

【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15日
【計算期間】	第16期 （自平成27年12月16日 至 平成28年12月15日）
【ファンド名】	PRUグッドライフ2020（年金）
【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

PRU国内株式マザーファンド、PRU国内債券マザーファンド、PRU海外株式マザーファンドおよびPRU海外債券マザーファンド（以下総称して、または各々を「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、わが国の株式・公社債等および海外の株式・公社債等への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ投資信託財産の中・長期的な成長を目指します。

信託金の限度額

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

基本的性格

当ファンドは追加型投信 / 内外 / 資産複合に属します。

当ファンドが該当する商品分類および属性区分を網掛け表示しています。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信
	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]

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

[投資対象資産（収益の源泉）による区分]

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

属性区分表

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

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

< 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（資産複合 資産配分変更型（株式、債券、短期金融商品）））

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分]

グローバル（日本を含む）

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

〔投資形態による属性区分〕

ファミリーファンド

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

〔為替ヘッジによる属性区分〕

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

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

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

ファンドの特色

当ファンドは確定拠出年金法に基づき、確定拠出年金運営管理機関等 が加入者等に対して提示する運用の方法に係る金融商品の一つです。

確定拠出年金運営管理機関等とは、確定拠出年金法第2条第7項に定められた運営管理業務のうち、運用関連業務（確定拠出年金における運用の方法の選定及び加入者等に対する提示並びに当該運用の方法に係る情報の提供）を行う者をいいます。企業型年金においては、事業主もしくは事業主から運用関連業務の委託を受けた確定拠出年金運営管理機関（同法第6章に定める確定拠出年金運営管理機関をいいます。以下同じ。）をいいます。個人型年金においては、個人型年金加入者等が指定した運営管理業務を行う確定拠出年金運営管理機関をいいます。

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

基本ガイドラインに基づいてポートフォリオを変更します。この基本ガイドラインは、当ファンドの償還時期に向けて、実質的に組入れている株式の組入比率を漸減させ、公社債および短期金融商品の組入比率を漸増させることにより、償還直前には実質的な組入れが短期金融商品100%となるように変化します。これにより、償還日に近づくにしたがって株価等の変動リスクを低減させた、安定的な運用に移行します。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

当ファンドの償還日は平成32年（2020年）12月15日です。

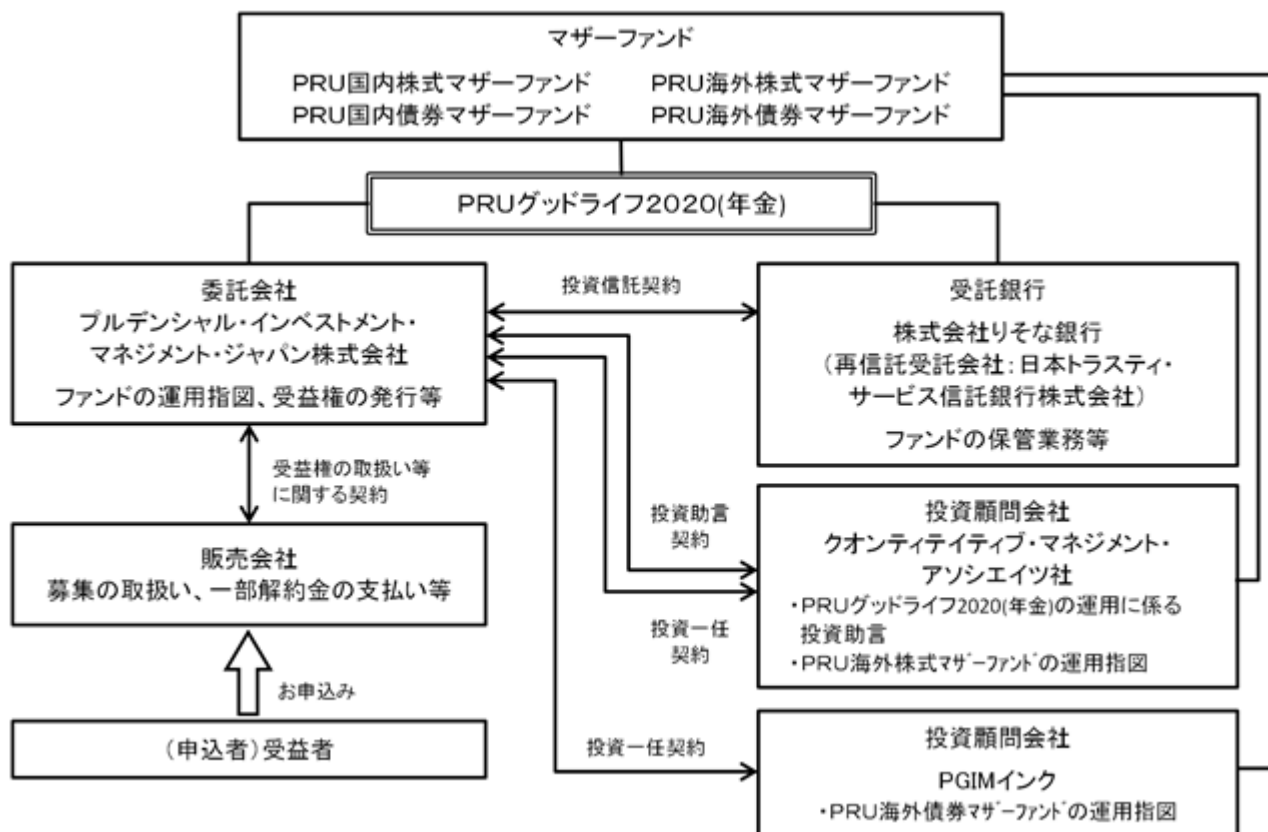
年1回（原則、12月15日。）決算し、収益分配方針に基づいて分配を行います。

（2）【ファンドの沿革】

平成13年9月28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、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。
- d. 投資顧問会社：
 - ・投資助言契約に基づき、当ファンドの運用に関する投資助言を行います。
 - ・投資一任契約に基づき、マザーファンドの運用指図を行います。

委託会社等の概況（平成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。

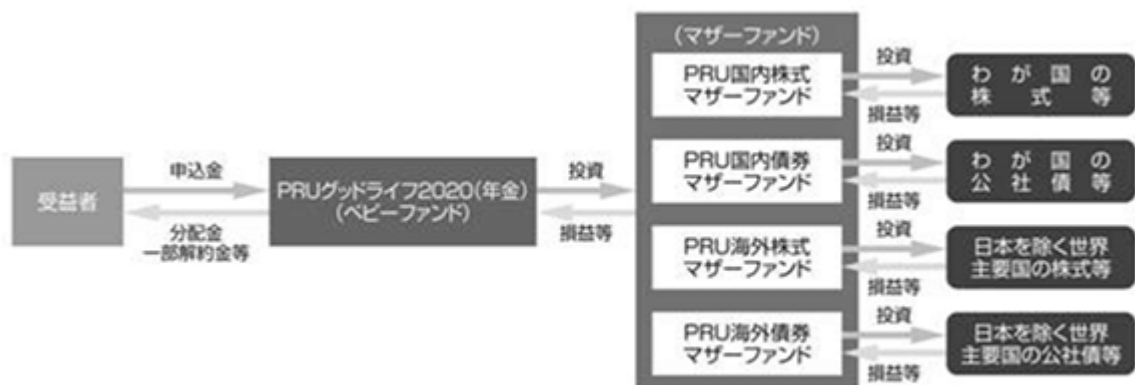
2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

当ファンドは、4種類のマザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の株式・公社債等および海外の株式・公社債等への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ投資信託財産の中・長期的な成長を目指します。

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



(注) 収益分配金(税控除後)は、原則として、自動的に再投資されます。

運用方法

a. 投資対象

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

なお、内外の株式・公社債等に直接投資することがあります。

b. 投資態度

(a) 主として、「PRU国内株式マザーファンド」受益証券、「PRU国内債券マザーファンド」受益証券、「PRU海外株式マザーファンド」受益証券および「PRU海外債券マザーファンド」受益証券への投資を通じて、わが国の株式・公社債等および海外の株式・公社債等への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ投資信託財産の中・長期的な成長を目指します。

- (b) 当初設定時は、「PRU国内株式マザーファンド」24.4%、「PRU国内債券マザーファンド」50.4%、「PRU海外株式マザーファンド」14.6%、「PRU海外債券マザーファンド」7.6%およびコール・ローン等の短期金融商品3%の組入比率を基本ガイドラインとし、この基本ガイドラインに基づいてポートフォリオを構築します。
- (c) 当初設定後の基本ガイドラインは、償還時期に向け株式の組入比率を漸減させ、公社債および短期金融商品の組入比率を漸増させます。また、この基本ガイドラインに基づいてポートフォリオを変更します。これにより、償還日に近づくにしたがって株価等の変動リスクを低減させる運用を目指します。ただし、市況動向等の変化によっては、基本ガイドラインを見直す場合があります。
- 基本ガイドラインは以下のとおりです。

	当初設定時 (平成13年9月28日)	当初設定日から 約15年経過時 (平成28年10月1日)	償還直前
PRU国内株式マザーファンド	24.4%	5.625%	0.0%
PRU国内債券マザーファンド	50.4%	77.500%	0.0%
PRU海外株式マザーファンド	14.6%	3.375%	0.0%
PRU海外債券マザーファンド	7.6%	4.500%	0.0%
短期金融商品	3.0%	9.000%	100.0%

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

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

市況動向等の変化によっては、基本ガイドラインを見直す場合があります。

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

(2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

- a. 株券または新株引受権証書
 - 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. 投資信託または外国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、)。
 - 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、)。
 - t. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 - u. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - v. 外国の者に対する権利で前記u. の有価証券の性質を有するもの
- なお、前記a. の証券または証書、l. ならびにq. の証券または証書のうちa. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、b. からf. までの証券およびl. ならびにq. の証券または証書のうちb. からf. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、m. の証券およびn. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

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

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

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

（3）【運用体制】

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

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

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

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

当ファンドの主要投資対象である「PRU海外債券マザーファンド」は、投資一任契約に基づき、PGIMインクにて運用され、同社のパブリック債券運用グループが運用を担当します。

投資顧問会社の運用体制

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

クオンティテティブ・マネジメント・アソシエイツ社は2004年7月に、PGIMインクのクオンティテティブ・マネジメント・チームが独立することにより設立されました。なお、同社はPGIMインクの100%子会社です（以下の説明は、同社の前身であるPGIMインクのクオンティテティブ・マネジメント・チームに関するものを含みます。）。

1975年よりクオンツ運用を開始し、その運用資産額は約1,164億米ドル（約11.8兆円）にのぼります。

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

（クオンティテティブ・マネジメント・アソシエイツ社に関する情報は平成28年9月末現在のものです。為替換算レート：1米ドル=101.265円）

PGIMインクにおける債券運用

債券の運用額は約6,812億米ドル（約69兆円）

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

独自の信用調査と運用モデル、綿密な分析とリスク管理

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

効果の高いボトムアップ・アプローチとトップダウン・アプローチの併用

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

一貫した投資プロセスで安定した投資成果の獲得

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

（PGIMインクに関する情報は平成28年9月末現在のものです。為替換算レート：1米ドル=101.265円）

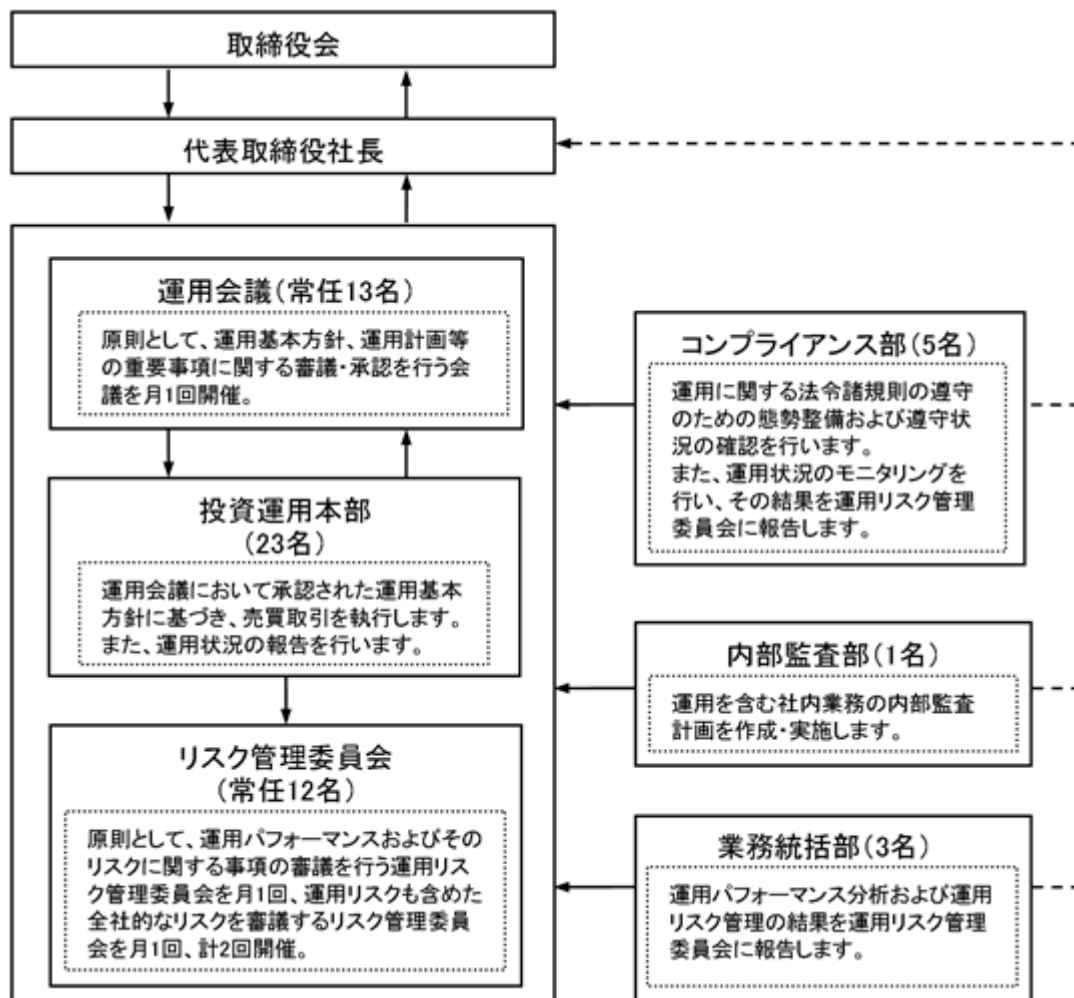
委託会社の運用体制



委託会社の運用体制に関する社内規則

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

委託会社の内部管理および意思決定を監督する組織等



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く。）に対する管理体制

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

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

前記の運用体制等は平成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15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、必ず分配を行うものではありません。

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

株式への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2．運用方法（３）投資制限、第18条）

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。

外貨建資産への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2．運用方法（３）投資制限、第28条）

外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

新株引受権証券等への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2．運用方法（3）投資制限、第18条）

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

同一銘柄の株式への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2．運用方法（3）投資制限、第21条）

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

同一銘柄の転換社債等への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2．運用方法（3）投資制限、第22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21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18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18条）

投資する株式等の範囲（投資信託約款第20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23条）

- a．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- b．前記a．の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - (a) 投資信託財産に属する株券および新株引受権証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ません。）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24条)

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

スワップ取引の運用指図・目的・範囲(投資信託約款第25条)

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

金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の運用指図・目的・範囲(投資信託約款第26条)

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

有価証券の貸付けの指図・目的・範囲(投資信託約款第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、投資信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
- (a) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（投資信託約款第29条）

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

外国為替予約取引の指図・目的・範囲（投資信託約款第30条）

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

資金の借入れの指図・目的・範囲（投資信託約款第38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。

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

T O P I Xの指数値およびT O P I Xの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などT O P I Xに関するすべての権利・ノウハウおよびT O P I Xの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

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

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

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

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

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

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

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

平成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、プルデンシャル私募国内株式マーケット・パフォーマー（適格機関投資家向け）、P R Uグッドライフ2020（年金）（当ファンド）、P R Uグッドライフ2030（年金）、P R Uグッドライフ2040（年金）、P R Uグッドライフ2050（年金）、プルデンシャル私募国内株式・債券バランスファンド（適格機関投資家向け）です。なお、この他にも、今後「P R U国内株式マザーファンド」に投資するファンドが設定される場合があります。

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

NOMURA - B P I（総合）とは、野村證券株式会社が公表している国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出され、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、安全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、当ファンドの運用成果等に関し一切責任を負いません。

平成29年2月1日現在において、「P R U国内債券マザーファンド」に投資しているファンドは、P R U国内債券マーケット・パフォーマー、P R Uグッドライフ2020（年金）（当ファンド）、P R Uグッドライフ2030（年金）、P R Uグッドライフ2040（年金）、P R Uグッドライフ2050（年金）、プルデンシャル私募国内株式・債券バランスファンド（適格機関投資家向け）、プルデンシャル私募国内債券マーケット・パフォーマー（適格機関投資家向け）です。なお、この他にも、今後「P R U国内債券マザーファンド」に投資するファンドが設定される場合があります。

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

「MSCI KOKUSAIインデックス」とは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要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。

平成29年2月1日現在において、「P R U海外株式マザーファンド」に投資しているファンドは、P R U海外株式マーケット・パフォーマー、P R Uグッドライフ2020（年金）（当ファンド）、P R Uグッドライフ2030（年金）、P R Uグッドライフ2040（年金）、P R Uグッドライフ2050（年金）、ブルデンシャル私募海外株式マーケット・パフォーマー（適格機関投資家向け）です。なお、この他にも、今後「P R U海外株式マザーファンド」に投資するファンドが設定される場合があります。

P R U海外債券マザーファンド	
基本方針	日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティ世界国債インデックス（除く日本）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
運用方法	
投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>シティ世界国債インデックス（除く日本）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、運用の効率化を図るため、為替のエクスポージャーの調整を行う場合があります。</p> <p>運用の効率化を図るため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じた時等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>運用にあたっては、投資一任契約に基づいてPGIMインクに運用の指図に関する権限を委託します。</p> <p>委託する範囲：マザーファンドの運用指図 委託先所在地：アメリカ合衆国ニュージャージー州ニューアーク、ブロード・ストリート655 委託に係る費用：後記「4手数料等及び税金（3）信託報酬等」をご参照ください。</p>
投資制限	<p>外貨建資産への投資には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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。</p>

「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。

平成29年2月1日現在において、「P R U海外債券マザーファンド」に投資しているファンドは、P R U海外債券マーケット・パフォーマー、P R Uグッドライフ2020（年金）（当ファンド）、P R Uグッドライフ2030（年金）、P R Uグッドライフ2040（年金）、P R Uグッドライフ2050（年金）、プルデンシャル私募海外債券マーケット・パフォーマー（適格機関投資家向け）です。なお、この他にも、今後「P R U海外債券マザーファンド」に投資するファンドが設定される場合があります。

3【投資リスク】

(1) 当ファンドへの投資リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

ファンドが有する主なリスクは以下のとおりです。

<資産配分リスク>

当ファンドでは、基本ガイドラインに基づいてポートフォリオを構築し、各マザーファンドへの資産配分を行います。また、この基本ガイドラインは、当ファンドの償還時期が近づくにしたがって、実質的に組入れている株式の組入比率を漸減させ公社債および短期金融商品の組入比率を漸増させることにより、時間の経過とともに株価等の変動リスクを低減させる運用を目指します。

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

<株価変動リスク>

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

<金利変動リスク>

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

<信用リスク>

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

<カントリー・リスク>

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

<為替変動リスク>

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

<同一マザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドによる影響>

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

(2) 分配金に関する留意点

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

（３）その他の留意点

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

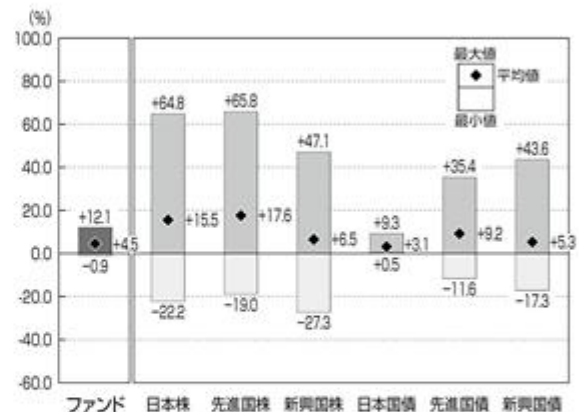
（４）投資リスクに対する管理体制

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

（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の商標または標準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】

申込手数料は販売会社が独自に定めるものとします。

平成29年3月15日現在、手数料はありません。

(2)【換金（解約）手数料】

解約時に手数料はかかりません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年0.8424%（税抜0.78%）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0.378%（税抜0.35%）	委託した資金の運用の対価
販売会社	年0.378%（税抜0.35%）	運用報告書等各種書類の送付、 口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価
受託会社	年0.0864%（税抜0.08%）	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相当額および地方消費税相当額（以下「消費税等相当額」といいます。）を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

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

PRU海外株式マザーファンド 年0.10%

PRU海外債券マザーファンド 年0.10%

(4)【その他の手数料等】

信託事務の諸費用

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

(a) 売買委託手数料等の有価証券取引等に要する費用および保管費用等

(b) 借入金の利息

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

(a) 投資信託振替制度に係る費用

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

監査報酬

- a. 投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、投資信託財産の純資産総額に年0.0054%（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。

確定拠出年金法第86条において、「確定拠出年金に係る掛金、積立金及び給付については、所得税法（昭和40年法律第33号）、法人税法（昭和40年法律第34号）、相続税法（昭和25年法律第73号）及び地方税法（昭和25年法律第226号）並びにこれらの法律に基づく命令で定めるところにより、所得税、法人税、相続税並びに道府県民税（都民税を含む。）及び市町村民税（特別区民税を含む。）の課税について必要な措置を講ずる」とされています。

受益者が同法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

- ・上記は、平成29年1月末現在のものであり、税法または確定拠出年金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	111,190,888	5.65
投資信託受益証券 （PRU国内債券マザーファンド）	日本	1,516,607,443	77.10
投資信託受益証券 （PRU海外株式マザーファンド）	日本	66,810,892	3.40
投資信託受益証券 （PRU海外債券マザーファンド）	日本	86,730,041	4.41
現金、預金、その他の資産（負債控除後）		185,788,434	9.44
合計（純資産総額）		1,967,127,698	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。

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

(平成29年1月31日現在)

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	5,347,306,000	83.43
地方債証券	日本	450,335,958	7.03
特殊債券	日本	382,655,330	5.97
社債券	日本	172,896,950	2.70
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		55,808,276	0.87
合計（純資産総額）		6,409,002,514	100.00

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

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

（平成29年1月31日現在）

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）	
株式	アメリカ	2,751,871,149	58.05
	イギリス	317,103,876	6.69
	カナダ	183,761,509	3.88
	スイス	173,947,013	3.67
	ドイツ	169,709,833	3.58
	フランス	162,316,717	3.42
	オーストラリア	124,472,111	2.63
	オランダ	79,678,205	1.68
	アイルランド	70,779,207	1.49
	スペイン	56,785,691	1.20
	スウェーデン	51,861,605	1.10
	香港	41,917,635	0.88
	シンガポール	35,198,644	0.74
	イタリア	30,670,254	0.65
	デンマーク	30,184,144	0.64
	ベルギー	21,000,750	0.44
	ジャージー	18,228,576	0.38
	バミューダ	16,945,233	0.36
	フィンランド	16,925,157	0.36
	キュラソー	16,709,489	0.35
	ノルウェー	12,597,098	0.27
	ケイマン	12,091,159	0.26
	イスラエル	10,843,006	0.23
	ルクセンブルク	5,794,151	0.12
	オーストリア	3,793,781	0.08
	ニュージーランド	3,507,181	0.07
	パナマ	3,039,546	0.06
	ポルトガル	2,553,936	0.05
	リベリア	2,363,606	0.05
	バプアニューギニア	1,028,356	0.02
英ヴァージン諸島	903,663	0.02	
マン島	769,056	0.02	
モーリシャス	403,754	0.01	

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	101,568,233	2.14
	オーストラリア	10,668,185	0.23
	フランス	6,056,243	0.13
	イギリス	4,566,006	0.10
	香港	2,417,102	0.05
	シンガポール	2,244,081	0.05
	カナダ	955,066	0.02
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		182,557,316	3.85
合計（純資産総額）		4,740,787,323	100.00

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

（注2）時価は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。

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

（平成29年1月31日現在）

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）	
国債証券	アメリカ	2,515,373,941	44.06
	イタリア	544,707,410	9.54
	フランス	543,552,910	9.52
	イギリス	423,283,929	7.41
	スペイン	359,195,999	6.29
	ドイツ	272,962,486	4.78
	ベルギー	152,038,226	2.66
	オーストラリア	123,596,407	2.17
	オランダ	123,517,726	2.16
	オーストリア	100,311,658	1.76
	カナダ	100,162,902	1.75
	アイルランド	76,225,169	1.34
	メキシコ	42,436,437	0.74
	デンマーク	42,343,163	0.74
	南アフリカ	33,456,059	0.59
	フィンランド	31,093,018	0.54
	ポーランド	28,495,477	0.50
	マレーシア	26,158,231	0.46
	スウェーデン	23,688,807	0.42
	ノルウェー	17,416,508	0.31
シンガポール	16,633,719	0.29	
小計	5,596,650,182	98.04	
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	112,105,974	1.96	
合計（純資産総額）	5,708,756,156	100.00	

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

（注2）時価は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

(平成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	P R U国内債券 マザーファンド	1,141,679,798	1.3313	1,520,032,407	1.3284	1,516,607,443	77.10
日本	投資信託 受益証券	P R U国内株式 マザーファンド	69,716,527	1.6149	112,585,224	1.5949	111,190,888	5.65
日本	投資信託 受益証券	P R U海外債券 マザーファンド	40,292,702	2.2126	89,155,624	2.1525	86,730,041	4.41
日本	投資信託 受益証券	P R U海外株式 マザーファンド	31,012,808	2.1771	67,517,993	2.1543	66,810,892	3.40

(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	KDDI	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	NTT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。

P R U国内債券マザーファンド

	地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還期限	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	国債証券	第118回利付国債（5年）	0.2	2019/6/20	65,000,000	100.98	65,637,000	100.89	65,581,750	1.02
2	日本	国債証券	第120回利付国債（5年）	0.2	2019/9/20	60,000,000	101.04	60,629,400	100.96	60,578,400	0.95
3	日本	国債証券	第121回利付国債（5年）	0.1	2019/9/20	60,000,000	100.76	60,461,400	100.70	60,420,000	0.94
4	日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	0.4	2025/3/20	55,000,000	103.52	56,939,850	102.95	56,626,350	0.88
5	日本	国債証券	第126回利付国債（5年）	0.1	2020/12/20	55,000,000	100.91	55,501,600	100.85	55,471,350	0.87
6	日本	国債証券	第117回利付国債（5年）	0.2	2019/3/20	55,000,000	100.89	55,491,150	100.83	55,457,600	0.87
7	日本	国債証券	第124回利付国債（5年）	0.1	2020/6/20	55,000,000	100.85	55,468,600	100.81	55,447,700	0.87
8	日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	0.1	2020/3/20	55,000,000	100.82	55,453,200	100.78	55,431,750	0.86
9	日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	1.3	2021/3/20	50,000,000	106.11	53,056,000	105.84	52,922,000	0.83
10	日本	国債証券	第327回利付国債（10年）	0.8	2022/12/20	50,000,000	105.40	52,700,500	105.07	52,537,000	0.82
11	日本	国債証券	第309回利付国債（10年）	1.1	2020/6/20	50,000,000	104.40	52,202,000	104.19	52,095,500	0.81
12	日本	国債証券	第122回利付国債（5年）	0.1	2019/12/20	50,000,000	100.79	50,396,500	100.73	50,368,500	0.79
13	日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	0.1	2026/6/20	50,000,000	100.90	50,452,500	100.32	50,163,000	0.78
14	日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	0.1	2026/9/20	50,000,000	100.83	50,415,000	100.28	50,143,000	0.78
15	日本	国債証券	第330回利付国債（10年）	0.8	2023/9/20	45,000,000	105.96	47,685,600	105.54	47,497,050	0.74
16	日本	国債証券	第310回利付国債（10年）	1	2020/9/20	45,000,000	104.29	46,934,550	104.10	46,845,900	0.73
17	日本	国債証券	第128回利付国債（5年）	0.1	2021/6/20	45,000,000	100.97	45,440,550	100.92	45,415,350	0.71
18	日本	国債証券	第127回利付国債（5年）	0.1	2021/3/20	45,000,000	100.94	45,425,700	100.89	45,400,950	0.71
19	日本	国債証券	第114回利付国債（5年）	0.3	2018/9/20	45,000,000	100.92	45,415,350	100.86	45,390,150	0.71
20	日本	国債証券	第119回利付国債（5年）	0.1	2019/6/20	45,000,000	100.72	45,326,250	100.65	45,295,200	0.71
21	日本	国債証券	第329回利付国債（10年）	0.8	2023/6/20	40,000,000	105.78	42,312,000	105.40	42,161,600	0.66
22	日本	国債証券	第316回利付国債（10年）	1.1	2021/6/20	40,000,000	105.51	42,205,200	105.29	42,119,600	0.66
23	日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	1.2	2020/12/20	40,000,000	105.37	42,149,600	105.12	42,049,600	0.66
24	日本	国債証券	第314回利付国債（10年）	1.1	2021/3/20	40,000,000	105.25	42,100,400	105.01	42,006,000	0.66
25	日本	国債証券	第326回利付国債（10年）	0.7	2022/12/20	40,000,000	104.79	41,917,600	104.48	41,793,600	0.65
26	日本	国債証券	第333回利付国債（10年）	0.6	2024/3/20	40,000,000	104.75	41,900,000	104.27	41,710,000	0.65
27	日本	国債証券	第331回利付国債（10年）	0.6	2023/9/20	40,000,000	104.60	41,841,600	104.21	41,687,600	0.65
28	日本	国債証券	第328回利付国債（10年）	0.6	2023/3/20	40,000,000	104.32	41,730,400	104.02	41,610,400	0.65
29	日本	国債証券	第301回利付国債（10年）	1.5	2019/6/20	40,000,000	104.27	41,710,800	103.99	41,599,600	0.65
30	日本	国債証券	第311回利付国債（10年）	0.8	2020/9/20	40,000,000	103.53	41,415,200	103.37	41,349,200	0.65

（注）投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

P R U海外株式マザーファンド

	地域	種類	業種	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	時価単価 (円)	時価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	APPLE INC	6,895	12,507.71	86,240,723	13,842.71	95,445,488	2.01
2	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	MICROSOFT CORP	9,460	6,743.24	63,791,075	7,412.44	70,121,733	1.48
3	アメリカ	株式	エネルギー	EXXON MOBIL CORPORATION	5,319	9,906.02	52,690,133	9,657.91	51,370,458	1.08
4	アメリカ	株式	小売	AMAZON.COM INC	505	84,258.09	42,550,339	94,505.54	47,725,302	1.01
5	アメリカ	株式	銀行	JPMORGAN CHASE & CO	4,666	9,286.89	43,332,657	9,791.07	45,685,153	0.96
6	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	JOHNSON & JOHNSON	3,513	12,742.16	44,763,235	12,875.32	45,231,018	0.95
7	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	FACEBOOK INC-A	3,020	13,133.67	39,663,695	14,906.83	45,018,638	0.95
8	アメリカ	株式	資本財	GENERAL ELECTRIC CO.	11,479	3,566.80	40,943,359	3,409.74	39,140,493	0.83
9	アメリカ	株式	銀行	WELLS FARGO COMPANY	6,124	6,097.93	37,343,783	6,382.46	39,086,214	0.82
10	アメリカ	株式	電気通信サービス	AT&T INC	7,909	4,394.20	34,753,760	4,759.53	37,643,156	0.79
11	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	ALPHABET INC-CL C	401	85,414.40	34,251,177	91,312.03	36,616,128	0.77
12	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	ALPHABET INC-CL A	380	87,003.19	33,061,213	93,760.09	35,628,835	0.75
13	アメリカ	株式	銀行	BANK OF AMERICA CORP	13,091	2,416.18	31,630,295	2,611.93	34,192,900	0.72
14	スイス	株式	食品・飲料・タバコ	NESTLE SA-REGISTERED	3,973	7,777.16	30,898,657	8,280.38	32,897,982	0.69
15	アメリカ	株式	家庭用品・パーソナル用品	PROCTER & GAMBLE CO	3,234	9,377.94	30,328,271	9,873.01	31,929,339	0.67
16	アメリカ	株式	エネルギー	CHEVRON CORP	2,430	12,860.53	31,251,088	12,726.23	30,924,749	0.65
17	アメリカ	株式	電気通信サービス	VERIZON COMMUNICATIONS INC	5,260	5,668.87	29,818,288	5,618.79	29,554,886	0.62
18	アメリカ	株式	各種金融	BERKSHIRE HATHAWAY INC	1,570	18,140.17	28,480,076	18,755.88	29,446,744	0.62
19	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	PFIZER INC	7,822	3,599.81	28,157,716	3,563.39	27,872,845	0.59
20	アメリカ	株式	メディア	COMCAST CORP-CL A	3,042	7,827.85	23,812,325	8,574.44	26,083,463	0.55
21	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	INTEL CORP	6,050	3,887.74	23,520,885	4,258.77	25,765,560	0.54
22	アメリカ	株式	小売	HOME DEPOT INC	1,590	14,780.50	23,501,002	15,759.27	25,057,240	0.53
23	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	MERCK & CO. INC.	3,557	6,957.20	24,746,779	6,991.34	24,868,226	0.52
24	アメリカ	株式	メディア	WALT DISNEY CO	1,965	11,210.28	22,028,210	12,626.08	24,810,250	0.52
25	アメリカ	株式	食品・飲料・タバコ	COCA-COLA COMPANY	5,240	4,593.37	24,069,267	4,709.45	24,677,559	0.52
26	イギリス	株式	銀行	HSBC HOLDINGS PLC	25,449	893.03	22,726,875	968.52	24,647,967	0.52
27	スイス	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	900	25,230.02	22,707,020	26,762.58	24,086,322	0.51
28	アメリカ	株式	銀行	CITIGROUP INC	3,733	6,375.63	23,800,250	6,442.78	24,050,913	0.51
29	スイス	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	NOVARTIS AG-REG SHS	2,866	7,862.93	22,535,179	8,234.63	23,600,478	0.50
30	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,160	18,211.87	21,125,777	20,007.79	23,209,046	0.49

(注1) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

(注2) 時価は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。

P R U海外債券マザーファンド

	地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還期限	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	時価単価 (円)	時価金額 (円)	投資比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2021/5/15	2,270,000	12,023.93	272,943,436	11,981.16	271,972,460	4.76
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2018/12/31	1,970,000	11,435.64	225,282,109	11,420.57	224,985,263	3.94
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.5	2024/5/15	1,710,000	11,571.06	197,865,172	11,527.71	197,123,883	3.45
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2019/4/30	1,700,000	11,485.70	195,256,989	11,460.13	194,822,246	3.41
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2	2021/11/15	1,565,000	11,443.61	179,092,507	11,410.78	178,578,771	3.13
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2019/12/31	1,395,000	11,449.71	159,723,530	11,431.23	159,465,738	2.79
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.25	2024/11/15	1,395,000	11,329.78	158,050,508	11,280.08	157,357,181	2.76
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2020/8/15	1,230,000	11,787.30	144,983,811	11,761.55	144,667,162	2.53
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.75	2018/1/31	1,265,000	11,352.87	143,613,898	11,365.44	143,772,843	2.52
10	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT BOND 0	2.5	2020/10/25	860,000	13,544.68	116,484,312	13,402.81	115,264,185	2.02
11	イギリス	国債証券	UNITED KINGDOM GILT	4.25	2040/12/7	525,000	20,364.64	106,914,367	20,134.53	105,706,290	1.85
12	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T.	8.5	2023/4/25	575,000	18,755.58	107,844,628	18,345.85	105,488,638	1.85
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2019/8/31	900,000	11,473.18	103,258,675	11,449.46	103,045,213	1.81
14	イタリア	国債証券	ITALY BUONI POLIENNALI D	3.75	2021/3/1	735,000	13,742.22	101,005,367	13,678.62	100,537,891	1.76
15	スペイン	国債証券	SPAIN GOVERNMENT BOND	4	2020/4/30	700,000	13,717.70	96,023,939	13,712.36	95,986,531	1.68
16	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	9	2023/11/1	520,000	18,289.28	95,104,282	17,930.12	93,236,637	1.63
17	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T.	5.75	2032/10/25	455,000	20,475.12	93,161,813	19,472.98	88,602,092	1.55
18	イギリス	国債証券	UNITED KINGDOM TREASURY	4.25	2036/3/7	435,000	19,594.09	85,234,314	19,405.60	84,414,374	1.48
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2018/6/30	720,000	11,614.31	83,623,036	11,596.61	83,495,614	1.46
20	イタリア	国債証券	ITALY BUONI POLIENNALI D	4.5	2026/3/1	575,000	14,895.23	85,647,606	14,429.42	82,969,167	1.45
21	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB DEUTSCHLAND	4.75	2034/7/4	410,000	20,456.87	83,873,181	19,961.72	81,843,086	1.43
22	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5	2039/8/1	475,000	16,578.69	78,748,813	15,698.68	74,568,770	1.31
23	スペイン	国債証券	SPAIN GOVERNMENT BOND	0.25	2018/4/30	605,000	12,241.96	74,063,873	12,253.06	74,131,050	1.30
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2022/8/15	645,000	11,136.65	71,831,436	11,113.36	71,681,200	1.26
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.75	2041/2/15	465,000	14,861.33	69,105,225	14,779.29	68,723,737	1.20
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.375	2044/5/15	570,000	12,085.48	68,887,258	12,029.62	68,568,868	1.20
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3	2045/5/15	580,000	11,275.65	65,398,775	11,195.61	64,934,566	1.14
28	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.75	2032/7/30	310,000	18,161.44	56,300,487	17,882.60	55,436,071	0.97
29	スペイン	国債証券	SPAIN GOVERNMENT BOND	4.65	2025/7/30	350,000	15,392.02	53,872,086	15,308.12	53,578,443	0.94
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.375	2040/5/15	370,000	14,085.12	52,114,965	14,004.41	51,816,323	0.91

(注1) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

(注2) 時価は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。

全銘柄の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	90.56
合計	90.56

(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。

P R U国内債券マザーファンド

種類	投資比率（％）
国債証券	83.43
地方債証券	7.03
特殊債券	5.97
社債券	2.70
合計	99.13

（注）投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

P R U海外株式マザーファンド

	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	7.17
	素材	4.86
	資本財	7.09
	商業・専門サービス	0.91
	運輸	1.89
	自動車・自動車部品	1.46
	耐久消費財・アパレル	1.60
	消費者サービス	1.72
	メディア	2.61
	小売	3.75
	食品・生活必需品小売り	1.85
	食品・飲料・タバコ	5.59
	家庭用品・パーソナル用品	1.99
	ヘルスケア機器・サービス	3.68
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.16
	銀行	9.39
	各種金融	4.23
	保険	4.07
	不動産	0.55
	ソフトウェア・サービス	8.92
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.58
	電気通信サービス	2.87
公益事業	3.07	
半導体・半導体製造装置	2.42	
投資証券	-	2.71
	合計	96.15

（注）投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

P R U海外債券マザーファンド

種類	投資比率（％）
国債証券	98.04
合計	98.04

（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。

P R U海外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)	簿価金額 (円)	時価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	S&P EMINI FU	買建	10	128,945,130	129,515,780	2.73
株価指数先物取引	ドイツ	EURO STOXX50	買建	8	31,208,324	31,674,480	0.67
株価指数先物取引	イギリス	FTSE 100 IDX	買建	2	19,611,538	20,068,387	0.42

（注1）投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価比率です。

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額(円)	1万口当たりの純資産額 (基準価額)(円)
第1計算期間末	(分配付)	1,026,263	10,263
(平成13年12月17日)	(分配落)	1,026,263	10,263
第2計算期間末	(分配付)	32,458,074	9,588
(平成14年12月16日)	(分配落)	32,458,074	9,588
第3計算期間末	(分配付)	93,926,864	10,262
(平成15年12月15日)	(分配落)	93,926,864	10,262
第4計算期間末	(分配付)	255,506,532	10,745
(平成16年12月15日)	(分配落)	255,506,532	10,745
第5計算期間末	(分配付)	446,252,344	12,183
(平成17年12月15日)	(分配落)	446,252,344	12,183
第6計算期間末	(分配付)	504,392,063	12,706
(平成18年12月15日)	(分配落)	504,392,063	12,706
第7計算期間末	(分配付)	601,118,304	12,722
(平成19年12月17日)	(分配落)	601,118,304	12,722
第8計算期間末	(分配付)	1,059,837,522	10,808
(平成20年12月15日)	(分配落)	1,059,837,522	10,808
第9計算期間末	(分配付)	1,327,431,221	11,435
(平成21年12月15日)	(分配落)	1,327,431,221	11,435
第10計算期間末	(分配付)	1,448,531,044	11,494
(平成22年12月15日)	(分配落)	1,448,531,044	11,494
第11計算期間末	(分配付)	1,481,882,524	11,225
(平成23年12月15日)	(分配落)	1,481,882,524	11,225
第12計算期間末	(分配付)	1,589,903,584	11,868
(平成24年12月17日)	(分配落)	1,589,903,584	11,868
第13計算期間末	(分配付)	1,748,232,122	13,101
(平成25年12月16日)	(分配落)	1,748,232,122	13,101
第14計算期間末	(分配付)	1,844,725,406	13,799
(平成26年12月15日)	(分配落)	1,844,725,406	13,799
第15計算期間末	(分配付)	1,908,354,734	13,944
(平成27年12月15日)	(分配落)	1,908,354,734	13,944
平成28年1月末日		1,931,330,062	14,024
平成28年2月末日		1,938,891,468	14,046
平成28年3月末日		1,970,314,690	14,209
平成28年4月末日		1,978,384,418	14,260
平成28年5月末日		1,985,280,208	14,328

	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6月末日	1,998,834,138	14,275
平成28年7月末日	2,007,329,062	14,269
平成28年8月末日	1,996,187,560	14,148
平成28年9月末日	1,993,253,452	14,122
平成28年10月末日	1,994,835,967	14,134
平成28年11月末日	1,986,573,945	14,164
第16計算期間末（分配付）	1,982,319,718	14,161
（平成28年12月15日）（分配落）	1,982,319,718	14,161
平成28年12月末日	1,985,005,267	14,171
平成29年1月末日	1,967,127,698	14,086

【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17日	0
第2計算期間末 平成14年12月16日	0
第3計算期間末 平成15年12月15日	0
第4計算期間末 平成16年12月15日	0
第5計算期間末 平成17年12月15日	0
第6計算期間末 平成18年12月15日	0
第7計算期間末 平成19年12月17日	0
第8計算期間末 平成20年12月15日	0
第9計算期間末 平成21年12月15日	0
第10計算期間末 平成22年12月15日	0
第11計算期間末 平成23年12月15日	0
第12計算期間末 平成24年12月17日	0
第13計算期間末 平成25年12月16日	0
第14計算期間末 平成26年12月15日	0
第15計算期間末 平成27年12月15日	0
第16計算期間末 平成28年12月15日	0

【収益率の推移】

期間	収益率（％）
第1計算期間 （平成13年9月28日から平成13年12月17日）	2.6
第2計算期間 （平成13年12月18日から平成14年12月16日）	6.6
第3計算期間 （平成14年12月17日から平成15年12月15日）	7.0
第4計算期間 （平成15年12月16日から平成16年12月15日）	4.7
第5計算期間 （平成16年12月16日から平成17年12月15日）	13.4
第6計算期間 （平成17年12月16日から平成18年12月15日）	4.3
第7計算期間 （平成18年12月16日から平成19年12月17日）	0.1
第8計算期間 （平成19年12月18日から平成20年12月15日）	15.0
第9計算期間 （平成20年12月16日から平成21年12月15日）	5.8
第10計算期間 （平成21年12月16日から平成22年12月15日）	0.5
第11計算期間 （平成22年12月16日から平成23年12月15日）	2.3
第12計算期間 （平成23年12月16日から平成24年12月17日）	5.7
第13計算期間 （平成24年12月18日から平成25年12月16日）	10.4
第14計算期間 （平成25年12月17日から平成26年12月15日）	5.3
第15計算期間 （平成26年12月16日から平成27年12月15日）	1.1
第16計算期間 （平成27年12月16日から平成28年12月15日）	1.6

- (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9月28日から平成13年12月17日）	1,000,000	-
第2計算期間 （平成13年12月18日から平成14年12月16日）	33,533,558	679,207
第3計算期間 （平成14年12月17日から平成15年12月15日）	64,738,109	7,063,451
第4計算期間 （平成15年12月16日から平成16年12月15日）	152,292,488	6,025,032
第5計算期間 （平成16年12月16日から平成17年12月15日）	177,190,535	48,704,118
第6計算期間 （平成17年12月16日から平成18年12月15日）	85,110,333	54,419,924
第7計算期間 （平成18年12月16日から平成19年12月17日）	130,829,178	55,311,297
第8計算期間 （平成19年12月18日から平成20年12月15日）	587,759,313	79,663,314
第9計算期間 （平成20年12月16日から平成21年12月15日）	209,052,676	28,758,288
第10計算期間 （平成21年12月16日から平成22年12月15日）	168,828,704	69,514,894
第11計算期間 （平成22年12月16日から平成23年12月15日）	149,541,866	89,533,719
第12計算期間 （平成23年12月16日から平成24年12月17日）	126,703,504	107,216,981
第13計算期間 （平成24年12月18日から平成25年12月16日）	168,009,579	173,324,028
第14計算期間 （平成25年12月17日から平成26年12月15日）	133,118,419	130,671,144
第15計算期間 （平成26年12月16日から平成27年12月15日）	157,234,223	125,444,315
第16計算期間 （平成27年12月16日から平成28年12月15日）	158,301,891	127,109,270

（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	14.086円
純資産総額	19.67億円

分配の推移(1万円当たり、税引前)

2012年12月17日	0円
2013年12月16日	0円
2014年12月15日	0円
2015年12月15日	0円
2016年12月15日	0円
設定来累計	0円

(注)基準価額は、1万円当たり、信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

PRUグッドライフ2020(年金)

資産の種類	投資比率
PRU国内株式マザーファンド	5.65%
PRU国内債券マザーファンド	77.10%
PRU海外株式マザーファンド	3.40%
PRU海外債券マザーファンド	4.41%
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	9.44%
合計(純資産総額)	100.00%

PRU国内株式マザーファンド

	組入上位業種	投資比率
1	電気機器	12.30%
2	輸送用機器	9.15%
3	銀行業	8.33%
4	情報・通信業	7.75%
5	化学	6.54%
6	機械	4.98%
7	医薬品	4.52%
8	小売業	4.43%
9	卸売業	4.21%
10	食料品	4.19%

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

PRU国内債券マザーファンド

種類別構成	投資比率
国債証券	83.43%
地方債証券	7.03%
特殊債券	5.97%
社債券	2.70%
現金・その他の資産(負債控除後)	0.87%
合計	100.00%

	種類	組入上位10銘柄	投資比率
1	国債証券	第118回利付国債(5年)	1.02%
2	国債証券	第120回利付国債(5年)	0.95%
3	国債証券	第121回利付国債(5年)	0.94%
4	国債証券	第338回利付国債(10年)	0.88%
5	国債証券	第126回利付国債(5年)	0.87%
6	国債証券	第117回利付国債(5年)	0.87%
7	国債証券	第124回利付国債(5年)	0.87%
8	国債証券	第123回利付国債(5年)	0.86%
9	国債証券	第313回利付国債(10年)	0.83%
10	国債証券	第327回利付国債(10年)	0.82%

主要な資産の状況

PRU海外株式マザーファンド

通貨別構成	投資比率
米ドル	65.39%
ユーロ	12.07%
英ポンド	7.28%
加ドル	4.09%
スイス・フラン	3.50%
その他	7.67%
合計	100.00%

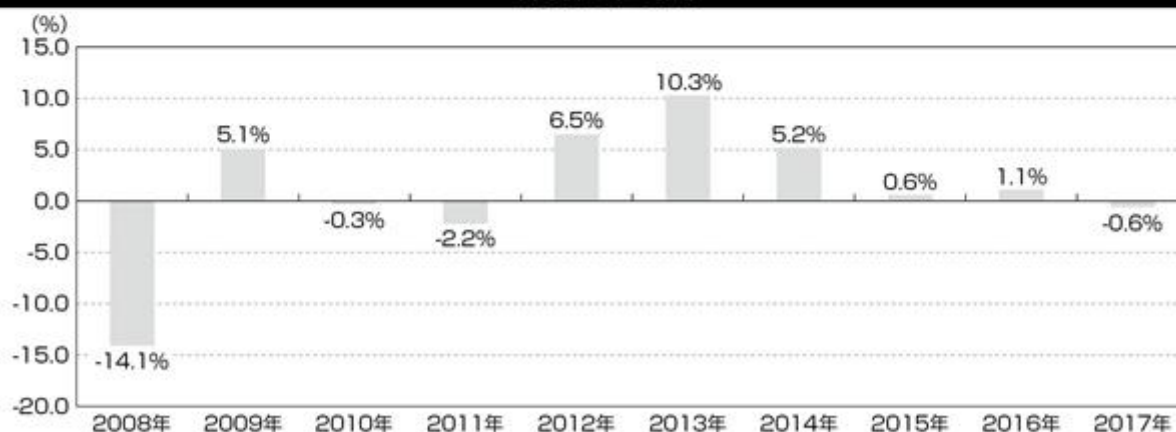
	国	組入上位10銘柄	業種	投資比率
1	アメリカ	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.01%
2	アメリカ	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.48%
3	アメリカ	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	1.08%
4	アメリカ	AMAZON.COM INC	小売	1.01%
5	アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.96%
6	アメリカ	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.95%
7	アメリカ	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	0.95%
8	アメリカ	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	0.83%
9	アメリカ	WELLS FARGO COMPANY	銀行	0.82%
10	アメリカ	AT&T INC	電気通信サービス	0.79%

PRU海外債券マザーファンド

通貨別構成	投資比率
米ドル	44.25%
ユーロ	39.86%
英ポンド	7.21%
その他	8.67%
合計	100.00%

	国	種類	組入上位10銘柄	クーポン	償還日	投資比率
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125%	2021年5月15日	4.76%
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375%	2018年12月31日	3.94%
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500%	2024年5月15日	3.45%
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625%	2019年4月30日	3.41%
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000%	2021年11月15日	3.13%
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625%	2019年12月31日	2.79%
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250%	2024年11月15日	2.76%
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625%	2020年8月15日	2.53%
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.750%	2018年1月31日	2.52%
10	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT BOND 0	2.500%	2020年10月25日	2.02%

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。

(注3) 当ファンドにはベンチマークはありません。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

（1）申込方法

当ファンドの取得申込者は、販売会社取引口座を開設し、取得の申込みを行うものとします。当ファンドの取得申込みは、「自動けいぞく投資コース」によるものとします。

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

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

（注2）平成30年3月末までの日本における営業日でニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所またはニューヨークもしくはロンドンの銀行の休業日に該当する日は以下のとおりです。

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

平成29年4月14日	平成29年4月17日	平成29年5月1日	平成29年5月29日
平成29年7月4日	平成29年8月28日	平成29年9月4日	平成29年11月10日
平成29年12月25日	平成29年12月26日	平成30年1月15日	平成30年2月19日
平成30年3月30日			

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

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

- * 「基準価額」とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。ただし、便宜上1万口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、「年金グッド20」として掲載されます。

（3）申込手数料

申込手数料は販売会社が独自に定めるものとします。
平成29年3月15日現在、手数料はありません。

（4）申込単位

1円以上1円単位とします。

（５）申込取扱場所

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

（６）申込代金の支払い

当ファンドの取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×取得申込口数）を、販売会社の定める日までに支払うものとします。

（７）当ファンドの受益権の取得申込みの勧誘は、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）第2条第5項に定める連合会（国民年金基金連合会であって、個人型年金を実施するものとして厚生労働大臣が全国を通じて一個に限り指定したものをいいます。同法第61条に基づき連合会が事務を委託した者を含みます。）、および同法第2条第7項第1号ロに定める資産管理機関（企業型年金を実施する事業主が同法第8条第1項の規定により締結した下記の契約の相手方をいいます。）に対して行われます。

- イ．信託会社、信託業務を営む金融機関、厚生年金基金又は企業年金基金を相手方とする運用の方法を特定する信託の契約
- ロ．生命保険会社を相手方とする生命保険の契約
- ハ．農業協同組合連合会を相手方とする生命共済の契約
- ニ．損害保険会社を相手方とする損害保険の契約

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

2【換金（解約）手続等】

一部解約

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

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

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

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

一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。

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

一部解約の実行の請求の受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け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、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において受益者に支払われます。

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

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

一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。受益証券をお手元で保有されている方は、一部解約の実行の請求に際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

当ファンドの主要投資対象の評価方法は以下のとおりです。

マザーファンド受益証券：計算日における基準価額で評価します。

（参考）マザーファンドの主要投資対象の評価方法

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

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

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

基準価額は、原則として毎営業日計算されます。

基準価額は、組入有価証券の値動き等により、日々変動します。

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

当ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日（平成13年9月28日）から平成32年12月15日までとします。ただし、後記「(5) その他 信託の終了」の場合には、当該信託の終了の日までとなります。

(4) 【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年12月16日から翌年12月15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9月28日から平成13年12月17日までとします。

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

(5) 【その他】**信託の終了****a. 投資信託契約の解約**

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

b. 投資信託契約に関する監督官庁の命令

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

c. 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

d. 受託銀行の辞任および解任に伴う取扱い

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

投資信託約款の変更

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

運用報告書等の作成

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コマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

d. 投資信託財産の登記等および記載等の留保等

- (a) 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託銀行が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。
- (b) 前記(a)ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社または受託銀行が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- (c) 投資信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託銀行が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- (d) 動産(金銭を除きます。)については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

信託事務処理の再信託

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

関係法人との契約の更新に関する手続き

- a. 販売会社との「投資信託受益権の取扱い等に関する契約書」(別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含みます。)に係る契約の有効期間は、契約締結の日から1年間とします。ただし、期間満了の3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ます。
- b. 投資顧問会社との「投資助言契約」に係る契約の有効期間は、契約締結の日から、当ファンドの信託の終了する日までとします。ただし、期間中において、必要のあるときは、契約の一部を変更することができるものとします。

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

4【受益者の権利等】

当ファンドの投資信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。委託会社は、当初設定に係る信託の受益権については100万口に、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

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、別に定める契約に基づき、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。

(注)「別に定める契約」とは、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て）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から受益証券と引換えに当該受益者に支払います。

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

(3) 一部解約の実行の請求権

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

(4) 反対者の買取請求権

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

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

(5) 受益者集会

受益者集会は開催しません。

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2．当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間（平成27年12月16日から平成28年12月15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グッドライフ2020（年金）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第15期 (平成27年12月15日現在)	第16期 (平成28年12月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	151,886,719	195,584,403
親投資信託受益証券	1,765,060,116	1,795,668,067
未収入金	-	85,182
未収利息	41	-
流動資産合計	1,916,946,876	1,991,337,652
資産合計	1,916,946,876	1,991,337,652
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	94,071
未払受託者報酬	826,889	858,758
未払委託者報酬	7,235,178	7,514,055
未払利息	-	535
その他未払費用	530,075	550,515
流動負債合計	8,592,142	9,017,934
負債合計	8,592,142	9,017,934
純資産の部		
元本等		
元本	1,368,612,773	1,399,805,394
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	539,741,961	582,514,324
（分配準備積立金）	241,181,846	247,434,772
元本等合計	1,908,354,734	1,982,319,718
純資産合計	1,908,354,734	1,982,319,718
負債純資産合計	1,916,946,876	1,991,337,652

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自	平成26年12月16日 平成27年12月15日	自	平成27年12月16日 平成28年12月15日
営業収益				
受取利息		13,117		2,158
有価証券売買等損益		36,306,191		47,491,325
営業収益合計		36,319,308		47,493,483
営業費用				
支払利息		-		113,211
受託者報酬		1,636,768		1,699,647
委託者報酬		14,321,556		14,871,818
その他費用		1,049,250		1,089,579
営業費用合計		17,007,574		17,774,255
営業利益又は営業損失（ ）		19,311,734		29,719,228
経常利益又は経常損失（ ）		19,311,734		29,719,228
当期純利益又は当期純損失（ ）		19,311,734		29,719,228
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（ ）		1,851,619		2,435,811
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		507,902,541		539,741,961
剰余金増加額又は欠損金減少額		62,157,850		65,764,995
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		62,157,850		65,764,995
剰余金減少額又は欠損金増加額		47,778,545		50,276,049
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		47,778,545		50,276,049
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		539,741,961		582,514,324

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	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。
-----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

第15期 (平成27年12月15日現在)	第16期 (平成28年12月15日現在)
1 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 1,336,822,865円 期中追加設定元本額 157,234,223円 期中解約元本額 125,444,315円 2. 計算期間末日における受益権の総数 1,368,612,773口	1 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 1,368,612,773円 期中追加設定元本額 158,301,891円 期中解約元本額 127,109,270円 2. 計算期間末日における受益権の総数 1,399,805,394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16日 至 平成27年12月15日	第16期 自 平成27年12月16日 至 平成28年12月15日
1. 資産運用の権限を再委託又は一部再委託する場合の当該委託費用 3,044,135円 2. 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(12,580,356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(4,879,759円)、投資信託約款に規定される収益調整金(378,753,495円)及び分配準備積立金(223,721,731円)より分配対象額は619,935,341円(1万口当たり4,529円)ですが、分配を行っておりません。	1. 資産運用の権限を再委託又は一部再委託する場合の当該委託費用 3,123,290円 2. 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(13,752,801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(13,530,616円)、投資信託約款に規定される収益調整金(414,125,734円)及び分配準備積立金(220,151,355円)より分配対象額は661,560,506円(1万口当たり4,726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 自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日	第16期 自 平成27年12月16日 至 平成28年12月15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15日現在)	第16期 (平成28年12月15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15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	30,546,624
合計	30,546,624

第16期（平成28年12月15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	52,506,596
合計	52,506,596

（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15日現在）		第16期 （平成28年12月15日現在）	
1口当たり純資産額	1.3944円	1口当たり純資産額	1.4161円
（1万口当たり純資産額	13,944円）	（1万口当たり純資産額	14,161円）

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式（平成28年12月15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15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	73,512,052	118,773,422
親投資信託受益証券	日本円	PRU国内債券マザーファンド	1,135,915,344	1,512,584,872
親投資信託受益証券	日本円	PRU海外株式マザーファンド	33,280,074	72,480,673
親投資信託受益証券	日本円	PRU海外債券マザーファンド	41,472,812	91,829,100
	合計		1,284,180,282	1,795,668,067

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考情報)

当ファンドは、「PRU国内株式マザーファンド」受益証券、「PRU国内債券マザーファンド」受益証券、「PRU海外株式マザーファンド」受益証券及び「PRU海外債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。同ファンドの状況は次の通りであります。

「PRU国内株式マザーファンド」の状況

なお、以下に掲載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(平成27年12月15日現在)	(平成28年12月15日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		78,942,931	126,596,319
株式		2,281,137,540	4,140,699,540
派生商品評価勘定		-	5,271,360
未収配当金		322,425	462,200
未収利息		21	-
前払金		3,060,000	-
差入委託証拠金		2,700,000	5,160,000
流動資産合計		2,366,162,917	4,278,189,419
資産合計		2,366,162,917	4,278,189,419
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		4,265,400	-
前受金		-	4,400,000
未払解約金		1,886,922	1,805,662
未払利息		-	346
流動負債合計		6,152,322	6,206,008
負債合計		6,152,322	6,206,008
純資産の部			
元本等			
元本	1	1,528,553,941	2,644,021,158
剰余金			
剰余金又は欠損金()		831,456,654	1,627,962,253
元本等合計		2,360,010,595	4,271,983,411
純資産合計		2,360,010,595	4,271,983,411
負債純資産合計		2,366,162,917	4,278,189,419

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15日現在)	(平成28年12月15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
1,812,707,285円	1,528,553,941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
288,838,406円	1,632,940,083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
572,991,750円	517,472,866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
56,794,769円	56,028,624円
PRUグッドライフ2020	PRUグッドライフ2020
882,520円	779,372円
PRUグッドライフ2030	PRUグッドライフ2030
1,933,876円	1,925,147円
PRUグッドライフ2040	PRUグッドライフ2040
8,346,721円	7,272,676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	73,512,052円
PRUグッドライフ2030（年金）	PRUグッドライフ2030（年金）
310,541,884円	319,623,069円
PRUグッドライフ2040（年金）	PRUグッドライフ2040（年金）
357,419,623円	371,836,562円
PRUグッドライフ2050（年金）	PRUグッドライフ2050（年金）
31,221,946円	33,199,500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）
672,729,003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 1,528,553,941円	計 2,644,021,158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
1,528,553,941円	2,644,021,158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16日 至 平成27年12月15日	自 平成27年12月16日 至 平成28年12月15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15日現在)	(平成28年12月15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15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	125,143,166
合計	125,143,166

（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15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	203,653,320
合計	203,653,320

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

株式関連

（単位：円）

種類	（平成27年12月15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	-	75,075,000	4,265,400
合計	79,340,400	-	75,075,000	4,265,400

（単位：円）

種類	（平成28年12月15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	-	123,680,000	5,271,360
合計	118,408,640	-	123,680,000	5,271,360

（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15日現在）		（平成28年12月15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	
	1.5439円		1.6157円
（1万口当たり純資産額	15,439円）	（1万口当たり純資産額	16,157円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

（平成28年12月15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	2,729.00	545,800
		日本水産	2,700	535.00	1,444,500
		マルハニチロ	400	3,015.00	1,206,000
		サカタのタネ	300	3,255.00	976,500
		ホクト	200	2,103.00	420,600
		日鉄鉱業	100	5,830.00	583,000
		三井松島産業	100	1,349.00	134,900
		国際石油開発帝石	10,900	1,220.50	13,303,450
		日本海洋掘削	100	2,605.00	260,500
		石油資源開発	300	2,765.00	829,500
		K & Oエナジーグループ	100	1,891.00	189,100
		ショーボンドホールディングス	200	4,980.00	996,000
		ミライト・ホールディングス	600	1,077.00	646,200
		タマホーム	100	543.00	54,300
		ダイセキ環境ソリューション	100	1,411.00	141,100
		安藤・間	1,500	778.00	1,167,000
		東急建設	700	920.00	644,000
		コムシスホールディングス	800	2,111.00	1,688,800
		ミサワホーム	300	1,026.00	307,800
		高松コンストラクショングループ	100	2,512.00	251,200
		東建コーポレーション	100	8,310.00	831,000
		大成建設	11,000	836.00	9,196,000
		大林組	6,200	1,124.00	6,968,800
		清水建設	6,000	1,082.00	6,492,000
		飛鳥建設	2,100	195.00	409,500
		長谷工コーポレーション	2,400	1,179.00	2,829,600
		松井建設	200	1,074.00	214,800
		鹿島建設	9,000	826.00	7,434,000
		不動テトラ	1,700	215.00	365,500
		大末建設	100	928.00	92,800
		鉄建建設	1,000	354.00	354,000
		西松建設	3,000	567.00	1,701,000
		三井住友建設	8,400	126.00	1,058,400
		大豊建設	1,000	571.00	571,000
		前田建設工業	1,000	1,042.00	1,042,000
		ナカノフドー建設	200	656.00	131,200
		奥村組	2,000	658.00	1,316,000
		東鉄工業	200	2,890.00	578,000
		浅沼組	1,000	381.00	381,000
		戸田建設	2,000	633.00	1,266,000
		熊谷組	3,000	300.00	900,000
		三井ホーム	1,000	478.00	478,000
		矢作建設工業	300	1,032.00	309,600
		日本ハウスホールディングス	400	485.00	194,000
		大東建託	800	17,325.00	13,860,000
		新日本建設	200	948.00	189,600
		N I P P O	1,000	2,211.00	2,211,000
		東亜道路工業	1,000	340.00	340,000
		前田道路	1,000	1,961.00	1,961,000
		東亜建設工業	200	1,946.00	389,200
		若築建設	1,000	156.00	156,000
		東洋建設	800	411.00	328,800
		五洋建設	2,400	573.00	1,375,200

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	大林道路	200	733.00	146,600
		世紀東急工業	300	508.00	152,400
		住友林業	1,400	1,583.00	2,216,200
		日本基礎技術	600	340.00	204,000
		日成ビルド工業	1,000	515.00	515,000
		巴コーポレーション	400	358.00	143,200
		パナホーム	1,000	839.00	839,000
		大和ハウス工業	6,100	3,249.00	19,818,900
		ライト工業	400	1,250.00	500,000
		積水ハウス	6,500	1,901.50	12,359,750
		日特建設	300	475.00	142,500
		中電工	300	2,550.00	765,000
		関電工	1,000	1,064.00	1,064,000
		きんでん	1,500	1,500.00	2,250,000
		住友電設	200	1,281.00	256,200
		日本電設工業	300	1,936.00	580,800
		協和エクシオ	700	1,712.00	1,198,400
		九電工	400	3,055.00	1,222,000
		三機工業	600	984.00	590,400
		日揮	1,900	2,136.00	4,058,400
		中外炉工業	1,000	218.00	218,000
		ヤマト	300	575.00	172,500
		高砂熱学工業	600	1,573.00	943,800
		朝日工業社	100	2,953.00	295,300
		明星工業	500	576.00	288,000
		大気社	200	2,882.00	576,400
		日比谷総合設備	200	1,631.00	326,200
		東芝プラントシステム	300	1,717.00	515,100
		OSJBホールディングス	1,000	232.00	232,000
		東洋エンジニアリング	1,000	313.00	313,000
		千代田化工建設	2,000	877.00	1,754,000
		新興プランテック	500	859.00	429,500
		日本製粉	600	1,596.00	957,600
		日清製粉グループ本社	2,300	1,720.00	3,956,000
		昭和産業	1,000	604.00	604,000
		中部飼料	300	1,001.00	300,300
		日本甜菜製糖	100	2,359.00	235,900
		三井製糖	200	2,469.00	493,800
		日新製糖	100	1,650.00	165,000
		森永製菓	400	4,665.00	1,866,000
		中村屋	100	4,800.00	480,000
		江崎グリコ	500	5,210.00	2,605,000
		名糖産業	100	1,385.00	138,500
		不二家	2,000	224.00	448,000
		山崎製パン	1,500	2,252.00	3,378,000
		モロゾフ	1,000	475.00	475,000
		亀田製菓	100	5,180.00	518,000
寿スピリッツ	200	2,626.00	525,200		
カルビー	800	3,685.00	2,948,000		
森永乳業	2,000	802.00	1,604,000		
六甲バター	100	2,486.00	248,600		
ヤクルト本社	1,100	5,260.00	5,786,000		
明治ホールディングス	1,200	8,980.00	10,776,000		
雪印メグミルク	400	3,090.00	1,236,000		
プリマハム	1,000	398.00	398,000		
日本ハム	1,000	3,080.00	3,080,000		
林兼産業	100	874.00	87,400		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	丸大食品	1,000	482.00	482,000
		S Foods	100	2,885.00	288,500
		伊藤ハム米久ホールディングス	1,200	1,007.00	1,208,400
		サッポロホールディングス	700	2,967.00	2,076,900
		アサヒグループホールディングス	3,900	3,430.00	13,377,000
		キリンホールディングス	9,000	1,916.00	17,244,000
		宝ホールディングス	1,500	1,033.00	1,549,500
		養命酒製造	100	1,861.00	186,100
		コカ・コーラウエスト	700	3,430.00	2,401,000
		コカ・コーライーストジャパン	800	2,555.00	2,044,000
		サントリー食品インターナショナル	1,400	4,830.00	6,762,000
		ダイトードリンコ	100	5,740.00	574,000
		伊藤園	600	3,660.00	2,196,000
		キーコーヒー	200	2,122.00	424,400
		日清オイリオグループ	1,000	516.00	516,000
		不二製油グループ本社	500	2,224.00	1,112,000
		J-オイルミルズ	100	3,780.00	378,000
		キッコーマン	1,000	3,715.00	3,715,000
		味の素	4,300	2,374.00	10,208,200
		キューピー	1,100	2,707.00	2,977,700
		ハウス食品グループ本社	800	2,363.00	1,890,400
		カゴメ	700	2,832.00	1,982,400
		焼津水産化学工業	300	1,070.00	321,000
		アリアケジャパン	200	6,020.00	1,204,000
		エバラ食品工業	100	1,993.00	199,300
		ニチレイ	1,000	2,322.00	2,322,000
		東洋水産	1,000	4,085.00	4,085,000
		日清食品ホールディングス	800	5,970.00	4,776,000
		一正蒲鉾	100	1,117.00	111,700
		フジッコ	200	2,349.00	469,800
		ロック・フィールド	200	1,510.00	302,000
		日本たばこ産業	11,400	3,890.00	44,346,000
		ケンコーマヨネーズ	100	3,250.00	325,000
		わらべや日洋ホールディングス	100	2,407.00	240,700
		なとり	200	1,811.00	362,200
		ユーグレナ	800	1,294.00	1,035,200
		ミヨシ油脂	2,000	144.00	288,000
		理研ビタミン	100	4,700.00	470,000
		片倉工業	100	1,302.00	130,200
		ゲンゼ	2,000	377.00	754,000
		東洋紡	8,000	177.00	1,416,000
		ユニチカ	5,000	87.00	435,000
		富士紡ホールディングス	100	3,265.00	326,500
		倉敷紡績	2,000	236.00	472,000
		シキボウ	2,000	140.00	280,000
		日本毛織	600	864.00	518,400
		ダイドーリミテッド	700	403.00	282,100
帝国繊維	200	1,662.00	332,400		
帝人	1,600	2,356.00	3,769,600		
東レ	14,000	955.20	13,372,800		
サカイオーベックス	100	1,782.00	178,200		
アツギ	1,000	126.00	126,000		
セーレン	500	1,496.00	748,000		
小松精練	300	711.00	213,300		
ワコールホールディングス	1,000	1,396.00	1,396,000		
ホギメディカル	100	6,910.00	691,000		
レナウン	1,500	121.00	181,500		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	T S Iホールディングス	800	721.00	576,800
		三陽商会	1,000	178.00	178,000
		オンワードホールディングス	1,000	837.00	837,000
		ゴールドウイン	100	5,370.00	537,000
		デサント	400	1,342.00	536,800
		特種東海製紙	100	3,945.00	394,500
		王子ホールディングス	8,000	497.00	3,976,000
		日本製紙	900	2,088.00	1,879,200
		三菱製紙	200	786.00	157,200
		北越紀州製紙	1,200	675.00	810,000
		中越パルプ工業	1,000	243.00	243,000
		大王製紙	700	1,291.00	903,700
		レンゴー	1,800	647.00	1,164,600
		ザ・バック	100	2,695.00	269,500
		クラレ	3,300	1,735.00	5,725,500
		旭化成	12,000	1,056.00	12,672,000
		昭和電工	1,300	1,689.00	2,195,700
		住友化学	14,000	577.00	8,078,000
		住友精化	100	4,480.00	448,000
		日産化学工業	1,100	3,855.00	4,240,500
		クレハ	200	4,600.00	920,000
		石原産業	400	987.00	394,800
		日東エフシー	100	904.00	90,400
		日本曹達	1,000	535.00	535,000
		東ソー	6,000	848.00	5,088,000
		トクヤマ	3,000	473.00	1,419,000
		セントラル硝子	2,000	535.00	1,070,000
		東亜合成	1,300	1,145.00	1,488,500
		デンカ	4,000	527.00	2,108,000
		信越化学工業	3,500	8,983.00	31,440,500
		日本カーバイド工業	1,000	156.00	156,000
		堺化学工業	1,000	385.00	385,000
		エア・ウォーター	1,500	2,088.00	3,132,000
		大陽日酸	1,500	1,360.00	2,040,000
		日本化学工業	1,000	248.00	248,000
		日本パーカライジング	1,000	1,377.00	1,377,000
		高圧ガス工業	400	746.00	298,400
		ステラ ケミファ	100	3,020.00	302,000
		保土谷化学工業	100	2,735.00	273,500
		日本触媒	300	7,280.00	2,184,000
		大日精化工業	1,000	641.00	641,000
		カネカ	3,000	984.00	2,952,000
		三菱瓦斯化学	1,800	1,972.00	3,549,600
		三井化学	9,000	543.00	4,887,000
		J S R	2,000	1,820.00	3,640,000
		東京応化工業	400	3,755.00	1,502,000
		大阪有機化学工業	100	899.00	89,900
		三菱ケミカルホールディングス	13,000	780.70	10,149,100
		K Hネオケム	200	1,237.00	247,400
		ダイセル	2,700	1,325.00	3,577,500
		住友ベークライト	2,000	660.00	1,320,000
		積水化学工業	4,400	1,785.00	7,854,000
		日本ゼオン	2,000	1,131.00	2,262,000
アイカ工業	600	3,035.00	1,821,000		
宇部興産	10,000	257.00	2,570,000		
積水樹脂	300	1,855.00	556,500		
日立化成	1,100	2,894.00	3,183,400		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	リケンテクノス	500	542.00	271,000
		大倉工業	1,000	484.00	484,000
		積水化成成品工業	400	835.00	334,000
		群栄化学工業	100	3,255.00	325,500
		ダイキョーニシカワ	300	1,490.00	447,000
		日本化薬	1,000	1,409.00	1,409,000
		扶桑化学工業	200	2,402.00	480,400
		A D E K A	800	1,643.00	1,314,400
		日油	2,000	1,073.00	2,146,000
		ハリマ化成グループ	200	783.00	156,600
		花王	4,900	5,538.00	27,136,200
		三洋化成工業	100	4,995.00	499,500
		大日本塗料	1,000	223.00	223,000
		日本ペイントホールディングス	1,500	3,195.00	4,792,500
		関西ペイント	2,100	2,110.00	4,431,000
		中国塗料	700	871.00	609,700
		日本特殊塗料	100	1,688.00	168,800
		藤倉化成	300	652.00	195,600
		太陽ホールディングス	100	4,630.00	463,000
		D I C	800	3,715.00	2,972,000
		サカティンクス	400	1,515.00	606,000
		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	4,452.00	16,917,600
		資生堂	3,700	2,940.00	10,878,000
		ライオン	2,000	1,823.00	3,646,000
		高砂香料工業	100	3,175.00	317,500
		マンダム	200	4,945.00	989,000
		ミルボン	100	4,480.00	448,000
		ファンケル	400	1,616.00	646,400
		コーセー	300	9,430.00	2,829,000
		コタ	100	1,285.00	128,500
		シーズ・ホールディングス	300	3,215.00	964,500
		ポーラ・オルビスホールディングス	200	8,910.00	1,782,000
		ノエビアホールディングス	100	3,580.00	358,000
		エステー	300	1,498.00	449,400
		アグロ カネショウ	100	1,224.00	122,400
		コニシ	300	1,291.00	387,300
		長谷川香料	300	1,993.00	597,900
		小林製薬	600	4,965.00	2,979,000
		荒川化学工業	200	1,712.00	342,400
		メック	200	938.00	187,600
		日本高純度化学	100	2,480.00	248,000
		タカラバイオ	400	1,430.00	572,000
		J C U	100	5,220.00	522,000
		新田ゼラチン	300	720.00	216,000
		デクセリアルズ	500	1,034.00	517,000
		アース製薬	100	4,830.00	483,000
		イハラケミカル工業	300	1,162.00	348,600
		クミアイ化学工業	400	714.00	285,600
		日本農薬	400	657.00	262,800
アキレス	200	1,639.00	327,800		
有沢製作所	300	667.00	200,100		
日東電工	1,400	9,058.00	12,681,200		
レック	100	3,295.00	329,500		
きもと	500	262.00	131,000		
藤森工業	100	2,948.00	294,800		
前澤化成工業	200	1,175.00	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	J S P	100	2,806.00	280,600
		エフピコ	200	5,310.00	1,062,000
		天馬	100	2,019.00	201,900
		信越ポリマー	300	862.00	258,600
		東リ	300	377.00	113,100
		ニフコ	300	6,100.00	1,830,000
		日本バルカー工業	200	1,530.00	306,000
		ユニ・チャーム	4,000	2,491.50	9,966,000
		協和発酵キリン	2,300	1,593.00	3,663,900
		武田薬品工業	7,300	4,782.00	34,908,600
		アステラス製薬	19,900	1,593.50	31,710,650
		大日本住友製薬	1,400	1,911.00	2,675,400
		塩野義製薬	2,600	5,197.00	13,512,200
		田辺三菱製薬	2,300	2,234.00	5,138,200
		あすか製薬	200	1,629.00	325,800
		日本新薬	400	5,630.00	2,252,000
		中外製薬	1,900	3,265.00	6,203,500
		科研製薬	400	5,990.00	2,396,000
		エーザイ	2,400	6,704.00	16,089,600
		ロート製薬	900	1,793.00	1,613,700
		小野薬品工業	4,400	2,498.00	10,991,200
		久光製薬	600	5,470.00	3,282,000
		持田製薬	100	7,880.00	788,000
		参天製薬	3,600	1,378.00	4,960,800
		扶桑薬品工業	100	2,748.00	274,800
		ツムラ	600	3,135.00	1,881,000
		日医工	500	1,684.00	842,000
		キッセイ薬品工業	300	2,801.00	840,300
		生化学工業	400	1,636.00	654,400
		栄研化学	200	2,970.00	594,000
		日水製薬	200	1,306.00	261,200
		鳥居薬品	100	2,576.00	257,600
		J C Rファーマ	200	2,658.00	531,600
		東和薬品	100	4,360.00	436,000
		富士製薬工業	100	2,620.00	262,000
		沢井製薬	300	6,180.00	1,854,000
		ゼリア新薬工業	400	1,801.00	720,400
		第一三共	5,700	2,376.00	13,543,200
		キョーリン製薬ホールディングス	500	2,430.00	1,215,000
		大幸薬品	200	1,808.00	361,600
		ダイト	100	2,208.00	220,800
		大塚ホールディングス	4,200	4,871.00	20,458,200
		大正製薬ホールディングス	400	9,510.00	3,804,000
		ペプチドリーム	300	5,520.00	1,656,000
		日本コークス工業	1,700	111.00	188,700
		昭和シェル石油	1,800	1,129.00	2,032,200
		ニチレキ	200	915.00	183,000
		東燃ゼネラル石油	3,000	1,249.00	3,747,000
		ユシロ化学工業	200	1,470.00	294,000
		富士石油	500	424.00	212,000
		出光興産	900	3,140.00	2,826,000
J Xホールディングス	21,200	501.80	10,638,160		
コスモエネルギーホールディングス	600	1,697.00	1,018,200		
横浜ゴム	1,200	2,191.00	2,629,200		
東洋ゴム工業	1,000	1,573.00	1,573,000		
ブリヂストン	6,500	4,407.00	28,645,500		
住友ゴム工業	1,800	1,937.00	3,486,600		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	藤倉ゴム工業	200	695.00	139,000
		オカモト	1,000	1,047.00	1,047,000
		ニッタ	200	3,165.00	633,000
		住友理工	400	1,132.00	452,800
		バンドー化学	300	1,054.00	316,200
		日東紡績	2,000	471.00	942,000
		旭硝子	9,000	824.00	7,416,000
		日本板硝子	900	892.00	802,800
		日本山村硝子	1,000	207.00	207,000
		日本電気硝子	4,000	661.00	2,644,000
		住友大阪セメント	4,000	420.00	1,680,000
		太平洋セメント	12,000	362.00	4,344,000
		日本コンクリート工業	400	364.00	145,600
		三谷セキサン	100	2,781.00	278,100
		アジアパイルホールディングス	300	532.00	159,600
		東海カーボン	2,000	397.00	794,000
		日本カーボン	1,000	250.00	250,000
		東洋炭素	100	1,901.00	190,100
		ノリタケカンパニーリミテド	100	2,717.00	271,700
		TOTO	1,400	4,590.00	6,426,000
		日本碍子	2,400	2,386.00	5,726,400
		日本特殊陶業	1,700	2,696.00	4,583,200
		MARUWA	100	3,885.00	388,500
		品川リフラクトリーズ	1,000	253.00	253,000
		フジインコーポレーテッド	200	2,217.00	443,400
		ニチアス	1,000	1,093.00	1,093,000
		ニチハ	300	2,821.00	846,300
		新日鐵住金	8,700	2,710.00	23,577,000
		神戸製鋼所	3,400	1,239.00	4,212,600
		中山製鋼所	300	792.00	237,600
		合同製鐵	100	2,207.00	220,700
		ジェイ エフ イー ホールディングス	5,300	1,894.50	10,040,850
		日新製鋼	900	1,488.00	1,339,200
		東京製鐵	1,000	899.00	899,000
		共英製鋼	200	2,172.00	434,400
		大和工業	400	3,380.00	1,352,000
		東京鐵鋼	1,000	487.00	487,000
		大阪製鐵	100	2,131.00	213,100
		淀川製鋼所	300	3,145.00	943,500
		東洋鋼鈑	600	406.00	243,600
		丸一鋼管	700	3,720.00	2,604,000
		モリ工業	100	2,024.00	202,400
		大同特殊鋼	3,000	505.00	1,515,000
		日本冶金工業	2,200	208.00	457,600
		山陽特殊製鋼	1,000	574.00	574,000
		愛知製鋼	100	5,300.00	530,000
		日立金属	2,000	1,609.00	3,218,000
		大平洋金属	1,000	399.00	399,000
		新日本電工	900	256.00	230,400
		栗本鐵工所	100	2,408.00	240,800
		三菱製鋼	2,000	241.00	482,000
		日本軽金属ホールディングス	4,500	257.00	1,156,500
		三井金属鉱業	5,000	307.00	1,535,000
		東邦亜鉛	1,000	485.00	485,000
		三菱マテリアル	1,200	3,755.00	4,506,000
		住友金属鉱山	5,000	1,572.00	7,860,000
DOWAホールディングス	2,000	926.00	1,852,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	古河機械金属	3,000	227.00	681,000
		大阪チタニウムテクノロジーズ	200	1,705.00	341,000
		東邦チタニウム	300	842.00	252,600
		UACJ	3,000	311.00	933,000
		古河電気工業	700	3,405.00	2,383,500
		住友電気工業	7,200	1,697.00	12,218,400
		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	90.00	180,000
		タツタ電線	500	470.00	235,000
		リョービ	1,000	483.00	483,000
		アーレスティ	200	1,211.00	242,200
		アサヒホールディングス	300	2,069.00	620,700
		稲葉製作所	100	1,339.00	133,900
		トーカロ	100	2,650.00	265,000
		SUMCO	2,000	1,520.00	3,040,000
		東洋製罐グループホールディングス	1,400	2,159.00	3,022,600
		ホッカンホールディングス	1,000	427.00	427,000
		コロナ	100	1,175.00	117,500
		横河ブリッジホールディングス	400	1,342.00	536,800
		三和ホールディングス	2,000	1,132.00	2,264,000
		文化シャッター	500	917.00	458,500
		三協立山	200	1,691.00	338,200
		アルインコ	300	1,042.00	312,600
		LIXILグループ	2,700	2,612.00	7,052,400
		ノーリツ	400	2,055.00	822,000
		長府製作所	200	2,686.00	537,200
		リンナイ	300	9,350.00	2,805,000
		ダイニチ工業	300	725.00	217,500
		岡部	300	999.00	299,700
		ジーテクト	200	2,275.00	455,000
		東プレ	400	2,940.00	1,176,000
		高周波熱錬	300	900.00	270,000
		東京製綱	100	2,042.00	204,200
		パイオラックス	100	7,660.00	766,000
		日本発條	1,800	1,073.00	1,931,400
		三益半導体工業	100	1,659.00	165,900
		日本製鋼所	600	2,107.00	1,264,200
		三浦工業	800	1,767.00	1,413,600
		タクマ	1,000	921.00	921,000
		ツガミ	1,000	703.00	703,000
		オークマ	1,000	1,126.00	1,126,000
		東芝機械	1,000	478.00	478,000
		アマダホールディングス	2,700	1,314.00	3,547,800
		アイダエンジニアリング	600	1,076.00	645,600
		滝澤鉄工所	1,000	167.00	167,000
		富士機械製造	500	1,357.00	678,500
		牧野フライス製作所	1,000	961.00	961,000
オーエスジー	900	2,333.00	2,099,700		
旭ダイヤモンド工業	500	863.00	431,500		
DMG森精機	1,100	1,538.00	1,691,800		
ソディック	500	987.00	493,500		
ディスコ	200	13,350.00	2,670,000		
日東工器	100	2,561.00	256,100		
豊和工業	200	639.00	127,800		
島精機製作所	300	3,705.00	1,111,500		
日阪製作所	200	876.00	175,200		
やまびこ	300	1,411.00	423,300		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	ペガサスミシン製造	200	718.00	143,600
		ナブテスコ	1,000	2,842.00	2,842,000
		三井海洋開発	200	1,888.00	377,600
		レオン自動機	100	901.00	90,100
		S M C	600	27,420.00	16,452,000
		新川	100	772.00	77,200
		オイレス工業	200	2,111.00	422,200
		日精エー・エス・ビー機械	100	2,460.00	246,000
		サトーホールディングス	300	2,625.00	787,500
		ワイエイシイ	100	1,185.00	118,500
		小松製作所	8,900	2,653.50	23,616,150
		住友重機械工業	6,000	730.00	4,380,000
		日立建機	900	2,499.00	2,249,100
		井関農機	2,000	230.00	460,000
		T O W A	200	1,301.00	260,200
		丸山製作所	1,000	191.00	191,000
		北川鉄工所	100	2,397.00	239,700
		ローツェ	100	1,715.00	171,500
		クボタ	9,300	1,708.00	15,884,400
		三菱化工機	1,000	227.00	227,000
		月島機械	400	1,248.00	499,200
		帝国電機製作所	200	977.00	195,400
		新東工業	400	1,013.00	405,200
		澁谷工業	200	2,375.00	475,000
		アイチ コーポレーション	300	883.00	264,900
		小森コーポレーション	500	1,571.00	785,500
		鶴見製作所	100	1,735.00	173,500
		荏原製作所	800	3,155.00	2,524,000
		西島製作所	100	1,115.00	111,500
		北越工業	300	801.00	240,300
		ダイキン工業	2,500	10,795.00	26,987,500
		トーヨーカネツ	1,000	314.00	314,000
		栗田工業	1,100	2,456.00	2,701,600
		椿本チエイン	1,000	980.00	980,000
		木村化工機	400	345.00	138,000
		アネスト岩田	300	1,149.00	344,700
		ダイフク	900	2,394.00	2,154,600
		加藤製作所	100	2,974.00	297,400
		油研工業	1,000	215.00	215,000
		タダノ	1,000	1,515.00	1,515,000
		フジテック	500	1,356.00	678,000
		C K D	600	1,394.00	836,400
		キトー	200	1,128.00	225,600
		平和	500	2,627.00	1,313,500
		理想科学工業	200	2,005.00	401,000
		S A N K Y O	500	3,815.00	1,907,500
		日本金銭機械	200	1,423.00	284,600
マースエンジニアリング	100	2,167.00	216,700		
福島工業	100	3,200.00	320,000		
ダイコク電機	100	1,743.00	174,300		
竹内製作所	300	2,546.00	763,800		
アマノ	600	2,028.00	1,216,800		
J U K I	300	1,129.00	338,700		
サンデンホールディングス	1,000	393.00	393,000		
蛇の目ミシン工業	200	842.00	168,400		
グローリー	600	3,735.00	2,241,000		
新晃工業	100	1,419.00	141,900		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	大和冷機工業	300	897.00	269,100
		セガサミーホールディングス	1,900	1,758.00	3,340,200
		リケン	100	4,440.00	444,000
		T P R	200	3,415.00	683,000
		ツバキ・ナカシマ	200	1,762.00	352,400
		ホシザキ	400	8,780.00	3,512,000
		大豊工業	200	1,710.00	342,000
		日本精工	3,800	1,400.00	5,320,000
		N T N	4,000	506.00	2,024,000
		ジェイテクト	2,000	1,959.00	3,918,000
		不二越	2,000	516.00	1,032,000
		日本トムソン	700	520.00	364,000
		T H K	1,300	2,613.00	3,396,900
		ユーシン精機	100	2,683.00	268,300
		前澤給装工業	400	1,526.00	610,400
		イーグル工業	200	1,585.00	317,000
		日本ピラー工業	200	1,247.00	249,400
		キッツ	1,000	676.00	676,000
		日立工機	500	1,177.00	588,500
		マキタ	1,200	7,670.00	9,204,000
		日立造船	1,500	619.00	928,500
		三菱重工業	31,000	554.10	17,177,100
		I H I	14,000	332.00	4,648,000
		スター精密	300	1,604.00	481,200
		日清紡ホールディングス	1,000	1,161.00	1,161,000
		イビデン	1,300	1,691.00	2,198,300
		コニカミノルタ	4,400	1,143.00	5,029,200
		ブラザー工業	2,400	2,082.00	4,996,800
		ミネベア	3,000	1,177.00	3,531,000
		日立製作所	44,000	642.20	28,256,800
		東芝	41,000	462.80	18,974,800
		三菱電機	19,800	1,654.00	32,749,200
		富士電機	6,000	609.00	3,654,000
		安川電機	2,100	1,856.00	3,897,600
		シンフォニアテクノロジー	1,000	281.00	281,000
		明電舎	2,000	407.00	814,000
		山洋電気	1,000	810.00	810,000
		デンヨー	200	1,569.00	313,800
		東芝テック	1,000	569.00	569,000
		マブチモーター	500	6,410.00	3,205,000
		日本電産	2,400	9,987.00	23,968,800
		東光高岳	100	2,027.00	202,700
		ダブル・スコープ	200	1,649.00	329,800
		ダイヘン	1,000	738.00	738,000
		田淵電機	400	414.00	165,600
		J V C ケンウッド	1,300	318.00	413,400
		ミマキエンジニアリング	200	682.00	136,400
		日新電機	400	1,216.00	486,400
		オムロン	2,000	4,575.00	9,150,000
		日東工業	300	1,632.00	489,600
I D E C	300	1,093.00	327,900		
ジーエス・ユアサ コーポレーション	4,000	496.00	1,984,000		
サクサホールディングス	1,000	221.00	221,000		
メルコホールディングス	100	3,215.00	321,500		
日本電気	26,000	320.00	8,320,000		
富士通	18,000	702.40	12,643,200		
沖電気工業	800	1,680.00	1,344,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	電気興業	1,000	593.00	593,000
		サンケン電気	1,000	569.00	569,000
		アイホン	100	1,905.00	190,500
		ルネサスエレクトロニクス	1,000	984.00	984,000
		セイコーエプソン	2,800	2,449.00	6,857,200
		ワコム	1,400	311.00	435,400
		アルバック	400	3,550.00	1,420,000
		E I Z O	200	3,600.00	720,000
		ジャパンディスプレイ	3,600	342.00	1,231,200
		日本信号	600	956.00	573,600
		能美防災	200	1,710.00	342,000
		ホーチキ	200	1,320.00	264,000
		エレコム	100	1,943.00	194,300
		日本無線	100	1,363.00	136,300
		パナソニック	20,900	1,303.00	27,232,700
		アンリツ	1,300	642.00	834,600
		富士通ゼネラル	1,000	2,312.00	2,312,000
		日立国際電気	500	2,271.00	1,135,500
		ソニー	13,100	3,373.00	44,186,300
		T D K	1,000	8,190.00	8,190,000
		ミツミ電機	700	691.00	483,700
		タムラ製作所	1,000	453.00	453,000
		アルプス電気	1,700	2,954.00	5,021,800
		パイオニア	2,800	253.00	708,400
		日本電波工業	200	913.00	182,600
		ローランド ディー・ジー・	100	3,110.00	311,000
		フォスター電機	200	2,183.00	436,600
		クラリオン	1,000	426.00	426,000
		S M K	1,000	444.00	444,000
		ヨコオ	100	819.00	81,900
		ホシデン	600	930.00	558,000
		ヒロセ電機	300	14,240.00	4,272,000
		日本航空電子工業	1,000	1,661.00	1,661,000
		T O A	200	1,019.00	203,800
		日立マクセル	300	2,025.00	607,500
		古野電気	300	861.00	258,300
		ユニデンホールディングス	1,000	176.00	176,000
		アルパイン	400	1,598.00	639,200
		スミダコーポレーション	100	1,000.00	100,000
		アイコム	100	2,120.00	212,000
		船井電機	200	993.00	198,600
		横河電機	2,000	1,624.00	3,248,000
		新電元工業	1,000	444.00	444,000
		アズビル	500	3,255.00	1,627,500
		日本光電工業	800	2,590.00	2,072,000
		チノー	100	1,106.00	110,600
		共和電業	400	403.00	161,200
		堀場製作所	400	5,320.00	2,128,000
		アドバンテスト	1,300	1,618.00	2,103,400
		エスペック	200	1,317.00	263,400
		パナソニック デバイス S U N X	200	734.00	146,800
		キーエンス	400	77,180.00	30,872,000
		シスメックス	1,400	6,540.00	9,156,000
日本マイクロニクス	300	1,180.00	354,000		
メガチップス	200	2,483.00	496,600		
O B A R A G R O U P	100	5,490.00	549,000		
コーセル	300	1,242.00	372,600		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	イリソ電子工業	100	6,840.00	684,000
		オプテックス	200	2,520.00	504,000
		千代田インテグレ	100	2,490.00	249,000
		レーザーテック	200	2,042.00	408,400
		スタンレー電気	1,300	3,175.00	4,127,500
		岩崎電気	1,000	182.00	182,000
		ウシオ電機	1,100	1,484.00	1,632,400
		ヘリオス テクノ ホールディング	300	458.00	137,400
		日本セラミック	100	2,139.00	213,900
		日本デジタル研究所	100	2,417.00	241,700
		山一電機	200	1,127.00	225,400
		日本電子	1,000	523.00	523,000
		カシオ計算機	1,600	1,706.00	2,729,600
		ファナック	1,900	20,275.00	38,522,500
		日本シイエムケイ	400	735.00	294,000
		エンプラス	100	3,600.00	360,000
		ローム	900	6,720.00	6,048,000
		浜松ホトニクス	1,400	3,140.00	4,396,000
		三井ハイテック	300	813.00	243,900
		新光電気工業	800	796.00	636,800
		京セラ	3,000	5,806.00	17,418,000
		太陽誘電	900	1,339.00	1,205,100
		村田製作所	1,900	15,875.00	30,162,500
		ユーシン	400	734.00	293,600
		双葉電子工業	400	1,954.00	781,600
		北陸電気工業	1,000	136.00	136,000
		ニチコン	600	1,048.00	628,800
		日本ケミコン	2,000	265.00	530,000
		K O A	200	1,112.00	222,400
		市光工業	1,000	381.00	381,000
		小糸製作所	1,100	6,160.00	6,776,000
		ミツバ	300	1,766.00	529,800
		S C R E E Nホールディングス	400	6,850.00	2,740,000
		キャノン電子	200	1,812.00	362,400
		キャノン	10,000	3,410.00	34,100,000
		リコー	5,400	1,027.00	5,545,800
		東京エレクトロン	1,200	10,380.00	12,456,000
		トヨタ紡織	700	2,695.00	1,886,500
		ユニプレス	400	2,307.00	922,800
		豊田自動織機	1,700	5,700.00	9,690,000
		モリタホールディングス	400	1,616.00	646,400
		三櫻工業	200	779.00	155,800
		デンソー	4,500	5,166.00	23,247,000
		東海理化電機製作所	500	2,404.00	1,202,000
		三井造船	7,000	183.00	1,281,000
		川崎重工業	14,000	390.00	5,460,000
		名村造船所	600	820.00	492,000
		日本車輛製造	1,000	279.00	279,000
		ニチュ三菱フォークリフト	300	847.00	254,100
		日産自動車	22,200	1,156.00	25,663,200
		いすゞ自動車	5,400	1,503.00	8,116,200
		トヨタ自動車	22,800	7,156.00	163,156,800
		日野自動車	2,600	1,211.00	3,148,600
三菱自動車工業	6,800	655.00	4,454,000		
エフテック	100	1,372.00	137,200		
武蔵精密工業	200	3,075.00	615,000		
日産車体	900	1,158.00	1,042,200		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	新明和工業	1,000	1,022.00	1,022,000
		極東開発工業	300	1,576.00	472,800
		日信工業	400	1,855.00	742,000
		トピー工業	100	2,978.00	297,800
		ティラド	1,000	310.00	310,000
		曙ブレーキ工業	900	313.00	281,700
		タチエス	300	1,920.00	576,000
		N O K	900	2,452.00	2,206,800
		フタバ産業	600	727.00	436,200
		K Y B	2,000	540.00	1,080,000
		大同メタル工業	300	1,215.00	364,500
		プレス工業	900	544.00	489,600
		カルソニックカンセイ	1,000	1,766.00	1,766,000
		太平洋工業	400	1,462.00	584,800
		ケーヒン	400	2,007.00	802,800
		河西工業	200	1,391.00	278,200
		アイシン精機	1,700	5,150.00	8,755,000
		富士機工	200	474.00	94,800
		マツダ	5,800	2,016.00	11,692,800
		今仙電機製作所	200	1,060.00	212,000
		本田技研工業	16,500	3,526.00	58,179,000
		スズキ	3,600	4,082.00	14,695,200
		富士重工業	5,700	4,880.00	27,816,000
		ヤマハ発動機	2,600	2,781.00	7,230,600
		ショーワ	500	799.00	399,500
		T B K	200	494.00	98,800
		エクセディ	300	3,300.00	990,000
		豊田合成	600	2,734.00	1,640,400
		愛三工業	300	1,012.00	303,600
		ヨロズ	200	1,744.00	348,800
		エフ・シー・シー	300	2,190.00	657,000
		シマノ	700	18,390.00	12,873,000
		タカタ	400	610.00	244,000
		テイ・エス テック	500	3,135.00	1,567,500
		ジャムコ	100	2,484.00	248,400
		テルモ	2,800	4,180.00	11,704,000
		日機装	700	1,083.00	758,100
		島津製作所	2,000	1,773.00	3,546,000
		J M S	1,000	303.00	303,000
		長野計器	300	682.00	204,600
		東京計器	1,000	220.00	220,000
		東京精密	300	3,290.00	987,000
		マニー	300	2,765.00	829,500
		ニコン	3,300	1,761.00	5,811,300
		トプコン	900	1,762.00	1,585,800
		オリンパス	3,000	4,290.00	12,870,000
		理研計器	100	1,650.00	165,000
タムロン	200	2,058.00	411,600		
H O Y A	3,800	4,739.00	18,008,200		
ノーリツ鋼機	200	827.00	165,400		
エー・アンド・デイ	400	483.00	193,200		
シチズン時計	2,200	746.00	1,641,200		
リズム時計工業	1,000	180.00	180,000		
大研医器	100	817.00	81,700		
メニコン	100	3,040.00	304,000		
松風	100	1,348.00	134,800		
セイコーホールディングス	1,000	444.00	444,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	ニプロ	1,300	1,245.00	1,618,500
		パラマウントベッドホールディングス	200	4,405.00	881,000
		前田工織	200	1,238.00	247,600
		アートネイチャー	200	687.00	137,400
		バンダイナムコホールディングス	2,000	3,155.00	6,310,000
		共立印刷	1,300	320.00	416,000
		S H O E I	100	2,231.00	223,100
		フランスベッドホールディングス	300	911.00	273,300
		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	2,392.00	239,200
		トッパン・フォームズ	300	1,143.00	342,900
		フジシールインターナショナル	200	4,715.00	943,000
		タカラトミー	700	1,127.00	788,900
		アーク	1,700	123.00	209,100
		プロネクサス	200	1,057.00	211,400
		大建工業	100	2,023.00	202,300
		凸版印刷	5,000	1,120.00	5,600,000
		大日本印刷	5,000	1,150.00	5,750,000
		日本写真印刷	300	2,865.00	859,500
		宝印刷	300	1,563.00	468,900
		アシックス	1,800	2,457.00	4,422,600
		ツツミ	100	1,904.00	190,400
		小松ウオール工業	100	1,920.00	192,000
		ヤマハ	1,300	3,545.00	4,608,500
		河合楽器製作所	100	2,368.00	236,800
		クリナップ	300	949.00	284,700
		ピジョン	1,100	2,876.00	3,163,600
		リンテック	400	2,563.00	1,025,200
		イトーキ	400	823.00	329,200
		任天堂	1,100	27,575.00	30,332,500
		三菱鉛筆	200	6,440.00	1,288,000
		タカラスタンダード	400	1,960.00	784,000
		コクヨ	1,000	1,359.00	1,359,000
		グローブライド	100	2,049.00	204,900
		岡村製作所	600	1,026.00	615,600
		美津濃	1,000	577.00	577,000
		アデランス	300	621.00	186,300
		東京電力ホールディングス	15,500	527.00	8,168,500
		中部電力	6,100	1,741.50	10,623,150
		関西電力	7,600	1,334.00	10,138,400
		中国電力	2,500	1,453.00	3,632,500
		北陸電力	1,700	1,390.00	2,363,000
		東北電力	4,600	1,539.00	7,079,400
		四国電力	1,700	1,225.00	2,082,500
		九州電力	4,000	1,311.00	5,244,000
		北海道電力	1,700	969.00	1,647,300
		沖縄電力	300	2,619.00	785,700
		電源開発	1,500	2,893.00	4,339,500
		イーレックス	100	2,802.00	280,200
		東京瓦斯	20,000	538.20	10,764,000
		大阪瓦斯	18,000	457.80	8,240,400
		東邦瓦斯	5,000	960.00	4,800,000
		広島ガス	300	380.00	114,000
		西部瓦斯	2,000	255.00	510,000
		静岡ガス	700	824.00	576,800
		メタウォーター	100	2,852.00	285,200
S B Sホールディングス	200	887.00	177,400		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	東武鉄道	10,000	569.00	5,690,000
		相鉄ホールディングス	3,000	568.00	1,704,000
		東京急行電鉄	10,000	878.00	8,780,000
		京浜急行電鉄	5,000	1,304.00	6,520,000
		小田急電鉄	2,900	2,288.00	6,635,200
		京王電鉄	5,000	944.00	4,720,000
		京成電鉄	1,400	2,802.00	3,922,800
		富士急行	1,000	1,064.00	1,064,000
		新京成電鉄	1,000	411.00	411,000
		東日本旅客鉄道	3,600	10,065.00	36,234,000
		西日本旅客鉄道	1,800	7,151.00	12,871,800
		東海旅客鉄道	1,500	19,205.00	28,807,500
		西武ホールディングス	2,600	2,092.00	5,439,200
		鴻池運輸	200	1,624.00	324,800
		西日本鉄道	2,000	534.00	1,068,000
		ハマキョウレックス	100	2,174.00	217,400
		サカイ引越センター	100	2,545.00	254,500
		近鉄グループホールディングス	19,000	447.00	8,493,000
		阪急阪神ホールディングス	2,400	3,720.00	8,928,000
		南海電気鉄道	4,000	591.00	2,364,000
		京阪ホールディングス	4,000	769.00	3,076,000
		神戸電鉄	2,000	371.00	742,000
		名古屋鉄道	7,000	564.00	3,948,000
		山陽電気鉄道	1,000	584.00	584,000
		日本通運	7,000	603.00	4,221,000
		ヤマトホールディングス	3,300	2,358.00	7,781,400
		山九	3,000	714.00	2,142,000
		センコー	800	815.00	652,000
		ニッコンホールディングス	600	2,440.00	1,464,000
		日本石油輸送	200	2,431.00	486,200
		福山通運	1,000	683.00	683,000
		セイノーホールディングス	1,400	1,314.00	1,839,600
		日立物流	400	2,398.00	959,200
		丸和運輸機関	100	2,911.00	291,100
		C & F ロジホールディングス	200	1,386.00	277,200
		九州旅客鉄道	600	3,065.00	1,839,000
		日本郵船	16,000	241.00	3,856,000
		商船三井	10,000	341.00	3,410,000
		川崎汽船	7,000	283.00	1,981,000
		N S ユナイテッド海運	1,000	211.00	211,000
		飯野海運	800	477.00	381,600
		乾汽船	200	948.00	189,600
		日本航空	3,300	3,486.00	11,503,800
A N A ホールディングス	34,000	317.10	10,781,400		
トランコム	100	5,870.00	587,000		
日新	1,000	368.00	368,000		
三菱倉庫	1,000	1,676.00	1,676,000		
三井倉庫ホールディングス	1,000	359.00	359,000		
住友倉庫	1,000	631.00	631,000		
日本トランスシティ	1,000	426.00	426,000		
中央倉庫	100	1,072.00	107,200		
安田倉庫	200	767.00	153,400		
東洋埠頭	1,000	189.00	189,000		
上組	2,000	1,122.00	2,244,000		
キューソー流通システム	100	2,384.00	238,400		
郵船ロジスティクス	200	1,274.00	254,800		
近鉄エクスプレス	300	1,773.00	531,900		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	エーアイティー	100	1,062.00	106,200
		NEC ネットエスアイ	100	2,116.00	211,600
		システナ	200	1,643.00	328,600
		デジタルアーツ	100	2,545.00	254,500
		新日鉄住金ソリューションズ	300	2,122.00	636,600
		コア	100	1,167.00	116,700
		T I S	600	2,511.00	1,506,600
		グリー	1,100	612.00	673,200
		コーエーテクモホールディングス	400	1,960.00	784,000
		三菱総合研究所	100	3,270.00	327,000
		ファインデックス	100	888.00	88,800
		ヒト・コミュニケーションズ	100	1,537.00	153,700
		K L a b	400	649.00	259,600
		ネクソン	2,000	1,618.00	3,236,000
		アイスタイル	300	756.00	226,800
		エイチーム	100	2,143.00	214,300
		テクノスジャパン	200	1,187.00	237,400
		コロブラ	500	1,013.00	506,500
		ブロードリーフ	600	708.00	424,800
		ハーツユナイテッドグループ	100	1,526.00	152,600
		ブイキューブ	100	662.00	66,200
		ティーガイア	200	1,908.00	381,600
		テクマトリックス	100	1,984.00	198,400
		ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,900	252.00	982,800
		GMO ペイメントゲートウェイ	100	4,205.00	420,500
		インターネットイニシアティブ	300	1,705.00	511,500
		さくらインターネット	200	932.00	186,400
		S R A ホールディングス	100	2,451.00	245,100
		朝日ネット	700	491.00	343,700
		g u m i	200	836.00	167,200
		L I N E	300	4,030.00	1,209,000
		フェイス	100	1,233.00	123,300
		野村総合研究所	1,200	3,980.00	4,776,000
		サイバネットシステム	200	629.00	125,800
		インテージホールディングス	100	1,995.00	199,500
		ティー・ワイ・オー	600	151.00	90,600
		フジ・メディア・ホールディングス	1,900	1,666.00	3,165,400
		オービック	600	5,110.00	3,066,000
		ジャストシステム	400	1,068.00	427,200
		T D C ソフトウェアエンジニアリング	100	1,188.00	118,800
		ヤフー	13,100	444.00	5,816,400
		トレンドマイクロ	1,000	4,235.00	4,235,000
		日本オラクル	300	5,700.00	1,710,000
		フューチャー	200	734.00	146,800
		C A C H o l d i n g s	200	940.00	188,000
		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	5,040.00	504,000
		伊藤忠テクノソリューションズ	400	3,000.00	1,200,000
		アイティフォー	200	631.00	126,200
		大塚商会	500	5,670.00	2,835,000
		サイボウズ	200	455.00	91,000
		電通国際情報サービス	100	1,839.00	183,900
		デジタルガレージ	300	2,001.00	600,300
ウェザーニューズ	100	3,570.00	357,000		
C I J	800	529.00	423,200		
WOWOW	100	3,285.00	328,500		
スカラ	100	1,051.00	105,100		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	イマジカ・ロボット ホールディングス	100	666.00	66,600
		ネットワンシステムズ	800	752.00	601,600
		マーベラス	400	774.00	309,600
		エイベックス・グループ・ホールディングス	300	1,673.00	501,900
		日本ユニシス	600	1,454.00	872,400
		兼松エレクトロニクス	100	2,434.00	243,400
		東京放送ホールディングス	1,200	1,875.00	2,250,000
		日本テレビホールディングス	1,700	2,072.00	3,522,400
		テレビ朝日ホールディングス	500	2,243.00	1,121,500
		スカパー J S A Tホールディングス	1,200	551.00	661,200
		テレビ東京ホールディングス	200	2,313.00	462,600
		ワイヤレスゲート	100	1,698.00	169,800
		コネクシオ	100	1,474.00	147,400
		日本通信	1,700	181.00	307,700
		日本電信電話	14,700	4,895.00	71,956,500
		K D D I	18,000	3,090.00	55,620,000
		光通信	200	10,850.00	2,170,000
		N T T ドコモ	13,700	2,713.00	37,168,100
		エムティーアイ	400	750.00	300,000
		G M O インターネット	700	1,470.00	1,029,000
		カドカワ	500	1,596.00	798,000
		ゼンリン	200	1,912.00	382,400
		松竹	1,000	1,242.00	1,242,000
		東宝	1,200	3,225.00	3,870,000
		東映	1,000	952.00	952,000
		エヌ・ティ・ティ・データ	1,100	5,820.00	6,402,000
		D T S	100	2,552.00	255,200
		スクウェア・エニックス・ホールディングス	700	2,949.00	2,064,300
		シーイーシー	100	1,720.00	172,000
		カプコン	400	2,511.00	1,004,400
		ジャステック	300	1,073.00	321,900
		S C S K	500	4,050.00	2,025,000
		日本システムウエア	100	1,424.00	142,400
		アイネス	200	1,254.00	250,800
		T K C	200	3,105.00	621,000
		富士ソフト	300	2,783.00	834,900
		N S D	400	1,819.00	727,600
		コナミホールディングス	800	4,095.00	3,276,000
		福井コンピュータホールディングス	100	2,438.00	243,800
		ミロク情報サービス	100	1,767.00	176,700
		ソフトバンクグループ	8,200	7,848.00	64,353,600
		エレマテック	100	1,835.00	183,500
		J A L U X	100	1,912.00	191,200
		あらた	100	2,516.00	251,600
		トーマンデバイス	100	2,066.00	206,600
		フィールズ	100	1,468.00	146,800
		双日	11,000	298.00	3,278,000
		アルフレッサ ホールディングス	2,100	1,903.00	3,996,300
		横浜冷凍	400	1,038.00	415,200
		ラサ商事	100	620.00	62,000
		アルコニックス	100	1,795.00	179,500
		神戸物産	100	3,465.00	346,500
		あい ホールディングス	300	2,346.00	703,800
ディービーエックス	100	1,385.00	138,500		
ダイワボウホールディングス	2,000	294.00	588,000		
マクニカ・富士エレホールディングス	300	1,438.00	431,400		
バイタルケーエスケー・ホールディングス	300	970.00	291,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	八洲電機	400	601.00	240,400
		U K Cホールディングス	200	2,135.00	427,000
		T O K A Iホールディングス	900	766.00	689,400
		三洋貿易	100	1,588.00	158,800
		シップヘルスケアホールディングス	400	3,015.00	1,206,000
		コメダホールディングス	200	1,791.00	358,200
		小野建	200	1,398.00	279,600
		佐島電機	300	745.00	223,500
		コンドーテック	300	838.00	251,400
		中山福	200	814.00	162,800
		ナガイレーベン	300	2,472.00	741,600
		三菱食品	200	3,335.00	667,000
		松田産業	100	1,509.00	150,900
		第一興商	300	4,410.00	1,323,000
		メディパルホールディングス	1,800	1,780.00	3,204,000
		アズワン	100	5,080.00	508,000
		スズデン	100	1,015.00	101,500
		シモジマ	200	1,122.00	224,400
		ドウシシャ	200	2,067.00	413,400
		高速	300	1,088.00	326,400
		たけびし	300	1,155.00	346,500
		黒田電気	200	2,338.00	467,600
		丸文	300	704.00	211,200
		ハピネット	200	1,303.00	260,600
		日本ライフライン	200	2,332.00	466,400
		エクセル	100	1,493.00	149,300
		マルカキカイ	100	1,535.00	153,500
		I D O M	500	673.00	336,500
		日本エム・ディ・エム	200	820.00	164,000
		進和	200	1,727.00	345,400
		シークス	100	3,845.00	384,500
		オーハシテクニカ	100	1,406.00	140,600
		伊藤忠商事	13,300	1,606.00	21,359,800
		丸紅	17,800	672.10	11,963,380
		高島	1,000	194.00	194,000
		長瀬産業	1,100	1,524.00	1,676,400
		蝶理	100	1,760.00	176,000
		豊田通商	2,000	3,055.00	6,110,000
		兼松	4,000	203.00	812,000
		三井物産	16,500	1,688.00	27,852,000
		日本紙パルプ商事	1,000	372.00	372,000
		日立ハイテクノロジーズ	600	4,425.00	2,655,000
		カメイ	200	1,191.00	238,200
		スターゼン	100	4,810.00	481,000
		山善	700	990.00	693,000
		椿本興業	1,000	339.00	339,000
		住友商事	11,400	1,413.50	16,113,900
三菱商事	13,600	2,547.50	34,646,000		
キャノンマーケティングジャパン	600	1,933.00	1,159,800		
西華産業	1,000	346.00	346,000		
菱洋エレクトロ	200	1,416.00	283,200		
東京産業	300	494.00	148,200		
ユアサ商事	100	2,979.00	297,900		
阪和興業	2,000	777.00	1,554,000		
菱電商事	1,000	737.00	737,000		
フルサト工業	100	1,699.00	169,900		
岩谷産業	2,000	637.00	1,274,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	すてきなイスグループ	1,000	157.00	157,000
		イワキ	1,000	220.00	220,000
		三愛石油	500	858.00	429,000
		稲畑産業	400	1,274.00	509,600
		ワキタ	400	980.00	392,000
		東邦ホールディングス	600	2,383.00	1,429,800
		サンゲツ	600	2,052.00	1,231,200
		ミツウロコグループホールディングス	400	713.00	285,200
		伊藤忠エネクス	400	923.00	369,200
		サンリオ	600	2,265.00	1,359,000
		サンワテクノス	100	972.00	97,200
		リョーサン	300	3,500.00	1,050,000
		新光商事	200	1,236.00	247,200
		トーホー	100	2,524.00	252,400
		三信電気	200	1,104.00	220,800
		東陽テクニカ	100	1,005.00	100,500
		モスフードサービス	200	3,550.00	710,000
		加賀電子	200	1,897.00	379,400
		ソーダニッカ	600	514.00	308,400
		立花エレテック	200	1,318.00	263,600
		PALTA C	300	2,675.00	802,500
		日鉄住金物産	200	4,680.00	936,000
		トラスコ中山	200	4,945.00	989,000
		オートバックスセブン	700	1,764.00	1,234,800
		加藤産業	300	2,616.00	784,800
		イエローハット	100	2,389.00	238,900
		J Kホールディングス	400	595.00	238,000
		日伝	100	3,180.00	318,000
		因幡電機産業	300	4,035.00	1,210,500
		ミスミグループ本社	2,000	1,938.00	3,876,000
		スズケン	800	3,710.00	2,968,000
		ジェコス	100	1,033.00	103,300
		ルネサスイーストン	400	514.00	205,600
		ローソン	600	8,180.00	4,908,000
		サンエー	100	5,580.00	558,000
		カワチ薬品	200	2,855.00	571,000
		エービーシー・マート	300	6,380.00	1,914,000
		ハードオフコーポレーション	100	1,188.00	118,800
		アスクル	200	4,300.00	860,000
		ゲオホールディングス	400	1,380.00	552,000
		アダストリア	300	3,230.00	969,000
		くらコーポレーション	100	4,895.00	489,500
		キャンドウ	100	1,793.00	179,300
		パルグループホールディングス	100	2,870.00	287,000
		エディオン	600	1,128.00	676,800
		サーラコーポレーション	200	645.00	129,000
		ワッツ	100	1,088.00	108,800
		ハローズ	100	2,290.00	229,000
		ひらまつ	300	689.00	206,700
		ハニーズ	200	1,237.00	247,400
アルペン	100	2,295.00	229,500		
クオール	200	1,456.00	291,200		
ジェイアイエヌ	100	5,000.00	500,000		
ビックカメラ	1,000	1,122.00	1,122,000		
DCMホールディングス	1,000	1,020.00	1,020,000		
MonotaRO	600	2,398.00	1,438,800		
アークランドサービスホールディングス	100	2,890.00	289,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	J・フロント リテイリング	2,300	1,722.00	3,960,600
		ドトール・日レスホールディングス	300	2,171.00	651,300
		マツモトキヨシホールディングス	400	5,970.00	2,388,000
		ブロンコビリー	100	2,979.00	297,900
		スタートトゥデイ	1,700	1,889.00	3,211,300
		物語コーポレーション	200	4,215.00	843,000
		ココカラファイン	200	4,420.00	884,000
		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	6,740.00	1,348,000
		クリエイティブSDホールディングス	300	2,463.00	738,900
		丸善CHホールディングス	400	367.00	146,800
		ジョイフル本田	300	3,075.00	922,500
		鳥貴族	100	2,345.00	234,500
		ホットランド	100	1,224.00	122,400
		すかいらーく	800	1,612.00	1,289,600
		綿半ホールディングス	100	1,619.00	161,900
		ユニテッド・スーパーマーケット・ホール	800	975.00	780,000
		あさひ	200	1,330.00	266,000
		日本調剤	100	4,655.00	465,500
		コスモス薬品	100	20,710.00	2,071,000
		セブン&アイ・ホールディングス	7,600	4,514.00	34,306,400
		クリエイティブ・レストランツ・ホールディング	400	1,023.00	409,200
		ツルハホールディングス	400	11,270.00	4,508,000
		サンマルクホールディングス	100	3,520.00	352,000
		トリドールホールディングス	200	2,393.00	478,600
		クスリのアオキホールディングス	200	4,820.00	964,000
		総合メディカル	100	4,045.00	404,500
		ノジマ	200	1,299.00	259,800
		カップ・クリエイティブ	200	1,288.00	257,600
		ライトオン	200	1,090.00	218,000
		良品計画	200	22,390.00	4,478,000
		三城ホールディングス	500	453.00	226,500
		アドヴァン	200	1,179.00	235,800
		コナカ	500	594.00	297,000
		ハウス オブ ローゼ	300	1,507.00	452,100
		G-7ホールディングス	100	1,480.00	148,000
		コジマ	600	291.00	174,600
		コーナン商事	300	2,270.00	681,000
		ワタミ	200	1,090.00	218,000
		ドンキホーテホールディングス	1,200	4,320.00	5,184,000
		西松屋チェーン	300	1,488.00	446,400
		ゼンショーホールディングス	1,000	1,905.00	1,905,000
		幸楽苑ホールディングス	500	1,636.00	818,000
		サイゼリヤ	300	2,690.00	807,000
		V Tホールディングス	600	594.00	356,400
		魚力	100	1,268.00	126,800
		ユニテッドアローズ	200	3,295.00	659,000
		ハイデイ日高	200	2,636.00	527,200
		京都きもの友禅	100	937.00	93,700
		コロワイド	600	1,880.00	1,128,000
		ピーシーデポコーポレーション	300	602.00	180,600
		壱番屋	100	3,745.00	374,500
		スギホールディングス	400	5,530.00	2,212,000
スクロール	400	359.00	143,600		
ヨンドシーホールディングス	100	2,460.00	246,000		
ユニー・ファミリーマートホールディングス	800	7,540.00	6,032,000		
木曽路	200	2,350.00	470,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	サトレストランシステムズ	200	817.00	163,400
		千趣会	500	741.00	370,500
		日本瓦斯	300	3,470.00	1,041,000
		ベスト電器	1,100	160.00	176,000
		ロイヤルホールディングス	400	1,968.00	787,200
		いなげや	200	1,450.00	290,000
		島忠	500	3,095.00	1,547,500
		チヨダ	200	2,770.00	554,000
		ライフコーポレーション	100	3,360.00	336,000
		リンガーハット	200	2,157.00	431,400
		MrMax	200	422.00	84,400
		テンアライド	1,100	379.00	416,900
		AOKIホールディングス	400	1,419.00	567,600
		コメリ	300	2,758.00	827,400
		青山商事	400	4,050.00	1,620,000
		しまむら	200	13,800.00	2,760,000
		はせがわ	300	446.00	133,800
		高島屋	3,000	1,043.00	3,129,000
		松屋	400	1,107.00	442,800
		エイチ・ツー・オー リテイリング	1,000	1,882.00	1,882,000
		近鉄百貨店	1,000	355.00	355,000
		パルコ	200	1,036.00	207,200
		丸井グループ	1,900	1,793.00	3,406,700
		アクシアル リテイリング	200	3,960.00	792,000
		イオン	7,500	1,680.50	12,603,750
		イズミ	400	4,990.00	1,996,000
		東武ストア	100	2,835.00	283,500
		平和堂	400	2,517.00	1,006,800
		フジ	200	2,457.00	491,400
		ヤオコー	200	4,525.00	905,000
		ゼビオホールディングス	300	1,877.00	563,100
		ケーズホールディングス	800	2,134.00	1,707,200
		日産東京販売ホールディングス	700	335.00	234,500
		アインホールディングス	200	8,230.00	1,646,000
		元気寿司	100	2,096.00	209,600
		ヤマダ電機	6,100	630.00	3,843,000
		アークランドサカモト	300	1,412.00	423,600
		ニトリホールディングス	800	12,480.00	9,984,000
		吉野家ホールディングス	600	1,585.00	951,000
		松屋フーズ	100	3,875.00	387,500
		サガミチェーン	400	1,278.00	511,200
		関西スーパーマーケット	200	1,491.00	298,200
		王将フードサービス	100	4,235.00	423,500
		プレナス	200	2,277.00	455,400
		ミニストップ	100	1,971.00	197,100
		アークス	400	2,641.00	1,056,400
		パローホールディングス	400	2,963.00	1,185,200
		ベルク	100	4,455.00	445,500
		大庄	100	1,576.00	157,600
		ファーストリテイリング	300	43,000.00	12,900,000
サンドラッグ	300	8,090.00	2,427,000		
サックスパー ホールディングス	200	1,196.00	239,200		
ヤマザワ	100	1,740.00	174,000		
ベルーナ	500	658.00	329,000		
じもとホールディングス	1,700	202.00	343,400		
めぶきフィナンシャルグループ	9,000	447.00	4,023,000		
東京TYフィナンシャルグループ	300	4,270.00	1,281,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	九州フィナンシャルグループ	2,900	824.00	2,389,600
		ゆうちょ銀行	5,200	1,473.00	7,659,600
		富山第一銀行	400	557.00	222,800
		コンコルディア・フィナンシャルグループ	12,000	574.80	6,897,600
		西日本フィナンシャルホールディングス	1,200	1,163.00	1,395,600
		新生銀行	17,000	207.00	3,519,000
		あおぞら銀行	12,000	427.00	5,124,000
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	137,600	755.00	103,888,000
		りそなホールディングス	21,300	626.50	13,344,450
		三井住友トラスト・ホールディングス	3,800	4,469.00	16,982,200
		三井住友フィナンシャルグループ	14,500	4,692.00	68,034,000
		第四銀行	2,000	537.00	1,074,000
		北越銀行	200	2,699.00	539,800
		千葉銀行	7,000	750.00	5,250,000
		群馬銀行	4,100	663.00	2,718,300
		武蔵野銀行	300	3,405.00	1,021,500
		千葉興業銀行	400	608.00	243,200
		筑波銀行	700	363.00	254,100
		七十七銀行	3,000	603.00	1,809,000
		青森銀行	1,000	395.00	395,000
		秋田銀行	1,000	384.00	384,000
		山形銀行	1,000	496.00	496,000
		岩手銀行	100	4,840.00	484,000
		東邦銀行	2,000	448.00	896,000
		みちのく銀行	1,000	225.00	225,000
		ふくおかフィナンシャルグループ	8,000	554.00	4,432,000
		静岡銀行	5,000	1,006.00	5,030,000
		十六銀行	2,000	426.00	852,000
		スルガ銀行	1,900	2,714.00	5,156,600
		八十二銀行	3,500	711.00	2,488,500
		山梨中央銀行	1,000	583.00	583,000
		大垣共立銀行	2,000	465.00	930,000
		福井銀行	1,000	299.00	299,000
		北國銀行	2,000	417.00	834,000
		清水銀行	100	3,575.00	357,500
		滋賀銀行	2,000	653.00	1,306,000
		南都銀行	200	4,540.00	908,000
		百五銀行	1,000	488.00	488,000
		京都銀行	3,000	922.00	2,766,000
		紀陽銀行	700	1,912.00	1,338,400
		三重銀行	100	2,468.00	246,800
		ほくほくフィナンシャルグループ	1,200	2,099.00	2,518,800
		広島銀行	5,000	575.00	2,875,000
		山陰合同銀行	1,100	983.00	1,081,300
		中国銀行	1,200	1,725.00	2,070,000
		伊予銀行	2,000	815.00	1,630,000
		百十四銀行	2,000	401.00	802,000
		四国銀行	2,000	286.00	572,000
		阿波銀行	2,000	735.00	1,470,000
		大分銀行	1,000	442.00	442,000
		宮崎銀行	1,000	367.00	367,000
		佐賀銀行	1,000	296.00	296,000
		十八銀行	1,000	364.00	364,000
沖縄銀行	200	4,375.00	875,000		
琉球銀行	400	1,568.00	627,200		
セブン銀行	6,800	339.00	2,305,200		
みずほフィナンシャルグループ	246,100	219.50	54,018,950		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	高知銀行	1,000	138.00	138,000
		山口フィナンシャルグループ	2,000	1,296.00	2,592,000
		長野銀行	100	2,024.00	202,400
		名古屋銀行	100	4,285.00	428,500
		北洋銀行	3,100	501.00	1,553,100
		愛知銀行	100	6,910.00	691,000
		第三銀行	100	1,866.00	186,600
		中京銀行	100	2,385.00	238,500
		大光銀行	1,000	270.00	270,000
		愛媛銀行	300	1,420.00	426,000
		みなと銀行	200	2,063.00	412,600
		京葉銀行	1,000	528.00	528,000
		関西アーバン銀行	300	1,418.00	425,400
		栃木銀行	1,100	584.00	642,400
		東和銀行	3,000	114.00	342,000
		福島銀行	2,000	98.00	196,000
		大東銀行	1,000	168.00	168,000
		トモニホールディングス	1,500	634.00	951,000
		フィデアホールディングス	2,100	215.00	451,500
		池田泉州ホールディングス	2,000	552.00	1,104,000
		F P G	600	954.00	572,400
		S B Iホールディングス	2,000	1,538.00	3,076,000
		ジャフコ	300	3,995.00	1,198,500
		大和証券グループ本社	17,000	764.00	12,988,000
		野村ホールディングス	37,500	749.40	28,102,500
		岡三証券グループ	2,000	756.00	1,512,000
		丸三証券	600	1,041.00	624,600
		東洋証券	1,000	290.00	290,000
		東海東京フィナンシャル・ホールディングス	2,100	657.00	1,379,700
		水戸証券	800	362.00	289,600
		いちよし証券	400	947.00	378,800
		松井証券	900	1,016.00	914,400
		マネックスグループ	1,800	347.00	624,600
		カブドットコム証券	900	404.00	363,600
		極東証券	300	1,820.00	546,000
		岩井コスモホールディングス	200	1,136.00	227,200
		藍澤證券	200	691.00	138,200
		マネーパートナーズグループ	300	578.00	173,400
		かんぽ生命保険	700	2,579.00	1,805,300
		S O M P Oホールディングス	3,700	4,130.00	15,281,000
		アニコムホールディングス	100	2,384.00	238,400
		M S & A Dインシュアランスグループホール	5,400	3,790.00	20,466,000
		ソニーフィナンシャルホールディングス	1,700	1,898.00	3,226,600
		第一生命ホールディングス	10,900	2,030.50	22,132,450
		東京海上ホールディングス	7,300	5,261.00	38,405,300
		T & Dホールディングス	6,700	1,578.00	10,572,600
		全国保証	500	3,910.00	1,955,000
クレディセゾン	1,400	2,167.00	3,033,800		
芙蓉総合リース	200	5,690.00	1,138,000		
興銀リース	300	2,663.00	798,900		
東京センチュリー	400	4,010.00	1,604,000		
日本証券金融	800	653.00	522,400		
アイフル	3,000	359.00	1,077,000		
ポケットカード	200	555.00	111,000		
リコーリース	200	3,675.00	735,000		
イオンフィナンシャルサービス	1,200	2,127.00	2,552,400		
アコム	3,900	530.00	2,067,000		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	ジャックス	1,000	543.00	543,000
		オリエントコーポレーション	3,600	220.00	792,000
		日立キャピタル	400	2,935.00	1,174,000
		オリックス	12,900	1,856.00	23,942,400
		三菱UFJリース	4,600	600.00	2,760,000
		日本取引所グループ	5,700	1,786.00	10,180,200
		イー・ギャランティ	100	2,455.00	245,500
		アサックス	100	1,655.00	165,500
		いちご	1,800	441.00	793,800
		日本駐車場開発	2,400	170.00	408,000
		ヒューリック	3,800	1,053.00	4,001,400
		三栄建築設計	100	1,645.00	164,500
		野村不動産ホールディングス	1,200	1,965.00	2,358,000
		三重交通グループホールディングス	400	395.00	158,000
		サムティ	100	1,076.00	107,600
		日本商業開発	100	1,934.00	193,400
		プレサンスコーポレーション	300	1,472.00	441,600
		ユニゾホールディングス	200	3,250.00	650,000
		日本管理センター	200	1,322.00	264,400
		オープンハウス	300	2,767.00	830,100
		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	2,242.00	3,363,000
		パーク24	900	3,025.00	2,722,500
		三井不動産	10,000	2,768.50	27,685,000
		三菱地所	13,000	2,354.50	30,608,500
		平和不動産	300	1,636.00	490,800
		東京建物	2,200	1,525.00	3,355,000
		ダイビル	500	1,041.00	520,500
		住友不動産	4,000	3,160.00	12,640,000
		大京	3,000	246.00	738,000
		テーオーシー	700	921.00	644,700
		レオパレス21	2,300	609.00	1,400,700
		スターツコーポレーション	200	1,975.00	395,000
		フジ住宅	400	752.00	300,800
		空港施設	300	583.00	174,900
		住友不動産販売	200	2,851.00	570,200
		ゴールドクレスト	100	2,180.00	218,000
		タカラレーベン	800	674.00	539,200
		サンヨーハウジング名古屋	200	1,057.00	211,400
		イオンモール	1,200	1,707.00	2,048,400
		トーセイ	300	850.00	255,000
		エヌ・ティ・ティ都市開発	1,000	1,061.00	1,061,000
		サンフロンティア不動産	300	1,001.00	300,300
		日本空港ビルデング	600	4,300.00	2,580,000
		日本工営	1,000	538.00	538,000
		ネクスト	500	779.00	389,500
		ジェイエイシーリクルートメント	100	1,315.00	131,500
日本M&Aセンター	600	3,135.00	1,881,000		
アコーディア・ゴルフ	600	1,203.00	721,800		
タケエイ	100	921.00	92,100		
トラスト・テック	100	1,575.00	157,500		
コシダカホールディングス	500	1,979.00	989,500		
パソナグループ	200	785.00	157,000		
リンクアンドモチベーション	500	387.00	193,500		
GCA	300	939.00	281,700		
エス・エム・エス	300	2,566.00	769,800		
テンブホールディングス	1,500	1,735.00	2,602,500		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	リニカル	100	1,275.00	127,500
		クックパッド	400	1,132.00	452,800
		アイ・ケイ・ケイ	100	638.00	63,800
		スタジオアリス	100	2,255.00	225,500
		シミックホールディングス	100	1,502.00	150,200
		総合警備保障	700	4,525.00	3,167,500
		カカクコム	1,400	1,871.00	2,619,400
		ルネサンス	200	1,425.00	285,000
		ディップ	300	2,371.00	711,300
		新日本科学	200	588.00	117,600
		ツクイ	500	709.00	354,500
		エムスリー	1,700	2,830.00	4,811,000
		ツカダ・グローバルホールディング	200	728.00	145,600
		アウトソーシング	100	3,635.00	363,500
		ウェルネット	100	1,261.00	126,100
		ディー・エヌ・エー	900	3,065.00	2,758,500
		博報堂D Yホールディングス	2,800	1,387.00	3,883,600
		ぐるなび	300	2,298.00	689,400
		ファンコミュニケーションズ	500	740.00	370,000
		WDBホールディングス	100	1,198.00	119,800
		インフォマート	500	1,211.00	605,500
		J Pホールディングス	600	261.00	156,600
		E P Sホールディングス	300	1,357.00	407,100
		プレステージ・インターナショナル	300	738.00	221,400
		アミューズ	100	1,692.00	169,200
		ドリームインキュベータ	100	2,079.00	207,900
		クイック	200	1,009.00	201,800
		ケネディクス	2,600	435.00	1,131,000
		電通	2,100	5,460.00	11,466,000
		イオンファンタジー	100	3,010.00	301,000
		みらかホールディングス	500	5,120.00	2,560,000
		アルプス技研	100	2,522.00	252,200
		日本空調サービス	200	589.00	117,800
		オリエンタルランド	2,100	6,661.00	13,988,100
		ダスキン	500	2,318.00	1,159,000
		明光ネットワークジャパン	200	1,057.00	211,400
		ラウンドワン	600	765.00	459,000
		リゾートトラスト	700	2,195.00	1,536,500
		ビー・エム・エル	200	2,779.00	555,800
		りらいあコミュニケーションズ	400	1,097.00	438,800
		リソー教育	300	571.00	171,300
		ユー・エス・エス	2,400	1,819.00	4,365,600
		サイバーエージェント	1,000	2,675.00	2,675,000
		楽天	9,900	1,142.00	11,305,800
		セントラルスポーツ	100	2,778.00	277,800
		フルキャストホールディングス	200	913.00	182,600
		テクノプロ・ホールディングス	300	3,645.00	1,093,500
ジャパンマテリアル	100	3,515.00	351,500		
ベクトル	200	1,095.00	219,000		
I B J	200	626.00	125,200		
N・フィールド	100	1,365.00	136,500		
リクルートホールディングス	4,200	4,500.00	18,900,000		
日本郵政	4,800	1,559.00	7,483,200		
ベルシステム24ホールディングス	300	965.00	289,500		
リログループ	100	15,500.00	1,550,000		
東祥	100	5,050.00	505,000		
エイチ・アイ・エス	300	3,085.00	925,500		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	日本円	共立メンテナンス	200	6,690.00	1,338,000
		建設技術研究所	200	1,073.00	214,600
		スペース	300	1,299.00	389,700
		燦ホールディングス	100	1,570.00	157,000
		東京テアトル	1,000	190.00	190,000
		東京都競馬	2,000	289.00	578,000
		常磐興産	300	1,559.00	467,700
		カナモト	200	3,040.00	608,000
		東京ドーム	700	1,203.00	842,100
		西尾レントオール	100	3,365.00	336,500
		トランス・コスモス	200	2,704.00	540,800
		乃村工藝社	400	1,654.00	661,600
		藤田観光	1,000	351.00	351,000
		KNT - CTホールディングス	2,000	144.00	288,000
		日本管財	100	1,764.00	176,400
		トーカイ	100	4,000.00	400,000
		白洋舎	100	2,670.00	267,000
		セコム	2,000	8,466.00	16,932,000
		セントラル警備保障	100	2,078.00	207,800
		丹青社	300	829.00	248,700
		メイテック	300	4,145.00	1,243,500
		アサツー ディ・ケイ	300	2,910.00	873,000
		応用地質	300	1,400.00	420,000
		船井総研ホールディングス	300	1,790.00	537,000
		ベネッセホールディングス	600	3,280.00	1,968,000
		イオンディライト	200	3,220.00	644,000
		ニチイ学館	300	891.00	267,300
ダイセキ	300	2,302.00	690,600		
小計					4,140,699,540
		銘柄数：	1,449		
		組入時価比率：	96.9%		100.0%
合計					4,140,699,540

（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15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。

「PRU国内債券マザーファンド」の状況

なお、以下に掲載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(平成27年12月15日現在)	(平成28年12月15日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		53,614,050	68,006,460
国債証券		3,691,288,500	5,294,364,000
地方債証券		359,929,384	452,709,207
特殊債券		318,002,570	391,361,070
社債券		98,492,750	173,001,150
未収利息		16,238,726	21,277,530
前払費用		512,794	410,147
流動資産合計		4,538,078,774	6,401,129,564
資産合計		4,538,078,774	6,401,129,564
負債の部			
流動負債			
未払解約金		2,035,421	2,191,250
未払利息		-	186
流動負債合計		2,035,421	2,191,436
負債合計		2,035,421	2,191,436
純資産の部			
元本等			
元本	1	3,509,587,213	4,805,459,651
剰余金			
剰余金又は欠損金()		1,026,456,140	1,593,478,477
元本等合計		4,536,043,353	6,398,938,128
純資産合計		4,536,043,353	6,398,938,128
負債純資産合計		4,538,078,774	6,401,129,564

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

（平成27年12月15日現在）		（平成28年12月15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 3,295,751,500円 同期中における追加設定元本額 718,364,311円 同期中における解約元本額 504,528,598円 同期末における元本の内訳 PRU国内債券マーケット・パフォーマー 496,536,526円 PRUグッドライフ2020 12,341,785円 PRUグッドライフ2030 7,240,211円 PRUグッドライフ2040 13,204,790円 PRUグッドライフ2020（年金） 1,131,221,725円 PRUグッドライフ2030（年金） 1,162,731,077円 PRUグッドライフ2040（年金） 565,451,928円 PRUグッドライフ2050（年金） 19,905,353円 プルデンシャル私募国内株式・債券バランス ファンド（適格機関投資家向け） 9,661,792円 プルデンシャル私募国内債券マーケット・パ フォーマー（適格機関投資家向け） 91,292,026円 計 3,509,587,213円	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 3,509,587,213円 同期中における追加設定元本額 1,980,886,840円 同期中における解約元本額 685,014,402円 同期末における元本の内訳 PRU国内債券マーケット・パフォーマー 482,291,942円 PRUグッドライフ2020 12,045,357円 PRUグッドライフ2030 6,988,959円 PRUグッドライフ2040 10,876,196円 PRUグッドライフ2020（年金） 1,135,915,344円 PRUグッドライフ2030（年金） 1,164,603,406円 PRUグッドライフ2040（年金） 556,037,670円 PRUグッドライフ2050（年金） 19,673,418円 プルデンシャル私募国内株式・債券バランス ファンド（適格機関投資家向け） 8,392,523円 プルデンシャル私募国内債券マーケット・パ フォーマー（適格機関投資家向け） 1,408,634,836円 計 4,805,459,651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 3,509,587,213口		2 . 本報告書における開示対象ファンドの 期末における当該親投資信託の受益権の 総数 4,805,459,651口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日	自 平成27年12月16日 至 平成28年12月15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15日現在）	（平成28年12月15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 該当事項はありません。</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15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	10,927,850
地方債証券	500,967
特殊債券	108,070
社債券	93,950
合計	11,630,837

（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15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	49,585,850
地方債証券	1,791,997
特殊債券	1,732,920
社債券	370,800
合計	53,481,567

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

(平成27年12月15日現在)	(平成28年12月15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
1.2925円	1.3316円
(1万口当たり純資産額 12,925円)	(1万口当たり純資産額 13,316円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式（平成28年12月15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15日現在）

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額
国債証券	日本円	第360回利付国債（2年）		10,000,000	10,042,500
		第361回利付国債（2年）		10,000,000	10,044,100
		第362回利付国債（2年）		20,000,000	20,090,400
		第363回利付国債（2年）		30,000,000	30,143,100
		第364回利付国債（2年）		20,000,000	20,098,400
		第365回利付国債（2年）		20,000,000	20,098,400
		第366回利付国債（2年）		20,000,000	20,102,400
		第367回利付国債（2年）		30,000,000	30,161,700
		第109回利付国債（5年）		10,000,000	10,046,300
		第110回利付国債（5年）		15,000,000	15,107,100
		第111回利付国債（5年）		25,000,000	25,209,750
		第112回利付国債（5年）		20,000,000	20,191,200
		第113回利付国債（5年）		20,000,000	20,161,200
		第114回利付国債（5年）		45,000,000	45,415,800
		第115回利付国債（5年）		40,000,000	40,295,600
		第116回利付国債（5年）		40,000,000	40,317,600
		第117回利付国債（5年）		55,000,000	55,477,950
		第118回利付国債（5年）		65,000,000	65,612,300
		第119回利付国債（5年）		45,000,000	45,310,500
		第120回利付国債（5年）		60,000,000	60,597,000
		第121回利付国債（5年）		60,000,000	60,431,400
		第122回利付国債（5年）		50,000,000	50,369,000
		第123回利付国債（5年）		55,000,000	55,412,500
		第124回利付国債（5年）		55,000,000	55,415,250
		第125回利付国債（5年）		40,000,000	40,308,800
		第126回利付国債（5年）		55,000,000	55,441,650
		第127回利付国債（5年）		45,000,000	45,373,950
		第128回利付国債（5年）		45,000,000	45,375,750
		第129回利付国債（5年）		30,000,000	30,257,400
		第2回利付国債（40年）		10,000,000	14,208,100
		第3回利付国債（40年）		5,000,000	7,138,400
		第4回利付国債（40年）		15,000,000	21,573,450
		第5回利付国債（40年）		10,000,000	13,831,900
		第6回利付国債（40年）		15,000,000	20,380,950
		第7回利付国債（40年）		10,000,000	12,992,900
		第8回利付国債（40年）		20,000,000	24,078,600
		第9回利付国債（40年）		15,000,000	13,032,600
		第290回利付国債（10年）		10,000,000	10,208,700
		第291回利付国債（10年）		10,000,000	10,196,100
		第292回利付国債（10年）		10,000,000	10,246,300
第293回利付国債（10年）		10,000,000	10,305,800		
第294回利付国債（10年）		10,000,000	10,290,700		
第295回利付国債（10年）		10,000,000	10,259,800		
第296回利付国債（10年）		30,000,000	30,905,400		
第297回利付国債（10年）		20,000,000	20,641,200		
第298回利付国債（10年）		20,000,000	20,601,000		

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額
		第299回利付国債（10年）		20,000,000	20,668,400
		第300回利付国債（10年）		10,000,000	10,379,400
		第301回利付国債（10年）		40,000,000	41,672,800
		第302回利付国債（10年）		35,000,000	36,375,500
		第303回利付国債（10年）		30,000,000	31,289,700
		第304回利付国債（10年）		20,000,000	20,804,600
		第305回利付国債（10年）		30,000,000	31,307,100
		第306回利付国債（10年）		30,000,000	31,492,500
		第307回利付国債（10年）		35,000,000	36,627,150
		第308回利付国債（10年）		30,000,000	31,492,200
		第309回利付国債（10年）		50,000,000	52,135,500
		第310回利付国債（10年）		45,000,000	46,873,350
		第311回利付国債（10年）		40,000,000	41,364,000
		第312回利付国債（10年）		40,000,000	42,089,600
		第313回利付国債（10年）		50,000,000	52,975,500
		第314回利付国債（10年）		40,000,000	42,039,200
		第315回利付国債（10年）		30,000,000	31,734,600
		第316回利付国債（10年）		40,000,000	42,132,000
		第317回利付国債（10年）		30,000,000	31,689,000
		第318回利付国債（10年）		30,000,000	31,545,900
		第319回利付国債（10年）		30,000,000	31,761,900
		第320回利付国債（10年）		35,000,000	36,879,850
		第321回利付国債（10年）		25,000,000	26,402,250
		第322回利付国債（10年）		20,000,000	21,016,400
		第323回利付国債（10年）		20,000,000	21,059,600
		第324回利付国債（10年）		25,000,000	26,186,500
		第325回利付国債（10年）		25,000,000	26,233,500
		第326回利付国債（10年）		40,000,000	41,806,000
		第327回利付国債（10年）		50,000,000	52,558,500
		第328回利付国債（10年）		40,000,000	41,616,800
		第329回利付国債（10年）		40,000,000	42,190,000
		第330回利付国債（10年）		45,000,000	47,527,200
		第331回利付国債（10年）		40,000,000	41,705,200
		第332回利付国債（10年）		35,000,000	36,521,450
		第333回利付国債（10年）		40,000,000	41,724,400
		第334回利付国債（10年）		35,000,000	36,534,050
		第335回利付国債（10年）		35,000,000	36,300,250
		第336回利付国債（10年）		35,000,000	36,327,550
		第337回利付国債（10年）		40,000,000	40,878,400
		第338回利付国債（10年）		55,000,000	56,674,200
		第339回利付国債（10年）		35,000,000	36,082,550
		第340回利付国債（10年）		35,000,000	36,099,000
		第341回利付国債（10年）		40,000,000	40,914,400
		第342回利付国債（10年）		35,000,000	35,161,000
		第343回利付国債（10年）		50,000,000	50,212,500
		第344回利付国債（10年）		50,000,000	50,169,500
		第6回利付国債（30年）		10,000,000	12,999,000
		第8回利付国債（30年）		10,000,000	12,187,300
		第10回利付国債（30年）		5,000,000	5,550,950
		第13回利付国債（30年）		10,000,000	12,557,100
		第15回利付国債（30年）		5,000,000	6,695,500
		第17回利付国債（30年）		10,000,000	13,258,400
		第18回利付国債（30年）		5,000,000	6,548,900
		第19回利付国債（30年）		5,000,000	6,551,850
		第20回利付国債（30年）		5,000,000	6,737,650

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額
		第21回利付国債（30年）		5,000,000	6,561,800
		第22回利付国債（30年）		10,000,000	13,500,000
		第23回利付国債（30年）		5,000,000	6,758,850
		第25回利付国債（30年）		10,000,000	13,177,200
		第26回利付国債（30年）		10,000,000	13,382,900
		第27回利付国債（30年）		15,000,000	20,448,450
		第28回利付国債（30年）		15,000,000	20,545,350
		第29回利付国債（30年）		15,000,000	20,332,200
		第30回利付国債（30年）		20,000,000	26,805,200
		第31回利付国債（30年）		15,000,000	19,884,450
		第32回利付国債（30年）		20,000,000	27,047,400
		第33回利付国債（30年）		25,000,000	32,343,750
		第34回利付国債（30年）		20,000,000	26,859,400
		第35回利付国債（30年）		25,000,000	32,543,250
		第36回利付国債（30年）		20,000,000	26,111,000
		第37回利付国債（30年）		25,000,000	32,177,750
		第38回利付国債（30年）		20,000,000	25,327,600
		第39回利付国債（30年）		15,000,000	19,392,150
		第40回利付国債（30年）		10,000,000	12,693,200
		第41回利付国債（30年）		15,000,000	18,682,200
		第42回利付国債（30年）		10,000,000	12,473,900
		第43回利付国債（30年）		15,000,000	18,740,100
		第44回利付国債（30年）		15,000,000	18,769,200
		第45回利付国債（30年）		20,000,000	24,027,400
		第46回利付国債（30年）		20,000,000	24,057,200
		第47回利付国債（30年）		15,000,000	18,448,800
		第48回利付国債（30年）		20,000,000	23,605,200
		第49回利付国債（30年）		15,000,000	17,723,550
		第50回利付国債（30年）		25,000,000	25,606,750
		第51回利付国債（30年）		15,000,000	13,385,550
		第52回利付国債（30年）		10,000,000	9,449,300
		第46回利付国債（20年）		10,000,000	10,817,000
		第49回利付国債（20年）		10,000,000	10,935,300
		第55回利付国債（20年）		10,000,000	11,085,300
		第59回利付国債（20年）		10,000,000	11,056,900
		第60回利付国債（20年）		10,000,000	10,876,200
		第61回利付国債（20年）		10,000,000	10,664,900
		第62回利付国債（20年）		10,000,000	10,547,500
		第63回利付国債（20年）		10,000,000	11,199,300
		第66回利付国債（20年）		10,000,000	11,272,300
		第68回利付国債（20年）		10,000,000	11,582,200
		第70回利付国債（20年）		20,000,000	23,574,000
		第71回利付国債（20年）		10,000,000	11,637,200
		第72回利付国債（20年）		10,000,000	11,610,200
		第73回利付国債（20年）		10,000,000	11,577,300
		第75回利付国債（20年）		10,000,000	11,708,200
		第76回利付国債（20年）		5,000,000	5,771,750
		第78回利付国債（20年）		5,000,000	5,792,850
		第79回利付国債（20年）		10,000,000	11,670,500
		第80回利付国債（20年）		20,000,000	23,510,600
		第81回利付国債（20年）		15,000,000	17,572,050
		第82回利付国債（20年）		10,000,000	11,802,000
		第84回利付国債（20年）		20,000,000	23,516,400
		第85回利付国債（20年）		10,000,000	11,898,300
		第86回利付国債（20年）		10,000,000	12,082,600

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額
		第87回利付国債（20年）		10,000,000	11,990,400
		第88回利付国債（20年）		10,000,000	12,127,700
		第89回利付国債（20年）		10,000,000	12,033,100
		第90回利付国債（20年）		15,000,000	18,112,500
		第91回利付国債（20年）		5,000,000	6,086,000
		第92回利付国債（20年）		15,000,000	18,015,600
		第93回利付国債（20年）		10,000,000	11,945,700
		第94回利付国債（20年）		15,000,000	18,071,100
		第95回利付国債（20年）		10,000,000	12,292,600
		第96回利付国債（20年）		20,000,000	24,169,400
		第99回利付国債（20年）		10,000,000	12,156,700
		第100回利付国債（20年）		15,000,000	18,452,700
		第101回利付国債（20年）		10,000,000	12,523,700
		第102回利付国債（20年）		10,000,000	12,565,200
		第103回利付国債（20年）		5,000,000	6,225,950
		第104回利付国債（20年）		10,000,000	12,225,400
		第105回利付国債（20年）		10,000,000	12,259,200
		第106回利付国債（20年）		5,000,000	6,187,400
		第107回利付国債（20年）		10,000,000	12,284,600
		第108回利付国債（20年）		20,000,000	24,098,200
		第109回利付国債（20年）		10,000,000	12,075,900
		第110回利付国債（20年）		10,000,000	12,315,800
		第111回利付国債（20年）		10,000,000	12,469,700
		第112回利付国債（20年）		10,000,000	12,347,400
		第113回利付国債（20年）		25,000,000	30,926,250
		第114回利付国債（20年）		25,000,000	31,000,000
		第115回利付国債（20年）		15,000,000	18,789,900
		第116回利付国債（20年）		10,000,000	12,549,000
		第117回利付国債（20年）		20,000,000	24,840,600
		第118回利付国債（20年）		10,000,000	12,309,700
		第119回利付国債（20年）		10,000,000	12,047,900
		第120回利付国債（20年）		15,000,000	17,679,300
		第121回利付国債（20年）		10,000,000	12,193,800
		第122回利付国債（20年）		10,000,000	12,060,900
		第123回利付国債（20年）		20,000,000	24,988,800
		第124回利付国債（20年）		20,000,000	24,718,400
		第125回利付国債（20年）		5,000,000	6,328,450
		第126回利付国債（20年）		15,000,000	18,573,300
		第127回利付国債（20年）		10,000,000	12,236,500
		第128回利付国債（20年）		15,000,000	18,373,500
		第129回利付国債（20年）		10,000,000	12,109,700
		第130回利付国債（20年）		10,000,000	12,119,200
		第131回利付国債（20年）		10,000,000	11,977,900
		第132回利付国債（20年）		15,000,000	17,989,050
		第133回利付国債（20年）		20,000,000	24,272,000
		第134回利付国債（20年）		5,000,000	6,075,900
		第135回利付国債（20年）		5,000,000	6,003,200
		第136回利付国債（20年）		5,000,000	5,926,200
		第137回利付国債（20年）		15,000,000	18,017,100
		第138回利付国債（20年）		15,000,000	17,575,050
		第139回利付国債（20年）		10,000,000	11,864,100
		第140回利付国債（20年）		10,000,000	12,015,500
		第141回利付国債（20年）		20,000,000	24,055,000
		第142回利付国債（20年）		10,000,000	12,178,800
		第143回利付国債（20年）		10,000,000	11,876,200

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額
		第144回利付国債（20年）		15,000,000	17,584,500
		第145回利付国債（20年）		30,000,000	36,120,900
		第146回利付国債（20年）		30,000,000	36,151,800
		第147回利付国債（20年）		30,000,000	35,646,000
		第148回利付国債（20年）		30,000,000	35,154,600
		第149回利付国債（20年）		35,000,000	40,995,150
		第150回利付国債（20年）		35,000,000	40,399,800
		第151回利付国債（20年）		30,000,000	33,579,000
		第152回利付国債（20年）		25,000,000	27,949,750
		第153回利付国債（20年）		30,000,000	34,035,300
		第154回利付国債（20年）		25,000,000	27,904,750
		第155回利付国債（20年）		20,000,000	21,566,800
		第156回利付国債（20年）		20,000,000	19,359,800
		第157回利付国債（20年）		25,000,000	23,213,500
		第158回利付国債（20年）		40,000,000	39,258,800
	小計			4,810,000,000	5,294,364,000
		銘柄数：	226		
		組入時価比率：	82.7%		83.9%
地方債証 券	日本円	第650回東京都公募公債		10,000,000	10,141,200
		第715回東京都公募公債		20,000,000	20,851,000
		第733回東京都公募公債		10,000,000	10,347,300
		第153回神奈川県公募公債		20,000,000	20,465,200
		第10回大阪府公募公債（20年）		10,000,000	11,689,100
		第13回大阪府公募公債（20年）		10,000,000	10,825,800
		平成27年度第3回京都府公募公債		10,000,000	10,051,500
		平成27年度第13回京都府公募公債		10,000,000	9,958,800
		第5回兵庫県公募公債（15年）		10,000,000	11,067,200
		第9回兵庫県公募公債（15年）		10,000,000	10,734,300
		平成21年度第1回静岡県公募公債		12,000,000	12,460,800
		平成28年度第1回静岡県公募公債		10,000,000	9,926,800
		平成21年度第12回愛知県公募公債（10年）		10,000,000	10,396,600
		平成23年度第5回広島県公募公債		20,000,000	20,976,000
		平成25年度第10回千葉県公募公債		10,000,000	10,457,800
		平成25年度第1回新潟県公募公債		10,000,000	10,384,400
		平成26年度第1回大分県公募公債		10,000,000	10,319,000
		第85回共同発行市場公募地方債		20,000,000	20,959,600
		第149回共同発行市場公募地方債		10,000,000	10,304,900
		第153回共同発行市場公募地方債		10,000,000	10,284,200
		平成25年度第2回島根県公募公債		10,000,000	10,398,000
		平成21年度第2回熊本県公募公債（10年）		11,000,000	11,423,610
		平成27年度第1回奈良県公募公債		10,000,000	10,034,400
		平成20年度第1回浜松市公募公債		16,800,000	17,358,432
		平成24年度第1回静岡市公募公債		20,000,000	20,901,000
		第488回名古屋市公募公債（10年）		10,000,000	10,363,900
		平成23年度第4回京都市公募公債		10,000,000	10,517,100
		第12回横浜市公募公債（20年）		10,000,000	11,963,600
		平成20年度第4回横浜市公募公債		10,000,000	10,327,400
		平成22年度第2回北九州市公募公債		11,000,000	11,550,880
		平成23年度第9回福岡市公募公債		10,000,000	10,511,400
		平成26年度第2回広島市公募公債		12,000,000	12,310,920
		第4回さいたま市公募公債		11,500,000	11,505,865
		平成22年度第2回福井県公募公債		10,000,000	10,602,400
		平成27年度第1回岡山市公募公債（10年）		10,000,000	10,215,900
		第50回地方公共団体金融機構債券（20年）		10,000,000	9,605,400

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額
	小計	第51回地方公共団体金融機構債券		10,000,000	10,517,500
		銘柄数：	37	434,300,000	452,709,207
		組入時価比率：	7.1%		7.2%
特殊債券	日本円	第23回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債		10,000,000	10,419,200
		第26回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債		10,000,000	10,306,700
		第27回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債		20,000,000	20,087,000
		第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券		10,000,000	11,822,400
		第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券		10,000,000	12,085,200
		第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券		10,000,000	14,356,500
		第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		17,000,000	17,009,690
		第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		11,000,000	11,304,810
		第73回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		10,000,000	10,277,300
		第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券		10,000,000	11,958,800
		第92回日本高速道路保有・債務返済機構債券		10,000,000	10,431,000
		第146回日本高速道路保有・債務返済機構債券		10,000,000	10,154,400
		第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		10,000,000	10,468,700
		第172回日本高速道路保有・債務返済機構債券		10,000,000	9,143,400
		第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		10,000,000	10,430,200
		第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		10,000,000	10,404,100
		第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		10,000,000	10,489,900
		第263回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		10,000,000	10,249,800
		第37回政府保証地方公共団体金融機構債券		10,000,000	10,489,900
		第75回政府保証地方公共団体金融機構債券		10,000,000	10,296,700
		第80回政府保証地方公共団体金融機構債券		6,000,000	6,116,280
		第15回政府保証日本政策金融公庫債券		20,000,000	20,957,800
		第190回政府保証中小企業債券		13,000,000	13,024,830
		第19回都市再生債券		30,000,000	30,769,800
		第342回東京交通債券		10,000,000	11,200,300
		第3回一般担保住宅金融支援機構債券		10,000,000	12,021,700
		い第745号農林債		20,000,000	20,036,000
		い第784号農林債		10,000,000	10,077,100
		第8回政府保証東日本高速道路債券		14,000,000	14,182,560
		第16回政府保証東日本高速道路債券		10,000,000	10,297,100

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額
	小計	第36回中日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人）		10,000,000	10,491,900
		銘柄数： 組入時価比率：	31 6.1%	371,000,000	391,361,070 6.2%
社債券	日本円	第7回東日本旅客鉄道株式会社社債		20,000,000	20,461,400
		第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定）		5,000,000	5,558,850
		第9回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特）		10,000,000	10,905,700
		第547回東京電力株式会社社債（一般担保付）		10,000,000	10,552,100
		第548回東京電力株式会社社債（一般担保付）		10,000,000	11,264,300
		第563回東京電力株式会社社債（一般担保付）		10,000,000	10,340,300
		第495回関西電力株式会社社債（一般担保付）		10,000,000	10,216,100
		第497回関西電力株式会社社債（一般担保付）		10,000,000	10,474,100
		第381回中国電力株式会社社債（一般担保付）		10,000,000	10,444,000
		第471回東北電力株式会社社債（一般担保付）		10,000,000	10,568,300
		第473回東北電力株式会社社債（一般担保付）		10,000,000	10,142,500
		第371回九州電力株式会社社債（一般担保付）		10,000,000	10,649,000
		第427回九州電力株式会社社債（一般担保付）		10,000,000	10,447,100
		第316回北海道電力株式会社社債（一般担保付）		10,000,000	10,326,700
		第317回北海道電力株式会社社債（一般担保付）		10,000,000	10,539,400
		第9回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）		10,000,000	10,111,300
	小計	銘柄数： 組入時価比率：	16 2.7%	165,000,000	173,001,150 2.7%
	合計				6,311,435,427

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「PRU海外株式マザーファンド」の状況

なお、以下に掲載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(平成27年12月15日現在)	(平成28年12月15日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		124,067,413	83,760,184
コール・ローン		18,832,499	20,734,303
株式		3,391,756,753	4,669,682,564
投資証券		87,663,680	132,128,189
派生商品評価勘定		3,241,938	63,949
未収入金		5,251,360	21,158,993
未収配当金		5,851,632	7,644,356
未収利息		5	-
前払金		10,324,443	50,488,186
差入委託証拠金		21,791,886	9,105,097
流動資産合計		3,668,781,609	4,994,765,821
資産合計		3,668,781,609	4,994,765,821
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,329,091	996,357
未払解約金		289,607	9,278,394
未払利息		-	56
流動負債合計		1,618,698	10,274,807
負債合計		1,618,698	10,274,807
純資産の部			
元本等			
元本	1	1,812,572,746	2,288,700,415
剰余金			
剰余金又は欠損金()		1,854,590,165	2,695,790,599
元本等合計		3,667,162,911	4,984,491,014
純資産合計		3,667,162,911	4,984,491,014
負債純資産合計		3,668,781,609	4,994,765,821

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1．有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券 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等から提示される気配相場等に基づいて評価しております。
2．デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 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。 為替予約取引 原則としてわが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令133号）第60条及び第61条に基づき処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

（平成27年12月15日現在）		（平成28年12月15日現在）	
1	1．本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1	1．本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額
	2,196,559,110円		1,812,572,746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
	219,680,618円		948,811,139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
	603,666,982円		472,683,470円
	同期末における元本の内訳		同期末における元本の内訳
	PRU海外株式マーケット・パフォーマー		PRU海外株式マーケット・パフォーマー
	1,051,902,597円		950,781,610円
	PRUグッドライフ2020		PRUグッドライフ2020
	405,450円		352,989円
	PRUグッドライフ2030		PRUグッドライフ2030
	886,930円		872,421円
	PRUグッドライフ2040		PRUグッドライフ2040
	3,830,734円		3,294,823円
	PRUグッドライフ2020（年金）		PRUグッドライフ2020（年金）
	37,163,023円		33,280,074円
	PRUグッドライフ2030（年金）		PRUグッドライフ2030（年金）
	142,455,511円		144,801,491円
	PRUグッドライフ2040（年金）		PRUグッドライフ2040（年金）
	164,038,645円		168,463,101円
	PRUグッドライフ2050（年金）		PRUグッドライフ2050（年金）
	14,324,395円		15,040,650円
	プルデンシャル私募海外株式マーケット・パフォーマー（適格機関投資家向け）		プルデンシャル私募海外株式マーケット・パフォーマー（適格機関投資家向け）
	397,565,461円		971,813,256円
	計 1,812,572,746円		計 2,288,700,415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
	1,812,572,746口		2,288,700,415口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日	自 平成27年12月16日 至 平成28年12月15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15日現在）	（平成28年12月15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15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	144,146,573
投資証券	1,711,908
合計	145,858,481

（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15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	140,310,012
投資証券	3,691,856
合計	144,001,868

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

1．株式関連

（単位：円）

種類	（平成27年12月15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	183,482,108	-	185,394,955	1,912,847
合計	183,482,108	-	185,394,955	1,912,847

（単位：円）

種類	（平成28年12月15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	180,026,468	-	179,218,995	807,473
合計	180,026,468	-	179,218,995	807,473

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2．通貨関連

（平成27年12月15日現在）

該当事項はありません。

（単位：円）

種類	（平成28年12月15日現在）			
	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建 アメリカドル	8,000,000	-	8,124,935	124,935
合計	8,000,000	-	8,124,935	124,935

（注）１．時価の算定方法

為替予約の時価

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

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

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

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

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

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

２．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。

３．換算においては円未満の端数は切り捨てております。

（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15日現在）		（平成28年12月15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	
	2,0232円		2,1779円
（１万口当たり純資産額	20,232円）	（１万口当たり純資産額	21,779円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

(平成28年12月15日現在)

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	730	70.68	51,596.40
		ANTERO RESOURCES CORP	250	25.05	6,262.50
		APACHE CORP	514	65.74	33,790.36
		BAKER HUGHES INC	500	64.74	32,370.00
		CABOT OIL & GAS CORPORATION	600	22.80	13,680.00
		CHENIERE ENERGY INC	240	41.62	9,988.80
		CHEVRON CORP	2,500	115.96	289,900.00
		CIMAREX ENERGY CO	140	137.08	19,191.20
		CONCHO RRESOURCES INC	180	137.71	24,787.80
		CONOCOPHILLIPS	1,660	51.49	85,473.40
		CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	150	52.59	7,888.50
		CORE LABORATORIES N.V.	50	118.84	5,942.00
		DEVON ENERGY CORPORATION	590	47.02	27,741.80
		DIAMONDBACK ENERGY INC	50	101.51	5,075.50
		EOG RESOURCES INC	740	104.21	77,115.40
		EQT CORPORATION	240	68.60	16,464.00
		EXXON MOBIL CORPORATION	5,479	90.58	496,287.82
		FMC TECHNOLOGIES INC	350	34.99	12,246.50
		HALLIBURTON CO	1,170	53.51	62,606.70
		HELMERICH & PAYNE INC	120	81.27	9,752.40
		HESS CORP	380	63.17	24,004.60
		HOLLYFRONTIER CORP	200	31.61	6,322.00
		KINDER MORGAN INC	2,621	20.82	54,569.22
		MARATHON OIL CORP	1,150	18.20	20,930.00
		MARATHON PETROLEUM CORP	730	48.42	35,346.60
		MURPHY OIL CORPORATION	230	32.80	7,544.00
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	517	39.48	20,411.16
		NEWFIELD EXPLORATION CO	250	45.88	11,470.00
		NOBLE ENERGY INC	630	40.79	25,697.70
		OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	980	70.96	69,540.80
		ONEOK INC	300	57.36	17,208.00
		PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	100	35.98	3,598.00
		PHILLIPS 66	645	86.42	55,740.90
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	230	187.59	43,145.70
		PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	123	33.77	4,153.71
		RANGE RESOURCES CORPORATION	200	34.85	6,970.00
		SCHLUMBERGER LTD	1,796	85.16	152,947.36
		SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	500	10.92	5,460.00
		SPECTRA ENERGY CORP	909	40.63	36,932.67
		TARGA RESOURCES CORP	100	53.07	5,307.00
		TESORO CORP	150	89.65	13,447.50
		VALERO ENERGY CORP	626	66.49	41,622.74
		WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD	1,524	5.51	8,397.24
		WILLIAMS COMPANIES INC	990	29.22	28,927.80
		AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	280	148.18	41,490.40
		ALBEMARLE CORP	110	89.94	9,893.40
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	90	112.08	10,087.20		
AVERY DENNISON CORP	110	71.78	7,895.80		
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	210	25.89	5,436.90		
BALL CORP	153	74.98	11,471.94		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	アメリカドル	CELANESE CORPORATION	210	81.74	17,165.40
		CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	350	28.11	9,838.50
		CROWN HOLDINGS INC	170	52.92	8,996.40
		DOW CHEMICAL	1,500	57.66	86,490.00
		DU PONT (E.I.)DE NEMOURS	1,170	73.71	86,240.70
		EASTMAN CHEMICAL COMPANY	180	75.64	13,615.20
		ECOLAB INC	370	121.05	44,788.50
		FMC CORP	200	57.28	11,456.00
		FREEPORT-MCMORAN INC	1,632	14.65	23,908.80
		INTERNATIONAL PAPER CO	510	52.92	26,989.20
		INTL FLAVORS & FRAGRANCES	120	118.43	14,211.60
		LYONDELLBASELL INDU-CL A	490	88.09	43,164.10
		MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	70	221.81	15,526.70
		MONSANTO CO	606	104.32	63,217.92
		NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO.	760	31.68	24,076.80
		NUCOR CORP	420	63.04	26,476.80
		PACKAGING CORP OF AMERICA	90	86.16	7,754.40
		PPG INDUSTRIES INC	370	96.17	35,582.90
		PRAXAIR INC	390	122.58	47,806.20
		SEALED AIR CORP	300	47.79	14,337.00
		SHERWIN-WILLIAMS CO	110	266.49	29,313.90
		THE MOSAIC COMPANY PRODUCES & DISTRIB-WI	460	29.38	13,514.80
		VALSPAR CORP/THE	110	102.77	11,304.70
		VULCAN MATERIALS CO	180	124.72	22,449.60
		WESTROCK CO	297	51.47	15,286.59
		WR GRACE & CO	110	66.82	7,350.20
		3M CO	820	176.60	144,812.00
		ACUITY BRANDS INC	60	244.11	14,646.60
		AERCAP HOLDINGS NV	250	42.78	10,695.00
		AGCO CORPORATION	60	57.63	3,457.80
		ALCONIC INC	600	20.75	12,450.00
		AMETEK INC	330	49.82	16,440.60
		B/E AEROSPACE INC	100	59.28	5,928.00
		BOEING CO	820	154.47	126,665.40
		CATERPILLAR INC	780	93.74	73,117.20
		CUMMINS INC	230	138.86	31,937.80
		DEERE & CO	340	100.55	34,187.00
		DOVER CORP	220	75.64	16,640.80
		EATON CORP PLC	566	67.67	38,301.22
		EMERSON ELECTRIC CO	860	56.27	48,392.20
		FASTENAL CO	350	48.32	16,912.00
		FLOWSERVE CORPORATION	120	49.24	5,908.80
		FLUOR CORP (NEW)	160	55.77	8,923.20
		FORTIVE CORP	455	54.25	24,683.75
		FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	230	56.02	12,884.60
		GENERAL DYNAMICS CORP	350	173.74	60,809.00
		GENERAL ELECTRIC CO.	11,979	31.50	377,338.50
		GRAINGER (W.W.) INC	70	235.04	16,452.80
		HONEYWELL INTERNATIONAL INC	970	116.51	113,014.70
		HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	30	176.23	5,286.90
ILLINOIS TOOL WORKS	420	124.16	52,147.20		
INGERSOLL-RAND PLC	365	77.68	28,353.20		
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	150	59.95	8,992.50		
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	1,250	42.99	53,737.50		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	アメリカドル	L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	100	158.05	15,805.00
		LOCKHEED MARTIN CORPORATION	360	252.30	90,828.00
		MASCO CORP	450	32.50	14,625.00
		MIDDLEBY CORP	40	134.22	5,368.80
		NORTHROP GRUMMAN CORP	240	232.10	55,704.00
		PACCAR INC	455	65.71	29,898.05
		PARKER HANNIFIN CORP	190	140.20	26,638.00
		PENTAIR PLC-REGISTERED	185	57.73	10,680.05
		RAYTHEON COMPANY	410	142.84	58,564.40
		ROCKWELL COLLINS	150	93.10	13,965.00
		ROCKWELL INTL CORP	180	135.57	24,402.60
		ROPER TECHNOLOGIES INC	140	186.66	26,132.40
		SENSATA TECHNOLOGIES HOLDIN	200	39.69	7,938.00
		SMITH (A.O.) CORP	220	49.46	10,881.20
		SNAP-ON INC	90	171.60	15,444.00
		STANLEY BLACK & DECKER INC	209	118.20	24,703.80
		TEXTRON INC	390	48.18	18,790.20
		TRANSDIGM CROUP INC	60	250.79	15,047.40
		UNITED RENTALS INC	99	105.05	10,399.95
		UNITED TECHNOLOGIES CORP	1,070	109.27	116,918.90
		WABCO HOLDINGS INC	70	108.15	7,570.50
		WABTEC CORP	100	80.20	8,020.00
		XYLEM INC	260	50.57	13,148.20
		CINTAS CORP	90	119.53	10,757.70
		DUN&BRADSTREET CORP	60	121.66	7,299.60
		EQUIFAX INC	170	115.85	19,694.50
		IHS MARKIT LIMITED	320	34.49	11,036.80
		MANPOWER GROUP	70	90.55	6,338.50
		NIELSEN HOLDINGS PLC	506	43.12	21,818.72
		REPUBLIC SERVICES INC	340	56.51	19,213.40
		ROBERT HALF INTL INC	120	48.16	5,779.20
		STERICYCLE INC	110	75.43	8,297.30
		VERISK ANALYTICS INC	220	82.05	18,051.00
		WASTE CONNECTIONS INC	252	76.95	19,391.40
		WASTE MANAGEMENT INC	560	70.04	39,222.40
		AMERICAN AIRLINES GROUP INC	130	47.92	6,229.60
		C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	170	76.62	13,025.40
		CSX CORP	1,290	36.48	47,059.20
		DELTA AIR LINES INC	275	49.82	13,700.50
		EXPEDITORS INTL WASH INC	180	55.02	9,903.60
		FEDEX CORPORATION	340	197.92	67,292.80
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	7,000	0.44	3,080.00
		JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	90	98.61	8,874.90
		KANSAS CITY SOUTHERN	110	84.71	9,318.10
		MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	80	81.81	6,544.80
		NORFOLK SOUTHERN CORP	370	107.58	39,804.60
		SOUTHWEST AIRLINES	270	49.28	13,305.60
UNION PACIFIC CORP	1,100	102.82	113,102.00		
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	120	72.94	8,752.80		
UNITED PARCEL SERVICE	920	117.26	107,879.20		
AUTOLIV INC	120	108.42	13,010.40		
BORGWARNER INC	260	39.31	10,220.60		
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	350	68.80	24,080.00		
FORD MOTOR COMPANY	5,100	12.53	63,903.00		
GENERAL MOTORS CO	1,840	35.95	66,148.00		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	アメリカドル	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	400	32.44	12,976.00
		HARLEY-DAVIDSON INC	220	60.00	13,200.00
		LEAR CORP	110	134.06	14,746.60
		TESLA MOTORS INC	130	198.69	25,829.70
		COACH INC	330	37.74	12,454.20
		DR HORTON INC	500	28.48	14,240.00
		GARMIN LTD	120	48.89	5,866.80
		HANESBRANDS INC	520	22.46	11,679.20
		HARMAN INTERNATIONAL	80	109.89	8,791.20
		HASBRO INC	110	85.08	9,358.80
		LEGGETT & PLATT INC	150	49.79	7,468.50
		LENNAR CORP-CL A	200	44.00	8,800.00
		LULULEMON ATHLETICA INC	120	68.64	8,236.80
		MATTEL INC	430	29.65	12,749.50
		MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	190	47.30	8,987.00
		MOHAWK INDUSTRIES INC	80	199.64	15,971.20
		NEWELL BRANDS INC	605	46.64	28,217.20
		NIKE INC -CL B	1,780	51.79	92,186.20
		POLARIS INDUSTRIES INC	60	83.92	5,035.20
		POLO RALPH LAUREN CORPORATION	50	101.75	5,087.50
		PULTE GROUP INC	400	19.09	7,636.00
		PVH CORP	110	100.02	11,002.20
		TOLL BROTHERS INC	270	31.20	8,424.00
		UNDER ARMOUR INC-CLASS A	240	31.67	7,600.80
		UNDER ARMOUR INC-CLASS C	241	26.57	6,403.37
		VF CORP	460	54.91	25,258.60
		WHIRLPOOL CORP	110	175.99	19,358.90
		ARAMARK	350	36.29	12,701.50
		BLOCK H & R INC	300	22.89	6,867.00
		CARNIVAL CORP	510	52.41	26,729.10
		CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	40	375.70	15,028.00
		DARDEN RESTAURANTS INC	140	76.40	10,696.00
		DOMINO'S PIZZA INC	60	161.99	9,719.40
		HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	750	26.68	20,010.00
		LAS VEGAS SANDS CORP	580	57.71	33,471.80
		MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	409	83.94	34,331.46
		MCDONALD'S CORPORATION	1,180	122.84	144,951.20
		MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	200	17.31	3,462.00
		MGM RESORTS INTERNATIONAL	600	29.72	17,832.00
		NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	240	44.03	10,567.20
		ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	240	85.72	20,572.80
		STARBUCKS CORP	1,940	58.75	113,975.00
		WYNDHAM WORLDWIDE CORP	120	76.89	9,226.80
		WYNN RESORTS LTD	90	92.16	8,294.40
		YUM! BRANDS INC	490	63.88	31,301.20
		CBS CORP-CL B	525	63.64	33,411.00
		CHARTER COMMUNICATION-A	290	288.26	83,595.40
COMCAST CORP-CL A	3,142	70.02	220,002.84		
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	185	28.68	5,305.80		
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	295	27.74	8,183.30		
DISH NETWORK CORPORATION-A	330	59.70	19,701.00		
INTERPUBLIC GROUP COS INC	600	24.10	14,460.00		
LIBERTY GLOBAL PLC-A	362	30.05	10,878.10		
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	842	29.12	24,519.04		
LIBERTY LILAC GROUP-C	105	21.48	2,255.40		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	アメリカドル	LIBERTY SIRIUSXM GROUP	80	35.47	2,837.60
		LIBERTY SIRIUSXM GROUP C	270	34.67	9,360.90
		NEWS CORP NEW-CL A-W/I	431	11.88	5,120.28
		OMNICOM GROUP	310	87.89	27,245.90
		SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	70	71.54	5,007.80
		SIRIUS XM HOLDINGS INC	2,800	4.51	12,628.00
		TEGNA INC	300	22.17	6,651.00
		TIME WARNER INC	1,066	94.65	100,896.90
		TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	1,526	28.02	42,758.52
		TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	652	27.59	17,988.68
		VIACOM INC-CL B	505	34.60	17,473.00
		WALT DISNEY CO	2,005	104.05	208,620.25
		ADVANCE AUTO PARTS	100	171.51	17,151.00
		AMAZON.COM INC	535	768.82	411,318.70
		AUTONATION INC	140	47.50	6,650.00
		AUTOZONE INC	35	788.96	27,613.60
		BED BATH & BEYOND INC	180	46.95	8,451.00
		BEST BUY COMPANY INC	370	48.21	17,837.70
		CARMAX INC	258	61.42	15,846.36
		DICK'S SPORTING GOODS INC	100	57.87	5,787.00
		DOLLAR GENERAL CORP	350	75.89	26,561.50
		DOLLAR TREE INC	324	84.72	27,449.28
		EXPEDIA INC	167	116.39	19,437.13
		FOOT LOCKER INC	180	76.34	13,741.20
		GAP INC	300	25.39	7,617.00
		GENUINE PARTS CO	210	97.92	20,563.20
		HOME DEPOT INC	1,640	135.98	223,007.20
		KOHL'S CORP	220	55.51	12,212.20
		L BRANDS INC	320	72.20	23,104.00
		LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A	587	20.59	12,086.33
		LKQ CORP	400	32.40	12,960.00
		LOWE'S COMPANIES	1,120	73.56	82,387.20
		MACY'S INC	454	40.16	18,232.64
		NETFLIX INC	530	123.44	65,423.20
		NORDSTROM INC	140	57.02	7,982.80
		O'REILLY AUTOMOTIVE INC	120	276.83	33,219.60
		PRICELINE GROUP INC/THE	75	1,528.45	114,633.75
		ROSS STORES INC	540	67.44	36,417.60
		SIGNET JEWELERS LTD	70	94.97	6,647.90
		STAPLES INC	900	9.93	8,937.00
		TARGET CORP	760	77.19	58,664.40
		TIFFANY & CO	190	83.17	15,802.30
		TJX COMPANIES INC	860	77.30	66,478.00
		TRACTOR SUPPLY COMPANY	190	75.49	14,343.10
		TRIPADVISOR INC	130	47.62	6,190.60
		ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	70	252.93	17,705.10
		COSTCO WHOLESALE CORP	592	158.99	94,122.08
CVS HEALTH CORPORATION	1,393	78.96	109,991.28		
KROGER CO	1,200	34.72	41,664.00		
RITE AID CORP	1,300	8.34	10,842.00		
SYSCO CORP	650	55.51	36,081.50		
WAL-MART STORES INC	2,150	71.34	153,381.00		
WALGREEN CO	1,200	85.74	102,888.00		
WHOLE FOODS MARKET INC	460	31.21	14,356.60		
ALTRIA GROUP INC	2,590	65.94	170,784.60		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	アメリカドル	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	795	45.59	36,244.05
		BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	250	44.75	11,187.50
		BUNGE LIMITED	140	71.06	9,948.40
		CAMPBELL SOUP CO	300	59.10	17,730.00
		COCA-COLA COMPANY	5,440	41.21	224,182.40
		CONAGRA BRANDS INC	600	37.74	22,644.00
		CONSTELLATION BRANDS INC	240	155.59	37,341.60
		DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	254	89.75	22,796.50
		GENERAL MILLS INC	780	62.87	49,038.60
		HORMEL FOODS CORPORATION	410	34.33	14,075.30
		INGREDION INC	110	124.56	13,701.60
		JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	170	128.08	21,773.60
		KELLOGG CO	330	73.12	24,129.60
		KRAFT HEINZ COMPANY	792	84.36	66,813.12
		MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	160	92.09	14,734.40
		MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	200	72.85	14,570.00
		MOLSON COORS BREWING CO-B	260	98.80	25,688.00
		MONDELEZ INTERNATIONAL INC	2,048	42.83	87,715.84
		MONSTER BEVARAGE CORP	570	44.02	25,091.40
		PEPSICO INC	1,933	104.47	201,940.51
		PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,030	90.72	184,161.60
		REYNOLDS AMERICAN INC	1,094	55.31	60,509.14
		THE HERSHEY COMPANY	190	99.99	18,998.10
		TYSON FOODS INC	400	62.14	24,856.00
		WHITEWAVE FOODS CO	240	55.26	13,262.40
		CHURCH & DWIGHT CO INC	320	44.75	14,320.00
		CLOROX COMPANY	180	116.02	20,883.60
		COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	1,120	65.91	73,819.20
		COTY INC-CL A	200	18.62	3,724.00
		EDGEWELL PERSONAL CARE CO	50	76.08	3,804.00
		ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	300	77.96	23,388.00
		KIMBERLY-CLARK CORP	500	114.61	57,305.00
		PROCTER & GAMBLE CO	3,384	84.37	285,508.08
		SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	40	121.33	4,853.20
		ABBOTT LABORATORIES	1,970	38.82	76,475.40
		AETNA INC	484	126.66	61,303.44
		ALIGN TECHNOLOGY INC	50	98.60	4,930.00
		AMERISOURCEBERGEN CORP	240	77.05	18,492.00
		ANTHEM INC	360	144.69	52,088.40
		BARD C R INC	100	217.92	21,792.00
		BAXTER INTERNATIONAL INC	670	45.04	30,176.80
		BECTON DICKINSON & CO	288	167.75	48,312.00
		BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,821	21.21	38,623.41
		CARDINAL HEALTH INC	430	72.47	31,162.10
		CENTENE CORP	250	56.14	14,035.00
		CERNER CORP	440	48.01	21,124.40
		CIGNA CORP	350	133.24	46,634.00
		COOPER COS INC/THE	70	175.19	12,263.30
		DANAHER CORP	810	78.71	63,755.10
		DAVITA INC	180	63.80	11,484.00
DENTSPLY SIRONA INC	310	59.67	18,497.70		
DEXCOM INC	70	64.14	4,489.80		
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	300	89.82	26,946.00		
ENVISION HEALTHCARE CORP	90	66.00	5,940.00		
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	854	70.52	60,224.08		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	アメリカドル	HCA HOLDINGS INC	420	73.07	30,689.40
		HENRY SCHEIN INC	110	152.83	16,811.30
		HOLOGIC INC	338	40.79	13,787.02
		HUMANA INC	210	205.24	43,100.40
		IDEXX LABORATORIES INC	120	119.77	14,372.40
		INTUITIVE SURGICAL INC	45	636.59	28,646.55
		LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	140	127.35	17,829.00
		MCKESSON HBOC INC	300	143.37	43,011.00
		MEDNAX INC	100	65.39	6,539.00
		MEDTRONIC PLC	1,871	73.30	137,144.30
		PATTERSON COS INC	100	40.14	4,014.00
		QUEST DIAGNOSTICS INC	180	91.05	16,389.00
		RESMED INC	150	62.21	9,331.50
		ST JUDE MEDICAL INC	350	79.76	27,916.00
		STRYKER CORP	460	116.73	53,695.80
		TELEFLEX INC	20	156.62	3,132.40
		UNITEDHEALTH GROUP INC	1,290	159.86	206,219.40
		UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	120	101.55	12,186.00
		VARIAN MEDICAL SYSTEMS	90	90.81	8,172.90
		ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	270	104.87	28,314.90
		ABBVIE INC	2,170	61.67	133,823.90
		AGILENT TECHNOLOGIES INC	420	46.14	19,378.80
		ALEXION PHARMACEUTICALS INC	310	113.52	35,191.20
		ALKERMES PLC	200	55.03	11,006.00
		ALLERGAN PLC	522	192.40	100,432.80
		AMGEN INC	1,018	148.69	151,366.42
		BIOGEN INC	299	286.25	85,588.75
		BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	220	85.58	18,828.70
		BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,221	58.50	129,928.50
		CELGENE CORP	1,040	115.83	120,463.20
		ENDO INTERNATIONAL PLC	280	15.34	4,295.20
		GILEAD SCIENCES INC	1,780	75.71	134,763.80
		ILLUMINA INC	200	125.45	25,090.00
		INCYTE CORP	240	102.42	24,580.80
		JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	80	103.39	8,271.20
		JOHNSON & JOHNSON	3,633	114.99	417,758.67
		LILLY (ELI) & CO	1,300	67.67	87,971.00
		MALLINCKRODT PLC	140	52.72	7,380.80
		MERCK & CO. INC.	3,657	61.80	226,002.60
		METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	40	419.56	16,782.40
		MYLAN INC	600	37.69	22,614.00
		PERRIGO CO PLC	170	83.21	14,145.70
		PFIZER INC	8,022	32.82	263,282.04
		QUINTILES IMS HOLDINGS INC	168	79.39	13,337.52
		REGENERON PHARMACEUTICALS	100	381.50	38,150.00
		SEATTLE GENETICS INC	100	62.90	6,290.00
		TARO PHARMACEUTICAL INDUS	20	107.55	2,151.00
		TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	1,210	37.00	44,770.00
		THERMO ELECTRON CORP	530	143.80	76,214.00
		UNITED THERAPEUTICS CORP	60	138.09	8,285.40
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	290	78.33	22,715.70		
WATERS CORP	120	138.40	16,608.00		
ZOETIS INC	600	50.84	30,504.00		
BANK OF AMERICA CORP	13,591	22.67	308,107.97		
BB&T CORPORATION	1,100	46.78	51,458.00		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	アメリカドル	CIT GROUP INC	300	42.50	12,750.00
		CITIGROUP INC	3,933	59.45	233,816.85
		CITIZENS FINANCIAL GROUP	700	34.63	24,241.00
		COMERICA INC	240	67.53	16,207.20
		FIFTH THIRD BANCORP	1,100	26.91	29,601.00
		FIRST REPUBLIC BANK/CA	150	88.51	13,276.50
		HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,000	13.10	13,100.00
		JPMORGAN CHASE & CO	4,816	84.73	408,059.68
		KEYCORP	1,150	18.14	20,861.00
		M&T BANK CORP	200	152.86	30,572.00
		NEW YORK COMMUNITY BANCORP	600	16.86	10,116.00
		PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	400	19.18	7,672.00
		PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	650	114.20	74,230.00
		REGIONS FINANCIAL CORP	1,791	14.34	25,682.94
		SIGNATURE BANK	70	147.40	10,318.00
		SUNTRUST BANKS INC	690	55.13	38,039.70
		US BANCORP	2,300	51.73	118,979.00
		WELLS FARGO COMPANY	6,404	54.70	350,298.80
		AFFILIATED MANAGERS GROUP	80	154.82	12,385.60
		ALLY FINANCIAL INC	550	19.67	10,818.50
		AMERICAN EXPRESS COMPANY	1,014	74.07	75,106.98
		AMERIPRISE FINANCIAL INC	210	112.93	23,715.30
		BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1,418	48.07	68,163.26
		BERKSHIRE HATHAWAY INC	1,610	165.06	265,746.60
		BLACKROCK INC	158	390.00	61,620.00
		CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	658	88.95	58,529.10
		CME GROUP INC	430	121.61	52,292.30
		DISCOVER FINANCIAL SERVICES-W/I	540	71.23	38,464.20
		E*TRADE FINANCIAL CORP	400	34.92	13,968.00
		EATON VANCE CORP	200	41.56	8,312.00
		FRANKLIN RESOURCES INC	490	39.31	19,261.90
		GOLDMAN SACHS GROUP INC	490	239.93	117,565.70
		INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	810	58.37	47,279.70
		INVESCO LTD	538	31.52	16,957.76
		LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	450	23.52	10,584.00
		MOODY'S CORPORATION	220	97.45	21,439.00
		MORGAN ST DEAN WITTER & CO	1,990	42.86	85,291.40
		MSCI INC	100	79.85	7,985.00
		NASDAQ INC	150	68.26	10,239.00
		NAVIENT CORP	450	16.37	7,366.50
		NORTHERN TRUST CORP	280	88.50	24,780.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	200	71.87	14,374.00		
S&P GLOBAL INC	370	114.93	42,524.10		
SCHWAB (CHARELES) CORP	1,550	39.00	60,450.00		
SEI INVESTMENT COMPANY	200	49.11	9,822.00		
STATE STREET CORP	495	79.38	39,293.10		
SYNCHRONY FINANCIAL	1,107	35.94	39,785.58		
T ROWE PRICE GROUP INC	330	75.71	24,984.30		
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	380	43.27	16,442.60		
VOYA FINANCIAL INC	300	39.87	11,961.00		
AFLAC INC	550	69.72	38,346.00		
ALLEGHANY CORP	14	603.53	8,449.42		
ALLSTATE CORP	470	72.61	34,126.70		
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,430	66.01	94,394.30		
AON PLC	370	111.75	41,347.50		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	アメリカドル	ARCH CAPITAL GROUP LTD	130	86.45	11,238.50
		ARTHUR J GALLAGHER & CO	200	50.23	10,046.00
		ASSURANT INC	95	92.13	8,752.35
		AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	100	64.67	6,467.00
		CHUBB LIMITED	622	131.88	82,029.36
		CINCINNATI FINANCIAL CORP	210	77.15	16,201.50
		EVEREST RE GROUP LTD	60	216.65	12,999.00
		FNF GROUP	350	33.73	11,805.50
		HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	500	47.85	23,925.00
		LINCOLN NATIONAL CORP	269	66.23	17,815.87
		LOEWS CORP	350	47.23	16,530.50
		MARKEL CORP	15	875.18	13,127.70
		MARSH & MCLENNAN COS	670	68.54	45,921.80
		METLIFE INC	1,250	56.39	70,487.50
		PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC	400	58.72	23,488.00
		PROGRESSIVE CORP	780	35.09	27,370.20
		PRUDENTIAL FINANCIAL INC	550	103.99	57,194.50
		REINSURANCE GROUP OF AMERICA	40	127.22	5,088.80
		RENAISSANCEWE HOLDINGS LTD	60	131.40	7,884.00
		THE TRAVELERS COS INC	406	120.37	48,870.22
		TORCHMARK CORP	100	73.45	7,345.00
		UNUM GROUP	300	43.59	13,077.00
		WILLIS TOWERS WATSON PLC	182	122.26	22,251.32
		WR BERKLEY CORP	125	65.53	8,191.25
		XL GROUP LTD	400	36.42	14,568.00
		CBRE GROUP INC	450	31.82	14,319.00
		HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,600	6.25	10,000.00
		JONES LANG LASALLE INC	60	100.85	6,051.00
		ACCENTURE PLC-CL A	850	123.65	105,102.50
		ACTIVISION BLIZZARD INC	800	36.74	29,392.00
		ADOBE SYSTEMS INC	690	105.81	73,008.90
		AKAMAI TECHNOLOGIES	270	66.99	18,087.30
		ALLIANCE DATA SYSTEMS CORPORATION	75	229.99	17,249.25
		ALPHABET INC-CL A	390	817.89	318,977.10
		ALPHABET INC-CL C	410	797.07	326,798.70
		ANSYS INC	100	94.46	9,446.00
		AUTODESK INC	220	76.83	16,902.60
		AUTOMATIC DATA PROCESSING	610	97.69	59,590.90
		BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	130	64.93	8,440.90
		CADENCE DESIGN SYSTEM INC	400	25.66	10,264.00
		CDK GLOBAL INC	200	59.32	11,864.00
		CHECK POINT SOFTWARE TECH	180	84.92	15,285.60
		CITRIX SYSTEMS INC	220	90.45	19,899.00
		COGNIZANT TECH SOLUTIONS	810	56.34	45,635.40
		COMPUTER SCIENCES CORP	100	60.64	6,064.00
		COSTAR GROUP INC	40	193.02	7,720.80
		DELL TECHNOLOGIES -CL V	300	54.21	16,263.00
		EBAY INC	1,440	29.82	42,940.80
		ELECTRONIC ARTS INC	400	80.70	32,280.00
		FACEBOOK INC-A	3,110	120.21	373,853.10
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	400	75.92	30,368.00		
FIRST DATA CORP- CLASS A	300	14.21	4,263.00		
FISERV INC	310	106.03	32,869.30		
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	130	151.00	19,630.00		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	アメリカドル	FORTINET INC	250	29.72	7,430.00
		GARTNER INC	130	103.12	13,405.60
		GLOBAL PAYMENTS INC	150	71.46	10,719.00
		INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,220	168.51	205,582.20
		INTUIT INC	340	117.67	40,007.80
		MASTERCARD INC-CLASS A	1,300	103.28	134,264.00
		MERCADOLIBRE INC	40	157.74	6,309.60
		MICROSOFT CORP	9,860	62.68	618,024.80
		MOBILEYE NV	250	35.11	8,777.50
		NUANCE COMMUNICATIONS INC	300	15.33	4,599.00
		ORACLE CORPORATION	4,150	40.88	169,652.00
		PAYCHEX INC	460	60.48	27,820.80
		PAYPAL HOLDINGS INC	1,410	39.55	55,765.50
		RED HAT INC	260	79.08	20,560.80
		SABRE CORP	340	26.11	8,877.40
		SALESFORCE.COM INC	810	71.33	57,777.30
		SERVICENOW INC	220	78.95	17,369.00
		SPLUNK INC	120	55.33	6,639.60
		SYMANTEC CORP	900	24.84	22,356.00
		SYNOPSIS INC	210	59.96	12,591.60
		TOTAL SYSTEM SERVICES INC	248	49.40	12,251.20
		TWITTER INC	800	18.93	15,144.00
		VANTIV INC - CL A	230	57.77	13,287.10
		VERISIGN INC	110	79.12	8,703.20
		VISA INC	2,450	79.13	193,868.50
		VMWARC INC-CLASS A	100	80.92	8,092.00
		WESTERN UNION COMPANY-W/I	751	21.54	16,176.54
		WORKDAY INC-CLASS A	170	68.92	11,716.40
		XEROX CORP	1,080	9.00	9,720.00
		YAHOO! INC	1,190	40.91	48,682.90
		ZILLOW GROUP INC - C	170	36.69	6,237.30
		AMPHENOL CORP-CL A	420	67.76	28,459.20
		APPLE INC	7,145	115.19	823,032.55
		ARROW ELECTRONICS INC	110	71.92	7,911.20
		AVNET INC	180	47.70	8,586.00
		CDW CORP/DE	210	53.09	11,148.90
		CISCO SYSTEMS INC	6,800	30.46	207,128.00
		CORNING INC	1,500	24.34	36,510.00
		F5 NETWORKS INC	100	144.08	14,408.00
		FLEX LTD	772	14.53	11,217.16
		FLIR SYSTEMS INC	170	36.20	6,154.00
		HARRIS CORPORATION	150	105.15	15,772.50
		HEWLETT-PACKARD ENTERPRISE COMPANY	2,350	23.92	56,212.00
		HP INC	2,350	15.61	36,683.50
		JUNIPER NETWORKS INC	500	28.36	14,180.00
		MOTOROLA SOLUTIONS INC	208	82.90	17,243.20
		NETAPP INC	370	36.19	13,390.30
PALO ALTO NETWORKS INC	130	128.21	16,667.30		
SEAGATE TECHNOLOGY	400	40.20	16,080.00		
TE CONNECTIVITY LTD	445	70.62	31,425.90		
TRIMBLE INC	400	29.72	11,888.00		
WESTERN DIGITAL CORPORATION	332	67.17	22,300.44		
AT&T INC	8,259	41.10	339,444.90		
CENTURYLINK INC	794	23.87	18,952.78		
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	1,408	3.44	4,843.52		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	アメリカドル	LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	400	56.48	22,592.00
		SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	170	101.36	17,231.20
		SPRINT CORP-W/I	1,131	8.33	9,421.23
		T-MOBILE US INC	410	56.55	23,185.50
		VERIZON COMMUNICATIONS INC	5,460	51.63	281,899.80
		ZAYO GROUP HOLDINGS INC	200	32.96	6,592.00
		AES CORPORATION	900	11.94	10,746.00
		ALLIANT ENERGY CORPORATION	340	36.62	12,450.80
		AMEREN CORPORATION	330	50.70	16,731.00
		AMERICAN ELECTRIC POWER	650	61.70	40,105.00
		AMERICAN WATER WORKS CO INC	260	71.94	18,704.40
		ATMOS ENERGY CORP	100	72.41	7,241.00
		CALPINE CORP	400	11.36	4,544.00
		CENTERPOINT ENERGY INC	550	24.18	13,299.00
		CMS ENERGY CORP	400	40.82	16,328.00
		CONSOLIDATED EDISON INC	400	71.21	28,484.00
		DOMINION RESOURCES INC/VA	740	74.12	54,848.80
		DTE ENERGY COMPANY	230	96.91	22,289.30
		DUKE ENERGY CORP	922	75.53	69,638.66
		EDISON INTERNATIONAL	400	69.59	27,836.00
		ENTERGY CORP	200	71.67	14,334.00
		EVERSOURCE ENERGY	433	53.07	22,979.31
		EXELON CORPORATION	1,284	35.09	45,055.56
		FIRSTENERGY CORP	586	31.29	18,335.94
		NEXTERA ENERGY INC	620	116.03	71,938.60
		NISOURCE INC	500	21.66	10,830.00
		OGE ENERGY CORP	300	33.25	9,975.00
		P G & E CORPORATION	610	59.50	36,295.00
		PINNACLE WEST CAPITAL	150	75.97	11,395.50
		PPL CORPORATION	870	33.78	29,388.60
		PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	660	42.71	28,188.60
		SCANA CORP	190	72.67	13,807.30
		SEMPRA ENERGY	330	100.65	33,214.50
		SOUTHERN CO	1,270	48.48	61,569.60
		UGI CORP	240	44.12	10,588.80
		WESTAR ENERGY INC	220	57.26	12,597.20
		WISCONSIN ENERGY CORPORATION	412	56.91	23,446.92
		XCEL ENERGY INC	700	40.04	28,028.00
		ANALOG DEVICES	380	72.54	27,565.20
		APPLIED MATERIALS INC	1,500	32.14	48,210.00
		BROADCOM LIMITED	523	177.62	92,895.26
		INTEL CORP	6,350	36.55	232,092.50
		KLA-TENCOR CORPORATION	180	77.81	14,005.80
		LAM RESEARCH CORP	190	104.44	19,843.60
		LINEAR TECHNOLOGY CORP	350	62.29	21,801.50
		MARVELL TECHNOLOGY	510	14.26	7,272.60
		MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	380	38.64	14,683.20
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	300	65.05	19,515.00		
MICRON TECHNOLOGY INC	1,400	20.02	28,028.00		
NVIDIA CORP	690	96.45	66,550.50		
NXP SEMICONDUCTORS NV	350	97.83	34,240.50		
QORVO INC	130	53.59	6,966.70		
QUALCOMM INC	2,010	67.56	135,795.60		
SKYWORKS SOLUTIONS INC	270	75.14	20,287.80		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	アメリカドル 小計	TEXAS INSTRUMENTS INC	1,350	72.50	97,875.00
		XILINX INC	280	56.73	15,884.40
					26,325,350.13 (3,099,020,217)
		銘柄数:	600		
		組入時価比率:	62.2%		66.4%
	カナダドル	ALTAGAS LTD	240	33.86	8,126.40
		ARC RESOURCES LTD	438	23.47	10,279.86
		CAMECO CORP	736	13.39	9,855.04
		CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,486	44.77	66,528.22
		GENOVUS ENERGY INC	1,154	20.40	23,541.60
		CRESCENT POINT ENERGY CORP	700	18.38	12,866.00
		ENBRIDGE INC	1,272	55.45	70,532.40
		ENCANA CORP	1,204	16.27	19,589.08
		HUSKY ENERGY INC	398	16.18	6,439.64
		IMPERIAL OIL LTD	409	47.04	19,239.36
		INTER PIPELINE LTD	500	29.02	14,510.00
		KEYERA CORP	280	39.57	11,079.60
		PEMBINA PIPELINE CORP	500	41.50	20,750.00
		PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	200	33.74	6,748.00
		PRAIRIESKY ROYALTY LTD	271	32.40	8,780.40
		SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	230	30.43	6,998.90
		SUNCOR ENERGY INC	2,167	43.23	93,679.41
		TOURMALINE OIL CORP	300	35.89	10,767.00
		TRANSCANADA CORP	1,038	60.26	62,549.88
		VERESEN INC	400	12.18	4,872.00
		VERMILION ENERGY INC	180	57.57	10,362.60
		AGNICO EAGLE MINES	291	50.29	14,634.39
		AGRIUM INC	139	134.69	18,721.91
		BARRICK GOLD CORP	1,593	19.54	31,127.22
		CCL INDUSTRIES INC - CL B	40	228.03	9,121.20
		ELDORADO GOLD CORP	800	3.75	3,000.00
		FIRST QUANTUM MINERALS LTD	844	14.56	12,288.64
		FRANCO-NEVADA CORP	250	73.36	18,340.00
		GOLDCORP INC	1,173	16.46	19,307.58
		KINROSS GOLD CORP	1,500	4.25	6,375.00
		METHANEX CORP	100	59.26	5,926.00
		POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	1,194	24.39	29,121.66
		SILVER WHEATON CORP	600	24.81	14,886.00
		TECK RESOURCES LTD-CL B	800	28.25	22,600.00
		TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	1,250	4.49	5,612.50
		YAMANA GOLD INC	1,100	3.73	4,103.00
		YAMANA GOLD INC-RIGHTS	68	0.04	2.72
		BOMBARDIER INC 'B'	3,200	1.91	6,112.00
		CAE INC	350	18.74	6,559.00
		FINNING INTERNATIONAL INC	200	26.94	5,388.00
		SNC-LAVALIN GROUP INC	217	57.03	12,375.51
		CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,038	88.90	92,278.20
		CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	205	193.61	39,690.05
		LINAMAR CORP	50	59.06	2,953.00
		MAGNA INTERNATIONAL INC	498	59.19	29,476.62
		GILDAN ACTIVIWEAR	320	36.66	11,731.20
		RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	304	63.99	19,452.96
		SHAW COMMUNICATIONS INC-B	524	26.99	14,142.76
		CANADIAN TIRE CORP -CL A	104	141.95	14,762.80

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額		
株式	カナダドル	DOLLARAMA INC	130	100.21	13,027.30		
		ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	530	62.30	33,019.00		
		EMPIRE COMPANY LTD	350	18.70	6,545.00		
		JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	100	21.67	2,167.00		
		LOBLAW COMPANIES LTD	325	70.81	23,013.25		
		METRO INC	330	40.28	13,292.40		
		WESTON (GEORGE) LTD	65	113.15	7,354.75		
		SAPUTO INC	380	45.74	17,381.20		
		VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	440	18.79	8,267.60		
		BANK OF MONTREAL	858	96.15	82,496.70		
		BANK OF NOVA SCOTIA	1,619	76.59	123,999.21		
		CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	496	111.36	55,234.56		
		NATIONAL BANK OF CANADA	476	54.80	26,084.80		
		ROYAL BANK OF CANADA	1,982	90.67	179,707.94		
		TORONTO-DOMINION BANK	2,432	65.77	159,952.64		
		BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC- CLASS A	1,160	44.02	51,063.20		
		CI FINANCIAL CORP	350	28.92	10,122.00		
		ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	450	13.01	5,854.50		
		IGM FINANCIAL INC	127	38.73	4,918.71		
		ONEX CORPORATION	105	91.52	9,609.60		
		THOMSON REUTERS CORP	467	59.55	27,809.85		
		FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	30	598.28	17,948.40		
		GREAT-WEST LIFECO INC	390	35.60	13,884.00		
		INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FIN	180	54.77	9,858.60		
		INTACT FINANCIAL CORP	190	92.76	17,624.40		
		MANULIFE FINANCIAL CORP	2,700	24.37	65,799.00		
		POWER CORP OF CANADA	534	30.20	16,126.80		
		POWER FINANCIAL CORP	342	34.14	11,675.88		
		SUN LIFE FINANCIAL INC	798	51.24	40,889.52		
		FIRST CAPITAL REALTY INC	160	20.44	3,270.40		
		CGI GROUP INC	309	64.34	19,881.06		
		CONSTELLATION SOFTWARE INC	25	581.01	14,525.25		
		OPEN TEXT CORP	140	81.07	11,349.80		
		BLACKBERRY LIMITED	550	10.23	5,626.50		
		BCE INC	154	57.23	8,813.42		
		ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	470	51.74	24,317.80		
		TELUS CORP	300	42.52	12,756.00		
		ATCO LTD -CLASS I	130	43.49	5,653.70		
		CANADIAN UTILITIES LTD	130	35.88	4,664.40		
		FORTIS INC	480	40.79	19,579.20		
		HYDRO ONE LTD	200	23.30	4,660.00		
		小計					2,158,010.65 (190,746,561)
				銘柄数 :	90		
				組入時価比率 :	3.8%		4.1%
		株式	ユーロ	ENI SPA	3,518	14.88	52,347.84
				GALP ENERGIA SGPS SA-B SHARES	562	14.13	7,941.06
	KONINKLIJKE VOPAK NV			85	42.80	3,638.00	
NESTE OYJ	177			35.61	6,302.97		
OMV AG	173			32.47	5,617.31		
REPSOL SA	1,528			13.20	20,169.60		
SAIPEM SPA	5,073			0.47	2,409.67		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	ユーロ	SNAM SPA	3,389	3.74	12,688.41
		TECHNIP SA	130	66.66	8,665.80
		TENARIS SA	573	16.28	9,328.44
		TOTAL SA	2,978	47.11	140,293.58
		AIR LIQUIDE	473	103.85	49,121.05
		AKZO NOBEL	342	59.20	20,246.40
		ARCELORMITTAL	2,544	7.58	19,283.52
		ARKEMA	99	93.36	9,242.64
		BASF SE	1,233	85.82	105,816.06
		COVESTRO AG	111	64.20	7,126.20
		CRH PLC	1,138	31.85	36,250.99
		EVONIK INDUSTRIES AG	193	28.02	5,408.82
		FUCHS PETROLUB SE -PREF	80	38.40	3,072.40
		HEIDELBERGCEMENT AG	195	87.78	17,117.10
		IMERYS SA	43	71.48	3,073.64
		K+S AG	232	21.72	5,039.04
		KONINKLIJKE DSM NV	251	55.00	13,805.00
		LANXESS AG	111	61.01	6,772.11
		LINDE AG	247	157.40	38,877.80
		SOLVAY SA	102	111.55	11,378.10
		STORA ENSO OYJ-R SHS	819	9.68	7,932.01
		SYMRISE AG	153	56.86	8,699.58
		THYSSEN KRUPP AG	455	23.40	10,647.00
		UMICORE	116	53.55	6,211.80
		UPM-KYMMENE OYJ	738	22.16	16,354.08
		VOESTALPINE AG	135	37.38	5,046.30
		ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	238	29.70	7,068.60
		AIRBUS GROUP SE	768	62.40	47,923.20
		ALSTOM	186	26.10	4,854.60
		ANDRITZ AG	85	46.86	3,983.52
		BOUYGUES	246	33.39	8,213.94
		BRENNTAG AG	187	51.42	9,615.54
		CNH INDUSTRIAL NV	1,229	8.04	9,881.16
		COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	659	43.34	28,564.35
		EIFFAGE	69	64.09	4,422.21
		FERROVIAL SA	683	17.09	11,672.47
		GEA GROUP AG	253	37.80	9,564.66
		HOCHTIEF AG	30	133.00	3,990.00
		KONE OYJ	466	40.90	19,059.40
		KONINKLIJKE BOSKALIS WESTMINSTER NV	98	32.70	3,204.60
		KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,288	28.00	36,064.00
		LEGRAND SA	369	53.27	19,656.63
		LEONARDO-FINMECCANICA SPA	590	13.22	7,799.80
		MAN SE	44	94.40	4,153.60
		METSO OYJ	118	27.50	3,245.00
		OSRAM LICHT AG	121	47.59	5,758.99
PRYSMIAN SPA	291	24.08	7,007.28		
REXEL SA	366	15.64	5,726.07		
SAFRAN S.A.	433	67.39	29,179.87		
SCHNEIDER ELECTRIC SE	731	64.87	47,419.97		
SIEMENS AG	1,031	116.10	119,699.10		
THALES	156	89.62	13,980.72		
VINCI S.A.	645	63.34	40,854.30		
WARTSILA OYJ	210	42.29	8,880.90		
ZARDOYA OTIS SA	104	7.77	808.08		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	ユーロ	ZODIAC AEROSPACE	306	21.04	6,439.77
		BIC	44	125.05	5,502.20
		BUREAU VERITAS SA	366	18.30	6,699.63
		EDENRED	237	18.75	4,443.75
		RANDSTAD HOLDING	139	51.68	7,183.52
		RELX NV	1,376	15.50	21,334.88
		WOLTERS KLUWER-CVA	417	33.66	14,038.30
		ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	876	13.28	11,633.28
		AENA SA	87	130.90	11,388.30
		AEROPORTS DE PARIS	34	95.85	3,258.90
		ATLANTIA SPA	571	22.00	12,562.00
		BOLLORE	966	3.29	3,183.93
		DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	356	12.62	4,492.72
		DEUTSCHE POST AG	1,342	30.67	41,159.14
		FRAPORT AG	74	56.38	4,172.12
		GROUPE EUROTUNNEL SE	646	8.87	5,735.83
		INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	1,159	5.17	6,000.14
		BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	458	89.05	40,784.90
		BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	63	73.53	4,632.39
		CONTINENTAL AG	143	181.95	26,018.85
		DAIMLER AG-REG	1,282	69.05	88,522.10
		FERRARI NV	170	54.50	9,265.00
		FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	1,092	8.08	8,823.36
		MICHELIN (CGDE)-B	252	104.80	26,409.60
		NOKIAN RENKAAT OYJ	98	36.43	3,570.14
		PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	184	50.65	9,319.60
		PSA PEUGEOT CITROEN	576	15.50	8,930.88
		RENAULT SA	266	82.93	22,059.38
		SCHAEFFLER AG	202	13.28	2,683.57
		VALEO SA	330	54.82	18,090.60
		VOLKSWAGEN AG	52	136.80	7,113.60
		VOLKSWAGEN AG PFD	254	128.95	32,753.30
		ADIDAS AG	251	142.85	35,855.35
		CHRISTIAN DIOR	74	196.50	14,541.00
		HERMES INTERNATIONAL	35	389.95	13,648.25
		HUGO BOSS AG -ORD	100	57.50	5,750.00
		KERING	94	208.35	19,584.90
		LUXOTTICA GROUP SPA	244	51.35	12,529.40
		LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	369	176.50	65,128.50
		ACCOR SA	244	35.51	8,664.44
		PADDY POWER BETFAIR PLC	101	99.38	10,037.38
		SODEXO	134	105.90	14,190.60
		ALTICE NV-A	449	18.21	8,178.53
		ALTICE NV-B	100	18.24	1,824.50
		AXEL SPRINGER SE	45	44.69	2,011.05
		EUTELSAT COMMUNICATIONS	178	18.36	3,268.08
		JC DECAUX SA	80	27.08	2,166.40
		LAGARDERE S.C.A.	183	25.74	4,711.33
		PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	303	36.32	11,004.96
		PUBLICIS GROUPE	262	64.51	16,901.62
RTL GROUP	44	67.79	2,982.76		
SES	437	20.90	9,133.30		
TELENET GROUP HOLDING NV	90	51.29	4,616.10		
VIVENDI SA	1,366	18.08	24,697.28		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	ユーロ	INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA (INDITEX)	1,508	32.00	48,256.00
		ZALANDO SE	86	35.75	3,074.50
		CARREFOUR SA	766	23.09	17,686.94
		CASINO GUICHARD PERRACHON	94	46.47	4,368.18
		COLRUYT SA	93	45.12	4,196.16
		DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	729	4.56	3,327.15
		JERONIMO MARTINS	301	14.92	4,492.42
		KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,789	19.42	34,751.32
		METRO AG	216	31.27	6,754.32
		ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,010	97.99	98,969.90
		COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	284	30.16	8,566.86
		DANONE	757	61.58	46,616.06
		HEINEKEN HOLDING NV	123	66.39	8,165.97
		HEINEKEN NV	319	70.86	22,604.34
		KERRY GROUP PLC-A	219	64.80	14,191.20
		PERNOD-RICARD	290	101.10	29,319.00
		BEIERSDORF AG	139	79.54	11,056.06
		HENKEL AG & CO KGAA	131	98.35	12,883.85
		HENKEL AG & CO KGAA	250	112.10	28,025.00
		L'OREAL	332	168.25	55,859.00
		UNILEVER NV-CVA	2,189	38.17	83,565.07
		ESSILOR INTERNATIONAL	287	103.50	29,704.50
		FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	303	77.05	23,346.15
		FRESENIUS SE & CO KGAA	541	70.17	37,961.97
		BAYER AG	1,103	95.92	105,799.76
		EUROFINS SCIENTIFIC	10	401.70	4,017.00
		GRIFOLS SA	493	17.12	8,440.16
		MERCK KGAA	179	96.03	17,189.37
		ORION OYJ	147	41.01	6,028.47
		QIAGEN N.V.	268	26.64	7,139.52
		SANOFI	1,553	75.45	117,173.85
		UCB SA	175	56.85	9,948.75
		ABN AMRO GROUP NV-CVA	285	20.90	5,957.92
		BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	8,665	6.37	55,196.05
		BANCO DE SABADELL SA	6,067	1.36	8,263.25
		BANCO POPULAR ESPANOL	2,367	1.01	2,395.40
		BANCO SANTANDER SA	19,542	4.88	95,521.29
		BANK OF IRELAND	35,255	0.23	8,108.65
		BANKIA SA	6,155	0.97	5,970.35
		BANKINTER SA	818	7.47	6,111.27
		BNP PARIBAS	1,406	58.59	82,377.54
		CAIXABANK	3,557	3.12	11,122.73
		COMMERZBANK AG	1,448	7.62	11,042.44
		CREDIT AGRICOLE SA	1,460	11.54	16,848.40
		ERSTE GROUP BANK AG	457	27.75	12,684.03
		ING GROEP N.V.	5,122	13.38	68,557.97
		INTESA SANPAOLO	17,545	2.36	41,511.47
		KBC GROUPE	347	59.71	20,719.37
		MEDIOBANCA SPA	789	7.60	5,996.40
		NATIXIS	1,418	5.34	7,580.62
		RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	138	18.29	2,524.02
SOCIETE GENERALE-A	1,059	45.93	48,639.87		
UNICREDIT SPA	7,014	2.63	18,446.82		
DEUTSCHE BANK AG-REG	1,907	17.24	32,886.21		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	ユーロ	DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	267	77.15	20,599.05
		EURAZEO	48	53.27	2,556.96
		EXOR NV	171	40.45	6,916.95
		GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	95	79.33	7,536.35
		WENDEL	30	112.85	3,385.50
		AEGON NV	2,524	5.19	13,104.60
		AGEAS	245	37.07	9,083.37
		ALLIANZ SE-REG	609	155.05	94,425.45
		ASSICURAZIONI GENERALI	1,615	13.82	22,319.30
		AXA SA	2,556	23.67	60,500.52
		CNP ASSURANCES	283	17.80	5,037.40
		HANNOVER RUECK SE	80	103.65	8,292.00
		MAPFRE SA	1,099	3.04	3,347.55
		MUENCHENER RUECKVER AG-REG	209	176.10	36,804.90
		NN GROUP NV	438	31.75	13,906.50
		POSTE ITALIANE SPA	722	6.20	4,476.40
		SAMPO OYJ	555	43.26	24,009.30
		SCOR SE	198	31.37	6,212.25
		UNIPOLSAI SPA	700	2.02	1,414.00
		DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	467	28.83	13,463.61
		VONOVIA SE	644	30.17	19,429.48
		AMADEUS IT GROUP SA-A	607	42.38	25,724.66
		ATOS SE	110	95.00	10,450.00
		CAP GEMINI SA	226	76.50	17,289.00
		DASSAULT SYSTEMES SA	178	69.79	12,422.62
		GEMALTO NV	97	54.54	5,290.38
		SAP SE	1,318	80.40	105,967.20
		UNITED INTERNET AG	149	35.30	5,260.44
		INGENICO GROUP	76	73.55	5,589.80
		NOKIA	7,466	4.46	33,328.22
		DEUTSCHE TELEKOM REGD	4,295	15.86	68,118.70
		ELISA CORP-A SHARES	197	31.10	6,126.70
		ILIAD SA	34	176.50	6,001.00
		KONINKLIJKE KPN NV	4,724	2.75	13,009.89
		ORANGE S.A.	2,747	13.86	38,073.42
		PROXIMUS SA	187	26.85	5,021.88
		SFR GROUP SA	112	25.29	2,832.48
		TELECOM ITALIA SPA	13,737	0.76	10,501.93
		TELECOM ITALIA-RNC	4,980	0.62	3,124.95
		TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	1,028	3.97	4,082.18
		TELEFONICA S.A.	6,469	8.52	55,128.81
		E.ON SE	2,767	6.45	17,872.05
		ELECTRICITE DE FRANCE	260	11.20	2,913.30
ENAGAS	274	24.30	6,659.57		
ENDESA SA	439	20.19	8,865.60		
ENEL SPA	10,544	4.04	42,597.76		
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	3,189	2.85	9,104.59		
ENGIE	2,021	12.03	24,312.63		
FORTUM OYJ	539	14.83	7,993.37		
GAS NATURAL SDG SA	431	17.10	7,370.10		
IBERDROLA SA	7,462	5.93	44,316.81		
RED ELECTRICA CORPORATION SA	600	17.53	10,521.00		
RWE AG	613	11.39	6,982.07		
SUEZ	395	13.30	5,253.50		
TERNA SPA	2,347	4.21	9,885.56		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	ユーロ	VEOLIA ENVIRONNEMENT	623	15.60	9,718.80
		ASML HOLDING NV	479	98.00	46,942.00
		INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,484	15.76	23,387.84
		STMICROELECTRONICS NV	881	10.07	8,871.67
	小計				4,553,483.08 (562,173,021)
		銘柄数:	229		
		組入時価比率:	11.3%		12.0%
	イギリスポ ンド	BP PLC	24,914	4.81	119,836.34
		PETROFAC LIMITED	298	9.10	2,711.80
		ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	5,660	21.36	120,897.60
		ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	5,042	22.38	112,865.17
		ANGLO AMERICAN PLC	1,939	12.02	23,316.47
		ANTOFAGASTA PLC	431	7.21	3,107.51
		BILLITON PLC	2,734	13.55	37,059.37
		CRODA INTERNATIONAL PLC	190	31.25	5,937.50
		FRESNILLO PLC	268	11.80	3,162.40
		GLENORE PLC	15,788	2.79	44,135.35
		JOHNSON MATTHEY PLC	235	31.01	7,287.35
		MONDI PLC	511	15.50	7,920.50
		RANDGOLD RESOURCES LTD	129	59.40	7,662.60
		RIO TINTO PLC	1,623	31.67	51,408.52
		ASHTREAD GROUP PLC	696	16.09	11,198.64
		BAE SYSTEMS PLC	4,379	5.89	25,792.31
		BUNZL PLC	464	20.33	9,433.12
		COBHAM PLC	2,073	1.63	3,378.99
		DCC PLC	107	58.80	6,291.60
		IMI PLC	376	10.22	3,842.72
		MEGGITT PLC	1,205	4.74	5,720.13
		ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,543	6.70	17,038.10
		ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C ENTITLEMENT	116,978	0.00	116.97
		SMITHS GROUP PLC	570	14.11	8,042.70
		TRAVIS PERKINS PLC	407	14.22	5,787.54
		WEIR GROUP PLC	228	18.31	4,174.68
		WOLSELEY PLC	353	49.22	17,374.66
		BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	306	9.32	2,853.45
		CAPITA PLC	919	4.76	4,382.71
		EXPERIAN PLC	1,327	15.01	19,918.27
		G4S PLC	1,884	2.32	4,376.53
		INTERTEK GROUP PLC	198	33.41	6,615.18
		RELX PLC	1,365	13.79	18,823.35
		EASYJET PLC	182	9.80	1,784.51
		ROYAL MAIL PLC	1,037	4.47	4,639.53
		GKN PLC	2,078	3.19	6,637.13
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,156	4.54	5,254.02	
	BERKLEY GRP HOLDINGS	185	27.78	5,139.30	
	BURBERRY GROUP PLC	538	14.60	7,854.80	
	PERSIMMON PLC	455	16.88	7,680.40	
	TAYLOR WIMPEY PLC	3,666	1.52	5,575.98	
	CARNIVAL PLC	262	40.45	10,597.90	
	COMPASS GROUP PLC	2,129	13.78	29,337.62	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	227	34.48	7,826.96	
	MERLIN ENTERTAINMENT	1,104	4.30	4,756.03	
	TUI AG-DI	581	10.77	6,257.37	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	イギリスポ ンド	WHITBREAD PLC	252	35.69	8,993.88
		WILLIAM HILL PLC-W/I	1,385	2.90	4,027.58
		ITV PLC	5,018	1.95	9,790.11
		PEARSON PLC	1,136	8.08	9,178.88
		SKY PLC	1,428	9.83	14,044.38
		WPP PLC	1,670	17.75	29,642.50
		DIXONS CARPHONE PLC	1,188	3.42	4,070.08
		KINGFISHER PLC	3,154	3.42	10,789.83
		MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,858	3.49	6,493.71
		NEXT PLC	198	48.70	9,642.60
		MORRISON(WM) SUPERMARKETS	2,693	2.27	6,137.34
		SAINSBURY (J) PLC	1,862	2.49	4,643.82
		TESCO PLC	11,053	2.05	22,741.54
		ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	493	27.11	13,365.23
		BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,475	44.68	110,595.37
		COCA-COLA HBC AG-CDI	230	16.15	3,714.50
		DIAGEO PLC	3,378	20.57	69,485.46
		IMPERIAL BRANDS PLC	1,271	34.87	44,319.77
		TATE & LYLE PLC	645	6.81	4,395.67
		RECKITT BENCKISER GROUP PLC	849	66.74	56,662.26
		UNILEVER PLC	1,713	31.70	54,310.66
		MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	510	7.44	3,796.95
		SMITH & NEPHEW PLC	1,238	11.65	14,422.70
		ASTRAZENECA PLC	1,705	43.05	73,400.25
		GLAXOSMITHKLINE PLC	6,393	14.90	95,255.70
		HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	174	17.29	3,008.46
		SHIRE PLC	1,197	44.35	53,086.95
		BARCLAYS PLC	21,837	2.21	48,423.54
		HSBC HOLDINGS PLC	26,348	6.59	173,712.36
		LLOYDS BANKING GROUP PLC	84,859	0.62	53,257.50
		ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	4,823	2.17	10,485.20
		STANDARD CHARTERED PLC	4,533	6.82	30,951.32
		3I GROUP PLC	1,338	6.79	9,085.02
		ABERDEEN ASSET MGMT PLC	1,028	2.57	2,650.18
		HARGREAVES LANSDOWN PLC	361	12.27	4,429.47
		ICAP PLC	672	4.69	3,156.38
		INVESTEC PLC	750	5.37	4,031.25
		LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	434	27.19	11,800.46
		PROVIDENT FINANCIAL PLC	179	27.14	4,858.06
		SCHRODERS PLC	165	29.36	4,844.40
		ADMIRAL GROUP PLC	292	17.96	5,244.32
		AVIVA PLC	5,599	4.73	26,494.46
		DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	1,901	3.48	6,624.98
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	8,044	2.38	19,152.76		
OLD MUTUAL PLC	6,816	1.93	13,175.32		
PRUDENTIAL PLC	3,401	15.68	53,344.68		
RSA INSURANCE GROUP PLC	1,203	5.59	6,724.77		
ST JAMES'S PLACE PLC	626	10.10	6,322.60		
STANDARD LIFE PLC	2,724	3.60	9,822.74		
AUTO TRADER GROUP PLC	1,215	3.91	4,750.65		
SAGE GROUP PLC/THE	1,493	6.38	9,525.34		
WORLDPAY GROUP PLC	2,434	2.63	6,420.89		
BT GROUP PLC	11,157	3.63	40,572.43		
INMARSAT PLC	493	7.35	3,626.01		
VODAFONE GROUP PLC	35,591	1.98	70,790.49		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	
株式	イギリスポ ンド	CENTRICA PLC	7,503	2.18	16,424.06	
		NATIONAL GRID PLC	5,066	9.22	46,713.58	
		SEVERN TRENT PLC	287	21.81	6,259.47	
		SSE PLC	1,391	15.08	20,976.28	
		UNITED UTILITIES PLC	943	8.92	8,411.56	
	小計					2,308,890.39 (340,422,799)
			銘柄数 :	106		
			組入時価比率 :	6.8%		7.3%
	スイスフラ ン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	13	507.00	6,591.00	
		GIVAUDAN-REG	8	1,806.00	14,448.00	
		LAFARGEHOLCIM LTD-REG	629	52.80	33,211.20	
		SIKA AG	2	4,850.00	9,700.00	
		SYNGENTA AG-REGISTERED	116	406.50	47,154.00	
		ABB LTD	2,507	21.50	53,900.50	
		GEBERIT AG-REG	57	402.00	22,914.00	
		SCHINDLER HOLDING AG-REG	28	173.30	4,852.40	
		SCHINDLER HOLDING-PART CERT	68	175.90	11,961.20	
		ADECCO GROUP AG-REG	229	66.45	15,217.05	
		SGS SA	6	2,057.00	12,342.00	
		KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	90	134.60	12,114.00	
		CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-(REGD) A	718	66.95	48,070.10	
THE SWATCH GROUP AG-B		50	312.80	15,640.00		
THE SWATCH GROUP AG-REG		97	61.50	5,965.50		
DUFREY AG-REG		64	127.40	8,153.60		
ARYZTA AG		156	45.51	7,099.56		
LINDT & SPRUENGLI AG		1	5,170.00	5,170.00		
NESTLE SA-REGISTERED		4,127	72.35	298,588.45		
SONOVA HOLDING AG		82	119.70	9,815.40		
ACTELION LTD		132	189.30	24,987.60		
GALENICA AG-REG		4	1,110.00	4,440.00		
LONZA AG-REG		77	169.60	13,059.20		
NOVARTIS AG-REG SHS		2,998	72.20	216,455.60		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS		930	231.30	215,109.00		
CREDIT SUISSE GROUP-REG AG		2,571	15.30	39,336.30		
JULIUS BAER GROUP LTD		329	46.12	15,173.48		
PARGESA HOLDING SA		85	65.65	5,580.25		
PARTNERS GROUP HOLDING AG		17	475.00	8,075.00		
UBS GROUP AG		4,958	16.57	82,154.06		
BALOISE HOLDINGS AG		70	127.50	8,925.00		
SWISS LIFE HOLDING AG		51	287.60	14,667.60		
SWISS RE LTD		459	96.25	44,178.75		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	191	277.10	52,926.10			
SWISS PRIME SITE AG	117	81.95	9,588.15			
SWISSCOM AG-REG	36	448.40	16,142.40			
小計					1,413,706.45 (162,463,145)	
		銘柄数 :	36			
		組入時価比率 :	3.3%		3.5%	
スウェーデ ンクローネ	LUNDIN PETROLEUM AB	218	189.70	41,354.60		
	BOLIDEN AB	332	246.00	81,672.00		
	ALFA LAVAL AB	406	148.10	60,128.60		
	ASSA ABLOY AB-B	1,386	172.50	239,085.00		
	ATLAS COPCO AB-A SHS	835	282.60	235,971.00		
	ATLAS COPCO AB-B SHS	540	253.60	136,944.00		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	スウェーデン クローネ	SANDVIK AB	1,474	113.30	167,004.20
		SKANSKA AB-B SHS	401	215.70	86,495.70
		SKF AB-B SHS	461	169.50	78,139.50
		VOLVO AB-B SHS	2,132	108.00	230,256.00
		SECURITAS AB-B SHS	411	137.30	56,430.30
		ELECTROLUX AB-SER B	347	221.90	76,999.30
		HUSQVARNA AB-B SHS	616	69.30	42,688.80
		HENNES & MAURITZ	1,220	271.10	330,742.00
		ICA GRUPPEN AB	89	274.30	24,412.70
		SWEDISH MATCH AB	239	296.80	70,935.20
		SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	838	255.30	213,941.40
		GETINGE AB-B SHS	277	145.60	40,331.20
		NORDEA BANK AB	3,915	102.00	399,330.00
		SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	2,101	98.00	205,898.00
		SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	2,071	132.80	275,028.80
		SWEDBANK AB	1,129	223.90	252,783.10
		INDUSTRIVARDEN AB-C	161	167.30	26,935.30
		INVESTOR AB	630	337.50	212,625.00
		KINNEVIK AB-B SHS	349	225.30	78,629.70
		ERICSSON LM TEL, SEK1 SER B	4,208	53.35	224,496.80
HEXAGON AB-B SHS	357	327.10	116,774.70		
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	93	394.50	36,688.50		
TELE2 AB-B SHS	329	72.95	24,000.55		
TELIA CO AB	3,593	36.78	132,150.54		
小計					4,198,872.49 (53,115,736)
		銘柄数 :	30		
		組入時価比率 :	1.1%		1.1%
株式	ノルウェー クローネ	STATOIL ASA	1,543	155.50	239,936.50
		NORSK HYDRO ASA	1,957	41.30	80,824.10
		YARA INTERNATIONAL ASA	212	324.50	68,794.00
		SCHIBSTED ASA-B SHS	133	166.40	22,131.20
		SCHIBSTED ASA-CL A	92	178.10	16,385.20
		MARINE HARVEST	529	155.00	81,995.00
		ORKLA ASA	1,127	77.70	87,567.90
		DNB ASA	1,351	134.00	181,034.00
		GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	230	136.10	31,303.00
		TELENOR ASA	1,038	131.20	136,185.60
小計					946,156.50 (12,924,497)
		銘柄数 :	10		
		組入時価比率 :	0.3%		0.3%
株式	デンマーク クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	122	384.00	46,848.00
		NOVOZYMES A/S-B SHARES	323	234.50	75,743.50
		VESTAS WIND SYSTEMS A/S	310	414.10	128,371.00
		ISS A/S	208	237.80	49,462.40
		A P MOLLER - MAERSK A/S	7	11,250.00	78,750.00
		A P MOLLER - MAERSK A/S - A	4	10,640.00	42,560.00
		DSV AS	240	303.50	72,840.00
		PANDORA A/S	159	834.00	132,606.00
		CARLSBERG AS-B	148	602.00	89,096.00
		COLOPLAST-B	168	459.40	77,179.20
		WILLIAM DEMANT HOLDING	219	122.40	26,805.60
		GENMAB A/S	74	1,147.00	84,878.00
NOVO NORDISK A/S-B	2,516	248.20	624,471.20		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	デンマーク クローネ	DANSKE BANK A/S	976	215.10	209,937.60
		TRYG A/S	140	126.30	17,682.00
		TDC A/S	1,323	36.06	47,707.38
	小計				1,804,937.88 (29,961,968)
		銘柄数 :	16		
		組入時価比率 :	0.6%		0.6%
オーストラ リアドル		CATLEX AUSTRALIA LTD	385	30.33	11,677.05
		OIL SEARCH LTD	1,721	7.06	12,150.26
		ORIGIN ENERGY LIMITED	2,106	6.76	14,236.56
		SANTOS LIMITED	2,198	4.41	9,693.18
		WOODSIDE PETROLEUM LTD	1,025	31.88	32,677.00
		ALUMINA LIMITED	2,648	1.77	4,686.96
		AMCOR LIMITED	1,602	14.50	23,229.00
		BHP BILLITON LTD	4,268	25.80	110,114.40
		BORAL LIMITED	944	5.21	4,918.24
		FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	2,485	6.33	15,730.05
		INCITEC PIVOT LIMITED	2,122	3.35	7,108.70
		JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	551	21.34	11,758.34
		NEWCREST MINING LIMITED	1,060	18.54	19,652.40
		ORICA LIMITED	600	16.77	10,062.00
		RIO TINTO LIMITED	587	60.96	35,783.52
		SOUTH32 LTD	6,463	2.84	18,354.92
		CIMIC GROUP LTD	122	32.63	3,980.86
		BRAMBLES LIMITED	2,183	12.10	26,414.30
		SEEK LTD	363	14.61	5,303.43
		AURIZON HOLDINGS LTD	2,895	4.88	14,127.60
		QANTAS AIRWAYS LIMITED	1,000	3.32	3,320.00
		SYDNEY AIRPORT	1,326	6.43	8,526.18
		TRANSURBAN GROUP	2,815	10.30	28,994.50
		ARISTOCRAT LEISURE LIMITED	657	15.30	10,052.10
		CROWN RESORTS LTD	391	11.37	4,445.67
		DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	74	65.25	4,828.50
		TABCORP HOLDINGS LIMITED	914	4.61	4,213.54
		TATTS GROUP LTD	2,590	4.49	11,629.10
		REA GROUP LTD	70	53.18	3,722.60
		HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	300	4.88	1,464.00
		WESFARMERS LIMITED	1,473	41.60	61,276.80
		WOOLWORTHS LIMITED	1,758	22.96	40,363.68
		COCA-COLA AMATIL LIMITED	669	9.68	6,475.92
		TREASURY WINE ESTATES LTD	1,086	10.35	11,240.10
		COCHLEAR LTD	69	115.51	7,970.19
		HEALTHSCOPE LTD	2,106	2.30	4,843.80
		RAMSAY HEALTH CARE LTD	175	67.02	11,728.50
		SONIC HEALTHCARE LTD	543	21.61	11,734.23
		CSL LIMITED	605	96.80	58,564.00
		AUST AND NZ BANKING GROUP LT	3,893	29.89	116,361.77
		BANK OF QUEENSLAND LTD	620	11.47	7,111.40
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	507	12.26	6,215.82		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	2,288	81.18	185,739.84		
NATIONAL AUSTRALIA BANK & LTD	3,508	29.87	104,783.96		
WESTPAC BANKING CORPORATION	4,489	32.35	145,219.15		
AMP LIMITED	4,090	4.87	19,918.30		
ASX LIMITED	240	48.41	11,618.40		
CHALLENGER LTD	789	10.88	8,584.32		

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額		
株式	オーストラリアドル	MACQUARIE GROUP LIMITED	424	87.27	37,002.48		
		INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	3,362	5.84	19,634.08		
		MEDIBANK PRIVATE LTD	3,808	2.78	10,586.24		
		QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,896	12.10	22,941.60		
		SUNCORP GROUP LTD	1,779	13.36	23,767.44		
		LENLEASE GROUP	670	14.05	9,413.50		
		COMPUTERSHARE LIMITED	597	12.21	7,289.37		
		TELSTRA CORPORATION LTD	5,917	5.02	29,703.34		
		TPG TELECOM LTD	469	7.22	3,386.18		
		VOCUS COMMUNICATIONS LTD	549	3.99	2,190.51		
		AGL ENERGY LTD	933	21.52	20,078.16		
		APA GROUP	1,541	8.43	12,990.63		
		AUSNET SERVICES	2,455	1.52	3,743.87		
		DUET GROUP	3,210	2.79	8,955.90		
		小計				1,504,288.44 (131,173,951)	
				銘柄数 :	62		
				組入時価比率 :	2.6%		2.8%
株式	ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	960	10.41	9,993.60		
		AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,215	6.16	7,484.40		
		RYMAN HEALTHCARE LTD	455	8.30	3,776.50		
		SPARK NEW ZEALAND LIMITED	3,139	3.42	10,735.38		
		CONTACT ENERGY LTD	736	4.68	3,444.48		
		MERCURY NZ LTD	1,216	3.00	3,648.00		
		MERIDIAN ENERGY LTD	1,281	2.55	3,266.55		
		小計				42,348.91 (3,533,593)	
		銘柄数 :	7				
		組入時価比率 :	0.1%		0.1%		
株式	香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	3,536	91.35	323,013.60		
		NWS HOLDINGS LIMITED	2,000	12.80	25,600.00		
		CATHAY PACIFIC AIRWAYS	1,000	10.16	10,160.00		
		MTR CORPORATION	1,800	38.65	69,570.00		
		LI & FUNG LTD	6,600	3.71	24,486.00		
		TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,500	29.65	44,475.00		
		YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	1,000	29.30	29,300.00		
		GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	3,500	34.55	120,925.00		
		MGM CHINA HOLDINGS LTD	1,000	15.70	15,700.00		
		SANDS CHINA LTD	3,500	34.00	119,000.00		
		SHANGRI-LA ASIA LTD	2,200	8.49	18,678.00		
		SJM HOLDINGS LTD	2,000	6.25	12,500.00		
		WYNN MACAU LTD	2,500	12.76	31,900.00		
		WH GROUP LTD	8,000	6.58	52,640.00		
		BANK OF EAST ASIA	2,000	31.50	63,000.00		
		BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	5,500	28.50	156,750.00		
		HANG SENG BANK	700	147.00	102,900.00		
		FIRST PACIFIC CO	2,000	5.59	11,180.00		
		HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,600	190.00	304,000.00		
		AIA GROUP LTD	16,200	44.10	714,420.00		
		CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	3,436	51.50	176,954.00		
		HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,500	17.36	60,760.00		
		HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,177	41.90	49,316.30		
		HYSAN DEVELOPMENT CO	1,100	33.20	36,520.00		
KERRY PROPERTIES	800	21.90	17,520.00				
NEW WORLD DEVELOPMENT	7,074	8.57	60,624.18				

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額
株式	香港ドル	SINO LAND CO	3,860	11.94	46,088.40
		SUN HUNG KAI PROPERTIES	2,100	102.10	214,410.00
		SWIRE PACIFIC LTD 'A'	600	75.35	45,210.00
		SWIRE PROPERTIES LTD	1,600	22.10	35,360.00
		THE WHARF HOLDINGS	2,000	54.50	109,000.00
		WHEELOCK & CO LTD	1,000	45.10	45,100.00
		HKT TRUST AND HKD LTD	4,000	9.70	38,800.00
		PCCW LIMITED	5,000	4.46	22,300.00
		CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	1,000	64.30	64,300.00
		CLP HOLDINGS LIMITED	2,000	73.60	147,200.00
		HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	4,000	6.66	26,640.00
		HONG KONG & CHINA GAS	10,702	14.00	149,828.00
		POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,500	70.85	106,275.00
		ASM PACIFIC TECHNOLOGY	300	74.30	22,290.00
		小計			
		銘柄数 :	40		
		組入時価比率 :	1.1%		1.2%
株式	シンガポールドル	KEPPEL CORP	2,500	6.22	15,550.00
		SEBACORP INDUSTRIES LTD	1,000	2.94	2,940.00
		SINGAPORE TECH ENGINEERING	3,000	3.41	10,230.00
		YANGZIJIANG SHIPBUILDING	5,000	0.84	4,225.00
		COMFORTDELGRO CORP LTD	3,000	2.58	7,740.00
		SINGAPORE AIRLINES LTD	800	9.76	7,808.00
		GENTING SINGAPORE PLC	10,000	0.98	9,850.00
		SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	2,200	3.62	7,964.00
		JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9	41.10	369.90
		GOLDEN AGRI-RESOURCES LIMITED	12,000	0.43	5,160.00
		WILMAR INTERNATIONAL LIMITED	3,000	3.70	11,100.00
		DBS GROUP HLDG LTD	2,000	17.96	35,920.00
		OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	4,594	9.24	42,448.56
		UNITED OVERSEAS BANK	1,900	21.20	40,280.00
		SINGAPORE EXCHANGE	1,400	7.41	10,374.00
		CAPITALAND LIMITED	4,000	3.08	12,320.00
		CITY DEVELOPMENTS	800	8.38	6,704.00
		GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	5,000	2.22	11,100.00
		UOL GROUP LTD	800	6.27	5,016.00
		SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	11,020	3.76	41,435.20
STARHUB LTD	1,000	2.90	2,900.00		
小計				291,434.66 (23,807,297)	
		銘柄数 :	21		
		組入時価比率 :	0.5%		0.5%
株式	イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	500	15.62	7,810.00
		BANK HAPOLIM BM	1,300	22.44	29,172.00
		BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,700	15.66	26,622.00
		MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	250	52.60	13,150.00
		AZRIELI GROUP	80	170.70	13,656.00
		NICE LTD	70	252.50	17,675.00
		BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	2,500	6.70	16,750.00
		小計			
		銘柄数 :	7		
		組入時価比率 :	0.1%		0.1%
合計				4,669,682,564 (4,669,682,564)	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

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

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

株式以外の有価証券

（平成28年12月15日現在）

種類	通貨	銘柄	銘柄数比率	口数	評価額
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION		450	8,050.50
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		100	10,687.00
		AMERICAN TOWER CORP		560	59,640.00
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC		1,300	13,130.00
		AVALONBAY COMMUNITIES INC		187	31,795.61
		BOSTON PROPERTIES INC		210	26,275.20
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		280	6,700.40
		CAMDEN PROPERTY TRUST		100	7,981.00
		CROWN CASTLE INTL CORP		430	37,070.30
		DIGITAL REALTY TRUST INC		210	19,851.30
		DUKE REALTY CORP		500	12,920.00
		EQUINIX INC		82	29,076.38
		EQUITY RESIDENTIAL PROPS TR		440	27,627.60
		ESSEX PROPERTY TRUST INC		80	17,581.60
		EXTRA SPACE STORAGE INC		130	9,543.30
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST		100	13,861.00
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC		817	21,127.62
		HCP INC		650	18,856.50
		HOST HOTELS & RESORTS INC		996	18,794.52
		IRON MOUNTAIN INCORPORATED		363	11,695.86
		iShares Core S&P 500 ETF		450	102,294.00
		KIMCO REALTY CORP		550	13,986.50
		LIBERTY PROPERTY TRUST		200	7,688.00
		MACERICH CO		150	10,386.00
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC		130	12,311.00
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES		100	4,207.00
		PROLOGIS INC		687	35,559.12
		PUBLIC STORAGE		200	43,040.00
		REALTY INCOME CORPORATION		340	18,581.00
		REGENCY CENTERS CORPORATION		140	9,377.20
		SIMON PROPERTY GROUP INC		406	73,599.68
		SL GREEN REALTY CORP		140	15,491.00
		UDR INC		400	13,716.00
		VENTAS INC		440	26,923.60
		VEREIT INC		1,079	8,923.33
		VORNADO REALTY TRUST		236	24,133.36
		WELLTOWER INC		450	29,020.50
		WEYERHAEUSER CO		970	30,390.10
	小計				15,053
		銘柄数：	38		
		組入時価比率：	2.1%		78.6%
	カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		200	4,302.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		254	6,637.02
		小計		454	10,939.02 (966,899)
		銘柄数：	2		
		組入時価比率：	0.0%		0.7%
	ユーロ	FONCIERE DES REGIONS		40	3,208.00
		GECINA SA		55	7,023.50
		ICADE		65	4,316.00

種類	通貨	銘柄	銘柄数比率	口数	評価額
	小計	KLEPIERRE UNIBAIL-RODAMCO SE		304 120 584	11,021.52 25,860.00 51,429.02 (6,349,426)
		銘柄数： 組入時価比率：	5 0.1%		4.8%
	イギリスポ ンド	BRITISH LAND COMPANY PLC HAMMERSON PLC INTU PROPERTIES PLC LAND SECURITIES GROUP SEGRO PLC		1,352 952 1,302 1,093 1,034 5,733	8,436.48 5,236.00 3,529.72 11,159.53 4,578.55 32,940.28 (4,856,714)
	小計				
		銘柄数： 組入時価比率：	5 0.1%		3.7%
	オーストラ リアドル	DEXUS PROPERTY GROUP GOODMAN GROUP GPT GROUP MIRVAC GROUP SCENTRE GROUP STOCKLAND VICINITY CENTRES WESTFIELD CORP		1,339 2,459 2,162 3,622 7,363 2,937 4,126 2,730 26,738	12,573.21 17,139.23 10,766.76 7,642.42 32,838.98 13,128.39 12,212.96 24,761.10 131,063.05 (11,428,697)
	小計				
		銘柄数： 組入時価比率：	8 0.2%		8.6%
	香港ドル 小計	LINK REIT		3,100 3,100	162,750.00 162,750.00 (2,468,917)
		銘柄数： 組入時価比率：	1 0.0%		1.9%
	シンガポ ールドル	ASCENDAS REAL ESTATE CAPITALAND COMMERCIAL TRUST CAPITALAND MALL TRUST SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		3,000 2,700 5,000 4,000 14,700	6,960.00 4,104.00 9,650.00 6,720.00 27,434.00 (2,241,083)
	小計				
		銘柄数： 組入時価比率：	4 0.0%		1.7%
	合計				132,128,189 (132,128,189)

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

「PRU海外債券マザーファンド」の状況

なお、以下に掲載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(平成27年12月15日現在)	(平成28年12月15日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		5,550,843	13,794,345
金銭信託		655,210	687,404
コール・ローン		37,269,193	38,729,660
国債証券		6,966,933,664	6,592,961,847
派生商品評価勘定		5,887,191	25,597,957
未収入金		10,376,692	9,168,460
未収利息		66,091,897	55,283,996
前払費用		1,716,336	1,875,580
流動資産合計		7,094,481,026	6,738,099,249
資産合計		7,094,481,026	6,738,099,249
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		5,300,617	23,502,008
未払解約金		10,172,714	5,374,241
未払利息		-	106
流動負債合計		15,473,331	28,876,355
負債合計		15,473,331	28,876,355
純資産の部			
元本等			
元本	1	3,050,027,609	3,030,125,737
剰余金			
剰余金又は欠損金()		4,028,980,086	3,679,097,157
元本等合計		7,079,007,695	6,709,222,894
純資産合計		7,079,007,695	6,709,222,894
負債純資産合計		7,094,481,026	6,738,099,249

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

（平成27年12月15日現在）	（平成28年12月15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 3,206,237,696円	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 3,050,027,609円
同期中における追加設定元本額 257,725,187円	同期中における追加設定元本額 196,912,390円
同期中における解約元本額 413,935,274円	同期中における解約元本額 216,814,262円
同期末における元本の内訳 PRU海外債券マーケット・パフォーマー 2,777,355,978円	同期末における元本の内訳 PRU海外債券マーケット・パフォーマー 2,739,512,157円
PRUグッドライフ2020 483,730円	PRUグッドライフ2020 439,660円
PRUグッドライフ2030 579,564円	PRUグッドライフ2030 663,291円
PRUグッドライフ2040 1,026,614円	PRUグッドライフ2040 1,067,528円
PRUグッドライフ2020（年金） 44,331,767円	PRUグッドライフ2020（年金） 41,472,812円
PRUグッドライフ2030（年金） 93,056,391円	PRUグッドライフ2030（年金） 110,382,809円
PRUグッドライフ2040（年金） 43,959,263円	PRUグッドライフ2040（年金） 54,586,330円
PRUグッドライフ2050（年金） 1,430,488円	PRUグッドライフ2050（年金） 2,103,756円
プルデンシャル私募海外債券マーケット・パ フォーマー（適格機関投資家向け） 87,803,814円	プルデンシャル私募海外債券マーケット・パ フォーマー（適格機関投資家向け） 79,897,394円
計 3,050,027,609円	計 3,030,125,737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 3,050,027,609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 3,030,125,737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16日 至 平成27年12月15日	自 平成27年12月16日 至 平成28年12月15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15日現在）	（平成28年12月15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15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	28,284,271
合計	28,284,271

(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15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	18,979,987
合計	18,979,987

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

通貨関連

(単位：円)

種類	(平成27年12月15日現在)			
	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建				
アメリカドル	256,850,699	-	256,356,831	493,868
カナダドル	8,509,594	-	8,176,533	333,061
メキシコペソ	15,971,350	-	15,133,623	837,727
ユーロ	23,576,574	-	23,720,514	143,940
イギリスポンド	19,254,102	-	19,030,538	223,564
スイスフラン	21,734,267	-	21,717,685	16,582
スウェーデンクローネ	14,691,585	-	14,560,474	131,111
ノルウェークローネ	2,868,463	-	2,813,734	54,729
デンマーククローネ	15,646,571	-	15,281,512	365,059
ポーランドズロチ	5,290,659	-	5,242,322	48,337
オーストラリアドル	14,458,101	-	14,458,317	216
シンガポールドル	17,470,927	-	17,266,140	204,787
売建				
アメリカドル	161,209,533	-	160,871,321	338,212
カナダドル	25,925,435	-	24,881,838	1,043,597
メキシコペソ	17,492,278	-	16,736,037	756,241
ユーロ	90,275,737	-	91,266,871	991,134
イギリスポンド	21,292,497	-	21,044,448	248,049
ノルウェークローネ	4,281,816	-	4,049,740	232,076
デンマーククローネ	19,989,445	-	20,221,821	232,376
ポーランドズロチ	19,419,653	-	18,660,481	759,172
オーストラリアドル	2,305,413	-	2,344,774	39,361
シンガポールドル	17,366,903	-	17,093,895	273,008
南アフリカランド	6,340,522	-	5,575,166	765,356
合計	802,222,124	-	796,504,615	588,171

（単位：円）

種類	（平成28年12月15日現在）			
	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引 為替予約取引				
買建				
アメリカドル	130,899,084	-	145,237,077	14,337,993
カナダドル	22,975,026	-	25,769,977	2,794,951
メキシコペソ	3,149,207	-	3,248,664	99,457
ユーロ	47,872,442	-	50,375,132	2,502,690
イギリスポンド	33,515,175	-	36,081,721	2,566,546
スイスフラン	15,486,258	-	16,841,120	1,354,862
スウェーデンクローネ	2,213,450	-	2,374,695	161,245
デンマーククローネ	994,837	-	1,037,500	42,663
ポーランドズロチ	21,685,711	-	22,842,503	1,156,792
シンガポールドル	6,916,671	-	7,497,429	580,758
売建				
アメリカドル	128,494,002	-	142,332,946	13,838,944
メキシコペソ	9,770,597	-	10,199,938	429,341
ユーロ	33,194,668	-	34,321,297	1,126,629
イギリスポンド	48,980,028	-	55,083,565	6,103,537
デンマーククローネ	4,145,468	-	4,466,595	321,127
ポーランドズロチ	15,595,944	-	16,273,171	677,227
オーストラリアドル	5,381,405	-	5,953,258	571,853
南アフリカランド	3,874,356	-	4,307,706	433,350
合計	535,144,329	-	584,244,294	2,095,949

（注）1．時価の算定方法

為替予約の時価

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

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

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

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

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

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

2. 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。

3. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

(単位：アメリカドル)

種類	(平成27年12月15日現在)			
	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引 直物為替先渡取引 売建 マレーシアリングット	65,637.51 (7,952,641)	- (-)	65,650.70 (7,954,238)	13.19 (1,597)
合計 (邦貨換算額)	65,637.51 (7,952,641)	- (-)	65,650.70 (7,954,238)	13.19 (1,597)

(注) 時価の算定方法

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

2. ()内の金額は邦貨換算額であります。

邦貨換算額は計算期間末日の対顧客相場の仲値で換算しております。

(平成28年12月15日現在)

直物為替先渡取引において該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

(平成27年12月15日現在)		(平成28年12月15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	2.3210円	本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額	2.2142円
(1万口当たり純資産額	23,210円)	(1万口当たり純資産額	22,142円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式（平成28年12月15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15日現在）

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額
国債証券	アメリカドル	US TREASURY N/B		1,440,000.00	1,435,443.84
		US TREASURY N/B		820,000.00	834,766.56
		US TREASURY N/B		365,000.00	365,969.44
		US TREASURY N/B		2,240,000.00	2,244,549.44
		US TREASURY N/B		1,930,000.00	1,941,535.61
		US TREASURY N/B		1,025,000.00	1,029,684.25
		US TREASURY N/B		1,585,000.00	1,588,653.42
		US TREASURY N/B		1,395,000.00	1,437,449.85
		US TREASURY N/B		265,000.00	266,666.58
		US TREASURY N/B		2,530,000.00	2,656,302.66
		US TREASURY N/B		1,780,000.00	1,777,427.90
		US TREASURY N/B		735,000.00	713,610.03
		US TREASURY N/B		280,000.00	273,240.52
		US TREASURY N/B		325,000.00	321,115.27
		US TREASURY N/B		70,000.00	68,047.63
		US TREASURY N/B		1,945,000.00	1,959,739.21
		US TREASURY N/B		1,585,000.00	1,563,144.43
		US TREASURY N/B		225,000.00	218,891.70
		US TREASURY N/B		140,000.00	137,096.12
		US TREASURY N/B		165,000.00	209,105.32
		US TREASURY N/B		1,030,000.00	1,254,588.41
		US TREASURY N/B		820,000.00	1,053,891.88
		US TREASURY N/B		455,000.00	422,528.01
		US TREASURY N/B		175,000.00	166,215.87
		US TREASURY N/B		645,000.00	672,639.54
	US TREASURY N/B		355,000.00	344,031.21	
	小計			24,325,000.00	24,956,334.70 (2,937,859,720)
		銘柄数： 組入時価比率：	26 43.8%		44.6%
	カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT		425,000.00	446,432.75
		CANADIAN GOVERNMENT		370,000.00	548,040.30
		CANADIAN GOVERNMENT BOND		120,000.00	122,040.00
		CANADIAN GOVERNMENT BOND		10,000.00	10,767.70
		CANADIAN GOVERNMENT BOND		150,000.00	194,148.00
	小計			1,075,000.00	1,321,428.75 (116,801,087)
		銘柄数： 組入時価比率：	5 1.7%		1.8%
	メキシコペソ	MEXICAN BONOS		2,880,000.00	2,995,871.04
		MEXICAN BONOS		4,580,000.00	4,533,059.58
		MEXICAN BONOS		2,000,000.00	2,022,502.00
		MEXICAN BONOS		1,330,000.00	1,352,522.22
	小計			10,790,000.00	10,903,954.84 (62,697,740)
		銘柄数： 組入時価比率：	4 0.9%		1.0%

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額
国債証券	ユーロ	AUSTRIA GOVERNMENT BOND		155,000.00	172,417.50
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND		390,000.00	471,377.40
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND		85,000.00	95,429.50
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND		135,000.00	209,041.29
		BELGIUM GOVERNMENT BOND		5,000.00	5,301.95
		BELGIUM GOVERNMENT BOND		370,000.00	429,894.12
		BELGIUM GOVERNMENT BOND		345,000.00	424,011.90
		BELGIUM GOVERNMENT BOND		110,000.00	113,385.58
		BELGIUM GOVERNMENT BOND		245,000.00	253,786.19
		BELGIUM GOVERNMENT BOND		135,000.00	213,167.70
		BELGIUM GOVERNMENT BOND		50,000.00	52,907.65
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO		320,000.00	331,552.00
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO		385,000.00	579,373.02
		BUNDESREPUB DEUTSCHLAND		339,000.00	564,160.41
		BUNDESREPUB DEUTSCHLAND		410,000.00	681,167.85
		BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA		110,000.00	124,068.45
		BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA		90,000.00	105,792.93
		BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA		345,000.00	391,403.88
		BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA		340,000.00	349,199.04
		BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA		245,000.00	368,624.06
		BUONI POLIENNALI DEL TES		360,000.00	387,381.24
		BUONI POLIENNALI DEL TES		670,000.00	1,018,895.80
		BUONI POLIENNALI DEL TES		540,000.00	747,728.82
		FINLAND GOVERNMENT BOND		90,000.00	105,321.96
		FINLAND GOVERNMENT BOND		140,000.00	140,585.48
		FINLAND GOVERNMENT BOND		25,000.00	33,138.45
		FRANCE GOVERNMENT BOND O		175,000.00	180,626.42
		FRANCE GOVERNMENT BOND O		375,000.00	389,959.50
		FRANCE GOVERNMENT BOND O		115,000.00	116,745.12
		FRANCE GOVERNMENT BOND O		860,000.00	956,851.48
		FRANCE GOVERNMENT BOND O		70,000.00	70,829.78
		FRANCE GOVERNMENT BOND O		30,000.00	34,490.85
		FRANCE GOVERNMENT BOND O		80,000.00	80,335.52
		FRANCE GOVERNMENT BOND O		335,000.00	422,977.70
		FRANCE GOVERNMENT BOND O		135,000.00	133,018.20
		FRANCE GOVERNMENT BOND O		350,000.00	519,187.90
		FRANCE GOVERNMENT BOND O		160,000.00	153,036.80
		FRANCE O.A.T.		925,000.00	1,424,786.75
		FRANCE O.A.T.		455,000.00	758,712.50
		IRELAND GOVERNMENT BOND		150,000.00	163,932.45
		IRELAND GOVERNMENT BOND		60,000.00	70,908.18
		IRELAND GOVERNMENT BOND		285,000.00	331,476.66
		IRELAND GOVERNMENT BOND		50,000.00	61,512.60
		IRELAND GOVERNMENT BOND		45,000.00	61,980.34
		IRELAND GOVERNMENT BOND		15,000.00	15,600.63
		ITALY BUONI POLIENNALI D		515,000.00	534,811.02
		ITALY BUONI POLIENNALI D		735,000.00	838,910.62
		ITALY BUONI POLIENNALI D		335,000.00	408,439.37
		ITALY BUONI POLIENNALI D		50,000.00	61,164.00
		ITALY BUONI POLIENNALI D		575,000.00	710,992.10
ITALY BUONI POLIENNALI D		80,000.00	79,296.40		
ITALY BUONI POLIENNALI D		240,000.00	348,486.00		
ITALY BUONI POLIENNALI D		30,000.00	41,055.63		
ITALY BUONI POLIENNALI D		73,000.00	100,741.46		
NETHERLANDS GOVERNMENT B		250,000.00	287,293.00		
NETHERLANDS GOVERNMENT B		180,000.00	265,043.34		
NETHERLANDS GOVERNMENT B		300,000.00	301,677.30		

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額	
国債証券	ユーロ	NETHERLANDS GOVERNMENT B		150,000.00	239,635.05	
		SPAIN GOVERNMENT BOND		830,000.00	836,151.96	
		SPAIN GOVERNMENT BOND		800,000.00	907,816.00	
		SPAIN GOVERNMENT BOND		70,000.00	90,135.29	
		SPAIN GOVERNMENT BOND		65,000.00	78,064.80	
		SPAIN GOVERNMENT BOND		65,000.00	73,180.38	
		SPAIN GOVERNMENT BOND		350,000.00	447,979.00	
		SPAIN GOVERNMENT BOND		135,000.00	188,198.10	
		SPAIN GOVERNMENT BOND		30,000.00	31,197.09	
		SPAIN GOVERNMENT BOND		40,000.00	43,129.20	
		小計			17,002,000.00	21,229,480.66 (2,620,991,682)
		銘柄数 :	67			
		組入時価比率 :	39.1%		39.8%	
イギリスポンド		UNITED KINGDOM GILT		345,000.00	351,340.75	
		UNITED KINGDOM GILT		65,000.00	67,629.38	
		UNITED KINGDOM GILT		25,000.00	28,590.75	
		UNITED KINGDOM GILT		295,000.00	311,746.56	
		UNITED KINGDOM GILT		295,000.00	306,702.65	
		UNITED KINGDOM GILT		15,000.00	20,705.58	
		UNITED KINGDOM GILT		15,000.00	21,112.68	
		UNITED KINGDOM GILT		595,000.00	846,799.24	
		UNITED KINGDOM GILT		305,000.00	399,514.62	
		UNITED KINGDOM TREASURY		265,000.00	352,896.79	
		UNITED KINGDOM TREASURY		495,000.00	678,437.59	
		小計			2,715,000.00	3,385,476.59 (499,154,668)
				銘柄数 :	11	
		組入時価比率 :	7.4%		7.6%	
スウェーデンクローネ	小計	SWEDEN GOVERNMENT BOND		450,000.00	539,937.00	
		SWEDEN GOVERNMENT BOND		1,090,000.00	1,286,595.67	
		SWEDEN GOVERNMENT BOND		220,000.00	299,936.56	
			1,760,000.00	2,126,469.23 (26,899,835)		
		銘柄数 :	3			
		組入時価比率 :	0.4%		0.4%	
ノルウェークローネ	小計	NORWAY GOVERNMENT BOND		850,000.00	927,066.95	
		NORWAY GOVERNMENT BOND		470,000.00	519,389.48	
			1,320,000.00	1,446,456.43 (19,758,594)		
		銘柄数 :	2			
		組入時価比率 :	0.3%		0.3%	
デンマーククローネ	小計	DENMARK GOVERNMENT BOND		600,000.00	679,761.60	
		DENMARK GOVERNMENT BOND		640,000.00	704,593.92	
		DENMARK GOVERNMENT BOND		1,060,000.00	1,186,643.50	
		DENMARK GOVERNMENT BOND		230,000.00	391,109.25	
			2,530,000.00	2,962,108.27 (49,170,997)		
		銘柄数 :	4			
		組入時価比率 :	0.7%		0.7%	
ポーランドズロチ	小計	POLAND GOVERNMENT BOND		750,000.00	720,765.75	
		POLAND GOVERNMENT BOND		160,000.00	168,709.76	
		POLAND GOVERNMENT BOND		285,000.00	282,865.35	
			1,195,000.00	1,172,340.86 (32,626,246)		
		銘柄数 :	3			
		組入時価比率 :	0.5%		0.5%	

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額
国債証券	オーストラリアドル	AUSTRALIA GOVERNMENT BON		550,000.00	595,641.20
		AUSTRALIA GOVERNMENT BON		410,000.00	484,369.49
		AUSTRALIA GOVERNMENT BON		350,000.00	393,444.45
		AUSTRALIA GOVERNMENT BON		30,000.00	30,766.89
		AUSTRALIA GOVERNMENT BON		80,000.00	82,877.76
		AUSTRALIA GOVERNMENT BON		50,000.00	42,843.95
		小計		1,470,000.00	1,629,943.74 (142,131,094)
			銘柄数： 組入時価比率：	6 2.1%	2.2%
	シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT BON		100,000.00	104,400.00
		SINGAPORE GOVERNMENT BON		100,000.00	101,188.50
				200,000.00	205,588.50 (16,794,524)
		小計			
			銘柄数： 組入時価比率：	2 0.3%	0.3%
	マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVERNMENT BOND		1,185,000.00	1,145,834.56
				1,185,000.00	1,145,834.56 (30,250,032)
	小計				
		銘柄数： 組入時価比率：	1 0.5%	0.5%	
南アフリカランド	SOUTH AFRICA GOVERNMENT		700,000.00	702,618.00	
	SOUTH AFRICA GOVERNMENT		2,715,000.00	2,599,015.20	
	SOUTH AFRICA GOVERNMENT		1,670,000.00	1,190,721.69	
			5,085,000.00	4,492,354.89 (37,825,628)	
	小計				
		銘柄数： 組入時価比率：	3 0.6%	0.6%	
	合計			6,592,961,847 (6,592,961,847)	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成29年1月31日現在

資産総額	1,969,942,782円
負債総額	2,815,084円
純資産総額（ - ）	1,967,127,698円
発行済数量	1,396,552,222口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4086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

P R U国内債券マザーファンド

資産総額	6,444,764,688円
負債総額	35,762,174円
純資産総額（ - ）	6,409,002,514円
発行済数量	4,824,558,078口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3284円

P R U海外株式マザーファンド

資産総額	4,748,200,814円
負債総額	7,413,491円
純資産総額（ - ）	4,740,787,323円
発行済数量	2,200,664,324口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1543円

P R U海外債券マザーファンド

資産総額	5,713,058,399円
負債総額	4,302,243円
純資産総額(-)	5,708,756,156円
発行済数量	2,652,121,041口
1口当たり純資産額(/)	2.1525円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

(1) 名義書換等

該当事項はありません。

(2) 受益者名簿の閉鎖の時期

受益者名簿は作成しません。したがって、該当事項はありません。

(3) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(4) 譲渡制限

該当事項はありません。ただし、受益権の譲渡等は以下によるものとします。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益証券の再発行

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【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。

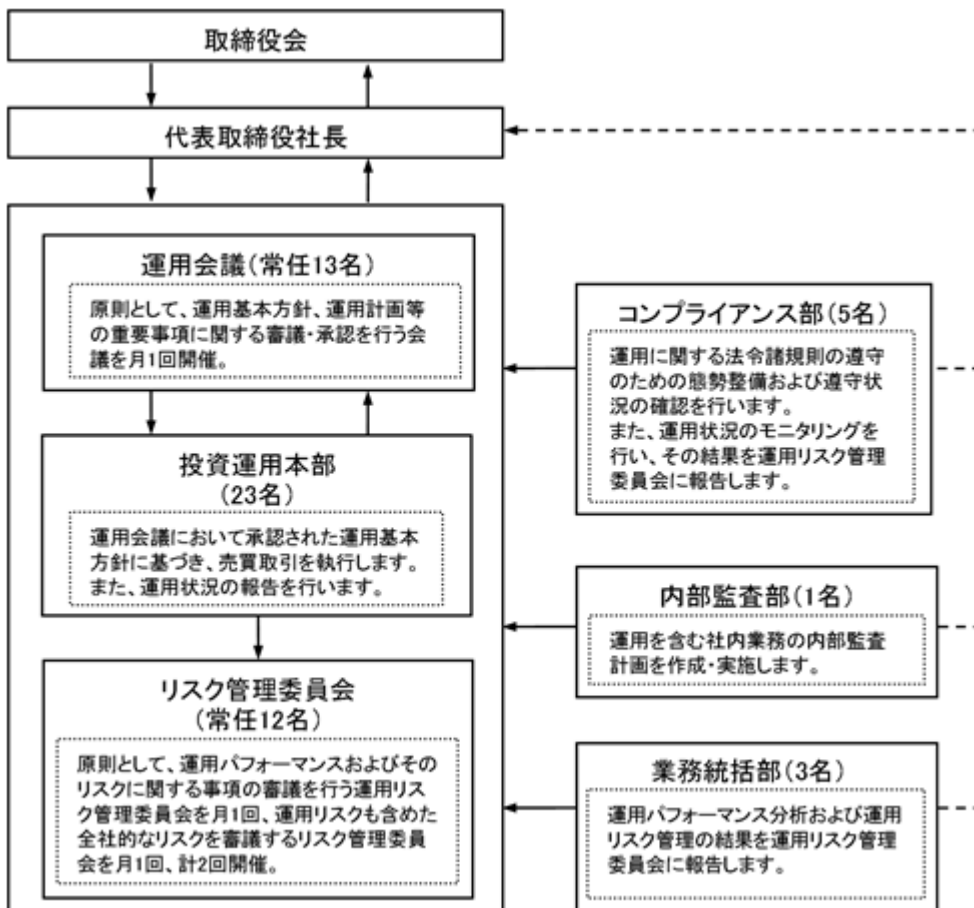
取締役会を招集するには、各取締役及び監査役に対し、会日の少なくとも1週間前に招集通知を發します。ただし、取締役及び監査役全員の同意を得て、招集期間を短縮しまたは招集手続を省略することができます。法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会は代表取締役の1名が招集し、議長となります。代表取締役のいずれにも事故ある場合には、予め取締役会の決議によって定められた順序に従って他の取締役がこの任にあたります。

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：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んでいます。

(3) 投資顧問会社

名称：クオンティテイティブ・マネジメント・アソシエイツ社

(Quantitative Management Associates LLC)

資本金の額：26,841千米ドル（約3,228百万円、1米ドル=120.295円、平成27年12月末現在）

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

2【関係業務の概要】

(1) 受託銀行における関係業務の概要

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

(2) 販売会社における関係業務の概要

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

(3) 投資顧問会社における関係業務の概要

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

3【資本関係】

委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

第3【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15日	有価証券届出書
平成28年3月15日	有価証券報告書
平成28年9月15日	半期報告書
平成28年9月15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グッドライフ2020（年金）の平成27年12月16日から平成28年12月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、PRUグッドライフ2020（年金）の平成28年12月15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
業務執行社員 公認会計士 大 畑 茂指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 男 澤 顕

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。