

# PRU グッドライフ 2020

## 目論見書

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・インク

1. この目論見書により行う PRU グッドライフ 2020 の受益証券の募集については、委託会社は、証券取引法(昭和 23 年法第 25 号)第 5 条の規定により有価証券届出書を平成 14 年 12 月 13 日に関東財務局長に提出しており、平成 14 年 12 月 29 日にその届出の効力が生じております。
2. PRU グッドライフ 2020 の受益証券の価額は、同ファンドに組入れられている有価証券の値動きのほか為替変動による影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資家の皆様に帰属します。したがって、このファンドは元本が保証されているものではありません。

## 有価証券届出書 表紙記載事項

有価証券届出書提出日 平成 14 年 12 月 13 日提出  
発行者名 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・インク  
代表者の役職氏名 取締役社長、日本における代表者 佐々木 雅彦  
本店の所在の場所 アメリカ合衆国デラウェア州ニュー・キャッスル郡シティ・オブ・ウィルミントン、オレンジ・ストリート 1209、コーポレーション・トラスト・センター

### 届出の対象とした募集

募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称 PRU グッドライフ 2020  
募集内国投資信託受益証券の金額 続募集額：上限 1,000 億円

有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所 東京支店  
東京都千代田区丸の内二丁目 3 番 2 号

## 目 次

	頁
第一部 証券情報 .....	1
第二部 ファンド情報 .....	4
第 1 ファンドの状況 .....	4
1. ファンドの性格 .....	4
2. 投資方針 .....	7
3. 投資リスク .....	19
4. 手数料等及び税金 .....	20
5. 運用状況 .....	22
6. 管理及び運営 .....	25
第 2 ファンドの経理状況 .....	31
第 3 その他 .....	105
第 4 内国投資信託受益証券事務の概要 .....	106
投資信託約款 .....	107

## 第一部 証券情報

### (1) ファンドの名称

PRU グッドライフ 2020

以下、「当ファンド」といいます。

また、当ファンドとともに「PRU グッドライフ 2010」、「PRU グッドライフ 2030」および「PRU グッドライフ 2040」を総称して「PRU グッドライフ・ファンド」という名称を使用します。なお、上記各ファンドを総称してまたは各ファンドについて「順風満帆」という愛称を用いることがあります。

### (2) 国内投資信託受益証券の形態等

契約型投資信託追加型無額面受益証券（以下「受益証券」といいます。）

当ファンドの受益証券は、原則として無記名式です。

格付は取得していません。

### (3) 発行数

それぞれの受益証券 1 口当たりの各発行価格に、各発行口数を乗じた金額の合計額が、1,000 億円となる口数の合計口数を上限とします。

### (4) 発行価額の総額

1,000 億円を上限とします。

（上記金額には、後記「(6) 申込手数料」に記載の申込手数料ならびに申込手数料に係る消費税相当額および地方消費税相当額（以下「消費税等相当額」といいます。）は含まれていません。）

### (5) 発行価格

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

（上記基準価額には、後記「(6) 申込手数料」に記載の申込手数料および申込手数料に係る消費税等相当額は含まれていません。）

\* 「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。）を法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受益権総口数で除した 1 万口当たりの価額をいいます。（「計算日」とは、基準価額が算出される日をいい、原則としてブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン・インク（以下「委託会社」といいます。）の営業日です。）

基準価額は、組入有価証券などの値動きにより、日々変動します。

基準価額は、委託会社（下記の「委託会社問合わせ先」をご参照ください。）または委託会社の指定する証券会社（外国証券会社を含みます。）および銀行、保険会社等の登録金融機関（以下総称して「販売会社」といいます。販売会社の詳細については後記「(9) 申込取扱場所」をご参照ください。）までお問い合わせください。また、基準価額は、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

委託会社問合わせ先 PRUホットライン	
フリーダイヤル	0120-50-6690（携帯電話・PHSからもご利用いただけます。） 受付時間：9:00～17:00 （土日・祝日、12月31日～1月3日は休業。年末最終営業日、年始営業開始日は9:00～12:00）
ホームページ	<a href="http://www.pru.co.jp">http://www.pru.co.jp</a>

## (6) 申込手数料

申込手数料は3%を上限として、販売会社がそれぞれ定めるものとします。

各販売会社の申込手数料の詳細については、委託会社のホームページをご参照いただくか、またはフリーダイヤルまでお問い合わせください。

(委託会社へのお問い合わせは、前記「(5) 発行価格」に記載の「委託会社問い合わせ先」をご参照ください。)

申込手数料には、申込手数料に係る消費税等相当額が加算されます。

なお、自動けいぞく投資コースを選択され、収益分配金(所得税および地方税控除後)の自動再投資により当ファンドを取得される場合には、申込手数料はかかりません。

## (7) 申込単位

申込単位は、販売会社が次の中からそれぞれ定める単位とします。

1万口以上1万口単位

1万円以上1円単位

(注)「自動けいぞく投資コース」を選択した投資者が、販売会社との間で「定時定額購入サービス」等に関する契約を締結した場合は、当該契約で規定する取得申込の単位によるものとします。

各販売会社の申込単位については、委託会社のホームページをご参照いただくか、またはフリーダイヤルまでお問い合わせください。

(委託会社へのお問い合わせは、前記「(5) 発行価格」に記載の「委託会社問い合わせ先」をご参照ください。)

## (8) 申込期間

継続募集期間：平成14年12月31日から平成16年3月10日まで

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

毎営業日お申込みいただけます。ただし、ニューヨークまたはロンドンのいずれかの証券取引所または銀行が休業日の場合には、お申込みの受け付けはいたしません。

(注) お申込みの取扱いは、営業日の午後3時(年末年始のような証券取引所等が半休日の場合は午前11時)までとさせていただきます。なお午後3時を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

## (9) 申込取扱場所

申込取扱場所は、原則として販売会社の本・支店、営業所等とします。

なお、申込取扱場所の詳細については、委託会社のホームページをご参照いただくか、またはフリーダイヤルまでお問い合わせください。

(委託会社へのお問い合わせは、前記「(5) 発行価格」に記載の「委託会社問い合わせ先」をご参照ください。)

## (10) 払込期日

当ファンドの取得申込者は、申込総金額(申込金額に申込手数料および申込手数料に係る消費税等相当額を加算した額)を販売会社の定める日までに支払うものとします。

各取得申込日における発行価額の総額は、当該取得申込みに係る追加信託を行う日に、販売会社により、委託会社の口座を経由して受託銀行であるりそな信託銀行株式会社(以下「受託銀行」といいます。))の当ファンド口座に払い込まれます。

(11) 払込取扱場所

前記「(9) 申込取扱場所」と同じです。

(12) その他

a. 申込の方法

当ファンドの取得申込者は、販売会社との間で、受益証券の取引に関する契約を締結します。このため販売会社は有価証券取引に係る「投資信託取引の約款・規定集」その他の約款（以下「総合約款」といいます。）を取得申込者に交付し、取得申込者は総合約款に基づく取引口座の設定を申込む旨の申込書を提出します。

また、受益証券の取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」その他同様の権利義務関係を規定する契約（以下「自動けいぞく約款」といいます。）にしたがって、収益分配金が税金を差引いた後で自動的に無手数料で再投資される、分配金再投資に関する契約を締結することができます。受益証券は原則として保護預りとさせていただきます。なお、自動けいぞく投資コースを選択された方は、すべて保護預りとさせていただきます。

委託会社は、証券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、受益証券の取得申込みの受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みを取消することができます。

b. 日本以外の地域における発行

該当事項はありません。

c. 申込証拠金

該当事項はありません。

## 第二部 ファンド情報

### 第1 ファンドの状況

#### 1. ファンドの性格

##### (1) ファンドの目的及び基本的性格

目的	PRUグッドライフ2020（以下、「当ファンド」といいます。）は、投資信託財産の中・長期的な成長を図ることを目標として運用を行うことを基本とします。
基本的性格	追加型株式投資信託・バランス型に属します。 *「バランス型」とは、社団法人投資信託協会が定める商品分類において、「約款上の株式組入限度70%未満のファンドで、株式・公社債等のバランス運用、あるいは、公社債中心の運用を行うもの」として分類されるファンドです。
特色	<ul style="list-style-type: none"><li>➢ 当ファンドは、基本ガイドラインに基づき、時間の経過とともに安定的な運用に移行します。</li><li>➢ 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、日本の株式・公社債等および海外の株式・公社債等への分散投資を行います。これにより、リスクを低減させながら各ファンドの中・長期的な成長を目指します。</li><li>➢ 当ファンドの償還日は平成32年（2020年）12月10日です。</li><li>➢ 年1回（原則12月10日）決算し、収益分配方針に基づいて分配を行います。</li></ul>
信託金の限度額	<ul style="list-style-type: none"><li>➢ 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。</li><li>➢ 委託会社は、受託銀行と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。</li></ul>

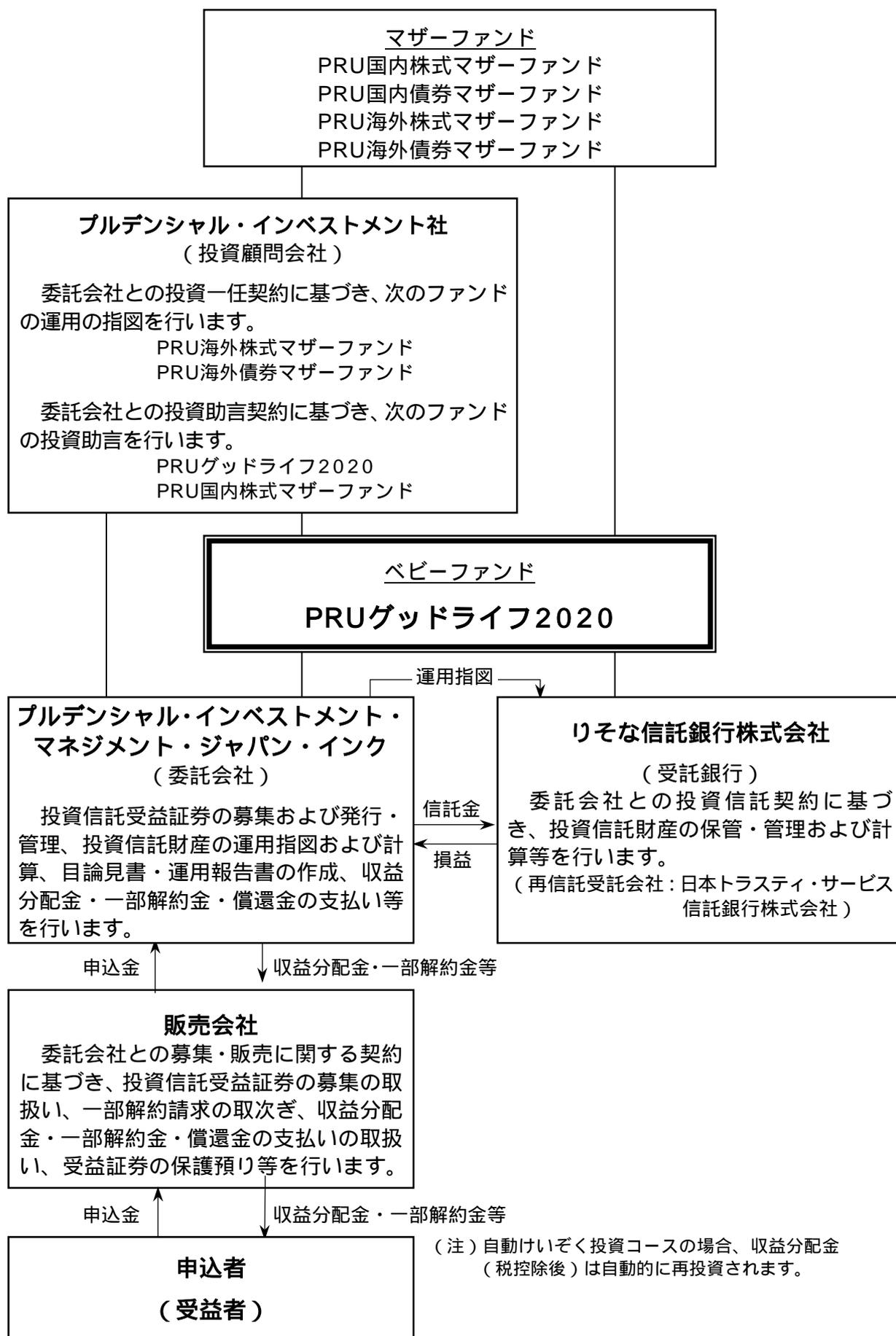
##### (2) ファンドの沿革

平成13年3月16日  
平成14年12月31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  
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（委託会社）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（予定）

(3) ファンドの仕組み

a. ファンドの仕組み



b. ファンドの関係法人

(a) 委託会社

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・インク

当ファンドの委託会社として、投資信託財産の運用指図およびその権限の委託、受益証券の発行等を行います。なお、委託会社はプルデンシャル・インベストメント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受けます。

(b) 受託銀行

りそな信託銀行株式会社

(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)

当ファンドの受託銀行として、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、また投資信託財産に関する報告書を作成し委託会社への交付を行います。なお、信託事務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。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(c) 販売会社

当ファンドの販売会社として、受益証券の募集の取扱、販売、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。

c. 委託会社等の概況（本書提出日現在）

資本の額	100 万米ドル
沿革	<p>平成 13 年 11 月 8 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・インク設立</p> <p>平成 13 年 11 月 12 日 東京支店開設</p> <p>平成 14 年 2 月 1 日 投資顧問登録</p> <p>平成 14 年 11 月 22 日 投資信託委託業及び投資一任業務認可取得</p> <p>平成 14 年 12 月 31 日 プルデンシャル投信株式会社より営業の全部を譲受（予定）</p>
大株主の状況	<p>株主名 : 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 (Prudential International Investments Corporation)</p> <p>住所 : アメリカ合衆国ニュージャージー州ニューアーク、マルベリー・ストリート 100</p> <p>持株数 : 100 株</p> <p>持株比率 : 100%</p>

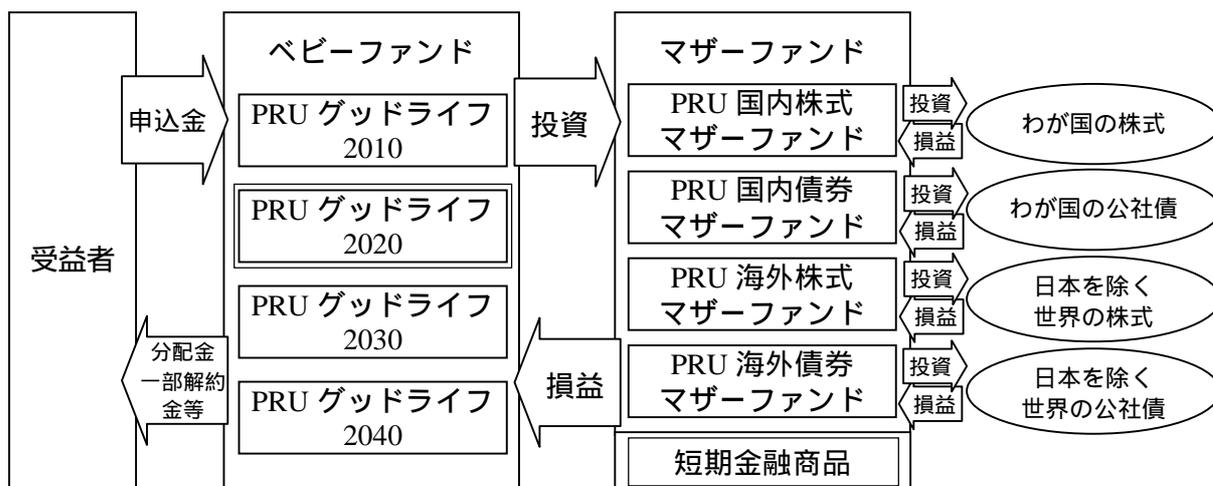
## 2. 投資方針

### (1) 投資方針

#### a. 基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中・長期的な成長を図ることを目標として、ファミリーファンド方式で運用を行います。

ファミリーファンド方式とは、複数のファンドの資金を合同運用する仕組みで、受益者から投資された資金をまとめてベビーファンド（PRU グッドライフ・ファンドを構成する当ファンドを含む各ファンド等）とし、その資金の全部または一部を親投資信託（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。）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、全てベビーファンドに反映されます。



(注) 自動けいぞく投資コースの場合、分配金（税控除後）は自動的に再投資されます。

#### b. 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

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。

当初設定時は、PRU 国内株式マザーファンド 25%、PRU 国内債券マザーファンド 49.5%、PRU 海外株式マザーファンド 15%、PRU 海外債券マザーファンド 7.5%およびコール・ローン等の短期金融商品 3%の組入比率を基本ガイドラインとし、この基本ガイドラインに基づいてポートフォリオを構築します。

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とします。

	平成14年10月1日現在 (当初設定日から約1年半経過時)	当初設定日から 約10年経過時	償還直前
PRU国内株式マザーファンド	23.1%	12.5%	0.0%
PRU国内債券マザーファンド	52.1%	67.0%	0.0%
PRU海外株式マザーファンド	13.9%	7.5%	0.0%
PRU海外債券マザーファンド	7.9%	10.0%	0.0%
短期金融商品	3.0%	3.0%	100.0%

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。基本ガイドラインは約10年間で、概ねPRU国内株式マザーファンドおよびPRU海外株式マザーファンドの合計組入比率を約20%漸減し、PRU国内債券マザーファンド、PRU海外債券マザーファンドおよび短期金融資産の合計組入比率を約20%漸増させます。また、満期償還直前には、短期金融商品100%となるように基本ガイドラインは変化します。

この基本ガイドラインは、実際のポートフォリオ構築を行う際に基準となる資産配分を意味します。したがって、この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、上記の基本ガイドラインの推移と実際の各マザーファンドの組入比率は必ずしも一致しません。

また、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。

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。

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。

当ファンドは、ブルデンシャル・インベストメント社より助言を受け、運用を行います。

## (2) 投資対象

### a. 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。)

- イ. 有価証券
- ロ. 有価証券指数等先物取引に係る権利
- ハ. 有価証券オプション取引に係る権利
- ニ. 外国市場証券先物取引に係る権利
- ホ. 有価証券店頭指数等先渡取引に係る権利
- ヘ. 有価証券店頭オプション取引に係る権利
- ト. 有価証券店頭指数等スワップ取引に係る権利
- チ. 金銭債権(イ、リおよびルに掲げるものに該当するものを除きます。以下同じ。)
- リ. 約束手形(証券取引法第2条第1項第8号に掲げるものを除きます。)
- ヌ. 金融先物取引等(金融先物取引法第2条第9項に規定する金融先物取引等をいいます。以下同じ。)に係る権利
- ル. 金利、通貨の価格その他の指標の数値としてあらかじめ当事者間で約定された数値と将来の一定の時期における現実の当該指標の数値の差に基づいて算出される金銭の授受を約する取引又はこれに類似する取引であって、内閣府令で定めるもの(金融先物取引等を除きます。)に係る権利(ロ.からト.までに掲げるものに該当するものを除きます。)

ヲ. 次に掲げるものを信託する信託の受益権（イ.に掲げるものに該当するものを除きます。）

1. 金銭( 信託財産を主として前各号に掲げる資産に対する投資として運用することを目的とする場合に限り。 )
2. 有価証券
3. 金銭債権

ワ. 当事者の一方が相手方の行う前各号に掲げる資産の運用のために出資を行い、相手方がその出資された財産を主として当該資産に対する投資として運用し、当該運用から生じる利益の分配を行うことを約する契約に係る出資の持分（以下「匿名組合出資持分」といいます。）

カ. 金銭の信託の受益権（イ.に掲げるものに該当するものを除きます。）であって、信託財産を主として匿名組合出資持分に対する投資として運用することを目的とするもの

(b) 次に掲げる特定資産以外の資産

抵当証券

b. 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・インクを委託会社とし、りそな信託銀行株式会社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、次の有価証券に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 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。 )
6. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券( 証券取引法第 2 条第 1 項第 3 号の 2 で定めるものをいいます。 )
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券( 証券取引法第 2 条第 1 項第 5 号で定めるものをいいます。 )
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券または優先出資引受権を表示する証書( 証券取引法第 2 条第 1 項第 5 号の 2 で定めるものをいいます。 )
9. 資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券( 証券取引法第 2 条第 1 項第 5 号の 3 で定めるものをいいます。 )
10. コマーシャル・ペーパー
11. 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
12. 外国または外国法人の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券( 証券取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます。 )
14. 投資証券または外国投資証券( 証券取引法第 2 条第 1 項第 7 号の 2 で定めるものをいいます。 )
15. 外国貸付債権信託受益証券( 証券取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。 )
16. オプションを表示する証券または証書( 証券取引法第 2 条第 1 項第 10 号の 2 で定めるものをいいます。 )
17. 預託証書( 証券取引法第 2 条第 1 項第 10 号の 3 で定めるものをいいます。 )
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

19. 貸付債権信託受益権(証券取引法第2条第2項第1号で定めるものをいいます。)
20. 外国法人に対する権利で前号の権利の性質を有するものなお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号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、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

c. 金融商品の指図範囲

委託会社は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 抵当証券

上記b.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、上記の第1号から第4号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

**運用体制**

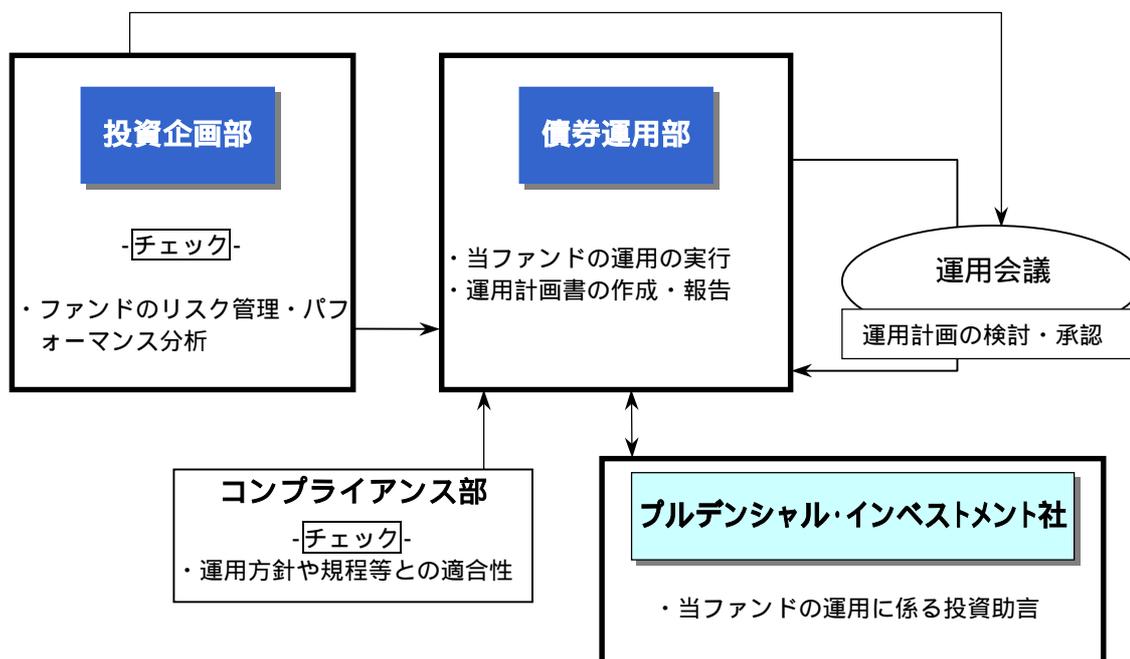
当ファンドは、主として、PRU 国内株式マザーファンド受益証券、PRU 国内債券マザーファンド受益証券、PRU 海外株式マザーファンド受益証券および PRU 海外債券マザーファンド受益証券を投資対象とします。

当ファンドは、投資助言契約に基づき米国のプルデンシャル・インベストメント社から助言を受け、債券運用部のファンド・マネージャーが上記マザーファンドの投資配分を決定します。

**管理体制**

パフォーマンスの分析を行い、ポートフォリオ状況を把握し、当ファンドの運用が商品ガイドラインに則して成果を上げているかをチェックします。

具体的には、法令諸規則・投資信託約款等の遵守性についてはコンプライアンス部門で、ファンドのリスク管理・パフォーマンス分析については投資企画部でチェックが行われ、月1回開催される運用会議で報告・検討が行われます。



#### (4) 分配方針

- a. 年1回の毎決算時(12月10日。ただし、休業日の場合は翌営業日)に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。
  - (a) 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。
  - (b) 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないこともあります。
  - (c) 収益分配に充てず投資信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。
- b. (a) 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等相当額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

売買損益に評価損益を加減した利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等相当額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

  - (b) 毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。
- c. (a) 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(一般コースの場合は、原則として決算日から起算して5営業日目)から収益分配金交付票と引換えに受益者に支払います。
  - (b) 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金を販売会社に支払います。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益証券の売付けを行います。ただし、投資信託約款第54条第4項により信託の一部解約が行われた場合に、当該受益証券に帰属する収益分配金があるときは、前項の規定に準じて受益者に支払います。
- d. 受託銀行は、収益分配金については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、その全額を委託会社に交付します。
- e. 受託銀行は、前項の規定により委託会社に収益分配金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

#### (5) 投資制限

- a. (a) 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。
  - (b) 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。
  - (c) 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。
  - (d) 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。
  - (e) 同一銘柄の転換社債および新株予約権付社債のうち商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがあるもの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。
  - (f) 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。
  - (g) 投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(投資信託約款「運用の基本方針」中の2. 運用方法(3) 投資制限)
- b. 投資する株式等の範囲(投資信託約款第24条)
  - (a) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券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) 前項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。
- c. 信用取引の指図範囲（投資信託約款第 27 条）
  - (a) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付ける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) 前項の信用取引の指図は、次の各号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、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
    1. 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
    2. 株式分割により取得する株券
    3. 有償増資により取得する株券
    4. 売出しにより取得する株券
    5. 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（商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
    6. 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（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- d. 先物取引等の運用指図（投資信託約款第 28 条）
  - (a) 委託会社は、わが国の証券取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所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、わが国の取引所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取引所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、わが国の取引所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取引所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。
- e. スワップ取引の運用指図・目的・範囲（投資信託約款第 29 条）
  - (a) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
  - (b) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として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。
- f. 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（投資信託約款第 30 条）
  - (a) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および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) 金利先渡取引および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) 金利先渡取引および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、金利先渡取引および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。
- g. 有価証券の貸付けの指図および範囲（投資信託約款第 31 条）
  - (a) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
    1. 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。
    2. 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) 前項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。
- h. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（投資信託約款第 33 条）
  - 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- i. 外国為替予約取引の指図および範囲（投資信託約款第 34 条）
  - (a) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
  - (b) 前項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) 前項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) 上記（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。
- j. 資金の借入れ（投資信託約款第 42 条）
  - (a) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
  - (b) 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券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金融商品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の売却代金、金融商品の解約代金および有価証券等の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。
- k. 有価証券売却等の指図（投資信託約款第 40 条）

委託会社は、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る投資信託契約の一部解約、有価証券の売却等の指図ができます。

l. 再投資の指図（投資信託約款第 41 条）

委託会社は、上記 k.の規定による一部解約金、売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

m. 有価証券先物取引等の投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第 27 条第 1 項第 5 号）

委託会社は、投資信託財産の純資産総額に 100 分の 50 を乗じて得られる額が当該投資信託財産に係る次のイ及びロに掲げる額（これに係る取引のうち当該取引が評価損を生じたのと同じ事由により評価益を生じた取引がある場合には当該評価益の合計額を控除した額とします。）並びにハ及びニに掲げる額の合計額を下回ることとなるにもかかわらず、当該投資信託財産に係る有価証券先物取引等を行うこと又は継続することを受託会社に指図しないものとします。

イ 当該投資信託財産に係る先物取引等評価損（有価証券オプション取引等及び有価証券店頭オプション取引等の売付約定に係るものを除きます。）

ロ 当該投資信託財産に係る有価証券オプション取引等及び有価証券店頭オプション取引等のうち売付約定に係るものにおける原証券等の時価とその行使価格との差額であって当該オプションの行使に伴い発生すると見込まれる損失の額から当該オプションに係る帳簿価額を控除した金額であって評価損となるもの

ハ 当該投資信託財産をもって取得し現在保有している新株引受権を表示する証券又は証書に係る時価とその帳簿価額との差額であって評価損となるもの

ニ 当該投資信託財産をもって取得し現在保有しているオプションを表示する証券又は証書に係る時価とその帳簿価額との差額であって評価損となるもの

n. 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 16 条、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第 32 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全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の総数が、当該株式の発行済総数に 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

<b>PRU 国内株式マザーファンド</b>	
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 (TOPIX) *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	わが国の証券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 (TOPIX) 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。当ファンドは、プルデンシャル・インベストメント社より助言を受け、運用を行います。
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および新株予約権付社債のうち商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがあるものへの投資は、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。

\* 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、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用など TOPIX に関するすべての権利および TOPIX の商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

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

株式会社東京証券取引所は、TOPIX の商標の使用もしくは TOPIX の指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。株式会社東京証券取引所は、TOPIX の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株式会社東京証券取引所は、TOPIX の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

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、TOPIX の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

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。

本書提出日現在において、「PRU 国内株式マザーファンド」に投資しているファンドは以下のとおりです。

なお、この他にも、今後「PRU 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。

ファンド名	商品分類
PRU グッドライフ 2010	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2020 (当ファンド)	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2030	追加型株式投資信託・国内株式型 (一般型)
PRU グッドライフ 2040	追加型株式投資信託・国内株式型 (一般型)
PRU 国内株式マーケット・パフォーマー	追加型株式投資信託・国内株式型 (一般型)
PRU グッドライフ 2010 (年金)	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2020 (年金)	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2030 (年金)	追加型株式投資信託・国内株式型 (一般型)
PRU グッドライフ 2040 (年金)	追加型株式投資信託・国内株式型 (一般型)
ワールド・ミックス 40 (バランス指向)	追加型株式投資信託・バランス型
ワールド・ミックス 60 (成長指向)	追加型株式投資信託・国内株式型 (一般型)
ワールド・ミックス 80 (積極指向)	追加型株式投資信託・国内株式型 (一般型)

## PRU 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-BPI（総合）*の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
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-BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 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および新株予約権付社債のうち商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがあるものへの投資は、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。

\* NOMURA-BPI（総合）とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券指数で、国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債で構成されています。当該指数は野村證券株式会社の知的財産であり、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し一切責任ありません。

本書提出日現在において、「PRU 国内債券マザーファンド」に投資しているファンドは以下のとおりです。

なお、この他にも、今後「PRU 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。

ファンド名	商品分類
PRU グッドライフ 2010	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2020（当ファンド）	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2030	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）
PRU グッドライフ 2040	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）
PRU 国内債券マーケット・パフォーマー	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2010（年金）	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2020（年金）	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2030（年金）	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）
PRU グッドライフ 2040（年金）	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）
ワールド・ミックス 40（バランス指向）	追加型株式投資信託・バランス型
ワールド・ミックス 60（成長指向）	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）
ワールド・ミックス 80（積極指向）	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）

## PRU 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プルデンシャル・インベストメント社に運用の指図に関する権限を委託します。</p>
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および新株予約権付社債のうち商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがあるものへの投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>

\*「MSCI KOKUSAI インデックス」とは、MSCI（モルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル）が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要国で構成されています。

\*「MSCI KOKUSAI インデックス（円換算ベース）」は、「MSCI KOKUSAI インデックス（米ドルベース）」をもとに、モルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル・インクの承諾を受けたうえで委託会社で計算したものです。

「MSCI KOKUSAI インデックス」はモルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル・インクの財産であり、モルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル（MSCI）はモルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル・インクのサービス・マークです。

本書提出日現在において、「PRU 海外株式マザーファンド」に投資しているファンドは以下のとおりです。

なお、この他にも、今後「PRU 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。

ファンド名	商品分類
PRU グッドライフ 2010	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2020（当ファンド）	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2030	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）
PRU グッドライフ 2040	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）
PRU 海外株式マーケット・パフォーマー	追加型株式投資信託・国際株式型（一般型）
PRU グッドライフ 2010（年金）	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2020（年金）	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2030（年金）	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）
PRU グッドライフ 2040（年金）	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）
ワールド・ミックス 40（バランス指向）	追加型株式投資信託・バランス型
ワールド・ミックス 60（成長指向）	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）
ワールド・ミックス 80（積極指向）	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）

## PRU 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、ソロモン・スミス・バーニー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>ソロモン・スミス・バーニー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ブルデンシャル・インベストメント社に運用の指図に関する権限を委託します。</p>
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および新株予約権付社債のうち商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがあるものへの投資は、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>

\*「ソロモン・スミス・バーニー世界国債インデックス」とは、ソロモン・スミス・バーニー・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。  
当ファンドでは、ソロモン・スミス・バーニー世界国債インデックス・データをもとに、日興ソロモン・スミス・バーニー証券会社の承諾を得たうえで、委託会社が円換算ベースに計算したものを使用します。

本書提出日現在において、「PRU 海外債券マザーファンド」に投資しているファンドは以下のとおりです。

なお、この他にも、今後「PRU 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。

ファンド名	商品分類
PRU グッドライフ 2010	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2020（当ファンド）	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2030	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）
PRU グッドライフ 2040	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）
PRU 海外債券マーケット・パフォーマー	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2010（年金）	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2020（年金）	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2030（年金）	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）
PRU グッドライフ 2040（年金）	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）
ワールド・ミックス 40（バランス指向）	追加型株式投資信託・バランス型
ワールド・ミックス 60（成長指向）	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）
ワールド・ミックス 80（積極指向）	追加型株式投資信託・国内株式型（一般型）

### 3. 投資リスク

#### a. 当ファンドへの投資リスク

当ファンドはマザーファンドを通じて株式および公社債など値動きのある証券(外国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、当ファンドは金融機関の預金・保険商品・金融債とは異なり、元本あるいは受取金額が保証されているものではありません。

また、当ファンドは預金保険および保険契約者保護機構の保護の対象ではなく、投資信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

証券会社以外で当ファンドを購入した場合は、投資者保護基金の対象にはなりません。ファンドが有する主なリスクは以下のとおりです。

#### (a) 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を償還時期が近づくにしたがって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、各資産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もあります。

#### (b) 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。

#### (c) 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る可能性があります。

#### (d) 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。

#### (e) 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、基準価額が下がる要因となる可能性があります。

#### (f) 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。

#### (g) 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。

#### b. 投資リスクに対する管理体制

法令諸規則・投資信託約款等の遵守性についてはコンプライアンス部門で、ファンドのリスク管理・パフォーマンス分析については投資企画部でチェックが行われ、月1回開催される運用会議で報告・検討が行われます。

#### c. その他

法令、税制および会計基準等は今後変更される可能性もあります。

## 4. 手数料等及び税金

### (1) 申込手数料

申込手数料は3%を上限として、販売会社がそれぞれ定めるものとします。

各販売会社の申込手数料の詳細については、委託会社のホームページをご参照いただくか、またはフリーダイヤルまでお問い合わせください。

委託会社問合わせ先 PRU <sup>ぶる</sup> ホットライン	
フリーダイヤル	0120-50-6690 (携帯電話・PHSからもご利用いただけます。) 受付時間：9:00～17:00 (土日・祝日、12月31日～1月3日は休業。年末最終営業日、年始営業開始日は9:00～12:00)
ホームページ	<a href="http://www.pru.co.jp">http://www.pru.co.jp</a>

申込手数料には、申込手数料に係る消費税等相当額が加算されます。

なお、自動けいぞく投資コースを選択され、収益分配金(所得税および地方税控除後)の自動再投資により当ファンドを取得される場合には、申込手数料はかかりません。

### (2) 換金(解約)手数料

解約時に手数料はかかりません。

### (3) 信託報酬等

- a. 委託会社および受託銀行の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

計算期間	信託報酬率	信託報酬の配分		
		委託会社	販売会社	受託銀行
第1期計算期から第10期計算期	年 1.28%	年 0.60%	年 0.60%	年 0.08%
第11期計算期から第20期計算期	年 1.08%	年 0.50%	年 0.50%	

- b. 前項の信託報酬は、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。
- c. 信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。
- d. 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、上記 a. 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

- a. 投資信託財産に関する租税、投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用(消費税等相当額を含みます。)等の信託事務の処理に要する諸費用および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支弁します。
- 上記の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0.005%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、計算期間を通じて毎日、費用計上します。
- b. 借入金の利息は投資信託財産中から支弁します。
- c. 証券取引に伴う手数料・税金等、ファンドの組入価証券の売買の際に発生する売買委託

手数料は、投資信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料に対する消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用ならびに先物取引・オプション取引等に要する費用についても投資信託財産が負担します。

#### (5) 課税上の取扱い

課税については、次のような取扱いとなります。なお、税法が改正された場合は、以下の内容が変更になることがあります。

##### a. 個別元本方式について

追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益証券の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益証券を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、保護預りではない受益証券および記名式受益証券については各受益証券毎に、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には各販売会社毎に、個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は、当該支店等毎に個別元本の算出が行われる場合があります。

受益者が特別分配金を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「特別分配金」については、下記の〈収益分配金の課税について〉を参照。）

##### <一部解約時および償還時の課税について>

一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象額となります。

##### <収益分配金の課税について>

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「特別分配金」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が特別分配金を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

##### b. 個人、法人別の課税の取扱いについて

###### <個人の受益者に対する課税>

個人の受益者が支払を受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、20%（所得税 15%および地方税 5%）の税率による源泉分離課税が行われます。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金は課税されません。

###### <法人の受益者に対する課税>

法人の受益者が支払を受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、20%（所得税 15%および地方税 5%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金は課税されません。

## 5. 運用状況

### (1) 投資状況（平成14年10月31日現在）

#### 資産別及び地域別の投資状況

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	32,452,943	23.09
投資信託受益証券（PRU国内債券マザーファンド）	日本	67,679,714	48.15
投資信託受益証券（PRU海外株式マザーファンド）	日本	28,929,959	20.58
投資信託受益証券（PRU海外債券マザーファンド）	日本	11,330,990	8.06
現金、預金、その他資産（負債控除後）		144,972	0.12
合計（純資産総額）		140,538,578	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国内株式マザーファンドの投資状況は以下のとおりです。

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
株 式	日 本	2,069,847,266	94.21
現金、預金、その他資産（負債控除後）		127,172,879	5.79
合計（純資産総額）		2,197,020,145	100.00

（注）投資比率は、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とおりです。

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	1,657,030,010	66.38
地方債証券	日本	119,177,270	4.77
特殊債券	日本	329,258,050	13.19
社債券	日本	353,095,460	14.15
	小計	2,458,560,790	98.49
現金、預金、その他資産（負債控除後）		37,532,453	1.51
合計（純資産総額）		2,496,093,243	100.00

（注）投資比率は、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とおりです。

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
株 式	アメリカ	1,441,659,961	57.28
	カナダ	56,545,994	2.25
	ドイツ	67,322,032	2.67
	イタリア	42,693,840	1.70
	フランス	96,832,844	3.85
	オーストラリア	46,997,451	1.87
	イギリス	282,373,494	11.22
	スイス	85,039,864	3.38
	バミューダ	8,086,355	0.32
	香港	21,604,697	0.86
	シンガポール	11,035,799	0.44
	ニュージーランド	1,755,059	0.07
	オランダ	56,834,611	2.26
	スペイン	32,630,550	1.30
	ベルギー	12,623,153	0.50
スウェーデン	19,801,363	0.79	

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
	ノルウェー	5,681,043	0.22
	オーストリア	1,776,491	0.07
	ルクセンブルグ	393,206	0.01
	フィンランド	21,466,440	0.85
	デンマーク	9,687,563	0.38
	アイルランド	7,741,541	0.31
	ギリシャ	2,481,989	0.10
	ポルトガル	4,687,946	0.19
	小計	2,337,753,286	92.89
新株予約権証券	イタリア	2,950	0.00
現金、預金、その他資産（負債控除後）		178,850,027	7.11
合計（純資産総額）		2,516,606,263	100.00

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

（注2） 時価は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。

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

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	2,089,856,236	32.71
	カナダ	131,235,124	2.05
	ドイツ	564,464,061	8.84
	イタリア	2,079,001,690	32.54
	フランス	341,864,566	5.35
	オーストラリア	25,563,746	0.40
	イギリス	409,154,695	6.41
	スペイン	86,091,546	1.35
	ベルギー	239,540,853	3.75
	スウェーデン	118,323,067	1.85
	デンマーク	67,517,854	1.06
	小計	6,152,613,438	96.31
現金、預金、その他資産（負債控除後）		235,412,448	3.69
合計（純資産総額）		6,388,025,886	100.00

（注1） 投資比率は、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） 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）
平成13年11月末	138,596,554	9,648
第1計算期間末（分配付） （平成13年12月10日）（分配落）	138,729,600	9,654
	138,729,600	9,654
平成13年12月末	140,489,148	9,771
平成14年1月末	138,301,647	9,529
平成14年2月末	140,509,420	9,670
平成14年3月末	143,900,881	9,855
平成14年4月末	148,801,839	9,780
平成14年5月末	149,207,433	9,795
平成14年6月末	145,405,355	9,451
平成14年7月末	141,726,450	9,195
平成14年8月末	141,835,912	9,154
平成14年9月末	140,184,431	9,033

	純資産総額 (円)	1万口当たりの純資産額 (基準価額)(円)
平成14年10月末	140,538,578	9,038

分配の推移

決 算 期	1万口当たりの分配金(円)
第1計算期間末 平成13年12月10日	0

収益率の推移

期 間	収益率(%)
第1計算期間 (平成13年3月16日から平成13年12月10日)	3.5
第2計算期間中間期 (平成13年12月11日から平成14年6月10日)	0.6

\* 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期の収益率については、元本(10,000万円)を前期末基準価額とみなして計算しています。

(3) 設定及び解約実績

期 間	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間 (平成13年3月16日から平成13年12月10日)	146,641,985	2,938,297
第2計算期間中間期 (平成13年12月11日から平成14年6月10日)	8,790,459	97,945

\* 本邦外における設定・解約の実績はありません。

## 6. 管理及び運営

### (1) 資産管理等の概要

#### a. 資産の評価

基準価額とは、純資産総額を計算日における受益権総口数で除した1万口当たりの価額をいいます。

基準価額は、委託会社（前記「4. 手数料等及び税金、(1) 申込手数料」に記載の「委託会社問合わせ先」をご参照ください。）または販売会社までお問合わせください。また、基準価額は、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

#### b. 申込（販売）手続等

当ファンドの取得申込者は、販売会社において取引口座を開設し、取得の申込みを行うものとします。

毎営業日お申込みいただけます。ただし、ニューヨークまたはロンドンのいずれかの証券取引所または銀行が休業日の場合には、お申込みの受付はいたしません。

(注1) お申込みの取扱いは、営業日の午後3時(年末年始のような証券取引所が半休日の場合は午前11時)までとさせていただきます。なお午後3時を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

委託会社は、証券取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益証券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ことができます。

(注2) 平成15年12月末までの日本における営業日でニューヨークまたはロンドンのいずれかの証券取引所または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、詳しくは販売会社にお問合わせください。

平成15年1月20日(月)	平成15年2月17日(月)
平成15年4月18日(金)	平成15年4月21日(月)
平成15年5月26日(月)	平成15年7月4日(金)
平成15年8月25日(月)	平成15年9月1日(月)
平成15年11月11日(火)	平成15年11月27日(木)
平成15年12月25日(木)	平成15年12月26日(金)

当ファンドをお申込みいただく際には、「一般コース(口数指定)」、「一般コース(金額指定)」および「自動けいぞく投資コース」のいずれかのコースをご指定いただきます。

申込手数料については、前記「4 手数料等及び税金 (1) 申込手数料」をご参照ください。

当ファンドの取得申込者は、申込総金額(申込金額に申込手数料および申込手数料にかかる消費税相当額等を加算した額)を販売会社の定める日までに支払うものとします。

#### c. 換金（解約）手続等

##### 解約請求

(a) 受益者は、自己の有する受益証券につき、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。

(b) 前項の規定にかかわらず、ニューヨークまたはロンドンのいずれかの証券取引所または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。

(c) 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、受益証券をもって行うものとします。

(d) 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。

(e) 委託会社は、証券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を中止することができます。

- (f) 一部解約の実行の請求の受付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、当該証券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たものとして当該基準価額の計算日の翌営業日の基準価額とします。
- (g) 一部解約金は、受益者の請求を受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。
- (h) 一部解約の価額（基準価額）は、委託会社または販売会社までお問合わせください。  
（委託会社へのお問合わせは、前記「4. 手数料等及び税金、（1）申込手数料」に記載の「委託会社問合わせ先」をご参照ください。）
- (i) 一部解約の実行の請求の受付は、営業日の午後 3 時（年末年始のような証券取引所が半休日の場合は午前 11 時）までとさせていただきます。なお午後 3 時を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

#### d. 受益証券の保管

- (a) 委託会社が発行する受益証券は、1 口券、10 口券、100 口券、1,000 口券、1 万口券、5 万口券、10 万口券、50 万口券、100 万口券、1,000 万口券および 5,000 万口券の 11 種類とします。  
販売会社は、受益証券を原則として保護預り契約に基づき保管するものとします。  
別に定める契約および保護預り契約に基づいて販売会社が保管する受益証券の種類は、上記に定めるもののほか、1 口の整数倍の口数を表示した受益証券とすることができます。
- (b) 販売会社は、原則として、受益証券を別に定める契約または保護預り契約に基づき、混蔵保管するものとします。
- (c) 「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、受益証券はすべて保護預りとさせていただきます。
- (d) 委託会社は、無記名式の受益証券を喪失した受益者が、当該受益証券の公示催告による除権判決の謄本を添え、委託会社の定める手続きにより再交付を請求したときは、無記名式の受益証券を再交付し、記名式の受益証券を喪失した受益者が、委託会社の定める手続きによって再交付を請求したときは、記名式の受益証券を再交付します。  
また、受益証券を毀損または汚損した受益者が、当該受益証券を添え、委託会社の定める手続きにより再交付を請求したときは、受益証券を再交付します。ただし、真偽を鑑別しがたいときは、上記の無記名式または記名式の受益証券の再交付の手続きを準用します。  
委託会社は、受益証券を再交付するときは、受益者に対して実費を請求することができます。

#### e. 信託期間

当ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日から平成 32 年 12 月 10 日までとします。

#### f. 計算期間

- (a) 当ファンドの計算期間は、毎年 12 月 11 日から翌年 12 月 10 日までとすることを原則とします。ただし、第 1 計算期間は平成 13 年 3 月 16 日から平成 13 年 12 月 10 日までとします。
- (b) 前項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されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、投資信託約款第 5 条に定める信託期間の終了日とします。

#### g. その他

##### 信託の終了

- (a) 委託会社は、監督官庁よりこ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、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

- (b) 委託会社が監督官庁より認可の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、投資信託契約を解約し、信託を終了させます。
- (c) 上記(b)にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、投資信託約款第60条第4項に該当する場合を除き、当該委託会社と受託銀行との間において存続します。
- (d) 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。
- (e) 委託会社は、前項の事項について、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。
- (f) 上記(e)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。
- (g) 上記(f)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、投資信託契約の解約をしません。
- (h) 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、全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。
- (i) 上記(f)から(h)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、上記(f)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。
- (j) 当ファンドの投資信託契約の解約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、自己の有する受益証券を、投資信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

委託会社は、受託銀行が上記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。

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。

#### 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、前項の変更事項のうち、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) 前項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) 前項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、上記(a)の投資信託約款の変更をしません。
- (e) 委託会社は、当該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、全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) 当ファンド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、自己の有する受益証券を、投資信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

委託会社は、受託銀行が上記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。

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。

- (g) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、上記(a)から(e)の規定にしたがいます。

#### 運用報告書等の作成

当ファンドについて、法令の定めるところにより、有価証券報告書の提出が計算期間の終了毎に、半期報告書の提出が計算期間開始6ヵ月経過毎になされます。また委託会社は「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表並びに運用報告書に関する規則」の定めるところにより、計算期間の終了毎に運用報告書を作成し、かつ、知られたる受益者に交付します。

#### 投資信託財産に関する報告

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

#### 受益証券の発行

委託会社は、投資信託約款第8条の規定により分割された受益権を表示する収益分配金交付票付きの無記名式の受益証券を発行します。

#### 受益証券の発行についての受託銀行の認証

- (a) 委託会社は、投資信託約款第11条の規定により受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの投資信託約款に適合する旨の受託銀行の認証を受けなければなりません。
- (b) 前項の認証は、受託銀行の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

#### 受益証券の記名式、無記名式への変更ならびに名義書換手続き

- (a) 委託会社は、受益者が委託会社の定める手続きによって請求したときは、無記名式の受益証券と引換えに記名式の受益証券を、または記名式の受益証券と引換えに無記名式の受益証券を交付します。
- (b) 記名式の受益証券の所持人は、委託会社の定める手続きによって名義書換を委託会社に請求することができます。
- (c) 前項の規定による名義書換の手続きは、投資信託約款第45条に規定する毎計算期間の末日の翌日から15日間停止します。

#### 記名式の受益証券譲渡の対抗要件

記名式の受益証券の譲渡は、上記の規定による名義書換によらなければ、委託会社および受託銀行に対抗することができません。

#### ワラント・新株引受権またはオプションの発行

ワラント・新株引受権またはオプションの発行に基づいてファンド証券を買付ける権利は受益者に付与されません。

#### 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かかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、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。

#### 委託会社の営業の譲渡および承継に伴う取扱い

- (a) 委託会社は、営業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契

約に関する営業を譲渡することがあります。

- (b) 委託会社は、分割により営業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する営業を承継させることがあります。

受託銀行の辞任に伴う取扱い

- (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。この場合、委託会社は、投資信託約款第 60 条の規定にしたがい、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、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

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) 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) 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) 金融機関または証券会社から、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証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるものとします。
- (d) 投資信託財産に属する国債証券のうち振替決済にかかる国債証券については、日本銀行で保管することがあります。この場合、日本銀行においては日本銀行名義で一括登録することがあります。
- (e) 投資信託財産に属する有価証券については、委託会社または受託銀行が必要と認める場合のほか、信託の表示および記載をしません。

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。

当ファンドに係る信託事務の処理の一部について、受託銀行は日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

関係法人との契約の更改に関する手続き

- (a) 販売会社との「証券投資信託受益証券の募集・販売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。）にかか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 ヶ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」にかか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) 上記 (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有価証券報告書を提出することにより開示します。

## (2) 受益者の権利等

- a. 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証券取得申込者とし、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、当初設定にかかる信託の受益権については 120,188,161 口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど追加口数に、それぞれ均等に分割します。委託会社は、受託銀行と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。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。
- b. 収益分配金に対する請求権
  - (a) 収益分配金は、毎計算期間終了日後 1 ヶ月以内の委託会社の指定する日（一般コースの場合は、原則として決算日から起算して 5 営業日目）から収益分配金交付票と引換えに受益者に支払います。
  - (b) 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金を販売会社に支払います。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益証券の売付けを行います。ただし、投資信託約款第 54 条第 4 項により信託の一部解約が行われた場合に、当該受益証券に帰属する収益分配金があるときは、前項の規定に準じて受益者に支払います。
  - (c) 受益者が収益分配金について支払開始日から 5 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が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。
- c. 償還金に対する請求権
  - (a) 償還金は、信託終了日後 1 ヶ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）から受益証券と引換えに受益者に支払います。
  - (b) 受益者が償還金について支払開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が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。
- d. 一部解約の実行の請求権
  - (a) 受益者は、自己の有する受益証券につき、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。
  - (b) 一部解約金は、解約請求受付日から起算して、原則として 5 営業日目から受益者に支払います。
- e. 受益者集会は開催されません。

## 第2 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）ならびに同規則第2条の2に基づき「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表並びに運用報告書に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

当ファンドの中間財務諸表は、「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条の3、第57条の2及び「担保附社債信託法施行細則等の一部を改正する内閣府令」（平成14年内閣府令第17号）附則第10条の規定により、改正前の「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表並びに運用報告書に関する規則」（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、財務諸表および中間財務諸表に掲載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドの第1期計算期間は投資信託約款第45条により、平成13年3月16日から平成13年12月10日までであります。

3. 当ファンドは、証券取引法第193条の2の規定に基づき、第1期計算期間（平成13年3月16日から平成13年12月10日まで）の財務諸表および当中間計算期間（平成13年12月11日から平成14年6月10日まで）の中間財務諸表について、中央青山監査法人による監査を受けております。

その監査報告書および中間監査報告書は、該当する財務諸表および中間財務諸表の直前に添付しております。

監 査 報 告 書

平成 14 年 2 月 18 日

ブルデンシャル投信株式会社

代表取締役社長 長 谷 川 泰 二 殿

中 央 青 山 監



代表社員  
公認会計士  
関与社員

山手



関与社員 公認会計士

大畑



当監査法人は、証券取引法第 193 条の 2 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（以下「ファンド」という。）の平成 13 年 3 月 16 日から平成 13 年 12 月 10 日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表について監査を行った。

この監査に当たって、当監査法人は、一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠し、通常実施すべき監査手続を実施した。

監査の結果、ファンドの採用する会計処理の原則及び手続は、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠し、また、財務諸表の表示方法は、「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）の定めるところに準拠しているものと認められた。

よって、当監査法人は、上記の財務諸表が PRUグッドライフ 2020 の平成 13 年 12 月 10 日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を適正に表示しているものと認める。

ブルデンシャル投信株式会社及びファンドと当監査法人又は関与社員との間には、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.財務諸表

## PRU グッドライフ 2020

## (イ) 貸借対照表

(単位:円)

科 目	期 別	第1期 (平成13年12月10日現在)	
		金	額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン			1,116,226
親投資信託受益証券			138,048,711
流動資産合計			139,164,937
資産合計			139,164,937
負債の部			
流動負債			
未払受託者報酬			27,106
未払委託者報酬			406,573
その他未払費用			1,658
流動負債合計			435,337
負債合計			435,337
純資産の部			
元本			
元本			143,703,688
欠損金			
期末欠損金			4,974,088
(うち当期損失)			(5,407,595)
欠損金合計			4,974,088
純資産合計			138,729,600
負債・純資産合計			139,164,937

## (ロ) 損益及び剰余金計算書

(単位:円)

科 目	期 別	第1期 (自平成13年3月16日 至平成13年12月10日)	
		金	額
経常損益の部			
営業損益の部			
営業収益			
受取利息			95
有価証券売買等損益			4,080,504
営業収益計			4,801,880
営業費用			
受託者報酬			82,634
委託者報酬			1,239,484
その他費用			5,068
営業費用計			1,327,186
営業損失			5,407,595
経常損失			5,407,595
当期損失			5,407,595
一部解約に伴う当期利益分配額			52,770
期首剰余金			-
剰余金増加額			493,448
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)			(493,448)
剰余金減少額			7,171
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)			(7,171)
分配金			-
期末欠損金			4,974,088

重要な会計方針

期別 項目	第1期 (自平成13年3月16日 至平成13年12月10日)
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。

注記事項

(貸借対照表関係)

第1期 (平成13年12月10日現在)	
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	120,188,161 円
期中追加設定元本額	26,453,824 円
期中解約元本額	2,938,297 円

(損益及び剰余金計算書関係)

第1期 (自平成13年3月16日 至平成13年12月10日)	
1. 資産運用の権限を再委託又は一部再委託する場合の当該委託費用	253,669 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利益分配後の配当等収益から費用を控除した額(530,419円)、解約に伴う当期利益分配後の有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(37,815円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は568,234円(1万口当たり39.54円)であります。分配を行っておりません。	

(有価証券関係)

第1期(平成13年12月10日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	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	138,048,711	3,999,483
合計	138,048,711	3,999,483

(デリバティブ取引等関係)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第1期 (平成13年12月10日現在)	
1口当たり純資産額	0.9654 円
(1万口当たり純資産額)	9,654 円)

(八) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	銘柄数比率	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	日本円	PRU国内株式マザーファンド		41,498,281	34,937,402	
		PRU国内債券マザーファンド		67,609,088	68,163,482	
		PRU海外株式マザーファンド		25,009,931	24,462,213	
		PRU海外債券マザーファンド		9,868,814	10,485,614	
	計	銘柄数：	4	143,986,114	138,048,711	
		組入時価比率：	99.5%		100.0%	
	合計				138,048,711	
株式以外計					138,048,711	

(注1) 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す。

(注2) 親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 有価証券先物取引等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とおりであります。

「PRU 国内株式マザーファンド」の状況  
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)

科 目	(平成13年12月10日現在)	
	金	額
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		153,625,603
株式		2,377,472,160
未収入金		199,663
未収配当金		1,513,584
未収利息		4
前受金		1,210,000
差入委託証拠金		4,290,000
流動資産合計		2,538,311,014
資産合計		2,538,311,014
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,311,200
未払金		1,797,400
流動負債合計		3,108,600
負債合計		3,108,600
純資産の部		
元本		
元本		3,011,424,320
欠損金		
欠損金		476,221,906
欠損金合計		476,221,906
純資産合計		2,535,202,414
負債・純資産合計		2,650,951,014

重要な会計方針

対象年月日 項目	( 自 平成13年 3月16日 ) ( 至 平成13年12月10日 )
1.有価証券の評 価基準及び 評価方法	<p>株式</p> <p>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。</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券は原則として、証券取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる最終相場）で評価しております。</p> <p>計算期間末日に当該証券取引所の最終相場がない場合は、当該証券取引所における直近の最終相場、もしくは当該証券取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券</p> <p>当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券</p> <p>適正な時価を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2.デリバティブ 等の評価基 準及び評価 方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p>
3.収益及び費用 の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>受取配当金は原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>

注記事項

( 貸借対照表関係 )

( 平成13年12月10日現在 )	
1. 本有価証券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	3,000,000,000 円
同期中における追加設定元本額	372,227,468 円
同期中における解約元本額	360,803,148 円
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	2,725,531,821 円
PRU グッドライフ2010	81,090,861 円
PRU グッドライフ2020	41,498,281 円
PRU グッドライフ2030	54,245,829 円
PRU グッドライフ2040	107,474,885 円
PRU グッドライフ2010 ( 年金 )	148,093 円
PRU グッドライフ2020 ( 年金 )	309,464 円
PRU グッドライフ2030 ( 年金 )	476,582 円
PRU グッドライフ2040 ( 年金 )	648,504 円
	計 3,011,424,320 円
2. 同ファンドの計算期間は、開示対象ファンドの計算期間とは異なるため、当期損失の金額を表示しておりません。	

(有価証券関係)  
(平成13年12月10日現在)  
売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた 評価差額
株式	2,377,472,160	55,122,984
合計	2,377,472,160	55,122,984

(デリバティブ取引等関係)  
取引の状況に関する事項

〔 自 平成13年 3月16日 至 平成13年12月10日 〕	
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。
2. 取引に対する取組みと利用目的	トピックスの株価指数先物取引を主要投資対象としております。
3. 取引に係るリスクの内容	株価指数先物取引に係る主要なリスクは株価の変動による株価変動リスクであります。
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。 なお、リスク管理はデリバティブだけに限定しては行っておりません。デリバティブと現物資産等を統合し、各信託財産全体でのリスク管理を、行っております。
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

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)

区分	種類	(平成13年12月10日現在)			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	113,951,200	-	112,640,000	1,311,200
	合計	113,951,200	-	112,640,000	1,311,200

(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。

(1口当たり情報)

(平成13年12月10日現在)	
本有価証券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	0.8419 円
	(1万口当たり純資産額 8,419 円)
なお、純資産額は、投資信託財産純資産総額を用いております。	

## (八) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## 株式

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
株式	日本円	極洋	1,000	136.00	136,000	
		二チ口	1,000	161.00	161,000	
		日本水産	2,000	188.00	376,000	
		マル八	3,000	120.00	360,000	
		サカタのタネ	500	1,563.00	781,500	
		ホクト産業	200	5,000.00	1,000,000	
		三井鉱山	1,000	73.00	73,000	
		住友石炭鉱業	2,000	43.00	86,000	
		日鉄鉱業	1,000	213.00	213,000	
		帝国石油	3,000	497.00	1,491,000	
		アラビア石油	400	562.00	224,800	
		関東天然瓦斯開発	1,000	492.00	492,000	
		大成建設	9,000	322.00	2,898,000	
		大林組	7,000	410.00	2,870,000	
		清水建設	8,000	460.00	3,680,000	
		フジタ	4,000	18.00	72,000	
		長谷工コーポレーション	12,000	22.00	264,000	
		鹿島建設	9,000	375.00	3,375,000	
		不動建設	1,000	70.00	70,000	
		鉄建建設	1,000	116.00	116,000	
		安藤建設	1,000	154.00	154,000	
		西松建設	2,000	400.00	800,000	
		三井建設	1,000	44.00	44,000	
		大豊建設	1,000	134.00	134,000	
		住友建設	1,000	50.00	50,000	
		前田建設工業	2,000	404.00	808,000	
		奥村組	2,000	361.00	722,000	
		大日本土木	1,000	98.00	98,000	
		間組	3,000	23.00	69,000	
		東急建設	7,000	57.00	399,000	
		戸田建設	3,000	350.00	1,050,000	
		熊谷組	3,000	18.00	54,000	
		北野建設	1,000	151.00	151,000	
		三井ホーム	1,000	390.00	390,000	
		大東建託	1,200	1,970.00	2,364,000	
		日本鋪道	2,000	524.00	1,048,000	
		前田道路	2,000	430.00	860,000	
		日本道路	1,000	155.00	155,000	
		東亜建設工業	1,000	115.00	115,000	
		青木建設	4,000	2.00	8,000	
		東洋建設	1,000	58.00	58,000	
		五洋建設	3,000	111.00	333,000	
		大成ロテック	1,000	146.00	146,000	
		住友林業	2,000	695.00	1,390,000	
		日本基礎技術	300	423.00	126,900	
		日成ビルド工業	1,000	177.00	177,000	
		ニッセキハウス工業	2,000	43.00	86,000	
		エス・バイ・エル	1,000	137.00	137,000	
		殖産住宅相互	2,000	36.00	72,000	
		ミサワホーム	1,000	272.00	272,000	
		ナショナル住宅産業	1,000	515.00	515,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		大和ハウス工業	5,000	720.00	3,600,000	
		ライト工業	500	405.00	202,500	
		積水ハウス	6,000	920.00	5,520,000	
		ユアテック	1,000	379.00	379,000	
		中電工	1,000	1,860.00	1,860,000	
		関電工	2,000	567.00	1,134,000	
		きんでん	2,000	640.00	1,280,000	
		トーエネック	2,000	439.00	878,000	
		日本コムシス	1,000	820.00	820,000	
		住友電設	300	493.00	147,900	
		日本電設工業	1,000	444.00	444,000	
		協和エクシオ	1,000	778.00	778,000	
		日本電話施設	1,000	364.00	364,000	
		九電工	1,000	432.00	432,000	
		三機工業	1,000	610.00	610,000	
		日揮	3,000	860.00	2,580,000	
		中外炉工業	1,000	228.00	228,000	
		高砂熱学工業	1,000	651.00	651,000	
		日立プラント建設	1,000	360.00	360,000	
		日本電気システム建設	500	1,415.00	707,500	
		東芝プラント建設	1,000	220.00	220,000	
		ショーボンド建設	300	1,192.00	357,600	
		東洋エンジニアリング	1,000	122.00	122,000	
		千代田化工建設	1,000	108.00	108,000	
		日本製粉	1,000	271.00	271,000	
		日清製粉	2,000	780.00	1,560,000	
		昭和産業	2,000	229.00	458,000	
		日本農産工業	1,000	159.00	159,000	
		日本甜菜製糖	1,000	150.00	150,000	
		新三井製糖	1,000	203.00	203,000	
		森永製菓	2,000	215.00	430,000	
		明治製菓	3,000	515.00	1,545,000	
		中村屋	1,000	266.00	266,000	
		江崎グリコ	1,000	583.00	583,000	
		不二家	1,000	191.00	191,000	
		山崎製パン	2,000	754.00	1,508,000	
		明治乳業	2,000	338.00	676,000	
		雪印乳業	2,000	200.00	400,000	
		森永乳業	2,000	265.00	530,000	
		ヤクルト本社	1,000	979.00	979,000	
		プリマハム	1,000	60.00	60,000	
		日本ハム	2,000	1,225.00	2,450,000	
		伊藤ハム	2,000	317.00	634,000	
		丸大食品	1,000	105.00	105,000	
		米久	500	715.00	357,500	
		サッポロビール	3,000	338.00	1,014,000	
		アサヒビール	4,000	1,151.00	4,604,000	
		麒麟麦酒	8,000	853.00	6,824,000	
		寶酒造	2,000	1,158.00	2,316,000	
		メルシャン	1,000	235.00	235,000	
		三国コカ・コーラボトリング	1,000	1,190.00	1,190,000	
		近畿コカ・コーラボトリング	1,000	978.00	978,000	
		四国コカ・コーラボトリング	200	1,098.00	219,600	
		コカ・コーラウエストジャパン	800	2,500.00	2,000,000	
		コカ・セントラルジャパン	1	744,000.00	744,000	
		カルピス	1,000	528.00	528,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		伊藤園	400	5,550.00	2,220,000	
		キーコーヒー	400	1,540.00	616,000	
		キリンビバレッジ	500	2,140.00	1,070,000	
		アサヒ飲料	500	630.00	315,000	
		ホーネンコーポレーション	1,000	182.00	182,000	
		日清製油	1,000	345.00	345,000	
		不二製油	1,000	1,225.00	1,225,000	
		キッコーマン	1,000	707.00	707,000	
		味の素	5,000	1,181.00	5,905,000	
		キュービー	1,000	1,090.00	1,090,000	
		ハウス食品	1,000	1,062.00	1,062,000	
		カゴメ	1,000	996.00	996,000	
		焼津水産化学工業	100	1,670.00	167,000	
		ニチレイ	3,000	313.00	939,000	
		加ト吉	500	2,245.00	1,122,500	
		東洋水産	1,000	905.00	905,000	
		日清食品	1,100	2,540.00	2,794,000	
		ロック・フィールド	200	2,890.00	578,000	
		日本たばこ産業	6	711,000.00	4,266,000	
		ミヨシ油脂	1,000	225.00	225,000	
		ゲンゼ	2,000	450.00	900,000	
		東洋紡績	6,000	164.00	984,000	
		ユニチカ	3,000	68.00	204,000	
		日清紡績	2,000	494.00	988,000	
		倉敷紡績	2,000	182.00	364,000	
		大和紡績	1,000	83.00	83,000	
		日東紡績	1,000	95.00	95,000	
		日本毛織	1,000	509.00	509,000	
		帝人	8,000	451.00	3,608,000	
		東レ	12,000	312.00	3,744,000	
		東邦レーヨン	1,000	87.00	87,000	
		三菱レイヨン	6,000	322.00	1,932,000	
		クラレ	3,000	802.00	2,406,000	
		住江織物	1,000	158.00	158,000	
		日本バイリーン	1,000	225.00	225,000	
		アツギ	1,000	73.00	73,000	
		セーレン	1,000	273.00	273,000	
		ワコール	1,000	1,088.00	1,088,000	
		ホギメディカル	100	6,200.00	620,000	
		ワールド	500	3,800.00	1,900,000	
		ニチメンインフィニティ	100	1,352.00	135,200	
		三陽商会	1,000	567.00	567,000	
		オンワード樫山	1,000	1,280.00	1,280,000	
		レナウン	1,000	53.00	53,000	
		東京スタイル	1,000	1,055.00	1,055,000	
		デザート	1,000	199.00	199,000	
		東海パルプ	1,000	419.00	419,000	
		王子製紙	9,000	568.00	5,112,000	
		三菱製紙	2,000	198.00	396,000	
		北越製紙	1,000	610.00	610,000	
		日本板紙	1,000	156.00	156,000	
		中越パルプ工業	2,000	195.00	390,000	
		大王製紙	1,000	856.00	856,000	
		紀州製紙	1,000	158.00	158,000	
		日本ユニパックホールディング	9	589,000.00	5,301,000	
		レンゴー	3,000	266.00	798,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		トーマク	1,000	221.00	221,000	
		鐘紡	4,000	174.00	696,000	
		旭化成工業	13,000	437.00	5,681,000	
		昭和電工	11,000	159.00	1,749,000	
		住友化学工業	15,000	445.00	6,675,000	
		日本化成	1,000	156.00	156,000	
		住友精化	1,000	235.00	235,000	
		三菱化学	18,000	266.00	4,788,000	
		日産化学工業	2,000	641.00	1,282,000	
		ラサ工業	1,000	175.00	175,000	
		呉羽化学工業	2,000	374.00	748,000	
		石原産業	3,000	186.00	558,000	
		日本曹達	1,000	314.00	314,000	
		東ソー	5,000	287.00	1,435,000	
		トクヤマ	2,000	365.00	730,000	
		セントラル硝子	2,000	685.00	1,370,000	
		東亜合成	1,000	194.00	194,000	
		ダイソー	1,000	221.00	221,000	
		関東電化工業	1,000	255.00	255,000	
		電気化学工業	4,000	285.00	1,140,000	
		信越化学工業	3,400	4,810.00	16,354,000	
		堺化学工業	1,000	407.00	407,000	
		日本エア・リキード	1,000	529.00	529,000	
		エア・ウォーター	1,000	550.00	550,000	
		大阪酸素工業	1,000	135.00	135,000	
		日本酸素	3,000	321.00	963,000	
		日本化学工業	1,000	191.00	191,000	
		日本パーカライジング	1,000	319.00	319,000	
		高圧ガス工業	1,000	318.00	318,000	
		四国化成工業	1,000	427.00	427,000	
		大陽東洋酸素	1,000	236.00	236,000	
		ステラケミファ	100	1,939.00	193,900	
		日本触媒	2,000	484.00	968,000	
		大日精化工業	1,000	372.00	372,000	
		鐘淵化学工業	3,000	716.00	2,148,000	
		三菱瓦斯化学	3,000	210.00	630,000	
		三井化学	7,000	405.00	2,835,000	
		J S R	2,000	856.00	1,712,000	
		東京応化工業	400	1,708.00	683,200	
		日本合成化学工業	1,000	122.00	122,000	
		ダイセル化学工業	3,000	374.00	1,122,000	
		住友ベークライト	2,000	829.00	1,658,000	
		積水化学工業	5,000	317.00	1,585,000	
		日本ゼオン	2,000	442.00	884,000	
		アイカ工業	1,000	776.00	776,000	
		宇部興産	6,000	146.00	876,000	
		三菱樹脂	1,000	167.00	167,000	
		タキロン	1,000	285.00	285,000	
		旭有機材工業	1,000	293.00	293,000	
		日立化成工業	2,000	1,353.00	2,706,000	
		リケンテクノス	1,000	321.00	321,000	
		大倉工業	1,000	355.00	355,000	
		積水化成品工業	1,000	207.00	207,000	
		群栄化学工業	1,000	139.00	139,000	
		日本化薬	2,000	490.00	980,000	
		新日鐵化学	2,000	139.00	278,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		旭電化工業	1,000	730.00	730,000	
		日本油脂	2,000	263.00	526,000	
		花王	5,000	2,590.00	12,950,000	
		三洋化成工業	1,000	725.00	725,000	
		大日本塗料	1,000	151.00	151,000	
		日本ペイント	2,000	284.00	568,000	
		関西ペイント	2,000	281.00	562,000	
		中国塗料	1,000	258.00	258,000	
		太陽インキ製造	200	3,800.00	760,000	
		大日本インキ化学工業	7,000	173.00	1,211,000	
		サカタインクス	1,000	261.00	261,000	
		東洋インキ製造	2,000	246.00	492,000	
		富士写真フイルム	4,000	4,270.00	17,080,000	
		コニカ	3,000	732.00	2,196,000	
		資生堂	3,000	1,250.00	3,750,000	
		ライオン	2,000	470.00	940,000	
		高砂香料工業	1,000	547.00	547,000	
		ミルボン	100	2,715.00	271,500	
		ファンケル	200	5,460.00	1,092,000	
		コーセー	300	3,650.00	1,095,000	
		コニシ	200	1,075.00	215,000	
		長谷川香料	400	1,410.00	564,000	
		小林製薬	200	4,820.00	964,000	
		クミアイ化学工業	1,000	157.00	157,000	
		日本農薬	1,000	162.00	162,000	
		アキレス	1,000	157.00	157,000	
		日東電工	1,500	2,860.00	4,290,000	
		前澤化成工業	100	1,249.00	124,900	
		信越ポリマー	1,000	384.00	384,000	
		東リ	1,000	196.00	196,000	
		ニフコ	1,000	985.00	985,000	
		日本バルカー工業	1,000	130.00	130,000	
		ユニ・チャーム	600	3,000.00	1,800,000	
		協和醗酵工業	4,000	636.00	2,544,000	
		三共	4,000	2,035.00	8,140,000	
		武田薬品工業	7,000	5,380.00	37,660,000	
		山之内製薬	3,000	3,160.00	9,480,000	
		第一製薬	2,000	2,530.00	5,060,000	
		大日本製薬	1,000	1,278.00	1,278,000	
		塩野義製薬	3,000	1,994.00	5,982,000	
		田辺製薬	3,000	1,155.00	3,465,000	
		三菱ウェルファーマ	3,000	1,440.00	4,320,000	
		藤沢薬品工業	3,000	2,765.00	8,295,000	
		萬有製薬	2,000	1,910.00	3,820,000	
		日本新薬	1,000	602.00	602,000	
		富山化学工業	1,000	409.00	409,000	
		中外製薬	2,000	1,515.00	3,030,000	
		科研製薬	1,000	714.00	714,000	
		エーザイ	2,000	2,900.00	5,800,000	
		小野薬品工業	1,000	3,930.00	3,930,000	
		日研化学	1,000	296.00	296,000	
		久光製薬	1,000	1,943.00	1,943,000	
		持田製薬	1,000	810.00	810,000	
		大正製薬	3,000	2,300.00	6,900,000	
		参天製薬	1,000	1,538.00	1,538,000	
		エスエス製薬	1,000	990.00	990,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		扶桑薬品工業	1,000	445.00	445,000	
		ツムラ	1,000	504.00	504,000	
		キッセイ薬品工業	1,000	1,797.00	1,797,000	
		鳥居薬品	300	1,980.00	594,000	
		杏林製薬	500	3,030.00	1,515,000	
		日石三菱	13,000	541.00	7,033,000	
		昭和シェル石油	3,000	707.00	2,121,000	
		コスモ石油	4,000	197.00	788,000	
		東燃ゼネラル石油	5,000	852.00	4,260,000	
		ジャパンエナジー	9,000	150.00	1,350,000	
		横浜ゴム	3,000	300.00	900,000	
		東洋ゴム工業	1,000	182.00	182,000	
		オーツタイヤ	1,000	153.00	153,000	
		ブリヂストン	7,000	1,330.00	9,310,000	
		住友ゴム工業	2,000	560.00	1,120,000	
		オカモト	1,000	248.00	248,000	
		ニッタ	400	900.00	360,000	
		東海ゴム工業	1,000	796.00	796,000	
		三ツ星ベルト	1,000	297.00	297,000	
		バンドー化学	1,000	232.00	232,000	
		旭硝子	10,000	733.00	7,330,000	
		日本板硝子	4,000	518.00	2,072,000	
		日本山村硝子	1,000	184.00	184,000	
		東芝セラミックス	1,000	249.00	249,000	
		日本電気硝子	1,000	1,012.00	1,012,000	
		住友大阪セメント	3,000	199.00	597,000	
		太平洋セメント	7,000	165.00	1,155,000	
		東海カーボン	1,000	230.00	230,000	
		日本カーボン	1,000	94.00	94,000	
		ノリタケカンパニーリミテド	1,000	525.00	525,000	
		東陶機器	4,000	645.00	2,580,000	
		日本碍子	3,000	973.00	2,919,000	
		日本特殊陶業	2,000	963.00	1,926,000	
		M A R U W A	100	1,824.00	182,400	
		品川白煉瓦	1,000	182.00	182,000	
		黒崎播磨	1,000	112.00	112,000	
		ニチアス	1,000	244.00	244,000	
		ニチハ	300	1,030.00	309,000	
		新日本製鐵	55,000	170.00	9,350,000	
		川崎製鐵	26,000	122.00	3,172,000	
		日本鋼管	29,000	81.00	2,349,000	
		住友金属工業	31,000	42.00	1,302,000	
		神戸製鋼所	22,000	50.00	1,100,000	
		日新製鋼	9,000	51.00	459,000	
		中山製鋼所	1,000	88.00	88,000	
		合同製鐵	1,000	72.00	72,000	
		東京製鐵	1,900	337.00	640,300	
		大和工業	1,000	475.00	475,000	
		大阪製鐵	400	503.00	201,200	
		淀川製鋼所	1,000	246.00	246,000	
		東洋鋼鈹	1,000	259.00	259,000	
		丸一鋼管	1,000	1,322.00	1,322,000	
		大同特殊鋼	4,000	217.00	868,000	
		日本金属工業	1,000	60.00	60,000	
		日本冶金工業	1,000	32.00	32,000	
		山陽特殊製鋼	1,000	127.00	127,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		愛知製鋼	2,000	638.00	1,276,000	
		日立金属	3,000	394.00	1,182,000	
		大太平洋金属	1,000	67.00	67,000	
		日本重化学工業	1,000	41.00	41,000	
		日本電工	1,000	188.00	188,000	
		栗本鐵工所	2,000	259.00	518,000	
		三菱製鋼	1,000	74.00	74,000	
		日本軽金属	6,000	68.00	408,000	
		三井金属鉱業	5,000	449.00	2,245,000	
		東邦亜鉛	1,000	167.00	167,000	
		三菱マテリアル	9,000	182.00	1,638,000	
		住友金属鉱山	5,000	422.00	2,110,000	
		同和鉱業	2,000	533.00	1,066,000	
		古河機械金属	2,000	112.00	224,000	
		日鉱金属	3,000	397.00	1,191,000	
		志村化工	1,000	194.00	194,000	
		住友軽金属工業	1,000	64.00	64,000	
		三菱伸銅	1,000	116.00	116,000	
		古河電気工業	6,000	766.00	4,596,000	
		住友電気工業	6,000	920.00	5,520,000	
		フジクラ	3,000	523.00	1,569,000	
		三菱電線工業	1,000	146.00	146,000	
		昭和電線電纜	1,000	108.00	108,000	
		日立電線	4,000	483.00	1,932,000	
		リョービ	1,000	135.00	135,000	
		東洋製罐	2,000	1,569.00	3,138,000	
		北海製罐	1,000	243.00	243,000	
		三和シャッター工業	2,000	285.00	570,000	
		文化シャッター	1,000	256.00	256,000	
		三協アルミニウム工業	2,000	43.00	86,000	
		INAXシステムホールディングス	2,848	1,620.00	4,613,760	
		長府製作所	300	1,530.00	459,000	
		リンナイ	500	2,210.00	1,105,000	
		東京製鋼	1,000	79.00	79,000	
		日本発條	2,000	270.00	540,000	
		中央発條	1,000	372.00	372,000	
		日本製鋼所	2,000	84.00	168,000	
		日立ツール	500	450.00	225,000	
		三浦工業	400	1,730.00	692,000	
		タクマ	1,000	941.00	941,000	
		ツガミ	1,000	155.00	155,000	
		オークマ	1,000	206.00	206,000	
		東芝機械	1,000	238.00	238,000	
		アマダマシニックス	1,000	222.00	222,000	
		アマダ	3,000	515.00	1,545,000	
		アイダエンジニアリング	1,000	377.00	377,000	
		牧野フライス製作所	1,000	370.00	370,000	
		オーエスジー	1,000	440.00	440,000	
		東芝タンガロイ	1,000	267.00	267,000	
		旭ダイヤモンド工業	1,000	553.00	553,000	
		森精機製作所	1,000	866.00	866,000	
		ディスコ	300	6,350.00	1,905,000	
		日東工器	200	1,790.00	358,000	
		豊田工機	1,000	463.00	463,000	
		帝人製機	1,000	241.00	241,000	
		島精機製作所	300	2,120.00	636,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		S M C	600	12,800.00	7,680,000	
		新川	200	2,090.00	418,000	
		ユニオンツール	200	5,650.00	1,130,000	
		オイレス工業	200	1,685.00	337,000	
		サトー	300	3,040.00	912,000	
		小松製作所	8,000	413.00	3,304,000	
		住友重機械工業	4,000	66.00	264,000	
		日立建機	1,000	318.00	318,000	
		井関農機	2,000	47.00	94,000	
		T O W A	200	1,160.00	232,000	
		クボタ	12,000	317.00	3,804,000	
		三菱化工機	1,000	139.00	139,000	
		東京機械製作所	1,000	366.00	366,000	
		新東工業	1,000	281.00	281,000	
		小森コーポレーション	1,000	1,365.00	1,365,000	
		荏原製作所	3,000	861.00	2,583,000	
		ダイキン工業	2,000	2,140.00	4,280,000	
		オルガノ	1,000	450.00	450,000	
		トーヨーカネツ	1,000	79.00	79,000	
		栗田工業	1,000	1,514.00	1,514,000	
		椿本チエイン	1,000	307.00	307,000	
		T C M	1,000	300.00	300,000	
		日機装	1,000	538.00	538,000	
		ダイフク	1,000	535.00	535,000	
		タダノ	1,000	168.00	168,000	
		フジテック	1,000	432.00	432,000	
		シーケーディ	1,000	360.00	360,000	
		平和	1,000	1,655.00	1,655,000	
		S A N K Y O	900	3,720.00	3,348,000	
		マースエンジニアリング	100	2,985.00	298,500	
		高砂電器産業	100	1,260.00	126,000	
		サミー	400	3,120.00	1,248,000	
		アマノ	1,000	776.00	776,000	
		J U K I	1,000	134.00	134,000	
		サンデン	1,000	372.00	372,000	
		蛇の目ミシン工業	1,000	60.00	60,000	
		ブラザー工業	2,000	361.00	722,000	
		マックス	1,000	1,066.00	1,066,000	
		リケン	1,000	301.00	301,000	
		大豊工業	200	920.00	184,000	
		日本精工	5,000	457.00	2,285,000	
		N T N	3,000	210.00	630,000	
		光洋精工	2,000	424.00	848,000	
		不二越	1,000	136.00	136,000	
		ツバキ・ナカシマ	500	1,058.00	529,000	
		日本トムソン	1,000	695.00	695,000	
		T H K	1,000	2,100.00	2,100,000	
		ユーシン精機	200	3,700.00	740,000	
		前澤工業	200	716.00	143,200	
		キッツ	1,000	156.00	156,000	
		マキタ	1,000	708.00	708,000	
		日立造船	7,000	58.00	406,000	
		三菱重工業	27,000	305.00	8,235,000	
		石川島播磨重工業	10,000	154.00	1,540,000	
		イビデン	1,000	1,810.00	1,810,000	
		ミネベア	3,000	760.00	2,280,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		日立製作所	27,000	915.00	24,705,000	
		東芝	26,000	516.00	13,416,000	
		三菱電機	19,000	527.00	10,013,000	
		富士電機	6,000	277.00	1,662,000	
		安川電機	2,000	500.00	1,000,000	
		神鋼電機	1,000	132.00	132,000	
		明電舎	2,000	213.00	426,000	
		エネサーブ	200	4,980.00	996,000	
		日立工機	2,000	367.00	734,000	
		松下精工	1,000	465.00	465,000	
		東芝テック	2,000	308.00	616,000	
		マブチモーター	400	10,500.00	4,200,000	
		日本電産	500	7,090.00	3,545,000	
		高岳製作所	1,000	131.00	131,000	
		ダイヘン	1,000	136.00	136,000	
		日新電機	1,000	172.00	172,000	
		オムロン	2,000	1,835.00	3,670,000	
		日東工業	400	920.00	368,000	
		和泉電気	500	629.00	314,500	
		日本電気	13,000	1,337.00	17,381,000	
		富士通	16,000	1,015.00	16,240,000	
		沖電気工業	5,000	439.00	2,195,000	
		岩崎通信機	1,000	170.00	170,000	
		NECインフロンティア	1,000	412.00	412,000	
		電気興業	1,000	500.00	500,000	
		サンケン電気	1,000	609.00	609,000	
		東洋通信機	1,000	460.00	460,000	
		富士通電装	400	715.00	286,000	
		アイホン	200	1,474.00	294,800	
		日本信号	1,000	332.00	332,000	
		京三製作所	1,000	233.00	233,000	
		マスプロ電工	200	1,193.00	238,600	
		日本無線	1,000	432.00	432,000	
		松下電器産業	17,000	1,540.00	26,180,000	
		シャープ	9,000	1,606.00	14,454,000	
		アンリツ	1,000	1,264.00	1,264,000	
		富士通ゼネラル	1,000	315.00	315,000	
		日立国際電気	1,000	544.00	544,000	
		ソニー	7,500	6,030.00	45,225,000	
		トーキン	1,000	534.00	534,000	
		アイワ	1,200	240.00	288,000	
		TDK	1,100	6,550.00	7,205,000	
		三洋電機	16,000	674.00	10,784,000	
		ケンウッド	1,000	81.00	81,000	
		ミツミ電機	600	1,697.00	1,018,200	
		タムラ製作所	1,000	284.00	284,000	
		アルプス電気	2,000	823.00	1,646,000	
		パイオニア	1,400	2,980.00	4,172,000	
		日本電波工業	200	2,330.00	466,000	
		松下通信工業	1,600	4,600.00	7,360,000	
		九州松下電器	2,000	823.00	1,646,000	
		松下寿電子工業	1,000	914.00	914,000	
		日本コロムビア	1,000	126.00	126,000	
		日本ビクター	2,000	361.00	722,000	
		クラリオン	1,000	89.00	89,000	
		SMK	1,000	331.00	331,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		ヨコオ	200	840.00	168,000	
		東光	1,000	309.00	309,000	
		ティアック	1,000	142.00	142,000	
		ホシデン	1,000	2,530.00	2,530,000	
		ヒロセ電機	300	10,690.00	3,207,000	
		日本航空電子工業	1,000	502.00	502,000	
		日立マクセル	1,000	1,620.00	1,620,000	
		アルパイン	1,000	1,290.00	1,290,000	
		スミダコーポレーション	200	2,040.00	408,000	
		島田理化工業	200	842.00	168,400	
		アイコム	100	1,031.00	103,100	
		船井電機	300	9,500.00	2,850,000	
		横河電機	2,000	1,070.00	2,140,000	
		新電元工業	1,000	360.00	360,000	
		山武	1,000	1,045.00	1,045,000	
		アドバンテスト	900	8,750.00	7,875,000	
		キーエンス	300	23,410.00	7,023,000	
		シスメックス	200	2,415.00	483,000	
		メガチップス	300	4,590.00	1,377,000	
		東京電波	100	1,623.00	162,300	
		コーセル	200	1,925.00	385,000	
		メルコ	200	1,237.00	247,400	
		デンセイ・ラムダ	300	929.00	278,700	
		スタンレー電気	2,000	1,150.00	2,300,000	
		岩崎電気	1,000	276.00	276,000	
		ウシオ電機	1,000	1,610.00	1,610,000	
		日本電池	2,000	253.00	506,000	
		ユアサコーポレーション	1,000	180.00	180,000	
		日本デジタル研究所	500	1,044.00	522,000	
		山一電機	100	914.00	91,400	
		図研	300	1,010.00	303,000	
		日本電子	1,000	615.00	615,000	
		カシオ計算機	2,000	630.00	1,260,000	
		ファナック	2,000	5,900.00	11,800,000	
		F D K	1,000	320.00	320,000	
		エンブラス	200	2,700.00	540,000	
		ローム	1,000	18,400.00	18,400,000	
		浜松ホトニクス	600	3,250.00	1,950,000	
		三井ハイテック	400	1,004.00	401,600	
		新光電気工業	400	2,605.00	1,042,000	
		京セラ	1,500	9,300.00	13,950,000	
		住友特殊金属	1,000	650.00	650,000	
		太陽誘電	1,000	2,155.00	2,155,000	
		村田製作所	2,000	9,280.00	18,560,000	
		双葉電子工業	400	2,980.00	1,192,000	
		北陸電気工業	1,000	84.00	84,000	
		松下電工	6,000	1,092.00	6,552,000	
		ニチコン	700	1,440.00	1,008,000	
		日本ケミコン	1,000	446.00	446,000	
		K O A	400	1,150.00	460,000	
		市光工業	1,000	192.00	192,000	
		小糸製作所	1,000	436.00	436,000	
		スター精密	1,000	815.00	815,000	
		大日本スクリーン製造	2,000	453.00	906,000	
		キヤノン	7,000	4,400.00	30,800,000	
		リコー	6,000	2,350.00	14,100,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		三協精機製作所	1,000	401.00	401,000	
		東京エレクトロン	1,500	7,390.00	11,085,000	
		豊田紡織	1,000	642.00	642,000	
		ボッシュオートモーティブシステム	2,000	111.00	222,000	
		豊田自動織機製作所	2,600	1,850.00	4,810,000	
		デンソー	7,400	1,754.00	12,979,600	
		東海理化電機製作所	1,000	1,033.00	1,033,000	
		三井造船	6,000	116.00	696,000	
		佐世保重工業	1,000	80.00	80,000	
		川崎重工業	11,000	118.00	1,298,000	
		日本車輛製造	1,000	192.00	192,000	
		日産自動車	32,000	626.00	20,032,000	
		いすゞ自動車	10,000	83.00	830,000	
		トヨタ自動車	29,700	3,080.00	91,476,000	
		日野自動車	4,000	419.00	1,676,000	
		日産ディーゼル工業	1,000	92.00	92,000	
		三菱自動車工業	12,000	209.00	2,508,000	
		トヨタ車体	1,000	1,298.00	1,298,000	
		日産車体	1,000	175.00	175,000	
		関東自動車工業	1,000	748.00	748,000	
		新明和工業	1,000	198.00	198,000	
		小松フォークリフト	1,000	151.00	151,000	
		極東開発工業	300	699.00	209,700	
		トピー工業	1,000	169.00	169,000	
		トキコ	1,000	218.00	218,000	
		東洋ラジエーター	1,000	249.00	249,000	
		曙ブレーキ工業	1,000	198.00	198,000	
		N O K	1,000	580.00	580,000	
		フタバ産業	1,000	1,193.00	1,193,000	
		カヤバ工業	1,000	185.00	185,000	
		シロキ工業	1,000	200.00	200,000	
		カルソニックカンセイ	2,000	294.00	588,000	
		ケーヒン	1,000	1,090.00	1,090,000	
		アイシン精機	2,000	1,271.00	2,542,000	
		マツダ	10,000	202.00	2,020,000	
		ダイハツ工業	4,000	506.00	2,024,000	
		愛知機械工業	1,000	177.00	177,000	
		本田技研工業	7,900	4,770.00	37,683,000	
		スズキ	5,000	1,312.00	6,560,000	
		富士重工業	6,000	522.00	3,132,000	
		ヤマハ発動機	2,000	737.00	1,474,000	
		ショーワ	1,000	917.00	917,000	
		ユニシアジェックス	1,000	148.00	148,000	
		エクセディ	700	570.00	399,000	
		豊田合成	1,000	1,798.00	1,798,000	
		シマノ	1,200	1,540.00	1,848,000	
		テルモ	1,900	1,500.00	2,850,000	
		島津製作所	2,000	317.00	634,000	
		モリテックス	200	1,400.00	280,000	
		東京精密	400	4,770.00	1,908,000	
		ニコン	3,000	1,210.00	3,630,000	
		オリンパス光学工業	2,000	1,781.00	3,562,000	
		H O Y A	1,000	7,900.00	7,900,000	
		ノーリツ鋼機	300	1,730.00	519,000	
		旭光学工業	1,000	182.00	182,000	
		ミノルタ	1,000	161.00	161,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		日本電産コパル	1,000	1,254.00	1,254,000	
		シチズン時計	3,000	658.00	1,974,000	
		リズム時計工業	1,000	101.00	101,000	
		セイコー	1,000	312.00	312,000	
		ニプロ	1,000	1,768.00	1,768,000	
		エイベックス	400	4,190.00	1,676,000	
		トッパン・フォームズ	1,100	2,345.00	2,579,500	
		トミー	200	1,630.00	326,000	
		廣済堂	200	1,096.00	219,200	
		大建工業	1,000	317.00	317,000	
		凸版印刷	6,000	1,161.00	6,966,000	
		大日本印刷	6,000	1,244.00	7,464,000	
		図書印刷	1,000	223.00	223,000	
		共同印刷	1,000	425.00	425,000	
		アシックス	1,000	93.00	93,000	
		ツツミ	300	2,440.00	732,000	
		ローランド	300	1,241.00	372,300	
		ヤマハ	2,000	958.00	1,916,000	
		ピジョン	200	920.00	184,000	
		パラマウントベッド	300	2,655.00	796,500	
		セガ・エンタープライゼス	1,400	2,575.00	3,605,000	
		リンテック	1,000	799.00	799,000	
		バンダイ	500	4,020.00	2,010,000	
		タカラ	1,000	1,090.00	1,090,000	
		任天堂	1,200	23,040.00	27,648,000	
		フランスベッド	1,000	300.00	300,000	
		タカスタンダード	1,000	484.00	484,000	
		コクヨ	1,000	1,097.00	1,097,000	
		ナカバヤシ	1,000	209.00	209,000	
		岡村製作所	2,000	547.00	1,094,000	
		美津濃	1,000	346.00	346,000	
		アデランス	400	3,890.00	1,556,000	
		昭文社	200	1,224.00	244,800	
		インプレス	2	114,000.00	228,000	
		東京電力	11,000	2,630.00	28,930,000	
		中部電力	6,000	2,245.00	13,470,000	
		関西電力	8,000	1,805.00	14,440,000	
		中国電力	3,100	1,822.00	5,648,200	
		北陸電力	1,000	1,794.00	1,794,000	
		東北電力	4,100	1,729.00	7,088,900	
		四国電力	2,300	1,946.00	4,475,800	
		九州電力	3,900	1,895.00	7,390,500	
		北海道電力	1,900	1,669.00	3,171,100	
		東京瓦斯	24,000	336.00	8,064,000	
		大阪瓦斯	20,000	320.00	6,400,000	
		東邦瓦斯	4,000	297.00	1,188,000	
		北海道瓦斯	1,000	256.00	256,000	
		西部瓦斯	2,000	191.00	382,000	
		東武鉄道	7,000	333.00	2,331,000	
		西武鉄道	3,000	1,509.00	4,527,000	
		相模鉄道	3,000	302.00	906,000	
		東京急行電鉄	10,000	390.00	3,900,000	
		京浜急行電鉄	4,000	470.00	1,880,000	
		小田急電鉄	7,000	471.00	3,297,000	
		京王電鉄	6,000	563.00	3,378,000	
		京成電鉄	3,000	378.00	1,134,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		富士急行	1,000	423.00	423,000	
		東日本旅客鉄道	33	589,000.00	19,437,000	
		西日本旅客鉄道	16	485,000.00	7,760,000	
		東海旅客鉄道	18	770,000.00	13,860,000	
		西日本鉄道	3,000	308.00	924,000	
		近畿日本鉄道	14,000	435.00	6,090,000	
		阪急電鉄	7,000	394.00	2,758,000	
		阪神電気鉄道	3,000	302.00	906,000	
		名古屋鉄道	7,000	324.00	2,268,000	
		日本通運	9,000	434.00	3,906,000	
		ヤマト運輸	4,000	2,305.00	9,220,000	
		山九	1,000	96.00	96,000	
		丸全昭和運輸	1,000	226.00	226,000	
		センコー	1,000	245.00	245,000	
		トナミ運輸	1,000	239.00	239,000	
		日本梱包運輸倉庫	1,000	833.00	833,000	
		福山通運	2,000	463.00	926,000	
		西濃運輸	1,000	546.00	546,000	
		神奈川中央交通	1,000	597.00	597,000	
		日立物流	1,000	618.00	618,000	
		日本郵船	11,000	347.00	3,817,000	
		商船三井	10,000	250.00	2,500,000	
		川崎汽船	5,000	160.00	800,000	
		飯野海運	1,000	178.00	178,000	
		第一中央汽船	2,000	42.00	84,000	
		日本航空	15,000	344.00	5,160,000	
		全日本空輸	13,000	321.00	4,173,000	
		パスコ	1,000	260.00	260,000	
		日新	1,000	198.00	198,000	
		三菱倉庫	1,000	922.00	922,000	
		三井倉庫	1,000	250.00	250,000	
		住友倉庫	1,000	319.00	319,000	
		澁澤倉庫	1,000	229.00	229,000	
		日本トランスシティ	1,000	222.00	222,000	
		東洋埠頭	1,000	158.00	158,000	
		上組	2,000	514.00	1,028,000	
		近畿日本ツーリスト	1,000	247.00	247,000	
		日本電信電話	71	455,000.00	32,305,000	
		第二電電	35	298,000.00	10,430,000	
		日本テレコム	26	400,000.00	10,400,000	
		光通信	200	1,009.00	201,800	
		エヌ・ティ・ティ・ドコモ	82	1,580,000.00	129,560,000	
		J S A T	3	720,000.00	2,160,000	
		伊藤忠食品	200	4,050.00	810,000	
		伯東	300	1,759.00	527,700	
		菱食	400	4,400.00	1,760,000	
		クラヤ三星堂	1,300	570.00	741,000	
		アドヴァン	400	1,362.00	544,800	
		アズワン	100	1,371.00	137,100	
		ドウシシャ	100	1,499.00	149,900	
		黒田電気	200	1,613.00	322,600	
		丸文	300	800.00	240,000	
		ハピネット	100	1,208.00	120,800	
		トーメンエレクトロニクス	100	4,250.00	425,000	
		日本エム・ディ・エム	200	3,100.00	620,000	
		マクニカ	100	5,430.00	543,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		伊藤忠商事	12,000	309.00	3,708,000	
		丸紅	13,000	90.00	1,170,000	
		トーマン	6,000	86.00	516,000	
		ニチメン	5,000	87.00	435,000	
		長瀬産業	2,000	546.00	1,092,000	
		蝶理	1,000	80.00	80,000	
		豊田通商	2,000	488.00	976,000	
		三共生興	1,000	243.00	243,000	
		兼松	2,000	133.00	266,000	
		三井物産	14,000	635.00	8,890,000	
		日本紙パルプ商事	2,000	376.00	752,000	
		日立ハイテクノロジーズ	1,000	1,343.00	1,343,000	
		スターゼン	1,000	137.00	137,000	
		シャディ	300	1,400.00	420,000	
		山善	1,000	167.00	167,000	
		住友商事	10,000	615.00	6,150,000	
		三菱商事	13,000	788.00	10,244,000	
		キヤノン販売	1,000	845.00	845,000	
		西華産業	1,000	142.00	142,000	
		日商岩井	8,000	82.00	656,000	
		ユアサ商事	1,000	80.00	80,000	
		阪和興業	1,000	121.00	121,000	
		岩谷産業	1,000	234.00	234,000	
		ナイス日栄	1,000	215.00	215,000	
		昭光通商	1,000	138.00	138,000	
		富士通ビジネスシステム	300	1,050.00	315,000	
		三愛石油	1,000	318.00	318,000	
		稲畑産業	1,000	585.00	585,000	
		G S Iクレオス	1,000	207.00	207,000	
		川鉄商事	1,000	96.00	96,000	
		ミツウロコ	1,000	684.00	684,000	
		シナネン	1,000	513.00	513,000	
		伊藤忠エネクス	1,000	650.00	650,000	
		ザ・トーカイ	1,000	461.00	461,000	
		サンリオ	700	1,100.00	770,000	
		リョーサン	400	1,499.00	599,600	
		東陽テクニカ	300	2,330.00	699,000	
		加賀電子	200	1,355.00	271,000	
		三益半導体工業	200	1,330.00	266,000	
		アズウェル	1,100	432.00	475,200	
		トラスコ中山	400	1,291.00	516,400	
		オートバックスセブン	400	3,000.00	1,200,000	
		イエローハット	300	810.00	243,000	
		日本ビジネスコンピューター	400	1,600.00	640,000	
		バイタルネット	300	730.00	219,000	
		因幡電機産業	300	1,330.00	399,000	
		インパクト二十一	100	1,348.00	134,800	
		ドトールコーヒー	100	6,900.00	690,000	
		ミスミ	300	4,550.00	1,365,000	
		ソフトバンク	2,800	2,560.00	7,168,000	
		スズケン	700	2,150.00	1,505,000	
		ローソン	900	3,840.00	3,456,000	
		CアンドS	800	3,310.00	2,648,000	
		ライトオン	100	950.00	95,000	
		良品計画	300	2,700.00	810,000	
		三城	500	3,500.00	1,750,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		コナカ	200	754.00	150,800	
		マイカル北海道	200	725.00	145,000	
		コジマ	400	1,011.00	404,400	
		ワタミフードサービス	300	2,340.00	702,000	
		ドン・キホーテ	100	7,490.00	749,000	
		西松屋チェーン	100	2,205.00	220,500	
		ゼンシヨー	100	1,350.00	135,000	
		ユニマットオフィスコ	200	1,219.00	243,800	
		サイゼリヤ	300	4,880.00	1,464,000	
		シートゥーネットワーク	100	3,140.00	314,000	
		スギ薬局	100	5,500.00	550,000	
		ファミリーマート	900	2,315.00	2,083,500	
		ケーヨー	900	708.00	637,200	
		ベスト電器	1,000	300.00	300,000	
		西洋フードシステムズ	1,000	333.00	333,000	
		マルエツ	1,000	331.00	331,000	
		すかいらーく	1,000	2,460.00	2,460,000	
		セブン・イレブン・ジャパン	7,000	4,820.00	33,740,000	
		島忠	500	1,950.00	975,000	
		ヨークベニマル	500	3,080.00	1,540,000	
		カスミ	1,000	370.00	370,000	
		東急ストア	1,000	338.00	338,000	
		デオデオ	700	555.00	388,500	
		リンガーハット	200	1,090.00	218,000	
		アオキインターナショナル	500	385.00	192,500	
		コメリ	500	3,140.00	1,570,000	
		青山商事	800	1,280.00	1,024,000	
		しまむら	300	7,780.00	2,334,000	
		ハックキミサワ	500	830.00	415,000	
		三越	5,000	375.00	1,875,000	
		東急百貨店	1,000	97.00	97,000	
		高島屋	3,000	738.00	2,214,000	
		大丸	3,000	530.00	1,590,000	
		松坂屋	1,000	287.00	287,000	
		丸善	1,000	204.00	204,000	
		伊勢丹	2,000	1,252.00	2,504,000	
		阪急百貨店	2,000	774.00	1,548,000	
		パルコ	1,000	516.00	516,000	
		丸井	3,000	1,430.00	4,290,000	
		十字屋	2,000	50.00	100,000	
		井筒屋	1,000	186.00	186,000	
		ダイエー	6,000	106.00	636,000	
		イトーヨーカ堂	3,000	5,710.00	17,130,000	
		イズミヤ	1,000	460.00	460,000	
		イオン	2,000	2,630.00	5,260,000	
		西友	3,000	242.00	726,000	
		ユニー	2,000	1,309.00	2,618,000	
		イズミ	1,000	1,401.00	1,401,000	
		平和堂	1,000	919.00	919,000	
		フジ	400	1,970.00	788,000	
		ヤオコー	200	1,554.00	310,800	
		ゼビオ	400	1,881.00	752,400	
		Olympic	200	1,890.00	378,000	
		ヤマダ電機	300	9,390.00	2,817,000	
		ホームツク	400	679.00	271,600	
		愛眼	200	740.00	148,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		吉野家ディー・アンド・シー	6	189,000.00	1,134,000	
		マツモトキヨシ	200	4,700.00	940,000	
		松屋フーズ	200	2,210.00	442,000	
		ミニストップ	300	1,798.00	539,400	
		カーマ	300	562.00	168,600	
		ダイキ	200	1,054.00	210,800	
		ファーストリテイリング	400	13,150.00	5,260,000	
		ベルーナ	200	4,400.00	880,000	
		みずほホールディングス	75	251,000.00	18,825,000	
		三菱東京フィナンシャルグループ	47	789,000.00	37,083,000	
		UFJホールディングス	39	297,000.00	11,583,000	
		三井住友銀行	46,000	534.00	24,564,000	
		大和銀行	16,000	90.00	1,440,000	
		あさひ銀行	23,000	85.00	1,955,000	
		第四銀行	3,000	423.00	1,269,000	
		北越銀行	1,000	229.00	229,000	
		福岡銀行	5,000	462.00	2,310,000	
		西日本銀行	3,000	340.00	1,020,000	
		札幌北洋ホールディングス	3	542,000.00	1,626,000	
		もみじホールディングス	1	455,000.00	455,000	
		千葉銀行	7,000	397.00	2,779,000	
		横浜銀行	9,000	409.00	3,681,000	
		常陽銀行	7,000	348.00	2,436,000	
		群馬銀行	4,000	544.00	2,176,000	
		足利銀行	5,000	117.00	585,000	
		武蔵野銀行	200	4,200.00	840,000	
		千葉興業銀行	400	739.00	295,600	
		関東銀行	100	1,145.00	114,500	
		東京都民銀行	300	1,030.00	309,000	
		七十七銀行	3,000	552.00	1,656,000	
		青森銀行	2,000	470.00	940,000	
		秋田銀行	2,000	412.00	824,000	
		山形銀行	2,000	555.00	1,110,000	
		岩手銀行	200	3,770.00	754,000	
		東邦銀行	2,000	385.00	770,000	
		みちのく銀行	1,000	670.00	670,000	
		北海道銀行	2,000	105.00	210,000	
		静岡銀行	6,000	937.00	5,622,000	
		十六銀行	3,000	453.00	1,359,000	
		北陸銀行	5,000	138.00	690,000	
		駿河銀行	2,000	612.00	1,224,000	
		八十二銀行	5,000	620.00	3,100,000	
		山梨中央銀行	2,000	368.00	736,000	
		大垣共立銀行	3,000	640.00	1,920,000	
		福井銀行	2,000	340.00	680,000	
		北國銀行	3,000	446.00	1,338,000	
		清水銀行	100	5,500.00	550,000	
		滋賀銀行	2,000	430.00	860,000	
		南都銀行	2,000	381.00	762,000	
		百五銀行	3,000	458.00	1,374,000	
		京都銀行	3,000	520.00	1,560,000	
		紀陽銀行	1,000	248.00	248,000	
		近畿大阪銀行	7,000	61.00	427,000	
		三重銀行	1,000	483.00	483,000	
		池田銀行	200	5,440.00	1,088,000	
		広島銀行	5,000	409.00	2,045,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		山口銀行	2,000	825.00	1,650,000	
		山陰合同銀行	2,000	467.00	934,000	
		中国銀行	2,000	769.00	1,538,000	
		鳥取銀行	1,000	347.00	347,000	
		伊予銀行	3,000	671.00	2,013,000	
		百十四銀行	3,000	694.00	2,082,000	
		四国銀行	2,000	656.00	1,312,000	
		阿波銀行	2,000	552.00	1,104,000	
		鹿児島銀行	1,000	440.00	440,000	
		親和銀行	2,000	331.00	662,000	
		大分銀行	1,000	463.00	463,000	
		宮崎銀行	1,000	366.00	366,000	
		肥後銀行	2,000	380.00	760,000	
		佐賀銀行	1,000	461.00	461,000	
		十八銀行	1,000	470.00	470,000	
		沖縄銀行	100	2,100.00	210,000	
		琉球銀行	200	1,200.00	240,000	
		住友信託銀行	11,000	508.00	5,588,000	
		安田信託銀行	23,000	38.00	874,000	
		中央三井信託銀行	6,000	106.00	636,000	
		長野銀行	1,000	427.00	427,000	
		名古屋銀行	2,000	565.00	1,130,000	
		愛知銀行	100	7,540.00	754,000	
		第三銀行	1,000	453.00	453,000	
		中京銀行	1,000	436.00	436,000	
		東日本銀行	1,000	304.00	304,000	
		福岡シティ銀行	1,000	311.00	311,000	
		愛媛銀行	1,000	453.00	453,000	
		トマト銀行	1,000	315.00	315,000	
		みなと銀行	3,000	311.00	933,000	
		京葉銀行	2,000	310.00	620,000	
		九州銀行	1,000	255.00	255,000	
		栃木銀行	1,000	646.00	646,000	
		北日本銀行	100	5,280.00	528,000	
		香川銀行	1,000	635.00	635,000	
		東和銀行	2,000	380.00	760,000	
		徳島銀行	1,000	699.00	699,000	
		福島銀行	1,000	212.00	212,000	
		大東銀行	1,000	335.00	335,000	
		大和証券グループ本社	11,000	762.00	8,382,000	
		日興コーディアルグループ	15,000	640.00	9,600,000	
		野村ホールディングス	16,000	1,701.00	27,216,000	
		新光証券	7,000	209.00	1,463,000	
		みずほインベスターズ証券	11,000	116.00	1,276,000	
		岡三証券	2,000	414.00	828,000	
		さくらフレンド証券	2,000	173.00	346,000	
		コスモ証券	4,000	85.00	340,000	
		丸三証券	1,000	385.00	385,000	
		東洋証券	1,000	186.00	186,000	
		国際証券	2,000	798.00	1,596,000	
		東海東京証券	3,000	185.00	555,000	
		光世証券	1,000	130.00	130,000	
		つばさ証券	2,000	286.00	572,000	
		水戸証券	1,000	291.00	291,000	
		明光ナショナル証券	1,500	299.00	448,500	
		松井証券株式会社	800	1,954.00	1,563,200	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		小林洋行	100	1,700.00	170,000	
		東京海上火災保険	13,000	880.00	11,440,000	
		三井住友海上火災保険	12,000	593.00	7,116,000	
		日本興亜損害保険	7,000	437.00	3,059,000	
		安田火災海上保険	7,000	768.00	5,376,000	
		日産火災海上保険	2,000	282.00	564,000	
		日新火災海上保険	1,000	226.00	226,000	
		ニッセイ同和損害保険	3,000	502.00	1,506,000	
		日動火災海上保険	4,000	591.00	2,364,000	
		あいおい損害保険	5,000	243.00	1,215,000	
		富士火災海上保険	1,000	216.00	216,000	
		クレディセゾン	1,500	2,600.00	3,900,000	
		ダイエーオーエムシー	2,000	325.00	650,000	
		日本証券金融	1,000	399.00	399,000	
		アイフル	750	9,170.00	6,877,500	
		マイカルカード	300	1,231.00	369,300	
		武富士	1,200	9,250.00	11,100,000	
		三洋電機クレジット	300	3,050.00	915,000	
		リコーリース	200	1,878.00	375,600	
		クレディア	100	1,862.00	186,200	
		シンキ	600	760.00	456,000	
		イオンクレジットサービス	400	7,280.00	2,912,000	
		ニッシン	300	1,995.00	598,500	
		アコム	1,200	9,680.00	11,616,000	
		三洋信販	400	3,200.00	1,280,000	
		プロミス	1,000	6,930.00	6,930,000	
		日栄	900	901.00	810,900	
		日本信販	3,000	150.00	450,000	
		ジャックス	2,000	350.00	700,000	
		オリエントコーポレーション	5,000	124.00	620,000	
		日立キャピタル	1,000	1,890.00	1,890,000	
		セントラルファイナンス	1,000	389.00	389,000	
		オリックス	700	10,850.00	7,595,000	
		ダイヤモンドリース	1,000	1,462.00	1,462,000	
		ジャフコ	400	9,200.00	3,680,000	
		商工ファンド	110	10,640.00	1,170,400	
		三井不動産	7,000	951.00	6,657,000	
		三菱地所	11,000	961.00	10,571,000	
		平和不動産	500	242.00	121,000	
		東京建物	1,000	171.00	171,000	
		ダイビル	1,000	600.00	600,000	
		サンケイビル	1,000	331.00	331,000	
		東急不動産	3,000	143.00	429,000	
		住友不動産	3,000	586.00	1,758,000	
		東宝不動産	1,000	392.00	392,000	
		大京	1,000	78.00	78,000	
		テーオーシー	1,000	645.00	645,000	
		東京楽天地	1,000	366.00	366,000	
		三井不動産販売	1,000	460.00	460,000	
		明和地所	300	1,076.00	322,800	
		住友不動産販売	200	2,660.00	532,000	
		ゴールドクレスト	100	4,620.00	462,000	
		ジョイント・コーポレーション	100	2,765.00	276,500	
		日本工営	1,000	237.00	237,000	
		コナミスポーツ	300	3,620.00	1,086,000	
		サニックス	400	5,460.00	2,184,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		オリエンタルランド	800	8,730.00	6,984,000	
		パーク24	100	7,240.00	724,000	
		クレスコ	100	1,530.00	153,000	
		フジテレビジョン	9	515,000.00	4,635,000	
		ラウンドワン	4	122,000.00	488,000	
		リゾートトラスト	300	3,260.00	978,000	
		オービック	100	25,100.00	2,510,000	
		アルゴ二十一	100	2,040.00	204,000	
		ビー・エム・エル	200	3,180.00	636,000	
		トレンドマイクロ	1,000	3,360.00	3,360,000	
		富士通サポートアンドサービス	500	2,730.00	1,365,000	
		東急コミュニティー	100	1,600.00	160,000	
		日本オラクル	1,000	10,200.00	10,200,000	
		アルファシステムズ	100	5,950.00	595,000	
		シーエーシー	200	4,150.00	830,000	
		トーセ	100	2,250.00	225,000	
		ユー・エス・エス	200	4,300.00	860,000	
		日立ビジネスソリューション	100	1,214.00	121,400	
		伊藤忠テクノサイエンス	500	6,330.00	3,165,000	
		大塚商会	400	2,900.00	1,160,000	
		NECソフト	200	11,020.00	2,204,000	
		総合メディカル	100	3,140.00	314,000	
		電通国際情報サービス	100	9,900.00	990,000	
		日本ユニシス	1,100	774.00	851,400	
		東京放送	1,000	2,000.00	2,000,000	
		日本テレビ放送網	220	31,000.00	6,820,000	
		全国朝日放送	9	210,000.00	1,890,000	
		松竹	1,000	584.00	584,000	
		東宝	200	13,800.00	2,760,000	
		東映	1,000	339.00	339,000	
		ベンチャーリンク	100	6,550.00	655,000	
		エヌ・ティ・ティ・データ	23	492,000.00	11,316,000	
		ベルシステム24	40	48,500.00	1,940,000	
		共立メンテナンス	100	3,020.00	302,000	
		スクウェア	500	1,510.00	755,000	
		公益社	100	3,300.00	330,000	
		テクモ	100	1,142.00	114,200	
		光栄	200	3,580.00	716,000	
		オークネット	100	1,400.00	140,000	
		よみうりランド	1,000	380.00	380,000	
		東京都競馬	3,000	113.00	339,000	
		東京ドーム	1,000	290.00	290,000	
		データ通信システム	100	3,760.00	376,000	
		エニックス	600	2,260.00	1,356,000	
		シーイーシー	200	1,182.00	236,400	
		日立ソフトウェアエンジニアリング	600	5,070.00	3,042,000	
		カプコン	500	3,420.00	1,710,000	
		日本空港ビルデング	1,000	920.00	920,000	
		トランス・コスモス	200	4,270.00	854,000	
		住商情報システム	400	3,700.00	1,480,000	
		藤田観光	2,000	456.00	912,000	
		セコム	2,000	6,080.00	12,160,000	
		CSK	600	3,300.00	1,980,000	
		日本システムウエア	100	5,100.00	510,000	
		日立情報システムズ	300	3,480.00	1,044,000	
		アイネス	500	977.00	488,500	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		メイテック	300	3,300.00	990,000	
		T K C	300	1,745.00	523,500	
		アサツーディ・ケイ	400	2,545.00	1,018,000	
		富士ソフト A B C	300	5,570.00	1,671,000	
		東洋情報システム	400	2,955.00	1,182,000	
		ナムコ	500	2,380.00	1,190,000	
		応用地質	300	1,245.00	373,500	
		日本システムディベロップメント	200	5,550.00	1,110,000	
		大和工商リース	2,000	296.00	592,000	
		コナミ	1,100	3,840.00	4,224,000	
		日本電子計算	200	1,134.00	226,800	
		ベネッセコーポレーション	900	3,320.00	2,988,000	
		ジャパンメンテナンス	200	350.00	70,000	
		ダイセキ	200	1,950.00	390,000	
		銘柄数：	1,073		2,377,472,160	
		組入時価比率：	93.8%		100.0%	
					2,377,472,160	

(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す。

株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記事項(デリバティブ取引等関係注記)」に記載しております。

「PRU 国内債券マザーファンド」の状況

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)

科 目	(平成13年12月10日現在)	
	金	額
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		60,520,493
国債証券		1,412,668,560
地方債証券		98,376,660
特殊債券		258,615,760
社債券		282,502,949
未収利息		11,787,538
前払費用		581,408
流動資産合計		2,125,053,368
資産合計		2,125,053,368
負債の部		
流動負債		
未払解約金		39,837
流動負債合計		39,837
負債合計		39,837
純資産の部		
元本		
元本		2,107,678,230
剰余金		
剰余金		17,335,301
剰余金合計		17,335,301
純資産合計		2,125,013,531
負債・純資産合計		2,125,053,368

重要な会計方針

対象年月日 項目	( 自 平成13年 3月16日 ) ( 至 平成13年12月10日 )
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>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。</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券は原則として、証券取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる最終相場）で評価しております。</p> <p>計算期間末日に当該証券取引所の最終相場がない場合は、当該証券取引所における直近の最終相場、もしくは当該証券取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券</p> <p>当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券</p> <p>適正な時価を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

注記事項

(貸借対照表関係)

(平成13年12月10日現在)	
1. 本有価証券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	2,000,000,000 円
同期中における追加設定元本額	550,566,626 円
同期中における解約元本額	442,888,396 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	1,606,635,957 円
PRU グッドライフ2010	379,886,962 円
PRU グッドライフ2020	67,609,088 円
PRU グッドライフ2030	34,940,239 円
PRU グッドライフ2040	16,998,241 円
PRU グッドライフ2010(年金)	694,002 円
PRU グッドライフ2020(年金)	504,195 円
PRU グッドライフ2030(年金)	306,973 円
PRU グッドライフ2040(年金)	102,573 円
	計 2,107,678,230 円
2. 同ファンドの計算期間は、親投資信託受益証券の計算期間とは異なるため、当期損失の金額を表示しておりません。	

(有価証券関係)

(平成13年12月10日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた 評価差額
国債証券	1,412,668,560	2,126,620
地方債券	98,376,660	142,390
特殊債券	258,615,760	65,440
社債券	282,502,949	150,474
合計	2,052,163,929	2,484,924

(デリバティブ取引等関係)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

(平成13年12月10日現在)	
本有価証券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	1.0082 円
	(1万口当たり純資産額 10,082 円)
なお、純資産額は、投資信託財産純資産総額を用いております。	

## (八) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	第179回 利付国債(2年)		52,000,000	52,291,200	
		第54回 利付国債(4年)		39,000,000	39,334,620	
		第55回 利付国債(4年)		54,000,000	54,261,900	
		第2回 利付国債(5年)		79,000,000	81,110,880	
		第14回利付国債(5年)		40,000,000	39,911,200	
		第153回 利付国債(10年)		57,000,000	59,763,930	
		第157回 利付国債(10年)		46,000,000	49,082,000	
		第174回 利付国債(10年)		48,000,000	53,824,800	
		第184回 利付国債(10年)		34,000,000	37,413,940	
		第185回 利付国債(10年)		25,000,000	27,842,750	
		第186回利付国債10年		34,000,000	38,008,600	
		第187回 利付国債(10年)		39,000,000	43,979,520	
		第190回 利付国債(10年)		33,000,000	36,895,650	
		第193回 利付国債(10年)		32,000,000	35,384,000	
		第194回 利付国債(10年)		32,000,000	35,303,680	
		第200回 利付国債(10年)		31,000,000	33,395,060	
		第201回 利付国債(10年)		51,000,000	54,656,700	
		第203回 利付国債(10年)		33,000,000	35,142,030	
		第204回 利付国債(10年)		33,000,000	34,710,390	
		第207回 利付国債(10年)		37,000,000	37,061,050	
		第209回 利付国債(10年)		31,000,000	33,348,250	
		第210回 利付国債(10年)		39,000,000	41,645,370	
		第214回 利付国債(10年)		37,000,000	39,106,410	
		第218回 利付国債(10年)		29,000,000	30,823,520	
		第219回 利付国債(10年)		38,000,000	40,016,660	
		第220回 利付国債(10年)		37,000,000	38,668,330	
		第221回 利付国債(10年)		29,000,000	30,723,470	
		第224回 利付国債(10年)		29,000,000	30,416,650	
		第225回 利付国債(10年)		30,000,000	31,657,500	
		第226回 利付国債(10年)		50,000,000	52,335,000	
		第234回利付国債(10年)		50,000,000	50,280,500	
		第22回 利付国債(20年)		30,000,000	42,018,900	
		第27回 利付国債(20年)		30,000,000	41,794,500	
		第49回 利付国債(20年)		30,000,000	30,459,600	
	計	銘柄数 :	34	1,318,000,000	1,412,668,560	
		組入時価比率 :	66.5%		68.8%	
	小計				1,412,668,560	
地方債証券	日本円	東京都公募公債第503回		10,000,000	10,938,000	
		東京都公募公債第549回		30,000,000	31,373,100	
		第2回 東京都公募公債5年		40,000,000	41,135,200	
		神戸市公募公債 112回		14,500,000	14,930,360	
	計	銘柄数 :	4	94,500,000	98,376,660	

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額	備考
		組入時価比率：	4.6%		4.8%	
	小計				98,376,660	
特殊債券	日本円	第3回 政府保証日本政策投資銀行債券		30,000,000	31,212,300	
		政府保証 第782回公営企業債券		32,000,000	33,898,560	
		第41回 政府保証石油債		17,000,000	18,024,760	
		第1回政府保証国民生活債券		12,000,000	12,272,040	
		い第597号 興業債券		40,000,000	40,716,800	
		い第605号 商工債券		10,000,000	10,304,600	
		農林中央金庫 585回 イ号		20,000,000	20,678,600	
		い第578号 農林債券		40,000,000	40,909,600	
		第91回 東京三菱銀行債券(5年)		50,000,000	50,598,500	
	計	銘柄数：	9	251,000,000	258,615,760	
		組入時価比率：	12.2%		12.6%	
	小計				258,615,760	
普通社債	日本円	第105回放送債券		20,000,000	20,904,600	
		第2回株式会社オリエンタルランド 無担保社債		100,000,000	103,168,000	
		第2回昭和シェル石油株式会社 無担保社債		44,000,000	48,381,520	
		第463回 東京電力		48,000,000	48,796,320	
		第393回 中部電力		30,300,000	34,694,409	
		第382回 東北電力		23,000,000	26,558,100	
	計	銘柄数：	6	265,300,000	282,502,949	
		組入時価比率：	13.3%		13.8%	
	小計				282,502,949	
	合計		53		2,052,163,929	
			96.6%		100.0%	
	株式以外計				2,052,163,929	

(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す。

## 第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記事項(デリバティブ取引等関係注記)」に記載しております。

「PRU 海外株式マザーファンド」の状況  
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)

科 目	(平成13年12月10日現在)	
	金	額
資産の部		
流動資産		
預金		121,840,837
金銭信託		748,070
コール・ローン		18,235,597
株式		2,755,321,115
派生商品評価勘定		131,120,626
未収入金		34,286
未収配当金		3,680,787
差入委託証拠金		29,979,612
流動資産合計		3,060,960,930
資産合計		3,060,960,930
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		116,425,138
流動負債合計		116,425,138
負債合計		116,425,138
純資産の部		
元本		
元本		3,010,473,059
欠損金		
欠損金		65,937,267
欠損金合計		65,937,267
純資産合計		2,944,535,792
負債・純資産合計		3,060,960,930

重要な会計方針

対象年月日 項目	〔 自 平成13年 3月16日 至 平成13年12月10日
1. 有価証券の 評価基準及び 評価方法	<p>株式</p> <p>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。</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は原則として、証券取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる最終相場）で評価しております。</p> <p>計算期間末日に当該証券取引所の最終相場がない場合は、当該証券取引所における直近の最終相場、もしくは当該証券取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p>

	<p>時価が入手できなかった有価証券 適正な時価を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 受取配当金は原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。</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>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表ならびに運用報告書に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び61条に基づき処理しております。</p>

#### 注記事項

(貸借対照表関係)

(平成13年12月10日現在)	
1. 本有価証券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	3,000,000,000 円
同期中における追加設定元本額	272,834,029 円
同期中における解約元本額	262,360,970 円
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	2,838,197,367 円
PRU グッドライフ2010	48,867,309 円
PRU グッドライフ2020	25,009,931 円
PRU グッドライフ2030	32,684,591 円
PRU グッドライフ2040	64,760,199 円
PRU グッドライフ2010(年金)	89,233 円
PRU グッドライフ2020(年金)	186,513 円
PRU グッドライフ2030(年金)	287,152 円
PRU グッドライフ2040(年金)	390,764 円
	計 3,010,473,059 円
2. 同ファンドの計算期間は、開示対象ファンドの計算期間とは異なるため、当期損失の金額を表示しておりません。	

(有価証券関係)

(平成13年12月10日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,755,321,115	40,860,864
合計	2,755,321,115	40,860,864

(デリバティブ取引等関係)

取引の状況に関する事項

〔 自 平成13年 3月16日 〕 〔 至 平成13年12月10日 〕	
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。
2. 取引に対する取組みと利用目的	アメリカドル及びユーロ建の株価指数先物取引を主要投資対象としております。
3. 取引に係るリスクの内容	株価指数先物取引に係る主要なリスクは株価の変動による株価変動リスクであります。
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定しては行っておりません。デリバティブと現物資産等を統合し、各投資信託財産全体でのリスク管理を、行っております。
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

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)

区分	種類	(平成13年12月10日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	116,425,138	-	131,120,626	14,695,488
	合計	116,425,138	-	131,120,626	14,695,488

(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に評価しております。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。また契約額等及び時価の邦貨換算は計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っており、換算においては円未満の端数は切り捨てております。
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。

(1口当たり情報)

(平成13年12月10日現在)

本有価証券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	0.9781 円
	(1万口当たり純資産額 9,781 円)

なお、純資産額は、投資信託財産純資産総額を用いております。

(八) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
株券	ドル	ABBOTT LABORATORIES	2,400	55.14	132,336.00	
		ADOBE SYSTEMS INC	400	36.49	14,596.00	
		AES CORPORATION	800	16.50	13,200.00	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		AETNA INC-NEW	200	31.32	6,264.00	
		AFLAC INC	800	26.15	20,920.00	
		AGILENT TECHNOLOGIES INC	700	30.15	21,105.00	
		AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	300	46.65	13,995.00	
		ALBERTSON'S INC	600	34.05	20,430.00	
		ALCOA INC	1,300	38.85	50,505.00	
		ALLSTATE CORP	1,100	32.15	35,365.00	
		AMAZON.COM INC	500	11.71	5,855.00	
		AMERICAN ELECTRIC POWER	500	42.86	21,430.00	
		AMERICAN EXPRESS COMPANY	2,100	34.70	72,870.00	
		AMERICAN HOME PRODUCTS CORP	2,100	59.28	124,488.00	
		AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	3,550	81.90	290,745.00	
		AMERICAN POWER CONVERSION	300	15.26	4,578.00	
		AMGEN INC	1,600	66.80	106,880.00	
		ANHEUSER-BUSCH COS INC	1,400	42.69	59,766.00	
		AOL TIME WARNER	6,700	32.98	220,966.00	
		AON CORP	400	35.58	14,232.00	
		APPLE COMPUTER INC	500	22.54	11,270.00	
		APPLIED BIOSYSTEMS GROUP-APP	300	34.81	10,443.00	
		APPLIED MATERIALS INC	1,300	44.45	57,785.00	
		ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	945	15.60	14,742.00	
		AT&T CORP	5,700	17.68	100,776.00	
		AT&T WIRELRSS SERVICES	3,166	13.97	44,229.02	
		AUTOMATIC DATA PROCESSING	900	59.85	53,865.00	
		AVAYA INC	400	12.98	5,192.00	
		AVERY DENNISON CORP	100	54.50	5,450.00	
		AVON PRODUCTS INC	400	48.43	19,372.00	
		BAKER HUGHES INC	500	34.37	17,185.00	
		BANK OF AMERICA CORP	2,500	63.18	157,950.00	
		BANK OF NEW YORK CO INC	1,100	41.63	45,793.00	
		BANK ONE CORP	1,800	39.24	70,632.00	
		BAXTER INTERNATIONAL INC	900	50.97	45,873.00	
		BEA SYSTEMS INC	600	17.03	10,218.00	
		BECTON DICKINSON & CO	400	32.50	13,000.00	
		BELLSOUTH CORP	3,000	38.02	114,060.00	
		BLACK & DECKER CORP	100	39.40	3,940.00	
		BLOCK H & R INC	300	41.25	12,375.00	
		BMC SOFTWARE INC	400	16.75	6,700.00	
		BOEING CO	1,300	37.30	48,490.00	
		BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,000	53.82	161,460.00	
		BROADCOM CORP-CL A	300	45.56	13,668.00	
		BURLINGTON NORTHERN SANTA FE	600	29.23	17,538.00	
		CAMPBELL SOUP CO	600	29.60	17,760.00	
		CARDINAL HEALTH INC	650	66.14	42,991.00	
		CARNIVAL CORP	800	27.67	22,136.00	
		CATERPILLAR INC	500	51.15	25,575.00	
		CELERA GENOMICS GROUP-APPLER	100	28.95	2,895.00	
		CENDANT CORP	1,232	18.85	23,223.20	
		CENTEX CORP	100	50.04	5,004.00	
		CERIDIAN CORP-NEW	200	19.02	3,804.00	
		CERTEGY INC	100	30.72	3,072.00	
		CHEVRONTEXACO CORP	1,450	87.23	126,483.50	
		CHUBB CORP	200	67.71	13,542.00	
		CIGNA CORP	200	94.30	18,860.00	
		CISCO SYSTEMS INC	11,300	21.16	239,108.00	
		CITIGROUP INC	8,100	49.21	398,601.00	
		CLEAR CHANNEL COMMUNICATIONS	900	49.21	44,289.00	
		CLOROX COMPANY	300	39.42	11,826.00	
		COCA-COLA COMPANY	3,600	46.60	167,760.00	
		COMCAST CORP-SPECIAL CL A	400	39.99	15,996.00	
		COMPUTER ASSOCIATES INTL INC	800	34.14	27,312.00	
		COMPUTER SCIENCES CORP	200	48.40	9,680.00	
		CONAGRA FOODS INC	800	23.29	18,632.00	
		CONSOLIDATED EDISON INC	300	38.80	11,640.00	
		CONSTELLATION ENERGY GROUP	300	25.51	7,653.00	
		COOPER INDUSTRIES INC	100	35.75	3,575.00	
		CORNING INC	1,400	9.71	13,594.00	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		COSTCO WHOLESALE CORP	700	43.08	30,156.00	
		COUNTRYWIDE CREDIT IND INC	200	40.06	8,012.00	
		COX COMMUNICATIONS INC-CL A	600	38.99	23,394.00	
		CRESCENT REAL ESTATE EQT CO	200	18.01	3,602.00	
		CSX CORP	300	37.12	11,136.00	
		CVS CORP	600	27.35	16,410.00	
		DANA CORP	200	14.42	2,884.00	
		DEERE & CO	400	42.36	16,944.00	
		DELL COMPUTER CORP	3,800	28.94	109,972.00	
		DELPHI AUTOMOTIVE SYSTEMS	800	14.15	11,320.00	
		DOMINION RESOURCES INC/VA	400	58.50	23,400.00	
		DONNELLEY (R.R.) & SONS CO	200	29.90	5,980.00	
		DOVER CORP	300	38.72	11,616.00	
		DOW CHEMICAL	1,400	37.21	52,094.00	
		DOW JONES & CO INC	100	52.02	5,202.00	
		DTE ENERGY COMPANY	300	41.01	12,303.00	
		DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	1,600	43.82	70,112.00	
		DUKE ENERGY CORP	1,200	36.81	44,172.00	
		EASTMAN KODAK CO	500	31.83	15,915.00	
		EATON CORP	100	73.68	7,368.00	
		EBAY INC	300	67.95	20,385.00	
		EDISON INTERNATIONAL	500	15.50	7,750.00	
		EL PASO CORPORATION	800	43.76	35,008.00	
		ELECTRONIC ARTS INC	200	62.94	12,588.00	
		ELECTRONIC DATA SYSTEMS CORP	700	70.10	49,070.00	
		EMC CORP/MASS	3,500	17.17	60,095.00	
		EMERSON ELECTRIC CO	600	58.08	34,848.00	
		ENTERGY CORP	300	38.70	11,610.00	
		EQUIFAX INC	200	24.45	4,890.00	
		EQUITY OFFICE PROPERTIES TR	600	30.10	18,060.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PROPS TR	400	29.20	11,680.00	
		EXELON CORPORATION	500	45.40	22,700.00	
		EXXON MOBIL CORPORATION	10,700	38.07	407,349.00	
		FANNIE MAE	1,500	77.67	116,505.00	
		FEDEX CORPORATION	400	48.32	19,328.00	
		FIFTH THIRD BANCORP	200	60.09	12,018.00	
		FIRST DATA CORP	600	77.43	46,458.00	
		FIRSTENERGY CORP	433	34.20	14,808.60	
		FLEETBOSTON FINANCIAL CORP	1,700	37.15	63,155.00	
		FLUOR CORP (NEW)	100	38.93	3,893.00	
		FORD MOTOR COMPANY	2,900	17.13	49,677.00	
		FPL GROUP INC	300	55.75	16,725.00	
		FREDDIE MAC	300	64.25	19,275.00	
		GANNETT CO	400	68.23	27,292.00	
		GAP INC	1,100	13.82	15,202.00	
		GEMSTAR-TV GUIDE INTL INC	600	29.67	17,802.00	
		GENERAL DYNAMICS CORP	300	80.20	24,060.00	
		GENERAL ELECTRIC CO.	15,600	37.15	579,540.00	
		GENERAL MILLS INC	400	49.09	19,636.00	
		GENERAL MOTORS CORP	800	51.59	41,272.00	
		GENERAL MOTORS-CLASS H	1,300	14.50	18,850.00	
		GENUINE PARTS CO	300	36.18	10,854.00	
		GEORGIA-PAC (GEORGIA-PAC GP)	400	29.65	11,860.00	
		GILLETTE COMPANY	1,600	32.77	52,432.00	
		GLOBALSANTAFE CORP	199	24.70	4,915.30	
		GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	200	22.62	4,524.00	
		GRAINGER (W.W.) INC	100	48.03	4,803.00	
		HALLIBURTON CO	700	12.00	8,400.00	
		HARLEY-DAVIDSON INC	500	51.67	25,835.00	
		HARRAH'S ENTERTAINMENT INC	200	33.92	6,784.00	
		HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	400	59.60	23,840.00	
		HCA - THE HEALTHCARE COMPANY	800	39.16	31,328.00	
		HEALTHSOUTH CORP	600	14.45	8,670.00	
		HEINZ (H.J.) CO	500	38.80	19,400.00	
		HEWLETT-PACKARD CO.	3,000	23.52	70,560.00	
		HILTON HOTELS CORP	500	10.67	5,335.00	
		HOME DEPOT INC	3,500	49.41	172,935.00	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		HOST MARRIOTT CORP	300	9.20	2,760.00	
		HOUSEHOLD INTERNATIONAL INC	700	59.66	41,762.00	
		ILLINOIS TOOL WORKS	400	63.98	25,592.00	
		IMS HEALTH INC	400	21.80	8,720.00	
		INGERSOLL-RAND CO	300	45.25	13,575.00	
		INTEL CORP	10,400	33.24	345,696.00	
		INTERNATIONAL PAPER CO	700	40.49	28,343.00	
		INTERPUBLIC GROUP COS INC	600	30.44	18,264.00	
		INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,700	120.40	325,080.00	
		INTL FLAVORS & FRAGRANCES	100	30.24	3,024.00	
		INTUIT INC	300	42.90	12,870.00	
		ITT INDUSTRIES INC	100	50.37	5,037.00	
		J.P.MORGAN CHASE & CO	3,100	39.77	123,287.00	
		JDS UNIPHASE CORP	2,000	10.53	21,060.00	
		JOHNSON & JOHNSON	4,700	56.65	266,255.00	
		JOHNSON CONTROLS INC	150	80.92	12,138.00	
		JONES APPAREL GROUP INC	200	33.29	6,658.00	
		KEYCORP	700	23.84	16,688.00	
		KIMBERLY-CLARK CORP	800	57.70	46,160.00	
		KOHL'S CORP	100	69.96	6,996.00	
		KROGER CO	1,300	24.60	31,980.00	
		LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	500	6.40	3,200.00	
		LIBERTY MEDIA CORP	4,000	13.80	55,200.00	
		LILLY (ELI) & CO	1,600	82.32	131,712.00	
		LIMITED INC	600	14.37	8,622.00	
		LINCOLN NATIONAL CORP	300	48.85	14,655.00	
		LIZ CLAIBORNE INC	100	50.85	5,085.00	
		LOCKHEED MARTIN CORPORATION	100	45.74	4,574.00	
		LOWE'S COMPANIES	300	46.31	13,893.00	
		LUCENT TECHNOLOGIES INC	5,200	8.10	42,120.00	
		MANPOWER INC	100	34.30	3,430.00	
		MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	300	40.20	12,060.00	
		MARSH & MCLENNAN COS	400	107.99	43,196.00	
		MASCO CORP	700	23.42	16,394.00	
		MATTEL INC	600	18.07	10,842.00	
		MAY DEPARTMENT STORES CO	500	34.97	17,485.00	
		MAYTAG CORP	100	31.56	3,156.00	
		MBIA INC	200	51.08	10,216.00	
		MBNA CORP	1,300	33.99	44,187.00	
		MCDONALD'S CORPORATION	2,000	26.90	53,800.00	
		MCGRAW-HILL COMPANIES INC	300	58.15	17,445.00	
		MCKESSON HBOC INC	400	36.23	14,492.00	
		MEAD CORP	200	30.64	6,128.00	
		MEDTRONIC INC	1,900	48.00	91,200.00	
		MELLON FINANCIAL CORP	200	39.34	7,868.00	
		MERCK & CO., INC.	3,550	67.00	237,850.00	
		MERRILL LYNCH & CO	1,300	53.07	68,991.00	
		METROMEDIA FIBER NETWORK-A	800	0.60	480.00	
		MICRON TECHNOLOGY INC	900	31.75	28,575.00	
		MICROSOFT CORP	8,000	67.83	542,640.00	
		MINNESOTA MINING & MFG CO	600	118.30	70,980.00	
		MIRANT CORP	497	25.06	12,454.82	
		MOODY'S CORPORATION	200	36.25	7,250.00	
		MORGAN ST DEAN WITTER & CO	500	55.66	27,830.00	
		MOTOROLA INC	3,500	16.84	58,940.00	
		NATIONAL CITY CORP	900	28.62	25,758.00	
		NEW YORK TIMES CO -CL A	200	44.76	8,952.00	
		NEWELL RUBBERMAID INC	400	26.82	10,728.00	
		NEWMONT MINING CORP	300	20.02	6,006.00	
		NEXTEL COMMUNICATIONS INC-A	1,100	11.96	13,156.00	
		NIKE INC -CL B	300	55.04	16,512.00	
		NISOURCE INC	300	22.05	6,615.00	
		NORFOLK SOUTHERN CORP	600	19.08	11,448.00	
		NUCOR CORP	100	52.67	5,267.00	
		OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	600	25.80	15,480.00	
		OMNICOM GROUP	300	87.40	26,220.00	
		ORACLE CORPORATION	7,600	15.91	120,916.00	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		P G & E CORPORATION	600	19.14	11,484.00	
		PALM INC	800	3.72	2,976.00	
		PARAMETRIC TECHNOLOGY CORP	400	8.58	3,432.00	
		PARK PLACE ENTERTAINMENT	400	8.36	3,344.00	
		PARKER HANNIFIN CORP	200	43.63	8,726.00	
		PAYCHEX INC	600	37.52	22,512.00	
		PEOPLESOFT INC	400	38.55	15,420.00	
		PEPSICO INC	1,060	47.60	50,456.00	
		PFIZER INC	9,800	43.10	422,380.00	
		PHARMACIA CORPORATION	2,000	44.05	88,100.00	
		PHELPS DODGE CORP	100	35.82	3,582.00	
		PHILIP MORRIS COMPANIES INC	3,400	45.08	153,272.00	
		PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	400	58.80	23,520.00	
		PPG INDUSTRIES INC	200	53.24	10,648.00	
		PPL CORPORATION	200	34.03	6,806.00	
		PRAXAIR INC	200	53.72	10,744.00	
		PROCTER & GAMBLE CO	2,000	75.43	150,860.00	
		PROGRESS ENERGY INC	300	42.65	12,795.00	
		PROGRESSIVE CORP	20	149.66	2,993.20	
		PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	300	41.45	12,435.00	
		QUALCOMM INC	1,200	56.97	68,364.00	
		QWEST COMMUNICATIONS INTL	2,400	11.77	28,248.00	
		RADIOSHACK CORP	300	28.70	8,610.00	
		RALSTON PURINA GROUP	500	33.06	16,530.00	
		RATIONAL SOFTWARE CORP	300	20.87	6,261.00	
		RAYTHEON COMPANY	600	32.00	19,200.00	
		READER'S DIGEST ASSN-CL A	200	23.56	4,712.00	
		RELIANT ENERGY INC	500	25.87	12,935.00	
		ROBERT HALF INTL INC	300	27.64	8,292.00	
		ROCKWELL COLLINS	300	18.90	5,670.00	
		ROCKWELL INTL CORP	300	18.18	5,454.00	
		ROHM AND HAAS CO	300	35.35	10,605.00	
		SAFECO CORP	200	32.10	6,420.00	
		SAFEWAY INC	200	44.45	8,890.00	
		SANMINA CORP	500	23.95	11,975.00	
		SARA LEE CORP	1,200	21.93	26,316.00	
		SBC COMMUNICATIONS INC	5,200	37.45	194,740.00	
		SCHLUMBERGER LTD	900	52.79	47,511.00	
		SCHWAB ( CHARELES ) CORP	2,000	15.62	31,240.00	
		SEALED AIR CORP	100	42.29	4,229.00	
		SEARS, ROEBUCK & CO	500	45.58	22,790.00	
		SEMPRA ENERGY	300	24.40	7,320.00	
		SERVICEMASTER COMPANY	400	13.25	5,300.00	
		SHERWIN-WILLIAMS CO	200	26.99	5,398.00	
		SIEBEL SYSTEMS INC	600	24.02	14,412.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	300	29.93	8,979.00	
		SOLETRON CORP	1,000	16.25	16,250.00	
		SOUTHERN CO	1,100	22.79	25,069.00	
		SOUTHWEST AIRLINES	1,000	19.53	19,530.00	
		ST. PAUL COMPANIES	300	46.79	14,037.00	
		STANLEY WORKS	100	43.53	4,353.00	
		STAPLES INC	700	18.16	12,712.00	
		STARWOOD HOTELS & RESORTS	300	28.92	8,676.00	
		STATE STREET CORP	500	54.30	27,150.00	
		SUN MICROSYSTEMS INC	1,500	13.39	20,085.00	
		SUNTRUST BANKS INC	400	64.25	25,700.00	
		SYSCO CORP	1,100	24.80	27,280.00	
		TARGET CORP	1,400	38.00	53,200.00	
		TEMPLE-INLAND INC	100	57.72	5,772.00	
		TENET HEALTHCARE CORPORATION	500	59.85	29,925.00	
		TEXAS INSTRUMENTS INC	2,700	32.70	88,290.00	
		TEXTRON INC	200	40.67	8,134.00	
		TOYS R US INC	300	21.45	6,435.00	
		TRANSOCEAN SEDCO FOREX INC	500	31.24	15,620.00	
		TRIBUNE CO	400	37.00	14,800.00	
		TRW INC	200	40.46	8,092.00	
		TXU CORPORATION	400	44.93	17,972.00	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		TYCO INTERNATIONAL LTD	1,200	58.84	70,608.00	
		UNION PACIFIC CORP	300	56.10	16,830.00	
		UNITED TECHNOLOGIES CORP	700	61.08	42,756.00	
		UNITEDHEALTH GROUP INC	500	72.14	36,070.00	
		UNOCAL CORP	400	34.65	13,860.00	
		UNUMPROVIDENT CORP	400	26.01	10,404.00	
		US BANCORP	3,100	20.06	62,186.00	
		USX-MARATHON GROUP	600	28.06	16,836.00	
		VERISIGN INC	300	42.33	12,699.00	
		VERIZON COMMUNICATIONS INC	4,200	47.86	201,012.00	
		VF CORP	200	38.80	7,760.00	
		VIACOM INC-CL B	2,550	45.43	115,846.50	
		VISTEON CORP	200	14.65	2,930.00	
		VULCAN MATERIALS CO	100	48.06	4,806.00	
		WACHOVIA CORP	2,300	31.50	72,450.00	
		WALGREEN CO	1,600	33.06	52,896.00	
		WAL-MART STORES INC	6,100	55.34	337,574.00	
		WALT DISNEY CO	3,235	22.35	72,302.25	
		WASHINGTON MUTUAL INC	1,350	31.65	42,727.50	
		WASTE MANAGEMENT INC	1,000	30.00	30,000.00	
		WELLPOINT HEALTH NETWORKS	100	120.00	12,000.00	
		WELLS FARGO COMPANY	2,700	43.72	118,044.00	
		WEYERHAEUSER CO	350	54.52	19,082.00	
		WILLIAMS COMPANIES INC	800	27.80	22,240.00	
		WORLDCOM INC-MCI GROUP	180	13.65	2,457.00	
		WORLDCOM INC-WORLDCOM GROUP	4,600	15.67	72,082.00	
		XEROX CORP	1,000	8.78	8,780.00	
		YAHOO! INC	800	17.67	14,136.00	
		ZIMMER HOLDINGS INC	320	31.40	10,048.00	
	計	銘柄数 :	301		13,213,880.89	
					( 1,662,306,215 )	
		組入時価比率 :	56.5%		60.3%	
	カナダドル	ABITIBI-CONSOLIDATED INC	643	12.00	7,716.00	
		AGRIUM INC	180	16.01	2,881.80	
		ALBERTA ENERGY CO LTD	219	57.15	12,515.85	
		ALCAN ALUMINIUM LTD	520	58.09	30,206.80	
		ATI TECHNOLOGIES INC	946	21.28	20,130.88	
		BALLARD POWER SYSTEMS INC	130	48.32	6,281.60	
		BANK OF MONTREAL	801	35.55	28,475.55	
		BANK OF NOVA SCOTIA	828	49.35	40,861.80	
		BARRICK GOLD CORP	579	23.78	13,768.62	
		BCE INC	827	34.70	28,696.90	
		BIOVAIL CORPORATION	179	84.34	15,096.86	
		BOMBARDIER INC 'B'	2,163	14.96	32,358.48	
		BRASCAN CORPORATION	255	27.18	6,930.90	
		C.I. FUND MANAGEMENT INC	268	12.18	3,264.24	
		CAE INC	316	10.91	3,447.56	
		CAMECO CORP	127	38.75	4,921.25	
		CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	629	54.85	34,500.65	
		CANADIAN NATL RAILWAY CO	50	72.34	3,617.00	
		CANADIAN NATURAL RESOURCES	176	38.74	6,818.24	
		CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	229	32.05	7,339.45	
		CANADIAN TIRE CORP -CL A	168	26.50	4,452.00	
		CELESTICA INC	344	74.55	25,645.20	
		CGI GROUP INC	549	11.54	6,335.46	
		COGNOS INC	124	32.94	4,084.56	
		CP SHIPS LTD	114	16.90	1,926.60	
		DESCARTES SYSTEMS GRP ( THE )	127	12.41	1,576.07	
		DOFASCO INC	149	25.10	3,739.90	
		DOMTAR INC	288	14.83	4,271.04	
		ENBRIDGE INC	237	42.75	10,131.75	
		FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	18	185.85	3,345.30	
		FAIRMONT HOTELS & RESORTS	114	36.90	4,206.60	
		FORDING INC	76	26.75	2,033.00	
		FOUR SEASONS HOTELS INC	51	71.52	3,647.52	
		HUDSON'S BAY CO	200	13.60	2,720.00	
		IMPERIAL OIL LTD	611	43.18	26,382.98	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		INCO LTD	266	26.59	7,072.94	
		INVESTORS GROUP INC	231	24.95	5,763.45	
		MAGNA INTERNATIONAL INC-CL A	113	103.28	11,670.64	
		MANULIFE FINANCIAL CORP	789	42.33	33,398.37	
		MDS INC	204	19.38	3,953.52	
		MOLSON INC-A SHS	174	26.90	4,680.60	
		NATIONAL BANK OF CANADA	277	28.23	7,819.71	
		NEXEN INC	174	31.50	5,481.00	
		NORANDA INC	348	14.37	5,000.76	
		NORTEL NETWORKS CORP	4,903	13.88	68,053.64	
		PANCANADIAN ENERGY CORP	313	39.65	12,410.45	
		PETRO-CANADA	400	38.05	15,220.00	
		PLACER DOME INC	479	17.05	8,166.95	
		POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	76	99.12	7,533.12	
		POWER CORP OF CANADA	287	38.25	10,977.75	
		PRECISION DRILLING CORP	77	39.30	3,026.10	
		QLT INC	98	36.24	3,551.52	
		QUEBECOR INC -CL B	133	16.95	2,254.35	
		ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	298	26.50	7,897.00	
		ROYAL BANK OF CANADA	1,099	49.50	54,400.50	
		SUN LIFE FINANCIAL SVSC CAN	713	37.00	26,381.00	
		SUNCOR ENERGY INC	324	47.27	15,315.48	
		TALISMAN ENERGY INC	198	57.58	11,400.84	
		TECK COMINCO LIMITED	518	11.95	6,190.10	
		THOMSON CORP	631	47.50	29,972.50	
		TRANSALTA CORP	246	21.70	5,338.20	
		TRANSCANADA PIPELINES LTD	694	19.20	13,324.80	
		TRIZEC HAHN CORPORATION	225	24.21	5,447.25	
		WESTCOAST ENERGY INC	178	40.94	7,287.32	
		WESTON ( GEORGE ) LTD	192	104.50	20,064.00	
	計	銘柄数 :	65		833,382.27	
					( 66,520,572 )	
		組入時価比率 :	2.3%		2.4%	
	ユーロ	ABN AMRO HOLDING NV	2,220	18.90	41,958.00	
		ACCOR SA	281	39.90	11,211.90	
		ACERINOX SA	87	36.25	3,153.75	
		ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV	94	29.82	2,803.08	
		ADIDAS-SALOMON AG	66	80.00	5,280.00	
		AEGON NV	1,752	30.70	53,786.40	
		AGFA GEVAERT NV	205	15.00	3,075.00	
		AGUAS DE BARCELONA	204	14.90	3,039.60	
		AIR LIQUIDE	143	156.60	22,393.80	
		AKZO NOBEL	443	50.80	22,504.40	
		ALCATEL A	1,827	22.15	40,468.05	
		ALITALIA	2,264	1.07	2,440.59	
		ALLIANZ AG-REG	320	276.00	88,320.00	
		ALLIED IRISH BANKS PLC	1,600	12.75	20,400.00	
		ALPHA BANK A.E.	313	21.20	6,635.60	
		ALTADIS SA	564	18.45	10,405.80	
		ARNOLDO MONDADORI EDITORE	379	7.70	2,918.30	
		ASML HOLDING NV	689	21.64	14,909.96	
		ASSICURAZIONI GENERALI	1,742	31.50	54,873.00	
		AUTOGRILL SPA	372	10.28	3,824.16	
		AUTOPISTAS CONCESIONARIA ESP	426	10.90	4,643.40	
		AUTOSTRADA SPA	1,785	7.61	13,583.85	
		AVENTIS SA	1,123	76.90	86,358.70	
		AXA	2,387	25.70	61,345.90	
		BANCA DI ROMA	1,531	2.58	3,949.98	
		BANCA INTESA SPA-RNC	1,000	1.97	1,975.00	
		BANCA POPOLARE CI MILANO	620	4.03	2,498.60	
		BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	4,875	14.56	70,980.00	
		BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	3,449	4.53	15,623.97	
		BANCO ESPIRITO SANTO-REG	292	14.16	4,134.72	
		BANCO SANTANDER CENTRAL HIPS	6,896	10.03	69,166.88	
		BANK OF IRELAND ( LONDON )	200	10.39	2,078.00	
		BASF AG	929	43.00	39,947.00	
		BAYER AG	1,072	37.30	39,985.60	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		BAYERISCHE HYPO-UND VEREINSB	788	36.40	28,683.20	
		BEIERSDORF AG	123	129.00	15,867.00	
		BENETTON GROUP S.P.A.	265	12.99	3,442.35	
		BIC	81	37.25	3,017.25	
		BIPOP SPA	2,223	2.07	4,612.72	
		BNP PARIBAS	703	100.20	70,440.60	
		BOUYGUES	516	40.50	20,898.00	
		BPI-SGPS S.A.-REG SHS	944	2.37	2,237.28	
		BRISA AUTO-ESTRADAS-PRIV	439	9.58	4,205.62	
		BUDERUS AG	106	28.25	2,994.50	
		BUHRMANN N.V.	310	12.22	3,788.20	
		BULGARI SPA	428	10.48	4,485.44	
		CAP GEMINI SA	168	84.60	14,212.80	
		CARREFOUR SUPERMARCHE	934	59.75	55,806.50	
		CASINO GUICHARD PERRACHON	108	88.30	9,536.40	
		CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	197	19.67	3,874.99	
		CLUB MEDITERRANEE SA	26	49.18	1,278.68	
		COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	154	16.00	2,464.00	
		COFLEXIP	27	149.00	4,023.00	
		COLRUYT NV	57	48.50	2,764.50	
		COMMERCIAL BANK OF GREECE	111	39.58	4,393.38	
		COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	135	168.70	22,774.50	
		CONTINENTAL AG	187	14.60	2,730.20	
		CRH PLC	845	18.80	15,886.00	
		DAIMLERCHRYSLER AG-REG	1,554	48.85	75,912.90	
		DASSAULT SYSTEMES SA	120	56.10	6,732.00	
		DELHAIZE 'LE LION'	82	59.95	4,915.90	
		DEUTSCHE BANK AG -REG	864	77.10	66,614.40	
		DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	389	15.80	6,146.20	
		DEUTSCHE TELEKOM REGD	4,003	19.90	79,659.70	
		DEXIA	200	15.35	3,070.00	
		E.ON AG	1,061	54.00	57,294.00	
		EFG EUROBANK ERGASIAS	250	16.08	4,020.00	
		ELAN CORPORATION PLC	529	49.70	26,291.30	
		ELECTRABEL SA	85	225.00	19,125.00	
		ELECTRICIDADE DE PORTUGAL SA	4,454	2.52	11,224.08	
		ELSEVIER	1,146	13.50	15,471.00	
		ENDESA S.A.	1,619	17.73	28,704.87	
		ENEL SPA	4,450	6.33	28,168.50	
		ENI SPA	5,255	13.47	70,784.85	
		EPCOS AG	95	57.90	5,500.50	
		ERSTE BANK DER OESTER SPARK	45	57.86	2,603.70	
		ESSILOR INTERNATIONAL	87	32.69	2,844.03	
		FIAT SPA	561	19.10	10,715.10	
		FIAT SPA -PFD	151	14.10	2,129.10	
		FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	186	24.80	4,612.80	
		FORTIS ( B )	1,105	26.23	28,984.15	
		FRANCE TELECOM SA	1,305	47.60	62,118.00	
		FRESENIUS MEDICAL CARE	123	71.10	8,745.30	
		GAS NATURAL SDG SA	738	18.60	13,726.80	
		GEHE AG	77	42.70	3,287.90	
		GETRONICS NV	494	4.65	2,297.10	
		GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	200	57.75	11,550.00	
		GROUPE DANONE	225	127.00	28,575.00	
		GRUPO DRAGADOS, S.A.	252	14.40	3,628.80	
		GRUPPO EDITORIALE L'ESPRESSO	504	3.69	1,859.76	
		HAGEMEYER NV	157	19.60	3,077.20	
		HEIDELBERGER ZEMENT AG	71	56.00	3,976.00	
		HEINEKEN NV	594	40.05	23,789.70	
		HELLENIC TELECOMMUN	450	18.86	8,487.00	
		HUGO BOSS-PFD	100	22.55	2,255.00	
		IBERDROLA SA	1,384	13.88	19,209.92	
		IHCN NA NV	46	47.50	2,185.00	
		IMERYS SA	24	110.50	2,652.00	
		ING GROEP N.V.	2,816	29.42	82,846.72	
		INTERBREW	256	27.50	7,040.00	
		INTESABCI SPA	8,327	2.74	22,815.98	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		IRISH LIFE & PERMANENT PLC	492	12.65	6,223.80	
		ITALCEMENTI SPA	287	8.95	2,568.65	
		ITALGAS	510	10.43	5,319.30	
		KARSTADT AG	108	43.50	4,698.00	
		KBC BANCASSURANCE HOLDING NV	441	36.00	15,876.00	
		KERRY GROUP PLC-A	252	14.00	3,528.00	
		KONE OYJ-B SHS	32	78.25	2,504.00	
		KONINKLIJKE AHOLD NV	1,229	33.00	40,557.00	
		KONINKLIJKE KPN NV	1,588	5.69	9,035.72	
		LAFARGE SA	182	106.00	19,292.00	
		LAGARDERE S.C.A.	195	49.30	9,613.50	
		LINDE AG	121	48.60	5,880.60	
		L'OREAL	906	79.75	72,253.50	
		LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	549	49.65	27,257.85	
		MAN AG	161	22.90	3,686.90	
		MEDIASET SPA	1,785	9.14	16,314.90	
		MEDIOBANCA SPA	1,000	12.76	12,760.00	
		MERCK KGAA	190	39.60	7,524.00	
		METRO AG	494	40.00	19,760.00	
		METSO OYJ	220	11.08	2,437.60	
		MICHELIN (CGDE) -B	197	38.12	7,509.64	
		MUENCHENER RUECKVER AG-REG	230	306.70	70,541.00	
		NATIONAL BANK OF GREECE	367	27.90	10,239.30	
		NOKIA	7,289	28.55	208,100.95	
		OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	33	86.97	2,870.01	
		OMV AG	126	96.75	12,190.50	
		PARMALAT FINANZIARIA SPA	1,300	3.00	3,900.00	
		PECHINEY SA-A SHS	73	57.50	4,197.50	
		PERNOD-RICARD	51	82.05	4,184.55	
		PHILIPS ELECTRONICS NV	2,059	33.71	69,408.89	
		PINAULT-PRINTEMPS REDOUTE	175	154.90	27,107.50	
		PIRELLI SPA	2,227	2.00	4,454.00	
		PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	1,831	9.04	16,552.24	
		PREUSSAG AG	194	28.50	5,529.00	
		PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	228	7.40	1,687.20	
		PSA PEUGEOT CITROEN	405	47.25	19,136.25	
		PUBLICIS GROUPE	113	30.45	3,440.85	
		QIAGEN N.V.	207	22.45	4,647.15	
		RAS SPA	1,010	13.69	13,826.90	
		REPSOL YPF S.A.	1,837	16.22	29,796.14	
		ROYAL DUTCH PETROLEUM	3,282	54.25	178,048.50	
		RWE AG	815	40.25	32,803.75	
		RYANAIR HOLDINGS PLC	1,058	6.75	7,141.50	
		SAGEM S.A.-NEW	55	70.80	3,894.00	
		SAMPO OYJ	1,000	8.60	8,600.00	
		SAN PAOLO-IMI SPA	2,054	13.30	27,318.20	
		SANOF I-SYNTHELABO SA	984	78.05	76,801.20	
		SAP AG	401	150.80	60,470.80	
		SCHERING AG	302	60.80	18,361.60	
		SCHNEIDER ELECTRIC SA	265	55.50	14,707.50	
		SIEMENS AG	1,386	72.60	100,623.60	
		SMURFIT (JEFFERSON) GROUP	1,591	2.50	3,977.50	
		SOC GENERALE D'ENTERPRISES	76	63.45	4,822.20	
		SOCIETE GENERALE-A	638	64.40	41,087.20	
		SODEXHO ALLIANCE SA	173	46.69	8,077.37	
		SOL MELIA S.A.	270	8.64	2,332.80	
		SOLVAY SA	81	64.40	5,216.40	
		SONAE SGPS, SA	2,924	0.81	2,368.44	
		SONERA OYJ	1,772	6.15	10,897.80	
		STMICROELECTRONICS NV	1,063	39.55	42,041.65	
		STORA ENSO OYJ-R SHS	200	14.43	2,886.00	
		SUEZ	1,583	32.26	51,067.58	
		TECHNIP	23	134.80	3,100.40	
		TELECOM ITALIA SPA	4,682	9.84	46,070.88	
		TELECOM ITALIA SPA-RNC	1,755	5.96	10,459.80	
		TELEFONICA S.A.	6,757	16.02	108,247.14	
		TELEKOM AUSTRIA AG	325	9.21	2,993.25	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		THALES	182	40.00	7,280.00	
		THYSSEN KRUPP AG	593	16.90	10,021.70	
		TIETOENATOR OYJ	269	31.00	8,339.00	
		TIM SPA	10,874	6.60	71,768.40	
		TISCALI SPA	303	11.05	3,348.15	
		TOTAL FINA ELF S.A.	1,098	150.80	165,578.40	
		TPG NV	746	24.45	18,239.70	
		UCB SA	252	45.00	11,340.00	
		UNIBAIL	69	56.50	3,898.50	
		UNICREDITO ITALIANO SPA	7,431	4.48	33,290.88	
		UNILEVER NV-CVA	895	60.65	54,281.75	
		UNION ELECTRICA FENOSA SA	487	16.51	8,040.37	
		UPM-KYMMENE OYJ	382	37.90	14,477.80	
		USINOR SA	356	14.44	5,140.64	
		VALEO	121	42.53	5,146.13	
		VIVENDI UNIVERSAL	1,511	60.00	90,660.00	
		VOLKSWAGEN AG	477	51.50	24,565.50	
		VOLKSWAGEN AG PFD	154	34.90	5,374.60	
		WCM BETEILIGUNGS & GRUND AG	202	12.50	2,525.00	
		WOLTERS KLUWER-CVA	397	26.09	10,357.73	
		ZELTIA SA	292	9.20	2,686.40	
	計	銘柄数：	189		4,247,925.96	
					( 475,172,997 )	
		組入時価比率：	16.1%		17.2%	
	ボンド	3I GROUP PLC	933	8.89	8,294.37	
		ABBEY NATIONAL PLC	2,287	9.70	22,183.90	
		AIRTOURS PLC	718	2.50	1,795.00	
		AMEC PLC	356	3.87	1,377.72	
		AMERSHAM PLC	929	6.50	6,038.50	
		AMVESCAP PLC	1,297	10.67	13,838.99	
		ARM HOLDINGS PLC	1,446	3.98	5,755.08	
		ASTRAZENECA PLC	2,806	31.60	88,669.60	
		AWG PLC	398	5.26	2,093.48	
		BAA PLC	1,910	5.78	11,039.80	
		BAE SYSTEMS PLC	4,695	3.10	14,577.97	
		BARCLAYS PLC	2,625	21.64	56,805.00	
		BBA GROUP PLC	655	2.90	1,899.50	
		BERKELEY GROUP ( THE ) PLC	208	6.55	1,362.40	
		BG GROUP PLC	6,055	2.57	15,591.62	
		BILLITON PLC	600	3.51	2,106.00	
		BOC GROUP PLC	882	10.88	9,596.16	
		BOOTS COMPANY PLC	1,592	5.93	9,440.56	
		BP PLC	34,682	5.12	177,745.25	
		BRAMBLES INDUSTRIES PLC	1,291	3.42	4,415.22	
		BRITISH AIRWAYS PLC	1,582	2.23	3,539.72	
		BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	3,336	5.45	18,197.88	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	758	4.52	3,426.16	
		BRITISH SKY BROADCASTING PLC	2,116	8.48	17,943.68	
		BT GROUP PLC	13,286	2.73	36,337.21	
		BTG PLC	150	7.60	1,140.00	
		BUNZL PLC	670	4.60	3,082.00	
		CABLE & WIRELESS PLC	800	3.54	2,832.00	
		CADBURY SCHWEPPE'S PLC	3,519	4.23	14,885.37	
		CANARY WHARF GROUP PLC	1,004	4.65	4,668.60	
		CAPITA GROUP PLC	952	4.90	4,664.80	
		CARLTON COMMUNICATIONS PLC	903	2.45	2,212.35	
		CELLTECH GROUP PLC	398	9.46	3,765.08	
		CENTRICA PLC	6,166	2.10	12,948.60	
		CGNU PLC	3,542	8.51	30,142.42	
		CHUBB PLC	1,211	1.59	1,928.51	
		CMG PLC	881	2.50	2,209.10	
		COMPASS GROUP PLC	3,670	4.85	17,808.67	
		CORUS GROUP PLC	2,199	0.71	1,561.29	
		DE LA RUE PLC	312	4.96	1,549.08	
		DIAGEO PLC	5,386	7.34	39,533.24	
		DIXONS GROUP PLC	2,800	2.52	7,056.00	
		ELECTROCOMPONENTS PLC	635	5.45	3,460.75	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		EMI GROUP PLC	1,153	3.60	4,150.80	
		EXEL PLC	435	8.60	3,741.00	
		FKI PLC	841	1.99	1,679.89	
		GKN PLC	1,291	2.95	3,808.45	
		GLAXOSMITHKLINE PLC	9,641	17.41	167,849.81	
		GRANADA PLC	4,048	1.48	6,021.40	
		GREAT UNIVERSAL STORES PLC	1,782	6.63	11,814.66	
		HAMMERSON PLC	411	4.47	1,837.17	
		HANSON PLC	1,075	4.83	5,192.25	
		HAYS PLC	2,314	2.16	5,015.59	
		HBOS PLC	5,612	8.35	46,860.20	
		HILTON GROUP PLC	2,200	2.15	4,735.50	
		HSBC HOLDINGS PLC	14,091	8.70	122,662.15	
		IMPERIAL CHEMICAL INDS PLC	1,064	4.24	4,514.02	
		INTERNATIONAL POWER PLC	1,634	2.01	3,284.34	
		INVENSYS PLC	5,116	1.28	6,574.06	
		JOHNSON MATTHEY PLC	324	9.81	3,178.44	
		KINGFISHER PLC	2,205	3.95	8,709.75	
		LAND SECURITIES PLC	766	7.96	6,097.36	
		LATTICE GROUP PLC	5,159	1.50	7,738.50	
		LEGAL & GENERAL GROUP PLC	8,080	1.59	12,907.80	
		LLOYDS TSB GROUP PLC	8,740	7.23	63,190.20	
		LOGICA PLC	646	8.16	5,274.59	
		MARCONI PLC	4,619	0.45	2,078.55	
		MARKS & SPENCER PLC	4,802	3.59	17,275.19	
		MISYS PLC	844	3.56	3,004.64	
		NATIONAL GRID GROUP PLC	2,601	4.35	11,327.35	
		P & O PRINCESS CRUISES PLC	1,013	3.75	3,798.75	
		PACE MICRO TECHNOLOGY PLC	326	4.10	1,339.04	
		PEARSON PLC	1,329	8.93	11,867.97	
		PENINSULAR & ORIENTAL STEAM	993	2.43	2,417.95	
		PILKINGTON PLC	1,797	1.10	1,985.68	
		PROVIDENT FINANCIAL PLC	363	6.40	2,323.20	
		PRUDENTIAL PLC	3,158	8.00	25,264.00	
		RAILTRACK GROUP PLC	754	-	-	
		RANK GROUP PLC	862	2.23	1,926.57	
		REED INTERNATIONAL PLC	2,208	5.97	13,181.76	
		RENTOKIL INITIAL PLC	3,057	2.60	7,948.20	
		REUTERS GROUP PLC	2,328	7.68	17,879.04	
		REXAM	624	3.83	2,391.48	
		RIO TINTO PLC - REG	1,660	13.26	22,011.60	
		RMC GROUP PLC	386	6.35	2,451.10	
		ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	4,306	16.18	69,671.08	
		SAGE GROUP PLC ( THE )	1,854	2.57	4,764.78	
		SAINSBURY ( J ) PLC	3,032	3.52	10,687.80	
		SCHRODERS PLC	438	8.93	3,911.34	
		SCOTTISH POWER PLC	3,209	3.75	12,033.75	
		SHELL TRANSPRT&TRADNG CO PLC	5,000	4.69	23,475.00	
		SIX CONTINENTS PLC	1,512	7.34	11,098.08	
		SLOUGH ESTATES PLC	605	3.16	1,914.82	
		SMITH & NEPHEW PLC	1,343	3.66	4,925.45	
		SMITHS GROUP PLC	810	6.95	5,633.55	
		SSL INTERNATIONAL PLC	306	5.39	1,649.34	
		STAGECOACH HOLDINGS PLC	2,136	0.74	1,580.64	
		TATE & LYLE PLC	704	3.33	2,346.08	
		TAYLOR WOODROW PLC	910	1.71	1,556.10	
		TESCO PLC	10,995	2.30	25,343.47	
		UNILEVER PLC	4,720	5.31	25,063.20	
		UNITED UTILITIES PLC	808	5.90	4,767.20	
		VODAFONE GROUP PLC	105,239	1.90	199,954.10	
		WOLSELEY PLC	841	5.21	4,385.81	
		WPP GROUP PLC	1,695	7.48	12,678.60	
	計	銘柄数 :	105		1,774,268.82	
					( 319,634,527 )	
		組入時価比率 :	10.9%		11.6%	
	スイスフラン	ABB LTD	1,932	18.85	36,418.20	
		ADECCO SA-REG	277	97.00	26,869.00	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		CIE FINANC RICHEMONT-UTS A	100	33.60	3,360.00	
		CREDIT SUISSE GROUP-REG	1,719	68.85	118,353.15	
		GIVAUDAN-REG	13	503.00	6,539.00	
		HOLCIM LTD-B	40	356.00	14,240.00	
		KUDELSKI SA-BEARER	78	119.25	9,301.50	
		LONZA AG-REG	11	1,044.00	11,484.00	
		NESTLE SA-REGISTERED	620	341.50	211,730.00	
		NOVARTIS AG-REG SHS	4,458	58.30	259,901.40	
		ROCHE HOLDING AG-BEARER	161	133.50	21,493.50	
		ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	1,103	116.25	128,223.75	
		SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2	2,300.00	4,600.00	
		SGS SOC GEN SURVEILLANCE-R	15	315.00	4,725.00	
		SULZER AG-REG	10	261.00	2,610.00	
		SULZER MEDICA-REGISTERED	20	77.00	1,540.00	
		SWISS RE-REG	443	171.75	76,085.25	
		SWISSCOM AG-REG	77	451.50	34,765.50	
		SYNGENTA AG-REGISTERED	165	82.00	13,530.00	
		THE SWATCH GROUP AG-REG	210	34.20	7,182.00	
		THE SWAYCH GROUP AG-B	50	159.75	7,987.50	
		UBS AG REG	2,004	86.75	173,847.00	
		UNAXIS HOLDING AG-R	19	179.00	3,401.00	
		ZURICH FINANCIAL SERVICES	130	456.00	59,280.00	
	計	銘柄数 :	24		1,237,466.75	
					( 93,812,354 )	
		組入時価比率 :	3.2%		3.4%	
	スウェーデン クローネ	ASSA ABLOY AB-B	600	160.50	96,300.00	
		ASSIDOMAN AB	100	257.50	25,750.00	
		ATLAS COPCO AB-A SHS	200	242.00	48,400.00	
		ELECTROLUX AB-SER B	700	162.50	113,750.00	
		ERICSSON LM TEL,SEK1 SER B	12,478	63.00	786,114.00	
		GAMBRO AB-A SHS	400	67.50	27,000.00	
		HENNES & MAURITZ	1,006	222.00	223,332.00	
		MODERN TIMES GROUP	97	241.50	23,425.50	
		NORDBANKEN HOLDING AB	4,467	54.50	243,451.50	
		OM AB	100	146.00	14,600.00	
		SANDVIK AB	400	234.00	93,600.00	
		SECURITAS AB-B SHS	579	201.00	116,379.00	
		SKANDIA FORSAKRINGS AB	1,505	87.00	130,935.00	
		SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,148	98.00	112,504.00	
		SKANSKA AB-B SHS	664	71.00	47,144.00	
		SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	412	278.00	114,536.00	
		SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	986	146.00	143,956.00	
		SWEDISH MATCH AB	1,000	54.50	54,500.00	
		TELE2 AB-B SHS	212	372.50	78,970.00	
		TELIA AB	2,200	47.40	104,280.00	
		VOLVO AB-A SHS	200	169.00	33,800.00	
		VOLVO AB-B SHS	464	176.00	81,664.00	
		WM-DATA AB-B SHS	581	27.60	16,035.60	
	計	銘柄数 :	23		2,730,426.60	
					( 32,765,119 )	
		組入時価比率 :	1.1%		1.2%	
	ノルウェー クローネ	DNB HOLDING ASA	1,967	38.20	75,139.40	
		FRONTLINE LTD	120	81.50	9,780.00	
		NORSK HYDRO ASA	319	360.00	114,840.00	
		NORSKE SKOGINDUSTRIER ASA	174	156.50	27,231.00	
		ORKLA ASA	553	145.00	80,185.00	
		STATOIL ASA	714	59.50	42,483.00	
		STOREBRAND ASA	400	51.00	20,400.00	
		TELENOR ASA	791	39.90	31,560.90	
		TOMRA SYSTEMS ASA	644	84.50	54,418.00	
	計	銘柄数 :	9		456,037.30	
					( 6,398,203 )	
		組入時価比率 :	0.2%		0.2%	
	デンマーク クローネ	CARLSBERG AS-B	47	332.50	15,627.50	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		D/S 1912 -B-	1	55,600.00	55,600.00	
		D/S SVENDBORG-B	2	75,000.00	150,000.00	
		DANISCO A/S	85	295.00	25,075.00	
		DANSKE BANK A/S	1,155	127.00	146,685.00	
		GROUP 4 FALCK A/S	43	943.00	40,549.00	
		ISS A/S	18	416.00	7,488.00	
		NOVO NORDISK A/S-B	580	326.00	189,080.00	
		NOVOZYMES A/S-B SHARES	110	166.00	18,260.00	
		TDC A/S	357	299.00	106,743.00	
		VESTAS WIND SYSTEMS A/S	180	237.00	42,660.00	
		WILLIAM DEMANT HOLDING	109	225.00	24,525.00	
	計	銘柄数：	12		822,292.50	
					( 12,350,833 )	
		組入時価比率：	0.4%		0.4%	
	オーストラリアドル	AMCOR LIMITED	959	6.99	6,703.41	
		AMP LIMITED	1,955	18.60	36,380.59	
		ARISTOCRAT LEISURE LIMITED	680	6.35	4,318.00	
		AUST AND NZ BANKING GROUP LT	300	16.98	5,094.00	
		AUSTRALIAN GAS LIGHT COMPANY	549	8.97	4,924.53	
		BHP BILLITON LTD	6,056	10.38	62,861.28	
		BRAMBLES INDUSTRIES LTD	2,006	9.75	19,568.53	
		COCA-COLA AMATIL LIMITED	1,549	5.39	8,349.11	
		COLES MYER LIMITED	2,476	8.56	21,194.56	
		COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	2,074	28.30	58,694.20	
		COMPUTERSHARE LIMITED	790	5.49	4,337.10	
		CSL LIMITED	219	49.60	10,862.40	
		CSR LIMITED	1,429	6.70	9,577.15	
		FOSTER'S BREWING GROUP LTD	4,300	4.79	20,597.00	
		GENERAL PROPERTY TRUST	2,613	2.80	7,316.40	
		LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	433	10.80	4,678.56	
		LEND LEASE CORP LIMITED	972	11.59	11,273.25	
		MAYNE NICKLESS LIMITED	1,340	6.90	9,246.00	
		NATIONAL AUSTRALIA BANK & LTD	2,487	30.87	76,773.69	
		NEWS CORP LTD- PREF ORDINARY	3,602	13.92	50,139.84	
		NEWS CORPORATION LIMITED	3,099	16.35	50,668.65	
		QBE INSURANCE GROUP LIMITED	646	7.45	4,812.70	
		RIO TINTO LIMITED	543	36.74	19,951.99	
		SANTOS LIMITED	891	6.24	5,559.84	
		SOUTHCORP LIMITED	1,651	7.44	12,283.44	
		STOCKLAND TRUST GROUP	1,152	4.33	4,988.16	
		STOCKLAND TRUST GROUP NEW	40	4.25	170.00	
		SUNCORP-METWAY LIMITED	470	12.99	6,105.30	
		TABCORP HOLDINGS LIMITED	544	9.75	5,304.00	
		TELSTRA CORPORATION LTD	7,654	5.54	42,403.16	
		WESFARMERS LIMITED	671	30.51	20,477.57	
		WESTFIELD TRUST	3,555	3.30	11,731.50	
		WESTFIELD TRUST-NEW	174	3.19	555.06	
		WESTPAC BANKING CORPORATION	3,046	15.10	45,994.60	
		WMC LIMITED	2,474	9.42	23,305.08	
		WOOLWORTHS LIMITED	2,047	11.18	22,885.46	
	計	銘柄数：	36		710,086.11	
					( 45,956,773 )	
		組入時価比率：	1.6%		1.7%	
	ニュージーランドドル	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	5,680	5.09	28,911.20	
	計	銘柄数：	1		28,911.20	
					( 1,508,297 )	
		組入時価比率：	0.1%		0.1%	
	香港ドル	BANK OF EAST ASIA	2,000	16.80	33,600.00	
		CATHAY PACIFIC AIRWAYS	5,000	10.15	50,750.00	
		CHEUNG KONG LTD	1,000	82.25	82,250.00	
		CLP HOLDINGS LIMITED	4,200	29.70	124,740.00	
		HANG SENG BANK	2,100	86.50	181,650.00	
		HENDERSON LAND DEVELOPMENT	2,000	33.70	67,400.00	
		HONG KONG & CHINA GAS	8,800	9.60	84,480.00	
		HUTCHISON WHAMPOA	5,000	76.75	383,750.00	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		HYSAN DEVELOPMENT CO	2,000	8.30	16,600.00	
		JOHNSON ELECTRIC HLDGS	5,500	9.10	50,050.00	
		LI & FUNG LTD	4,000	9.55	38,200.00	
		NEW WORLD DEVELOPMENT	5,000	7.15	35,750.00	
		PACIFIC CENTURY CYBERWORKS	19,000	2.25	42,750.00	
		SHANGRI-LA ASIA LTD.	4,000	5.90	23,600.00	
		SINO LAND CO	6,000	3.02	18,150.00	
		SUN HUNG KAI PROPERTIES	3,000	65.75	197,250.00	
		SWIRE PACIFIC LTD 'A'	2,500	41.80	104,500.00	
		TELEVISION BROADCASTS LTD	1,000	32.30	32,300.00	
		THE WHARF HOLDINGS	4,000	18.10	72,400.00	
	計	銘柄数：	19		1,640,170.00	
					( 26,455,942 )	
		組入時価比率：	0.9%		1.0%	
	シンガポールドル	CAPITALAND LIMITED	3,000	1.75	5,250.00	
		CHARTERED SEMICONDUCTOR	2,000	4.86	9,720.00	
		CITY DEVELOPMENTS	2,000	5.95	11,900.00	
		DBS GROUP HLDG LTD	2,000	13.80	27,600.00	
		KEPPEL CORP	1,000	2.83	2,830.00	
		OVERSEA-CHINESE BANKING-ORD	2,000	11.80	23,600.00	
		SEMBICORP INDUSTRIES LIMITED	2,000	1.54	3,080.00	
		SINGAPORE AIRLINES LTD	2,000	11.20	22,400.00	
		SINGAPORE PRESS HOLDINGS	1,000	21.00	21,000.00	
		SINGAPORE TECH ENGINEERING	4,000	2.14	8,560.00	
		SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	11,000	1.77	19,470.00	
		UNITED OVERSEAS BANK	2,000	13.00	26,000.00	
	計	銘柄数：	12		181,410.00	
					( 12,439,283 )	
		組入時価比率：	0.4%		0.5%	
	合計	銘柄数：	796			
		組入時価比率：	93.6%		100.0%	
					2,755,321,115	
					( 2,755,321,115 )	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額です。

(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す。

株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記事項(デリバティブ取引等関係注記)」に記載しております。

「PRU 海外債券マザーファンド」の状況  
 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)

科 目	(平成13年12月10日現在)	
	金	額
資産の部		
流動資産		
預金		5,409,801
コール・ローン		24,317,884
国債証券		5,430,096,108
派生商品評価勘定		8,106,678
未収入金		642,039,022
未収利息		70,448,234
前払費用		47,391,034
流動資産合計		6,227,808,761
資産合計		6,227,808,761
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		5,642,645
未払金		639,585,194
未払解約金		6,739,147
流動負債合計		651,966,986
負債合計		651,966,986
純資産の部		
元本		
元本		5,247,834,944
剰余金		
剰余金		328,006,831
剰余金合計		328,006,831
純資産合計		5,575,841,775
負債・純資産合計		6,734,631,103

重要な会計方針

対象年月日 項目	( 自 平成13年 3月16日 ) ( 至 平成13年12月10日 )
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。          証券取引所に上場されている有価証券          証券取引所に上場されている有価証券は原則として、証券取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる最終相場）で評価しております。          計算期間末日に当該証券取引所の最終相場がない場合は、当該証券取引所における直近の最終相場、もしくは当該証券取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。          証券取引所に上場されていない有価証券          当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。          時価が入手できなかった有価証券          適正な時価を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

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。
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、「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表ならびに運用報告書に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び61条に基づき処理しております。

## 注記事項

### (貸借対照表関係)

(平成13年12月10日現在)	
1. 本有価証券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	2,000,000,000 円
同期中における追加設定元本額	5,260,906,540 円
同期中における解約元本額	2,013,071,596 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	5,175,078,451 円
PRU グッドライフ2010	52,754,045 円
PRU グッドライフ2020	9,868,814 円
PRU グッドライフ2030	5,683,276 円
PRU グッドライフ2040	4,205,090 円
PRU グッドライフ2010(年金)	96,366 円
PRU グッドライフ2020(年金)	73,597 円
PRU グッドライフ2030(年金)	49,929 円
PRU グッドライフ2040(年金)	25,376 円
	計 5,247,834,944 円
2. 同ファンドの計算期間は、開示対象ファンドの計算期間とは異なるため、当期損失の金額を表示していません。	

### (有価証券関係)

(平成13年12月10日現在)

#### 売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	5,430,096,108	102,861,167
合計	5,430,096,108	102,861,167

### (デリバティブ取引等関係)

#### 取引の状況に関する事項

(自平成13年3月16日 至平成13年12月10日)	
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。
2. 取引に対する取組みと利用目的	外貨建証券の売買代金、償還金、利金等についての為替変動リスクを回避するために、為替予約取引を行うことができますものとします。

3. 取引に係るリスクの内容 為替予約取引に係る主要なリスクは、取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。
4. 取引に係るリスク管理体制 組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定しては行っておりません。デリバティブと現物資産等を統合し、各信託財産全体でのリスク管理を、行っております。
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

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)

区分	種類	(平成13年12月10日現在)				
		契約額等		時価	評価損益	
			うち1年超			
市場取引以外	為替予約取引					
取 引 の 取 引	買建	アメリカ・ドル	131,065,226	-	135,322,865	4,257,639
		カナダ・ドル	11,385,350	-	11,639,344	253,994
		ユーロ	76,716,684	-	79,767,786	3,051,102
		イギリス・ポンド	9,696,340	-	10,016,694	320,354
		スイス・フラン	33,868,589	-	34,092,178	223,589
	売建	アメリカ・ドル	210,312,534	-	215,005,880	4,693,346
		イギリス・ポンド	24,899,804	-	25,518,713	618,909
		オーストラリア・ドル	8,877,815	-	9,208,205	330,390
合計		506,822,342	-	520,571,665	2,464,033	

(注) 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は為替予約の受渡日(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。

(1口当たり情報)

(平成13年12月10日現在)	
本有価証券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	1.0625 円
(1万口当たり純資産額)	10,625 円)
なお、純資産額は、投資信託財産純資産総額を用いております。	

## (八) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	ドル	US TREASURY N/B 6.25%	2,670,000.00	2,743,737.87	
		US TREASURY N/B 11.625%	490,000.00	594,201.56	
		US TREASURY N/B 6.75%	360,000.00	390,178.12	
		US TREASURY N/B 10.75%	2,453,000.00	2,994,959.68	
		US TREASURY N/B 8.875%	595,000.00	779,078.12	
		US TREASURY N/B 8.875%	1,650,000.00	2,180,062.50	
		US TREASURY N/B 6.75%	1,340,000.00	1,485,725.00	
		US TREASURY N/B 6.625%	250,000.00	273,505.85	
		US TREASURY N/B 6.125%	110,000.00	114,632.03	
		US TREASURY N/B 11.75%	40,000.00	56,834.37	
		US TREASURY N/B 12.5%	345,000.00	503,807.81	
		US TREASURY N/B 4.625%	315,000.00	322,973.43	
		US TREASURY N/B 5.5%	1,150,000.00	1,181,939.45	
		US TREASURY N/B 6%	190,000.00	195,915.23	
		US TREASURY N/B 6.5%	555,000.00	604,581.43	
		US TREASURY N/B 6.875%	520,000.00	570,293.75	
		US TREASURY N/B 6.875%	230,000.00	258,103.12	
		US TREASURY N/B 8.125%	47,000.00	59,065.78	
		US TREASURY N/B 9%	40,000.00	53,326.56	
	計	銘柄数：19	13,350,000.00	15,362,921.66	
				( 1,932,655,544 )	
		組入時価比率：	34.6%	35.6%	
	カナダドル	CANADA=GOV'T 9%	100,000.00	113,380.00	
		CANADA-GOV'T 6%	1,470,000.00	1,544,925.90	
		CANADA-GOV'T 8%	545,000.00	695,856.00	
		CANADA-GOV'T 9%	50,000.00	69,172.00	
	計	銘柄数：4	2,165,000.00	2,423,333.90	
				( 193,430,511 )	
		組入時価比率：	3.5%	3.6%	
	ユーロ	BELGIUM KINGDOM 8.5%	2,495,000.00	2,976,036.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ES 5.75%	525,000.00	530,617.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.95%	2,860,000.00	2,931,500.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4%	2,490,000.00	2,337,861.00	
		BUNDESREPUB DEUTSCHLAND 6.5%	1,860,000.00	2,183,268.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHL 6.25%	370,000.00	418,840.00	
		BUONI POLIENNALI DEL 4.75%	3,925,000.00	3,994,472.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25%	4,185,000.00	4,296,739.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 6%	195,000.00	209,781.00	
		FRANCE O.A.T 5.5%	2,945,000.00	3,071,929.50	
		FRANCE O.A.T. 8.5%	390,000.00	551,070.00	
		FRANCE O.A.T. 4%	320,000.00	305,760.00	
		FRENCH TREASURY NOTE 4.5%	650,000.00	658,190.00	
	計	銘柄数：13	23,210,000.00	24,466,065.00	
				( 2,736,774,030 )	
		組入時価比率：	49.1%	50.4%	
	ポンド	TSY 4.25%	290,000.00	276,080.00	
		TSY 6%	50,000.00	59,745.00	
		TSY 7.5%	75,000.00	83,347.50	
		TSY 8.5%	860,000.00	1,003,620.00	
		TSY 8%	365,000.00	474,317.50	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		UNITED KINGDOM GOV 8%	245,000.00	257,250.00	
	計	銘柄数：6	1,885,000.00	2,154,360.00	
				( 388,107,954 )	
		組入時価比率：	7.0%	7.1%	
	スウェーデン クローネ	SWEDISH GOVERNMENT 8%	4,235,000.00	4,823,241.50	
	計	銘柄数：1	4,235,000.00	4,823,241.50	
				( 57,878,898 )	
		組入時価比率：	1.0%	1.1%	
	デンマーク クローネ	KINGDOM OF DENMARK 8%	4,545,000.00	5,129,487.00	
	計	銘柄数：1	4,545,000.00	5,129,487.00	
				( 77,044,894 )	
		組入時価比率：	1.4%	1.4%	
	オーストラリ アドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 10%	580,000.00	683,008.00	
	計	銘柄数：1	580,000.00	683,008.00	
				( 44,204,277 )	
		組入時価比率：	0.8%	0.8%	
	小計			5,430,096,108	
				( 5,430,096,108 )	
	合計			5,430,096,108	
		銘柄数：45		( 5,430,096,108 )	
		組入時価比率：	97.5%	100.0%	
	株式以外計			5,430,096,108	
				( 5,430,096,108 )	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額です。

(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す。

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記事項(デリバティブ取引等関係注記)」に記載しております。

中 間 監 査 報 告 書

平成 14 年 7 月 29 日

ブルデンシャル投信株式会社

代表取締役社長 長 谷 川 泰 二 殿

中 央 青 山 監 査 士 会



代表社員 公認会計士  
関与社員

山手



関与社員 公認会計士

大畑



当監査法人は、証券取引法第 193 条の 2 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（以下「ファンド」という。）の平成 13 年 12 月 11 日から平成 14 年 6 月 10 日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表及び中間損益及び剰余金計算書について中間監査を行った。

この中間監査に当たって、当監査法人は、一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠し、中間監査に係る通常実施すべき監査手続を実施した。すなわち、この中間監査において当監査法人は、中間監査実施基準二に準拠して財務諸表の監査に係る通常実施すべき監査手続の一部を省略した。

中間監査の結果、中間財務諸表についてファンドの採用する会計処理の原則及び手続は、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、かつ、前計算期間と同一の基準に従って継続して適用されており、また、中間財務諸表の表示方法は、「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）の定めるところに準拠しているものと認められた。

よって、当監査法人は、上記の中間財務諸表が PRU グッドライフ 2020 の平成 14 年 6 月 10 日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

ブルデンシャル投信株式会社及びファンドと当監査法人又は関与社員との間には、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) 中間貸借対照表

(単位：円)

科 目	期 別	当中間計算期間
		(平成14年6月10日現在)
		金 額
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,153,941
親投資信託受益証券		147,779,447
流動資産合計		148,933,388
資産合計		148,933,388
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		59,986
未払委託者報酬		899,828
その他未払費用		3,680
流動負債合計		963,494
負債合計		963,494
純資産の部		
元本		
元本		152,396,202
欠損金		
中間欠損金		4,426,308
(うち分配準備積立金)		(530,078)
(うち中間利益又は中間損失( ))		(687,208)
欠損金合計		4,426,308
純資産合計		147,969,894
負債・純資産合計		148,933,388

## (2) 中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

科 目	期 別	当中間計算期間
		(自平成13年12月11日 至平成14年6月10日)
		金 額
経常損益の部		
営業損益の部		
営業収益		
受取利息		-
有価証券売買等損益		1,650,702
営業収益計		1,650,702
営業費用		
受託者報酬		59,986
委託者報酬		899,828
その他費用		3,680
営業費用計		963,494
営業利益又は営業損失( )		687,208
経常利益又は経常損失( )		687,208
中間利益又は中間損失( )		687,208
一部解約に伴う中間利益分配額		742
期首欠損金		4,974,088
欠損金減少額		3,289
(中間追加信託に伴う欠損金減少額)		(-)
(中間一部解約に伴う欠損金減少額)		(3,289)
欠損金増加額		141,975
(中間一部解約に伴う欠損金増加額)		(-)
(中間追加信託に伴う欠損金増加額)		(141,975)
分配金		-
中間欠損金		4,426,308

重要な会計方針

期別 項目	当中間計算期間 (自平成13年12月11日) (至平成14年6月10日)
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。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

当中間計算期間 (平成14年6月10日現在)	
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	143,703,688 円
期中追加設定元本額	8,790,459 円
期中解約元本額	97,945 円

(中間損益及び剰余金計算書関係)

当中間計算期間 (自平成13年12月11日) (至平成14年6月10日)	
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	302,252 円

(有価証券関係)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係)

該当事項はありません。

(1口当たりの情報)

当中間計算期間 (平成14年6月10日現在)	
1口当たり純資産額	0.9710 円
(1万口当たり純資産額)	9,710 円)

(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とおりであります。

「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)

科 目	対象年月日	(平成14年6月10日現在)	
		金	額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン			136,827,862
株式			2,584,959,500
派生商品評価勘定			1,843,000
未収入金			7,000
未収配当金			10,507,939
未収利息			3
差入委託証拠金			715,000
流動資産合計			2,734,860,304
資産合計			2,734,860,304
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定			-
未払金			5,956,481
未払解約金			2,131,395
流動負債合計			8,087,876
負債合計			8,087,876
純資産の部			
元本			
元本			3,018,572,876
欠損金			
中間欠損金			291,800,448
欠損金合計			291,800,448
純資産合計			2,726,772,428
負債・純資産合計			2,734,860,304

重要な会計方針

項目	対象年月日	(自平成13年12月11日 至平成14年6月10日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式	<p>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。</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は原則として、証券取引所における中間計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は中間計算期間末日において知りうる最終相場)で評価しております。</p> <p>中間計算期間末日に当該証券取引所の最終相場がない場合は、当該証券取引所における直近の最終相場、もしくは当該証券取引所における中間計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な時価を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的</p>

	事由をもって時価と認められた価額、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
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、原則として中間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。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 受取配当金は原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。

#### 表示方法の変更

対象年月日	(自平成13年12月11日)
項目	(至平成14年6月10日)
1. 派生商品評価勘定	派生商品評価勘定については、従来、相殺処理をしていましたが、「信託財産貸借対照表等の科目について」(平成12年12月15日社団法人投資信託協会理事決議)に基づき、当期より、個別取引(契約)毎に資産、負債科目に両建て表示することとしております。
2. 差入委託証拠金	差入委託証拠金に含まれる値洗差損益金については、従来、差入委託証拠金に含めて表示していましたが、「信託財産貸借対照表等の科目について」(平成12年12月5日社団法人投資信託協会理事決議)に基づき、当期より、前払金又は前受金として表示することとしております。

#### 注記事項

(貸借対照表関係)

(平成14年6月10日現在)	
1. 本半期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	3,011,424,320円
同期中における追加設定元本額	133,353,748円
同期中における解約元本額	126,205,192円
同中間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	2,732,357,433円
PRU グッドライフ2010	113,683,466円
PRU グッドライフ2020	41,732,741円
PRU グッドライフ2030	53,072,109円
PRU グッドライフ2040	49,826,122円
PRU グッドライフ2010(年金)	579,981円
PRU グッドライフ2020(年金)	7,343,964円
PRU グッドライフ2030(年金)	4,222,424円
PRU グッドライフ2040(年金)	3,458,029円
ワールド・ミックス40(バランス指向)	4,559,458円
ワールド・ミックス60(成長指向)	4,424,672円
ワールド・ミックス80(積極指向)	3,312,477円
	計3,018,572,876円
2. 同ファンドの計算期間は、開示対象ファンドの計算期間とは異なるため、当期損益の金額を表示しておりません。	

(有価証券関係)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係)

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)

区分	種類	(平成14年6月10日現在)		時価	評価損益
		契約額等			
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	107,307,000	-	109,150,000	1,843,000
	合計	107,307,000	-	109,150,000	1,843,000

(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。原則として中間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、中間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。

(1口当たりの情報)

(平成14年6月10日現在)

本半期報告書における開示対象ファンドの中間期末における当該親投資信託の1口当たりの純資産額	0.9033円
(1万口当たり純資産額)	9,033円
なお、純資産額は、投資信託財産純資産総額を用いております。	

「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)

科 目	対象年月日	(平成14年6月10日現在)
		金 額
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		50,237,519
国債証券		1,563,012,660
地方債証券		117,672,045
特殊債券		326,799,300
社債券		315,607,276
未収利息		12,070,119
前払費用		359,413
流動資産合計		2,385,758,332
資産合計		2,385,758,332
負債の部		
流動負債		
未払解約金		1,054,880
流動負債合計		1,054,880
負債合計		1,054,880
純資産の部		
元本		
元本		2,343,886,889
剰余金		
剰余金		40,816,563
剰余金合計		40,816,563
純資産合計		2,384,703,452
負債・純資産合計		2,385,758,332

重要な会計方針

対象年月日	〔 自 平成 13 年 12 月 11 日 至 平成 14 年 6 月 10 日 〕
項目	
有価証券の 評価基準及び 評価方法	<p>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。</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は原則として、証券取引所における中間計算期間末日の最終相場（外貨建証券等の場合は中間計算期間末日において知りうる最終相場）で評価しております。</p> <p>中間計算期間末日に当該証券取引所の最終相場がない場合は、当該証券取引所における直近の最終相場、もしくは当該証券取引所における中間計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券等については、原則として、日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な時価を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

注記事項

（貸借対照表関係）

（平成 14 年 6 月 10 日現在）	
1. 本半期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	2,107,678,230円
同期中における追加設定元本額	321,457,074円
同期中における解約元本額	85,248,415円
同中間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	1,612,608,077円
PRU グッドライフ2010	585,219,011円
PRU グッドライフ2020	72,180,837円
PRU グッドライフ2030	35,463,931円
PRU グッドライフ2040	8,046,368円
PRU グッドライフ2010（年金）	2,985,492円
PRU グッドライフ2020（年金）	12,701,612円
PRU グッドライフ2030（年金）	2,821,436円
PRU グッドライフ2040（年金）	558,208円
ワールド・ミックス40（バランス指向）	7,444,234円
ワールド・ミックス60（成長指向）	3,063,271円
ワールド・ミックス80（積極指向）	794,412円
	計 2,343,886,889円
2. 同ファンドの計算期間は、開示対象ファンドの計算期間とは異なるため、当期損益の金額を表示しておりません。	

（有価証券関係）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等関係）

該当事項はありません。

（1口当たりの情報）

（平成 14 年 6 月 10 日現在）	
本半期報告書における開示対象ファンドの中間期末における当該親投資信託の1口当たりの純資産額	1,0174 円
（1万口当たり純資産額	10,174 円）
なお、純資産額は、投資信託財産純資産総額を用いております。	

「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)

科 目	対象年月日	(平成14年6月10日現在)	
		金	額
<b>資産の部</b>			
流動資産			
預金		110,471,882	
金銭信託		211,842	
コール・ローン		39,027,987	
株式		2,602,962,784	
新株予約権証券		4,364	
派生商品評価勘定		2,400	
未収入金		1,361,339	
未収配当金		5,257,402	
未収利息		1	
前払金		36,813,643	
差入委託証拠金		6,748,350	
流動資産合計		2,802,861,994	
資産合計		2,802,861,994	
<b>負債の部</b>			
流動負債			
派生商品評価勘定		12,714,804	
未払金		8,563,010	
未払解約金		1,226,345	
その他未払費用		-	
流動負債合計		22,504,159	
負債合計		22,504,159	
<b>純資産の部</b>			
元本			
元本		3,131,090,157	
欠損金			
欠損金		350,732,322	
欠損金合計		350,732,322	
純資産合計		2,780,357,835	
負債・純資産合計		2,802,861,994	

重要な会計方針

項目	対象年月日	(自平成13年12月11日 至平成14年6月10日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法		<p>株式、新株予約権証券          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。          証券取引所に上場されている有価証券          証券取引所に上場されている有価証券は原則として、証券取引所における中間計算期間末日の最終相場（外貨建証券等の場合は計算期間末日において知りうる最終相場）で評価しております。          中間計算期間末日に当該証券取引所の最終相場がない場合は、当該証券取引所における直近の最終相場、もしくは当該証券取引所における中間計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。          証券取引所に上場されていない有価証券          当該有価証券等については、原則として、日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。          時価が入手できなかった有価証券          適正な時価を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもつ</p>

	て時価と認めた価額で評価しております。
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、原則として中間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中間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. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4. 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、「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表ならびに運用報告書に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条及び 61 条に基づき処理しております。

#### 表示方法の変更

対象年月日	(自 平成 13 年 12 月 11 日) (至 平成 14 年 6 月 10 日)
項目	
1. 派生商品評価勘定	派生商品評価勘定については、従来、相殺処理をしていましたが、「信託財産貸借対照表等の科目について」（平成 12 年 12 月 15 日社団法人投資信託協会理事決議）に基づき、当期より、個別取引（契約）毎に資産、負債科目に両建て表示することとしております。
2. 差入委託証拠金	差入委託証拠金に含まれる値洗差損益金については、従来、差入委託証拠金に含めて表示していましたが、「信託財産貸借対照表等の科目について」（平成 12 年 12 月 5 日社団法人投資信託協会理事決議）に基づき、当期より、前払金又は前受金として表示することとしております。

#### 注記事項

（貸借対照表関係）

（平成 14 年 6 月 10 日現在）	
1. 本半期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	3,010,473,059円
同期中における追加設定元本額	198,919,427円
同期中における解約元本額	78,302,329円
同中間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	2,937,198,209円
PRU グッドライフ2010	77,831,724円
PRU グッドライフ2020	28,550,058円
PRU グッドライフ2030	36,320,931円
PRU グッドライフ2040	34,199,041円
PRU グッドライフ2010（年金）	397,051円
PRU グッドライフ2020（年金）	5,023,736円
PRU グッドライフ2030（年金）	2,889,567円
PRU グッドライフ2040（年金）	2,373,194円
ワールド・ミックス40（バランス指向）	2,477,734円
ワールド・ミックス60（成長指向）	2,225,959円
ワールド・ミックス80（積極指向）	1,602,953円
計	3,131,090,157円
2. 同ファンドの計算期間は、開示対象ファンドの計算期間とは異なるため、当期損益の金額を表示していません。	

（有価証券関係）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係)

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)

区分	種類	(平成14年6月10日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	117,994,168	-	105,279,364	12,714,804
	合計	117,994,168	-	105,279,364	12,714,804

(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。原則として中間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、中間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。

また、契約額等及び時価の邦貨換算は中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

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。

2. 通貨関連

(単位：円)

区分	種類	(平成14年6月10日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米・ドル	7,473,000	-	7,475,400	2,400
	合計	7,473,000	-	7,475,400	2,400

(注) 時価の算定方法

為替予約の時価

(1) 中間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。

中間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。

中間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) 中間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) 中間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) 中間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、中間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。

(1口当たりの情報)

(平成14年6月10日現在)

本半期報告書における開示対象ファンドの中間期末における当該親投資信託の1口当たりの純資産額

0.8880円

(1万口当たり純資産額

8,880円)

なお、純資産額は、投資信託財産純資産総額を用いております。

「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)

科 目	対象年月日	(平成14年6月10日現在)	
		金	額
資産の部			
流動資産			
預金			26,549,418
コール・ローン			60,721,442
国債証券			5,552,100,319
派生商品評価勘定			12,242,869
未収利息			79,884,330
前払費用			39,033,603
差入委託証拠金			2,615,309
流動資産合計			5,773,147,290
資産合計			5,773,147,290
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定			11,992,326
未払金			16,709,542
未払解約金			261,587
その他未払費用			-
流動負債合計			28,963,455
負債合計			28,963,455
純資産の部			
元本			
元本			5,218,505,861
剰余金			
中間剰余金			525,677,974
剰余金合計			525,677,974
純資産合計			5,744,183,835
負債・純資産合計			5,773,147,290

重要な会計方針

対象年月日 項目	(自平成13年12月11日 至平成14年6月10日)
1. 有価証券の 評価基準及び 評価方法	<p>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。 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は原則として、証券取引所における中間計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は中間計算期間末日において知りうる最終相場）で評価しております。 中間計算期間末日に当該証券取引所の最終相場がない場合は、当該証券取引所における直近の最終相場、もしくは当該証券取引所における中間計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 時価が入手できなかった有価証券 適正な時価を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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、原則として中間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中間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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表ならびに運用報告書に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び61条に基づき処理しております。</p>

表示方法の変更

対象年月日 項目	(自平成13年12月11日 至平成14年6月10日)
1. 派生商品評価勘定	<p>派生商品評価勘定については、従来、相殺処理をしていましたが、「信託財産貸借対照表等の科目について」（平成12年12月15日社団法人投資信託協会理事決議）に基づき、当期より、個別取引（契約）毎に資産、負債科目に両建て表示することとしております。</p>
2. 差入委託証拠金	<p>差入委託証拠金に含まれる値洗差損益金については、従来、差入委託証拠金に含めて表示していましたが、「信託財産貸借対照表等の科目について」（平成12年12月5日社団法人投資信託協会理事決議）に基づき、当期より、前払金又は前受金として表示することとしております。</p>

注記事項

（貸借対照表関係）

(平成14年6月10日現在)	
1. 本半期報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	5,247,834,944円
同期中における追加設定元本額	3,957,591,671円
同期中における解約元本額	3,986,920,754円
同中間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	5,116,546,224円
PRU グッドライフ2010	78,693,427円
PRU グッドライフ2020	10,259,861円
PRU グッドライフ2030	5,699,812円
PRU グッドライフ2040	2,005,059円
PRU グッドライフ2010（年金）	401,476円
PRU グッドライフ2020（年金）	1,805,525円

PRU グッドライフ2030 (年金)	453,498円
PRU グッドライフ2040 (年金)	139,092円
ワールド・ミックス40 (バランス指向)	1,512,139円
ワールド・ミックス60 (成長指向)	774,254円
ワールド・ミックス80 (積極指向)	215,494円
計	5,218,505,861円

2. 同ファンドの計算期間は、開示対象ファンドの計算期間とは異なるため、当期損益の金額を表示しておりません。

(有価証券関係)  
該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係)  
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. 通貨関連

(単位：円)

区分	種類	(平成14年6月10日現在)			
		契約額等	時価	評価損益	
		うち1年超			
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	米・ドル	760,516,003	-	759,693,858	822,145
	カナダ・ドル	47,353,105	-	47,397,972	44,867
	ユーロ	289,036,310	-	292,132,164	3,095,854
	英・ポンド	123,551,953	-	120,510,515	3,041,438
	スイス・フラン	-	-	-	-
	スウェーデンクローネ	31,210,610	-	31,639,252	428,642
	豪・ドル	17,348,605	-	17,662,520	313,915
	売建				
	米・ドル	654,077,458	-	649,463,297	4,614,161
	ユーロ	390,719,924	-	395,498,299	4,778,375
	英・ポンド	63,666,993	-	63,271,931	395,062
	スウェーデンクローネ	97,386,778	-	97,386,778	-
	デンマーク・クローネ	-	-	-	-
	豪・ドル	-	-	-	-
	合計		2,474,867,739		2,474,656,586

為替予約の時価

(1) 中間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。

中間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。

中間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) 中間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) 中間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) 中間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、中間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。

(1口当たりの情報)

(平成14年6月10日現在)

本半期報告書における開示対象ファンドの中間期末における当該親投資信託の1口当たりの純資産額

1,1007円

(1万口当たり純資産額

11,007円)

なお、純資産額は、投資信託財産純資産総額を用いております。

## 2. ファンドの現況

### (1) 純資産額計算書（平成 14 年 10 月 31 日現在）

資産総額	141,288,421 円
負債総額	749,843 円
純資産総額（ - ）	140,538,578 円
発行済数量	155,498,595 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9038 円

### （参考情報）

#### PRU 国内株式マザーファンド

資産総額	2,203,155,545 円
負債総額	6,135,400 円
純資産総額（ - ）	2,197,020,145 円
発行済数量	3,062,419,433 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7174 円

#### PRU 国内債券マザーファンド

資産総額	2,516,339,243 円
負債総額	20,246,000 円
純資産総額（ - ）	2,496,093,243 円
発行済数量	2,406,243,564 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0373 円

#### PRU 海外株式マザーファンド

資産総額	2,516,906,580 円
負債総額	300,317 円
純資産総額（ - ）	2,516,606,263 円
発行済数量	3,318,447,766 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7584 円

#### PRU 海外債券マザーファンド

資産総額	7,669,242,142 円
負債総額	1,281,216,256 円
純資産総額（ - ）	6,388,025,886 円
発行済数量	5,391,634,401 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1848 円

### (2) 投資有価証券の主要銘柄（平成 14 年 10 月 31 日現在）

#### 主要銘柄の明細

（単位：円）

地域	種類	銘柄	額面金額	簿価単価	簿価金額	時価単価	時価金額	投資比率（%）
日本	投資信託 受益証券	PRU国内株式 マザーファンド	45,236,888	8,354.00	37,795,093	7,174.00	32,452,943	23.09
日本	投資信託 受益証券	PRU国内債券 マザーファンド	65,246,037	10,081.00	65,776,244	10,373.00	67,679,714	48.15
日本	投資信託 受益証券	PRU海外株式 マザーファンド	38,146,043	9,125.00	34,811,114	7,584.00	28,929,959	20.58
日本	投資信託 受益証券	PRU海外債券 マザーファンド	9,563,631	10,769.00	10,299,256	11,848.00	11,330,990	8.06

（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)

## PRU 国内株式マザーファンド

(単位：円)

	地域	業種	銘柄名	通貨	数量 (株)	簿価 単価	簿価 金額	時価 単価	時価 金額	投資 比率 (%)
1	日本	通信業	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本円	420	330,632.78	138,865,768	226,000.00	94,920,000	4.32
2	日本	輸送用機器	トヨタ自動車	日本円	30,300	3,127.86	94,774,388	2,980.00	90,294,000	4.10
3	日本	電気機器	ソニー	日本円	7,758	5,964.06	46,269,195	5,270.00	40,884,660	1.86
4	日本	銀行業	三菱東京フィナンシャル・グループ	日本円	48	826,054.95	39,650,638	799,000.00	38,352,000	1.74
5	日本	医薬品	武田薬品工業	日本円	7,500	5,628.12	42,210,907	5,090.00	38,175,000	1.73
6	日本	輸送用機器	日産自動車	日本円	38,000	661.38	25,132,694	941.00	35,758,000	1.62
7	日本	輸送用機器	本田技研工業	日本円	8,100	4,907.33	39,749,433	4,390.00	35,559,000	1.61
8	日本	通信業	日本電信電話	日本円	73	471,093.68	34,389,839	449,000.00	32,777,000	1.49
9	日本	電気機器	松下電器産業	日本円	24,931	1,561.25	38,923,565	1,284.00	32,011,404	1.45
10	日本	電気機器	キヤノン	日本円	7,000	4,390.00	30,730,000	4,520.00	31,640,000	1.44
11	日本	電気・ガス業	東京電力	日本円	11,300	2,726.11	30,805,153	2,265.00	25,594,500	1.16
12	日本	銀行業	三井住友銀行	日本円	48,000	610.34	29,296,494	507.00	24,336,000	1.10
13	日本	小売業	セブン・イレブン・ジャパン	日本円	7,000	5,090.00	35,630,000	3,460.00	24,220,000	1.10
14	日本	証券・商品先物取引業	野村ホールディングス	日本円	16,000	1,687.00	26,992,000	1,410.00	22,560,000	1.02
15	日本	陸運業	東日本旅客鉄道	日本円	33	650,000.00	21,450,000	558,000.00	18,414,000	0.83
16	日本	電気機器	ローム	日本円	1,000	17,500.00	17,500,000	15,430.00	15,430,000	0.70
17	日本	銀行業	みずほホールディングス	日本円	78	287,637.82	22,435,750	186,000.00	14,508,000	0.66
18	日本	電気・ガス業	関西電力	日本円	8,200	1,875.45	15,378,760	1,734.00	14,218,800	0.64
19	日本	その他製品	任天堂	日本円	1,200	23,400.00	28,080,000	11,800.00	14,160,000	0.64
20	日本	陸運業	東海旅客鉄道	日本円	19	798,558.89	15,172,619	741,000.00	14,079,000	0.64
21	日本	輸送用機器	デンソー	日本円	7,200	1,798.51	12,949,272	1,953.00	14,061,600	0.64
22	日本	化学	花王	日本円	5,000	2,680.00	13,400,000	2,800.00	14,000,000	0.63
23	日本	保険業	ミレアホールディングス	日本円	15	884,581.20	13,268,718	915,000.00	13,725,000	0.62
24	日本	化学	富士写真フイルム	日本円	4,000	4,370.00	17,480,000	3,380.00	13,520,000	0.61
25	日本	電気機器	日立製作所	日本円	28,197	925.16	26,086,738	479.00	13,506,363	0.61
26	日本	電気・ガス業	中部電力	日本円	6,500	2,254.19	14,652,289	2,045.00	13,292,500	0.60
27	日本	化学	信越化学工業	日本円	3,500	4,872.17	17,052,595	3,780.00	13,230,000	0.60
28	日本	電気機器	リコー	日本円	6,000	2,330.00	13,980,000	2,190.00	13,140,000	0.59
29	日本	通信業	KDDI	日本円	35	303,000.00	10,605,000	360,000.00	12,600,000	0.57
30	日本	電気機器	村田製作所	日本円	2,000	8,800.00	17,600,000	5,790.00	11,580,000	0.52

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

## PRU 国内債券マザーファンド

(単位：円)

	地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還 期限	通貨	額面金額	簿価 単価	簿価金額	時価 単価	時価金額	投資 比率 (%)
1	日本	社債券	第2回(株)オリエンタルランド無担保社債券	1.35	2006/6/1	日本円	100,000,000	103.19	103,195,000	103.78	103,788,000	4.15
2	日本	国債証券	第2回利付国債(5年)	1.1	2005/3/21	日本円	79,000,000	102.61	81,063,480	102.44	80,934,710	3.24
3	日本	国債証券	第27回利付国債(20年)	5.0	2014/9/22	日本円	50,000,000	138.17	69,087,300	143.45	71,726,500	2.87
4	日本	国債	第198回利付国債	2.3	2007/9/20	日本円	60,000,000	109.62	65,777,200	109.89	65,935,200	2.64

	地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還期限	通貨	額面金額	簿価単価	簿価金額	時価単価	時価金額	投資比率 (%)
		証券	債(10年)									
5	日本	国債証券	第49回利付国債(20年)	2.1	2021/3/22	日本円	60,000,000	100.95	60,573,800	108.72	65,232,000	2.61
6	日本	国債証券	第234回利付国債(10年)	1.4	2011/9/20	日本円	60,000,000	100.36	60,218,600	104.70	62,825,400	2.51
7	日本	国債証券	第201回利付国債(10年)	1.9	2008/3/20	日本円	51,000,000	106.89	54,513,900	108.50	55,339,080	2.21
8	日本	国債証券	第226回利付国債(10年)	1.8	2010/12/20	日本円	50,000,000	104.50	52,251,500	108.49	54,246,500	2.17
9	日本	国債証券	第55回利付国債(4年)	0.4	2003/6/20	日本円	54,000,000	100.48	54,262,980	100.24	54,131,760	2.16
10	日本	国債証券	第237回利付国債(10年)	1.5	2012/3/20	日本円	50,000,000	101.99	50,995,700	105.22	52,614,000	2.10
11	日本	国債証券	第174回利付国債(10年)	4.6	2004/9/20	日本円	48,000,000	112.12	53,820,000	108.53	52,097,280	2.08
12	日本	国債証券	第61回利付国債(4年)	1.0	2004/7/21	日本円	50,000,000	101.90	50,951,200	101.65	50,826,000	2.03
13	日本	国債証券	第64回利付国債(4年)	0.6	2005/2/21	日本円	50,000,000	101.18	50,592,000	101.25	50,629,500	2.02
14	日本	国債証券	第15回利付国債(5年)	0.5	2006/9/20	日本円	50,000,000	100.67	50,339,200	101.23	50,615,000	2.02
15	日本	特殊債券	第91回東京三菱銀行債券(5年)	0.8	2004/5/27	日本円	50,000,000	101.20	50,602,000	101.01	50,505,000	2.02
16	日本	社債券	第463回東京電力	0.85	2005/6/24	日本円	48,000,000	101.57	48,756,960	101.85	48,892,320	1.95
17	日本	社債券	第2回昭和シェル石油株式会社無担保社債	3.25	2005/11/17	日本円	44,000,000	109.93	48,372,280	108.35	47,675,760	1.91
18	日本	国債証券	第187回利付国債(10年)	3.3	2006/6/20	日本円	39,000,000	112.66	43,939,740	111.29	43,406,220	1.73
19	日本	国債証券	第22回利付国債(20年)	5.3	2013/3/20	日本円	30,000,000	139.60	41,881,500	142.94	42,882,600	1.71
20	日本	国債証券	第210回利付国債(10年)	1.9	2009/3/20	日本円	39,000,000	106.49	41,534,610	109.24	42,605,550	1.70
21	日本	国債証券	第224回利付国債(10年)	1.8	2010/9/20	日本円	39,000,000	104.78	40,865,970	108.57	42,342,300	1.69
22	日本	国債証券	第219回利付国債(10年)	1.8	2010/3/22	日本円	38,000,000	105.11	39,942,560	108.62	41,277,500	1.65
23	日本	地方債証券	第2回東京都公募公債5年	1.2	2005/10/25	日本円	40,000,000	102.76	41,107,600	103.07	41,231,600	1.65
24	日本	特殊債券	い第597号興業債券	1.4	2004/4/27	日本円	40,000,000	101.93	40,774,000	101.56	40,624,400	1.62
25	日本	特殊債券	い第578号農林債券	1.6	2003/7/25	日本円	40,000,000	102.36	40,944,000	101.14	40,457,600	1.62
26	日本	国債証券	第14回利付国債(5年)	0.4	2006/6/20	日本円	40,000,000	99.66	39,866,800	100.84	40,338,000	1.61
27	日本	国債証券	第214回利付国債(10年)	1.8	2009/9/21	日本円	37,000,000	105.47	39,023,900	108.71	40,223,070	1.61
28	日本	国債証券	第220回利付国債(10年)	1.7	2010/3/22	日本円	37,000,000	104.31	38,596,550	107.88	39,915,600	1.59
29	日本	国債証券	第207回利付国債(10年)	0.9	2008/12/22	日本円	37,000,000	99.90	36,963,000	103.08	38,140,340	1.52
30	日本	国債証券	第186回利付国債10年	3.2	2006/3/20	日本円	34,000,000	111.69	37,976,300	110.25	37,486,700	1.50

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

PRU 海外株式マザーファンド

(単位：円)

	地域	業種	銘柄名	通貨	数量 (株)	簿価 単価	簿価 金額	時価 単価	時価 金額	投資 比率 (%)
1	アメリカ	資本財	GENERAL ELECTRIC CO.	USD	16,400	4,524.41	74,200,403	3,098.48	50,815,072	2.01
2	アメリカ	ソフトウェア・サービス	MICROSOFT CORP	USD	7,550	8,094.17	61,111,050	6,543.15	49,400,797	1.96
3	アメリカ	エネルギー	EXXON MOBIL CORPORATION	USD	11,100	4,713.21	52,316,633	4,198.65	46,605,081	1.85
4	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー	PFIZER INC	USD	10,200	5,268.99	53,743,720	3,948.56	40,275,312	1.60
5	アメリカ	各種金融	CITIGROUP INC	USD	8,400	5,446.00	45,746,404	4,568.25	38,373,350	1.52
6	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー	JOHNSON & JOHNSON	USD	4,900	7,010.55	34,351,702	7,064.28	34,615,011	1.37
7	アメリカ	小売	WAL-MART STORES INC	USD	4,900	6,806.80	33,353,320	6,628.16	32,477,984	1.29
8	イギリス	エネルギー	BP PLC	GBP	36,436	995.34	36,266,217	775.51	28,256,788	1.12
9	アメリカ	保険	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	USD	3,450	10,102.40	34,853,280	7,865.08	27,134,553	1.07
10	アメリカ	テクノロジー製品・機器	INTL BUSINESS MACHINES CORP	USD	2,750	14,174.54	38,979,987	9,692.14	26,653,396	1.05
11	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー	MERCK & CO., INC.	USD	3,750	8,197.92	30,742,219	6,682.36	25,058,880	0.99
12	イギリス	医薬品・バイオテクノロジー	GLAXOSMITHKLINE PLC	GBP	9,979	3,394.99	33,878,630	2,326.55	23,216,694	0.92
13	アメリカ	家庭用品・パーソナル用品	PROCTER & GAMBLE CO	USD	2,100	9,412.57	19,766,400	10,957.40	23,010,556	0.91
14	アメリカ	テクノロジー製品・機器	INTEL CORP	USD	10,900	3,920.12	42,729,332	2,087.00	22,748,387	0.90
15	イギリス	電気通信サービス	VODAFONE GROUP PLC	GBP	111,338	339.71	37,822,665	200.59	22,334,202	0.88
16	アメリカ	銀行	BANK OF AMERICA CORP	USD	2,500	7,728.23	19,320,593	8,679.44	21,698,600	0.86
17	アメリカ	食品・飲料・タバコ	COCA-COLA COMPANY	USD	3,700	5,753.19	21,286,834	5,771.92	21,356,104	0.84
18	アメリカ	電気通信サービス	VERIZON COMMUNICATIONS INC	USD	4,400	5,839.72	25,694,776	4,711.16	20,729,139	0.82
19	イギリス	銀行	HSBC HOLDINGS PLC	GBP	15,260	1,608.63	24,547,716	1,357.15	20,710,218	0.82
20	スイス	医薬品・バイオテクノロジー	NOVARTIS AG-REG SHS	CHF	4,458	4,873.36	21,725,476	4,633.21	20,654,892	0.82
21	オランダ	エネルギー	ROYAL DUTCH PETROLEUM	EUR	3,501	6,659.16	23,313,745	5,121.39	17,929,993	0.71
22	アメリカ	食品・飲料・タバコ	PHILIP MORRIS COMPANIES INC	USD	3,500	5,752.76	20,134,668	5,093.08	17,825,808	0.70
23	アメリカ	銀行	WELLS FARGO COMPANY	USD	2,800	5,329.97	14,923,924	6,237.61	17,465,324	0.69
24	アメリカ	電気通信サービス	SBC COMMUNICATIONS INC	USD	5,400	4,626.65	24,983,912	3,198.27	17,270,668	0.68
25	フランス	エネルギー	TOTAL FINA ELF S.A.	EUR	1,048	18,070.50	18,937,888	16,383.59	17,170,012	0.68

	地域	業種	銘柄名	通貨	数量 (株)	簿価 単価	簿価 金額	時価 単価	時価 金額	投資 比率 (%)
	ンス									
26	スイ ス	食品・飲料 ・タバコ	NESTLE REGISTERED SA-	CHF	643	28,879.46	18,569,494	26,043.74	16,746,128	0.66
27	アメ リカ	テクノロジー 製品・機器	CISCO SYSTEMS INC	USD	12,000	2,477.68	29,732,256	1,344.11	16,129,344	0.64
28	アメ リカ	食品・飲料 ・タバコ	PEPSICO INC	USD	2,910	6,174.35	17,967,374	5,393.69	15,695,655	0.62
29	フィン ランド	テクノロジー 製品・機器	NOKIA	EUR	7,630	3,174.60	24,222,265	2,029.13	15,482,332	0.61
30	アメ リカ	エネルギー	CHEVRONTEXACO CORP	USD	1,700	10,637.26	18,083,342	8,796.48	14,954,016	0.59

(注1) 投資比率は、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) 簿価及び時価は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。

PRU 海外債券マザーファンド

(単位：円)

	地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還 期限	通貨	額面金額	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	イタ リア	国債 証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	8.75	2006/7/1	EUR	8,700,000	14,161.05	1,232,011,829	14,202.76	1,235,640,189	19.34
2	イタ リア	国債 証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	8.5	2004/4/1	EUR	4,357,000	13,075.35	569,693,335	13,020.71	567,312,526	8.88
3	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8.75	2020/5/15	USD	2,369,000	17,491.14	414,365,239	17,771.60	421,009,204	6.59
4	ドイ ツ	国債 証券	DEUTSCHLAN D REPUBLIC	5.375	2010/1/4	EUR	2,890,000	12,827.57	370,717,057	12,932.12	373,738,314	5.85
5	フラ ンス	国債 証券	FRANCE O.A.T.	8.5	2023/4/25	EUR	1,980,000	17,306.11	342,661,173	17,265.88	341,864,566	5.35
6	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6.625	2007/5/15	USD	2,200,000	14,448.06	317,857,443	14,358.57	315,888,648	4.94
7	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	10.75	2005/8/15	USD	1,908,000	15,221.73	290,430,690	15,200.76	290,030,548	4.54
8	イタ リア	国債 証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	2010/11/1	EUR	2,135,000	12,822.92	273,769,531	12,929.69	276,048,975	4.32
9	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	11.75	2014/11/15	USD	1,380,000	18,299.84	252,537,812	18,480.00	255,024,000	3.99
10	ベル ギー	国債 証券	BELGIUM KINGDOM	8.0	2012/12/24	EUR	1,570,000	15,175.60	238,256,986	15,257.37	239,540,853	3.74
11	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	3.0	2004/1/31	USD	1,833,000	12,386.09	227,037,066	12,546.18	229,971,615	3.60
12	ドイ ツ	国債 証券	BUNDESREPU B. DEUTSCHL	6.25	2024/1/4	EUR	1,377,000	13,913.49	191,588,762	13,850.81	190,725,747	2.98
13	イギ リス	国債 証券	TSY	8.5	2007/7/16	GBP	704,000	22,598.09	159,090,612	22,526.50	158,586,602	2.48
14	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6.25	2030/5/15	USD	1,093,000	14,022.30	153,263,798	14,271.94	155,992,411	2.44
15	イギ リス	国債 証券	TSY	8.0	2015/12/7	GBP	535,000	25,666.14	137,313,882	25,398.22	135,880,517	2.12
16	スエ ーデン	国債 証券	SWEDISH GOVERNMENT	8.0	2007/8/15	SKK	7,725,000	1,504.45	116,219,384	1,531.69	118,323,067	1.85
17	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY	5.375	2003/6/30	USD	917,000	12,674.73	116,227,285	12,644.36	115,948,802	1.81

	地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還期限	通貨	額面金額	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	時価単価 (円)	時価金額 (円)	投資比率 (%)
	リカ	証券	N/B									
18	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	11.625	2004/11/15	USD	718,000	15,003.19	107,722,960	14,741.64	105,845,045	1.65
19	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	12.5	2014/8/15	USD	507,000	18,601.60	94,310,137	18,888.09	95,762,665	1.49
20	スベ イン	国債 証券	BONOS OBLIG DEL ES	5.75	2032/7/30	EUR	658,000	13,170.07	86,659,110	13,083.82	86,091,546	1.34
21	デン マー ク	国債 証券	KINGDOM OF DENMARK	6.0	2011/11/15	DKK	3,800,000	1,772.70	67,362,891	1,776.78	67,517,854	1.05
22	カナ ダ	国債 証券	CANADA GOVERNMENT	8.0	2027/6/1	CAD	653,000	10,332.35	67,470,254	10,233.80	66,826,779	1.04
23	イギ リス	国債 証券	TSY	6.0	2028/12/7	GBP	206,000	22,489.76	46,328,912	23,336.57	48,073,349	0.75
24	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	4.375	2012/8/15	USD	352,000	12,871.40	45,307,339	12,731.95	44,816,464	0.70
25	イギ リス	国債 証券	TSY	4.25	2032/6/7	GBP	233,000	18,478.09	43,053,959	18,347.53	42,749,760	0.66
26	カナ ダ	国債 証券	CANADA GOVERNMENT	9.0	2004/12/1	CAD	440,000	8,899.37	39,157,239	8,717.16	38,355,535	0.60
27	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	9.25	2016/2/15	USD	176,000	17,697.33	31,147,308	18,010.30	31,698,128	0.49
28	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6.125	2029/8/15	USD	199,000	13,723.10	27,308,974	14,004.37	27,868,706	0.43
29	カナ ダ	国債 証券	CANADA GOVERNMENT	9.0	2025/6/1	CAD	234,000	11,149.46	26,089,751	11,133.67	26,052,810	0.40
30	イギ リス	国債 証券	TSY	7.5	2006/12/7	GBP	111,000	21,599.44	23,975,381	21,499.51	23,864,467	0.37

(注1) 投資比率は、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) 簿価及び時価は、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

業種	投資比率 (%)
投資信託受益証券	99.88
合計	99.88

(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)

##### PRU 国内株式マザーファンド

業種	投資比率 (%)
株式	
水産・農林業	0.09
鉱業	0.10
建設業	1.82
食料品	2.61
繊維製品	0.92
パルプ・紙	0.61
化学	5.25
医薬品	4.91
石油・石炭製品	0.64
ゴム製品	0.68
ガラス・土石製品	0.84
鉄鋼	1.15
非鉄金属	0.62

業種	投資比率(%)
金属製品	0.58
機械	2.84
電気機器	14.36
輸送用機器	10.11
精密機器	1.26
その他製品	2.07
電気・ガス業	4.45
陸運業	4.05
海運業	0.33
空運業	0.34
倉庫・運輸関連業	0.14
通信業	6.85
卸売業	2.65
小売業	4.63
銀行業	7.98
証券・商品先物取引業	2.00
保険業	1.60
その他金融業	1.94
不動産業	1.07
サービス業	4.72
合計	94.21

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

#### PRU 国内債券マザーファンド

業種	投資比率(%)
国債証券	66.38
地方債証券	4.77
特殊債券	13.19
社債券	14.15
合計	98.49

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

#### PRU 海外株式マザーファンド

業種	投資比率(%)
株式	
エネルギー	7.48
素材	3.52
資本財	6.09
商業サービス・用品	1.70
運輸	1.22
自動車・自動車部品	1.15
耐久消費財・アパレル	1.01
ホテル・レストラン・レジャー	1.04
メディア	3.70
小売	4.03
食品・薬品小売	1.54
食品・飲料・タバコ	5.73
家庭用品・パーソナル用品	1.90
ヘルスケア機器・サービス	2.31
医薬品・バイオテクノロジー	10.54
銀行	11.31
各種金融	5.15

業種		投資比率(%)
	保険	4.24
	不動産	0.85
	ソフトウェア・サービス	3.30
	テクノロジー製品・機器	6.34
	電気通信サービス	5.48
	公益事業	3.26
	小計	92.89
新株予約権証券		0.00
合計		92.89

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

#### PRU 海外債券マザーファンド

業種	投資比率(%)
国債証券	96.31
合計	96.31

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

#### (3) 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### (4) 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)

##### PRU 国内株式マザーファンド

種類	地域	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	日本	TOPIX 2002年12月	買建	12	109,275,400	103,140,000	4.69

(注1) 投資比率は、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) 時価については、原則として当該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または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日にもっと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います。

##### PRU 海外株式マザーファンド

種類	地域	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	シカゴ	S&P500 EMINI FUTURE 2002年12月	買建	11	57,822,380	60,286,072	2.39
株価指数先物取引	シカゴ	S&P500 FUTURE 2002年12月	買建	2	52,606,400	54,805,520	2.18
株価指数先物取引	ロンドン	MSCI PAN EURO FUTURE 2002年12月	買建	10	18,087,494	18,271,961	0.73

(注1) 投資比率は、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) 時価については、銀行等が計算日の対顧客先物相場を基準として計算し、取引証券会社から入手した価額で評価しております。

(注3) 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。

### 第3 その他

1. 本書第一部「証券情報」および第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し、「目論見書の概要」として、目論見書の巻頭に記載することがあります。
2. 目論見書に、当ファンドの投資信託約款を添付することがあります。
3. 目論見書の表紙および裏表紙に委託会社およびファンドのロゴ・マークおよび図案を採用し、ファンドの形態等を記載することがあります。
4. 本書第一部「証券情報」および第二部「ファンド情報」に記載の内容について取得申込者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表等を付加して目論見書の当該内容に関連する個所に記載することがあります。また、「第二部 ファンド情報」中、「第1 ファンドの状況 5. 運用状況」および「第2 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」の情報の一部をグラフ化し、目論見書中に記載することがあります。
5. 「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」第12条第1項第1号ロに規定する書類として、要約目論見書を以下の記載に従い使用することがあります。

当該要約目論見書は、チラシ、ポスター、パンフレット、ダイレクトメール（ハガキ・封書用）として使用される他、新聞、雑誌、インターネット、電子媒体および書籍等に記載されることがあります。

当該要約目論見書は、使用形態によってレイアウト、用紙および印刷の色、デザイン等が変更されることがあります。また、写真、イラスト、キャッチ・コピーおよびロゴ・マークを付加して使用されることがあります。

当ファンドに関する下記の情報を、文章、数値、表、グラフ等で記載することがあります。なお、データは適宜、更新されます。

- 基準価額（収益分配金修正後のものを含みます。以下同じ。）、利回り、総収益、純資産総額、収益分配実績およびこれらの推移
  - 当ファンドの直近1週間、1ヵ月、3ヵ月、6ヵ月、1年、2年、設定来の騰落率及び累積リターン
  - 当ファンドの投資対象の資産別構成、業種別構成、格付構成、組入銘柄名（全部または一部）、組入比率、組入銘柄数
  - 投信評価機関、投信評価会社等による評価および評価データ等を含むレポート  
以下の趣旨の事項を記載することがあります。
  - 投資信託はリスクを含む商品であり、運用実績は市場環境等により変動しますが、これらの運用による損益はすべて投資家の皆様に帰属します。したがって元本が保証されているものではありません。
  - 外国証券への投資には、通貨の変動、政治経済の状況等によるリスクが付随します。
  - このファンドの投資目的が達成される保証はありません。
  - 過去の運用実績は必ずしも将来の運用成果等を約束するものではありません。
  - 投資信託は預金または保険契約ではないため、預金保険および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
  - 販売会社が登録金融機関の場合、証券会社と異なり、投資者保護基金に加入しておりません。
  - 投資信託は、金融機関の預貯金と異なり、元本および利息の保証はありません。
  - ブルデンシャル・グループについて
    - ◇ 会社の概要および運用資産総額（データは適宜更新されます。）
    - ◇ ロゴ・マークの説明
    - ◇ 調査・運用体制の説明（各拠点ごとの調査・運用スタッフの人数、調査対象企業、調査対象企業に対する年間コンタクト回数、および各々の合計数等を含みます。データは適宜更新されます。）
6. 要約目論見書は、届出の効力が発生するまでの間は、使用しません。
  7. 要約目論見書に記載する届出の効力発生日欄については、効力発生日以降に記入して使用します。

## 第4 内国投資信託受益証券事務の概要

### (1) 投資信託受益証券の名義書換等

投資家は、委託会社の定める手続きによって、ファンドの受益証券を取得した販売会社に申出ることにより、無記名式受益証券を記名式にまたは記名式受益証券を無記名式に変更することができます。また、記名式受益証券を所有している投資家は、委託会社の定める手続きによって、ファンドの受益証券を取得した販売会社に申出ることにより、名義書換を請求することができます。ただし、名義書換手続きは、ファンドの毎計算期間の末日の翌日から15日間停止します。記名式受益証券から無記名式受益証券への変更および無記名式受益証券から記名式受益証券への変更ならびに名義書換にかかる手数料は徴収しません。

### (2) 受益者名簿の閉鎖の時期

特に定めていません。

### (3) 受益者集会

受益者集会は開催されません。

### (4) 受益者等に対する特典

受益者に対する特典はありません。

### (5) 譲渡制限

記名式の受益証券の譲渡は、名義書換によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

運用の基本方針

投資信託約款第 23 条の規定に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、投資信託財産の中・長期的な成長を図ることを目標として、ファミリーファンド方式で運用を行います。

2. 運用方法

(1) 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。

(2) 投資態度

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。

当初設定時は、PRU国内株式マザーファンド25%、PRU国内債券マザーファンド49.5%、PRU海外株式マザーファンド15%、PRU海外債券マザーファンド7.5%およびコール・ローン等の短期金融商品3%の組入比率を基本ガイドラインとし、この基本ガイドラインに基づいてポートフォリオを構築します。

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、償還日に近づくとしたがつ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。

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者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。

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。

当ファンドは、ブルデンシャル・インベストメント社より助言を受け、運用を行います。

(3) 投資制限

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および新株予約権付社債のうち商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがあるもの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。

3. 収益分配方針

毎決算時に、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、委託者が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないこともあります。

収益分配にあてず投資信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。

約 款

(信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は、証券投資信託であり、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・インクを委託者とし、りそな信託銀行株式会社を受託者とします。

(信託事務の委託)

第2条 受託者は、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。

(信託の目的および金額)

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、金 120,188,161 円を受託者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

(信託金の限度額)

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、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。

追加信託が行われたときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。

委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第5条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から平成 32 年 12 月 10 日までとします。

(受益証券の取得申込みの勧誘の種類)

第6条 この信託に係る受益証券の取得申込みの勧誘は、証券取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第13項で定める公募により行われます。

(当初の受益者)

第7条 こ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、委託者の指定する受益証券取得申込者とし、第8条の規定により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。

(受益権の分割および再分割)

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については 120,188,161 口を、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第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

委託者は、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

この約款において基準価額とは、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。）を法令および社団法人投資信託協会規則にしたがつて時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、投資信託財産に属する外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。））と、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における当日の対顧客電信売買

相場の仲値によって計算します。

第34条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

#### (信託日時の異なる受益権の内容)

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

#### (受益証券の発行)

第11条 委託者は、第8条の規定により分割された受益権を表示する収益分配金交付票付きの無記名式の受益証券を発行します。

#### (受益証券の発行についての受託者の認証)

第12条 委託者は、前条の規定により受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの投資信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

#### (受益証券の申込単位、価額および手数料等)

第13条 委託者の指定する証券会社(証券取引法第2条第9項に規定する証券会社をいい、外国証券業者に関する法律第2条第2号に規定する外国証券会社を含みます。以下同じ。)および登録金融機関(証券取引法第65条の2第3項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。)は、第11条の規定により発行された受益証券を、その取得申込者に対し、委託者の指定する証券会社および登録金融機関が委託者の承認を得て独自に定める申込単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。ただし、別に定める自動けいぞく投資約款にしたがって契約(以下「別に定める契約」といいます。)を結んだ取得申込者には、1口の整数倍をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。なお、ニューヨークまたはロンドンのいずれかの証券取引所または銀行が休業日の場合は、追加信託の申込みを受付けないものとします。ただし、第50条第2項ただし書き以外に規定する収益分配金の再投資に係る追加信託金の申込みに限ってこれを受付けるものとします。

この約款において「自動けいぞく投資約款」とは、この信託について受益証券取得申込者と委託者の指定する証券会社および登録金融機関が締結する「自動けいぞく投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「自動けいぞく投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

前項の受益証券の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、手数料および当該手数料に係る消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この投資信託契約締結日前の取得申込みに係る受益証券の価額は、1口につき1円に、手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

前項の手数料の額は、当該取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.0%の率を乗じて得た額を上限として、委託者の指定する証券会社および登録金融機関が独自に定めることができるものとします。

前2項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益証券の価額は、原則として、第45条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

委託者は、証券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、第1項による受益証券の取得申込みの受付けを中止することができます。

前項により受益証券の取得申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止以前に行った当日の受益証券の取得申込みを撤回できます。ただし、受益者がその受益証券の取得申込みを撤回しない場合には、当該証券の取得申込みの価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に受益証券の取得申込みを受付けたものとして第2項の規定に準じて計算された価額とします。

#### (受益証券の種類)

第14条 委託者が発行する受益証券は、1口券、10口券、100口券、1,000口券、1万口券、5万口券、10万口券、50万口券、100万口券、1,000万口券および5,000万口券の11種類とします。

委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、第11条の受益証券を原則として保護預り契約に基づき保管するものとします。

別に定める契約および保護預り契約に基づいて委託者の指定する証券会社または登録金融機関が保管する受益証券の種類は、第1項に定めるもののほか、1口の整数倍の口数を表示した受益証券とすることができます。

#### (受益証券の記名式、無記名式への変更ならびに名義書換手続き)

第15条 委託者は、受益者が委託者の定める手続きによって請求したときは、無記名式の受益証券と引換えに記名式の受益証券を、または記名式の受益証券と引換えに無記名式の受益証券を交付します。

記名式の受益証券の所持人は、委託者の定める手続きによって名義書換を委託者に請求することができます。

前項の規定による名義書換の手続きは、第45条に規定する毎計算期間の末日の翌日から15日間停止します。

#### (記名式の受益証券譲渡の対抗要件)

第16条 記名式の受益証券の譲渡は、前条の規定による名義書換によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

#### (無記名式の受益証券の再交付)

第17条 委託者は、無記名式の受益証券を喪失した受益者が、当該受益証券の公示催告による除権判決の謄本を添え、委託者の定める手続きにより再交付を請求したときは、無記名式の受益証券を再交付します。

#### (記名式の受益証券の再交付)

第18条 委託者は、記名式の受益証券を喪失した受益者が、委託者の定める手続きによって再交付を請求したときは、記名式の受益証券を再交付します。

#### (受益証券を毀損した場合等の再交付)

第19条 委託者は、受益証券を毀損または汚損した受益者が、当該受益証券を添え、委託者の定める手続きにより再交付を請求したときは、受益証券を再交付します。ただし、真偽を鑑別しがたいときは、前2条の規定を準用します。

#### (受益証券の再交付の費用)

第20条 委託者は、受益証券を再交付するときは、受益者に対して実費を請求することができます。

#### (投資の対象とする資産の種類)

第21条 この信託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。

1. 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。)

イ.有価証券

ロ.有価証券指数等先物取引に係る権利

ハ.有価証券オプション取引に係る権利

ニ.外国市場証券先物取引に係る権利

ホ.有価証券店頭指数等先物取引に係る権利

ヘ.有価証券店頭オプション取引に係る権利

ト.有価証券店頭指数等スワップ取引に係る権利

チ.金銭債権(イ、リ.およびル.に掲げるものに該当するものを除きます。以下同じ。)

リ.約束手形(証券取引法第2条第1項第8号に掲げるものを除きます。以下同じ。)

又.金融先物取引等(金融先物取引法第2条第9項に規定する金融先物取引等をいいます。以下同じ。)に係る権利

ル.金利、通貨の価格その他の指標の数値としてあらかじめ当事者間で約定された数値と将来の一定の時期における現実の当該指標の数値の差に基づいて算出される金銭の授受を約する取引又はこれに類似する取引であって、内閣府令で定めるもの(金融先物取引等を除きます。)に係る権利(ロ.からト.までに掲げるものに該当するものを除きま

す。)   
 ヲ.次に掲げるものを信託する信託の受益権(イ.に掲げるものに該当するものを除きます。)

1. 金銭(信託財産を主として前各号に掲げる資産に対する投資として運用することを目的とする場合に限り。)
2. 有価証券
3. 金銭債権

ウ.当事者の一方が相手方の行う前各号に掲げる資産の運用のために出資を行い、相手方がその出資された財産を主として当該資産に対する投資として運用し、当該運用から生じる利益の分配を行うことを約する契約に係る出資の持分(以下「匿名組合出資持分」といいます。)

カ.金銭の信託の受益権(イ.に掲げるものに該当するものを除きます。)であって、信託財産を主として匿名組合出資持分に対する投資として運用することを目的とするもの

2. 次に掲げる特定資産以外の資産  
 抵当証券

#### (運用の指図範囲)

第22条 委託者は、信託金を、主としてブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン・インクを委託者とし、リそな信託銀行株式会社を受託者として締結された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(以下「親投資信託」といいます。)の受益証券のほか、次の有価証券に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 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。)
6. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券(証券取引法第2条第1項第3号の2で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(証券取引法第2条第1項第5号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券または優先出資引受権を表示する証書(証券取引法第2条第1項第5号の2で定めるものをいいます。)
9. 資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券(証券取引法第2条第1項第5号の3で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 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
12. 外国または外国法人の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券(証券取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券または外国投資証券(証券取引法第2条第1項第7号の2で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(証券取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(証券取引法第2条第1項第10号の2で定めるものをいいます。)
17. 預託証書(証券取引法第2条第1項第10号の3で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 貸付債権信託受益権(証券取引法第2条第2項第1号で定めるものをいいます。)

20. 外国法人に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号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、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 抵当証券

第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項第1号から第4号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。

委託者は、投資信託財産に属する株式の時価総額と親投資信託の投資信託財産に属する株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の60を超えることとなる投資の指図をしません。

前項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親投資信託受益証券の時価総額に親投資信託の投資信託財産の純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

委託者は、取得時において投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と親投資信託の投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

前項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親投資信託受益証券の時価総額に親投資信託の投資信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額と親投資信託の投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

前項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親投資信託受益証券の時価総額に親投資信託の投資信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

#### (運用の基本方針)

第23条 委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

#### (投資する株式等の範囲)

第24条 委託者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、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券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。

前項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、委託者が投資することを指図することができます。

#### (同一銘柄の株式等への投資制限)

第25条 委託者は、取得時において投資信託財産に属する同一銘柄

柄の株式の時価総額と親投資信託の投資信託財産に属する当該株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

前項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親投資信託受益証券の時価総額に親投資信託の投資信託財産の純資産総額に占める当該株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

委託者は、取得時において投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と親投資信託の投資信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

前項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親投資信託受益証券の時価総額に親投資信託の投資信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

#### (同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第26条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の転換社債および新株予約権付社債のうち商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがあるものの時価総額と親投資信託の投資信託財産に属する当該転換社債および新株予約権付社債のうち商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがあるものの時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

前項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親投資信託受益証券の時価総額に親投資信託の投資信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および新株予約権付社債のうち商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがあるものの時価総額の割合を乗じて得た額とします。

#### (信用取引の指図範囲)

第27条 委託者は、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の指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができますものとし、

前項の信用取引の指図は、次の各号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、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、

1. 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
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 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(商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
6. 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の新株予約権(前号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)

第28条 委託者は、わが国の証券取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所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。)

委託者は、わが国の取引所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取引所における

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。

委託者は、わが国の取引所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取引所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)

第29条 委託者は、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。

スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期間が、原則として第5条に定める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。

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。

委託者は、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。

#### (金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲)

第30条 委託者は、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、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条に定める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。

金利先渡取引および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。

委託者は、金利先渡取引および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および範囲)

第31条 委託者は、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各号の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

1. 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。
2. 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。

前項に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。

委託者は、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。

#### (外貨建有価証券への投資制限)

第32条 委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産と親投資信託の投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。

前項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親投資信託受益証券の時価総額に親投資信託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。

#### (特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第33条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### (外国為替予約取引の指図および範囲)

第34条 委託者は、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。  
前項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（親投資信託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。

前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者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。

第2項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親投資信託の受益証券の時価総額に親投資信託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。

#### （保管業務の委任）

第35条 受託者は、委託者と協議のうえ、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。

#### （有価証券の保管）

第36条 受託者は、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。

#### （混蔵寄託）

第37条 金融機関または証券会社から、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mercial・ペーパーは、当該金融機関または証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるものとします。

#### （一括登録）

第38条 投資信託財産に属する国債証券のうち振替決済に係る国債証券については、日本銀行で保管することがあります。この場合、日本銀行においては日本銀行名義で一括登録することがあります。

#### （投資信託財産の表示および記載の省略）

第39条 投資信託財産に属する有価証券については、委託者または受託者が必要と認める場合のほか、信託の表示および記載をしません。

#### （有価証券売却等の指図）

第40条 委託者は、投資信託財産に属する親投資信託の受益証券に係る投資信託契約の一部解約、有価証券の売却等の指図ができます。

#### （再投資の指図）

第41条 委託者は、前条の規定による一部解約金、売却代金、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収入金を再投資することの指図ができます。

#### （資金の借入れ）

第42条 委託者は、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。

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金融商品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の売却代金、金融商品の解約代金および有価証券等の償還金の合

計額を限度とします。

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。

借入金の利息は投資信託財産中から支弁します。

#### （損益の帰属）

第43条 委託者の指図に基づく行為により投資信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

#### （受託者による資金の立替え）

第44条 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、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

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、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。

前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

#### （信託の計算期間）

第45条 この信託の計算期間は、毎年12月11日から翌年12月10日までとするを原則とします。ただし、第1計算期間は平成13年3月16日から平成13年12月10日までとします。

前項にかかわらず、前項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されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第5条に定める信託期間の終了日とします。

#### （投資信託財産に関する報告）

第46条 受託者は、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、これを委託者に提出します。

受託者は、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、これを委託者に提出します。

#### （信託事務の諸費用）

第47条 投資信託財産に関する租税、投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）等の信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

#### （信託報酬等の額および支弁の方法）

第48条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第45条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に次に定める率を乗じて得た額とします。

第1計算期から第10計算期の場合 年10,000分の128  
第11計算期から第20計算期の場合 年10,000分の108

前項の信託報酬は、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、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

委託者は第22条第1項に規定する親投資信託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、第1項の委託者が受ける報酬から支払うものとします。その報酬額は、第45条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産に属する各親投資信託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10,000分の10  
PRU 海外債券マザーファンド 年10,000分の10

#### （収益の分配）

第49条 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する

金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### (収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第50条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から収益分配金交付票と引換えに受益者に支払います。

前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託者は、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金を委託者の指定する証券会社および登録金融機関に支払います。この場合、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益証券の売付けを行います。ただし、第54条第4項により信託の一部解約が行われた場合に、当該受益証券に帰属する収益分配金があるときは、前項の規定に準じて受益者に支払います。

償還金(信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。)は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引換えに受益者に支払います。

一部解約金は、受益者の請求を受けた日から起算して、原則として、5営業日目から受益者に支払います。

前各項(第2項ただし書き以外を除きます。)に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する証券会社または登録金融機関の営業所等において行うものとしします。

収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益証券の価額等に応じて計算されるものとしします。

記名式の受益証券を有する受益者は、あらかじめその印鑑を届け出るものとし、第1項の場合には収益分配金交付票に、第3項および第4項の場合には受益証券に、記名し届出印を押捺するものとしします。

委託者は、前項の規定により押捺された印影を届出印と照合し、相違ないものと認めて収益分配金および償還金もしくは一部解約金の支払いをしたときは、印鑑の盗用その他の事情があっても、そのために生じた損害について、その責を負わないものとしします。

#### (収益分配金および償還金の時効)

第51条 受益者が、収益分配金については、前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託者が受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

#### (収益分配金、償還金および一部解約金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責)

第52条 受託者は、収益分配金については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については第50条第3項に規定する支払開始日の前日までに、一部解約金については第50条第4項に規定する支払日までに、その全額を委託者に交付します。

受託者は、前項の規定により委託者に収益分配金、償還金および一部解約金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

#### (受益証券の混蔵保管)

第53条 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、原則として、第11条の規定により発行された受益証券を別に

定める契約または保護預り契約に基づき、混蔵保管するものとしします。

#### (一部解約)

第54条 受益者は、自己の有する受益証券につき、委託者に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。

前項の規定にかかわらず、ニューヨークまたはロンドンのいずれかの証券取引所または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します。

受益者が第1項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者の指定する証券会社および登録金融機関に対し、受益証券をもって行うものとしします。

委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

前項の一部解約の価額は、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。

委託者は、証券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、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。

前項により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、当該証券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たものとして第5項の規定に準じて計算された価額とします。

#### (投資信託契約の解約)

第55条 委託者は、信託期間中において、こ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、受託者と合意のうえ、こ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、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

委託者は、前項の事項について、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こ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、こ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。

前項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者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します。

前項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、第1項の投資信託契約の解約をしません。

委託者は、こ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、全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。

第3項から前項までの規定は、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、第3項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。

#### (投資信託契約に関する監督官庁の命令)

第56条 委託者は、監督官庁よりこ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、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、第60条の規定にしたがいます。

#### (委託者の認可取消等に伴う取扱い)

第57条 委託者が監督官庁より認可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、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託業者に引き

継ぐことを命じたときは、この信託は、第 60 条第 4 項に該当する場合を除き、当該投資信託委託業者と受託者との間において存続します。

**（委託者の営業の譲渡および承継に伴う取扱い）**

第58条 委託者は、営業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する営業を譲渡することがあります。

委託者は、分割により営業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する営業を承継させることがあります。

**（受託者の辞任に伴う取扱い）**

第59条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。この場合、委託者は、第 60 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

受託者が辞任した後、委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこ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）**

第60条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、こ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け出ます。

委託者は、前項の変更事項のうち、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こ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、こ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。

前項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者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。

前項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、第 1 項の投資信託約款の変更をしません。

委託者は、当該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、全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。

**（反対者の買取請求権）**

第61条 第 55 条に規定する投資信託契約の解約または前条に規定する投資信託約款の変更を行う場合において、第 55 条第 3 項または前条第 3 項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、委託者の指定する証券会社および登録金融機関を経由して、受託者に対し、自己の有する受益証券を、投資信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

委託者は、受託者が前項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。

前各項の買取請求の事務取扱い等については、委託者と受託者との協議により定めます。

**（公告）**

第62条 委託者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）**

第63条 この投資信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

**（付則）**

第 1 条 第 50 条第 6 項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第 27 条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益証券の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者毎の信託時の受益証券の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益証券の価額をい

い、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

上記条項により投資信託契約を締結します。

投資信託契約締結日 平成 13 年 3 月 16 日

（本社） アメリカ合衆国デラウェア州ニュー・キャッスル郡シティ・オブ・ウィルミントン、オレンジ・ストリート 1209、コーポレーション・トラスト・センター  
（東京支店）東京都千代田区丸の内二丁目 3 番 2 号  
委託者 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・インク

東京千代田区大手町二丁目 1 番 1 号  
受託者 りそな信託銀行株式会社

## PRU グッドライフ 2020

目論見書

(訂正事項分)

平成 15 年 3 月 10 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・インク

1. この目論見書により行うPRU グッドライフ 2020の受益証券の募集については、委託会社は、証券取引法(昭和 23 年法第 25 号)第 5 条の規定により有価証券届出書を平成 14 年 12 月 13 日に関東財務局長に提出しており、平成 14 年 12 月 29 日にその届出の効力が生じております。また、同法第 7 条の規定により有価証券届出書の訂正届出書を平成 15 年 3 月 3 日および平成 15 年 3 月 10 日に関東財務局長に提出しております。
2. PRU グッドライフ 2020 の受益証券の価額は、同ファンドに組入れられている有価証券の値動きのほか為替変動による影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資家の皆様に帰属します。したがって、このファンドは元本が保証されているものではありません。

## ・目論見書の訂正理由

「PRU グッドライフ 2020 目論見書」（以下「原目論見書」といいます。）の記載事項のうち、下記の項目について訂正すべき事項がありましたので、これを訂正するものです。

## ・訂正の内容

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。（以下同じ。）

### 第一部 証券情報

（原目論見書 3 頁）

（前略）

（11）払込取扱場所

前記「（9）申込取扱場所」と同じです。

（12）振替機関に関する事項

該当事項はありません。

（13）その他

（後略）

### 第二部 ファンド情報

#### 第1 ファンドの状況

#### 1. ファンドの性格

（2）ファンドの沿革

（原目論見書 4 頁）

平成 13 年 3 月 16 日

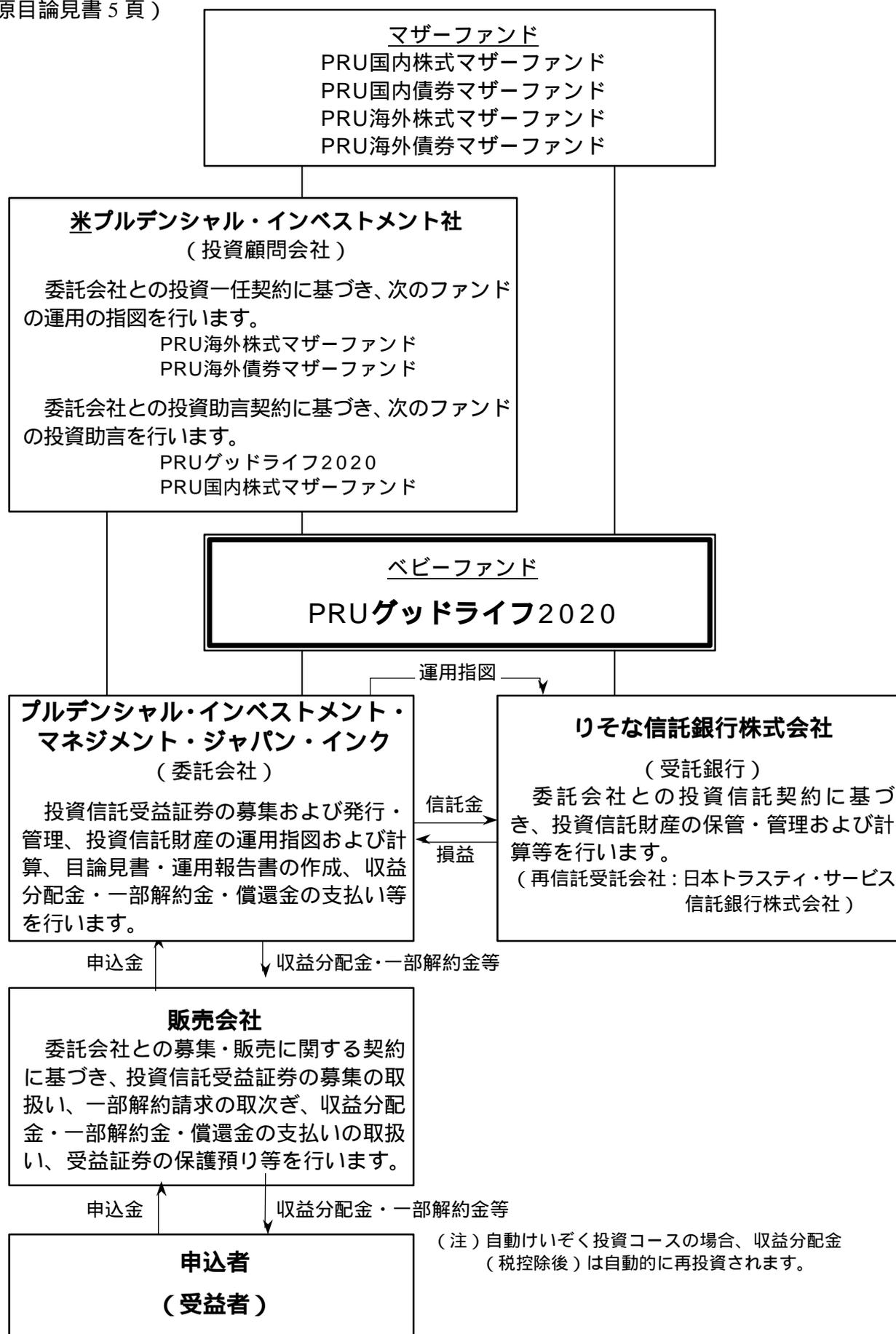
平成 14 年 12 月 31 日

プ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  
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・  
インク（委託会社）がプ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

(3) ファンドの仕組み

a. ファンドの仕組み

(原目論見書 5 頁)



(注) 自動けいぞく投資コースの場合、収益分配金(税控除後)は自動的に再投資されます。

b. ファンドの関係法人  
(原目論見書 6 頁)

(a) 委託会社

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・インク

当ファンドの委託会社として、投資信託財産の運用指図およびその権限の委託、受益証券の発行等を行います。なお、委託会社は米プルデンシャル・インベストメント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受けます。

((b) 略)

(c) 販売会社

当ファンドの販売会社として、受益証券の募集の取扱、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。

c. 委託会社等の概況 (本書提出日現在)

(原目論見書 6 頁)

沿革	(前略) 平成 14 年 12 月 31 日 プルデンシャル投信株式会社およびプルデンシャル・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社より営業の全部を譲受
----	--

## 2. 投資方針

(1) 投資方針

b. 運用方法

(b) 投資態度

(原目論見書 7 頁)

( ~ 略)

当ファンドは、米プルデンシャル・インベストメント社より助言を受け、運用を行います。

(3) 運用体制

**運用体制**

(原目論見書 10 頁)

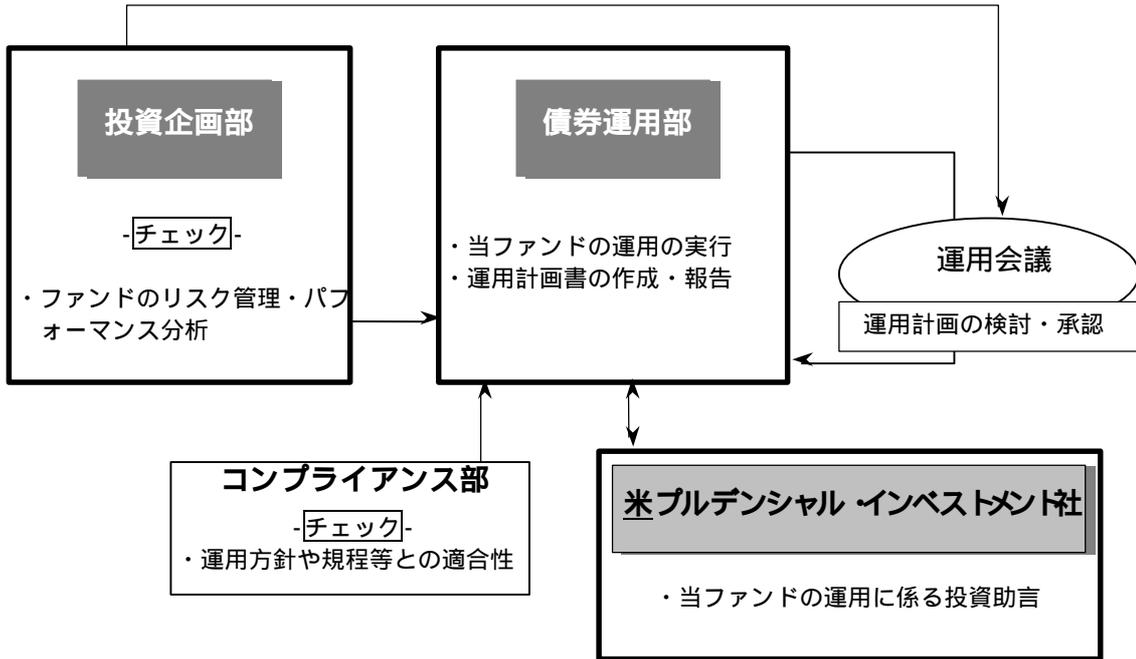
当ファンドは、主として、PRU 国内株式マザーファンド受益証券、PRU 国内債券マザーファンド受益証券、PRU 海外株式マザーファンド受益証券および PRU 海外債券マザーファンド受益証券を投資対象とします。

当ファンドは、投資助言契約に基づき米プルデンシャル・インベストメント社から助言を受け、債券運用部のファンド・マネージャーが上記マザーファンドの投資配分を決定します。

**管理体制**

(原目論見書 10 頁)

(前略)



**(参考) マザーファンドの投資方針**

**PRU 国内株式マザーファンド**

(原目論見書 15 頁)

投資態度	( ~ 略) 当ファンドは、米プルデンシャル・インベストメント社より助言を受け、運用を行います。
------	---

**PRU 海外株式マザーファンド**

(原目論見書 17 頁)

投資態度	( ~ 略) 運用にあたっては、投資一任契約に基づいて米プルデンシャル・インベストメント社に運用の指図に関する権限を委託します。
------	---

**PRU 海外債券マザーファンド**

(原目論見書 18 頁)

投資態度	( ~ 略) 運用にあたっては、投資一任契約に基づいて米プルデンシャル・インベストメント社に運用の指図に関する権限を委託します。
------	---

## 5. 運用状況

(原目論見書 22 頁)  
以下の情報に更新します。

### (1) 投資状況 (平成 15 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	34,399,668	24.64
投資信託受益証券 (PRU国内債券マザーファンド)	日本	66,235,948	47.44
投資信託受益証券 (PRU海外株式マザーファンド)	日本	27,223,514	19.50
投資信託受益証券 (PRU海外債券マザーファンド)	日本	11,568,539	8.28
現金、預金、その他資産 (負債控除後)		198,843	0.14
合計 (純資産総額)		139,626,512	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とおりです。

#### 投資状況

投資資産の種類		時価 (円)	投資比率 (%)
株 式	日 本	1,172,554,750	89.59
現金、預金、その他資産 (負債控除後)		136,148,353	10.41
合計 (純資産総額)		1,308,703,103	100.00

(注) 投資比率は、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。

#### その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引 (買建)	日 本	114,380,000	8.73
合計		114,380,000	8.73

(注1) 投資比率は、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) 時価については、原則として当該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または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日にもっと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います。

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とおりです。

#### 投資状況

投資資産の種類		時価 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	605,683,500	66.86
社債券	日本	110,781,590	12.23
地方債証券	日本	40,553,120	4.47
特殊債券	日本	131,249,260	14.49
	小計	888,267,470	98.05
現金、預金、その他資産 (負債控除後)		17,632,873	1.95
合計 (純資産総額)		905,900,343	100.00

(注) 投資比率は、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とおりです。

#### 投資状況

投資資産の種類		時価 (円)	投資比率 (%)
株 式	アメリカ	731,248,957	53.33
	カナダ	34,066,690	2.48
	ドイツ	32,562,307	2.37
	イタリア	22,504,645	1.64
	フランス	49,881,387	3.64
	オーストラリア	25,048,925	1.83

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
	イギリス	149,261,957	10.89
	スイス	45,370,787	3.31
	バミューダ	4,530,149	0.33
	香港	10,044,421	0.73
	シンガポール	4,090,161	0.30
	ニュージーランド	486,942	0.03
	オランダ	28,733,190	2.10
	スペイン	18,663,789	1.36
	ベルギー	5,720,402	0.42
	スウェーデン	10,407,537	0.76
	ノルウェー	2,639,934	0.19
	オーストリア	989,349	0.07
	ルクセンブルグ	289,151	0.02
	フィンランド	10,881,990	0.79
	デンマーク	5,906,771	0.43
	アイルランド	4,331,292	0.32
	ギリシャ	1,574,888	0.11
	ポルトガル	2,889,026	0.21
小計	1,202,124,647	87.66	
新株予約権証券	イタリア	3,280	0.00
現金、預金、その他資産（負債控除後）		169,089,908	12.34
合計（純資産総額）		1,371,217,835	100.00

（注1） 投資比率は、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。

#### その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	アメリカ	105,002,100	7.66
株価指数先物取引（買建）	イギリス	17,192,682	1.25
合計		122,194,782	8.91

（注1） 投資比率は、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） 時価については、銀行等が計算日の対顧客先物相場を基準として計算し、取引証券会社から入手した価額で評価しております。

（注3） 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。

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

#### 投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	1,344,564,317	31.88
	カナダ	74,508,166	1.77
	ドイツ	499,762,662	11.85
	イタリア	1,249,262,153	29.62
	フランス	137,534,753	3.26
	オーストラリア	17,390,993	0.41
	イギリス	298,012,372	7.06
	スペイン	107,284,500	2.54
	ベルギー	190,762,525	4.52
	スウェーデン	56,761,683	1.34
	デンマーク	28,055,686	0.66
	ギリシャ	97,668,999	2.32
	小計	4,101,568,809	97.23

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
現金、預金、その他資産（負債控除後）	116,601,252	2.77
合計（純資産総額）	4,218,170,061	100.00

（注1）投資比率は、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）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） （平成13年12月10日）（分配落）	138,729,600 138,729,600	9,654 9,654
平成14年2月末	140,509,420	9,670
平成14年3月末	143,900,881	9,855
平成14年4月末	148,801,839	9,780
平成14年5月末	149,207,433	9,795
平成14年6月末	145,405,355	9,451
平成14年7月末	141,726,450	9,195
平成14年8月末	141,835,912	9,154
平成14年9月末	140,184,431	9,033
平成14年10月末	140,538,578	9,038
平成14年11月末	143,240,466	9,197
第2計算期間末（分配付） （平成14年12月10日）（分配落）	141,653,385 141,653,385	9,054 9,054
平成14年12月末	140,233,341	8,952
平成15年1月末	139,626,512	8,867

### 分配の推移

決 算 期	1万口当たりの分配金（円）
第1計算期間末 平成13年12月10日	0
第2計算期間末 平成14年12月10日	0

### 収益率の推移

期 間	収益率（％）
第1計算期間 （平成13年3月16日から平成13年12月10日）	3.5
第2計算期間 （平成13年12月11日から平成14年12月10日）	6.2

\* 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期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。

## （3）設定及び解約実績

期 間	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間 （平成13年3月16日から平成13年12月10日）	146,641,985	2,938,297
第2計算期間 （平成13年12月11日から平成14年12月10日）	13,018,200	272,237

\* 本邦外における設定・解約の実績はありません。

## 第2 ファンドの経理状況

(原目論見書 31 頁)  
以下の情報に更新します。

1. 当ファンドの財務諸表は、第1期計算期間(平成13年3月16日から平成13年12月10日まで)については、「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)ならびに同規則第2条の2により、改正前の「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表並びに運用報告書に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しており、第2期計算期間(平成13年12月11日から平成14年12月10日まで)については、「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)ならびに同規則第2条の2の規定、および「担保附社債信託法施行細則等の一部を改正する内閣府令」(平成14年内閣府令第17号)附則第10条により、改正前の「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表並びに運用報告書に関する規則」(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、財務諸表に掲載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドの第1期計算期間は投資信託約款第45条により、平成13年3月16日から平成13年12月10日までとなっております。
3. 当ファンドは、証券取引法第193条の2の規定に基づき、第1期計算期間(平成13年3月16日から平成13年12月10日まで)および第2期計算期間(平成13年12月11日から平成14年12月10日まで)の財務諸表について、中央青山監査法人による監査を受けております。  
その監査報告書は、該当する財務諸表の直前に添付しております。
4. 平成14年12月31日をもってプルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン・インクがプルデンシャル投信株式会社より営業の全部を譲受け、当ファンドの投資信託委託業者となっております。

監 査 報 告 書

平成 14 年 2 月 18 日

ブルデンシャル投信株式会社

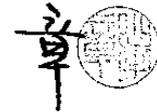
代表取締役社長 長 谷 川 泰 二 殿

中 央 青 山 監



代表社員 公認会計士  
関与社員

山手



関与社員 公認会計士

大畑



当監査法人は、証券取引法第 193 条の 2 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（以下「ファンド」という。）の平成 13 年 3 月 16 日から平成 13 年 12 月 10 日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表について監査を行った。

この監査に当たって、当監査法人は、一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠し、通常実施すべき監査手続を実施した。

監査の結果、ファンドの採用する会計処理の原則及び手続は、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠し、また、財務諸表の表示方法は、「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）の定めるところに準拠しているものと認められた。

よって、当監査法人は、上記の財務諸表が PRU グッドライフ 2020 の平成 13 年 12 月 10 日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を適正に表示しているものと認める。

ブルデンシャル投信株式会社及びファンドと当監査法人又は関与社員との間には、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

監 査 報 告 書

平成 15 年 1 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

取締役社長、佐々木 雅彦 殿  
日本における代表者

中央青山監査法人



代表社員 公認会計士  
関与社員

山手 章

関与社員 公認会計士

大畑 茂

当監査法人は、証券取引法第 193 条の 2 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（以下「ファンド」という。）の平成 13 年 12 月 11 日から平成 14 年 12 月 10 日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書及び附属明細表について監査を行った。

この監査に当たって、当監査法人は、一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠し、通常実施すべき監査手続を実施した。

監査の結果、ファンドの採用する会計処理の原則及び手続は、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠し、かつ、前計算期間と同一の基準に従って継続して適用されており、また、財務諸表の表示方法は、「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）の定めるところに準拠しているものと認められた。

よって、当監査法人は、上記の財務諸表が PRU グッドライフ 2020 の平成 14 年 12 月 10 日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を適正に表示しているものと認める。

ブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン・インク及びファンドと当監査法人又は関与社員の間には、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. 財務諸表

## PRU グッドライフ 2020

### (1) 貸借対照表

(単位：円)

科 目	期 別	第1期	第2期
		(平成13年12月10日現在)	(平成14年12月10日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,116,226	1,132,116
親投資信託受益証券		138,048,711	141,479,928
流動資産合計		139,164,937	142,612,044
資産合計		139,164,937	142,612,044
負債の部			
流動負債			
未払受託者報酬		27,106	59,691
未払委託者報酬		406,573	895,297
その他未払費用		1,658	3,671
流動負債合計		435,337	958,659
負債合計		435,337	958,659
純資産の部			
元本			
元本		143,703,688	156,449,651
欠損金			
期末欠損金		4,974,088	14,796,266
(うち分配準備積立金)		(-)	(529,482)
(うち当期損失)		(5,407,595)	(9,383,132)
欠損金合計		4,974,088	14,796,266
純資産合計		138,729,600	141,653,385
負債・純資産合計		139,164,937	142,612,044

### (2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

科 目	期 別	第1期	第2期
		(自平成13年3月16日 至平成13年12月10日)	(自平成13年12月11日 至平成14年12月10日)
		金 額	金 額
経常損益の部			
営業損益の部			
営業収益			
受取利息		95	-
有価証券売買等損益		4,080,504	7,460,979
営業収益合計		4,080,409	7,460,979
営業費用			
受託者報酬		82,634	119,677
委託者報酬		1,239,484	1,795,125
その他費用		5,068	7,351
営業費用合計		1,327,186	1,922,153
営業損失		5,407,595	9,383,132
経常損失		5,407,595	9,383,132
当期損失		5,407,595	9,383,132
一部解約に伴う当期利益又は当期損失( )分配額		52,770	11,356
期首剰余金又は期首欠損金( )		-	4,974,088
剰余金増加額		493,448	-
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)		(493,448)	(-)
剰余金減少額		7,171	-

科 目	期 別	第1期 〔 自 平成13年 3月16日 至 平成13年12月10日 〕	第2期 〔 自 平成13年12月11日 至 平成14年12月10日 〕
		金 額	金 額
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)		(7,171)	(-)
欠損金減少額		-	9,245
(当期一部解約に伴う欠損金減少額)		(-)	(9,245)
欠損金増加額		-	459,647
(当期追加信託に伴う欠損金増加額)		(-)	(459,647)
分配金		-	-
期末欠損金		4,974,088	14,796,266

#### 重要な会計方針

項目	第 1 期 〔 自 平成 13 年 3 月 16 日 至 平成 13 年 12 月 10 日 〕	第 2 期 〔 自 平成 13 年 12 月 11 日 至 平成 14 年 12 月 10 日 〕
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。	親投資信託受益証券 同左

#### 注記事項

##### (貸借対照表関係)

第1期 (平成13年12月10日現在)		第2期 (平成14年12月10日現在)	
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		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	120,188,161 円	期首元本額	143,703,688 円
期中追加設定元本額	26,453,824 円	期中追加設定元本額	13,018,200 円
期中解約元本額	2,938,297 円	期中解約元本額	272,237 円

##### (損益及び剰余金計算書関係)

第1期 〔 自 平成13年 3月16日 至 平成13年12月10日 〕	第2期 〔 自 平成13年12月11日 至 平成14年12月10日 〕
1. 資産運用の権限を再委託又は一部再委託する場合の当該委託費用 253,669 円	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 362,739 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利益分配後の配当等収益から費用を控除した額(530,419円)、解約に伴う当期利益分配後の有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(37,815円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は568,234円(1万口当たり39.54円)であります。分配を行っておりません。	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損失分配後の配当等収益から費用を控除した額(717,512円)、解約に伴う当期損失分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(95,312円)及び分配準備積立金(529,482円)より分配対象額は1,342,306円(1万口当たり85.79円)であります。分配を行っておりません。

(有価証券関係)

第1期(平成13年12月10日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	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	138,048,711	3,999,483
合計	138,048,711	3,999,483

第2期(平成14年12月10日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	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	141,479,928	7,329,010
合計	141,479,928	7,329,010

(デリバティブ取引等関係)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第1期 (平成13年12月10日現在)		第2期 (平成14年12月10日現在)	
1口当たり純資産額	0.9654 円	1口当たり純資産額	0.9054 円
(1万口当たり純資産額)	9,654 円)	(1万口当たり純資産額)	9,054 円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	銘柄数比率	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	日本円	PRU国内株式マザーファンド		47,552,405	33,909,620	
親投資信託 受益証券	日本円	PRU国内債券マザーファンド		65,658,933	68,075,181	
親投資信託 受益証券	日本円	PRU海外株式マザーファンド		35,636,300	27,354,423	
親投資信託 受益証券	日本円	PRU海外債券マザーファンド		9,966,101	12,140,704	
	計	銘柄数:	4	158,813,739	141,479,928	
		組入時価比率:	99.9%		100.0%	
合計					141,479,928	

(注1) 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。

(注2) 親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 有価証券先物取引等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)

科 目	対象年月日	(平成13年12月10日現在)	(平成14年12月10日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		153,625,603	130,475,881
株式		2,377,472,160	2,055,329,235
派生商品評価勘定		-	1,201,200
未収入金		199,663	662,353
未収配当金		1,513,584	717,219
未収利息		4	3
前払金		1,210,000	4,340,000
差入委託証拠金		4,290,000	6,055,000
流動資産合計		2,538,311,014	2,198,780,891
資産合計		2,538,311,014	2,198,780,891
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,311,200	-
未払金		1,797,400	7,119,200
未払解約金		-	126,632
流動負債合計		3,108,600	7,245,832
負債合計		3,108,600	7,245,832
純資産の部			
元本			
元本		3,011,424,320	3,073,240,467
欠損金			
欠損金		476,221,906	881,705,408
欠損金合計		476,221,906	881,705,408
純資産合計		2,535,202,414	2,191,535,059
負債・純資産合計		2,538,311,014	2,198,780,891

## 重要な会計方針

対象年月日 項目	〔 自 平成13年 3月16日 〕 〔 至 平成13年12月10日 〕	〔 自 平成13年12月11日 〕 〔 至 平成14年12月10日 〕
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>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。</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は原則として、証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる最終相場)で評価しております。</p> <p>計算期間末日に当該証券取引所の最終相場がない場合には、当該証券取引所における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該証券取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券は、原則として、日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融機関の提示する価額(ただし、売気配相場は使用し</p>	<p>株式</p> <p>同左</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券 同左</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券は、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売気配相</p>

対象年月日 項目	〔 自 平成13年 3月16日 至 平成13年12月10日 〕	〔 自 平成13年12月11日 至 平成14年12月10日 〕
	ない)又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	場は使用しない)又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 時価が入手できなかった有価証券 同左
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。	先物取引 同左
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金 受取配当金は原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。	受取配当金 同左

注記事項

(貸借対照表関係)

(平成13年12月10日現在)	(平成14年12月10日現在)
1. 本有価証券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 3,000,000,000 円	1. 本有価証券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 3,011,424,320 円
同期中における追加設定元本額 372,227,468 円	同期中における追加設定元本額 249,544,822 円
同期中における解約元本額 360,803,148 円	同期中における解約元本額 187,728,675 円
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 2,725,531,821円	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 2,720,855,512円
PRU グッドライフ2010 81,090,861円	PRU グッドライフ2010 142,512,017円
PRU グッドライフ2020 41,498,281円	PRU グッドライフ2020 47,552,405円
PRU グッドライフ2030 54,245,829円	PRU グッドライフ2030 59,394,923円
PRU グッドライフ2040 107,474,885円	PRU グッドライフ2040 48,481,477円
PRU グッドライフ2010(年金) 148,093円	PRU グッドライフ2010(年金) 2,973,923円
PRU グッドライフ2020(年金) 309,464円	PRU グッドライフ2020(年金) 10,997,164円
PRU グッドライフ2030(年金) 476,582円	PRU グッドライフ2030(年金) 6,491,491円
PRU グッドライフ2040(年金) 648,504円	PRU グッドライフ2040(年金) 3,742,770円
	ワールド・ミックス40(バランス指向) 11,604,327円
	ワールド・ミックス60(成長指向) 6,812,417円
	ワールド・ミックス80(積極指向) 11,822,041円
計 3,011,424,320円	計 3,073,240,467円

2. 同ファンドの計算期間は、開示対象ファンドの計算期間とは異なるため、当期損失の金額を表示していません。	2. 同ファンドの計算期間は、開示対象ファンドの計算期間とは異なるため、当期損失の金額を表示していません。
---	---

(有価証券関係)

(平成13年12月10日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,377,472,160	55,122,984
合計	2,377,472,160	55,122,984

(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(平成13年12月6日)から本有価証券報告書の開示対象ファンドの期末日(平成13年12月10日)までの期間に対応する金額であります。

(平成14年12月10日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,055,329,235	25,134,252
合計	2,055,329,235	25,134,252

(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(平成14年12月6日)から本有価証券報告書の開示対象ファンドの期末日(平成14年12月10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関係)

取引の状況に関する事項

〔 自 平成13年 3月16日 至 平成13年12月10日 〕	〔 自 平成13年12月11日 至 平成14年12月10日 〕
1. 取引の内容 当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。	1. 取引の内容 同左
2. 取引に対する取組みと利用目的 トピックスの株価指数先物取引を主要投資対象としております。	2. 取引に対する取組みと利用目的 同左
3. 取引に係るリスクの内容 株価指数先物取引に係る主要なリスクは株価の変動による株価変動リスクであります。	3. 取引に係るリスクの内容 同左
4. 取引に係るリスク管理体制 組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。 なお、リスク管理はデリバティブだけに限定しては行っておりません。デリバティブと現物資産等を統合し、各投資信託財産全体でのリスク管理を、行っております。	4. 取引に係るリスク管理体制 同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 同左

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)

区分	種類	平成13年12月10日現在)			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	113,951,200	-	112,640,000	1,311,200
	合計	113,951,200	-	112,640,000	1,311,200

(単位:円)

区分	種類	平成14年12月10日現在)			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	118,848,800	-	120,050,000	1,201,200
	合計	118,848,800	-	120,050,000	1,201,200

(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。

(1口当たり情報)

平成13年12月10日現在)	平成14年12月10日現在)
本有価証券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 0.8419 円 (1万口当たり純資産額 8,419 円)	本有価証券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 0.7131 円 (1万口当たり純資産額 7,131 円)
なお、純資産額は、投資信託財産純資産額を用いております。	なお、純資産額は、投資信託財産純資産額を用いております。

附属明細表

第1 有価証券明細表  
株式

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
株式	日本円	極洋	1,000	113.00	113,000	
		ニチロ	1,000	106.00	106,000	
		日本水産	2,000	226.00	452,000	
		マルハ	3,000	101.00	303,000	
		サカタのタネ	500	1,399.00	699,500	
		ホクト産業	200	2,450.00	490,000	
		三井鉱山	1,000	41.00	41,000	
		住友石炭鉱業	1,000	27.00	27,000	
		日鉄鉱業	1,000	189.00	189,000	
		帝国石油	3,000	434.00	1,302,000	
		アラビア石油	400	526.00	210,400	
		関東天然瓦斯開発	1,000	482.00	482,000	
		大成建設	9,000	183.00	1,647,000	
		大林組	7,000	262.00	1,834,000	
		清水建設	7,000	288.00	2,016,000	
		長谷工コーポレーション	2,000	49.00	98,000	
		鹿島建設	9,000	281.00	2,529,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		不動建設	1,000	38.00	38,000	
		鉄建建設	1,000	90.00	90,000	
		安藤建設	1,000	105.00	105,000	
		西松建設	2,000	322.00	644,000	
		三井建設	1,000	33.00	33,000	
		大豊建設	1,000	116.00	116,000	
		前田建設工業	2,000	324.00	648,000	
		奥村組	2,000	364.00	728,000	
		間組	3,000	18.00	54,000	
		東急建設	7,000	59.00	413,000	
		戸田建設	3,000	184.00	552,000	
		熊谷組	3,000	13.00	39,000	
		北野建設	1,000	138.00	138,000	
		三井ホーム	1,000	370.00	370,000	
		大東建託	1,200	2,535.00	3,042,000	
		日本舗道	2,000	499.00	998,000	
		前田道路	2,000	418.00	836,000	
		日本道路	1,000	133.00	133,000	
		東亜建設工業	1,000	105.00	105,000	
		東洋建設	1,000	40.00	40,000	
		五洋建設	3,000	45.00	135,000	
		大成ロテック	1,000	159.00	159,000	
		住友林業	1,000	625.00	625,000	
		日本基礎技術	300	209.00	62,700	
		日成ビルド工業	1,000	132.00	132,000	
		エス・バイ・エル	1,000	84.00	84,000	
		ミサワホーム	1,000	105.00	105,000	
		パナホーム	1,000	402.00	402,000	
		大和ハウス工業	5,000	650.00	3,250,000	
		ライト工業	500	206.00	103,000	
		積水ハウス	6,000	855.00	5,130,000	
		ユアテック	1,000	332.00	332,000	
		中電工	1,000	1,480.00	1,480,000	
		関電工	2,000	381.00	762,000	
		きんでん	2,000	411.00	822,000	
		トーエネック	2,000	379.00	758,000	
		日本コムシス	1,000	449.00	449,000	
		住友電設	300	342.00	102,600	
		日本電設工業	1,000	450.00	450,000	
		協和エクシオ	1,000	356.00	356,000	
		日本電話施設	1,000	233.00	233,000	
		九電工	1,000	442.00	442,000	
		三機工業	1,000	573.00	573,000	
		日揮	2,000	736.00	1,472,000	
		中外炉工業	1,000	104.00	104,000	
		高砂熱学工業	1,000	465.00	465,000	
		日立プラント建設	1,000	238.00	238,000	
		日本電気システム建設	500	832.00	416,000	
		東芝プラント建設	1,000	199.00	199,000	
		ショーボンド建設	300	782.00	234,600	
		東洋エンジニアリング	1,000	129.00	129,000	
		千代田化工建設	1,000	203.00	203,000	
		日本製粉	1,000	249.00	249,000	
		日清製粉グループ本社	2,000	775.00	1,550,000	
		昭和産業	2,000	219.00	438,000	
		日本農産工業	1,000	158.00	158,000	
		日本甜菜製糖	1,000	147.00	147,000	
		新三井製糖	1,000	184.00	184,000	
		森永製菓	2,000	160.00	320,000	
		明治製菓	3,000	338.00	1,014,000	
		中村屋	1,000	234.00	234,000	
		江崎グリコ	1,000	669.00	669,000	
		不二家	1,000	118.00	118,000	
		山崎製パン	2,000	644.00	1,288,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		明治乳業	2,000	365.00	730,000	
		雪印乳業	1,000	163.00	163,000	
		森永乳業	2,000	332.00	664,000	
		ヤクルト本社	2,000	1,375.00	2,750,000	
		プリマハム	1,000	47.00	47,000	
		日本ハム	2,000	1,177.00	2,354,000	
		伊藤ハム	2,000	345.00	690,000	
		丸大食品	1,000	108.00	108,000	
		米久	500	839.00	419,500	
		サッポロビール	3,000	211.00	633,000	
		アサヒビール	4,000	745.00	2,980,000	
		麒麟麦酒	8,000	719.00	5,752,000	
		宝ホールディングス	2,000	543.00	1,086,000	
		メルシャン	1,000	173.00	173,000	
		三国コカ・コーラボトリング	1,000	837.00	837,000	
		近畿コカ・コーラボトリング	1,000	738.00	738,000	
		四国コカ・コーラボトリング	200	1,004.00	200,800	
		コカ・コーラウエストジャパン	800	1,819.00	1,455,200	
		コカ・コーラセントラルジャパン	1	701,000.00	701,000	
		カルピス	1,000	556.00	556,000	
		伊藤園	400	3,880.00	1,552,000	
		キーコーヒー	400	1,465.00	586,000	
		麒麟ビバレッジ	500	1,920.00	960,000	
		アサヒ飲料	500	426.00	213,000	
		日清オイリオグループ	1,000	243.00	243,000	
		不二製油	1,000	1,092.00	1,092,000	
		豊年味の素製油	1,000	174.00	174,000	
		キッコーマン	1,000	793.00	793,000	
		味の素	5,000	1,240.00	6,200,000	
		キユーピー	1,300	929.00	1,207,700	
		ハウス食品	1,000	1,062.00	1,062,000	
		カゴメ	1,000	713.00	713,000	
		焼津水産化学工業	100	820.00	82,000	
		アリアゲジャパン	200	3,420.00	684,000	
		ニチレイ	3,000	335.00	1,005,000	
		加ト吉	500	1,701.00	850,500	
		東洋水産	1,000	1,057.00	1,057,000	
		日清食品	1,100	2,695.00	2,964,500	
		ロック・フィールド	200	1,950.00	390,000	
		日本たばこ産業	6	778,000.00	4,668,000	
		ミヨシ油脂	1,000	174.00	174,000	
		ゲンゼ	2,000	415.00	830,000	
		東洋紡績	6,000	152.00	912,000	
		ユニチカ	3,000	42.00	126,000	
		日清紡績	2,000	429.00	858,000	
		倉敷紡績	2,000	139.00	278,000	
		大和紡績	1,000	57.00	57,000	
		日本毛織	1,000	386.00	386,000	
		帝人	8,000	279.00	2,232,000	
		東レ	12,000	255.00	3,060,000	
		東邦テナックス	1,000	80.00	80,000	
		三菱レイヨン	6,000	272.00	1,632,000	
		クラレ	3,000	703.00	2,109,000	
		住江織物	1,000	113.00	113,000	
		日本バイリーン	1,000	194.00	194,000	
		アツギ	1,000	79.00	79,000	
		セーレン	1,000	354.00	354,000	
		ワコール	1,000	916.00	916,000	
		ホギメディカル	100	4,960.00	496,000	
		ワールド	500	2,095.00	1,047,500	
		三陽商会	1,000	593.00	593,000	
		オンワード樫山	2,000	906.00	1,812,000	
		レナウン	1,000	58.00	58,000	
		東京スタイル	1,000	991.00	991,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		デサント	1,000	70.00	70,000	
		東海パルプ	1,000	390.00	390,000	
		王子製紙	9,000	490.00	4,410,000	
		三菱製紙	2,000	137.00	274,000	
		北越製紙	1,000	608.00	608,000	
		中越パルプ工業	2,000	188.00	376,000	
		大王製紙	1,000	817.00	817,000	
		紀州製紙	1,000	131.00	131,000	
		日本ユニパックホールディング	9.28	509,000.00	4,723,520	
		レンゴー	2,000	274.00	548,000	
		トーモク	1,000	190.00	190,000	
		カネボウ	4,000	120.00	480,000	
		旭化成	12,000	284.00	3,408,000	
		昭和電工	11,000	154.00	1,694,000	
		住友化学工業	14,000	457.00	6,398,000	
		日本化成	1,000	101.00	101,000	
		住友精化	1,000	224.00	224,000	
		三菱化学	18,000	248.00	4,464,000	
		日産化学工業	1,000	445.00	445,000	
		ラサ工業	1,000	159.00	159,000	
		呉羽化学工業	2,000	362.00	724,000	
		石原産業	3,000	130.00	390,000	
		日本曹達	1,000	191.00	191,000	
		東ソー	5,000	303.00	1,515,000	
		トクヤマ	2,000	318.00	636,000	
		セントラル硝子	2,000	556.00	1,112,000	
		東亜合成	1,000	149.00	149,000	
		ダイソー	1,000	160.00	160,000	
		関東電化工業	1,000	227.00	227,000	
		電気化学工業	4,000	269.00	1,076,000	
		信越化学工業	3,500	4,120.00	14,420,000	
		堺化学工業	1,000	305.00	305,000	
		日本エア・リキード	1,000	478.00	478,000	
		エア・ウォーター	1,000	474.00	474,000	
		日本酸素	3,000	373.00	1,119,000	
		日本化学工業	1,000	161.00	161,000	
		日本パーカライズン	1,000	328.00	328,000	
		高圧ガス工業	1,000	293.00	293,000	
		四国化成工業	1,000	373.00	373,000	
		大陽東洋酸素	1,000	240.00	240,000	
		ステラ ケミファ	100	1,619.00	161,900	
		日本触媒	2,000	510.00	1,020,000	
		大日精化工業	1,000	269.00	269,000	
		鐘淵化学工業	3,000	653.00	1,959,000	
		三菱瓦斯化学	3,000	161.00	483,000	
		三井化学	7,000	537.00	3,759,000	
		J S R	2,000	1,171.00	2,342,000	
		東京応化工業	400	1,570.00	628,000	
		日本合成化学工業	1,000	101.00	101,000	
		ダイセル化学工業	3,000	332.00	996,000	
		住友ベークライト	2,000	517.00	1,034,000	
		積水化学工業	5,000	315.00	1,575,000	
		日本ゼオン	2,000	440.00	880,000	
		アイカ工業	1,000	750.00	750,000	
		宇部興産	6,000	127.00	762,000	
		三菱樹脂	1,000	155.00	155,000	
		タキロン	1,000	223.00	223,000	
		旭有機材工業	1,000	225.00	225,000	
		日立化成工業	2,000	1,055.00	2,110,000	
		リケンテクノス	1,000	289.00	289,000	
		大倉工業	1,000	336.00	336,000	
		積水化成工業	1,000	184.00	184,000	
		群栄化学工業	1,000	228.00	228,000	
		日本化薬	2,000	471.00	942,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		新日鐵化学	2,000	143.00	286,000	
		旭電化工業	1,000	579.00	579,000	
		日本油脂	2,000	295.00	590,000	
		花王	5,000	2,605.00	13,025,000	
		三洋化成工業	1,000	744.00	744,000	
		大日本塗料	1,000	113.00	113,000	
		日本ペイント	2,000	291.00	582,000	
		関西ペイント	2,000	305.00	610,000	
		中国塗料	1,000	269.00	269,000	
		太陽インキ製造	100	3,950.00	395,000	
		大日本インキ化学工業	7,000	196.00	1,372,000	
		サカタインクス	1,000	291.00	291,000	
		東洋インキ製造	2,000	324.00	648,000	
		富士写真フイルム	4,000	3,900.00	15,600,000	
		コニカ	3,000	869.00	2,607,000	
		資生堂	3,000	1,464.00	4,392,000	
		ライオン	2,000	504.00	1,008,000	
		高砂香料工業	1,000	360.00	360,000	
		ミルボン	100	3,390.00	339,000	
		ファンケル	200	3,590.00	718,000	
		コーセー	300	3,650.00	1,095,000	
		コニシ	200	930.00	186,000	
		長谷川香料	400	1,425.00	570,000	
		小林製薬	200	4,300.00	860,000	
		クミアイ化学工業	1,000	155.00	155,000	
		日本農薬	1,000	121.00	121,000	
		アキレス	1,000	117.00	117,000	
		有沢製作所	200	2,350.00	470,000	
		日東電工	1,500	3,370.00	5,055,000	
		前澤化成工業	100	1,170.00	117,000	
		信越ポリマー	1,000	500.00	500,000	
		東リ	1,000	142.00	142,000	
		ニフコ	1,000	1,205.00	1,205,000	
		日本バルカー工業	1,000	127.00	127,000	
		ユニ・チャーム	600	4,510.00	2,706,000	
		協和醗酵工業	4,000	482.00	1,928,000	
		三共	4,000	1,389.00	5,556,000	
		武田薬品工業	7,500	5,040.00	37,800,000	
		山之内製薬	3,000	3,410.00	10,230,000	
		第一製薬	2,000	1,808.00	3,616,000	
		大日本製薬	1,000	1,056.00	1,056,000	
		塩野義製薬	3,000	1,656.00	4,968,000	
		田辺製薬	3,000	1,052.00	3,156,000	
		三菱ウェルファーマ	4,000	835.00	3,340,000	
		藤沢薬品工業	3,000	2,670.00	8,010,000	
		萬有製薬	2,000	1,015.00	2,030,000	
		日本新薬	1,000	554.00	554,000	
		富山化学工業	1,000	350.00	350,000	
		科研製薬	1,000	449.00	449,000	
		エーザイ	2,600	2,580.00	6,708,000	
		小野薬品工業	1,000	3,700.00	3,700,000	
		日研化学	1,000	254.00	254,000	
		久光製薬	1,000	1,589.00	1,589,000	
		持田製薬	1,000	545.00	545,000	
		大正製薬	3,000	1,810.00	5,430,000	
		参天製薬	1,000	1,170.00	1,170,000	
		エスエス製薬	1,000	743.00	743,000	
		扶桑薬品工業	1,000	350.00	350,000	
		ツムラ	1,000	989.00	989,000	
		富士レビオ	500	777.00	388,500	
		キッセイ薬品工業	1,000	1,455.00	1,455,000	
		鳥居薬品	300	1,490.00	447,000	
		杏林製薬	1,000	1,908.00	1,908,000	
		新日本石油	13,000	473.00	6,149,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		昭和シェル石油	3,000	761.00	2,283,000	
		コスモ石油	4,000	145.00	580,000	
		東燃ゼネラル石油	5,000	751.00	3,755,000	
		新日鉱ホールディングス	7,000	138.00	966,000	
		横浜ゴム	3,000	277.00	831,000	
		東洋ゴム工業	1,000	212.00	212,000	
		オーツタイヤ	1,000	188.00	188,000	
		ブリヂストン	7,000	1,669.00	11,683,000	
		住友ゴム工業	2,000	503.00	1,006,000	
		オカモト	1,000	220.00	220,000	
		ニッタ	400	874.00	349,600	
		東海ゴム工業	1,000	1,034.00	1,034,000	
		三ツ星ベルト	1,000	274.00	274,000	
		バンドー化学	1,000	218.00	218,000	
		日東紡績	1,000	103.00	103,000	
		旭硝子	10,000	743.00	7,430,000	
		日本板硝子	4,000	234.00	936,000	
		日本山村硝子	1,000	158.00	158,000	
		東芝セラミックス	1,000	220.00	220,000	
		日本電気硝子	1,000	1,256.00	1,256,000	
		住友大阪セメント	3,000	142.00	426,000	
		太平洋セメント	7,000	150.00	1,050,000	
		東海カーボン	1,000	188.00	188,000	
		日本カーボン	1,000	67.00	67,000	
		ノリタケカンパニーリミテド	1,000	325.00	325,000	
		東陶機器	4,000	455.00	1,820,000	
		日本碍子	3,000	628.00	1,884,000	
		日本特殊陶業	2,000	816.00	1,632,000	
		M A R U W A	100	930.00	93,000	
		品川白煉瓦	1,000	138.00	138,000	
		黒崎播磨	1,000	69.00	69,000	
		ニチアス	1,000	218.00	218,000	
		ニチハ	300	777.00	233,100	
		新日本製鐵	57,000	142.00	8,094,000	
		住友金属工業	31,000	42.00	1,302,000	
		神戸製鋼所	22,000	58.00	1,276,000	
		日新製鋼	9,000	48.00	432,000	
		中山製鋼所	1,000	65.00	65,000	
		合同製鐵	1,000	57.00	57,000	
		ジェイ エフ イー ホールディングス	4,775	1,371.00	6,546,525	
		東京製鐵	1,900	386.00	733,400	
		大和工業	1,000	497.00	497,000	
		大阪製鐵	400	600.00	240,000	
		淀川製鋼所	1,000	298.00	298,000	
		東洋鋼鈑	1,000	306.00	306,000	
		丸一鋼管	1,000	1,405.00	1,405,000	
		大同特殊鋼	4,000	144.00	576,000	
		日本金属工業	1,000	55.00	55,000	
		日本冶金工業	1,000	20.00	20,000	
		山陽特殊製鋼	1,000	90.00	90,000	
		愛知製鋼	2,000	655.00	1,310,000	
		日立金属	3,000	321.00	963,000	
		大平洋金属	1,000	72.00	72,000	
		日本電工	1,000	138.00	138,000	
		栗本鐵工所	2,000	152.00	304,000	
		三菱製鋼	1,000	59.00	59,000	
		日本軽金属	6,000	89.00	534,000	
		三井金属鉱業	5,000	303.00	1,515,000	
		東邦亜鉛	1,000	125.00	125,000	
		三菱マテリアル	9,000	140.00	1,260,000	
		住友金属鉱山	5,000	438.00	2,190,000	
		同和鉱業	2,000	500.00	1,000,000	
		古河機械金属	2,000	64.00	128,000	
		志村化工	1,000	95.00	95,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		住友軽金属工業	1,000	60.00	60,000	
		三菱伸銅	1,000	129.00	129,000	
		古河電気工業	6,000	270.00	1,620,000	
		住友電気工業	6,000	794.00	4,764,000	
		フジクラ	3,000	292.00	876,000	
		三菱電線工業	1,000	79.00	79,000	
		昭和電線電纜	1,000	62.00	62,000	
		日立電線	4,000	309.00	1,236,000	
		リョービ	1,000	135.00	135,000	
		アサヒブリテック	200	819.00	163,800	
		稲葉製作所	100	1,800.00	180,000	
		東洋製罐	2,000	1,425.00	2,850,000	
		北海製罐	1,000	204.00	204,000	
		三和シャッター工業	3,000	324.00	972,000	
		文化シャッター	1,000	291.00	291,000	
		三協アルミニウム工業	2,000	81.00	162,000	
		I N A X トステム・ホールディングス	3,000	1,642.00	4,926,000	
		ノーリツ	400	1,007.00	402,800	
		長府製作所	300	1,634.00	490,200	
		リンナイ	500	2,730.00	1,365,000	
		東京製綱	1,000	45.00	45,000	
		日本発条	3,000	290.00	870,000	
		中央発條	1,000	371.00	371,000	
		日本製鋼所	2,000	67.00	134,000	
		日立ツール	500	457.00	228,500	
		三浦工業	400	1,513.00	605,200	
		タクマ	1,000	725.00	725,000	
		ツガミ	1,000	104.00	104,000	
		オークマ	1,000	143.00	143,000	
		東芝機械	1,000	221.00	221,000	
		アマダマシニックス	1,000	187.00	187,000	
		アマダ	3,000	339.00	1,017,000	
		アイダエンジニアリング	1,000	238.00	238,000	
		牧野フライス製作所	1,000	266.00	266,000	
		オーエスジー	1,000	340.00	340,000	
		東芝タンガロイ	1,000	247.00	247,000	
		旭ダイヤモンド工業	1,000	417.00	417,000	
		森精機製作所	1,000	623.00	623,000	
		ディスコ	300	4,940.00	1,482,000	
		日東工器	200	1,399.00	279,800	
		豊田工機	1,000	467.00	467,000	
		帝人製機	1,000	219.00	219,000	
		津田駒工業	1,000	163.00	163,000	
		島精機製作所	300	2,530.00	759,000	
		S M C	600	10,960.00	6,576,000	
		新川	200	2,075.00	415,000	
		ユニオンツール	200	2,810.00	562,000	
		オイレス工業	200	1,842.00	368,400	
		サトー	300	2,130.00	639,000	
		小松製作所	8,000	420.00	3,360,000	
		住友重機械工業	4,000	68.00	272,000	
		日立建機	1,000	439.00	439,000	
		井関農機	2,000	73.00	146,000	
		T O W A	200	799.00	159,800	
		クボタ	12,000	320.00	3,840,000	
		三菱化工機	1,000	105.00	105,000	
		東京機械製作所	1,000	217.00	217,000	
		新東工業	1,000	231.00	231,000	
		小森コーポレーション	1,000	1,130.00	1,130,000	
		荏原製作所	3,000	388.00	1,164,000	
		ダイキン工業	2,000	1,868.00	3,736,000	
		オルガノ	1,000	360.00	360,000	
		トーヨーカネツ	1,000	70.00	70,000	
		栗田工業	1,000	1,113.00	1,113,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		椿本チエイン	1,000	302.00	302,000	
		T C M	1,000	173.00	173,000	
		日機装	1,000	412.00	412,000	
		ダイフク	1,000	329.00	329,000	
		タダノ	1,000	192.00	192,000	
		フジテック	1,000	642.00	642,000	
		シーケーディ	1,000	305.00	305,000	
		平和	1,000	1,571.00	1,571,000	
		S A N K Y O	900	2,995.00	2,695,500	
		マースエンジニアリング	100	3,030.00	303,000	
		高砂電器産業	100	720.00	72,000	
		サミー	400	2,600.00	1,040,000	
		アマノ	1,000	746.00	746,000	
		J U K I	1,000	228.00	228,000	
		サンデン	1,000	375.00	375,000	
		蛇の目ミシン工業	1,000	64.00	64,000	
		ブラザー工業	2,000	803.00	1,606,000	
		マックス	1,000	717.00	717,000	
		リケン	1,000	235.00	235,000	
		大豊工業	200	1,000.00	200,000	
		日本精工	5,000	306.00	1,530,000	
		N T N	3,000	379.00	1,137,000	
		光洋精工	2,000	559.00	1,118,000	
		不二越	1,000	119.00	119,000	
		ツバキ・ナカシマ	500	665.00	332,500	
		日本トムソン	1,000	408.00	408,000	
		T H K	1,000	1,436.00	1,436,000	
		ユースン精機	200	2,075.00	415,000	
		前澤工業	200	465.00	93,000	
		キッツ	1,000	118.00	118,000	
		マキタ	1,000	835.00	835,000	
		日立造船	7,000	24.00	168,000	
		三菱重工業	28,000	300.00	8,400,000	
		石川島播磨重工業	10,000	115.00	1,150,000	
		イビデン	1,000	1,338.00	1,338,000	
		ミネベア	3,000	497.00	1,491,000	
		日立製作所	28,000	486.00	13,608,000	
		東芝	27,000	378.00	10,206,000	
		三菱電機	18,000	302.00	5,436,000	
		富士電機	6,000	219.00	1,314,000	
		安川電機	2,000	276.00	552,000	
		神鋼電機	1,000	176.00	176,000	
		明電舎	2,000	104.00	208,000	
		エネサーブ	200	4,480.00	896,000	
		日立工機	2,000	355.00	710,000	
		東芝テック	2,000	268.00	536,000	
		マブチモーター	400	10,540.00	4,216,000	
		日本電産	500	7,500.00	3,750,000	
		高岳製作所	1,000	76.00	76,000	
		ダイヘン	1,000	104.00	104,000	
		日新電機	1,000	139.00	139,000	
		オムロン	2,000	1,749.00	3,498,000	
		日東工業	400	645.00	258,000	
		和泉電気	500	394.00	197,000	
		日本電気	14,000	462.00	6,468,000	
		富士通	16,000	406.00	6,496,000	
		沖電気工業	5,000	208.00	1,040,000	
		岩崎通信機	1,000	106.00	106,000	
		N E C インフロンティア	1,000	296.00	296,000	
		電気興業	1,000	244.00	244,000	
		サンケン電気	1,000	947.00	947,000	
		東洋通信機	1,000	307.00	307,000	
		富士通アクセス	400	425.00	170,000	
		アイホン	200	1,046.00	209,200	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		日本信号	1,000	263.00	263,000	
		京三製作所	1,000	223.00	223,000	
		マスプロ電工	200	1,009.00	201,800	
		日本無線	1,000	208.00	208,000	
		松下電器産業	22,931	1,190.00	27,287,890	
		シャープ	9,000	1,147.00	10,323,000	
		アンリツ	1,000	556.00	556,000	
		富士通ゼネラル	1,000	176.00	176,000	
		日立国際電気	1,000	330.00	330,000	
		ソニー	7,700	5,200.00	40,040,000	
		NEC トーキン	1,000	539.00	539,000	
		TDK	1,100	5,290.00	5,819,000	
		三洋電機	16,000	321.00	5,136,000	
		ケンウッド	1,000	124.00	124,000	
		ミツミ電機	600	1,142.00	685,200	
		タムラ製作所	1,000	243.00	243,000	
		アルプス電気	2,000	1,508.00	3,016,000	
		パイオニア	1,400	2,265.00	3,171,000	
		日本電波工業	200	1,377.00	275,400	
		日本ビクター	2,000	801.00	1,602,000	
		クラリオン	1,000	61.00	61,000	
		SMK	1,000	304.00	304,000	
		ヨコオ	200	676.00	135,200	
		東光	1,000	211.00	211,000	
		ティアック	1,000	118.00	118,000	
		ホシデン	1,000	1,061.00	1,061,000	
		ヒロセ電機	300	8,670.00	2,601,000	
		日本航空電子工業	1,000	682.00	682,000	
		日立マクセル	1,000	1,436.00	1,436,000	
		ユニデン	1,000	752.00	752,000	
		アルパイン	1,000	1,437.00	1,437,000	
		スミダ コーポレーション	200	2,850.00	570,000	
		島田理化工業	200	509.00	101,800	
		アイコム	100	1,069.00	106,900	
		船井電機	300	14,700.00	4,410,000	
		横河電機	2,000	722.00	1,444,000	
		新電元工業	1,000	191.00	191,000	
		山武	1,000	629.00	629,000	
		アドバンテスト	800	5,590.00	4,472,000	
		キーエンス	300	21,110.00	6,333,000	
		シスメックス	200	2,545.00	509,000	
		メガチップス	300	1,720.00	516,000	
		東京電波	100	969.00	96,900	
		コーセル	200	2,005.00	401,000	
		メルコ	200	1,800.00	360,000	
		デンセイ・ラムダ	300	815.00	244,500	
		スタンレー電気	2,000	1,333.00	2,666,000	
		岩崎電気	1,000	200.00	200,000	
		ウシオ電機	1,000	1,290.00	1,290,000	
		日本電池	2,000	162.00	324,000	
		ユアサコーポレーション	1,000	134.00	134,000	
		日本デジタル研究所	500	779.00	389,500	
		山一電機	100	1,290.00	129,000	
		函研	300	739.00	221,700	
		日本電子	1,000	496.00	496,000	
		カシオ計算機	2,000	703.00	1,406,000	
		ファナック	2,000	5,480.00	10,960,000	
		FDK	1,000	152.00	152,000	
		エンプラス	200	3,200.00	640,000	
		ローム	1,000	16,600.00	16,600,000	
		浜松ホトニクス	600	2,135.00	1,281,000	
		三井ハイテック	400	876.00	350,400	
		新光電気工業	400	1,745.00	698,000	
		京セラ	1,600	7,600.00	12,160,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		住友特殊金属	1,000	500.00	500,000	
		太陽誘電	1,000	1,394.00	1,394,000	
		村田製作所	2,000	5,230.00	10,460,000	
		双葉電子工業	400	2,410.00	964,000	
		北陸電気工業	1,000	53.00	53,000	
		松下電工	6,000	716.00	4,296,000	
		ニチコン	700	1,349.00	944,300	
		日本ケミコン	1,000	343.00	343,000	
		K O A	400	744.00	297,600	
		市光工業	1,000	228.00	228,000	
		小糸製作所	1,000	413.00	413,000	
		スター精密	1,000	534.00	534,000	
		大日本スクリーン製造	2,000	445.00	890,000	
		キヤノン	7,000	4,750.00	33,250,000	
		リコー	6,000	2,095.00	12,570,000	
		三協精機製作所	1,000	189.00	189,000	
		東京エレクトロン	1,500	5,520.00	8,280,000	
		豊田紡織	1,000	674.00	674,000	
		ボッシュ オートモーティブ システム	2,000	159.00	318,000	
		豊田自動織機	2,600	1,810.00	4,706,000	
		デンソー	7,200	1,986.00	14,299,200	
		東海理化電機製作所	1,000	785.00	785,000	
		三井造船	6,000	102.00	612,000	
		佐世保重工業	1,000	69.00	69,000	
		川崎重工業	11,000	98.00	1,078,000	
		日本車輛製造	1,000	194.00	194,000	
		近畿車輛	1,000	202.00	202,000	
		日産自動車	38,000	963.00	36,594,000	
		いすゞ自動車	10,000	40.00	400,000	
		トヨタ自動車	30,300	3,150.00	95,445,000	
		日野自動車	4,000	388.00	1,552,000	
		日産ディーゼル工業	1,000	77.00	77,000	
		三菱自動車工業	12,000	257.00	3,084,000	
		トヨタ車体	1,000	1,213.00	1,213,000	
		日産車体	1,000	383.00	383,000	
		関東自動車工業	1,000	601.00	601,000	
		新明和工業	1,000	149.00	149,000	
		極東開発工業	300	698.00	209,400	
		日信工業	200	2,580.00	516,000	
		トビー工業	1,000	177.00	177,000	
		トキコ	1,000	308.00	308,000	
		東洋ラジエーター	1,000	234.00	234,000	
		曙ブレーキ工業	1,000	177.00	177,000	
		N O K	1,000	1,400.00	1,400,000	
		フタバ産業	1,000	1,124.00	1,124,000	
		カヤバ工業	1,000	224.00	224,000	
		シロキ工業	1,000	228.00	228,000	
		カルソニックカンセイ	2,000	578.00	1,156,000	
		ケーヒン	1,000	1,169.00	1,169,000	
		アイシン精機	2,000	1,621.00	3,242,000	
		マツダ	10,000	234.00	2,340,000	
		ダイハツ工業	4,000	364.00	1,456,000	
		愛知機械工業	1,000	201.00	201,000	
		本田技研工業	8,100	4,630.00	37,503,000	
		スズキ	4,000	1,302.00	5,208,000	
		富士重工業	6,000	449.00	2,694,000	
		ヤマハ発動機	2,000	980.00	1,960,000	
		ショーワ	1,000	928.00	928,000	
		エクセディ	700	912.00	638,400	
		豊田合成	1,000	2,390.00	2,390,000	
		シマノ	1,200	1,767.00	2,120,400	
		テルモ	1,900	1,645.00	3,125,500	
		島津製作所	2,000	348.00	696,000	
		モリテックス	200	593.00	118,600	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		東京精密	400	2,805.00	1,122,000	
		ニコン	3,000	874.00	2,622,000	
		オリンパス光学工業	2,000	2,045.00	4,090,000	
		HOYA	1,000	8,210.00	8,210,000	
		ノーリツ鋼機	300	2,600.00	780,000	
		ペンタックス	1,000	165.00	165,000	
		ミノルタ	2,000	565.00	1,130,000	
		日本電産コバル	1,000	1,670.00	1,670,000	
		シチズン時計	3,000	589.00	1,767,000	
		リズム時計工業	1,000	78.00	78,000	
		セイコー	1,000	202.00	202,000	
		ニプロ	1,000	1,973.00	1,973,000	
		コロムビアミュージックエンタテインメント	1,000	79.00	79,000	
		エイベックス	500	1,408.00	704,000	
		トッパン・フォームズ	1,100	1,379.00	1,516,900	
		トミー	200	1,018.00	203,600	
		廣済堂	200	1,000.00	200,000	
		大建工業	1,000	221.00	221,000	
		凸版印刷	6,000	842.00	5,052,000	
		大日本印刷	6,000	1,375.00	8,250,000	
		図書印刷	1,000	231.00	231,000	
		共同印刷	1,000	310.00	310,000	
		アシックス	1,000	113.00	113,000	
		ツツミ	300	2,895.00	868,500	
		ローランド	300	1,153.00	345,900	
		小松ウオール工業	100	1,064.00	106,400	
		ヤマハ	2,000	1,125.00	2,250,000	
		ビジョン	200	813.00	162,600	
		パラマウントベッド	300	2,080.00	624,000	
		セガ	1,400	1,192.00	1,668,800	
		リンテック	1,000	980.00	980,000	
		バンダイ	500	4,250.00	2,125,000	
		タカラ	1,000	1,055.00	1,055,000	
		任天堂	1,200	12,360.00	14,832,000	
		フランスベッド	1,000	268.00	268,000	
		タカラスタンダード	1,000	515.00	515,000	
		コクヨ	1,000	963.00	963,000	
		ナカバヤシ	1,000	160.00	160,000	
		岡村製作所	1,000	450.00	450,000	
		美津濃	1,000	267.00	267,000	
		アデランス	400	2,795.00	1,118,000	
		学習研究社	1,000	96.00	96,000	
		昭文社	200	1,367.00	273,400	
		インプレス	2	52,200.00	104,400	
		東京電力	11,300	2,080.00	23,504,000	
		中部電力	6,500	2,060.00	13,390,000	
		関西電力	8,200	1,680.00	13,776,000	
		中国電力	3,100	1,691.00	5,242,100	
		北陸電力	1,700	1,521.00	2,585,700	
		東北電力	4,100	1,659.00	6,801,900	
		四国電力	2,300	1,697.00	3,903,100	
		九州電力	3,900	1,652.00	6,442,800	
		北海道電力	1,900	1,523.00	2,893,700	
		沖縄電力	100	2,545.00	254,500	
		東京瓦斯	24,000	361.00	8,664,000	
		大阪瓦斯	20,000	283.00	5,660,000	
		東邦瓦斯	4,000	297.00	1,188,000	
		北海道瓦斯	1,000	266.00	266,000	
		西部瓦斯	2,000	190.00	380,000	
		東武鉄道	7,000	308.00	2,156,000	
		西武鉄道	4,000	1,407.00	5,628,000	
		相模鉄道	3,000	310.00	930,000	
		東京急行電鉄	10,000	404.00	4,040,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		京浜急行電鉄	4,000	530.00	2,120,000	
		小田急電鉄	6,000	501.00	3,006,000	
		京王電鉄	6,000	614.00	3,684,000	
		京成電鉄	3,000	322.00	966,000	
		富士急行	1,000	421.00	421,000	
		東日本旅客鉄道	33	570,000.00	18,810,000	
		西日本旅客鉄道	16	421,000.00	6,736,000	
		東海旅客鉄道	19	759,000.00	14,421,000	
		西日本鉄道	3,000	300.00	900,000	
		近畿日本鉄道	14,000	261.00	3,654,000	
		阪急電鉄	7,000	329.00	2,303,000	
		阪神電気鉄道	3,000	291.00	873,000	
		名糖運輸	100	970.00	97,000	
		名古屋鉄道	7,000	300.00	2,100,000	
		日本通運	9,000	458.00	4,122,000	
		ヤマト運輸	4,000	1,679.00	6,716,000	
		山九	1,000	80.00	80,000	
		丸全昭和運輸	1,000	230.00	230,000	
		センコー	1,000	232.00	232,000	
		トナミ運輸	1,000	258.00	258,000	
		日本梱包運輸倉庫	1,000	866.00	866,000	
		福山通運	2,000	400.00	800,000	
		西濃運輸	1,000	710.00	710,000	
		神奈川中央交通	1,000	609.00	609,000	
		日立物流	1,000	650.00	650,000	
		日本郵船	11,000	398.00	4,378,000	
		商船三井	10,000	236.00	2,360,000	
		川崎汽船	5,000	196.00	980,000	
		飯野海運	1,000	232.00	232,000	
		第一中央汽船	2,000	26.00	52,000	
		全日本空輸	13,000	221.00	2,873,000	
		日本航空システム	16,000	257.00	4,112,000	
		パスコ	1,000	337.00	337,000	
		日新	1,000	180.00	180,000	
		三菱倉庫	1,000	604.00	604,000	
		三井倉庫	1,000	204.00	204,000	
		住友倉庫	1,000	252.00	252,000	
		澁澤倉庫	1,000	219.00	219,000	
		日本トランスシティ	1,000	227.00	227,000	
		東洋埠頭	1,000	141.00	141,000	
		上組	2,000	535.00	1,070,000	
		近畿日本ツーリスト	1,000	190.00	190,000	
		日本電信電話	74	466,000.00	34,484,000	
		KDDI	35	391,000.00	13,685,000	
		日本テレコムホールディングス	27	357,000.00	9,639,000	
		光通信	200	1,100.00	220,000	
		エヌ・ティ・ティ・ドコモ	420	234,000.00	98,280,000	
		J S A T	3	324,000.00	972,000	
		伊藤忠食品	200	4,890.00	978,000	
		伯東	300	1,105.00	331,500	
		菱食	400	4,130.00	1,652,000	
		クラヤ三星堂	1,300	768.00	998,400	
		アドヴァン	400	880.00	352,000	
		アズワン	100	1,357.00	135,700	
		ドウシシャ	100	1,629.00	162,900	
		黒田電気	200	2,355.00	471,000	
		ネットワンシステムズ	2	527,000.00	1,054,000	
		丸文	300	540.00	162,000	
		ハビネット	100	826.00	82,600	
		トーメンエレクトロニクス	100	2,550.00	255,000	
		日本エム・ディ・エム	200	1,624.00	324,800	
		マクニカ	100	1,720.00	172,000	
		伊藤忠商事	13,000	262.00	3,406,000	
		丸紅	13,000	109.00	1,417,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		トーメン	6,000	70.00	420,000	
		二チメン	6,000	70.00	420,000	
		長瀬産業	2,000	515.00	1,030,000	
		蝶理	1,000	53.00	53,000	
		豊田通商	2,000	540.00	1,080,000	
		三共生興	1,000	330.00	330,000	
		兼松	2,000	76.00	152,000	
		三井物産	13,000	577.00	7,501,000	
		日本紙パルプ商事	2,000	340.00	680,000	
		日立ハイテクノロジーズ	1,000	1,464.00	1,464,000	
		スターゼン	1,000	132.00	132,000	
		シャディ	300	1,195.00	358,500	
		山善	1,000	161.00	161,000	
		住友商事	9,000	515.00	4,635,000	
		三菱商事	13,000	743.00	9,659,000	
		キャノン販売	1,000	672.00	672,000	
		西華産業	1,000	124.00	124,000	
		日商岩井	8,000	42.00	336,000	
		菱洋エレクトロ	300	893.00	267,900	
		ユアサ商事	1,000	66.00	66,000	
		阪和興業	1,000	152.00	152,000	
		岩谷産業	1,000	170.00	170,000	
		ナイス	1,000	175.00	175,000	
		昭光通商	1,000	120.00	120,000	
		富士通ビジネスシステム	300	1,020.00	306,000	
		三愛石油	1,000	304.00	304,000	
		稲畑産業	1,000	436.00	436,000	
		G S イクレオス	1,000	166.00	166,000	
		川鉄商事	1,000	78.00	78,000	
		ミツウロコ	1,000	679.00	679,000	
		シナネン	1,000	408.00	408,000	
		伊藤忠エネクス	1,000	494.00	494,000	
		ザ・トーカイ	1,000	466.00	466,000	
		サンリオ	700	567.00	396,900	
		リョーサン	400	1,110.00	444,000	
		東陽テクニカ	300	1,097.00	329,100	
		加賀電子	200	1,789.00	357,800	
		三益半導体工業	200	1,170.00	234,000	
		アズウェル	1,100	437.00	480,700	
		トラスコ中山	400	1,309.00	523,600	
		オートボックスセブン	400	2,360.00	944,000	
		日商エレクトロニクス	200	930.00	186,000	
		イエローハット	300	840.00	252,000	
		日本ビジネスコンピューター	400	490.00	196,000	
		バイタルネット	300	700.00	210,000	
		因幡電機産業	300	1,410.00	423,000	
		インバクト二十ー	100	1,303.00	130,300	
		ドトールコーヒー	200	2,060.00	412,000	
		ミスミ	300	3,740.00	1,122,000	
		ソフトバンク	2,900	1,327.00	3,848,300	
		スズケン	700	2,990.00	2,093,000	
		ローソン	900	3,040.00	2,736,000	
		エディオン	700	555.00	388,500	
		サーラコーポレーション	500	621.00	310,500	
		セイジョー	100	1,123.00	112,300	
		シーアンドエス	800	1,593.00	1,274,400	
		ライトオン	100	1,200.00	120,000	
		良品計画	300	1,613.00	483,900	
		三城	500	1,830.00	915,000	
		コナカ	200	608.00	121,600	
		ボスフル	200	733.00	146,600	
		コジマ	400	696.00	278,400	
		コーナン商事	100	1,949.00	194,900	
		ワタミフードサービス	400	659.00	263,600	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		ドン・キホーテ	100	10,120.00	1,012,000	
		西松屋チェーン	100	2,860.00	286,000	
		同新	50	2,890.00	144,500	
		ゼンショー	100	2,250.00	225,000	
		ユニマツオフィスコ	200	1,235.00	247,000	
		ツルハ	200	2,500.00	500,000	
		サイゼリヤ	300	1,503.00	450,900	
		シートゥーネットワーク	100	2,495.00	249,500	
		京都きもの友禅	1	284,000.00	284,000	
		スギ薬局	100	4,400.00	440,000	
		ファミリーマート	900	2,225.00	2,002,500	
		ケーヨー	900	685.00	616,500	
		ベスト電器	1,000	328.00	328,000	
		マルエツ	1,000	548.00	548,000	
		すかいらーく	1,000	1,590.00	1,590,000	
		セブン・イレブン・ジャパン	7,000	3,400.00	23,800,000	
		島忠	500	2,335.00	1,167,500	
		ヨークベニマル	500	2,435.00	1,217,500	
		カスミ	1,000	450.00	450,000	
		東急ストア	1,000	343.00	343,000	
		リンガーハット	200	1,179.00	235,800	
		アオキインターナショナル	500	458.00	229,000	
		コメリ	500	2,865.00	1,432,500	
		青山商事	800	1,550.00	1,240,000	
		しまむら	300	7,430.00	2,229,000	
		ハックキミサワ	500	833.00	416,500	
		三越	5,000	247.00	1,235,000	
		東急百貨店	1,000	63.00	63,000	
		高島屋	3,000	463.00	1,389,000	
		大丸	3,000	389.00	1,167,000	
		松坂屋	1,000	284.00	284,000	
		丸善	1,000	129.00	129,000	
		伊勢丹	2,000	841.00	1,682,000	
		阪急百貨店	1,000	608.00	608,000	
		バルコ	1,000	485.00	485,000	
		丸井	3,000	1,142.00	3,426,000	
		十字屋	2,000	26.00	52,000	
		井筒屋	1,000	140.00	140,000	
		ダイエー	3,000	130.00	390,000	
		イトーヨーカ堂	3,000	3,610.00	10,830,000	
		イズミヤ	1,000	509.00	509,000	
		イオン	3,000	2,890.00	8,670,000	
		西友	3,000	363.00	1,089,000	
		ユニー	1,000	1,092.00	1,092,000	
		イズミ	1,000	1,463.00	1,463,000	
		平和堂	1,000	1,045.00	1,045,000	
		フジ	400	1,939.00	775,600	
		ヤオコー	200	1,765.00	353,000	
		ゼビオ	400	1,998.00	799,200	
		ケーズデンキ	100	1,460.00	146,000	
		O l y m p i c	200	1,385.00	277,000	
		ヤマダ電機	600	2,600.00	1,560,000	
		ホームック	400	920.00	368,000	
		愛眼	200	595.00	119,000	
		吉野家ディー・アンド・シー	6	174,000.00	1,044,000	
		マツモトキヨシ	200	5,040.00	1,008,000	
		松屋フーズ	200	2,390.00	478,000	
		セシール	300	1,409.00	422,700	
		ミニストップ	300	1,679.00	503,700	
		カーマ	300	650.00	195,000	
		ダイキ	200	1,322.00	264,400	
		大庄	100	1,000.00	100,000	
		ファーストリテイリング	800	3,840.00	3,072,000	
		サンドラッグ	100	4,460.00	446,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		ペルーナ	200	4,120.00	824,000	
		みずほホールディングス	78	114,000.00	8,892,000	
		三菱東京フィナンシャル・グループ	48	682,000.00	32,736,000	
		UFJホールディングス	41	108,000.00	4,428,000	
		りそなホールディングス	47,000	62.00	2,914,000	
		三井トラスト・ホールディングス	6,000	190.00	1,140,000	
		三井住友フィナンシャルグループ	48	377,000.00	18,096,000	
		第四銀行	3,000	376.00	1,128,000	
		北越銀行	1,000	274.00	274,000	
		福岡銀行	5,000	468.00	2,340,000	
		西日本銀行	4,000	342.00	1,368,000	
		札幌北洋ホールディングス	3	549,000.00	1,647,000	
		もみじホールディングス	1	338,000.00	338,000	
		千葉銀行	7,000	339.00	2,373,000	
		横浜銀行	9,000	465.00	4,185,000	
		常陽銀行	7,000	323.00	2,261,000	
		群馬銀行	4,000	513.00	2,052,000	
		足利銀行	7,000	134.00	938,000	
		武蔵野銀行	200	3,630.00	726,000	
		千葉興業銀行	400	613.00	245,200	
		関東銀行	100	910.00	91,000	
		東京都民銀行	300	990.00	297,000	
		九州親和ホールディングス	2,000	300.00	600,000	
		七十七銀行	3,000	438.00	1,314,000	
		青森銀行	2,000	418.00	836,000	
		秋田銀行	2,000	409.00	818,000	
		山形銀行	2,000	535.00	1,070,000	
		岩手銀行	200	3,860.00	772,000	
		東邦銀行	2,000	418.00	836,000	
		みちのく銀行	1,000	677.00	677,000	
		北海道銀行	2,000	92.00	184,000	
		静岡銀行	6,000	748.00	4,488,000	
		十六銀行	3,000	416.00	1,248,000	
		北陸銀行	8,000	165.00	1,320,000	
		駿河銀行	2,000	484.00	968,000	
		八十二銀行	5,000	511.00	2,555,000	
		山梨中央銀行	2,000	416.00	832,000	
		大垣共立銀行	3,000	500.00	1,500,000	
		福井銀行	2,000	401.00	802,000	
		北國銀行	3,000	479.00	1,437,000	
		清水銀行	100	5,030.00	503,000	
		滋賀銀行	2,000	455.00	910,000	
		南都銀行	2,000	375.00	750,000	
		百五銀行	3,000	426.00	1,278,000	
		京都銀行	3,000	446.00	1,338,000	
		紀陽銀行	3,000	204.00	612,000	
		三重銀行	1,000	516.00	516,000	
		池田銀行	200	5,300.00	1,060,000	
		広島銀行	5,000	399.00	1,995,000	
		山口銀行	2,000	783.00	1,566,000	
		山陰合同銀行	2,000	598.00	1,196,000	
		中国銀行	2,000	713.00	1,426,000	
		鳥取銀行	1,000	372.00	372,000	
		伊予銀行	3,000	639.00	1,917,000	
		百十四銀行	3,000	620.00	1,860,000	
		四国銀行	2,000	624.00	1,248,000	
		阿波銀行	2,000	531.00	1,062,000	
		鹿児島銀行	2,000	425.00	850,000	
		大分銀行	1,000	524.00	524,000	
		宮崎銀行	1,000	413.00	413,000	
		肥後銀行	2,000	467.00	934,000	
		佐賀銀行	1,000	424.00	424,000	
		十八銀行	1,000	465.00	465,000	
		沖縄銀行	100	2,060.00	206,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		琉球銀行	200	1,345.00	269,000	
		住友信託銀行	12,000	486.00	5,832,000	
		みずほアセット信託銀行	23,000	44.00	1,012,000	
		長野銀行	1,000	347.00	347,000	
		名古屋銀行	2,000	575.00	1,150,000	
		愛知銀行	100	6,500.00	650,000	
		第三銀行	1,000	423.00	423,000	
		中京銀行	2,000	450.00	900,000	
		東日本銀行	1,000	367.00	367,000	
		福岡シティ銀行	1,000	267.00	267,000	
		愛媛銀行	1,000	407.00	407,000	
		トマト銀行	1,000	285.00	285,000	
		みなと銀行	3,000	270.00	810,000	
		京葉銀行	2,000	300.00	600,000	
		栃木銀行	1,000	658.00	658,000	
		北日本銀行	100	4,530.00	453,000	
		香川銀行	1,000	643.00	643,000	
		東和銀行	2,000	340.00	680,000	
		徳島銀行	1,000	664.00	664,000	
		福島銀行	1,000	112.00	112,000	
		大東銀行	1,000	307.00	307,000	
		大和証券グループ本社	11,000	529.00	5,819,000	
		日興コーディアルグループ	15,000	424.00	6,360,000	
		野村ホールディングス	16,000	1,364.00	21,824,000	
		新光証券	7,000	147.00	1,029,000	
		みずほインベスターズ証券	11,000	92.00	1,012,000	
		岡三証券	1,000	307.00	307,000	
		さくらフレンド証券	2,000	146.00	292,000	
		コスモ証券	4,000	64.00	256,000	
		丸三証券	1,000	233.00	233,000	
		東洋証券	1,000	141.00	141,000	
		三菱証券	3,000	521.00	1,563,000	
		東海東京証券	3,000	130.00	390,000	
		光世証券	1,000	99.00	99,000	
		UFJつばさ証券	4,000	180.00	720,000	
		水戸証券	1,000	175.00	175,000	
		明光ナショナル証券	1,500	245.00	367,500	
		松井証券	800	814.00	651,200	
		小林洋行	100	1,645.00	164,500	
		三井住友海上火災保険	12,000	522.00	6,264,000	
		日本興亜損害保険	7,000	427.00	2,989,000	
		損害保険ジャパン	8,000	673.00	5,384,000	
		日新火災海上保険	1,000	223.00	223,000	
		ニッセイ同和損害保険	3,000	442.00	1,326,000	
		あいおい損害保険	6,000	223.00	1,338,000	
		富士火災海上保険	4,000	211.00	844,000	
		ミレアホールディングス	15	928,000.00	13,920,000	
		大同生命保険	13	238,000.00	3,094,000	
		クレディセゾン	1,500	2,115.00	3,172,500	
		オーエムシーカード	2,000	298.00	596,000	
		ソフトバンク・インベストメント	3	58,500.00	175,500	
		日本証券金融	1,000	396.00	396,000	
		アイフル	750	5,200.00	3,900,000	
		ポケットカード	300	797.00	239,100	
		武富士	1,240	6,210.00	7,700,400	
		三洋電機クレジット	300	1,785.00	535,500	
		リコーリース	200	1,340.00	268,000	
		クレディア	100	1,156.00	115,600	
		シンキ	600	408.00	244,800	
		イオンクレジットサービス	400	4,340.00	1,736,000	
		ニッシン	600	820.00	492,000	
		アコム	1,200	4,140.00	4,968,000	
		三洋信販	400	2,120.00	848,000	
		プロミス	1,000	3,960.00	3,960,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		ロプロ	900	408.00	367,200	
		東京リース	1,000	868.00	868,000	
		日本信販	3,000	107.00	321,000	
		ジャックス	2,000	397.00	794,000	
		オリエントコーポレーション	5,000	51.00	255,000	
		日立キャピタル	1,000	1,359.00	1,359,000	
		セントラルファイナンス	1,000	349.00	349,000	
		オリックス	700	7,750.00	5,425,000	
		住商リース	200	1,431.00	286,200	
		ダイヤモンドリース	500	2,140.00	1,070,000	
		ジャフコ	400	5,770.00	2,308,000	
		S F C G	110	8,920.00	981,200	
		三井不動産	7,000	811.00	5,677,000	
		三菱地所	11,000	906.00	9,966,000	
		平和不動産	500	229.00	114,500	
		東京建物	1,000	183.00	183,000	
		ダイビル	1,000	408.00	408,000	
		サンケイビル	1,000	326.00	326,000	
		東急不動産	3,000	132.00	396,000	
		住友不動産	3,000	502.00	1,506,000	
		東宝不動産	1,000	389.00	389,000	
		大京	1,000	46.00	46,000	
		テーオーシー	1,000	509.00	509,000	
		東京楽天地	1,000	364.00	364,000	
		アーバンコーポレイション	100	651.00	65,100	
		明和地所	300	916.00	274,800	
		住友不動産販売	200	2,140.00	428,000	
		ゴールドクレスト	100	2,760.00	276,000	
		ジョイント・コーポレーション	100	683.00	68,300	
		東栄住宅	100	1,260.00	126,000	
		飯田産業	100	1,379.00	137,900	
		日本工営	1,000	168.00	168,000	
		総合警備保障	500	1,664.00	832,000	
		野村総合研究所	400	11,050.00	4,420,000	
		電通	12	365,000.00	4,380,000	
		コナミスポーツ	300	2,100.00	630,000	
		サニックス	400	1,070.00	428,000	
		オリエンタルランド	900	7,040.00	6,336,000	
		パーク24	300	1,601.00	480,300	
		クレスコ	100	613.00	61,300	
		フジテレビジョン	10	481,000.00	4,810,000	
		ラウンドワン	4	149,000.00	596,000	
		リゾートトラスト	300	2,020.00	606,000	
		オービック	100	20,020.00	2,002,000	
		アルゴ二十一	100	700.00	70,000	
		ビー・エム・エル	200	2,215.00	443,000	
		住商オートリース	200	1,665.00	333,000	
		トレンドマイクロ	1,000	2,305.00	2,305,000	
		富士通サポートアンドサービス	600	1,498.00	898,800	
		もしもしホットライン	50	3,860.00	193,000	
		東急コミュニティー	100	1,420.00	142,000	
		日本オラクル	1,100	3,100.00	3,410,000	
		アルファシステムズ	100	1,061.00	106,100	
		シーエーシー	400	630.00	252,000	
		トーセ	100	925.00	92,500	
		ユー・エス・エス	300	5,430.00	1,629,000	
		日立ビジネスソリューション	100	800.00	80,000	
		伊藤忠テクノサイエンス	600	2,450.00	1,470,000	
		大塚商会	400	1,545.00	618,000	
		NECソフト	400	3,750.00	1,500,000	
		総合メディカル	100	1,404.00	140,400	
		電通国際情報サービス	400	1,490.00	596,000	
		日本ユニシス	1,100	713.00	784,300	
		東京放送	2,000	1,520.00	3,040,000	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		日本テレビ放送網	230	17,800.00	4,094,000	
		全国朝日放送	10	165,000.00	1,650,000	
		松竹	1,000	607.00	607,000	
		東宝	2,000	1,090.00	2,180,000	
		東映	2,000	272.00	544,000	
		ベンチャー・リンク	600	688.00	412,800	
		エヌ・ティ・ティ・データ	24	346,000.00	8,304,000	
		ベルシステム24	50	20,910.00	1,045,500	
		共立メンテナンス	100	2,000.00	200,000	
		スクウェア	500	1,748.00	874,000	
		公益社	100	1,320.00	132,000	
		ダイヤモンドコンピューターサービス	200	510.00	102,000	
		テクモ	100	945.00	94,500	
		光栄	300	2,970.00	891,000	
		CRCソリューションズ	100	1,410.00	141,000	
		オークネット	100	900.00	90,000	
		よみうりランド	1,000	348.00	348,000	
		東京都競馬	3,000	105.00	315,000	
		東京ドーム	1,000	263.00	263,000	
		データ通信システム	100	2,000.00	200,000	
		エニックス	600	2,165.00	1,299,000	
		シーイーシー	200	926.00	185,200	
		日立ソフトウェアエンジニアリング	600	2,890.00	1,734,000	
		カプコン	500	2,065.00	1,032,500	
		エスアールエル	300	1,040.00	312,000	
		日本空港ビルデング	1,000	796.00	796,000	
		トランス・コスモス	200	1,317.00	263,400	
		住商情報システム	400	3,060.00	1,224,000	
		藤田観光	2,000	429.00	858,000	
		日本管財	200	1,636.00	327,200	
		セコム	2,000	4,160.00	8,320,000	
		CSK	700	2,570.00	1,799,000	
		日本システムウエア	200	729.00	145,800	
		日立情報システムズ	400	2,890.00	1,156,000	
		アイネス	500	704.00	352,000	
		メイテック	400	2,710.00	1,084,000	
		TKC	300	1,390.00	417,000	
		アサツー ディ・ケイ	600	2,065.00	1,239,000	
		富士ソフトABC	400	2,105.00	842,000	
		ソラン	200	570.00	114,000	
		TIS	400	1,768.00	707,200	
		ナムコ	500	1,972.00	986,000	
		応用地質	300	768.00	230,400	
		日本システムディベロップメント	300	1,720.00	516,000	
		大和工商リース	2,000	282.00	564,000	
		コナミ	1,100	3,020.00	3,322,000	
		日本電子計算	200	905.00	181,000	
		ベネッセコーポレーション	900	1,312.00	1,180,800	
		キャッツ	200	932.00	186,400	
		ジャパンメンテナンス	200	418.00	83,600	
		ニチイ学館	200	5,880.00	1,176,000	
		ダイセキ	200	1,838.00	367,600	
計		銘柄数:	1,092		2,055,329,235	
		組入時価比率:	93.8%		100.0%	
合計					2,055,329,235	

(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  
該当事項はありません。

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記事項(デリバティブ取引等関係注記)」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)

科 目	対象年月日	(平成13年12月10日現在)	(平成14年12月10日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		60,520,493	38,912,300
国債証券		1,412,668,560	1,684,024,750
地方債証券		98,376,660	118,904,585
特殊債券		258,615,760	328,713,960
社債券		282,502,949	352,160,398
未収利息		11,787,538	12,029,072
前払費用		581,408	380,626
流動資産合計		2,125,053,368	2,535,125,691
資産合計		2,125,053,368	2,535,125,691
負債の部			
流動負債			
未払解約金		39,837	817,564
流動負債合計		39,837	817,564
負債合計		39,837	817,564
純資産の部			
元本			
元本		2,107,678,230	2,444,257,541
剰余金			
剰余金		17,335,301	90,050,586
剰余金合計		17,335,301	90,050,586
純資産合計		2,125,013,531	2,534,308,127
負債・純資産合計		2,125,053,368	2,535,125,691

重要な会計方針

対象年月日 項目	〔 自 平成13年 3月16日 至 平成13年12月10日 〕	〔 自 平成13年12月11日 至 平成14年12月10日 〕
有価証券の評価 基準及び評価方 法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>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。</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は原則として、証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる最終相場)で評価しております。</p> <p>計算期間末日に当該証券取引所の最終相場がない場合には、当該証券取引所における直近の日の最終相場で評価していますが、直近の日の最終相場によるものが適当でない認められた場合は、当該証券取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券 証券取引所に上場されていない有価証券は、原則として、日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融機関の提示</p>	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>同左</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券 同左</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券 証券取引所に上場されていない有価証券は、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等、金融</p>

対象年月日 項目	〔 自 平成13年 3月16日 至 平成13年12月10日 〕	〔 自 平成13年12月11日 至 平成14年12月10日 〕
	<p>する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>機関の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 同左</p>

注記事項

(貸借対照表関係)

(平成13年12月10日現在)	(平成14年12月10日現在)
1. 本有価証券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 2,000,000,000 円	1. 本有価証券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 2,107,678,230 円
同期中における追加設定元本額 550,566,626 円	同期中における追加設定元本額 494,397,819 円
同期中における解約元本額 442,888,396 円	同期中における解約元本額 157,818,508 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 1,606,635,957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 1,665,562,926円
PRU グッドライフ2010 379,886,962円	PRU グッドライフ2010 623,103,403円
PRU グッドライフ2020 67,609,088円	PRU グッドライフ2020 65,658,933円
PRU グッドライフ2030 34,940,239円	PRU グッドライフ2030 30,959,896円
PRU グッドライフ2040 16,998,241円	PRU グッドライフ2040 6,845,825円
PRU グッドライフ2010(年金) 694,002円	PRU グッドライフ2010(年金) 12,875,727円
PRU グッドライフ2020(年金) 504,195円	PRU グッドライフ2020(年金) 15,362,103円
PRU グッドライフ2030(年金) 306,973円	PRU グッドライフ2030(年金) 3,501,826円
PRU グッドライフ2040(年金) 102,573円	PRU グッドライフ2040(年金) 531,055円
計 2,107,678,230円	ワールド・ミックス40(バランス指向) 14,180,771円 ワールド・ミックス60(成長指向) 3,639,382円 ワールド・ミックス80(積極指向) 2,035,694円 計 2,444,257,541円
2. 同ファンドの計算期間は、開示対象ファンドの計算期間とは異なるため、当期損失の金額を表示しておりません。	2. 同ファンドの計算期間は、開示対象ファンドの計算期間とは異なるため、当期損失の金額を表示しておりません。

(有価証券関係)  
 (平成13年12月10日現在)  
 売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた 評価差額
国債証券	1,412,668,560	2,126,620
地方債券	98,376,660	142,390
特殊債券	258,615,760	65,440
社債券	282,502,949	150,474
合計	2,052,163,929	2,484,924

(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(平成13年12月6日)から本有価証券報告書の開示対象ファンドの期末日(平成13年12月10日)までの期間に対応する金額であります。

(平成14年12月10日現在)  
 売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた 評価差額
国債証券	1,684,024,750	561,000
地方債券	118,904,585	60,525
特殊債券	328,713,960	82,830
社債券	352,160,398	10,529
合計	2,483,803,693	714,884

(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(平成14年12月6日)から本有価証券報告書の開示対象ファンドの期末日(平成14年12月10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関係)  
 該当事項はありません。

(1口当たり情報)

(平成13年12月10日現在)	(平成14年12月10日現在)
本有価証券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 1.0082 円 (1万口当たり純資産額 10,082 円)	本有価証券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 1.0368 円 (1万口当たり純資産額 10,368 円)
なお、純資産額は、投資信託財産純資産額を用いております。	なお、純資産額は、投資信託財産純資産額を用いております。

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	銘柄数比率	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	第55回 利付国債(4年)		24,000,000	24,048,960	
		第61回 利付国債(4年)		50,000,000	50,768,500	
		第64回 利付国債(4年)		50,000,000	50,579,500	
		第2回 利付国債(5年)		79,000,000	80,815,420	
		第14回 利付国債(5年)		40,000,000	40,279,200	
		第15回 利付国債(5年)		50,000,000	50,532,500	
		第174回 利付国債(10年)		48,000,000	51,861,600	
		第184回 利付国債(10年)		34,000,000	36,810,100	
		第185回 利付国債(10年)		25,000,000	27,383,250	
		第186回 利付国債(10年)		34,000,000	37,351,720	
		第187回 利付国債(10年)		39,000,000	43,238,130	
		第190回 利付国債(10年)		33,000,000	36,508,560	
		第193回 利付国債(10年)		32,000,000	35,173,760	
		第194回 利付国債(10年)		32,000,000	35,176,960	

種類	通貨	銘柄	銘柄数比率	券面総額	評価額	備考
		第198回 利付国債(10年)		60,000,000	65,673,600	
		第200回 利付国債(10年)		31,000,000	33,580,750	
		第201回 利付国債(10年)		51,000,000	55,129,980	
		第203回 利付国債(10年)		33,000,000	35,570,700	
		第204回 利付国債(10年)		33,000,000	35,213,640	
		第207回 利付国債(10年)		37,000,000	38,043,400	
		第209回 利付国債(10年)		31,000,000	33,958,950	
		第210回 利付国債(10年)		39,000,000	42,471,780	
		第214回 利付国債(10年)		37,000,000	40,111,330	
		第218回 利付国債(10年)		29,000,000	31,646,830	
		第219回 利付国債(10年)		38,000,000	41,205,680	
		第220回 利付国債(10年)		37,000,000	39,849,370	
		第221回 利付国債(10年)		29,000,000	31,667,130	
		第224回 利付国債(10年)		39,000,000	42,285,750	
		第225回 利付国債(10年)		30,000,000	32,758,200	
		第226回 利付国債(10年)		50,000,000	54,196,500	
		第234回 利付国債(10年)		60,000,000	62,821,200	
		第237回 利付国債(10年)		50,000,000	52,610,500	
		第240回 利付国債(10年)		60,000,000	61,914,000	
		第243回 利付国債(10年)		20,000,000	20,223,000	
		第22回 利付国債(20年)		30,000,000	42,645,000	
		第27回 利付国債(20年)		50,000,000	71,257,000	
		第40回 利付国債(20年)		20,000,000	22,470,200	
		第49回 利付国債(20年)		60,000,000	64,837,200	
		第50回 利付国債(20年)		20,000,000	20,966,800	
		第58回 利付国債(20年)		10,000,000	10,388,100	
	計	銘柄数:	40	1,554,000,000	1,684,024,750	
		組入時価比率:	66.4%		67.8%	
	小計				1,684,024,750	
地方債証券	日本円	東京都公募公債第503回		10,000,000	10,741,400	
		東京都公募公債第549回		30,000,000	32,220,300	
		第2回 東京都公募公債5年		40,000,000	41,160,400	
		第109回 神奈川県公募公債		18,000,000	19,398,420	
		神戸市公募公債 112回		14,500,000	15,384,065	
	計	銘柄数:	5	112,500,000	118,904,585	
		組入時価比率:	4.7%		4.8%	
	小計				118,904,585	
特殊債券	日本円	第3回 政府保証日本政策投資銀行債券		30,000,000	32,387,100	
		第298回 政府保証道路債		20,000,000	21,995,000	
		政府保証 第782回公営企業債券		32,000,000	34,830,080	
		第41回 政府保証石油債		17,000,000	18,435,990	
		第29回 政府保証関西国際空港債		10,000,000	10,693,100	
		第36回 政府保証関西国際空港債		12,000,000	12,433,440	
		第1回 政府保証国民生活債券		25,000,000	25,605,250	
		い第597号 興業債券		40,000,000	40,556,400	
		い第593号 商工債券		10,000,000	10,192,400	
		い第605号 商工債券		10,000,000	10,292,800	
		農林中央金庫 585回 イ号		20,000,000	20,416,800	
		い第578号 農林債券		40,000,000	40,391,600	
		第91回 東京三菱銀行債券(5年)		50,000,000	50,484,000	
	計	銘柄数:	13	316,000,000	328,713,960	
		組入時価比率:	13.0%		13.2%	
	小計				328,713,960	
普通社債	日本円	第105回放送債券		20,000,000	21,629,800	
		第2回(株)オリエンタルランド無担保社債		100,000,000	103,567,000	
		第18回 日石三菱株式会社無担保社債(社債間限定同順)		36,000,000	36,315,360	
		第2回 昭和シェル石油株式会社無担保社債		44,000,000	47,533,640	
		第463回 東京電力		48,000,000	48,830,400	
		第393回 中部電力		30,300,000	33,165,168	
		第417回 中部電力		10,000,000	10,949,400	
		第385回 関西電力		20,000,000	22,077,200	
		第382回 東北電力		23,000,000	28,092,430	
	計	銘柄数:	9	331,300,000	352,160,398	

種類	通貨	銘柄	銘柄数比率	券面総額	評価額	備考
		組入時価比率：	13.9%		14.2%	
	小計				352,160,398	
	合計				2,483,803,693	

(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す。

第2 有価証券先物取引等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)

科 目	対象年月日	(平成13年12月10日現在)	(平成14年12月10日現在)
		金 額	金 額
<b>資産の部</b>			
流動資産			
預金		121,840,837	126,553,878
金銭信託		748,070	529,428
コール・ローン		18,235,597	19,321,569
株式		2,755,321,115	2,368,226,016
新株予約権証券		-	3,091
派生商品評価勘定		131,120,626	4,664,910
未収入金		34,286	1,236,161
未収配当金		3,680,787	4,042,482
前払金		-	11,514,836
差入委託証拠金		29,979,612	9,506,410
流動資産合計		3,060,960,930	2,545,598,781
資産合計		3,060,960,930	2,545,598,781
<b>負債の部</b>			
流動負債			
派生商品評価勘定		116,425,138	-
未払解約金		-	100,955
流動負債合計		116,425,138	100,955
負債合計		116,425,138	100,955
<b>純資産の部</b>			
元本			
元本		3,010,473,059	3,316,123,023
欠損金			
欠損金		65,937,267	770,625,197
欠損金合計		65,937,267	770,625,197
純資産合計		2,944,535,792	2,545,497,826
負債・純資産合計		3,060,960,930	2,545,598,781

重要な会計方針

対象年月日 項目	〔 自 平成13年 3月16日 至 平成13年12月10日 〕	〔 自 平成13年12月11日 至 平成14年12月10日 〕
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。 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は原則として、証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる最終相場)で評価しております。 計算期間末日に当該証券取引所の最	株式、新株予約権証券 同左 証券取引所に上場されている有価証券 同左

対象年月日 項目	〔 自 平成13年 3月16日 至 平成13年12月10日 〕	〔 自 平成13年12月11日 至 平成14年12月10日 〕
	<p>終相場がない場合には、当該証券取引所における直近の日の最終相場で評価していますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該証券取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券は、原則として、日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融機関の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券</p> <p>適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>証券取引所に上場されていない有価証券</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券は、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p>	<p>先物取引 同左</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>受取配当金は原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>	<p>受取配当金</p> <p>受取配当金は原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金時には、入金時基準で計上しております。</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>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表ならびに運用報告書に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び61条に基づき処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 同左</p>

注記事項  
(貸借対照表関係)

(平成13年12月10日現在)	(平成14年12月10日現在)
<p>1. 本有価証券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 3,000,000,000 円</p> <p>同期中における追加設定元本額</p>	<p>1. 本有価証券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 3,010,473,059 円</p> <p>同期中における追加設定元本額</p>

(平成13年12月10日現在)		(平成14年12月10日現在)	
同期中における解約元本額	272,834,029 円 262,360,970 円	同期中における解約元本額	470,960,819 円 165,310,855 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・パフォーマンス	2,838,197,367円	PRU 海外株式マーケット・パフォーマンス	3,057,147,512円
PRU グッドライフ2010	48,867,309円	PRU グッドライフ2010	112,361,442円
PRU グッドライフ2020	25,009,931円	PRU グッドライフ2020	35,636,300円
PRU グッドライフ2030	32,684,591円	PRU グッドライフ2030	44,033,711円
PRU グッドライフ2040	64,760,199円	PRU グッドライフ2040	35,113,658円
PRU グッドライフ2010(年金)	89,233円	PRU グッドライフ2010(年金)	2,155,270円
PRU グッドライフ2020(年金)	186,513円	PRU グッドライフ2020(年金)	8,145,504円
PRU グッドライフ2030(年金)	287,152円	PRU グッドライフ2030(年金)	4,808,571円
PRU グッドライフ2040(年金)	390,764円	PRU グッドライフ2040(年金)	2,706,029円
		ワールド・ミックス40(バランス指向)	5,598,198円
		ワールド・ミックス60(成長指向)	3,167,959円
		ワールド・ミックス80(積極指向)	5,248,869円
計	3,010,473,059円	計	3,316,123,023円
2. 同ファンドの計算期間は、開示対象ファンドの計算期間とは異なるため、当期損失の金額を表示していません。		2. 同ファンドの計算期間は、開示対象ファンドの計算期間とは異なるため、当期損失の金額を表示していません。	

(有価証券関係)

(平成13年12月10日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,755,321,115	40,860,864
合計	2,755,321,115	40,860,864

(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(平成13年12月6日)から本有価証券報告書の開示対象ファンドの期末日(平成13年12月10日)までの期間に対応する金額であります。

(平成14年12月10日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,368,226,016	70,498,733
新株予約権証券	3,091	230
合計	2,368,229,107	70,498,963

(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(平成14年12月6日)から本有価証券報告書の開示対象ファンドの期末日(平成14年12月10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関係)

取引の状況に関する事項

〔自平成13年3月16日 至平成13年12月10日〕	〔自平成13年12月11日 至平成14年12月10日〕
1. 取引の内容 当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。	1. 取引の内容 同左
2. 取引に対する取組みと利用目的 アメリカドル及びユーロ建の株価指数先物取引を主要投資対象としております。	2. 取引に対する取組みと利用目的 同左

〔 自 平成13年 3月16日 至 平成13年12月10日 〕	〔 自 平成13年12月11日 至 平成14年12月10日 〕
3. 取引に係るリスクの内容 株価指数先物取引に係る主要なリスクは株価の変動による株価変動リスクであります。	3. 取引に係るリスクの内容 同左
4. 取引に係るリスク管理体制 組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。 なお、リスク管理はデリバティブだけに限定しては行っておりません。デリバティブと現物資産等を統合し、各投資信託財産全体でのリスク管理を、行っております。	4. 取引に係るリスク管理体制 同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 同左

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)

区分	種類	(平成13年12月10日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	116,425,138	-	131,120,626	14,695,488
	合計	116,425,138	-	131,120,626	14,695,488

(単位:円)

区分	種類	(平成14年12月10日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	129,202,278	-	133,867,188	4,664,910
	合計	129,202,278	-	133,867,188	4,664,910

(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。

(1口当たり情報)

(平成13年12月10日現在)	(平成14年12月10日現在)
本有価証券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 0.9781 円 (1万口当たり純資産額 9,781 円)	本有価証券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 0.7676 円 (1万口当たり純資産額 7,676 円)
なお、純資産額は、投資信託財産純資産額を用いております。	なお、純資産額は、投資信託財産純資産額を用いております。

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
株券	ドル	3M CO	600	124.05	74,430.00	
		ABBOTT LABORATORIES	2,400	41.65	99,960.00	
		ADC TELECOMMUNICATIONS INC	400	1.63	652.00	
		ADOBE SYSTEMS INC	400	24.86	9,944.00	
		ADVANCED MICRO DEVICES	300	7.31	2,193.00	
		AETNA INC-NEW	200	39.60	7,920.00	
		AFLAC INC	800	29.67	23,736.00	
		AGERE SYSTEMS INC-CL A	56	1.15	64.40	
		AGERE SYSTEMS INC-CL B	1,375	1.14	1,567.50	
		AGILENT TECHNOLOGIES INC	700	16.40	11,480.00	
		AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	400	43.78	17,512.00	
		ALBERTSON'S INC	600	21.99	13,194.00	
		ALCOA INC	1,300	23.02	29,926.00	
		ALLSTATE CORP	1,100	37.85	41,635.00	
		AMAZON.COM INC	500	21.68	10,840.00	
		AMEREN CORPORATION	200	40.33	8,066.00	
		AMERICAN ELECTRIC POWER	500	26.73	13,365.00	
		AMERICAN EXPRESS COMPANY	2,100	36.60	76,860.00	
		AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	3,450	59.57	205,516.50	
		AMERICAN POWER CONVERSION	300	14.95	4,485.00	
		AMGEN INC	2,020	47.64	96,232.80	
		ANADARKO PETROLEUM CORP	400	47.49	18,996.00	
		ANALOG DEVICES	500	25.74	12,870.00	
		ANHEUSER-BUSCH COS INC	1,400	49.56	69,384.00	
		ANTHEM INC	100	61.65	6,165.00	
		AOL TIME WARNER	6,900	13.08	90,252.00	
		AON CORP	400	18.55	7,420.00	
		APACHE CORP	250	56.34	14,085.00	
		APPLE COMPUTER INC	500	14.75	7,375.00	
		APPLIED BIOSYSTEMS GROUP-APP	300	19.85	5,955.00	
		APPLIED MATERIALS INC	2,600	13.70	35,620.00	
		APPLIED MICRO CIRCUITS CORP	200	4.08	816.00	
		ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	945	12.99	12,275.55	
		AT&T CORP	1,240	27.89	34,583.60	
		AT&T WIRELRSS SERVICES	3,366	6.64	22,350.24	
		AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,000	41.77	41,770.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	100	39.25	3,925.00	
		AVERY DENNISON CORP	200	60.35	12,070.00	
		AVON PRODUCTS INC	400	52.25	20,900.00	
		BAKER HUGHES INC	500	32.50	16,250.00	
		BANK OF AMERICA CORP	2,500	68.05	170,125.00	
		BANK OF NEW YORK CO INC	1,100	26.66	29,326.00	
		BANK ONE CORP	1,900	37.60	71,440.00	
		BAXTER INTERNATIONAL INC	900	32.06	28,854.00	
		BEA SYSTEMS INC	600	9.11	5,466.00	
		BECTON DICKINSON & CO	400	30.91	12,364.00	
		BED BATH & BEYOND INC	500	33.02	16,510.00	
		BELLSOUTH CORP	3,000	26.14	78,420.00	
		BEST BUY COMPANY INC	400	25.27	10,108.00	
		BIOGEN INC	250	42.17	10,542.50	
		BIOMET INC	350	27.29	9,551.50	
		BJ SERVICES CO	300	32.87	9,861.00	
		BLACK & DECKER CORP	100	40.91	4,091.00	
		BLOCK H & R INC	300	37.52	11,256.00	
		BMC SOFTWARE INC	400	15.52	6,208.00	
		BOEING CO	1,300	32.40	42,120.00	
		BOSTON SCIENTIFIC CORP	500	42.51	21,255.00	
		BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,200	27.48	87,936.00	
		BROADCOM CORP-CL A	300	15.69	4,707.00	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		BROCADE COMMUNICATIONS SYS	300	4.64	1,392.00	
		BURLINGTON NORTHERN SANTA FE	600	25.79	15,474.00	
		BURLINGTON RESOURCES INC	300	41.19	12,357.00	
		CADENCE DESIGN SYSTEM INC	250	11.28	2,820.00	
		CALPINE CORP	200	3.37	674.00	
		CAMPBELL SOUP CO	600	24.13	14,478.00	
		CARDINAL HEALTH INC	750	62.74	47,055.00	
		CARMAX INC	94	19.36	1,819.84	
		CARNIVAL CORP	800	26.02	20,816.00	
		CATERPILLAR INC	500	45.00	22,500.00	
		CENDANT CORP	1,582	11.94	18,889.08	
		CENTERPOINT ENERGY INC	500	6.82	3,410.00	
		CENTEX CORP	100	47.54	4,754.00	
		CERIDIAN CORP-NEW	200	14.45	2,890.00	
		CERTEGY INC	100	24.97	2,497.00	
		CHEVRONTXACO CORP	1,750	67.32	117,810.00	
		CHIRON CORP	150	39.08	5,862.00	
		CHUBB CORP	300	56.52	16,956.00	
		CIENA CORP	200	5.10	1,020.00	
		CIGNA CORP	200	42.79	8,558.00	
		CINCINNATI FINANCIAL CORP	200	37.34	7,468.00	
		CINERGY CORP	200	31.75	6,350.00	
		CINTAS CORP	200	48.03	9,606.00	
		CIRCUIT CITY STORES	300	8.21	2,463.00	
		CISCO SYSTEMS INC	12,000	13.50	162,000.00	
		CITIGROUP INC	8,400	36.15	303,660.00	
		CITRIX SYSTEMS INC	100	12.65	1,265.00	
		CLEAR CHANNEL COMMUNICATIONS	900	38.96	35,064.00	
		CLOROX COMPANY	300	44.35	13,305.00	
		COCA-COLA COMPANY	3,700	45.10	166,870.00	
		COMCAST CORP-CL A	2,005	23.31	46,736.55	
		COMCAST CORP-SPECIAL CL A	1,400	22.69	31,766.00	
		COMERICA INC	300	43.75	13,125.00	
		COMPUTER ASSOCIATES INTL INC	800	12.76	10,208.00	
		COMPUTER SCIENCES CORP	200	32.08	6,416.00	
		COMPUWARE CORP	300	5.02	1,508.70	
		COMVERSE TECHNOLOGY INC	100	10.13	1,013.00	
		CONAGRA FOODS INC	800	24.12	19,296.00	
		CONCORD EFS INC	750	15.55	11,662.50	
		CONSOLIDATED EDISON INC	300	40.52	12,156.00	
		CONSTELLATION ENERGY GROUP	300	26.24	7,872.00	
		CONVERGYS CORP	100	16.08	1,608.00	
		COOPER INDUSTRIES LTD-CL A	100	36.04	3,604.00	
		CORNING INC	1,400	3.37	4,718.00	
		COSTCO WHOLESALE CORP	700	29.49	20,643.00	
		COUNTRYWIDE FINANCIAL CORPORATION	200	48.15	9,630.00	
		COX COMMUNICATIONS INC-CL A	600	28.65	17,190.00	
		CRESCENT REAL ESTATE EQT CO	200	16.70	3,340.00	
		CSX CORP	300	28.08	8,424.00	
		CVS CORP	600	26.39	15,834.00	
		DANA CORP	200	11.88	2,376.00	
		DANAHER CORP	150	60.85	9,127.50	
		DEERE & CO	400	47.63	19,052.00	
		DELL COMPUTER CORP	3,800	27.54	104,652.00	
		DELPHI AUTOMOTIVE SYSTEMS	800	8.17	6,536.00	
		DEVON ENERGY CORPORATION	250	48.71	12,177.50	
		DOMINION RESOURCES INC/VA	450	50.02	22,509.00	
		DONNELLEY (R.R.) & SONS CO	200	21.29	4,258.00	
		DOVER CORP	300	28.67	8,601.00	
		DOW CHEMICAL	1,400	29.23	40,922.00	
		DOW JONES & CO INC	100	39.09	3,909.00	
		DST SYSTEMS INC	50	35.33	1,766.50	
		DTE ENERGY COMPANY	300	44.13	13,239.00	
		DU PONT (E.I.)DE NEMOURS	1,600	42.52	68,032.00	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		DUKE ENERGY CORP	1,401	19.25	26,969.25	
		EASTMAN KODAK CO	500	36.44	18,220.00	
		EATON CORP	100	72.96	7,296.00	
		EBAY INC	300	67.47	20,241.00	
		EDISON INTERNATIONAL	500	10.37	5,185.00	
		EL PASO CORPORATION	800	6.72	5,376.00	
		ELECTRONIC ARTS INC	200	63.95	12,790.00	
		ELECTRONIC DATA SYSTEMS CORP	700	16.32	11,424.00	
		EMC CORP/MASS	3,500	6.33	22,155.00	
		EMERSON ELECTRIC CO	700	51.15	35,805.00	
		ENTERGY CORP	350	43.99	15,396.50	
		EQUIFAX INC	200	23.00	4,600.00	
		EQUITY OFFICE PROPERTIES TR	600	26.10	15,660.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PROPS TR	400	25.48	10,192.00	
		EXELON CORPORATION	500	51.72	25,860.00	
		EXXON MOBIL CORPORATION	11,100	34.51	383,061.00	
		FANNIE MAE	1,650	63.84	105,336.00	
		FEDERATED DEPARTMENT STORES	300	29.87	8,961.00	
		FEDEX CORPORATION	500	52.75	26,375.00	
		FIFTH THIRD BANCORP	850	57.20	48,620.00	
		FIRST DATA CORP	1,200	34.29	41,148.00	
		FIRSTENERGY CORP	433	31.33	13,565.89	
		FISERV INC	300	32.63	9,789.00	
		FLEETBOSTON FINANCIAL CORP	1,700	24.65	41,905.00	
		FLUOR CORP (NEW)	100	25.64	2,564.00	
		FORD MOTOR COMPANY	2,900	9.45	27,405.00	
		FORTUNE BRANDS INC	250	48.18	12,045.00	
		FPL GROUP INC	300	58.88	17,664.00	
		FREDDIE MAC	1,150	58.15	66,872.50	
		GANNETT CO	450	69.77	31,396.50	
		GAP INC	1,100	15.10	16,610.00	
		GENENTECH INC	400	34.00	13,600.00	
		GENERAL DYNAMICS CORP	300	80.10	24,030.00	
		GENERAL ELECTRIC CO.	16,400	25.50	418,200.00	
		GENERAL MILLS INC	500	43.90	21,950.00	
		GENERAL MOTORS CORP	800	36.17	28,936.00	
		GENERAL MOTORS-CLASS H	1,300	11.30	14,690.00	
		GENUINE PARTS CO	300	29.50	8,850.00	
		GENZYME CORP - GENL DIVISION	400	32.87	13,148.00	
		GEORGIA-PAC (GEORGIA-PAC GP)	400	16.39	6,556.00	
		GILLETTE COMPANY	1,600	30.12	48,192.00	
		GLOBAL SANTAFE CORP	199	24.55	4,885.45	
		GOLDEN WEST FINANCIAL CORP	250	69.67	17,417.50	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC	400	73.45	29,380.00	
		GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	200	7.20	1,440.00	
		GRAINGER (W.W.) INC	100	50.68	5,068.00	
		GUIDANT CORP	500	30.73	15,365.00	
		HALLIBURTON CO	700	19.50	13,650.00	
		HARLEY-DAVIDSON INC	500	47.72	23,860.00	
		HARRAH'S ENTERTAINMENT INC	200	39.62	7,924.00	
		HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	400	46.52	18,608.00	
		HCA - THE HEALTHCARE COMPANY	800	41.19	32,952.00	
		HEALTH MGMT ASSOCIATES INC-A	400	18.36	7,344.00	
		HEALTHSOUTH CORP	600	4.07	2,442.00	
		HEINZ (H.J.) CO	500	34.39	17,195.00	
		HEWLETT-PACKARD CO.	4,450	18.03	80,233.50	
		HILTON HOTELS CORP	500	12.81	6,405.00	
		HOME DEPOT INC	3,600	25.75	92,700.00	
		HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,300	23.39	30,407.00	
		HOST MARRIOTT CORP	300	9.06	2,718.00	
		HOUSEHOLD INTERNATIONAL INC	700	27.55	19,285.00	
		HUMAN GENOME SCIENCES INC	100	9.30	930.00	
		HUNTINGTON BANCSHARES INC	250	18.63	4,657.50	
		IDEC PHARMACEUTICALS CORP	200	33.32	6,664.00	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		ILLINOIS TOOL WORKS	500	66.10	33,050.00	
		IMS HEALTH INC	400	16.39	6,556.00	
		INGERSOLL-RAND CO-CL A	300	41.20	12,360.00	
		INTEL CORP	10,900	17.68	192,712.00	
		INTERNATIONAL PAPER CO	700	36.20	25,340.00	
		INTERPUBLIC GROUP COS INC	600	13.46	8,076.00	
		INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,850	79.54	226,689.00	
		INTL FLAVORS & FRAGRANCES	100	32.86	3,286.00	
		INTL GAME TECHNOLOGY	150	75.63	11,344.50	
		INTUIT INC	300	49.26	14,778.00	
		ITT INDUSTRIES INC	100	59.91	5,991.00	
		J.P.MORGAN CHASE & CO	3,200	23.26	74,432.00	
		JABIL CIRCUIT INC	300	18.55	5,565.00	
		JDS UNIPHASE CORP	2,000	2.65	5,300.00	
		JEFFERSON-PILOT CORP	200	36.53	7,306.00	
		JOHN HANCOCK FINANCIAL SRVCS	500	28.86	14,430.00	
		JOHNSON & JOHNSON	5,000	55.56	277,800.00	
		JOHNSON CONTROLS INC	150	79.58	11,937.00	
		JONES APPAREL GROUP INC	200	36.77	7,354.00	
		JUNIPER NETWORKS INC	500	7.67	3,835.00	
		KERR-MCGEE CORP	200	46.02	9,204.00	
		KEYCORP	700	24.98	17,486.00	
		KEYSPAN CORP	200	34.70	6,940.00	
		KIMBERLY-CLARK CORP	800	46.60	37,280.00	
		KINDER MORGAN INC	150	40.65	6,097.50	
		KLA-TENCOR CORPORATION	300	37.31	11,193.00	
		KOHL'S CORP	500	60.00	30,000.00	
		KRAFT FOODS INC-A	600	39.20	23,520.00	
		KROGER CO	1,300	15.10	19,630.00	
		LEHMAN BROTHERS HOLDINGS INC	350	54.79	19,176.50	
		LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	500	4.96	2,480.00	
		LIBERTY MEDIA CORP	4,000	9.41	37,640.00	
		LIBERTY MEDIA CORP RIGHTS	160	4.60	736.00	
		LILLY (ELI) & CO	1,700	65.36	111,112.00	
		LIMITED INC	600	14.71	8,826.00	
		LINCOLN NATIONAL CORP	300	32.75	9,825.00	
		LINEAR TECHNOLOGY CORP	500	27.80	13,900.00	
		LIZ CLAIBORNE INC	200	30.85	6,170.00	
		LOCKHEED MARTIN CORPORATION	600	51.50	30,900.00	
		LOWE'S COMPANIES	1,100	39.85	43,835.00	
		LUCENT TECHNOLOGIES INC	5,200	1.31	6,812.00	
		MANPOWER INC	100	33.80	3,380.00	
		MARATHON OIL CORP	600	21.08	12,648.00	
		MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	300	33.45	10,035.00	
		MARSH & MCLENNAN COS	850	46.99	39,941.50	
		MASCO CORP	700	19.35	13,545.00	
		MATTEL INC	600	20.12	12,072.00	
		MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	500	35.54	17,770.00	
		MAY DEPARTMENT STORES CO	500	23.20	11,600.00	
		MAYTAG CORP	100	26.36	2,636.00	
		MBIA INC	200	42.20	8,440.00	
		MBNA CORP	1,950	20.26	39,507.00	
		MCDONALD'S CORPORATION	2,000	17.40	34,800.00	
		MCGRAW-HILL COMPANIES INC	300	60.16	18,048.00	
		MCKESSON HBOC INC	400	26.36	10,544.00	
		MEADWESTVACO CORP	200	22.55	4,510.00	
		MEDIMMUNE INC	300	25.39	7,617.00	
		MEDTRONIC INC	2,000	46.25	92,500.00	
		MELLON FINANCIAL CORP	600	27.52	16,512.00	
		MERCK & CO., INC.	3,750	58.75	220,312.50	
		MERCURY INTERACTIVE CORP	50	28.81	1,440.50	
		MERRILL LYNCH & CO	1,300	40.08	52,104.00	
		METLIFE INC	1,200	26.31	31,572.00	
		MGIC INVESTMENT CORP	150	41.25	6,187.50	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		MICRON TECHNOLOGY INC	900	12.88	11,592.00	
		MICROSOFT CORP	7,550	53.53	404,151.50	
		MILLENNIUM PHARMACEUTICALS	200	10.28	2,056.00	
		MONSANTO CO	358	18.56	6,644.48	
		MOODY'S CORPORATION	200	42.67	8,534.00	
		MORGAN ST DEAN WITTER & CO	1,600	40.83	65,328.00	
		MOTOROLA INC	3,500	9.23	32,305.00	
		NABORS INDUSTRIES LTD	200	36.60	7,320.00	
		NATIONAL CITY CORP	900	27.02	24,318.00	
		NATL COMMERCE FINANCIAL CORP	300	24.15	7,245.00	
		NETWORK APPLIANCE INC	500	11.50	5,750.00	
		NEW YORK TIMES CO -CL A	200	45.70	9,140.00	
		NEWELL RUBBERMAID INC	400	31.23	12,492.00	
		NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO.	700	26.75	18,725.00	
		NEXTEL COMMUNICATIONS INC-A	1,100	11.39	12,529.00	
		NIKE INC -CL B	300	43.56	13,068.00	
		NISOURCE INC	300	18.93	5,679.00	
		NOBLE CORPORATION	200	33.75	6,750.00	
		NORFOLK SOUTHERN CORP	600	19.68	11,808.00	
		NORTH FORK BANCORPORATION	250	33.91	8,477.50	
		NORTHERN TRUST CORP	300	36.16	10,848.00	
		NOVELLUS SYSTEMS INC	250	28.97	7,242.50	
		NUCOR CORP	100	43.22	4,322.00	
		OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	600	27.67	16,602.00	
		OMNICOM GROUP	300	65.22	19,566.00	
		ORACLE CORPORATION	7,600	10.53	80,028.00	
		P G & E CORPORATION	600	12.90	7,740.00	
		PARK PLACE ENTERTAINMENT	400	7.95	3,180.00	
		PARKER HANNIFIN CORP	200	44.81	8,962.00	
		PAYCHEX INC	600	27.22	16,332.00	
		PEOPLESOFT INC	400	16.93	6,772.00	
		PEPSICO INC	2,910	43.21	125,741.10	
		PFIZER INC	10,200	31.23	318,546.00	
		PHARMACIA CORPORATION	2,100	42.40	89,040.00	
		PHELPS DODGE CORP	100	30.10	3,010.00	
		PHILIP MORRIS COMPANIES INC	3,500	40.06	140,210.00	
		PITNEY BOWES INC	400	33.60	13,440.00	
		PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	500	40.51	20,255.00	
		PPG INDUSTRIES INC	300	47.33	14,199.00	
		PPL CORPORATION	250	32.43	8,107.50	
		PRAXAIR INC	300	56.63	16,989.00	
		PROCTER & GAMBLE CO	2,150	86.38	185,717.00	
		PROGRESS ENERGY INC	300	41.27	12,381.00	
		PROGRESSIVE CORP	360	52.96	19,065.60	
		PROVIDIAN FINANCIAL CORP	200	5.95	1,190.00	
		PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,000	31.09	31,090.00	
		PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	300	28.74	8,622.00	
		QLOGIC CORP	150	36.62	5,493.00	
		QUALCOMM INC	1,200	39.19	47,028.00	
		QUEST DIAGNOSTICS INC	150	59.25	8,887.50	
		QWEST COMMUNICATIONS INTL	2,400	4.26	10,224.00	
		RADIOSHACK CORP	300	20.26	6,078.00	
		RATIONAL SOFTWARE CORP	300	10.28	3,084.00	
		RAYTHEON COMPANY	600	28.08	16,848.00	
		READER'S DIGEST ASSN-CL A	200	15.89	3,178.00	
		ROBERT HALF INTL INC	300	17.10	5,130.00	
		ROCKWELL COLLINS	300	20.94	6,282.00	
		ROCKWELL INTL CORP	300	20.30	6,090.00	
		ROHM AND HAAS CO	300	34.02	10,206.00	
		SABRE HOLDINGS CORP	200	18.25	3,650.00	
		SAFECO CORP	200	34.71	6,942.00	
		SAFEGWAY INC	700	22.32	15,624.00	
		SANMINA-SCI CORP	800	3.84	3,072.00	
		SARA LEE CORP	1,200	22.97	27,564.00	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		SBC COMMUNICATIONS INC	5,400	25.69	138,726.00	
		SCHLUMBERGER LTD	900	45.01	40,509.00	
		SCHWAB (CHARELES) CORP	2,000	10.43	20,860.00	
		SCIENTIFIC-ATLANTA INC	100	12.16	1,216.00	
		SEALED AIR CORP	100	34.63	3,463.00	
		SEARS, ROEBUCK & CO	500	25.71	12,855.00	
		SEMPRA ENERGY	300	23.06	6,918.00	
		SERVICEMASTER COMPANY	400	10.95	4,380.00	
		SHERWIN-WILLIAMS CO	200	27.77	5,554.00	
		SIEBEL SYSTEMS INC	600	7.68	4,608.00	
		SIGMA-ALDRICH	100	48.53	4,853.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	300	33.80	10,140.00	
		SMITH INTERNATIONAL INC	100	33.60	3,360.00	
		SOLECTRON CORP	1,000	3.51	3,510.00	
		SOUTHERN CO	1,100	27.28	30,008.00	
		SOUTHTRUST CORP	600	25.13	15,078.00	
		SOUTHWEST AIRLINES	1,000	16.00	16,000.00	
		SPRINT CORP-PCS GROUP	900	5.00	4,500.00	
		ST JUDE MEDICAL INC	300	34.72	10,416.00	
		ST. PAUL COMPANIES	400	34.58	13,832.00	
		STANLEY WORKS	100	34.11	3,411.00	
		STAPLES INC	700	18.06	12,642.00	
		STARBUCKS CORP	600	20.62	12,372.00	
		STARWOOD HOTELS & RESORTS	300	24.66	7,398.00	
		STATE STREET CORP	500	41.14	20,570.00	
		STRYKER CORP	250	65.17	16,292.50	
		SUN MICROSYSTEMS INC	4,950	3.39	16,780.50	
		SUNGARD DATA SYSTEMS	500	21.69	10,845.00	
		SUNTRUST BANKS INC	450	56.48	25,416.00	
		SYMBOL TECHNOLOGIES INC	400	8.31	3,324.00	
		SYSCO CORP	1,100	29.75	32,725.00	
		TARGET CORP	1,400	32.31	45,234.00	
		TELLABS INC	400	7.02	2,808.00	
		TEMPLE-INLAND INC	100	43.76	4,376.00	
		TENET HEALTHCARE CORPORATION	750	17.40	13,050.00	
		TERADYNE INC	200	12.95	2,590.00	
		TEXAS INSTRUMENTS INC	2,900	16.98	49,242.00	
		TEXTRON INC	200	41.04	8,208.00	
		THERMO ELECTRON CORP	300	19.31	5,793.00	
		TIFFANY & CO	200	26.25	5,250.00	
		TJX COMPANIES INC	900	19.11	17,199.00	
		TMP WORLDWIDE INC	50	11.46	573.00	
		TOYS R US INC	300	12.21	3,663.00	
		TRANSOCEAN SEDCO FOREX INC	500	23.69	11,845.00	
		TRAVELERS PROPERTY CASUALT-A	658	14.40	9,475.20	
		TRAVELERS PROPERTY CASUALT-B	736	14.40	10,598.40	
		TRIBUNE CO	400	44.34	17,736.00	
		TRW INC	200	50.90	10,180.00	
		TXU CORPORATION	500	14.61	7,305.00	
		TYCO INTERNATIONAL LTD	3,200	16.24	51,968.00	
		UNION PACIFIC CORP	400	59.37	23,748.00	
		UNISYS CORP	400	9.80	3,920.00	
		UNITED PARCEL SERVICE	700	63.80	44,660.00	
		UNITED TECHNOLOGIES CORP	800	60.60	48,480.00	
		UNITEDHEALTH GROUP INC	500	80.93	40,465.00	
		UNOCAL CORP	400	30.71	12,284.00	
		UNUMPROVIDENT CORP	400	16.58	6,632.00	
		US BANCORP	3,100	21.01	65,131.00	
		VERISIGN INC	300	8.51	2,553.00	
		VERITAS SOFTWARE CORP	700	16.66	11,662.00	
		VERIZON COMMUNICATIONS INC	4,400	38.30	168,520.00	
		VF CORP	200	36.15	7,230.00	
		VIACOM INC-CL B	2,550	42.47	108,298.50	
		VISTEON CORP	200	7.25	1,450.00	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		VULCAN MATERIALS CO	150	36.58	5,487.00	
		WACHOVIA CORP	2,300	35.06	80,638.00	
		WALGREEN CO	1,600	29.50	47,200.00	
		WAL-MART STORES INC	4,900	51.85	254,065.00	
		WALT DISNEY CO	3,235	16.85	54,509.75	
		WASHINGTON MUTUAL INC	1,550	35.88	55,614.00	
		WASTE MANAGEMENT INC	1,000	23.86	23,860.00	
		WATERS CORP	150	24.44	3,666.00	
		WEATHERFORD INTL LTD	200	40.99	8,198.00	
		WELLPOINT HEALTH NETWORKS	200	68.77	13,754.00	
		WELLS FARGO COMPANY	2,800	45.85	128,380.00	
		WEYERHAEUSER CO	350	46.55	16,292.50	
		WHIRLPOOL CORP	100	49.78	4,978.00	
		WILLIAMS COMPANIES INC	800	2.23	1,784.00	
		WYETH	2,100	37.40	78,540.00	
		XEROX CORP	1,000	7.71	7,710.00	
		XILINX INC	500	20.58	10,290.00	
		XL CAPITAL LTD -CLASS A	250	82.06	20,515.00	
		YAHOO! INC	800	15.74	12,592.00	
		YUM! BRANDS INC	450	22.96	10,332.00	
		ZIMMER HOLDINGS INC	320	39.41	12,611.20	
		ZIONS BANCORPORATION	150	40.64	6,096.00	
	計	銘柄数 :	401		11,845,863.08	
					(1,461,779,504)	
		組入時価比率 :	57.4%		61.7%	
	カナダドル	ABITIBI-CONSOLIDATED INC	643	10.90	7,008.70	
		AGRIUM INC	180	17.60	3,168.00	
		ALCAN ALUMINIUM LTD	520	46.50	24,180.00	
		ATI TECHNOLOGIES INC	646	10.40	6,718.40	
		BALLARD POWER SYSTEMS INC	130	22.27	2,895.10	
		BANK OF MONTREAL	801	40.85	32,720.85	
		BANK OF NOVA SCOTIA	828	49.65	41,110.20	
		BARRICK GOLD CORP	679	23.71	16,099.09	
		BCE INC	827	28.37	23,461.99	
		BIOVAIL CORPORATION	179	50.63	9,062.77	
		BOMBARDIER INC 'B'	2,163	4.70	10,166.10	
		BRASCAN CORPORATION	255	30.92	7,884.60	
		BROOKFIELD PROPERTIES CORP	147	29.72	4,368.84	
		CAE INC	316	4.88	1,542.08	
		CAMECO CORP	127	33.25	4,222.75	
		CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	629	43.00	27,047.00	
		CANADA LIFE FINANCIAL CORP	122	40.50	4,941.00	
		CANADIAN NATL RAILWAY CO	307	68.65	21,075.55	
		CANADIAN NATURAL RESOURCES	176	44.20	7,779.20	
		CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	229	32.90	7,534.10	
		CANADIAN TIRE CORP -CL A	168	32.99	5,542.32	
		CELESTICA INC	344	23.00	7,912.00	
		CGI GROUP INC	549	6.75	3,705.75	
		CI FUND MANAGEMENT INC	268	9.71	2,602.28	
		COGNOS INC	124	32.06	3,975.44	
		CP SHIPS LTD	114	19.45	2,217.30	
		DOFASCO INC	149	27.59	4,110.91	
		DOMTAR INC	288	16.50	4,752.00	
		ENBRIDGE INC	237	42.87	10,160.19	
		ENCANA CORP	635	46.25	29,368.75	
		FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	18	152.00	2,736.00	
		FAIRMONT HOTELS & RESORTS	114	36.31	4,139.34	
		FORDING INC	76	32.70	2,485.20	
		FOUR SEASONS HOTELS INC	51	49.42	2,520.42	
		HUDSON'S BAY CO	200	8.60	1,720.00	
		IMPERIAL OIL LTD	611	43.56	26,615.16	
		INCO LTD	266	29.30	7,793.80	
		INVESTORS GROUP INC	231	26.50	6,121.50	
		LOBLAW COMPANIES LTD	84	55.40	4,653.60	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		MAGNA INTERNATIONAL INC-CL A	113	84.75	9,576.75	
		MANULIFE FINANCIAL CORP	789	35.40	27,930.60	
		MDS INC	204	23.03	4,698.12	
		MOLSON INC-A SHS	174	31.60	5,498.40	
		NATIONAL BANK OF CANADA	277	30.55	8,462.35	
		NEXEN INC	174	33.93	5,903.82	
		NORANDA INC	348	14.10	4,906.80	
		NORTEL NETWORKS CORP	4,903	2.38	11,669.14	
		NOVA CHEMICALS CORP	141	30.22	4,261.02	
		ONEX CORPORATION	212	16.10	3,413.20	
		PETRO-CANADA	400	47.10	18,840.00	
		PLACER DOME INC	479	16.02	7,673.58	
		POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	76	96.81	7,357.56	
		POWER CORP OF CANADA	287	35.30	10,131.10	
		POWER FINANCIAL CORP	106	35.70	3,784.20	
		PRECISION DRILLING CORP	77	55.22	4,251.94	
		QLT INC	98	13.94	1,366.12	
		QUEBECOR INC -CL B	133	14.10	1,875.30	
		QUEBECOR WORLD INC	137	34.11	4,673.07	
		ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	298	14.87	4,431.26	
		ROYAL BANK OF CANADA	1,099	58.75	64,566.25	
		SHAW COMMUNICATIONS INC-B	327	17.00	5,559.00	
		SHELL CANADA LTD	50	48.80	2,440.00	
		SUN LIFE FINANCIAL SVSC CAN	867	27.10	23,495.70	
		SUNCOR ENERGY INC	648	23.75	15,390.00	
		TALISMAN ENERGY INC	198	56.15	11,117.70	
		TECK COMINCO LIMITED	518	11.30	5,853.40	
		THOMSON CORP	631	39.66	25,025.46	
		TRANSALTA CORP	246	17.30	4,255.80	
		TRANSCANADA PIPELINES LTD	694	22.77	15,802.38	
		WESTON (GEORGE) LTD	192	91.00	17,472.00	
	計	銘柄数 :	70		737,800.30	
					(58,256,711)	
		組入時価比率 :	2.3%		2.5%	
	ユーロ	ABN AMRO HOLDING NV	2,332	15.60	36,379.20	
		ACCOR SA	281	32.50	9,132.50	
		ACERINOX SA	87	38.46	3,346.02	
		ACESA INFRAESTRUCTURAS SA	426	10.98	4,677.48	
		ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV	94	31.14	2,927.16	
		ADIDAS-SALOMON AG	66	79.75	5,263.50	
		AEGON NV	1,805	13.95	25,179.75	
		AGFA GEVAERT NV	205	21.28	4,362.40	
		AGUAS DE BARCELONA	204	9.54	1,946.16	
		AGUAS DE BARCELONA-RIGHTS	204	0.08	16.32	
		AIR LIQUIDE	160	126.90	20,304.00	
		AKZO NOBEL	443	30.07	13,321.01	
		ALCATEL A	1,827	5.45	9,957.15	
		ALITALIA	2,264	0.27	620.33	
		ALLEANZA ASSICURAZIONI	300	7.66	2,298.00	
		ALLIANZ AG-REG	299	102.20	30,557.80	
		ALLIED IRISH BANKS PLC	1,600	12.75	20,400.00	
		ALPHA BANK A.E.	313	12.30	3,849.90	
		ALSTOM	406	6.06	2,460.36	
		ALTADIS SA	564	21.37	12,052.68	
		ALTANA AG	53	45.80	2,427.40	
		ALTRAN TECHNOLOGIES SA	49	6.56	321.44	
		ARCELOR	300	12.31	3,693.00	
		ARNOLDO MONDADORI EDITORE	379	6.20	2,349.80	
		ASML HOLDING NV	689	9.50	6,545.50	
		ASSICURAZIONI GENERALI	1,742	18.63	32,453.46	
		AUTOGRILL SPA	372	8.12	3,020.64	
		AUTOROUTES DU SUD DE LA FRAN	131	24.50	3,209.50	
		AUTOSTRAD SPA	1,785	9.57	17,082.45	
		AVENTIS SA	1,123	53.30	59,855.90	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		AXA	2,387	13.65	32,582.55	
		BANCA INTESA SPA-RNC	1,000	1.43	1,435.00	
		BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	1,249	2.24	2,797.76	
		BANCA NAZIONALE LAVORO-ORD	1,297	1.10	1,437.07	
		BANCA POPOLARE CI MILANO	620	3.57	2,213.40	
		BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	4,875	9.63	46,946.25	
		BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	3,449	2.65	9,139.85	
		BANCO COMERCIAL PORTUGUES-RTS	344	0.23	79.12	
		BANCO ESPIRITO SANTO-REG	292	11.70	3,416.40	
		BANCO SANTANDER CENTRAL HIPS	6,896	6.58	45,375.68	
		BANK OF IRELAND	1,400	10.01	14,014.00	
		BASF AG	874	38.70	33,823.80	
		BAYER AG	1,072	22.30	23,905.60	
		BAYERISCHE HYPO-UND VEREINSB	720	15.02	10,814.40	
		BEIERSDORF AG	83	93.00	7,719.00	
		BENETTON GROUP S.P.A.	265	9.08	2,406.20	
		BIC	81	32.00	2,592.00	
		BNP PARIBAS	1,314	35.71	46,922.94	
		BOUYGUES	516	27.52	14,200.32	
		BPI-SGPS S.A.-REG SHS	944	2.15	2,029.60	
		BRISA AUTO-ESTRADAS-PRIV	878	5.07	4,451.46	
		BUDERUS AG	106	21.55	2,284.30	
		BUHRMANN N.V.	310	4.09	1,267.90	
		BULGARI SPA	428	4.66	1,994.48	
		CAP GEMINI SA	168	25.60	4,300.80	
		CAPITALIA SPA	2,297	1.40	3,215.80	
		CARREFOUR SUPERMARCHE	891	41.23	36,735.93	
		CASINO GUICHARD PERRACHON	108	66.20	7,149.60	
		CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	197	15.98	3,148.06	
		CLUB MEDITERRANEE SA	26	22.00	572.00	
		COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	154	13.40	2,063.60	
		COLRUYT NV	57	48.30	2,753.10	
		COMMERCIAL BANK OF GREECE	111	14.96	1,660.56	
		COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	480	27.36	13,132.80	
		CONTINENTAL AG	187	14.85	2,776.95	
		CRH PLC	845	13.50	11,407.50	
		DAIMLERCHRYSLER AG-REG	1,554	32.50	50,505.00	
		DASSAULT SYSTEMES SA	120	23.15	2,778.00	
		DELHAIZE 'LE LION'	82	17.35	1,422.70	
		DEUTSCHE BANK AG -REG	864	45.90	39,657.60	
		DEUTSCHE BOERSE AG	50	39.25	1,962.50	
		DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	389	10.30	4,006.70	
		DEUTSCHE POST AG	626	10.15	6,353.90	
		DEUTSCHE TELEKOM REGD	4,003	12.11	48,476.33	
		DEXIA	1,031	11.50	11,856.50	
		E.ON AG	1,061	42.60	45,198.60	
		EFG EUROBANK ERGASIAS	250	10.98	2,745.00	
		ELAN CORPORATION PLC	529	2.95	1,560.55	
		ELECTRABEL SA	85	234.80	19,958.00	
		ELECTRICIDADE DE PORTUGAL SA	4,454	1.63	7,260.02	
		ELSEVIER	1,146	11.71	13,419.66	
		ENDESA S.A.	1,619	11.42	18,488.98	
		ENEL SPA	4,101	4.86	19,930.86	
		ENI SPA	4,614	14.00	64,596.00	
		EPCOS AG	95	12.69	1,205.55	
		ERSTE BANK DER OESTER SPARK	45	59.74	2,688.30	
		ESSILOR INTERNATIONAL	87	40.22	3,499.14	
		EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	245	11.65	2,854.25	
		FIAT SPA	645	9.04	5,830.80	
		FIAT SPA -PFD	151	4.84	730.84	
		FINECOGROUP SPA	2,223	0.51	1,133.73	
		FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	186	23.05	4,287.30	
		FORTIS	1,559	15.60	24,320.40	
		FORTUM OYJ	557	6.00	3,342.00	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		FRANCE TELECOM SA	1,141	19.30	22,021.30	
		FRESENIUS MEDICAL CARE	123	40.50	4,981.50	
		GAS NATURAL SDG SA	738	18.58	13,712.04	
		GEHE AG	77	37.10	2,856.70	
		GETRONICS NV	494	0.80	395.20	
		GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	200	38.56	7,712.00	
		GROUPE DANONE	225	127.70	28,732.50	
		GRUPO DRAGADOS, S.A.	252	15.75	3,969.00	
		GRUPPO EDITORIALE L'ESPRESSO	504	3.15	1,587.60	
		HAGEMEYER NV	157	7.50	1,177.50	
		HEIDELBERGCEMENT AG	71	37.21	2,641.91	
		HEINEKEN NV	541	37.11	20,076.51	
		HELLENIC TELECOMMUN	450	10.40	4,680.00	
		HENKEL KGAA-VORZUG	50	61.50	3,075.00	
		HUGO BOSS-PFD	100	10.10	1,010.00	
		IBERDROLA SA	1,384	13.33	18,448.72	
		IHCN NA NV	46	48.32	2,222.72	
		IMERYS SA	24	123.30	2,959.20	
		INDITEX	200	23.99	4,798.00	
		INFINEON TECHNOLOGIES	550	8.46	4,653.00	
		ING GROEP N.V.	2,816	16.63	46,830.08	
		INTERBREW	256	19.30	4,940.80	
		INTESABCI SPA	7,186	1.98	14,264.21	
		IRISH LIFE & PERMANENT PLC	492	11.20	5,510.40	
		ITALCEMENTI SPA	287	9.49	2,723.63	
		ITALGAS	510	12.85	6,553.50	
		KARSTADT AG	108	17.20	1,857.60	
		KBC BANCASSURANCE HOLDING NV	441	31.12	13,723.92	
		KERRY GROUP PLC-A	252	12.60	3,175.20	
		KONE OYJ-B SHS	96	28.01	2,688.96	
		KONINKLIJKE AHOLD NV	1,229	12.20	14,993.80	
		KONINKLIJKE KPN NV	2,768	6.13	16,967.84	
		LAFARGE SA	182	74.45	13,549.90	
		LAGARDERE S.C.A.	195	42.55	8,297.25	
		LINDE AG	121	36.00	4,356.00	
		L'OREAL	654	69.85	45,681.90	
		LUXOTTICA GROUP SPA	218	12.65	2,757.70	
		LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	549	42.00	23,058.00	
		MAN AG	161	14.15	2,278.15	
		MEDIASET SPA	1,518	7.43	11,278.74	
		MEDIOBANCA SPA	1,000	7.67	7,670.00	
		MERCK KGAA	190	24.19	4,596.10	
		METRO AG	494	22.50	11,115.00	
		METSO OYJ	220	10.19	2,241.80	
		MICHELIN (CGDE)-B	197	32.40	6,382.80	
		MLP AG	42	12.55	527.10	
		MUENCHENER RUECKVER AG-REG	172	124.65	21,439.80	
		NATIONAL BANK OF GREECE	367	13.90	5,101.30	
		NOKIA	7,630	17.94	136,882.20	
		NUMICO NV	109	11.90	1,297.10	
		OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	33	81.76	2,698.08	
		OMV AG	76	91.60	6,961.60	
		PARMALAT FINANZIARIA SPA	1,300	2.28	2,964.00	
		PECHINEY SA-A SHS	73	35.06	2,559.38	
		PERNOD-RICARD	51	88.35	4,505.85	
		PHILIPS ELECTRONICS NV	2,059	18.55	38,194.45	
		PINAULT-PRINTEMPS REDOUTE	155	78.35	12,144.25	
		PIRELLI SPA	2,227	0.94	2,093.38	
		PORSCHE AG-PFD	6	463.00	2,778.00	
		PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	1,831	6.53	11,956.43	
		PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	228	6.40	1,459.20	
		PSA PEUGEOT CITROEN	352	42.57	14,984.64	
		PUBLICIS GROUPE	113	22.00	2,486.00	
		QIAGEN N.V.	207	6.19	1,281.33	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		RAS SPA	860	11.69	10,053.40	
		RENAULT SA	161	46.80	7,534.80	
		REPSOL YPF S.A.	1,837	12.21	22,429.77	
		ROYAL DUTCH PETROLEUM	3,501	42.10	147,392.10	
		RWE AG	815	26.15	21,312.25	
		RYANAIR HOLDINGS PLC	1,058	7.30	7,723.40	
		SAGEM S.A.-NEW	55	70.05	3,852.75	
		SAMPO OYJ	1,000	7.38	7,380.00	
		SAN PAOLO-IMI SPA	1,843	6.75	12,440.25	
		SANOF I-SYNTHELABO SA	703	55.10	38,735.30	
		SAP AG	401	79.10	31,719.10	
		SCHERING AG	302	42.40	12,804.80	
		SCHNEIDER ELECTRIC SA	265	48.00	12,720.00	
		SEAT-PAGINE GIALLE SPA	4,231	0.69	2,944.77	
		SIEMENS AG	1,351	44.65	60,322.15	
		SNAM RETE GAS	1,253	3.10	3,884.30	
		SOCIETE GENERALE-A	602	51.80	31,183.60	
		SODEXHO ALLIANCE SA	173	24.16	4,179.68	
		SOL MELIA S.A.	270	4.38	1,182.60	
		SOLVAY SA	81	64.40	5,216.40	
		SONAE SGPS, SA	2,924	0.44	1,286.56	
		STMICROELECTRONICS NV	1,063	21.95	23,332.85	
		STORA ENSO OYJ-R SHS	1,080	10.97	11,847.60	
		SUEZ	1,583	16.79	26,578.57	
		TECHNIP	23	72.55	1,668.65	
		TELECOM ITALIA SPA	4,439	7.56	33,558.84	
		TELECOM ITALIA SPA-RNC	3,298	5.09	16,786.82	
		TELEFONICA S.A.	7,192	9.16	65,878.72	
		TELEKOM AUSTRIA AG	325	9.10	2,957.50	
		TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	96	26.95	2,587.20	
		TERRA NETWORKS	647	4.91	3,176.77	
		THALES	182	27.31	4,970.42	
		THOMSON SA	100	19.35	1,935.00	
		THYSSEN KRUPP AG	593	11.44	6,783.92	
		TIETOENATOR OYJ	269	14.41	3,876.29	
		TIM SPA	7,036	4.76	33,491.36	
		TISCALI SPA	303	5.12	1,551.36	
		TOTAL FINA ELF S.A.	1,048	130.50	136,764.00	
		TPG NV	746	16.61	12,391.06	
		TUI AG	194	18.75	3,637.50	
		UCB SA	252	26.53	6,685.56	
		UNIBAIL	69	65.90	4,547.10	
		UNICREDITO ITALIANO SPA	6,344	3.74	23,726.56	
		UNILEVER NV-CVA	895	58.15	52,044.25	
		UNION ELECTRICA FENOSA SA	487	12.54	6,106.98	
		UPM-KYMMENE OYJ	382	32.85	12,548.70	
		VALEO	121	30.19	3,652.99	
		VINCI S.A.	76	56.15	4,267.40	
		VIVENDI UNIVERSAL	1,511	15.38	23,239.18	
		VNU NV	356	27.31	9,722.36	
		VOLKSWAGEN AG	432	38.45	16,610.40	
		VOLKSWAGEN AG PFD	154	27.80	4,281.20	
		WCM BETEILIGUNGS & GRUND AG	202	2.53	511.06	
		WOLTERS KLUWER-CVA	397	17.20	6,828.40	
		ZELTIA SA	292	6.62	1,933.04	
	計	銘柄数：	213		2,871,141.16	
					(358,203,571)	
		組入時価比率：	14.1%		15.1%	
	ポンド	3I GROUP PLC	933	5.30	4,949.56	
		AMEC PLC	356	1.46	519.76	
		AMERSHAM PLC	929	5.64	5,239.56	
		AMVESCAP PLC	1,297	4.09	5,304.73	
		ARM HOLDINGS PLC	1,446	0.62	907.36	
		ASSOCIATED BRITISH PORTS	524	3.94	2,067.18	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		ASTRAZENECA PLC	2,792	22.90	63,936.80	
		AVIVA PLC	3,542	4.83	17,107.86	
		AWG PLC	248	4.20	1,041.60	
		BAA PLC	1,910	5.03	9,607.30	
		BAE SYSTEMS PLC	4,987	1.78	8,901.79	
		BARCLAYS PLC	10,500	3.94	41,370.00	
		BARRATT DEVELOPMENTS PLC	391	3.78	1,477.98	
		BBA GROUP PLC	655	1.92	1,262.51	
		BERKELEY GROUP (THE) PLC	208	5.61	1,167.92	
		BG GROUP PLC	6,055	2.34	14,168.70	
		BILLITON PLC	3,827	3.24	12,399.48	
		BOC GROUP PLC	882	8.83	7,788.06	
		BOOTS COMPANY PLC	1,592	5.58	8,883.36	
		BP PLC	36,436	4.12	150,116.32	
		BPB PLC	785	2.56	2,009.60	
		BRAMBLES INDUSTRIES PLC	1,291	1.40	1,807.40	
		BRITISH AIRWAYS PLC	1,582	1.57	2,491.65	
		BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	3,336	6.00	20,016.00	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	758	4.34	3,293.51	
		BRITISH SKY BROADCASTING PLC	2,116	6.20	13,119.20	
		BT GROUP PLC	13,286	1.92	25,509.12	
		BUNZL PLC	670	4.31	2,891.05	
		CABLE & WIRELESS PLC	3,626	0.47	1,731.41	
		CADBURY SCHWEPES PLC	3,519	4.13	14,533.47	
		CANARY WHARF GROUP PLC	1,004	2.48	2,489.92	
		CAPITA GROUP PLC	952	2.44	2,330.02	
		CARLTON COMMUNICATIONS PLC	903	1.45	1,309.35	
		CELLTECH GROUP PLC	398	3.19	1,269.62	
		CENTRICA PLC	6,166	1.68	10,358.88	
		CHUBB PLC	1,211	0.90	1,095.95	
		CMG PLC	881	0.82	729.02	
		COMPASS GROUP PLC	3,670	3.24	11,890.80	
		CORUS GROUP PLC	2,199	0.27	604.72	
		DAILY MAIL&GENERAL TST-A NV	200	5.84	1,168.00	
		DE LA RUE PLC	312	2.95	921.96	
		DIAGEO PLC	5,386	6.61	35,601.46	
		DIXONS GROUP PLC	2,800	1.61	4,529.00	
		ELECTROCOMPONENTS PLC	635	3.10	1,968.50	
		EMI GROUP PLC	1,153	1.52	1,752.56	
		EXEL PLC	435	7.05	3,068.92	
		FIRSTGROUP PLC	691	2.26	1,563.38	
		FKI PLC	841	0.89	748.49	
		GKN PLC	1,291	2.18	2,817.60	
		GLAXOSMITHKLINE PLC	9,979	11.68	116,554.72	
		GRANADA PLC	4,048	0.85	3,440.80	
		GREAT UNIVERSAL STORES PLC	1,782	5.60	9,979.20	
		HAMMERSON PLC	411	4.85	1,993.35	
		HANSON PLC	1,075	2.89	3,106.75	
		HAYS PLC	2,314	0.91	2,117.31	
		HBOS PLC	6,171	6.30	38,908.15	
		HILTON GROUP PLC	2,200	1.67	3,685.00	
		HSBC HOLDINGS PLC	15,260	7.15	109,185.30	
		IMPERIAL CHEMICAL INDS PLC	1,909	2.40	4,595.91	
		IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	1,191	9.77	11,636.07	
		INTERNATIONAL POWER PLC	1,634	1.02	1,666.68	
		INVENSYS PLC	5,116	0.56	2,903.33	
		JOHNSON MATTHEY PLC	324	7.85	2,543.40	
		KELDA GROUP PLC	630	3.89	2,450.70	
		KINGFISHER PLC	3,205	2.09	6,714.47	
		LAND SECURITIES GROUP	670	7.71	5,165.70	
		LEGAL & GENERAL GROUP PLC	10,694	1.01	10,881.14	
		LLOYDS TSB GROUP PLC	9,033	4.73	42,726.09	
		LOGICA PLC	646	1.70	1,103.04	
		MAN GROUP PLC	424	8.49	3,599.76	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		MARKS & SPENCER GROUP PLC	3,887	3.26	12,700.77	
		MISYS PLC	844	2.00	1,688.00	
		NATIONAL GRID TRANSCO PLC	5,100	4.20	21,432.75	
		NEXT PLC	520	7.76	4,035.20	
		P & O PRINCESS CRUISES PLC	1,013	4.64	4,700.32	
		PEARSON PLC	1,329	6.49	8,631.85	
		PENINSULAR & ORIENTAL STEAM	993	1.79	1,782.43	
		PILKINGTON PLC	1,797	0.61	1,096.17	
		PROVIDENT FINANCIAL PLC	363	6.27	2,277.82	
		PRUDENTIAL PLC	3,158	4.66	14,716.28	
		RANK GROUP PLC	862	2.71	2,336.02	
		RECKITT BENCKISER PLC	882	11.47	10,116.54	
		REED INTERNATIONAL PLC	2,208	5.27	11,636.16	
		RENTOKIL INITIAL PLC	3,057	2.03	6,220.99	
		REUTERS GROUP PLC	2,328	2.01	4,690.92	
		REXAM	624	4.13	2,577.12	
		RIO TINTO PLC - REG	1,660	12.13	20,135.80	
		RMC GROUP PLC	386	3.96	1,528.56	
		ROLLS-ROYCE PLC	1,000	1.21	1,215.00	
		ROYAL & SUN ALLIANCE INS GRP	1,680	1.28	2,154.60	
		ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	4,417	14.65	64,709.05	
		SABMILLER PLC	900	4.30	3,876.75	
		SAFEWAY PLC	1,722	2.06	3,547.32	
		SAGE GROUP PLC (THE)	1,854	1.38	2,558.52	
		SAINSBURY (J) PLC	3,032	2.75	8,360.74	
		SCHRODERS PLC	438	5.00	2,190.00	
		SCOTTISH & NEWCASTLE PLC	1,254	4.51	5,661.81	
		SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	1,405	6.30	8,851.50	
		SCOTTISH POWER PLC	3,209	3.47	11,151.27	
		SEVERN TRENT PLC	462	6.38	2,947.56	
		SHELL TRANSPRT&TRADNG CO PLC	15,466	3.96	61,361.35	
		SIGNET GROUP PLC	1,000	0.74	740.00	
		SIX CONTINENTS PLC	1,512	5.30	8,021.16	
		SLOUGH ESTATES PLC	605	3.35	2,029.77	
		SMITH & NEPHEW PLC	1,343	3.74	5,022.82	
		SMITHS GROUP PLC	810	7.15	5,795.55	
		SSL INTERNATIONAL PLC	306	2.79	853.74	
		STAGECOACH HOLDINGS PLC	2,136	0.28	608.76	
		TATE & LYLE PLC	704	3.32	2,337.28	
		TAYLOR WOODROW PLC	910	1.70	1,547.00	
		TESCO PLC	10,995	1.93	21,275.32	
		UNILEVER PLC	4,720	5.69	26,856.80	
		UNITED UTILITIES PLC	808	6.17	4,989.40	
		VODAFONE GROUP PLC	111,338	1.14	127,482.01	
		WHITBREAD PLC	473	5.55	2,625.15	
		WIMPEY (GEORGE) PLC	612	2.38	1,456.56	
		WOLSELEY PLC	841	5.25	4,415.25	
		WPP GROUP PLC	1,695	4.83	8,186.85	
	計	銘柄数 :	118		1,451,927.85	
					(283,387,277)	
		組入時価比率 :	11.1%		12.0%	
	スイスフラン	ABB LTD	1,932	4.33	8,365.56	
		ADECCO SA-REG	277	55.50	15,373.50	
		CENTERPULSE-REG	20	228.00	4,560.00	
		CIBA SPECIALTY CHEMICALS-REG	106	101.00	10,706.00	
		CIE FINANC RICHEMONT-UTS A	839	26.05	21,855.95	
		CLARIANT AG-REG	100	25.00	2,500.00	
		CREDIT SUISSE GROUP-REG	1,719	30.35	52,171.65	
		GIVAUDAN-REG	13	620.00	8,060.00	
		HOLCIM LTD-B	40	274.00	10,960.00	
		KUDELSKI SA-BEARER	78	24.15	1,883.70	
		LOGITECH INTERNATIONAL-REG	64	47.95	3,068.80	
		LONZA AG-REG	110	85.40	9,394.00	
		NESTLE SA-REGISTERED	643	297.50	191,292.50	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		NOVARTIS AG-REG SHS	4,458	53.50	238,503.00	
		ROCHE HOLDING AG-BEARER	161	174.25	28,054.25	
		ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	1,103	102.50	113,057.50	
		SERONO SA-B	5	811.00	4,055.00	
		SGS SOC GEN SURVEILLANCE-R	15	400.00	6,000.00	
		SULZER AG-REG	10	197.50	1,975.00	
		SWISS RE-REG	443	101.00	44,743.00	
		SWISSCOM AG-REG	77	414.50	31,916.50	
		SYNGENTA AG-REGISTERED	165	82.50	13,612.50	
		SYNTHES-STRATEC INC	7	864.00	6,048.00	
		THE SWATCH GROUP AG-REG	210	24.70	5,187.00	
		THE SWAYCH GROUP AG-B	50	123.25	6,162.50	
		UBS AG REG	2,004	70.45	141,181.80	
		UNAXIS HOLDING AG-R	19	100.00	1,900.00	
		ZURICH FINANCIAL SERVICES	216	142.25	30,726.00	
	計	銘柄数 :	28		1,013,313.71	
					(85,807,404)	
		組入時価比率 :	3.4%		3.6%	
	スウェーデン クローネ	ASSA ABLOY AB-B	600	105.50	63,300.00	
		ATLAS COPCO AB-A SHS	200	186.00	37,200.00	
		ELECTROLUX AB-SER B	700	154.00	107,800.00	
		ERICSSON LM TEL,SEK1 SER B	21,478	8.45	181,489.10	
		GAMBRO AB-A SHS	400	49.60	19,840.00	
		HENNES & MAURITZ	1,006	182.50	183,595.00	
		MODERN TIMES GROUP	97	96.00	9,312.00	
		NORDEA AB	4,467	41.20	184,040.40	
		OM AB	100	51.00	5,100.00	
		SANDVIK AB	400	211.00	84,400.00	
		SECURITAS AB-B SHS	579	120.00	69,480.00	
		SKANDIA FORSAKRINGS AB	1,505	23.70	35,668.50	
		SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,148	80.00	91,840.00	
		SKANSKA AB-B SHS	664	52.00	34,528.00	
		SKF AB-B SHS	117	245.50	28,723.50	
		SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	412	302.50	124,630.00	
		SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	986	123.00	121,278.00	
		SWEDISH MATCH AB	1,000	65.50	65,500.00	
		TELE2 AB-B SHS	212	225.00	47,700.00	
		TELIA AB	2,200	35.50	78,100.00	
		VOLVO AB-A SHS	200	152.50	30,500.00	
		VOLVO AB-B SHS	464	159.50	74,008.00	
		WM-DATA AB-B SHS	581	10.50	6,100.50	
	計	銘柄数 :	23		1,684,133.00	
					(23,139,987)	
		組入時価比率 :	0.9%		1.0%	
	ノルウェーク ローネ	DNB HOLDING ASA	1,967	33.80	66,484.60	
		FRONTLINE LTD	120	57.50	6,900.00	
		NORSK HYDRO ASA	319	292.50	93,307.50	
		NORSKE SKOGINDUSTRIER ASA	174	102.00	17,748.00	
		ORKLA ASA	553	119.00	65,807.00	
		STATOIL ASA	714	55.00	39,270.00	
		STOREBRAND ASA	400	27.90	11,160.00	
		TELENOR ASA	791	29.10	23,018.10	
		TOMRA SYSTEMS ASA	644	55.50	35,742.00	
	計	銘柄数 :	9		359,437.20	
					(6,139,187)	
		組入時価比率 :	0.2%		0.3%	
	デンマークク ローネ	CARLSBERG AS-B	47	286.00	13,442.00	
		D/S 1912 -B-	1	41,500.00	41,500.00	
		D/S SVENDBORG-B	2	53,100.00	106,200.00	
		DANISCO A/S	85	236.00	20,060.00	
		DANSKE BANK A/S	1,155	117.00	135,135.00	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		GROUP 4 FALCK A/S	132	162.00	21,384.00	
		H LUNDBECK A/S	115	194.00	22,310.00	
		ISS A/S	18	268.00	4,824.00	
		NOVO NORDISK A/S-B	524	219.50	115,018.00	
		NOVOZYMES A/S-B SHARES	110	143.00	15,730.00	
		TDC A/S	357	176.50	63,010.50	
		VESTAS WIND SYSTEMS A/S	180	73.50	13,230.00	
		WILLIAM DEMANT HOLDING	109	152.00	16,568.00	
	計	銘柄数 :	13		588,411.50	
					(9,885,313)	
		組入時価比率 :	0.4%		0.4%	
	オーストラリアドル	ALUMINA LIMITED	2,474	4.70	11,627.80	
		AMCOR LIMITED	975	8.14	7,936.50	
		AMP LIMITED	1,955	12.27	23,987.85	
		ARISTOCRAT LEISURE LIMITED	687	5.28	3,627.36	
		AUST AND NZ BANKING GROUP LT	2,375	17.90	42,512.50	
		AUSTRALIAN GAS LIGHT COMPANY	564	10.24	5,775.36	
		BHP BILLITON LTD	6,056	10.05	60,862.80	
		BHP STEEL LTD	4,211	3.15	13,264.65	
		BRAMBLES INDUSTRIES LTD	2,006	4.45	8,926.70	
		COCA-COLA AMATIL LIMITED	1,570	5.43	8,525.10	
		COLES MYER LIMITED	2,476	6.35	15,722.60	
		COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	2,127	27.21	57,875.67	
		COMPUTERSHARE LIMITED	790	1.96	1,548.40	
		CSL LIMITED	219	20.00	4,380.00	
		CSR LIMITED	1,429	6.17	8,816.93	
		FOSTER'S BREWING GROUP LTD	4,300	4.56	19,608.00	
		GENERAL PROPERTY TRUST	2,761	2.86	7,896.46	
		INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	2,085	2.57	5,358.45	
		LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	433	9.25	4,005.25	
		LEND LEASE CORP LIMITED	972	9.82	9,545.04	
		MACQUARIE BANK LIMITED	150	23.12	3,468.00	
		MACQUARIE INFRASTRUCTURE GRP	1,000	3.16	3,160.00	
		MAYNE NICKLESS LIMITED	1,340	3.06	4,100.40	
		NATIONAL AUSTRALIA BANK & LTD	2,589	33.00	85,437.00	
		NEWS CORP LTD- PREF ORDINARY	3,633	10.16	36,911.28	
		NEWS CORPORATION LIMITED	3,102	12.10	37,534.20	
		QBE INSURANCE GROUP LIMITED	661	7.95	5,254.95	
		RIO TINTO LIMITED	543	34.06	18,494.58	
		SANTOS LIMITED	891	6.07	5,408.37	
		SOUTHCORP LIMITED	1,651	4.57	7,545.07	
		STOCKLAND	1,192	4.87	5,805.04	
		SUNCORP-METWAY LIMITED	470	11.18	5,254.60	
		TABCORP HOLDINGS LIMITED	544	10.45	5,684.80	
		TELSTRA CORPORATION LTD	7,654	4.54	34,749.16	
		WESFARMERS LIMITED	689	27.37	18,857.93	
		WESTFIELD HOLDINGS LIMITED	343	13.57	4,654.51	
		WESTFIELD TRUST	3,729	3.46	12,902.34	
		WESTFIELD TRUST NEW UNITS	137	3.40	465.80	
		WESTPAC BANKING CORPORATION	2,796	13.95	39,004.20	
		WMC RESOURCES LTD	2,474	4.26	10,539.24	
		WOODSIDE PETROLEUM LTD	356	12.44	4,428.64	
		WOOLWORTHS LIMITED	2,078	11.30	23,481.40	
	計	銘柄数 :	42		694,944.93	
					(48,291,723)	
		組入時価比率 :	1.9%		2.0%	
	ニュージーランドドル	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	5,814	4.60	26,744.40	
	計	銘柄数 :	1		26,744.40	
					(1,662,966)	
		組入時価比率 :	0.1%		0.1%	
	香港ドル	BANK OF EAST ASIA	2,000	13.70	27,400.00	
		BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,000	8.25	16,500.00	

種類	通貨	銘柄	株数	評価額単価	評価額金額	備考
		CATHAY PACIFIC AIRWAYS	5,000	11.30	56,500.00	
		CHEUNG KONG LTD	2,000	54.75	109,500.00	
		CLP HOLDINGS LIMITED	3,700	31.40	116,180.00	
		ESPRIT HOLDINGS LTD	2,000	14.00	28,000.00	
		HANG SENG BANK	2,100	85.00	178,500.00	
		HENDERSON LAND DEVELOPMENT	2,000	25.75	51,500.00	
		HONG KONG & CHINA GAS	7,480	10.35	77,418.00	
		HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	1,000	30.50	30,500.00	
		HUTCHISON WHAMPOA	4,000	51.25	205,000.00	
		HYSAN DEVELOPMENT CO	2,000	6.05	12,100.00	
		JOHNSON ELECTRIC HLDGS	5,500	8.80	48,400.00	
		LI & FUNG LTD	4,000	8.35	33,400.00	
		NEW WORLD DEVELOPMENT	5,000	4.45	22,250.00	
		PACIFIC CENTURY CYBERWORKS	19,000	1.29	24,510.00	
		SHANGRI-LA ASIA LTD.	4,000	5.15	20,600.00	
		SINO LAND CO	6,000	2.72	16,350.00	
		SUN HUNG KAI PROPERTIES	3,000	50.25	150,750.00	
		SWIRE PACIFIC LTD 'A'	2,000	31.00	62,000.00	
		TELEVISION BROADCASTS LTD	1,000	24.95	24,950.00	
		THE WHARF HOLDINGS	3,000	16.35	49,050.00	
	計	銘柄数 :	22		1,361,358.00	
					(21,536,683)	
		組入時価比率 :	0.8%		0.9%	
	シンガポールドル	CAPITALAND LIMITED	3,000	1.15	3,450.00	
		CHARTERED SEMICONDUCTOR	2,000	0.91	1,830.00	
		CITY DEVELOPMENTS	2,000	4.38	8,760.00	
		DBS GROUP HLDG LTD	2,000	10.70	21,400.00	
		HAW PAR CORP LTD	81	3.56	288.36	
		KEPPEL CORP	1,000	3.78	3,780.00	
		OVERSEA-CHINESE BANKING-ORD	2,000	9.55	19,100.00	
		SEBACORP INDUSTRIES LIMITED	2,000	0.81	1,620.00	
		SINGAPORE AIRLINES LTD	2,000	10.90	21,800.00	
		SINGAPORE PRESS HOLDINGS	1,000	19.70	19,700.00	
		SINGAPORE TECH ENGINEERING	4,000	1.55	6,200.00	
		SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	11,000	1.25	13,750.00	
		UNITED OVERSEAS BANK	2,000	11.60	23,200.00	
	計	銘柄数 :	13		144,878.36	
					(10,135,690)	
		組入時価比率 :	0.4%		0.4%	
	合計				2,368,226,016	
					(2,368,226,016)	

(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、外貨建保有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

種類	通貨	銘柄	銘柄数比率	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	ユーロ	FIAT SPA-WTS		84	24.78	
	計	銘柄数 :	1	84	24.78	
					(3,091)	
		組入時価比率 :	0.0%		100.0%	
	合計				3,091	
					(3,091)	

(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、外貨建保有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 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記事項(デリバティブ取引等関係注記)」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)

科 目	対象年月日	(平成13年12月10日現在)	(平成14年12月10日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		5,409,801	19,078,275
コール・ローン		24,317,884	102,911,417
国債証券		5,430,096,108	6,236,440,650
派生商品評価勘定		8,106,678	5,075,525
未収入金		642,039,022	-
未収利息		70,448,234	77,249,470
前払費用		47,391,034	63,529,786
差入委託証拠金		-	4,502,184
流動資産合計		6,227,808,761	6,508,787,307
資産合計		6,227,808,761	6,508,787,307
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		5,642,645	6,400,540
未払金		639,585,194	-
未払解約金		6,739,147	764,786
流動負債合計		651,966,986	7,165,326
負債合計		651,966,986	7,165,326
純資産の部			
元本			
元本		5,247,834,944	5,337,040,414
剰余金			
剰余金		328,006,831	1,164,581,567
剰余金合計		328,006,831	1,164,581,567
純資産合計		5,575,841,775	6,501,621,981
負債・純資産合計		6,227,808,761	6,508,787,307

重要な会計方針

対象年月日 項目	〔 自 平成13年 3月16日 至 平成13年12月10日 〕	〔 自 平成13年12月11日 至 平成14年12月10日 〕
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。            証券取引所に上場されている有価証券            証券取引所に上場されている有価証券は原則として、証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる最終相場)で評価しております。            計算期間末日に当該証券取引所の最終相場がない場合には、当該証券取引所における直近の日の最終相場で評価していますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該証券取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。            証券取引所に上場されていない有価証券</p>	<p>国債証券            同左            証券取引所に上場されている有価証券            同左            証券取引所に上場されていない有価証券</p>

対象年月日 項目	〔 自 平成13年 3月16日 至 平成13年12月10日 〕	〔 自 平成13年12月11日 至 平成14年12月10日 〕
	<p>証券取引所に上場されていない有価証券は、原則として、日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融機関の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>証券取引所に上場されていない有価証券は、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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。</p>	<p>為替予約取引 同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表並びに運用報告書に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び61条に基づき処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 同左</p>

注記事項

(貸借対照表関係)

(平成13年12月10日現在)	(平成14年12月10日現在)
1. 本有価証券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. 本有価証券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
2,000,000,000 円	5,247,834,944 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
5,260,906,540 円	5,732,557,811 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
2,013,071,596 円	5,643,352,341 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 海外債券マーケット・パフォーマー	PRU 海外債券マーケット・パフォーマー
5,175,078,451円	5,229,965,101円
PRU グッドライフ2010	PRU グッドライフ2010
52,754,045円	81,056,474円
PRU グッドライフ2020	PRU グッドライフ2020
9,868,814円	9,966,101円
PRU グッドライフ2030	PRU グッドライフ2030
5,683,276円	5,446,704円
PRU グッドライフ2040	PRU グッドライフ2040
4,205,090円	1,849,204円
PRU グッドライフ2010(年金)	PRU グッドライフ2010(年金)
96,366円	1,664,409円
PRU グッドライフ2020(年金)	PRU グッドライフ2020(年金)
73,597円	2,313,294円
PRU グッドライフ2030(年金)	PRU グッドライフ2030(年金)
49,929円	601,130円
PRU グッドライフ2040(年金)	PRU グッドライフ2040(年金)
25,376円	142,631円
	ワールド・ミックス40(バランス指向)
	2,672,088円
	ワールド・ミックス60(成長指向)
	854,645円
	ワールド・ミックス80(積極指向)
	508,633円

(平成13年12月10日現在)	(平成14年12月10日現在)
計 5,247,834,944円	計 5,337,040,414円
2. 同ファンドの計算期間は、開示対象ファンドの計算期間とは異なるため、当期損失の金額を表示していません。	2. 同ファンドの計算期間は、開示対象ファンドの計算期間とは異なるため、当期損失の金額を表示していません。

(有価証券関係)

(平成13年12月10日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	5,430,096,108	102,861,167
合計	5,430,096,108	102,861,167

(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(平成13年12月6日)から本有価証券報告書の開示対象ファンドの期末日(平成13年12月10日)までの期間に対応する金額であります。

(平成14年12月10日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	6,236,440,650	35,426,706
合計	6,236,440,650	35,426,706

(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(平成14年12月6日)から本有価証券報告書の開示対象ファンドの期末日(平成14年12月10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関係)

取引の状況に関する事項

〔自平成13年3月16日 至平成13年12月10日〕	〔自平成13年12月11日 至平成14年12月10日〕
1. 取引の内容 当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	1. 取引の内容 同左
2. 取引に対する取組みと利用目的 外貨建証券の売買代金、償還金、利金等についての為替変動リスクを回避するために、為替予約取引を行うことができるものとします。	2. 取引に対する取組みと利用目的 同左
3. 取引に係るリスクの内容 為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。	3. 取引に係るリスクの内容 同左
4. 取引に係るリスク管理体制 組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。 なお、リスク管理はデリバティブだけに限定しては行っておりません。デリバティブと現物資産等を統合し、各投資信託財産全体でのリスク管理を、行っております。	4. 取引に係るリスク管理体制 同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 同左

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)

区分	種類	(平成13年12月10日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
			1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	131,065,226	-	135,322,865	4,257,639
	カナダ・ドル	11,385,350	-	11,639,344	253,994
	ユーロ	76,716,684	-	79,767,786	3,051,102
	イギリス・ポンド	9,696,340	-	10,016,694	320,354
	スイス・フラン	33,868,589	-	34,092,178	223,589
	売建				
	アメリカ・ドル	210,312,534	-	215,005,880	4,693,346
	イギリス・ポンド	24,899,804	-	25,518,713	618,909
	オーストラリア・ドル	8,877,815	-	9,208,205	330,390
合計	506,822,342	-	520,571,665	2,464,033	

(単位:円)

区分	種類	(平成14年12月10日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
			1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	215,061,462	-	212,771,697	2,289,765
	カナダ・ドル	79,183,608	-	81,740,944	2,557,336
	イギリス・ポンド	17,929,652	-	17,888,334	41,318
	スイス・フラン	59,535,536	-	60,767,850	1,232,314
	デンマーク・クローネ	34,103,113	-	35,038,048	934,935
	オーストラリア・ドル	10,534,679	-	10,497,984	36,695
	売建				
	アメリカ・ドル	201,286,588	-	204,722,815	3,436,227
	ユーロ	95,648,423	-	95,894,018	245,595
合計	713,283,061	-	719,321,690	1,325,015	

(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.契約額等および時価の合計欄の金額は各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

(平成13年12月10日現在)	(平成14年12月10日現在)
本有価証券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 1.0625 円 (1万口当たり純資産額 10,625 円) なお、純資産額は、投資信託財産純資産額を用いて おります。	本有価証券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 1.2182 円 (1万口当たり純資産額 12,182 円) なお、純資産額は、投資信託財産純資産額を用いて おります。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	銘柄数比率	券面総額	評価額	備考
国債証券	ドル	US TREASURY N/B		917,000.00	937,919.04	
		US TREASURY N/B		1,833,000.00	1,864,576.27	
		US TREASURY N/B		718,000.00	850,549.53	
		US TREASURY N/B		1,908,000.00	2,329,697.81	
		US TREASURY N/B		199,000.00	228,570.15	
		US TREASURY N/B		1,380,000.00	2,048,437.50	
		US TREASURY N/B		507,000.00	768,184.20	
		US TREASURY N/B		2,200,000.00	2,537,218.75	
		US TREASURY N/B		2,369,000.00	3,421,724.37	
		US TREASURY N/B		176,000.00	256,410.00	
		US TREASURY N/B		1,093,000.00	1,279,834.68	
		US TREASURY N/B		352,000.00	361,185.00	
計		銘柄数 :	12	13,652,000.00	16,884,307.30	
					(2,083,523,520)	
		組入時価比率 :	32.0%		33.4%	
カナダドル		CANADA-GOV'T		440,000.00	487,564.00	
		CANADA-GOV'T		653,000.00	869,012.40	
		CANADA-GOV'T		234,000.00	338,698.62	
		計	銘柄数 :	3	1,327,000.00	1,695,275.02
					(133,858,915)	
		組入時価比率 :	2.1%		2.1%	
ユーロ		BELGIUM KINGDOM		1,570,000.00	2,005,518.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ES		658,000.00	728,603.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHL		1,377,000.00	1,607,096.70	
		BUONI POLIENNALI		4,357,000.00	4,665,911.30	
		BUONI POLIENNALI DEL		8,700,000.00	10,217,280.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES		2,135,000.00	2,304,946.00	
		DEUTSCHLAND REPUBLIC		2,890,000.00	3,112,819.00	
		FRANCE O.A.T.		1,980,000.00	2,875,950.00	
		計	銘柄数 :	8	23,667,000.00	27,518,124.40
					(3,433,161,200)	
		組入時価比率 :	52.8%		55.1%	
ポンド		TSY		233,000.00	222,678.10	
		TSY		206,000.00	250,743.20	
		TSY		111,000.00	123,942.60	
		TSY		704,000.00	824,102.40	
		TSY		535,000.00	710,640.50	
		計	銘柄数 :	5	1,789,000.00	2,132,106.80
					(416,144,605)	
		組入時価比率 :	6.4%		6.7%	
スウェーデン クローネ		SWEDISH GOVERNMENT		4,825,000.00	5,526,555.00	
		計	銘柄数 :	1	4,825,000.00	5,526,555.00
					(75,934,865)	
		組入時価比率 :	1.2%		1.2%	
デンマーク クローネ		KINGDOM OF DENMARK		3,800,000.00	4,199,950.00	
		計	銘柄数 :	1	3,800,000.00	4,199,950.00

種類	通貨	銘柄	銘柄数比率	券面総額	評価額	備考
					(70,559,160)	
		組入時価比率：	1.1%		1.1%	
	オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT		34,000.00	41,155.98	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT		277,000.00	293,545.21	
	計	銘柄数：	2	311,000.00	334,701.19	
					(23,258,385)	
		組入時価比率：	0.4%		0.4%	
	小計				6,236,440,650	
					(6,236,440,650)	
	合計				6,236,440,650	
					(6,236,440,650)	

(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 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記事項(デリバティブ取引等関係注記)」に記載しております。

## 2. ファンドの現況

(1) 純資産額計算書(平成15年1月31日現在)

資産総額	139,897,512 円
負債総額	271,000 円
純資産総額 ( - )	139,626,512 円
発行済数量	157,473,463 口
1口当たり純資産額 ( / )	0.8867 円

(参考情報)

PRU 国内株式マザーファンド

資産総額	1,320,792,739 円
負債総額	12,089,636 円
純資産総額 ( - )	1,308,703,103 円
発行済数量	1,916,706,548 口
1口当たり純資産額 ( / )	0.6828 円

PRU 国内債券マザーファンド

資産総額	966,580,444 円
負債総額	60,680,101 円
純資産総額 ( - )	905,900,343 円
発行済数量	866,740,439 口
1口当たり純資産額 ( / )	1.0452 円

PRU 海外株式マザーファンド

資産総額	1,391,772,560 円
負債総額	20,554,725 円
純資産総額 ( - )	1,371,217,835 円
発行済数量	1,928,286,306 口
1口当たり純資産額 ( / )	0.7111 円

## PRU 海外債券マザーファンド

資産総額	4,847,219,126 円
負債総額	629,049,065 円
純資産総額 ( - )	4,218,170,061 円
発行済数量	3,369,527,532 口
1口当たり純資産額 ( / )	1.2519 円

## (2) 投資有価証券の主要銘柄 (平成 15 年 1 月 31 日現在)

## 主要銘柄の明細

(単位: 円)

地域	種類	銘柄	額面金額	簿価単価	簿価金額	時価単価	時価金額	投資比率 (%)
日本	投資信託 受益証券	PRU国内株式 マザーファンド	50,380,299	7,116.00	35,855,323	6,828.00	34,399,668	24.64
日本	投資信託 受益証券	PRU国内債券 マザーファンド	63,371,554	10,368.00	65,703,628	10,452.00	66,235,948	47.44
日本	投資信託 受益証券	PRU海外株式 マザーファンド	38,283,666	7,655.00	29,309,068	7,111.00	27,223,514	19.50
日本	投資信託 受益証券	PRU海外債券 マザーファンド	9,240,786	12,180.00	11,255,278	12,519.00	11,568,539	8.28

(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、1万口当たりの値段です。

## (参考情報)

## PRU 国内株式マザーファンド

(単位: 円)

	地域	業種	銘柄名	通貨	数量 (株)	簿価 単価	簿価 金額	時価 単価	時価 金額	投資 比率 (%)
1	日本	通信業	エヌ・ティ・ティ・ ドコモ	日本円	247	242,038.68	59,783,555	231,000.00	57,057,000	4.35
2	日本	輸送用機器	トヨタ自動車	日本円	17,900	3,217.44	57,592,277	2,855.00	51,104,500	3.90
3	日本	電気機器	ソニー	日本円	4,600	5,325.21	24,496,003	4,710.00	21,666,000	1.65
4	日本	輸送用機器	日産自動車	日本円	22,000	947.00	20,834,000	913.00	20,086,000	1.53
5	日本	医薬品	武田薬品工業	日本円	4,400	5,041.13	22,180,976	4,560.00	20,064,000	1.53
6	日本	輸送用機器	本田技研工業	日本円	4,800	4,566.21	21,917,821	3,990.00	19,152,000	1.46
7	日本	通信業	日本電信電話	日本円	44	468,701.47	20,622,865	402,000.00	17,688,000	1.35
8	日本	銀行業	三菱東京フィナン シャル・グループ	日本円	28	699,000.00	19,572,000	626,000.00	17,528,000	1.33
9	日本	電気機器	キヤノン	日本円	4,000	4,760.00	19,040,000	4,190.00	16,760,000	1.28
10	日本	電気・ガス業	東京電力	日本円	6,700	2,017.30	13,515,945	2,240.00	15,008,000	1.14
11	日本	証券・商品 先物取引業	野村ホール ディングス	日本円	10,000	1,443.38	14,433,881	1,441.00	14,410,000	1.10
12	日本	電気機器	松下電器産業	日本円	12,000	1,227.00	14,724,000	1,145.00	13,740,000	1.04
13	日本	小売業	セブン・イレブン ・ジャパン	日本円	4,000	3,410.00	13,640,000	3,070.00	12,280,000	0.93
14	日本	陸運業	東日本旅客鉄道	日本円	20	558,958.45	11,179,169	551,000.00	11,020,000	0.84
15	日本	化学	富士写真フイルム	日本円	3,000	3,825.79	11,477,371	3,610.00	10,830,000	0.82
16	日本	銀行業	三井住友フィナン シャルグループ	日本円	28	406,000.00	11,368,000	368,000.00	10,304,000	0.78
17	日本	電気・ガス業	関西電力	日本円	4,800	1,676.23	8,045,932	1,744.00	8,371,200	0.63
18	日本	化学	信越化学工業	日本円	2,100	4,095.16	8,599,837	3,920.00	8,232,000	0.62
19	日本	電気機器	ローム	日本円	600	16,620.00	9,972,000	13,670.00	8,202,000	0.62
20	日本	電気機器	日立製作所	日本円	16,000	494.00	7,904,000	500.00	8,000,000	0.61
21	日本	陸運業	東海旅客鉄道	日本円	11	747,000.00	8,217,000	720,000.00	7,920,000	0.60
22	日本	輸送用機器	デンソー	日本円	4,200	1,969.00	8,269,800	1,849.00	7,765,800	0.59

	地域	業種	銘柄名	通貨	数量 (株)	簿価 単価	簿価 金額	時価 単価	時価 金額	投資 比率 (%)
23	日本	保険業	ミアホールディングス	日本円	9	917,000.00	8,253,000	853,000.00	7,677,000	0.58
24	日本	電気・ガス業	中部電力	日本円	3,600	2,040.00	7,344,000	2,100.00	7,560,000	0.57
25	日本	化学	花王	日本円	3,000	2,635.00	7,905,000	2,445.00	7,335,000	0.56
26	日本	電気機器	リコー	日本円	4,000	2,130.00	8,520,000	1,821.00	7,284,000	0.55
27	日本	通信業	KDDI	日本円	20	406,000.00	8,120,000	352,000.00	7,040,000	0.53
28	日本	その他製品	任天堂	日本円	700	12,890.00	9,023,000	9,440.00	6,608,000	0.50
29	日本	小売業	イトーヨーカ堂	日本円	2,000	3,770.00	7,540,000	3,210.00	6,420,000	0.49
30	日本	卸売業	三菱商事	日本円	8,000	753.00	6,024,000	770.00	6,160,000	0.47

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

PRU 国内債券マザーファンド

(単位：円)

	地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還 期限	通貨	額面金額	簿価 単価	簿価金額	時価 単価	時価金額	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第61回利付国債(4年)	1.0	2004/7/21	日本円	40,000,000	101.54	40,617,000	101.40	40,561,200	4.47
2	日本	国債証券	第190回利付国債(10年)	2.9	2006/12/20	日本円	30,000,000	110.51	33,154,200	110.47	33,143,400	3.65
3	日本	国債証券	第193回利付国債(10年)	2.6	2007/3/20	日本円	30,000,000	109.89	32,967,000	109.84	32,953,800	3.63
4	日本	国債証券	第200回利付国債(10年)	2.0	2007/12/20	日本円	30,000,000	108.35	32,505,000	108.44	32,534,400	3.59
5	日本	国債証券	第2回利付国債(5年)	1.1	2005/3/21	日本円	30,000,000	102.29	30,687,000	102.21	30,663,900	3.38
6	日本	国債証券	第15回利付国債(5年)	0.5	2006/9/20	日本円	30,000,000	101.01	30,303,200	101.18	30,356,100	3.35
7	日本	国債証券	第64回利付国債(4年)	0.6	2005/2/21	日本円	30,000,000	101.16	30,348,000	101.13	30,339,900	3.34
8	日本	国債証券	第14回利付国債(5年)	0.4	2006/6/20	日本円	30,000,000	100.64	30,192,000	100.83	30,251,400	3.33
9	日本	特殊債券	第1回政府保証国民生活債券	1.0	2005/12/26	日本円	25,000,000	102.38	25,596,000	102.44	25,610,000	2.82
10	日本	社債券	第463回東京電力	0.85	2005/6/24	日本円	23,000,000	101.72	23,395,600	101.69	23,389,390	2.58
11	日本	国債証券	第225回利付国債(10年)	1.9	2010/12/20	日本円	20,000,000	109.12	21,824,000	110.10	22,020,400	2.43
12	日本	国債証券	第194回利付国債(10年)	2.5	2007/6/20	日本円	20,000,000	109.88	21,977,000	109.91	21,983,000	2.42
13	日本	国債証券	第219回利付国債(10年)	1.8	2010/3/22	日本円	20,000,000	108.33	21,666,000	109.12	21,825,800	2.40
14	日本	国債証券	第214回利付国債(10年)	1.8	2009/9/21	日本円	20,000,000	108.27	21,654,000	108.92	21,785,800	2.40
15	日本	社債券	第2回昭和シェル石油株式会社無担保社債	3.25	2005/11/17	日本円	20,000,000	108.01	21,602,000	107.78	21,557,600	2.37
16	日本	国債証券	第237回利付国債(10年)	1.5	2012/3/20	日本円	20,000,000	105.13	21,026,000	106.76	21,353,000	2.35
17	日本	国債証券	第234回利付国債(10年)	1.4	2011/9/20	日本円	20,000,000	104.66	20,932,000	105.99	21,198,600	2.34
18	日本	国債証券	第240回利付国債(10年)	1.3	2012/6/20	日本円	20,000,000	103.10	20,620,200	104.90	20,981,200	2.31
19	日本	特殊債券	い第597号興業債券	1.4	2004/4/27	日本円	20,000,000	101.40	20,280,000	101.34	20,268,200	2.23

	地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還期限	通貨	額面金額	簿価単価	簿価金額	時価単価	時価金額	投資比率 (%)
20	日本	社債券	第18回日石三菱株式会社無担保社債	0.7	2006/9/7	日本円	20,000,000	100.80	20,160,000	100.97	20,194,200	2.22
21	日本	特殊債券	第91回東京三菱銀行債券	0.8	2004/5/27	日本円	20,000,000	100.97	20,194,000	100.88	20,177,400	2.22
22	日本	地方債証券	第109回神奈川県公募債	1.8	2009/7/22	日本円	18,000,000	107.68	19,382,940	108.24	19,484,820	2.15
23	日本	国債証券	第27回利付国債(20年)	5.0	2014/9/22	日本円	10,000,000	142.46	14,246,000	145.14	14,514,200	1.60
24	日本	国債証券	第22回利付国債(20年)	5.3	2013/3/20	日本円	10,000,000	142.11	14,211,000	143.80	14,380,300	1.58
25	日本	社債券	第262回北陸電力株式会社社債	1.65	2011/3/25	日本円	12,000,000	106.42	12,771,120	107.28	12,873,600	1.42
26	日本	国債証券	第37回利付国債(20年)	3.1	2017/9/20	日本円	10,000,000	128.02	12,802,200	127.43	12,743,900	1.40
27	日本	特殊債券	第36回政府保証関西国際空港債券	1.3	2011/6/14	日本円	12,000,000	103.57	12,429,000	104.78	12,574,560	1.38
28	日本	国債証券	第40回利付国債(20年)	2.3	2018/9/20	日本円	10,000,000	112.43	11,243,000	116.54	11,654,100	1.28
29	日本	国債証券	第49回利付国債(20年)	2.1	2021/3/22	日本円	10,000,000	108.29	10,829,000	113.99	11,399,100	1.25
30	日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	1.9	2021/3/22	日本円	10,000,000	105.13	10,513,000	110.50	11,050,200	1.21

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

PRU 海外株式マザーファンド

(単位：円)

	地域	業種	銘柄名	通貨	数量 (株)	簿価単価	簿価金額	時価単価	時価金額	投資比率 (%)
1	アメリカ	資本財	GENERAL ELECTRIC	USD	9,000	3,144.95	28,304,583	2,684.57	24,161,197	1.76
2	アメリカ	エネルギー	EXXON MOBIL CORPORATION	USD	6,100	4,142.51	25,269,344	3,956.03	24,131,792	1.75
3	アメリカ	ソフトウェア・サービス	MICROSOFT CORP	USD	4,150	6,699.91	27,804,633	5,742.97	23,833,333	1.73
4	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー	PFIZER INC	USD	5,600	3,686.04	20,641,871	3,536.97	19,807,062	1.44
5	アメリカ	各種金融	CITIGROUP INC	USD	4,600	4,499.17	20,696,217	4,071.51	18,728,946	1.36
6	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー	JOHNSON & JOHNSON	USD	2,700	6,724.68	18,156,642	6,135.83	16,566,759	1.20
7	イギリス	エネルギー	BP PLC	GBP	20,369	816.86	16,638,635	754.86	15,375,818	1.12
8	アメリカ	小売	WAL-MART STORES INC	USD	2,600	6,460.00	16,796,020	5,663.20	14,724,342	1.07
9	アメリカ	テクノロジー製品・機器	INTL BUSINESS MACHINES CORP	USD	1,500	9,960.18	14,940,284	9,321.61	13,982,422	1.01
10	イギリス	電気通信サービス	VODAFONE GROUP PLC	GBP	61,864	238.33	14,744,600	217.08	13,429,746	0.97
11	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー	MERCK & CO INC	USD	2,050	6,993.27	14,336,209	6,489.41	13,303,301	0.97
12	イギリス	医薬品・バイオテクノロジー	GLAXOSMITHKLINE PLC	GBP	5,497	2,325.93	12,785,639	2,200.45	12,095,887	0.88

	地域	業種	銘柄名	通貨	数量 (株)	簿価 単価	簿価 金額	時価 単価	時価 金額	投資 比率 (%)
13	アメリカ	保険	AMERICAN INTERNATIONAL	USD	1,850	7,435.75	13,756,138	6,339.41	11,727,913	0.85
14	アメリカ	銀行	BANK OF AMERICA CORP	USD	1,400	8,219.44	11,507,224	8,179.92	11,451,895	0.83
15	アメリカ	テクノロジー 製品・機器	INTEL CORP	USD	5,900	2,338.25	13,795,692	1,878.60	11,083,793	0.80
16	アメリカ	家庭用品・パ ーソナル用品	PROCTER & GAMBLE	USD	1,100	10,253.27	11,278,604	10,059.72	11,065,697	0.80
17	スイス	医薬品・バイオ テクノロジー	NOVARTIS AG-REG SHS	CHF	2,488	4,756.46	11,834,077	4,417.34	10,990,356	0.80
18	イギリス	銀行	HSBC HOLDINGS PLC	GBP	8,579	1,444.62	12,393,402	1,265.01	10,852,550	0.79
19	アメリカ	テクノロジー 製品・機器	CISCO SYSTEMS INC	USD	6,500	1,716.11	11,154,776	1,651.22	10,732,952	0.78
20	アメリカ	電気通信 サービス	VERIZON COMMUNICATIONS	USD	2,400	4,753.45	11,408,293	4,425.08	10,620,212	0.77
21	オランダ	エネルギー	ROYAL DUTCH PETROLEUM	EUR	1,889	5,473.00	10,338,510	4,954.91	9,359,836	0.68
22	アメリカ	食品・飲料 ・タバコ	COCA-COLA COMPANY	USD	2,000	5,426.16	10,852,330	4,666.76	9,333,520	0.68
23	フランス	エネルギー	TOTAL FINA ELF S.A	EUR	567	16,926.48	9,597,315	16,022.26	9,084,627	0.66
24	アメリカ	電気通信 サービス	SBC COMMUNICATIONS	USD	3,000	3,166.63	9,499,892	2,839.34	8,518,027	0.62
25	スイス	食品・飲料 ・タバコ	NESTLE SA-REGISTERED	CHF	352	26,476.82	9,319,842	23,843.12	8,392,781	0.61
26	アメリカ	食品・薬品 小売	ALTRIA GROUP INC	USD	1,900	4,722.76	8,973,244	4,386.99	8,335,285	0.60
27	アメリカ	銀行	WELLS FARGO COMPANY	USD	1,500	5,538.58	8,307,874	5,517.96	8,276,951	0.60
28	フィンランド	テクノロジー 製品・機器	NOKIA	EUR	4,225	2,405.56	10,163,514	1,789.13	7,559,082	0.55
29	アメリカ	食品・飲料・ タバコ	PEPSICO INC	USD	1,610	5,149.81	8,291,201	4,606.04	7,415,731	0.54
30	アメリカ	エネルギー	CHEVRONTEXACO CORP	USD	950	8,071.58	7,668,010	7,643.00	7,260,859	0.52

(注1) 投資比率は、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) 簿価及び時価は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。

PRU 海外債券マザーファンド

(単位：円)

	地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還 期限	通貨	額面金額	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	イタリア	国債 証券	BUONI POLIENNALI	8.75	2006/7/1	EUR	5,765,000	15,081.30	869,436,945	15,247.58	879,023,044	20.83
2	ドイツ	国債 証券	DEUTSCHLAN D REPUBLIC	5.375	2010/1/4	EUR	2,090,000	13,794.87	288,312,950	14,158.37	295,910,058	7.01
3	アメリカ	国債 証券	US TREASURY	8.75	2020/5/15	USD	1,434,000	17,145.37	245,864,667	17,351.53	248,821,047	5.89
4	アメリカ	国債 証券	US TREASURY	6.625	2007/5/15	USD	1,590,000	13,638.36	216,850,051	13,752.13	218,658,948	5.18
5	イタリア	国債 証券	BUONI POLIENNALI	8.5	2004/4/1	EUR	1,552,000	13,781.98	213,896,453	13,742.02	213,276,290	5.05
6	アメリカ	国債 証券	US TREASURY	10.75	2005/8/15	USD	1,378,000	14,492.29	199,703,836	14,484.10	199,590,989	4.73

	地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還 期限	通貨	額面金額	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	時価 単価 (円)	時価金額 (円)	投資 比率 (%)
7	ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	8.0	2012/12/24	EUR	1,135,000	16,354.83	185,627,343	16,807.27	190,762,525	4.52
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY	3.0	2004/1/31	USD	1,323,000	12,100.48	160,089,351	12,106.36	160,167,166	3.79
9	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	5.5	2010/11/1	EUR	1,105,000	13,828.39	152,803,731	14,204.78	156,962,819	3.72
10	ドイツ	国債証券	BUNDESREPU B DEUTSCHL	6.25	2024/1/4	EUR	997,000	14,908.57	148,638,482	15,559.51	155,128,404	3.67
11	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T.	8.5	2023/4/25	EUR	710,000	18,565.46	131,814,815	19,371.09	137,534,753	3.26
12	イギリス	国債証券	TSY	8.5	2007/7/16	GBP	509,000	22,977.46	116,955,273	23,295.19	118,572,537	2.81
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY	6.25	2030/5/15	USD	788,000	13,775.27	108,549,170	14,073.94	110,902,664	2.62
14	イギリス	国債証券	TSY	8.0	2015/12/7	GBP	385,000	25,945.60	99,890,577	26,784.34	103,119,716	2.44
15	ギリシャ	国債証券	HELLENIC REPUBLIC	4.6	2013/5/20	EUR	743,000	12,929.18	96,063,849	13,145.22	97,668,999	2.31
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY	11.75	2014/11/15	USD	500,000	17,546.77	87,733,897	17,686.36	88,431,828	2.09
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY	5.375	2003/6/30	USD	662,000	12,181.21	80,639,624	12,110.54	80,171,822	1.90
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY	11.625	2004/11/15	USD	518,000	14,077.66	72,922,291	13,993.95	72,488,689	1.71
19	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG	5.75	2032/7/30	EUR	478,000	14,101.65	67,405,934	14,868.61	71,071,979	1.68
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY	12.5	2014/8/15	USD	367,000	17,924.29	65,782,177	18,076.99	66,342,581	1.57
21	スウェーデン	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	8.0	2007/8/15	SEK	3,485,000	1,598.99	55,725,118	1,628.74	56,761,683	1.34
22	ドイツ	国債証券	BUNDES OBL-140	4.5	2007/8/17	EUR	360,000	13,333.41	48,000,297	13,534.50	48,724,200	1.15
23	イギリス	国債証券	TSY	6.0	2028/12/7	GBP	151,000	23,717.52	35,813,459	24,731.90	37,345,172	0.88
24	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG	4.25	2007/10/31	EUR	270,000	13,338.57	36,014,144	13,412.04	36,212,521	0.85
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY	4.375	2012/8/15	USD	257,000	12,088.69	31,067,942	12,284.47	31,571,092	0.74
26	カナダ	国債証券	CANADA GOVERNMENT	8.0	2027/6/1	CAD	273,000	10,325.64	28,189,010	10,331.87	28,206,024	0.66
27	デンマーク	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	5.0	2013/11/15	DKK	1,530,000	1,805.96	27,631,203	1,833.70	28,055,686	0.66
28	カナダ	国債証券	CANADA GOVERNMENT	9.0	2004/12/1	CAD	320,000	8,627.42	27,607,760	8,537.06	27,318,595	0.64
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY	4.875	2012/2/15	USD	200,000	12,643.48	25,286,964	12,766.25	25,532,503	0.60
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY	9.25	2016/2/15	USD	126,000	17,176.60	21,642,516	17,459.42	21,998,876	0.52

(注1) 投資比率は、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) 簿価及び時価は、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

業種	投資比率 (%)
投資信託受益証券	99.86
合計	99.86

(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)

PRU 国内株式マザーファンド

	業種	投資比率 (%)
株式	水産・農林業	0.13
	鉱業	0.07
	建設業	1.67
	食料品	2.52
	繊維製品	1.03
	パルプ・紙	0.58
	化学	5.58
	医薬品	5.01
	石油・石炭製品	0.64
	ゴム製品	0.63
	ガラス・土石製品	0.88
	鉄鋼	1.09
	非鉄金属	0.78
	金属製品	0.62
	機械	2.93
	電気機器	13.25
	輸送用機器	9.59
	精密機器	1.07
	その他製品	1.80
	電気・ガス業	4.41
	陸運業	3.88
	海運業	0.36
	空運業	0.31
	倉庫・運輸関連業	0.20
	通信業	6.75
	卸売業	2.85
	小売業	4.09
	銀行業	6.55
	証券・商品先物取引業	2.02
	保険業	1.61
	その他金融業	1.82
	不動産業	0.90
サービス業	3.97	
合計	89.59	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

PRU 国内債券マザーファンド

業種	投資比率 (%)
国債証券	66.86
社債券	12.23
地方債証券	4.47

業種	投資比率 (%)
特殊債券	14.49
合計	98.05

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

#### PRU 海外株式マザーファンド

業種		投資比率 (%)
株式	エネルギー	7.25
	素材	3.71
	資本財	5.73
	商業サービス・用品	1.61
	運輸	1.14
	自動車・自動車部品	1.08
	耐久消費財・アパレル	0.99
	ホテル・レストラン・レジャー	1.03
	メディア	3.66
	小売	3.55
	食品・薬品小売	1.89
	食品・飲料・タバコ	4.33
	家庭用品・パーソナル用品	1.61
	ヘルスケア機器・サービス	2.31
	医薬品・バイオテクノロジー	9.93
	銀行	10.37
	各種金融	4.80
	保険	3.83
	不動産	0.90
	ソフトウェア・サービス	3.23
	テクノロジー製品・機器	6.62
	電気通信サービス	4.85
	公益事業	3.24
小計	87.66	
新株予約権証券	0.00	
合計	87.66	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

#### PRU 海外債券マザーファンド

業種	投資比率 (%)
国債証券	97.23
合計	97.23

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

#### (3) 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### (4) その他投資資産の主要なもの (平成 15 年 1 月 31 日現在)

#### (参考情報)

#### PRU 国内株式マザーファンド

種類	地域	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	日本	TOPIX 2003年3月	買建	14	118,848,800	114,380,000	8.73

(注1) 投資比率は、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) 時価については、原則として当該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または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日にもっと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います。

## PRU 海外株式マザーファンド

種類	地域	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	シカゴ	S&P500 EMINI FUTURE 2003年3月	買建	11	58,291,344	55,001,100	4.01
株価指数先物取引	シカゴ	S&P500 FUTURE 2003年3月	買建	2	53,346,305	50,001,000	3.65
株価指数先物取引	ロンドン	MSCI PAN EURO FUTURE 2003年3月	買建	10	19,211,256	17,192,682	1.25

(注1) 投資比率は、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) 時価については、銀行等が計算日の対顧客先物相場を基準として計算し、取引証券会社から入手した価額で評価しております。

(注3) 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。



# PRU グッドライフ 2020

## 目論見書

(訂正事項分)

平成 15 年 9 月 8 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・インク

1. この目論見書により行うPRUグッドライフ2020の受益証券の募集については、委託会社は、証券取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を平成14年12月13日に関東財務局長に提出しており、平成14年12月29日にその届出の効力が生じております。また、同法第7条の規定により有価証券届出書の訂正届出書を平成15年3月3日、平成15年3月10日および平成15年9月8日に関東財務局長に提出しております。
2. PRUグッドライフ2020の受益証券の価額は、同ファンドに組入れられている有価証券の値動きのほか為替変動による影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資家の皆様に帰属します。したがって、このファンドは元本が保証されているものではありません。

## ・目論見書の訂正理由

「PRU グッドライフ 2020 目論見書(平成 15 年 3 月 10 日付の目論見書訂正事項分の訂正を含む。)」(以下「原目論見書」といいます。)の記載事項のうち、下記の項目について訂正すべき事項がありましたので、これを訂正するものです。

## ・訂正の内容

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。(以下同じ。)

## 第二部 ファンド情報

### 第 1 ファンドの状況

#### 2. 投資方針

(参考) マザーファンドの投資方針

#### PRU 国内株式マザーファンド

(原目論見書 15 頁)

(前略)

平成15年9月8日現在において、「PRU 国内株式マザーファンド」に投資しているファンドは以下のとおりです。

なお、この他にも、今後「PRU 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。

ファンド名	商品分類
PRU グッドライフ 2010	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2020 (当ファンド)	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2030	追加型株式投資信託・国内株式型(一般型)
PRU グッドライフ 2040	追加型株式投資信託・国内株式型(一般型)
PRU 国内株式マーケット・パフォーマー	追加型株式投資信託・国内株式型(一般型)
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私募)	追加型株式投資信託・国内株式型(一般型)
PRU グッドライフ 2010 (年金)	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2020 (年金)	追加型株式投資信託・バランス型
PRU グッドライフ 2030 (年金)	追加型株式投資信託・国内株式型(一般型)
PRU グッドライフ 2040 (年金)	追加型株式投資信託・国内株式型(一般型)
ワールド・ミックス 40 (バランス指向)	追加型株式投資信託・バランス型
ワールド・ミックス 60 (成長指向)	追加型株式投資信託・国内株式型(一般型)
ワールド・ミックス 80 (積極指向)	追加型株式投資信託・国内株式型(一般型)

#### 4. 手数料等及び税金

(5) 課税上の取扱い

(原目論見書 21 頁)

(前略)

b. 個人、法人別の課税の取扱いについて

<個人の受益者に対する課税>

平成 15 年 12 月 31 日まで

個人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、20% (所得税 15% および地方税 5%) の税

率による源泉分離課税が行われます。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金は課税されません。

平成 16 年 1 月 1 日から平成 20 年 3 月 31 日まで

・収益分配金に対する課税

個人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金について、10%（所得税 7%および地方税 3%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行い総合課税を選択することもできます。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金は課税されません。

・一部解約および償還時の課税

一部解約時および償還時の個別元本超過額については、10%（所得税 7%および地方税 3%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。なお、一部解約時の一部解約金または償還時の償還金が個別元本を下回っている場合には確定申告を行うことにより、当該損金額を株式等の売買益と通算（損益通算）することができます。ただし、売買益を上回る損金額の翌年への繰越しはできません。

平成 20 年 4 月 1 日以降

源泉徴収税率を 20%（所得税 15%および地方税 5%）としたうえで、上記「平成 16 年 1 月 1 日から平成 20 年 3 月 31 日まで」と同様の取扱いとなります。

< 法人の受益者に対する課税 >

平成 15 年 12 月 31 日まで

法人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、20%（所得税 15%および地方税 5%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金は課税されません。

なお、税額控除制度が適用されます。

平成 16 年 1 月 1 日から平成 20 年 3 月 31 日まで

源泉徴収税率を所得税 7%（地方税の源泉徴収はありません。）としたうえで、上記「平成 15 年 12 月 31 日まで」と同様の取扱いとなります。

平成 20 年 4 月 1 日以降

源泉徴収税率を所得税 15%（地方税の源泉徴収はありません。）としたうえで、上記「平成 15 年 12 月 31 日まで」と同様の取扱いとなります。

## 5. 運用状況

(原目論見書 22 頁)  
以下の情報に更新します。

### (1) 投資状況 (平成 15 年 7 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	46,960,778	24.85
投資信託受益証券 (PRU国内債券マザーファンド)	日本	81,384,684	43.07
投資信託受益証券 (PRU海外株式マザーファンド)	日本	38,934,452	20.61
投資信託受益証券 (PRU海外債券マザーファンド)	日本	15,164,525	8.03
現金、預金、その他資産 (負債控除後)		6,494,263	3.44
合計 (純資産総額)		188,938,702	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とおりです。

#### 投資状況

投資資産の種類		時価 (円)	投資比率 (%)
株 式	日 本	1,075,392,512	89.64
現金、預金、その他資産 (負債控除後)		124,175,404	10.36
合計 (純資産総額)		1,199,567,916	100.00

(注) 投資比率は、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。

#### その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引 (買建)	日 本	112,680,000	9.39
合計		112,680,000	9.39

(注1) 投資比率は、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) 時価については、原則として当該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または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日にもっと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います。

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とおりです。

#### 投資状況

投資資産の種類		時価 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	672,914,000	68.61
社債券	日本	126,140,940	12.86
地方債証券	日本	40,315,040	4.11
特殊債券	日本	131,729,490	13.43
	小計	971,099,470	99.01
現金、預金、その他資産 (負債控除後)		9,698,814	0.99
合計 (純資産総額)		980,798,284	100.00

(注) 投資比率は、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とおりです。

#### 投資状況

投資資産の種類		時価 (円)	投資比率 (%)
株 式	アメリカ	512,691,088	53.72
	カナダ	24,307,988	2.55
	ドイツ	24,686,422	2.59
	イタリア	14,683,836	1.54
	フランス	34,110,492	3.57
	オーストラリア	18,948,888	1.99

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
	イギリス	97,738,734	10.24
	スイス	27,875,863	2.92
	バミューダ	2,954,095	0.31
	香港	6,678,273	0.70
	シンガポール	4,978,736	0.52
	ニュージーランド	305,010	0.03
	オランダ	18,077,749	1.89
	スペイン	14,163,815	1.48
	ベルギー	3,598,201	0.38
	スウェーデン	8,107,893	0.85
	ノルウェー	1,966,899	0.21
	オーストリア	770,738	0.08
	ルクセンブルグ	351,856	0.04
	フィンランド	7,094,895	0.74
	デンマーク	3,305,290	0.35
	アイルランド	2,900,806	0.30
	ギリシャ	1,484,052	0.16
	ポルトガル	1,763,286	0.18
	ケイマン島	645,618	0.06
	小計	834,190,523	87.40
新株予約権証券	イタリア	3,245	0.00
現金、預金、その他資産（負債控除後）		120,256,664	12.60
合計（純資産総額）		954,450,432	100.00

（注1） 投資比率は、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。

#### その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	アメリカ	83,012,524	8.70
株価指数先物取引（買建）	イギリス	7,985,444	0.83
合計		90,997,968	9.53

（注1） 投資比率は、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） 時価については、銀行等が計算日の対顧客先物相場を基準として計算し、取引証券会社から入手した価額で評価しております。

（注3） 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。

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

#### 投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	1,417,543,791	29.29
	カナダ	158,148,462	3.27
	ドイツ	889,039,788	18.37
	イタリア	617,253,750	12.75
	フランス	479,150,198	9.90
	オーストラリア	28,664,435	0.59
	イギリス	345,036,872	7.13
	スペイン	319,506,775	6.60
	ベルギー	227,627,724	4.70
	スウェーデン	45,578,339	0.94
	デンマーク	33,591,565	0.69
	ギリシャ	117,695,722	2.43

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
ポーランド	18,960,221	0.39
小計	4,697,797,642	97.05
現金、預金、その他資産（負債控除後）	142,580,565	2.95
合計（純資産総額）	4,840,378,207	100.00

（注1） 投資比率は、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） 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） （平成13年12月10日）（分配落）	138,729,600 138,729,600	9,654 9,654
平成14年7月末	141,726,450	9,195
平成14年8月末	141,835,912	9,154
平成14年9月末	140,184,431	9,033
平成14年10月末	140,538,578	9,038
平成14年11月末	143,240,466	9,197
第2計算期間末（分配付） （平成14年12月10日）（分配落）	141,653,385 141,653,385	9,054 9,054
平成14年12月末	140,233,341	8,952
平成15年1月末	139,626,512	8,867
平成15年2月末	139,985,492	8,796
平成15年3月末	153,520,536	8,339
平成15年4月末	159,879,558	9,004
平成15年5月末	177,679,740	9,239
平成15年6月末	186,128,494	9,377
平成15年7月末	188,938,702	9,461

### 分配の推移

決 算 期	1万口当たりの分配金（円）
第1計算期間末 平成13年12月10日	0
第2計算期間末 平成14年12月10日	0

### 収益率の推移

期 間	収益率（％）
第1計算期間 （平成13年3月16日から平成13年12月10日）	3.5
第2計算期間 （平成13年12月11日から平成14年12月10日）	6.2
第3計算期間中間期 （平成14年12月11日から平成15年6月10日）	3.4

\* 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期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。

(3) 設定及び解約実績

期 間	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間 (平成13年3月16日から平成13年12月10日)	146,641,985	2,938,297
第2計算期間 (平成13年12月11日から平成14年12月10日)	13,018,200	272,237
第3計算期間中間期 (平成14年12月11日から平成15年6月10日)	41,375,741	42,581

\* 本邦外における設定・解約の実績はありません。

## 第2 ファンドの経理状況

(原目論見書 31 頁)

1. 当ファンドの財務諸表は、第1期計算期間(平成13年3月16日から平成13年12月10日まで)については、「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)ならびに同規則第2条の2により、改正前の「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表並びに運用報告書に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しており、第2期計算期間(平成13年12月11日から平成14年12月10日まで)については、「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)ならびに同規則第2条の2の規定、および「担保附社債信託法施行細則等の一部を改正する内閣府令」(平成14年内閣府令第17号)附則第10条により、改正前の「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表並びに運用報告書に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
当中間計算期間(平成14年12月11日から平成15年6月10日まで)については、「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条の3及び第57条の2の規定により、改正後の「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表並びに運用報告書に関する規則」(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、財務諸表及び中間財務諸表に掲載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドの第1期計算期間は投資信託約款第45条により、平成13年3月16日から平成13年12月10日までとなっております。
3. 当ファンドは、証券取引法第193条の2の規定に基づき、第1期計算期間(平成13年3月16日から平成13年12月10日まで)および第2期計算期間(平成13年12月11日から平成14年12月10日まで)の財務諸表について、中央青山監査法人による監査を受けております。  
また、証券取引法第193条の2の規定に基づき、当中間計算期間(平成14年12月11日から平成15年6月10日まで)の中間財務諸表について、中央青山監査法人による中間監査を受けております。  
その監査報告書及び中間監査報告書は、該当する財務諸表及び中間財務諸表の直前に添付しております。
4. 平成14年12月31日をもってプルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン・インクがプルデンシャル投信株式会社より営業の全部を譲受け、当ファンドの投資信託委託業者となっております。

以下の情報を追加します。

# 中間監査報告書

平成 15 年 7 月 31 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・インク

取締役社長、佐々木 雅彦 殿  
日本における代表者

中央青山監査法人



代表社員 公認会計士  
関与社員

山手 章 

関与社員 公認会計士

大畑 茂 

当監査法人は、証券取引法第 193 条の 2 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（以下「ファンド」という。）の平成 14 年 12 月 11 日から平成 15 年 6 月 10 日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表及び中間損益及び剰余金計算書について中間監査を行った。

この中間監査に当たって、当監査法人は、一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠し、中間監査に係る通常実施すべき監査手続を実施した。すなわち、この中間監査において当監査法人は、中間監査実施基準二に準拠して財務諸表の監査に係る通常実施すべき監査手続の一部を省略した。

中間監査の結果、中間財務諸表についてファンドの採用する会計処理の原則及び手続は、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、かつ、前計算期間と同一の基準に従って継続して適用されており、また、中間財務諸表の表示方法は、「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）の定めるところに準拠しているものと認められた。

よって、当監査法人は、上記の中間財務諸表が PRU グッドライフ 2020 の平成 15 年 6 月 10 日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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・インク及びファンドと当監査法人又は関与社員との間には、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

## 中間財務諸表

## PRU グッドライフ 2020

## (1) 中間貸借対照表

(単位：円)

区 分	当中間計算期間 (平成15年6月10日現在)	
	金	額
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		5,727,328
親投資信託受益証券		180,531,714
未収入金		9,094
流動資産合計		186,268,136
資産合計		186,268,136
負債の部		
流動負債		
未払解約金		9,281
未払受託者報酬		63,235
未払委託者報酬		948,528
その他未払費用		3,896
流動負債合計		1,024,940
負債合計		1,024,940
純資産の部		
元本		
元本		197,782,811
欠損金		
剰余金		
中間欠損金		12,539,615
(うち分配準備積立金)		(1,246,701)
(うち中間利益)		-
欠損金合計		-
剰余金合計		12,539,615
純資産合計		185,243,196
負債・純資産合計		186,268,136

## (2) 中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

区 分	当中間計算期間 自 平成14年12月11日 至 平成15年 6月10日	
	金	額
経常損益の部		
営業損益の部		
営業収益		
有価証券売買等損益		7,512,118
営業収益合計		7,512,118
営業費用		
受託者報酬		63,235
委託者報酬		948,528
その他費用		3,896
営業費用合計		1,015,659
営業利益		6,496,459
経常利益		6,496,459
中間利益		-
中間純利益		6,496,459
一部解約に伴う中間利益分配額		-
一部解約に伴う中間純利益分配額		513
期首欠損金		14,796,266
欠損金減少額		4,156

区 分	当中間計算期間
	自 平成14年12月11日 至 平成15年 6月10日
	金 額
(中間一部解約に伴う欠損金減少額)	(4,156)
欠損金増加額	4,243,451
(中間追加信託に伴う欠損金増加額)	(4,243,451)
中間欠損金	12,539,615

重要な会計方針

区 分	当中間計算期間
	自 平成14年12月11日 至 平成15年 6月10日
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。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

当中間計算期間 (平成15年6月10日現在)	
1. 投資信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中解約元本額	
期首元本額	156,449,651 円
期中追加設定元本額	41,375,741 円
期中解約元本額	42,581 円
2. 元本の欠損	
中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は12,539,615円であります。	

(中間損益及び剰余金計算書関係)

当中間計算期間 自 平成14年12月11日 至 平成15年 6月10日	
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	27,508 円

(有価証券関係)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

当中間計算期間 (平成15年6月10日現在)	
1口当たり純資産額	0.9366 円
(1万口当たり純資産額)	9,366円)

(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、中間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	(平成15年6月10日現在)	
	金 額	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	143,573,395	
株式	182,916,300	
派生商品評価勘定	1,375,400	
未収入金	29,600	
未収配当金	6,985,389	
未収利息	3	
差入委託証拠金	3,900,000	
流動資産合計	338,780,087	
資産合計	338,780,087	
負債の部		
流動負債		
前受金	1,560,000	
未払金	-	
未払解約金	3,662,878	
流動負債合計	5,222,878	
負債合計	5,222,878	
純資産の部		
元本		
元本	459,249,461	
欠損金		
欠損金	125,692,252	
欠損金合計	-	
剰余金		
剰余金	125,692,252	
純資産合計	333,557,209	
負債・純資産合計	338,780,087	

重要な会計方針

区 分	自 平成14年12月11日 至 平成15年 6月10日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>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。</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券は原則として、証券取引所における中間計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は中間計算期間末日において知りうる最終相場）で評価しております。</p> <p>中間計算期間末日に当該証券取引所の最終相場がない場合には、当該証券取引所における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該証券取引所における中間計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p>

区 分	自 平成14年12月11日 至 平成15年 6月10日
	<p>証券取引所に上場されていない有価証券 証券取引所に上場されていない有価証券は、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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、原則として中間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。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 受取配当金は原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には、予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>

注記事項

（貸借対照表関係）

（平成15年6月10日現在）	
1. 本半期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	3,073,240,467 円
同期中における追加設定元本額	1,594,524,573 円
同期中における解約元本額	4,208,515,579 円
同中間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	65,140,769 円
PRUグットライフ2010	151,701,475 円
PRUグットライフ2020	63,564,116 円
PRUグットライフ2030	63,958,459 円
PRUグットライフ2040	35,165,986 円
PRUグットライフ2010（年金）	7,789,535 円
PRUグットライフ2020（年金）	14,910,614 円
PRUグットライフ2030（年金）	10,170,082 円
PRUグットライフ2040（年金）	7,141,499 円
ワールド・ミックス40（バランス指向）	12,997,851 円
ワールド・ミックス60（成長指向）	9,170,990 円
ワールド・ミックス80（積極指向）	17,538,085 円
	計 459,249,461 円
2. 元本の欠損	
貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は125,692,252円であります。	

（有価証券関係）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係)

取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

株式関連

(単位:円)

区分	種類	(平成15年6月10日現在)			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	111,594,600	-	112,970,000	1,375,400
	合計	111,594,600	-	112,970,000	1,375,400

(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。

原則として中間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、中間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。

(1口当たり情報)

(平成15年6月10日現在)	
本半期報告書における開示対象ファンドの中間期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額	0.7263 円
(1万口当たり純資産額)	7,263円)
なお、純資産額は、投資信託財産純資産額を用いております。	

「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	(平成15年6月10日現在)
	金 額
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,490,059
国債証券	696,962,900
地方債証券	40,759,300
特殊債券	122,009,210
社債券	127,719,080
未収利息	4,031,324
前払費用	282,057
流動資産合計	1,003,253,930
資産合計	1,003,253,930
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,176,593
流動負債合計	3,176,593
負債合計	3,176,593
純資産の部	
元本	
元本	940,578,771
剰余金	
剰余金	59,498,566
剰余金合計	59,498,566
純資産合計	1,000,077,337
負債・純資産合計	1,003,253,930

重要な会計方針

区 分	自 平成14年12月11日 至 平成15年 6月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は原則として、証券取引所における中間計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は中間計算期間末日において知りうる最終相場）で評価しております。 中間計算期間末日に当該証券取引所の最終相場がない場合には、当該証券取引所における直近の日の最終相場で評価していますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該証券取引所における中間計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券 証券取引所に上場されていない有価証券は、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

注記事項

（貸借対照表関係）

（平成15年6月10日現在）	
本半期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	2,444,257,541 円
同期中における追加設定元本額	213,935,596 円
同期中における解約元本額	1,717,614,366 円
同中間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	119,187,846 円
PRUグットライフ2010	628,835,053 円
PRUグットライフ2020	77,525,867 円
PRUグットライフ2030	30,141,132 円
PRUグットライフ2040	4,235,998 円
PRUグットライフ2010（年金）	34,059,332 円
PRUグットライフ2020（年金）	18,147,699 円
PRUグットライフ2030（年金）	4,806,048 円
PRUグットライフ2040（年金）	881,545 円
ワールド・ミックス40（バランス指向）	15,116,868 円
ワールド・ミックス60（成長指向）	4,521,508 円
ワールド・ミックス80（積極指向）	3,119,875 円
計	940,578,771 円

（有価証券関係）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

(平成15年6月10日現在)	
本半期報告書における開示対象ファンドの中間期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額	1.0633 円
(1万口当たり純資産額)	10,633円)
なお、純資産額は、投資信託財産純資産額を用いております。	

「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	(平成15年6月10日現在)
	金 額
資産の部	
流動資産	
預金	108,293,008
金銭信託	281,530
コール・ローン	16,826,201
株式	751,658,011
新株予約権証券	3,699
派生商品評価勘定	6,418,126
未収入金	-
未収配当金	2,216,117
未収利息	-
前払金	9,745,258
差入委託証拠金	3,368,700
流動資産合計	898,810,650
資産合計	898,810,650
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	-
未払金	4,988,749
未払解約金	6,539,057
流動負債合計	11,527,806
負債合計	11,527,806
純資産の部	
元本	
元本	1,084,152,374
欠損金	
剰余金	
欠損金	196,869,530
欠損金合計	-
剰余金合計	196,869,530
純資産合計	887,282,844
負債・純資産合計	898,810,650

重要な会計方針

区 分	自 平成14年12月11日 至 平成15年 6月10日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式及び新株予約権証券 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。</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は原則として、証券取引所における中間計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は中間計算期間末日において知りうる最終相場）で評価しております。</p> <p>中間計算期間末日に当該証券取引所の最終相場がない場合には、当該証券取引所における直近の日の最終相場で評価していますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該証券取引所における中間計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券 証券取引所に上場されていない有価証券は、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として中間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。</p> <p>為替予約取引 原則としてわが国における中間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。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 受取配当金は原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には、入金日基準で計上しております。</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>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表並びに運用報告書に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び61条に基づき処理しております。</p>

注記事項

(貸借対照表関係)

(平成15年6月10日現在)	
1. 本半期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	
	3,316,123,023 円
同期中における追加設定元本額	1,553,087,662 円
同期中における解約元本額	3,785,058,311 円
同中間期末における元本の内訳	
P R U海外株式マーケット・パフォーマー	819,995,964 円
P R Uグットライフ2010	108,674,702 円
P R Uグットライフ2020	45,509,424 円
P R Uグットライフ2030	42,551,094 円
P R Uグットライフ2040	22,129,906 円
P R Uグットライフ2010(年金)	5,894,674 円
P R Uグットライフ2020(年金)	10,624,488 円
P R Uグットライフ2030(年金)	6,770,283 円
P R Uグットライフ2040(年金)	4,496,936 円
ワールド・ミックス40(バランス指向)	6,089,596 円
ワールド・ミックス60(成長指向)	3,989,775 円
ワールド・ミックス80(積極指向)	7,425,532 円
	計 1,084,152,374 円
2. 元本の欠損	
貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は196,869,530円であります。	

(有価証券関係)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係)

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

1. 株式関連

(単位:円)

区分	種類	(平成15年6月10日現在)			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	59,194,716	-	65,612,842	6,418,126
	合計	59,194,716	-	65,612,842	6,418,126

(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。

原則として中間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、中間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。

2. 通貨関連

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

(平成15年6月10日現在)	
本半期報告書における開示対象ファンドの中間期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額	0.8184 円
(1万口当たり純資産額	8,184円)
なお、純資産額は、投資信託財産純資産額を用いております。	

「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	(平成15年6月10日現在)
	金 額
資産の部	
流動資産	
預金	7,752,891
コール・ローン	12,508,737
国債証券	3,992,345,823
派生商品評価勘定	3,283,791
未収入金	3,852,648
未収利息	54,877,708
前払費用	24,136,774
差入委託証拠金	-
流動資産合計	4,098,758,372
資産合計	4,098,758,372
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,543,594
未払金	-
未払解約金	17,355,243
流動負債合計	19,898,837
負債合計	19,898,837
純資産の部	
元本	
元本	2,988,873,783
剰余金	
剰余金	1,089,985,752
剰余金合計	1,089,985,752
純資産合計	4,078,859,535
負債・純資産合計	4,098,758,372

## 重要な会計方針

区 分	自 平成14年12月11日 至 平成15年 6月10日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は原則として、証券取引所における中間計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は中間計算期間末日において知りうる最終相場）で評価しております。</p> <p>中間計算期間末日に当該証券取引所の最終相場がない場合には、当該証券取引所における直近の日の最終相場で評価していますが、直近の日の最終相場によることが適当でないことが認められた場合は、当該証券取引所における中間計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p>

区 分	自 平成14年12月11日 至 平成15年 6月10日
	<p>証券取引所に上場されていない有価証券</p> <p>証券取引所に上場されていない有価証券は、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券</p> <p>適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として中間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。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則としてわが国における中間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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表並びに運用報告書に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び61条に基づき処理しております。</p>

注記事項

（貸借対照表関係）

（平成15年6月10日現在）	
本半期報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	
	5,337,040,414 円
同期中における追加設定元本額	1,561,076,932 円
同期中における解約元本額	3,909,243,563 円
同中間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	2,903,913,906 円
PRUグットライフ2010	57,966,908 円
PRUグットライフ2020	10,762,022 円
PRUグットライフ2030	4,456,906 円
PRUグットライフ2040	1,009,308 円
PRUグットライフ2010（年金）	3,142,783 円
PRUグットライフ2020（年金）	2,501,985 円
PRUグットライフ2030（年金）	709,109 円
PRUグットライフ2040（年金）	203,372 円
ワールド・ミックス40（バランス指向）	2,568,667 円
ワールド・ミックス60（成長指向）	942,444 円
ワールド・ミックス80（積極指向）	696,373 円
計	2,988,873,783 円

（有価証券関係）

該当事項はありません。

## (デリバティブ取引等関係)

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

通貨関連

(単位:円)

種類	(平成15年6月10日現在)			
	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引 為替予約取引				
買建				
アメリカ・ドル	187,821,009	-	187,850,207	29,198
カナダ・ドル	5,801,419	-	5,730,484	70,935
ユーロ	32,264,463	-	32,208,429	56,034
イギリス・ポンド	12,897,412	-	12,907,695	10,283
スイス・フラン	63,775,424	-	63,861,357	85,933
スウェーデン・クローネ	8,077,526	-	7,989,798	87,728
デンマーク・クローネ	60,752,372	-	62,106,209	1,353,837
ポーランド・ズロチ	15,086,226	-	15,086,396	170
オーストラリア・ドル	6,504,893	-	6,484,739	20,154
売建				
アメリカ・ドル	205,179,184	-	206,408,068	1,228,884
カナダ・ドル	8,968,212	-	9,038,422	70,210
ユーロ	28,280,435	-	28,036,456	243,979
イギリス・ポンド	65,051,504	-	65,07,534	46,030
スイス・フラン	23,647,565	-	23,360,460	287,105
デンマーク・クローネ	25,698,387	-	25,589,326	109,061
ポーランド・ズロチ	9,095,318	-	8,908,701	186,617
オーストラリア・ドル	14,252,878	-	14,238,889	13,989
合計	773,154,227	-	774,903,170	740,197

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約の時価

(1) 中間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。

中間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。

中間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) 中間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) 中間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) 中間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、中間計算期  
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。

## (1口当たり情報)

(平成15年6月10日現在)	
本半期報告書における開示対象ファンドの中間期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額	1.3647 円
(1万口当たり純資産額	13,647円)
なお、純資産額は、投資信託財産純資産額を用いております。	

## 2. ファンドの現況

### (1) 純資産額計算書（平成 15 年 7 月 31 日現在）

資産総額	189,292,098 円
負債総額	353,396 円
純資産総額（ - ）	188,938,702 円
発行済数量	199,704,504 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9461 円

#### （参考情報）

##### PRU 国内株式マザーファンド

資産総額	1,202,618,251 円
負債総額	3,050,335 円
純資産総額（ - ）	1,199,567,916 円
発行済数量	1,543,505,001 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7772 円

##### PRU 国内債券マザーファンド

資産総額	1,002,803,604 円
負債総額	22,005,320 円
純資産総額（ - ）	980,798,284 円
発行済数量	937,927,116 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0457 円

##### PRU 海外株式マザーファンド

資産総額	963,281,669 円
負債総額	8,831,237 円
純資産総額（ - ）	954,450,432 円
発行済数量	1,139,184,930 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8378 円

##### PRU 海外債券マザーファンド

資産総額	4,844,909,761 円
負債総額	4,531,554 円
純資産総額（ - ）	4,840,378,207 円
発行済数量	3,673,837,504 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3175 円

### (2) 投資有価証券の主要銘柄（平成 15 年 7 月 31 日現在）

#### 主要銘柄の明細

（単位：円）

地域	種類	銘柄	額面金額	簿価単価	簿価金額	時価単価	時価金額	投資比率（%）
日本	投資信託 受益証券	PRU国内株式 マザーファンド	60,423,029	7,020.00	42,416,967	7,772.00	46,960,778	24.85
日本	投資信託 受益証券	PRU国内債券 マザーファンド	77,827,947	10,405.00	80,980,293	10,457.00	81,384,684	43.07
日本	投資信託 受益証券	PRU海外株式 マザーファンド	46,472,252	7,603.00	35,335,874	8,378.00	38,934,452	20.61
日本	投資信託 受益証券	PRU海外債券 マザーファンド	11,510,076	12,409.00	14,283,275	13,175.00	15,164,525	8.03

（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 万口当たりの値段です。

(参考情報)

## PRU 国内株式マザーファンド

(単位：円)

	地域	業種	銘柄名	通貨	数量 (株)	簿価 単価	簿価 金額	時価 単価	時価 金額	投資 比率 (%)
1	日本	情報・通信業	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本円	201	260,159.34	52,292,028	276,000.00	55,476,000	4.62
2	日本	輸送用機器	トヨタ自動車	日本円	14,300	3,119.35	44,606,773	3,050.00	43,615,000	3.64
3	日本	電気機器	キヤノン	日本円	4,000	5,273.74	21,094,990	5,800.00	23,200,000	1.93
4	日本	輸送用機器	日産自動車	日本円	17,700	972.03	17,204,978	1,175.00	20,797,500	1.73
5	日本	輸送用機器	本田技研工業	日本円	3,800	4,547.28	17,279,701	4,650.00	17,670,000	1.47
6	日本	情報・通信業	日本電信電話	日本円	34	447,829.94	15,226,218	499,000.00	16,966,000	1.41
7	日本	医薬品	武田薬品工業	日本円	3,600	4,622.15	16,639,768	4,300.00	15,480,000	1.29
8	日本	電気機器	松下電器産業	日本円	10,000	1,166.20	11,662,000	1,425.00	14,250,000	1.19
9	日本	電気機器	ソニー	日本円	3,600	3,890.04	14,004,168	3,730.00	13,428,000	1.12
10	日本	銀行業	三菱東京フィナンシャル・グループ	日本円	25	542,654.64	13,566,366	536,000.00	13,400,000	1.12
11	日本	証券・商品先物取引業	野村ホールディングス	日本円	8,000	1,426.80	11,414,444	1,600.00	12,800,000	1.07
12	日本	電気・ガス業	東京電力	日本円	5,400	2,298.51	12,412,001	2,265.00	12,231,000	1.02
13	日本	小売業	セブン・イレブン・ジャパン	日本円	3,000	3,237.33	9,712,000	3,080.00	9,240,000	0.77
14	日本	保険業	ミレアホールディングス	日本円	8	888,818.12	7,110,545	1,120,000.00	8,960,000	0.75
15	日本	情報・通信業	KDDI	日本円	16	435,358.31	6,965,733	544,000.00	8,704,000	0.73
16	日本	電気機器	シャープ	日本円	5,000	1,422.24	7,111,243	1,705.00	8,525,000	0.71
17	日本	陸運業	東日本旅客鉄道	日本円	16	550,362.31	8,805,797	529,000.00	8,464,000	0.71
18	日本	化学	信越化学工業	日本円	1,800	4,023.24	7,241,844	4,200.00	7,560,000	0.63
19	日本	陸運業	東海旅客鉄道	日本円	9	803,413.00	7,230,717	835,000.00	7,515,000	0.63
20	日本	電気・ガス業	関西電力	日本円	3,900	1,853.94	7,230,390	1,876.00	7,316,400	0.61
21	日本	化学	富士写真フイルム	日本円	2,000	3,397.00	6,794,000	3,590.00	7,180,000	0.60
22	日本	電気機器	ローム	日本円	500	14,007.20	7,003,600	14,180.00	7,090,000	0.59
23	日本	電気機器	日立製作所	日本円	13,000	509.44	6,622,790	534.00	6,942,000	0.58
24	日本	銀行業	三井住友フィナンシャルグループ	日本円	23	288,497.86	6,635,451	296,000.00	6,808,000	0.57
25	日本	輸送用機器	デンソー	日本円	3,400	1,836.24	6,243,248	2,000.00	6,800,000	0.57
26	日本	電気機器	ファナック	日本円	1,000	5,865.03	5,865,034	6,700.00	6,700,000	0.56
27	日本	ゴム製品	ブリヂストン	日本円	4,000	1,617.35	6,469,423	1,645.00	6,580,000	0.55
28	日本	電気機器	リコー	日本円	3,000	1,994.66	5,984,000	2,165.00	6,495,000	0.54
29	日本	電気・ガス業	中部電力	日本円	3,000	2,234.17	6,702,519	2,165.00	6,495,000	0.54
30	日本	小売業	イトーヨーカ堂	日本円	2,000	3,171.00	6,342,000	3,090.00	6,180,000	0.52

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

## PRU 国内債券マザーファンド

(単位：円)

	地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還 期限	通貨	額面金額	簿価 単価	簿価金額	時価 単価	時価金額	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第200回利付国債(10年)	2.0	2007/12/20	日本円	30,000,000	108.35	32,505,000	107.52	32,258,100	3.29
2	日本	国債証券	第2回利付国債(5年)	1.1	2005/3/21	日本円	30,000,000	102.29	30,687,000	101.71	30,513,600	3.11
3	日本	国債証券	第15回利付国債(5年)	0.5	2006/9/20	日本円	30,000,000	101.01	30,303,200	101.05	30,317,100	3.09
4	日本	国債証券	第14回利付国債(5年)	0.4	2006/6/20	日本円	30,000,000	100.64	30,192,000	100.72	30,218,700	3.08

	地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還 期限	通貨	額面金額	簿価 単価	簿価金額	時価 単価	時価金額	投資 比率 (%)
5	日本	特殊 債券	第1回政府保証 国民生活債券	1.0	2005/12/26	日本円	25,000,000	102.38	25,596,000	102.04	25,512,250	2.60
6	日本	社債 券	第463回東京電 力	0.85	2005/6/24	日本円	23,000,000	101.72	23,395,600	101.41	23,324,760	2.38
7	日本	国債 証券	第190回利付国 債(10年)	2.9	2006/12/20	日本円	20,000,000	110.51	22,102,000	109.14	21,828,600	2.23
8	日本	国債 証券	第194回利付国 債(10年)	2.5	2007/6/20	日本円	20,000,000	109.88	21,977,000	108.77	21,755,600	2.22
9	日本	国債 証券	第193回利付国 債(10年)	2.6	2007/3/20	日本円	20,000,000	109.90	21,981,000	108.66	21,733,800	2.22
10	日本	国債 証券	第177回利付国 債(10年)	4.6	2005/3/21	日本円	20,000,000	107.41	21,482,400	107.41	21,482,400	2.19
11	日本	国債 証券	第201回利付国 債(10年)	1.9	2008/3/20	日本円	20,000,000	108.11	21,623,400	107.36	21,473,400	2.19
12	日本	社債 券	第2回昭和シェ ル石油(株)無担 保社債	3.25	2005/11/17	日本円	20,000,000	108.01	21,602,000	106.85	21,371,200	2.18
13	日本	国債 証券	第237回利付国 債(10年)	1.5	2012/3/20	日本円	20,000,000	105.13	21,026,000	105.85	21,171,800	2.16
14	日本	国債 証券	第234回利付国 債(10年)	1.4	2011/9/20	日本円	20,000,000	105.80	21,160,000	105.26	21,052,000	2.15
15	日本	国債 証券	第174回利付国 債(10年)	4.6	2004/9/20	日本円	20,000,000	107.05	21,411,200	105.13	21,026,400	2.14
16	日本	国債 証券	第240回利付国 債(10年)	1.3	2012/6/20	日本円	20,000,000	103.10	20,620,200	104.05	20,811,200	2.12
17	日本	国債 証券	第207回利付国 債(10年)	0.9	2008/12/22	日本円	20,000,000	103.34	20,669,000	102.87	20,575,400	2.10
18	日本	社債 券	第18回日石三 菱(株)無担保社 債	0.7	2006/9/7	日本円	20,000,000	100.80	20,160,000	101.24	20,249,200	2.06
19	日本	国債 証券	第244回利付国 債(10年)	1.0	2012/12/20	日本円	20,000,000	101.71	20,342,900	101.03	20,207,800	2.06
20	日本	特殊 債券	い第597号興業 債券	1.4	2004/4/27	日本円	20,000,000	101.40	20,280,000	100.88	20,177,200	2.06
21	日本	国債 証券	第247回利付国 債(10年)	0.8	2013/3/20	日本円	20,000,000	101.32	20,265,100	98.98	19,796,600	2.02
22	日本	地方 債証券	第109回神奈川 県公募公債	1.8	2009/7/22	日本円	18,000,000	107.68	19,382,940	107.57	19,363,140	1.97
23	日本	国債 証券	第250回利付国 債(10年)	0.5	2013/6/20	日本円	20,000,000	95.77	19,155,600	95.89	19,178,800	1.96
24	日本	国債 証券	第27回利付国 債(20年)	5.0	2014/9/22	日本円	10,000,000	142.46	14,246,000	142.27	14,227,400	1.45
25	日本	国債 証券	第22回利付国 債(20年)	5.3	2013/3/20	日本円	10,000,000	142.11	14,211,000	140.89	14,089,600	1.44
26	日本	国債 証券	第33回利付国 債(20年)	3.8	2016/9/20	日本円	10,000,000	132.53	13,253,000	132.87	13,287,300	1.35
27	日本	社債 券	第262回北陸電 力社債	1.65	2011/3/25	日本円	12,000,000	106.42	12,771,120	106.60	12,793,080	1.30
28	日本	国債 証券	第37回利付国 債(20年)	3.1	2017/9/20	日本円	10,000,000	128.02	12,802,200	125.37	12,537,200	1.28
29	日本	特殊 債券	第36回政府保 証関西国際空港 債券	1.3	2011/6/14	日本円	12,000,000	103.57	12,429,000	104.24	12,509,040	1.28
30	日本	国債 証券	第42回利付国 債(20年)	2.6	2019/3/20	日本円	10,000,000	121.61	12,161,600	119.67	11,967,700	1.22

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

## PRU 海外株式マザーファンド

(単位：円)

	地域	業種	銘柄名	通貨	数量 (株)	簿価 単価	簿価 金額	時価 単価	時価 金額	投資 比率 (%)
1	アメリカ	資本財	GENERAL ELECTRIC CO	USD	5,100	3,211.46	16,378,452	3,361.99	17,146,169	1.80
2	アメリカ	医薬品・バイオ テクノロジー	PFIZER INC	USD	4,080	3,741.46	15,265,165	4,013.47	16,374,990	1.72
3	アメリカ	ソフトウェア・ サービス	MICROSOFT CORP	USD	4,700	3,328.65	15,644,691	3,163.66	14,869,220	1.56
4	アメリカ	エネルギー	EXXON MOBIL CORPORATION	USD	3,450	4,207.02	14,514,225	4,245.46	14,646,850	1.53
5	アメリカ	各種金融	CITIGROUP INC	USD	2,600	4,595.17	11,947,459	5,436.64	14,135,279	1.48
6	アメリカ	小売	WAL-MART STORES INC	USD	1,500	6,510.25	9,765,378	6,719.18	10,078,770	1.06
7	アメリカ	テクノロジー 製品・機器	INTEL CORP	USD	3,400	2,373.07	8,068,455	2,942.49	10,004,486	1.05
8	イギリス	エネルギー	BP PLC	GBP	11,445	805.52	9,219,213	821.65	9,403,861	0.99
9	アメリカ	医薬品・バイオ テクノロジー	JOHNSON & JOHNSON	USD	1,500	6,711.86	10,067,801	6,138.61	9,207,921	0.96
10	アメリカ	保険	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	USD	1,100	7,397.95	8,137,750	7,641.11	8,405,225	0.88
11	アメリカ	テクノロジー 製品・機器	CISCO SYSTEMS INC	USD	3,600	1,785.60	6,428,175	2,317.45	8,342,841	0.87
12	アメリカ	テクノロジー 製品・機器	INTL BUSINESS MACHINES CORP	USD	850	10,014.83	8,512,609	9,731.39	8,271,683	0.87
13	イギリス	銀行	HSBC HOLDINGS PLC	GBP	5,473	1,411.67	7,726,119	1,475.19	8,073,728	0.85
14	アメリカ	医薬品・バイオ テクノロジー	MERCK & CO INC	USD	1,150	7,058.28	8,117,031	6,666.29	7,666,235	0.80
15	イギリス	電気通信サー ビス	VODAFONE GROUP PLC	GBP	33,444	233.79	7,818,892	228.85	7,653,957	0.80
16	アメリカ	銀行	BANK OF AMERICA CORP	USD	750	8,407.06	6,305,301	9,941.74	7,456,306	0.78
17	イギリス	医薬品・バイオ テクノロジー	GLAXOSMITHKLINE PLC	GBP	2,953	2,300.92	6,794,617	2,334.26	6,893,080	0.72
18	アメリカ	家庭用品・パー ソナル用品	PROCTER & GAMBLE CO	USD	600	10,317.96	6,190,780	10,547.55	6,328,530	0.66
19	アメリカ	食品・飲料・タ バコ	COCA-COLA COMPANY	USD	1,100	5,428.43	5,971,281	5,454.67	6,000,143	0.63
20	アメリカ	電気通信サー ビス	VERIZON COMMUNICATIONS INC	USD	1,400	4,737.57	6,632,605	4,234.64	5,928,504	0.62
21	フランス	エネルギー	TOTAL SA	EUR	334	17,910.00	5,981,942	17,737.84	5,924,440	0.62
22	スイス	医薬品・バイオ テクノロジー	NOVARTIS AG-REG SHS	CHF	1,229	4,748.67	5,836,116	4,691.70	5,766,109	0.60
23	アメリカ	医薬品・バイオ テクノロジー	AMGEN INC	USD	670	6,076.47	4,071,240	8,359.90	5,601,139	0.59
24	オランダ	エネルギー	ROYAL DUTCH PETROLEUM	EUR	1,074	5,732.13	6,156,315	5,195.72	5,580,211	0.58
25	アメリカ	銀行	WELLS FARGO COMPANY	USD	850	5,658.83	4,810,013	6,169.86	5,244,386	0.55
26	アメリカ	食品・飲料・タ バコ	PEPSICO INC	USD	910	5,188.92	4,721,918	5,571.26	5,069,855	0.53

	地域	業種	銘柄名	通貨	数量 (株)	簿価 単価	簿価 金額	時価 単価	時価 金額	投資 比率 (%)
27	スイス	食品・飲料・タバコ	NESTLE SA-REGISTERED	CHF	207	26,159.08	5,414,931	24,340.43	5,038,471	0.53
28	フィンランド	テクノロジー 製品・機器	NOKIA	EUR	2,647	2,381.42	6,303,640	1,846.15	4,886,774	0.51
29	アメリカ	電気通信サービス	SBC COMMUNICATIONS INC	USD	1,700	3,161.50	5,374,562	2,840.32	4,828,554	0.51
30	アメリカ	食品・薬品小売	ALTRIA GROUP INC	USD	1,000	4,811.09	4,811,095	4,808.00	4,808,000	0.50

(注1) 投資比率は、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) 簿価及び時価は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。

PRU 海外債券マザーファンド

(単位：円)

	地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還 期限	通貨	額面金額	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	フランス	国債 証券	FRENCH TREASURY NOTE	5.0	2006/1/12	EUR	2,201,200	14,517.49	319,559,154	14,423.77	317,496,168	6.56
2	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8.75	2020/5/15	USD	1,621,000	17,651.84	286,136,460	16,998.90	275,552,320	5.69
3	スペイン	国債 証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.25	2007/10/31	EUR	1,781,000	14,329.81	255,213,998	14,238.06	253,579,999	5.24
4	イタリア	国債 証券	BUONIPOLIEN N ALI DEL TES	8.75	2006/7/1	EUR	1,533,800	16,065.10	246,406,618	15,914.90	244,102,774	5.04
5	ドイツ	国債 証券	BUNDESREPUB DEUTSCHLAND	5.375	2010/1/4	EUR	1,616,600	14,966.31	241,945,505	14,995.92	242,424,058	5.01
6	ベルギー	国債 証券	BELGIUM KINGDOM	8.0	2012/12/24	EUR	1,282,400	17,715.55	227,184,222	17,750.13	227,627,724	4.70
7	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	10.75	2005/8/15	USD	1,558,000	14,564.78	226,919,384	14,204.25	221,302,358	4.57
8	ドイツ	国債 証券	BUND ESOBIGATION	4.25	2008/2/15	EUR	1,371,800	14,377.53	197,230,962	14,221.68	195,093,040	4.03
9	イタリア	国債 証券	BUONIPOLIEN NALI DEL TES	5.5	2010/11/1	EUR	1,249,000	14,921.93	186,374,937	15,077.85	188,322,358	3.89
10	イタリア	国債 証券	BUONIPOLIENN ALI DEL TES	8.5	2004/4/1	EUR	1,300,000	14,498.08	188,475,062	14,217.58	184,828,618	3.82
11	ドイツ	国債 証券	BUNDESREPUB DEUTSCHLAND	6.25	2024/1/4	EUR	1,126,500	16,210.12	182,607,102	16,177.07	182,234,789	3.76
12	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	3.0	2004/1/31	USD	1,495,000	12,203.66	182,444,801	12,136.91	181,446,849	3.75
13	フランス	国債 証券	FRANCE O.A.T.	8.5	2023/4/25	EUR	801,900	20,064.02	160,893,437	20,158.87	161,654,030	3.34
14	ドイツ	国債 証券	BUND ESOBIGATION	3.0	2008/4/11	EUR	980,000	13,668.65	133,952,819	13,500.69	132,306,845	2.73
15	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6.625	2007/5/15	USD	956,000	13,879.57	132,688,759	13,723.45	131,196,271	2.71
16	イギリス	国債 証券	UNITED KINGDOM TREASURY	8.5	2007/7/16	GBP	574,400	22,824.75	131,105,405	22,604.06	129,837,766	2.68
17	イギリス	国債 証券	UNITED KINGDOM TREASURY	8.0	2015/12/7	GBP	494,700	26,053.96	128,888,982	25,657.46	126,927,472	2.62
18	ギリシャ	国債 証券	HELLENIC REPUBLIC	4.6	2013/5/20	EUR	840,000	13,963.58	117,294,101	14,011.39	117,695,722	2.43

	地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還 期限	通貨	額面金額	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	時価 単価 (円)	時価金額 (円)	投資 比率 (%)
19	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	11.75	2014/11/15	USD	566,000	17,882.47	101,214,830	17,504.12	99,073,347	2.05
20	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	4.375	2012/8/15	USD	697,000	12,586.30	87,726,516	12,128.93	84,538,648	1.75
21	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	11.62 5	2004/11/15	USD	584,000	14,074.60	82,195,714	13,602.32	79,437,550	1.64
22	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	12.5	2014/8/15	USD	415,000	18,297.85	75,936,097	17,892.89	74,255,520	1.53
23	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6.25	2030/5/15	USD	533,000	14,452.23	77,030,429	13,607.01	72,525,392	1.50
24	ドイ ツ	国債 証券	BUNDESREPUB DEUTSCHLAND	4.5	2013/1/4	EUR	485,400	14,204.39	68,948,115	14,102.88	68,455,398	1.41
25	スベ イン	国債 証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.75	2032/7/30	EUR	432,000	15,504.75	66,980,560	15,260.82	65,926,776	1.36
26	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	3.625	2013/5/15	USD	498,000	12,150.45	60,509,243	11,362.65	56,586,027	1.17
27	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1.125	2005/6/30	USD	417,000	11,963.77	49,888,953	11,916.23	49,690,692	1.03
28	カナ ダ	国債 証券	CANADIAN GOVERNMENT	3.5	2005/6/1	CAD	520,000	8,569.46	44,561,230	8,680.52	45,138,711	0.93
29	イギ リス	国債 証券	UNITED KINGDOM TREASURY	6.0	2028/12/7	GBP	170,700	23,640.89	40,355,005	23,014.16	39,285,184	0.81
30	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5.375	2031/2/15	USD	291,000	13,400.91	38,996,659	12,251.00	35,650,435	0.74

(注1) 投資比率は、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) 簿価及び時価は、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

業種	投資比率(%)
投資信託受益証券	96.56
合計	96.56

(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)

#### PRU 国内株式マザーファンド

業種	投資比率(%)
株式	
水産・農林業	0.08
鉱業	0.07
建設業	1.58
食料品	2.38
繊維製品	0.97
パルプ・紙	0.53
化学	4.92
医薬品	3.99
石油・石炭製品	0.67
ゴム製品	0.67
ガラス・土石製品	1.10
鉄鋼	1.46
非鉄金属	0.85
金属製品	0.59
機械	3.03

業種	投資比率(%)
電気機器	14.60
輸送用機器	9.76
精密機器	1.07
その他製品	1.69
電気・ガス業	4.01
陸運業	3.55
海運業	0.38
空運業	0.30
倉庫・運輸関連業	0.15
情報・通信業	9.63
卸売業	2.98
小売業	4.14
銀行業	6.24
証券・商品先物取引業	2.22
保険業	1.73
その他金融業	1.89
不動産業	0.93
サービス業	1.48
合計	89.64

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

#### PRU 国内債券マザーファンド

業種	投資比率(%)
国債証券	68.61
社債券	12.86
地方債証券	4.11
特殊債券	13.43
合計	99.01

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

#### PRU 海外株式マザーファンド

業種	投資比率(%)
株式	
木材、紙・パルプ	0.02
ヘルス・ケア	0.02
レジャー旅行	0.02
商業	0.02
エネルギー	6.72
素材	3.68
資本財	6.11
商業サービス・用品	1.94
運輸	1.08
自動車・自動車部品	0.98
耐久消費財・アパレル	1.07
ホテル・レストラン・レジャー	1.10
メディア	3.58
小売	3.72
食品・薬品小売	1.67
食品・飲料・タバコ	3.78
家庭用品・パーソナル用品	1.38
ヘルスケア機器・サービス	2.26
医薬品・バイオテクノロジー	9.20
銀行	11.06

業種		投資比率(%)
	各種金融	5.38
	保険	3.98
	不動産	0.92
	ソフトウェア・サービス	3.08
	テクノロジー製品・機器	7.33
	電気通信サービス	4.40
	公益事業	2.90
	小計	87.40
	新株予約権証券	0.00
	合計	87.40

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

#### PRU 海外債券マザーファンド

業種	投資比率(%)
国債証券	97.05
合計	97.05

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

#### (3) 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### (4) その他投資資産の主要なもの(平成15年7月31日現在)

該当事項はありません。

#### (参考情報)

##### PRU 国内株式マザーファンド

種類	地域	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	日本	TOPIX 2003年9月	買建	12	103,010,400	112,680,000	9.39

(注1) 投資比率は、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) 時価については、原則として当該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または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日にもっと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います。

##### PRU 海外株式マザーファンド

種類	地域	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	シカゴ	S&P500 EMINI FUTURE 2003年9月	買建	14	84,874,723	83,012,524	8.70
株価指数先物取引	ロンドン	MSCI PAN EURO FUTURE 2003年9月	買建	4	7,907,884	7,985,444	0.83

(注1) 投資比率は、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) 時価については、銀行等が計算日の対顧客先物相場を基準として計算し、取引証券会社から入手した価額で評価しております。

(注3) 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。



