	390,900
		燦ホールディングス	100	1,550.00	155,000
		東京テアトル	1,000	181.00	181,000
		東京都競馬	2,000	282.00	564,000
		常磐興産	300	1,546.00	463,800
		カナモト	200	2,858.00	571,600
		東京ドーム	700	1,198.00	838,600
		西尾レントオール	100	3,250.00	325,000
		トランス・コスモス	200	2,666.00	533,200
		乃村工藝社	400	1,660.00	664,000
		藤田観光	1,000	342.00	342,000
		KNT - CTホールディングス	2,000	148.00	296,000
		日本管財	100	1,714.00	171,400
		トーカイ	100	3,955.00	395,500
		白洋舎	100	2,651.00	265,100
		セコム	2,000	8,452.00	16,904,000
		セントラル警備保障	100	2,150.00	215,000
		丹青社	300	821.00	246,300
		メイテック	300	4,195.00	1,258,500
		アサツー ディ・ケイ	300	3,080.00	924,000
		応用地質	300	1,429.00	428,700
		船井総研ホールディングス	300	1,779.00	533,700
		ベネッセホールディングス	600	3,305.00	1,983,000
		イオンディライト	200	3,225.00	645,000
ニチイ学館	300	889.00	266,700		
ダイセキ	300	2,347.00	704,100		
小計					4,110,132,720
		銘柄数：	1,449		
		組入時価比率：	96.9%		100.0%
合計					4,110,132,720

（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28年12月12日現在）

該当事項はありません。

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29年1月31日現在

資産総額	83,645,753円
負債総額	2,053,242円
純資産総額（ - ）	81,592,511円
発行済数量	54,206,759口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5052円

（参考情報）

P R U国内株式マザーファンド

資産総額	4,074,985,196円
負債総額	3,652,634円
純資産総額（ - ）	4,071,332,562円
発行済数量	2,552,763,954口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5949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對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。

第二部【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29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。

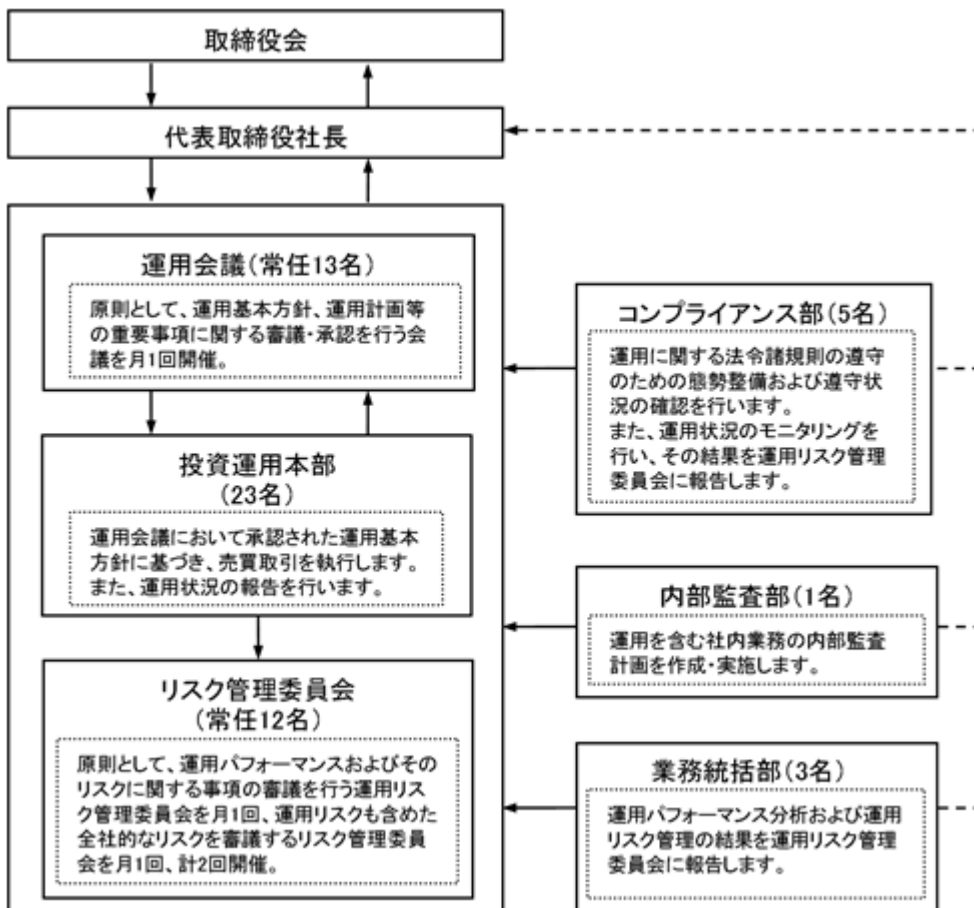
取締役会を招集するには、各取締役及び監査役に対し、会日の少なくとも1週間前に招集通知を發します。ただし、取締役及び監査役全員の同意を得て、招集期間を短縮しまたは招集手続を省略することができます。法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会は代表取締役の1名が招集し、議長となります。代表取締役のいずれにも事故ある場合には、予め取締役会の決議によって定められた順序に従って他の取締役がこの任にあたります。

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および意思決定を監督する組織等



前記の運用体制等は平成29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133兆円（13,143億米ドル、円換算レート1米ドル=101.265円、平成28年9月末現在）にのぼります。グループの運用部門は、ポートフォリオ・マネ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29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35本、純資産総額の合計金額は約2兆2,239億円です。以下はその種類別の内訳です。

追加型株式投資信託	31本
単位型株式投資信託	4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10期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、PwC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11期中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

なお、従来、当社が監査証明を受けているPwCあらた監査法人は、平成28年7月1日に名称を変更しPwCあらた有限責任監査法人となりました。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第 9 期 (平成27年 3 月31日)	第10期 (平成28年 3 月31日)
(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金	1,731,947	1,437,601
前払費用	36,890	43,881
未収入金	12,855	-
立替金	4,210	6,450
未収委託者報酬	68,898	94,229
未収運用受託報酬	2,271,378	2,549,299
未収収益	39,413	36,735
繰延税金資産	123,230	99,785
流動資産計	4,288,824	4,267,983
固定資産		
有形固定資産	83,260	143,646
建物附属設備 * 1	62,915	100,255
器具備品 * 1	20,344	43,391
無形固定資産	124,401	154,345
ソフトウェア	124,401	154,345
投資その他の資産	129,768	177,615
長期差入保証金	4,496	4,496
繰延税金資産	125,272	173,118
固定資産計	337,430	475,607
資産合計	4,626,255	4,743,591

（単位：千円）

	第9期 （平成27年3月31日）	第10期 （平成28年3月31日）
（負債の部）		
流動負債		
未払金	27,225	102,618
未払手数料	17,331	16,437
その他未払金	9,893	86,180
未払費用	2,065,067	1,533,217
未払法人税等	432,915	376,492
未払消費税等	23,213	88,299
預り金	13,156	17,909
賞与引当金	67,719	87,000
役員賞与引当金	10,325	12,000
流動負債計	2,639,622	2,217,536
固定負債		
長期未払費用	49,103	46,487
退職給付引当金	340,175	484,216
役員退職慰労引当金	26,518	39,240
資産除去債務	62,838	72,109
固定負債計	478,635	642,053
負債合計	3,118,257	2,859,590

(単位：千円)

	第9期 (平成27年3月31日)	第10期 (平成28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	1,139,997	1,516,000
利益準備金	54,750	54,750
その他利益剰余金	1,085,247	1,461,250
繰越利益剰余金	1,085,247	1,461,250
株主資本合計	1,507,997	1,884,000
純資産合計	1,507,997	1,884,000
負債・純資産合計	4,626,255	4,743,591

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第 9 期 (自 平成26年 4 月 1 日 至 平成27年 3 月31日)	第10期 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31日)
営業収益		
委託者報酬	517,394	771,253
運用受託報酬	8,093,506	9,001,835
その他営業収益	169,508	178,837
営業収益計	8,780,409	9,951,925
営業費用		
支払手数料	75,170	78,536
広告宣伝費	3,894	9,673
受益証券発行費	333	-
調査費	4,735,831	5,337,717
調査費	312,353	274,502
委託調査費	4,421,212	5,060,897
図書費	2,265	2,317
営業雑経費	39,717	40,820
通信費	7,938	8,131
印刷費	18,609	19,042
協会費	11,314	11,713
諸会費	1,854	1,932
営業費用計	4,854,948	5,466,747

（単位：千円）

	第9期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	第10期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）
一般管理費		
給料	1,099,440	1,291,737
役員報酬	38,893	36,900
給料・手当	781,680	873,237
賞与	172,141	244,923
賞与引当金繰入	67,719	87,000
役員賞与	28,680	37,674
役員賞与引当金繰入	10,325	12,000
福利厚生費	112,859	148,245
交際費	5,993	9,340
旅費交通費	61,833	69,348
水道光熱費	6,670	6,634
租税公課	32,695	26,893
不動産賃借料	151,373	163,957
退職給付費用	102,912	217,652
役員退職慰労引当金繰入	4,736	12,721
退職金	22,664	-
募集費	37,439	42,663
固定資産減価償却費	72,308	85,211
業務委託費	197,614	231,699
専門家報酬	68,265	56,143
消耗器具備品費	10,592	15,928
修繕維持費	8,090	3,382
諸経費	33,352	46,865
一般管理費計	2,028,844	2,428,425

（単位：千円）

	第9期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	第10期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）
営業利益	1,896,616	2,056,752
営業外収益		
受取利息	303	215
営業外収益計	303	215
営業外費用		
為替差損	68,053	36,425
営業外費用計	68,053	36,425
経常利益	1,828,865	2,020,542
特別損失		
固定資産除却損	107	2,714
特別損失計	107	2,714
税引前当期純利益	1,828,757	2,017,828
法人税、住民税及び事業税	744,253	709,426
法人税等調整額	44,211	24,401
当期純利益	1,128,715	1,332,802

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第9期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

	株主資本						評価・換算差額等		純資産合計	
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計		
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金					利益剰余金 合計
当期首残高	219,000	149,000	149,000	54,750	1,428,531	1,483,281	1,851,281	-	-	1,851,281
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	1,472,000	1,472,000	1,472,000	-	-	1,472,000
当期純利益	-	-	-	-	1,128,715	1,128,715	1,128,715	-	-	1,128,715
当期変動額合計	-	-	-	-	343,284	343,284	343,284	-	-	343,284
当期末残高	219,000	149,000	149,000	54,750	1,085,247	1,139,997	1,507,997	-	-	1,507,997

第10期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

	株主資本						評価・換算差額等		純資産合計	
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計		
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金					利益剰余金 合計
当期首残高	219,000	149,000	149,000	54,750	1,085,247	1,139,997	1,507,997	-	-	1,507,997
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	956,800	956,800	956,800	-	-	956,800
当期純利益	-	-	-	-	1,332,802	1,332,802	1,332,802	-	-	1,332,802
当期変動額合計	-	-	-	-	376,002	376,002	376,002	-	-	376,002
当期末残高	219,000	149,000	149,000	54,750	1,461,250	1,516,000	1,884,000	-	-	1,884,000

重要な会計方針

1. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物附属設備 8～38年 器具備品 5～20年</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 定額法を採用しております。 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。</p>
2. 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、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。
3. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に備えて、賞与支給見込額の当会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する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会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 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。 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 役員に対して支給する退職慰労金の支出に備えて、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</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>消費税等の会計処理 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。</p>

注記事項

(貸借対照表関係)

第9期 (平成27年3月31日)		第10期 (平成28年3月31日)	
* 1	減価償却累計額 123,833千円	* 1	減価償却累計額 145,956千円
	有形固定資産		有形固定資産
	建物附属設備 90,724千円		建物附属設備 102,761千円
	器具備品 33,109千円		器具備品 43,194千円

（株主資本等変動計算書関係）

第9期 （自 平成26年4月1日 至 平成27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 （千円）	1株当たり 配当額 （千円）	基準日	効力発生日
平成26年6月24日 株主総会	普通株式	736,000	100	平成26年 3月31日	平成26年 6月24日
平成26年12月19日 取締役会	普通株式	736,000	100	平成26年 9月30日	平成26年 12月19日

第10期 （自 平成27年4月1日 至 平成28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 （千円）	1株当たり 配当額 （千円）	基準日	効力発生日
平成27年6月25日 株主総会	普通株式	736,000	100	平成27年 3月31日	平成27年 6月25日
平成27年12月22日 取締役会	普通株式	220,800	30	平成27年 9月30日	平成27年 12月22日

（金融商品関係）

第9期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	第10期 （自 平成27年4月1日 至 平成28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27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28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>																																																
<table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>貸借対照表計上額 (千円)</th> <th>時価 (千円)</th> <th>差額 (千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>(1) 現金及び預金</td> <td>1,731,947</td> <td>1,731,947</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>(2) 未収運用受託報酬</td> <td>2,271,378</td> <td>2,271,378</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>資産計</td> <td>4,003,325</td> <td>4,003,325</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>(1) 未払費用</td> <td>2,065,067</td> <td>2,065,067</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>負債計</td> <td>2,065,067</td> <td>2,065,067</td> <td>-</td> </tr> </tbody> </table>		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	1,731,947	1,731,947	-	(2) 未収運用受託報酬	2,271,378	2,271,378	-	資産計	4,003,325	4,003,325	-	(1) 未払費用	2,065,067	2,065,067	-	負債計	2,065,067	2,065,067	-	<table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>貸借対照表計上額 (千円)</th> <th>時価 (千円)</th> <th>差額 (千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>(1) 現金及び預金</td> <td>1,437,601</td> <td>1,437,601</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>(2) 未収運用受託報酬</td> <td>2,549,299</td> <td>2,549,299</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>資産計</td> <td>3,986,900</td> <td>3,986,900</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>(1) 未払費用</td> <td>1,533,217</td> <td>1,533,217</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>負債計</td> <td>1,533,217</td> <td>1,533,217</td> <td>-</td> </tr> </tbody> </table>		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	1,437,601	1,437,601	-	(2) 未収運用受託報酬	2,549,299	2,549,299	-	資産計	3,986,900	3,986,900	-	(1) 未払費用	1,533,217	1,533,217	-	負債計	1,533,217	1,533,217	-
	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	1,731,947	1,731,947	-																																														
(2) 未収運用受託報酬	2,271,378	2,271,378	-																																														
資産計	4,003,325	4,003,325	-																																														
(1) 未払費用	2,065,067	2,065,067	-																																														
負債計	2,065,067	2,065,067	-																																														
	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	1,437,601	1,437,601	-																																														
(2) 未収運用受託報酬	2,549,299	2,549,299	-																																														
資産計	3,986,900	3,986,900	-																																														
(1) 未払費用	1,533,217	1,533,217	-																																														
負債計	1,533,217	1,533,217	-																																														

第9期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第10期 (自 平成27年4月1日 至 平成28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> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th></th> <th style="text-align: center;">1年以内(千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>現金及び預金</td> <td style="text-align: right;">1,731,947</td> </tr> <tr> <td>未収運用受託報酬</td> <td style="text-align: right;">2,271,378</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">合計</td> <td style="text-align: right;">4,003,325</td> </tr> </tbody> </table>		1年以内(千円)	現金及び預金	1,731,947	未収運用受託報酬	2,271,378	合計	4,003,325	<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> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th></th> <th style="text-align: center;">1年以内(千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>現金及び預金</td> <td style="text-align: right;">1,437,601</td> </tr> <tr> <td>未収運用受託報酬</td> <td style="text-align: right;">2,549,299</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">合計</td> <td style="text-align: right;">3,986,900</td> </tr> </tbody> </table>		1年以内(千円)	現金及び預金	1,437,601	未収運用受託報酬	2,549,299	合計	3,986,900
	1年以内(千円)																
現金及び預金	1,731,947																
未収運用受託報酬	2,271,378																
合計	4,003,325																
	1年以内(千円)																
現金及び預金	1,437,601																
未収運用受託報酬	2,549,299																
合計	3,986,900																

（退職給付関係）

第9期
（自 平成26年4月1日
至 平成27年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員の退職給付に充てるため、非積立型の確定給付制度を採用しております。

退職一時金制度（非積立型制度であります。）では、退職給付として、給与と勤務期間に基づいた一時金を支給しております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2．簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	320,564 千円
退職給付費用	102,912 千円
退職給付の支払額	83,301 千円
制度への拠出額	- 千円
退職給付引当金の期末残高	340,175 千円

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	- 千円
年金資産	- 千円
	- 千円
非積立型制度の退職給付債務	340,175 千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	340,175 千円
退職給付に係る負債	340,175 千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	340,175 千円

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	102,912 千円
----------------	------------

第10期
（自 平成27年4月1日
至 平成28年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員の退職給付に充てるため、非積立型の確定給付制度を採用しております。

退職一時金制度（非積立型制度であります。）では、退職給付として、給与と勤務期間に基づいた一時金を支給しております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2．簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	340,175 千円
退職給付費用	217,652 千円
退職給付の支払額	73,610 千円
制度への拠出額	- 千円
退職給付引当金の期末残高	484,216 千円

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	- 千円
年金資産	- 千円
	- 千円
非積立型制度の退職給付債務	484,216 千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	484,216 千円
退職給付に係る負債	484,216 千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	484,216 千円

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	217,652 千円
----------------	------------

（税効果会計関係）

第9期 (平成27年3月31日)	第10期 (平成28年3月31日)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 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 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
30,245 千円	24,044 千円
未払費用	未払費用
70,501 千円	48,828 千円
賞与引当金	賞与引当金
22,415 千円	26,848 千円
長期未払費用	長期未払費用
11,853 千円	9,505 千円
退職給付引当金	退職給付引当金
93,592 千円	133,760 千円
役員退職給付引当金	役員退職給付引当金
8,576 千円	12,109 千円
資産除去債務	資産除去債務
20,321 千円	22,253 千円
その他	その他
1,520 千円	1,290 千円
繰延税金資産小計	繰延税金資産小計
259,026 千円	278,640 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
259,026 千円	278,640 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
5,638 千円	5,736 千円
その他	その他
4,885 千円	-
繰延税金負債合計	繰延税金負債合計
10,523 千円	5,736 千円
繰延税金資産の純額	繰延税金資産の純額
248,502 千円	272,903 千円
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等 の負担率との間に重要な差異があるときの、 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 の負担率との間に重要な差異があるときの、 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 の負担率との間の差異が法定実効税率の100 分の5以下であるため注記を省略しておりま す。
35.6%	
(調整)	
交際費等永久に損金に算入され ない項目	
1.6%	
税率変更による期末繰延税金資 産の減額修正	
1.2%	
その他	
0.1%	
税効果会計適用後の法人税等の負 担率	
38.2%	

第9期 (平成27年3月31日)	第10期 (平成28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>「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等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の35.6%から平成27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33.1%に、平成28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、32.3%となります。</p> <p>この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は22,239千円減少し、法人税等調整額が同額増加しております。</p>	<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>「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立したことに伴い、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等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の33.1%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29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30.9%に、平成30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、30.6%となります。</p> <p>この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は16,235千円減少し、法人税等調整額が同額増加しております。</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9期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第10期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
期首残高	61,968千円	62,838千円
有形固定資産の取得に伴う増加額	- 千円	- 千円
時の経過による調整額	869千円	899千円
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	8,372千円
期末残高	62,838千円	72,109千円

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

第9期（自平成26年4月1日 至平成27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9期（自平成26年4月1日 至平成27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
7,278,740	1,328,867	172,801	8,780,409

(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	5,181,489	資産運用業
ブルデンシャル生命保険株式会社	1,254,905	資産運用業
A社	1,328,867	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。

〔セグメント情報〕

第10期（自平成27年4月1日 至平成28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10期（自平成27年4月1日 至平成28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
8,553,185	1,219,902	178,837	9,951,925

(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	5,567,297	資産運用業
ブルデンシャル生命保険株式会社	1,409,295	資産運用業
A社	1,219,902	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9期（自平成26年4月1日 至平成27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	20,761	未払費用	552
									長期未払費用	47,453

(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	プ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）	1,254,905	未収運用受託報酬	379,708
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）	5,181,489	未収運用受託報酬	1,442,444
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）	4,418,361	未払費用	1,809,336
						サービス契約	サービス料	169,508	未収収益	39,413

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

第10期（自平成27年4月1日 至平成28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	46,879	未払費用	392
									長期未払費用	46,487

(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）	1,409,295	未収運用受託報酬	399,300
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）	5,567,297	未収運用受託報酬	1,383,497
親会社の子会社	PGIM, 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）	5,058,307	未払費用	1,368,688
						サービス契約	サービス料	178,837	未収収益	36,735

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9期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第10期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
1株当たり純資産額	204,890.96円	1株当たり純資産額	255,978.32円
1株当たり当期純利益	153,358.13円	1株当たり当期純利益	181,087.36円
(注) 1株当たり純利益金額の算定上の基礎は、 以下のとおりであります。		(注) 1株当たり純利益金額の算定上の基礎は、 以下のとおりであります。	
当期純利益	1,128,715千円	当期純利益	1,332,802千円
普通株主に帰属しない金額	- 千円	普通株主に帰属しない金額	- 千円
普通株式に係る当期純利益	1,128,715千円	普通株式に係る当期純利益	1,332,802千円
期中平均株式数	7,360株	期中平均株式数	7,360株
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第11期中間会計期間 (平成28年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		2,690,501
前払費用		53,298
立替金		7,526
未収委託者報酬		109,050
未収運用受託報酬		2,628,606
未収収益		19,738
繰延税金資産		183,000
その他流動資産		117
流動資産合計		5,691,840
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	*1	91,695
器具備品	*1	37,483
有形固定資産合計		129,179
無形固定資産		128,885
投資その他の資産		
差入保証金		5,841
繰延税金資産		205,850
投資その他の資産合計		211,692
固定資産合計		469,756
資産合計		6,161,597

（単位：千円）

第11期中間会計期間
（平成28年9月30日）

負債の部

流動負債

未払金		73,893
未払手数料		16,216
その他未払金		57,677
未払費用		2,786,372
未払法人税等		403,544
未払消費税等	*2	90,376
預り金		21,914
賞与引当金		318,771
役員賞与引当金		46,547
その他流動負債		11
流動負債合計		3,741,432

固定負債

長期未払費用		57,987
退職給付引当金		532,947
役員退職慰労引当金		45,994
資産除去債務		72,581
固定負債合計		709,509

負債合計 4,450,941

(単位：千円)

第11期中間会計期間
(平成28年9月30日)

純資産の部

株主資本

資本金 219,000

資本剰余金 149,000

資本準備金 149,000

利益剰余金 1,342,655

利益準備金 54,750

その他利益剰余金 1,287,905

繰越利益剰余金 1,287,905

株主資本合計 1,710,655

純資産合計 1,710,655

負債・純資産合計 6,161,597

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第11期中間会計期間 (自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日)	
営業収益	
委託者報酬	515,129
運用受託報酬	4,646,577
その他営業収益	47,460
営業収益計	5,209,168
営業費用	
支払手数料	39,506
広告宣伝費	618
調査費	2,719,335
調査費	144,675
委託調査費	2,573,216
図書費	1,442
営業雑経費	24,275
通信費	5,234
印刷費	8,006
協会費	7,660
諸会費	3,374
営業費用計	2,783,735
一般管理費	
給料	822,101
役員報酬	19,050
給料・手当	515,328
賞与	21,403
賞与引当金繰入	231,771
役員賞与引当金繰入	34,547
福利厚生費	79,640
交際費	5,989
旅費交通費	57,247

（単位：千円）

		第11期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
水道光熱費		3,960
租税公課		34,292
不動産賃借料		83,178
退職給付費用		122,560
役員退職慰労引当金繰入		6,753
募集費		27,474
固定資産減価償却費	*1	50,586
業務委託費		172,720
専門家報酬		18,020
消耗器具備品費		9,803
修繕維持費		240
諸経費		24,670
一般管理費計		1,519,241
営業利益		906,191
営業外収益		
受取利息		768
営業外収益計		768
営業外費用		
為替差損		76,306
営業外費用計		76,306
経常利益		830,653
特別損失		
固定資産除却損		4,014
特別損失計		4,014
税引前中間純利益		826,638
法人税、住民税及び事業税		379,931
法人税等調整額		115,947
中間純利益		562,655

重要な会計方針

	第11期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28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） 定率法を採用しております。 (2) 無形固定資産（リース資産を除く） 定額法を採用しております。 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 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。 (2) 役員賞与引当金 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。 (3) 退職給付引当金 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。 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。 (4) 役員退職慰労引当金 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 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11期中間会計期間 (平成28年9月30日)		
* 1	減価償却累計額	162,394千円
	有形固定資産	
	建物附属設備	112,819千円
	器具備品	49,575千円
* 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 うえ、未払消費税等として表示しており ます。	

(中間損益計算書関係)

第11期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)		
* 1	減価償却実施額	50,586千円
	有形固定資産	15,903千円
	無形固定資産	34,683千円

（金融商品関係）

第11期中間会計期間
（平成28年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成28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	2,690,501	2,690,501	-
(2) 未収運用受託報酬	2,628,606	2,628,606	-
資産計	5,319,107	5,319,107	-
(1) 未払費用	2,786,372	2,786,372	-
負債計	2,786,372	2,786,372	-

（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11期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28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	72,109千円
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	471千円
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>72,581千円</u>

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

第11期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28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11期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28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
4,431,048	724,837	53,282	5,209,168

(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	2,676,964	資産運用業
プルデンシャル生命保険株式会社	736,924	資産運用業
A社	724,837	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11期中間会計期間 （自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日）	
1株当たり純資産額	232,426.02円
1株当たり中間純利益金額	76,447.71円
（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎 は、以下のとおりであります。	
中間純利益	562,655千円
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	562,655千円
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 については、潜在株式が存在しないため記載して 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) 通常取引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28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28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 (平成28年9月末現在)	事業の内容
野村證券株式会社 1	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。
キャピタル・パートナーズ証券株式会社 1	1,000百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
フィデリティ証券株式会社	7,657百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
みずほ証券株式会社 1	125,167百万円	
株式会社S B I証券	48,323百万円 2	

1 野村證券株式会社、キャピタル・パートナーズ証券株式会社、みずほ証券株式会社は、受益権の募集の取扱いを行いません。

2 資本金の額は平成28年12月31日現在のものです。

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【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【参考情報】

当計算期間において、次の書類を提出しています。

平成28年3月10日	有価証券届出書
平成28年3月10日	有価証券報告書
平成28年9月9日	半期報告書
平成28年9月9日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成28年6月20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

P W C 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27年4月1日から平成28年3月31日までの第10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、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28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

- () 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. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成29年2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

取締役会 御中

P w C あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 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国内株式マーケット・パフォーマーの平成27年12月11日から平成28年12月12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国内株式マーケット・パフォーマーの平成28年12月12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 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月12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

P w C あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 大 畑 茂
業務執行社員指定有限責任社員 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28年4月1日から平成29年3月31日までの第11期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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28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28年4月1日から平成28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

() 1 . 上記は、当社が、独立監査人の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。

2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。