

# PRU グッドライフ 2040

## 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 2040 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 2040 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 2040  
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 2040

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 2020」および「PRU グッドライフ 2030」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) 内国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（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<br>PRUホットライン |                                                                                                                  |
|------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| フリーダイヤル                | 0120-50-6690 （携帯電話・PHS からでもご利用いただけます。）<br>受付時間： 9:00～17:00<br>（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 1万口以上1万口単位

② 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、お申込みの受付はいたしません。

(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付けを中止すること、およびすでに受付けた取得申込みを取消することができます。

### 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2040（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・国内株式型（一般型）に属します。<br>*「国内株式型（一般型）」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%以上のファンドで、主として国内株式に投資するもの」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 52 年（2040 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>                                                                                                                                                           |

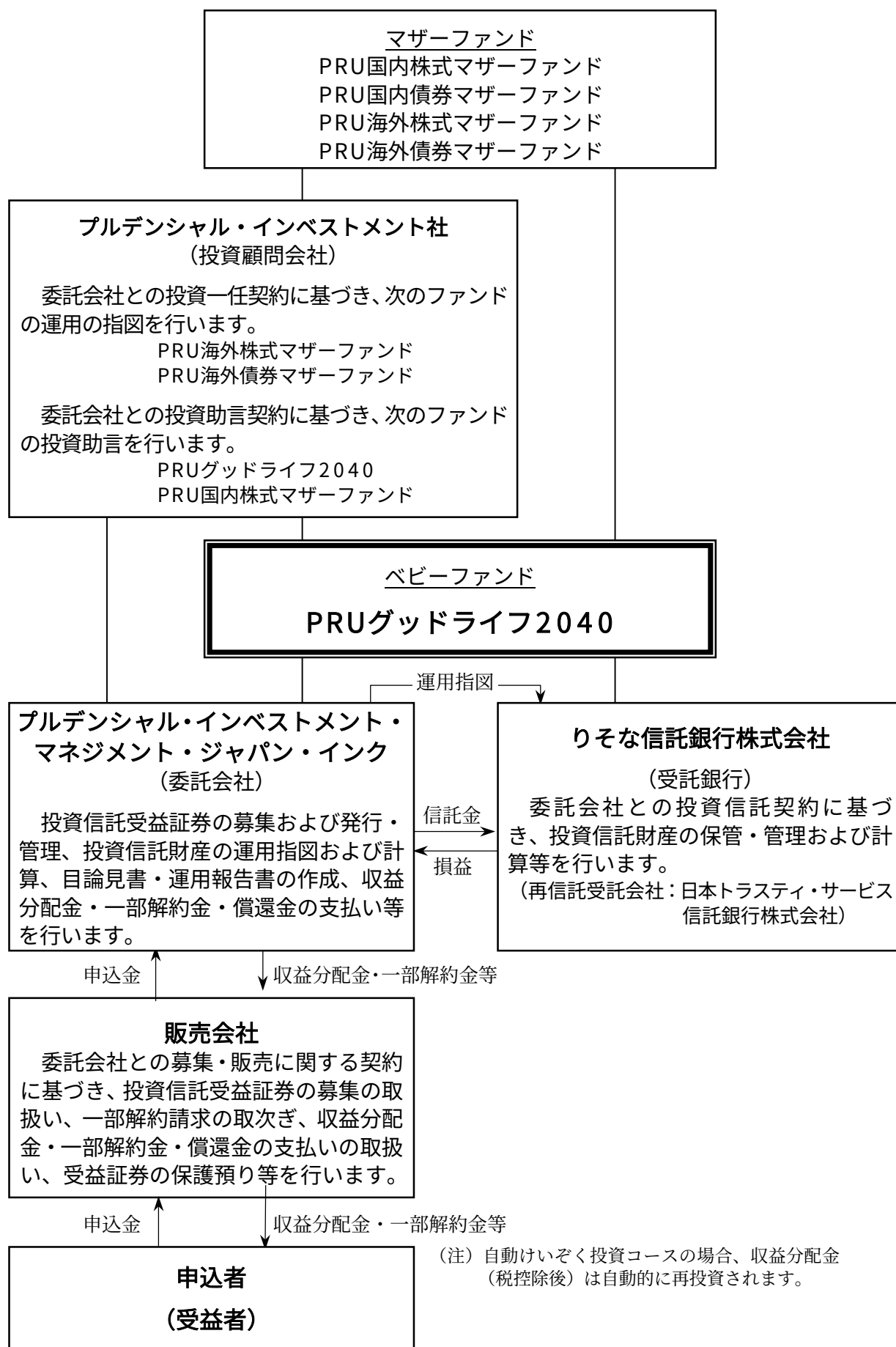
##### (2) ファンドの沿革

平成 13 年 3 月 16 日  
平成 14 年 12 月 31 日

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（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け、収益分配金の再投資、ならびに収益分配金、償還金および一部解約金の支払い等を行います。

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>                               |

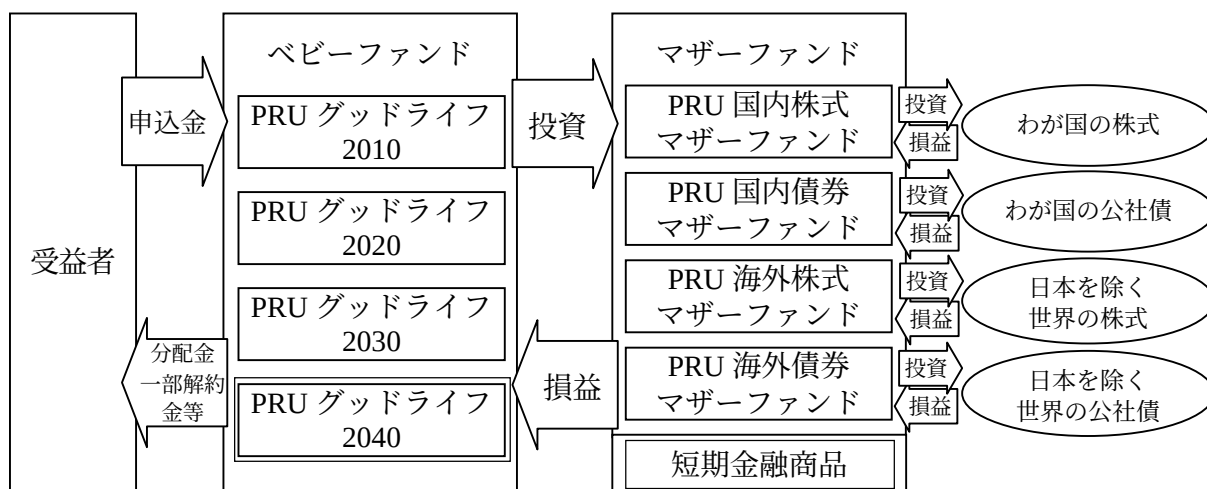
## 2. 投資方針

### (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、すべてベビーファンドに反映されます。



(注) 自動けいぞく投資コースの場合、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

- ① 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。
- ② 当初設定時は、PRU 国内株式マザーファンド 50%、PRU 国内債券マザーファンド 14.5%、PRU 海外株式マザーファンド 30%、PRU 海外債券マザーファンド 2.5%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。
- ③ 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<br>(当初設定日から<br>約1年半経過時) | 当初設定日から<br>約10年経過時 | 当初設定日から<br>約20年経過時 | 当初設定日から<br>約30年経過時 | 満期償還直前 |
|----------------|--------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------|
| PRU国内株式マザーファンド | 48.1%                                | 37.5%              | 25.0%              | 12.5%              | 0.0%   |
| PRU国内債券マザーファンド | 17.1%                                | 32.0%              | 49.5%              | 67.0%              | 0.0%   |
| PRU海外株式マザーファンド | 28.9%                                | 22.5%              | 15.0%              | 7.5%               | 0.0%   |
| PRU海外債券マザーファンド | 2.9%                                 | 5.0%               | 7.5%               | 10.0%              | 0.0%   |
| 短期金融商品         | 3.0%                                 | 3.0%               | 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。

- ④ 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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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。

## (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ま。
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

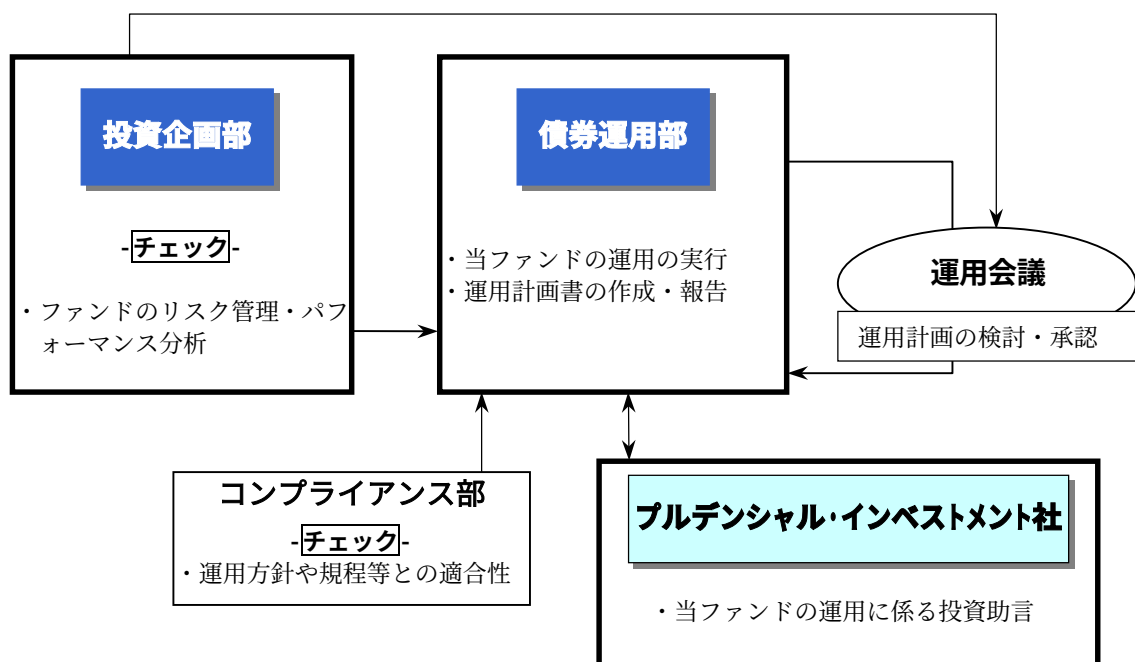
当ファンドは、主として、PRU 国内株式マザーファンド受益証券、PRU 国内債券マザーファンド受益証券、PRU 海外株式マザーファンド受益証券および PRU 海外債券マザーファンド受益証券を投資対象とします。

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。
  - 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。
  - 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には制限を設けません。
- (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60%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たときは、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. 金利先渡し取引および為替先渡し取引の運用指図・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、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行うことの指図をすることができます。
  - (b) 金利先渡し取引および為替先渡し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) 金利先渡し取引および為替先渡し取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (d) 委託会社は、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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たときは、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

| PRU 国内株式マザーファンド |                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基本方針            | この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、東証株価指数（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            | ① 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。<br>② 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。<br>③ 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。<br>④ 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。<br>⑤ 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            | ① 株式への投資には制限を設けません。<br>② 外貨建資産への投資は行いません。<br>③ 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>④ 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。<br>⑤ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>⑥ 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。

- ① 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。
  - ② 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。
  - ③ 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。
  - ④ 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。
  - ⑤ 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。
  - ⑥ 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。
  - ⑦ 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        | 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（当ファンド） | 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 | ① 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。<br>② 運用の効率化を図るため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>③ 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 | ① 外貨建資産への投資は行いません。<br>② 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。<br>③ 株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>④ 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>⑤ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>⑥ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>⑦ 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        | 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（当ファンド） | 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 | ① 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。<br>② 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。<br>③ 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。<br>④ 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。<br>⑤ 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。<br>⑥ 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。 |
| 投資制限 | ① 株式への投資には制限を設けません。<br>② 外貨建資産への投資には制限を設けません。<br>③ 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>④ 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。<br>⑤ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>⑥ 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。                                                                                               |

\* 「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        | 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（当ファンド） | 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 | ① 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。<br>② 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。<br>③ 運用の効率化を図るため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>④ 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。<br>⑤ 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。       |
| 投資制限 | ① 外貨建資産への投資には制限を設けません。<br>② 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。<br>③ 株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>④ 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>⑤ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>⑥ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>⑦ 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。 |

\*「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        | 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（当ファンド） | 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<br>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。）<br>受付時間：9:00～17:00<br>（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 1.68% | 年 0.80% | 年 0.80% | 年 0.08% |
| 第11期計算期から第20期計算期 | 年 1.48% | 年 0.70% | 年 0.70% |         |
| 第21期計算期から第30期計算期 | 年 1.28% | 年 0.60% | 年 0.60% |         |
| 第31期計算期から第40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、ファンドの組入有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

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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ついては各販売会社毎に、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。
- ④ 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、①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、②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 | 34,739,849 | 48.25   |
| 投資信託受益証券（PRU国内債券マザーファンド） | 日本 | 7,142,996  | 9.92    |
| 投資信託受益証券（PRU海外株式マザーファンド） | 日本 | 28,093,832 | 39.02   |
| 投資信託受益証券（PRU海外債券マザーファンド） | 日本 | 1,947,122  | 2.70    |
| 現金、預金、その他資産（負債控除後）       |    | 65,052     | 0.11    |
| 合計（純資産総額）                |    | 71,988,851 | 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    |

| 投資資産の種類            |         | 時価（円）         | 投資比率（％） |
|--------------------|---------|---------------|---------|
|                    | スウェーデン  | 19,801,363    | 0.79    |
|                    | 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

### ① 純資産の推移

|                                    | 純資産総額<br>（円）               | 1万口当たりの純資産額<br>（基準価額）（円） |
|------------------------------------|----------------------------|--------------------------|
| 平成13年11月末                          | 176,225,593                | 9,189                    |
| 第1計算期間末（分配付）<br>（平成13年12月10日）（分配落） | 176,295,376<br>176,295,376 | 9,189<br>9,189           |
| 平成13年12月末                          | 179,869,401                | 9,370                    |
| 平成14年1月末                           | 82,700,383                 | 8,963                    |
| 平成14年2月末                           | 80,617,524                 | 9,200                    |
| 平成14年3月末                           | 89,793,922                 | 9,526                    |
| 平成14年4月末                           | 88,827,224                 | 9,352                    |
| 平成14年5月末                           | 89,502,343                 | 9,390                    |
| 平成14年6月末                           | 81,218,370                 | 8,665                    |

|           | 純資産総額<br>(円) | 1万口当たりの純資産額<br>(基準価額) (円) |
|-----------|--------------|---------------------------|
| 平成14年7月末  | 75,439,252   | 8,174                     |
| 平成14年8月末  | 74,463,694   | 8,047                     |
| 平成14年9月末  | 72,222,110   | 7,786                     |
| 平成14年10月末 | 71,988,851   | 7,735                     |

② 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              |

③ 収益率の推移

| 期 間                                    | 収益率 (%) |
|----------------------------------------|---------|
| 第1計算期間<br>(平成13年3月16日から平成13年12月10日)    | △ 8.1   |
| 第2計算期間中間期<br>(平成13年12月11日から平成14年6月10日) | 0.0     |

\* 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<br>(平成13年3月16日から平成13年12月10日)    | 195,423,951 | 3,559,357   |
| 第2計算期間中間期<br>(平成13年12月11日から平成14年6月10日) | 8,533,492   | 106,986,269 |

\* 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、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付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、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5 営業日目から販売会社において受益者に支払われます。
- (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 52 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

① 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、販売会社を経由して、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。

## ② 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、販売会社を経由して、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。

③ 運用報告書等の作成

当ファンドについて、法令の定めるところにより、有価証券報告書の提出が計算期間の終了毎に、半期報告書の提出が計算期間開始 6 ヶ月経過毎になされます。また委託会社は「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。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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。

⑦ 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。

⑧ 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⑦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。

⑨ 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。

⑩ 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。

⑪ 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。

⑫ 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。

⑬ 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。

⑭ 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。

⑮ 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。

⑯ 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。

⑰ 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11,192,860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ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目）から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 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 2040（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 2040 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 2040

## (イ) 貸借対照表

(単位:円)

| 科 目       | 期 別 | 第1期<br>(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   |     | 1,579,992              |
| 親投資信託受益証券 |     | 175,430,589            |
| 流動資産合計    |     | 177,010,581            |
| 資産合計      |     | 177,010,581            |
| 負債の部      |     |                        |
| 流動負債      |     |                        |
| 未払受託者報酬   |     | 33,960                 |
| 未払委託者報酬   |     | 679,149                |
| その他未払費用   |     | 2,096                  |
| 流動負債合計    |     | 715,205                |
| 負債合計      |     | 715,205                |
| 純資産の部     |     |                        |
| 元本        |     |                        |
| 元本        |     | 191,864,594            |
| 欠損金       |     |                        |
| 期末欠損金     |     | 15,569,218             |
| (うち当期損失)  |     | (29,840,131)           |
| 欠損金合計     |     | 15,569,218             |
| 純資産合計     |     | 176,295,376            |
| 負債・純資産合計  |     | 177,010,581            |

## (ロ) 損益及び剰余金計算書

(単位:円)

| 科 目               | 期 別 | 第1期<br>〔 自 平成13年 3月16日 〕<br>〔 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              |     | 18                                            |
| 有価証券売買等損益         |     | △ 27,716,023                                  |
| 営業収益計             |     | △ 27,716,005                                  |
| 営業費用              |     |                                               |
| 受託者報酬             |     | 100,855                                       |
| 委託者報酬             |     | 2,017,053                                     |
| その他費用             |     | 6,218                                         |
| 営業費用計             |     | 2,124,126                                     |
| 営業損失              |     | 29,840,131                                    |
| 経常損失              |     | 29,840,131                                    |
| 当期損失              |     | 29,840,131                                    |
| 一部解約に伴う当期利益分配額    |     | 118,743                                       |
| 期首剰余金             |     | -                                             |
| 剰余金増加額            |     | 14,437,965                                    |
| (当期追加信託に伴う剰余金増加額) |     | (14,437,965)                                  |
| 剰余金減少額            |     | 48,309                                        |
| (当期一部解約に伴う剰余金減少額) |     | (48,309)                                      |
| 分配金               |     | -                                             |
| 期末欠損金             |     | 15,569,218                                    |

## 重要な会計方針

| 項目 \ 期別         | 第1期<br>(自 平成13年 3月16日<br>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<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

## 注記事項

### (貸借対照表関係)

| 第1期<br>(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                             | 59,607,968 円  |
| 期中追加設定元本額                         | 135,815,983 円 |
| 期中解約元本額                           | 3,559,357 円   |

### (損益及び剰余金計算書関係)

| 第1期<br>(自 平成13年 3月16日<br>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                                                                                                                                   | 316,689 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(0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(94,641円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は94,641円(1万口当たり4.93円)ですが、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<br>評価差額 |
|-----------|-------------|-----------------------|
| 親投資信託受益証券 | 175,430,589 | △ 25,363,814          |
| 合計        | 175,430,589 | △ 25,363,814          |

### (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<br>(平成13年12月10日現在) |          |
|------------------------|----------|
| 1口当たり純資産額              | 0.9189 円 |
| (1万口当たり純資産額)           | 9,189 円) |

(ハ) 附属明細表

第1 有価証券明細表

① 株式

該当事項はありません。

② 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<br>受益証券 | 日本円 | PRU国内株式マザーファンド |       | 107,474,885 | 90,483,105  |    |
|               |     | PRU国内債券マザーファンド |       | 16,998,241  | 17,137,626  |    |
|               |     | PRU海外株式マザーファンド |       | 64,760,199  | 63,341,950  |    |
|               |     | PRU海外債券マザーファンド |       | 4,205,090   | 4,467,908   |    |
|               | 計   | 銘柄数：           | 4     | 193,438,415 | 175,430,589 |    |
|               |     | 組入時価比率：        | 99.5% |             | 100.0%      |    |
|               | 合計  |                |       |             | 175,430,589 |    |
| 株式以外計         |     |                |       |             | 175,430,589 |    |

(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

「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。

(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<br>項目       | 〔 自 平成13年 3月16日 〕<br>〔 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>①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>②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>③時価が入手できなかった有価証券</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。 |
| 2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は、最終相場によっております。                           |
| 3.収益及び費用の計上基準        | 受取配当金<br>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。                        |

## 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<br>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)  
I 取引の状況に関する事項

| 〔 自 平成13年 3月16日<br>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。<br>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。                         |

II 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<br>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。                |          |

## (ハ) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## ① 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   |    |
|    |     | ニチロ         | 1,000  | 161.00   | 161,000   |    |
|    |     | 日本水産        | 2,000  | 188.00   | 376,000   |    |
|    |     | マルハ         | 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 |    |
|    |    | キューピー          | 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   |    |
|    |    | グンゼ            | 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 |    |
|    |    | デサント           | 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 |
|----|----|------------|--------|----------|------------|----|
|    |    | トーモク       | 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 |    |
|    |    | MARUWA        | 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 |    |
|    |    | 川崎製鉄          | 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   |    |
|    |    | 東洋鋼鈑          | 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 |    |
|    |    | 東京製綱             | 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 |
|----|----|-------------|--------|-----------|-----------|----|
|    |    | SMC         | 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    |    |
|    |    | TOWA        | 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 |    |
|    |    | SANKYO      | 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   |    |
|    |    | JUK 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 |    |
|    |    | NTN         | 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   |    |
|    |    | THK         | 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    |    |
|    |    | N E C 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    |    |
|    |    | T D K          | 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     |    |
|    |    | S M K          | 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    |    |
|    |    | エンプラス       | 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    |    |
|    |    | キャノン        | 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  |    |
|    |    | ノーリツ銅機           | 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    |    |
|    |    | タカラスタンダード    | 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  |    |
|    |    | トーメン          | 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    |    |
|    |    | ユニマツオフィスコ     | 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    |    |
|    |    | O l y m p i c | 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  |    |
|    |    | N E C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 |    |
|    |    | C S K            | 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。

② 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<br>項目                   | 〔 自 平成13年 3月16日 〕<br>〔 至 平成13年12月10日 〕                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.有価証券の評<br>価 基 準 及 び<br>評価方法 | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券<br/> 個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>①証券取引所に上場されている有価証券<br/> 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<br/> 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<br/> 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<br/> 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<br/> は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>②証券取引所に上場されていない有価証券<br/> 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<br/> 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<br/> かから入手した価額で評価しております。</p> <p>③時価が入手できなかった有価証券<br/> 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<br/> 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<br/> 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<br/> 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<br>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。                |           |

(ハ) 附属明細表

第1 有価証券明細表

① 株式

該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券

| 種類   | 通貨  | 銘柄              | 銘柄数<br>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 |    |

| 種類    | 通貨    | 銘柄                        | 銘柄数<br>比率 | 券面総額          | 評価額           | 備考 |
|-------|-------|---------------------------|-----------|---------------|---------------|----|
|       |       | 第 2 2 1 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 2 2 5 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 5 0 3 回          |           | 10,000,000    | 10,938,000    |    |
|       |       | 東京都公募公債第 5 4 9 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 1 1 2 回           |           | 14,500,000    | 14,930,360    |    |
|       | 計     | 銘柄数：                      | 4         | 94,500,000    | 98,376,660    |    |
|       |       | 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 7 8 2 回公営企業債券      |           | 32,000,000    | 33,898,560    |    |
|       |       | 第 4 1 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 6 0 5 号 商工債券           |           | 10,000,000    | 10,304,600    |    |
|       |       | 農林中央金庫 5 8 5 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 1 0 5 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<br>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<br>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 3 9 3 回 中部電力            |           | 30,300,000    | 34,694,409    |    |
|       |       | 第 3 8 2 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<br>項目                | 〔 自 平成13年 3月16日 〕<br>〔 至 平成13年12月10日 〕                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|----------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の<br>評価基準及び<br>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>①証券取引所に上場されている有価証券<br/>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。<br/>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>②証券取引所に上場されていない有価証券<br/>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>③時価が入手できなかった有価証券<br/>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      | 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は、最終相場によっております。           |
| 3. 収益及び費用の計上基準             | 受取配当金<br>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。        |
| 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<br>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              | 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)

I 取引の状況に関する事項

| 〔 自 平成13年 3月16日<br>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。                       |

II 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       | 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。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。                |          |

(ハ) 附属明細表

第1 有価証券明細表

① 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  |    |
|    |    | CLOXOX 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<br>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<br>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<br>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       |    |
|    |          | SEMBCORP 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。

## ② 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<br>項目       | 〔 自 平成13年 3月16日<br>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<br/>個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>①証券取引所に上場されている有価証券<br/>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。<br/>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>②証券取引所に上場されていない有価証券<br/>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>③時価が入手できなかった有価証券<br/>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<br>原則としてわが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。                                                            |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br>外貨建取引については、「投資信託財産の貸借対照表、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）

I 取引の状況に関する事項

| 〔 自 平成13年 3月16日<br>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。                     |

## II 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   |

(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。
  - ① 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。
  - ② 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。                |           |

## (ハ) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## ① 株式

該当事項はありません。

## ② 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<br>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<br>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<br>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



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PRUGOODライフ2040（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PRUGOODライフ2040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<br>(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           |     | 1,094,568                 |
| 親投資信託受益証券         |     | 85,770,026                |
| 未収入金              |     | 1,808,057                 |
| 流動資産合計            |     | 88,672,651                |
| 資産合計              |     | 88,672,651                |
| 負債の部              |     |                           |
| 流動負債              |     |                           |
| 未払解約金             |     | 1,810,774                 |
| 未払受託者報酬           |     | 46,881                    |
| 未払委託者報酬           |     | 937,482                   |
| その他未払費用           |     | 2,866                     |
| 流動負債合計            |     | 2,798,003                 |
| 負債合計              |     | 2,798,003                 |
| 純資産の部             |     |                           |
| 元本                |     |                           |
| 元本                |     | 93,411,817                |
| 欠損金               |     |                           |
| 中間欠損金             |     | 7,537,169                 |
| (うち分配準備積立金)       |     | (-)                       |
| (うち中間利益又は中間損失(△)) |     | (△286,831)                |
| 欠損金合計             |     | 7,537,169                 |
| 純資産合計             |     | 85,874,648                |
| 負債・純資産合計          |     | 88,672,651                |

## (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<br>(自 平成13年12月11日<br>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               |     | 700,398                                     |
| 営業収益計                   |     | 700,398                                     |
| 営業費用                    |     |                                             |
| 受託者報酬                   |     | 46,881                                      |
| 委託者報酬                   |     | 937,482                                     |
| その他費用                   |     | 2,866                                       |
| 営業費用計                   |     | 987,229                                     |
| 営業損失                    |     | 286,831                                     |
| 経常損失                    |     | 286,831                                     |
| 中間損失                    |     | 286,831                                     |
| 一部解約に伴う中間利益又は中間損失(△)分配額 |     | △ 88,810                                    |
| 期首欠損金                   |     | 15,569,218                                  |
| 欠損金減少額                  |     | 8,674,573                                   |
| (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)       |     | (8,674,573)                                 |
| 欠損金増加額                  |     | 444,503                                     |
| (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)       |     | (444,503)                                   |
| 分配金                     |     | -                                           |
| 中間欠損金                   |     | 7,537,169                                   |

## 重要な会計方針

| 期別<br>項目                | 当中間計算期間<br>〔自 平成 13 年 12 月 11 日〕<br>〔至 平成 14 年 6 月 10 日〕                   |
|-------------------------|----------------------------------------------------------------------------|
| 有価証券の<br>評価基準及び<br>評価方法 | 親投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。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<br>(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                             | 191,864,594 円 |
| 期中追加設定元本額                         | 8,533,492 円   |
| 期中解約元本額                           | 106,986,269 円 |

(中間損益及び剰余金計算書関係)

| 当中間計算期間<br>〔自 平成 13 年 12 月 11 日〕<br>〔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<br>255,076 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<br>(平成 14 年 6 月 10 日現在) |          |
|---------------------------------|----------|
| 1口当たり純資産額                       | 0.9193 円 |
| (1万口当たり純資産額)                    | 9,193 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<br>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                   | 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。                                                           |  |
|                    | ① 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。 |  |
|                    | ② 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。      |  |
|                    | ③ 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。                                              |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、原則として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<br>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<br>項目 | 〔自 平成 13 年 12 月 11 日〕<br>〔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)

|      |                | (平成14年6月10日現在) |       |             |           |
|------|----------------|----------------|-------|-------------|-----------|
| 区分   | 種類             | 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<br>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<br>項目             | 〔 自 平成 13 年 12 月 11 日 〕<br>〔 至 平成 14 年 6 月 10 日 〕                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|-------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 有価証券の<br>評価基準及び<br>評価方法 | <p>国債証券、地方債証券、<br/>特殊債券及び社債券<br/>個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>① 証券取引所に上場されている有価証券<br/>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。<br/>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>② 証券取引所に上場されていない有価証券<br/>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>③ 時価が入手できなかった有価証券<br/>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            |
| 資産の部     |       |                |
| 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  |
| 負債の部     |       |                |
| 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     |
| 純資産の部    |       |                |
| 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〕<br>〔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、新株予約権証券 | <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>① 証券取引所に上場されている有価証券<br/>         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。<br/>         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>② 証券取引所に上場されていない有価証券<br/>         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>③ 時価が入手できなかった有価証券<br/>         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      | ①先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、原則として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。<br>②為替予約取引<br>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取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<br>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<br>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<br>項目 | 〔自 平成 13 年 12 月 11 日〕<br>〔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               | 3,010,473,059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<br>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<br>以外の取引 | 為替予約取引<br><br>買建<br><br>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。

① 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。

② 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<br>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<br>項目                | 〔自 平成 13 年 12 月 11 日〕<br>〔至 平成 14 年 6 月 10 日〕                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|----------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 1. 有価証券の<br>評価基準及び<br>評価方法 | <p>国債証券<br/>個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>①証券取引所に上場されている有価証券<br/>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。<br/>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>②証券取引所に上場されていない有価証券<br/>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>③時価が入手できなかった有価証券<br/>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>①先物取引<br/>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br/>時価評価にあたっては、原則として中間計算期間末日に知りうる直近の日</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

|                            |                                                                                                                        |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 法                          | の主たる取引所の発表する清算値段又は、最終相場によっております。<br>②為替予約取引<br>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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br>外貨建取引については、「投資信託財産の貸借対照表、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<br>項目 | 〔自 平成 13 年 12 月 11 日〕<br>〔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                | 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<br>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 | 250,543     |

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。

① 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。

② 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）

|                     |              |
|---------------------|--------------|
| I 資産総額              | 72,510,404 円 |
| II 負債総額             | 521,553 円    |
| III 純資産総額（I - II）   | 71,988,851 円 |
| IV 発行済数量            | 93,065,037 口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 0.7735 円     |

#### （参考情報）

##### PRU 国内株式マザーファンド

|                     |               |
|---------------------|---------------|
| I 資産総額              | 115,008,388 円 |
| II 負債総額             | 706,648 円     |
| III 純資産総額（I - II）   | 114,301,740 円 |
| IV 発行済数量            | 136,781,491 口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 0.8357 円      |

##### PRU 国内債券マザーファンド

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

##### PRU 海外株式マザーファンド

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

##### PRU 海外債券マザーファンド

|                     |                 |
|---------------------|-----------------|
| I 資産総額              | 7,669,242,142 円 |
| II 負債総額             | 1,281,216,256 円 |
| III 純資産総額（I - II）   | 6,388,025,886 円 |
| IV 発行済数量            | 5,391,634,401 口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 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<br>単価  | 簿価金額       | 時価<br>単価  | 時価金額       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------------|--------------------|------------|-----------|------------|-----------|------------|-----------------|
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU国内株式<br>マザーファンド | 48,424,658 | 8,387.00  | 40,616,776 | 7,174.00  | 34,739,849 | 48.25           |
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU国内債券<br>マザーファンド | 6,886,143  | 10,105.00 | 6,958,710  | 10,373.00 | 7,142,996  | 9.92            |
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU海外株式<br>マザーファンド | 37,043,556 | 9,322.00  | 34,535,049 | 7,584.00  | 28,093,832 | 39.02           |
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU海外債券<br>マザーファンド | 1,643,419  | 10,821.00 | 1,778,388  | 11,848.00 | 1,947,122  | 2.70            |

（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<br>(株) | 簿価<br>単価   | 簿価<br>金額    | 時価<br>単価   | 時価<br>金額   | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----|----------------|------------------|-----|-----------|------------|-------------|------------|------------|-----------------|
| 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<br>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<br>(%) | 償還<br>期限  | 通貨  | 額面金額        | 簿価<br>単価 | 簿価金額        | 時価<br>単価 | 時価金額        | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|----|------|-----------------------|-----------|-----------|-----|-------------|----------|-------------|----------|-------------|-----------------|
| 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<br>(%) | 償還<br>期限   | 通貨  | 額面金額       | 簿価<br>単価 | 簿価金額       | 時価<br>単価 | 時価金額       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----|-------|---------------------|-----------|------------|-----|------------|----------|------------|----------|------------|-----------------|
|    |    | 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<br>(株) | 簿価<br>単価  | 簿価<br>金額   | 時価<br>単価  | 時価<br>金額   | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|---------------|------------------------------|-----|-----------|-----------|------------|-----------|------------|-----------------|
| 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            |
| 26 | スイス  | 食品・飲料・タバコ     | NESTLE SA-REGISTERED         | CHF | 643       | 28,879.46 | 18,569,494 | 26,043.74 | 16,746,128 | 0.66            |

|    | 地域     | 業種              | 銘柄名                  | 通貨  | 数量<br>(株) | 簿価<br>単価  | 簿価<br>金額   | 時価<br>単価 | 時価<br>金額   | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------|-----------------|----------------------|-----|-----------|-----------|------------|----------|------------|-----------------|
| 27 | アメリカ   | テクノロジー<br>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<br>・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<br>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           | CHEVRONTXACO<br>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<br>(%) | 償還<br>期限   | 通貨  | 額面金額      | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円)   | 時価<br>単価<br>(円) | 時価金額<br>(円)   | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------|----------|--------------------------------|-----------|------------|-----|-----------|-----------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|
| 1  | イタリア   | 国債<br>証券 | BUONI<br>POLIENNALI<br>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<br>証券 | BUONI<br>POLIENNALI<br>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<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>証券 | DEUTSCHLAN<br>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<br>証券 | FRANCE<br>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<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>証券 | BUONI<br>POLIENNALI<br>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<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>証券 | BELGIUM<br>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<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>証券 | BUNDESREPU<br>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<br>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<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>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 | スウェーデン | 国債<br>証券 | SWEDISH<br>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<br>証券 | US TREASURY<br>N/B             | 5.375     | 2003/6/30  | USD | 917,000   | 12,674.73       | 116,227,285   | 12,644.36       | 115,948,802   | 1.81            |
| 18 | アメリカ   | 国債<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>証券 | US TREASURY<br>N/B             | 12.5      | 2014/8/15  | USD | 507,000   | 18,601.60       | 94,310,137    | 18,888.09       | 95,762,665    | 1.49            |

|    | 地域    | 種類   | 銘柄名                     | 利率<br>(%) | 償還<br>期限   | 通貨  | 額面金額      | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円) | 時価<br>単価<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|-------|------|-------------------------|-----------|------------|-----|-----------|-----------------|-------------|-----------------|-------------|-----------------|
| 20 | スペイン  | 国債証券 | BONOS Y<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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 | 99.89    |
| 合計       | 99.89    |

(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     |
|    | 金属製品     | 0.58     |
|    | 機械       | 2.84     |
|    | 電気機器     | 14.36    |
|    | 輸送用機器    | 10.11    |

| 業種         | 投資比率 (%) |
|------------|----------|
| 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     |
|    | 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     |

| 業種       | 投資比率 (%) |
|----------|----------|
| 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/<br>売建 | 数量<br>(枚) | 簿価金額<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|----|----------------|-----------|-----------|-------------|-------------|-----------------|
| 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/<br>売建 | 数量<br>(枚) | 簿価金額<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|------|----------------------------------|-----------|-----------|-------------|-------------|-----------------|
| 株価指数先物取引 | シカゴ  | S&P500 EMINI<br>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<br>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<br>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。
  - ① 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。
  - ② 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。
  - ③ 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 ヶ月、3 ヶ月、6 ヶ月、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、格付け構成、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
  - ④ 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。
    - ・ プルデンシャル・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

① 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。

② 当初設定時は、PRU国内株式マザーファンド50%、PRU国内債券マザーファンド14.5%、PRU海外株式マザーファンド30%、PRU海外債券マザーファンド2.5%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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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。

## (3) 投資制限

① 株式への投資割合には制限を設けません。

② 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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。

⑦ 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。

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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、委託者および受益者〉

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

## 〈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 59,607,968 円を受益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。

② 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。

③ 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 52 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 59,607,968 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。

② 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。

② 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。

③ 第34条に規定する予約為替の評価は、原則として、わ

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>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。</p> <p><b>(信託日時の異なる受益権の内容)</b></p> <p>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。</p> <p><b>(受益証券の発行)</b></p> <p>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。</p> <p><b>(受益証券の発行についての受託者の認証)</b></p> <p>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。</p> <p>② 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。</p> <p><b>(受益証券の申込単位、価額および手数料等)</b></p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>② 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。</p> <p>③ 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。</p> <p>④ 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。</p> <p>⑤ 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を中止することができます。</p> <p>⑥ 前項により受益証券の取得申込み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。</p> <p><b>(受益証券の種類)</b></p> <p>第14条 委託者が発行する受益証券は、1口券、10口券、100口</p> | <p>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。</p> <p>② 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。</p> <p>③ 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。</p> <p><b>(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)</b></p> <p>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。</p> <p>② 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。</p> <p>③ 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。</p> <p><b>(記名式の受益証券譲渡の対抗要件)</b></p> <p>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。</p> <p><b>(無記名式の受益証券の再交付)</b></p> <p>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。</p> <p><b>(記名式の受益証券の再交付)</b></p> <p>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。</p> <p><b>(受益証券を毀損した場合等の再交付)</b></p> <p>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。</p> <p><b>(受益証券の再交付の費用)</b></p> <p>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。</p> <p><b>(投資の対象とする資産の種類)</b></p> <p>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。</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>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。） <ol style="list-style-type: none"> <li>有価証券</li> <li>有価証券指数等先物取引に係る権利</li> <li>有価証券オプション取引に係る権利</li> <li>外国市場証券先物取引に係る権利</li> <li>有価証券店頭指数等先物取引に係る権利</li> <li>有価証券店頭オプション取引に係る権利</li> <li>有価証券店頭指数等スワップ取引に係る権利</li> <li>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。）</li> <li>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。）</li> <li>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</li> <li>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。）</li> <li>次に掲げるものを信託する信託の受益権（イに掲</li> </ol> </li> </ol> |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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ます。)
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

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・インクを委託者とし、り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。

- ② 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
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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。
- ⑦ 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。

- ② 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。

- ② 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。
- ③ 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。

- ④ 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。

- ② 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ますものとし、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。

- ② 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、）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

#### （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。）。

- ② 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。
- ③ 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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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たときは、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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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たときは、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。
- ② 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。
- ③ 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、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60を超えることとなる投資の指図をしません。

- ② 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。

- ② 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。
- ③ 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。

- ④ 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。

#### （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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。

- ② 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。

- ③ 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。

- ② 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。

- ② 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 168 |
| 第11計算期から第20計算期の場合 | 年 10,000 分の 148 |
| 第21計算期から第30計算期の場合 | 年 10,000 分の 128 |
| 第31計算期から第40計算期の場合 | 年 10,000 分の 108 |

- ② 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。

- ③ 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。

- ④ 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賃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。

- ② 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。

- ② 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。

- ③ 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。

- ④ 一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から受益者に支払います。

- ⑤ 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。

- ⑥ 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。

- ⑦ 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。

- ⑧ 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。

- ② 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。

- ② 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。

- ③ 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。

- ④ 委託者は、第1項の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。

- ⑤ 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します。

- ⑥ 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付けを中止することができます。

- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該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付けたものとして第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。

- ② 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。

- ③ 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。

- ④ 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。

- ⑤ 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。

- ⑥ 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。

- ② 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します。

**(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。

- ② 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。

- ② 委託者は、分割により営業の全部又は一部を承継させ

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>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。</p> <p><b>（受託者の辞任に伴う取扱い）</b></p> <p>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。</p> <p>② 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。</p> <p><b>（投資信託約款の変更）</b></p> <p>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。</p> <p>② 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。</p> <p>③ 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</p> <p>④ 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。</p> <p>⑤ 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。</p> <p><b>（反対者の買取請求権）</b></p> <p>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</p> | <p>請求することができます。</p> <p>② 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。</p> <p>③ 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。</p> <p><b>（公告）</b></p> <p>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。</p> <p><b>（投資信託約款に関する疑義の取扱い）</b></p> <p>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。</p> <p><b>（付則）</b></p> <p>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。</p> <p>上記条項により投資信託契約を締結します。</p> <p>投資信託契約締結日 平成 13 年 3 月 16 日</p><br><div> <div>（本社）</div> <div>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</div> </div><br><div> <div>（東京支店）</div> <div>東京都千代田区丸の内二丁目 3 番 2 号</div> </div> <p>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</p><br><p>東京都千代田区大手町二丁目 1 番 1 号</p> <p>受託者 りそな信託銀行株式会社</p> |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

# PRU グッドライフ 2040

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 2040 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 2040 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。

## I. 目論見書の訂正理由

「PRU グッドライフ 2040 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。

## II. 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

|                     |
|---------------------|
| <h4>1. ファンドの性格</h4> |
|---------------------|

（2）ファンドの沿革

（原目論見書 4 頁）

平成 13 年 3 月 16 日

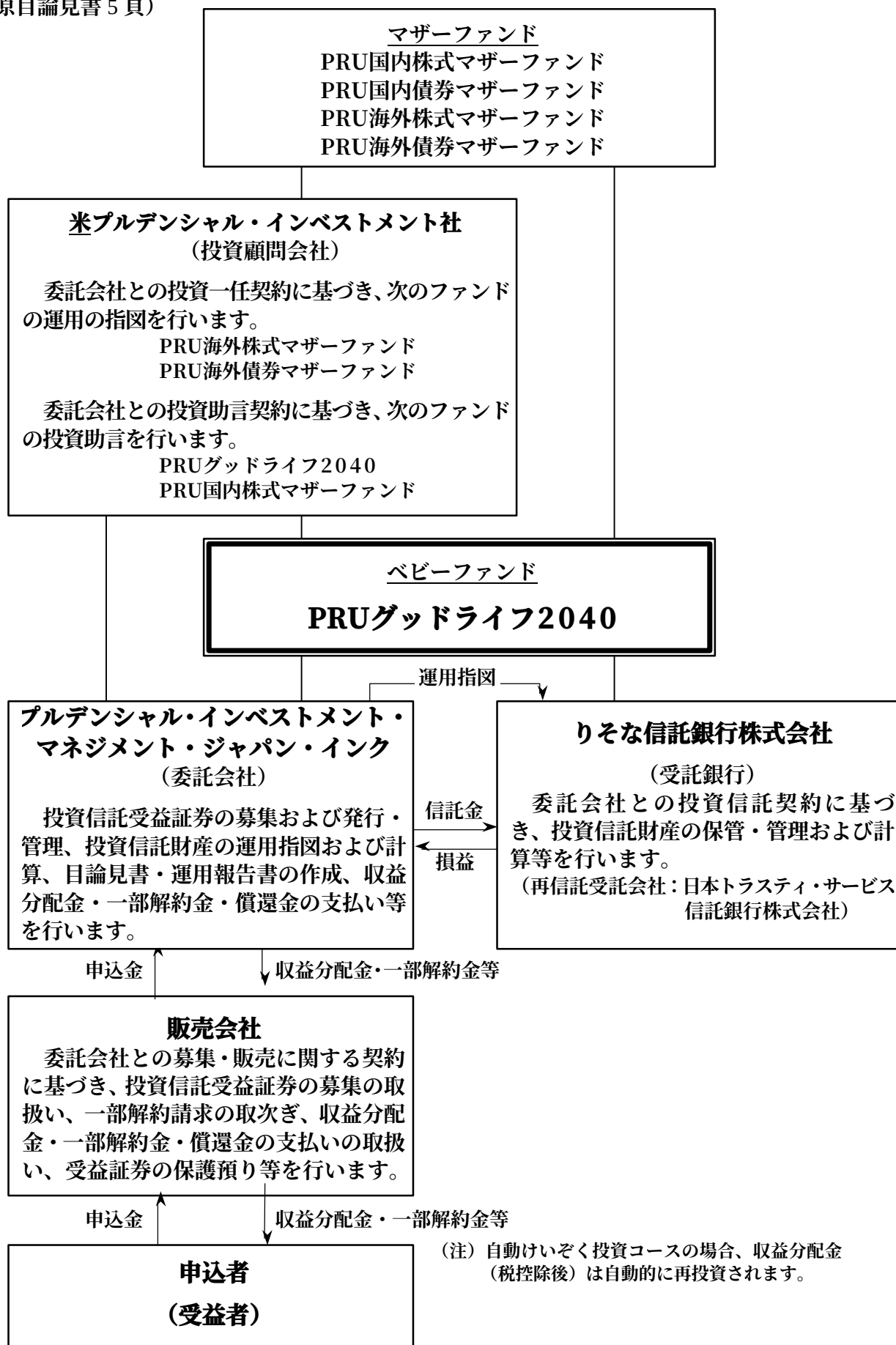
平成 14 年 12 月 31 日

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)



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)

(①～⑤略)

- ⑥ 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

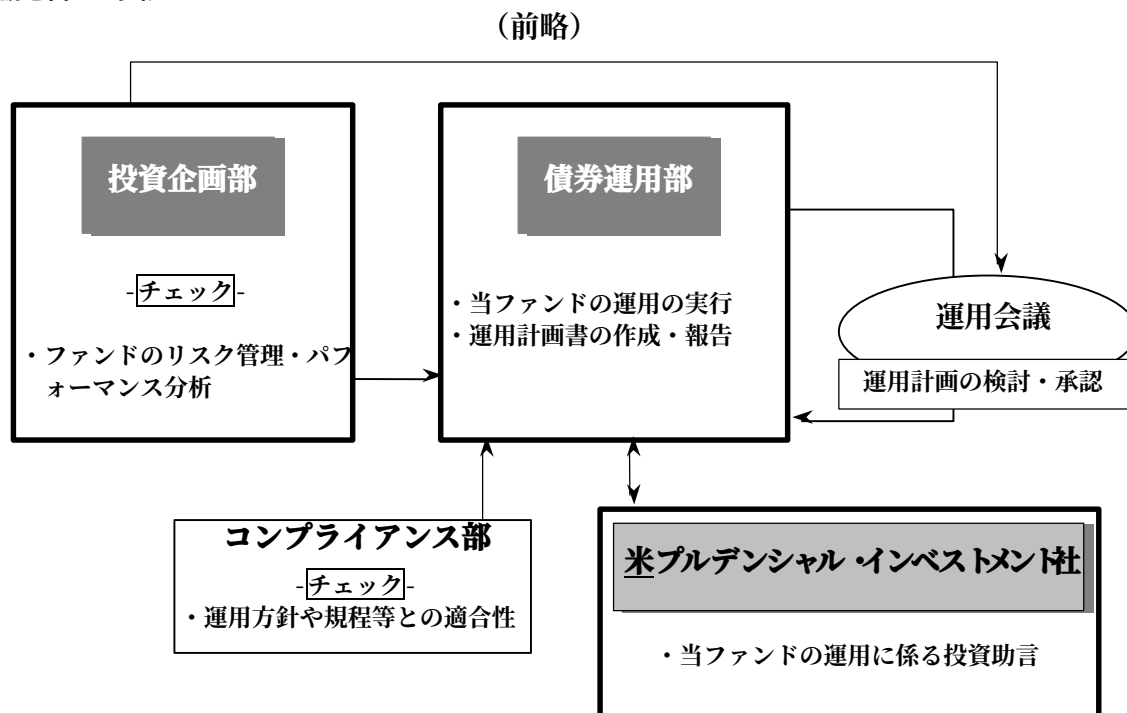
**運用体制**

(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)



**(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 | (①～④略)<br>⑤ 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 | (①～⑤略)<br>⑥ 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 | (①～④略)<br>⑤ 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 | 34,253,062 | 50.33    |
| 投資信託受益証券 (PRU国内債券マザーファンド) | 日 本 | 6,743,817  | 9.91     |
| 投資信託受益証券 (PRU海外株式マザーファンド) | 日 本 | 24,913,876 | 36.61    |
| 投資信託受益証券 (PRU海外債券マザーファンド) | 日 本 | 1,881,389  | 2.76     |
| 現金、預金、その他資産 (負債控除後)       |     | 266,407    | 0.39     |
| 合計 (純資産総額)                |     | 68,058,551 | 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

### ① 純資産の推移

|                     | 純資産総額<br>(円) | 1万口当たりの純資産額<br>(基準価額) (円) |
|---------------------|--------------|---------------------------|
| 第1計算期間末 (分配付)       | 176,295,376  | 9,189                     |
| (平成13年12月10日) (分配落) | 176,295,376  | 9,189                     |
| 平成14年2月末            | 80,617,524   | 9,200                     |
| 平成14年3月末            | 89,793,922   | 9,526                     |
| 平成14年4月末            | 88,827,224   | 9,352                     |
| 平成14年5月末            | 89,502,343   | 9,390                     |
| 平成14年6月末            | 81,218,370   | 8,665                     |
| 平成14年7月末            | 75,439,252   | 8,174                     |
| 平成14年8月末            | 74,463,694   | 8,047                     |
| 平成14年9月末            | 72,222,110   | 7,786                     |
| 平成14年10月末           | 71,988,851   | 7,735                     |
| 平成14年11月末           | 74,858,811   | 8,013                     |
| 第2計算期間末 (分配付)       | 70,958,579   | 7,743                     |
| (平成14年12月10日) (分配落) | 70,958,579   | 7,743                     |
| 平成14年12月末           | 69,212,325   | 7,546                     |
| 平成15年1月末            | 68,058,551   | 7,364                     |

### ② 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              |

### ③ 収益率の推移

| 期 間                                  | 収益率 (%) |
|--------------------------------------|---------|
| 第1計算期間<br>(平成13年3月16日から平成13年12月10日)  | △ 8.1   |
| 第2計算期間<br>(平成13年12月11日から平成14年12月10日) | △ 15.7  |

\* 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<br>(平成13年3月16日から平成13年12月10日)  | 195,423,951 | 3,559,357   |
| 第2計算期間<br>(平成13年12月11日から平成14年12月10日) | 10,492,067  | 110,711,121 |

\* 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

### (2) 受益者の権利等

(原目論見書 30 頁)

- 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 59,607,968 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.～e.略)

## 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 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 2040（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 2040 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 次

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 2040（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 2040 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 2040

### (1) 貸借対照表

(単位：円)

| 科 目       | 期 別 | 第1期<br>(平成13年12月10日現在) | 第2期<br>(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   |     | 1,579,992              | 744,919                |
| 親投資信託受益証券 |     | 175,430,589            | 70,875,835             |
| 流動資産合計    |     | 177,010,581            | 71,620,754             |
| 資産合計      |     | 177,010,581            | 71,620,754             |
| 負債の部      |     |                        |                        |
| 流動負債      |     |                        |                        |
| 未払受託者報酬   |     | 33,960                 | 31,450                 |
| 未払委託者報酬   |     | 679,149                | 628,826                |
| その他未払費用   |     | 2,096                  | 1,899                  |
| 流動負債合計    |     | 715,205                | 662,175                |
| 負債合計      |     | 715,205                | 662,175                |
| 純資産の部     |     |                        |                        |
| 元本        |     |                        |                        |
| 元本        |     | 191,864,594            | 91,645,540             |
| 欠損金       |     |                        |                        |
| 期末欠損金     |     | 15,569,218             | 20,686,961             |
| (うち当期損失)  |     | (29,840,131)           | (13,698,887)           |
| 欠損金合計     |     | 15,569,218             | 20,686,961             |
| 純資産合計     |     | 176,295,376            | 70,958,579             |
| 負債・純資産合計  |     | 177,010,581            | 71,620,754             |

### (2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

| 科 目                       | 期 別 | 第1期<br>〔 自 平成13年 3月16日<br>至 平成13年12月10日 〕 | 第2期<br>〔 自 平成13年12月11日<br>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                      |     | 18                                        | -                                         |
| 有価証券売買等損益                 |     | △ 27,716,023                              | △ 12,049,483                              |
| 営業収益合計                    |     | △ 27,716,005                              | △ 12,049,483                              |
| 営業費用                      |     |                                           |                                           |
| 受託者報酬                     |     | 100,855                                   | 78,331                                    |
| 委託者報酬                     |     | 2,017,053                                 | 1,566,308                                 |
| その他費用                     |     | 6,218                                     | 4,765                                     |
| 営業費用合計                    |     | 2,124,126                                 | 1,649,404                                 |
| 営業損失                      |     | 29,840,131                                | 13,698,887                                |
| 経常損失                      |     | 29,840,131                                | 13,698,887                                |
| 当期損失                      |     | 29,840,131                                | 13,698,887                                |
| 一部解約に伴う当期利益又は当期損失 (△) 分配額 |     | 118,743                                   | △ 436,878                                 |
| 期首剰余金又は期首欠損金 (△)          |     | -                                         | △ 15,569,218                              |
| 剰余金増加額                    |     | 14,437,965                                | -                                         |
| (当期追加信託に伴う剰余金増加額)         |     | (14,437,965)                              | (-)                                       |
| 剰余金減少額                    |     | 48,309                                    | -                                         |
| (当期一部解約に伴う剰余金減少額)         |     | (48,309)                                  | (-)                                       |

| 期 別<br>科 目        | 第1期<br>〔 自 平成13年 3月16日<br>至 平成13年12月10日 〕 | 第2期<br>〔 自 平成13年12月11日<br>至 平成14年12月10日 〕 |
|-------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------------|
|                   | 金 額                                       | 金 額                                       |
| 欠損金減少額            | -                                         | 8,972,233                                 |
| (当期一部解約に伴う欠損金減少額) | (-)                                       | (8,972,233)                               |
| 欠損金増加額            | -                                         | 827,967                                   |
| (当期追加信託に伴う欠損金増加額) | (-)                                       | (827,967)                                 |
| 分配金               | -                                         | -                                         |
| 期末欠損金             | 15,569,218                                | 20,686,961                                |

#### 重要な会計方針

| 期別<br>項目        | 第 1 期<br>〔 自 平成 13 年 3 月 16 日<br>至 平成 13 年 12 月 10 日 〕                         | 第 2 期<br>〔 自 平成 13 年 12 月 11 日<br>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<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 | 親投資信託受益証券<br>同左                                         |

#### 注記事項

(貸借対照表関係)

| 第1期<br>(平成13年12月10日現在)            | 第2期<br>(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 59,607,968 円                | 期首元本額 191,864,594 円               |
| 期中追加設定元本額 135,815,983 円           | 期中追加設定元本額 10,492,067 円            |
| 期中解約元本額 3,559,357 円               | 期中解約元本額 110,711,121 円             |

(損益及び剰余金計算書関係)

| 第1期<br>〔 自 平成13年 3月16日<br>至 平成13年12月10日 〕                                                                                                                                           | 第2期<br>〔 自 平成13年12月11日<br>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<br>316,689 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<br>242,223 円                                                                                                                                                 |
| 2. 分配金の計算過程<br>計算期間末における解約に伴う当期損失分配後の配当等収益から費用を控除した額(0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た額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(94,641円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は94,641円(1万口当たり4.93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<br>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(0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(55,408円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は55,408円(1万口当たり6.05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<br>評価差額 |
|-----------|-------------|-----------------------|
| 親投資信託受益証券 | 175,430,589 | △ 25,363,814          |
| 合計        | 175,430,589 | △ 25,363,814          |

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<br>評価差額 |
|-----------|------------|-----------------------|
| 親投資信託受益証券 | 70,875,835 | △ 11,057,741          |
| 合計        | 70,875,835 | △ 11,057,741          |

（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<br>（平成13年12月10日現在） |          | 第2期<br>（平成14年12月10日現在） |          |
|------------------------|----------|------------------------|----------|
| 1口当たり純資産額              | 0.9189 円 | 1口当たり純資産額              | 0.7743 円 |
| （1万口当たり純資産額            | 9,189 円） | （1万口当たり純資産額            | 7,743 円） |

（3） 附属明細表

第1 有価証券明細表

① 株式

該当事項はありません。

② 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<br>受益証券 | 日本円 | PRU国内株式マザーファンド |       | 48,481,477 | 34,572,141 |    |
| 親投資信託<br>受益証券 | 日本円 | PRU国内債券マザーファンド |       | 6,845,825  | 7,097,751  |    |
| 親投資信託<br>受益証券 | 日本円 | PRU海外株式マザーファンド |       | 35,113,658 | 26,953,243 |    |
| 親投資信託<br>受益証券 | 日本円 | PRU海外債券マザーファンド |       | 1,849,204  | 2,252,700  |    |
|               | 計   | 銘柄数：           | 4     | 92,290,164 | 70,875,835 |    |
|               |     | 組入時価比率：        | 99.9% |            | 100.0%     |    |
| 合計            |     |                |       |            | 70,875,835 |    |

（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  |

| 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            |
| 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<br>項目        | 〔 自 平成13年 3月16日<br>至 平成13年12月10日 〕                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 〔 自 平成13年12月11日<br>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>①証券取引所に上場されている有価証券<br/>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>②証券取引所に上場されていない有価証券<br/>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>③時価が入手できなかった有価証券<br/>適正な評価額を入手できなかった場</p> | <p>株式</p> <p>同左</p> <p>①証券取引所に上場されている有価証券<br/>同左</p> <p>②証券取引所に上場されていない有価証券<br/>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>③時価が入手できなかった有価証券<br/>同左</p> |

| 対象年月日<br>項目           | 〔 自 平成13年 3月16日<br>至 平成13年12月10日 〕                                                                              | 〔 自 平成13年12月11日<br>至 平成14年12月10日 〕 |
|-----------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|
|                       | 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。 |                                    |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は、最終相場によっております。            | 先物取引<br>同左                         |
| 3. 収益及び費用の計上基準        | 受取配当金<br>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<br>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)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <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</p> <p style="text-align: right;">3,000,000,000 円</p> <p>同期中における追加設定元本額</p> <p style="text-align: right;">372,227,468 円</p> <p>同期中における解約元本額</p> <p style="text-align: right;">360,803,148 円</p> <p>同期末における元本の内訳</p> <p>PRU 国内株式マーケット・パフォーマー</p> <p style="text-align: right;">2,725,531,821円</p> <p>PRU グッドライフ2010</p> <p style="text-align: right;">81,090,861円</p> <p>PRU グッドライフ2020</p> <p style="text-align: right;">41,498,281円</p> <p>PRU グッドライフ2030</p> <p style="text-align: right;">54,245,829円</p> <p>PRU グッドライフ2040</p> <p style="text-align: right;">107,474,885円</p> <p>PRU グッドライフ2010 (年金)</p> <p style="text-align: right;">148,093円</p> <p>PRU グッドライフ2020 (年金)</p> <p style="text-align: right;">309,464円</p> <p>PRU グッドライフ2030 (年金)</p> <p style="text-align: right;">476,582円</p> <p>PRU グッドライフ2040 (年金)</p> <p style="text-align: right;">648,504円</p> <p>計</p> <p style="text-align: right;">3,011,424,320円</p> <p>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。</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</p> <p style="text-align: right;">3,011,424,320 円</p> <p>同期中における追加設定元本額</p> <p style="text-align: right;">249,544,822 円</p> <p>同期中における解約元本額</p> <p style="text-align: right;">187,728,675 円</p> <p>同期末における元本の内訳</p> <p>PRU 国内株式マーケット・パフォーマー</p> <p style="text-align: right;">2,720,855,512円</p> <p>PRU グッドライフ2010</p> <p style="text-align: right;">142,512,017円</p> <p>PRU グッドライフ2020</p> <p style="text-align: right;">47,552,405円</p> <p>PRU グッドライフ2030</p> <p style="text-align: right;">59,394,923円</p> <p>PRU グッドライフ2040</p> <p style="text-align: right;">48,481,477円</p> <p>PRU グッドライフ2010 (年金)</p> <p style="text-align: right;">2,973,923円</p> <p>PRU グッドライフ2020 (年金)</p> <p style="text-align: right;">10,997,164円</p> <p>PRU グッドライフ2030 (年金)</p> <p style="text-align: right;">6,491,491円</p> <p>PRU グッドライフ2040 (年金)</p> <p style="text-align: right;">3,742,770円</p> <p>ワールド・ミックス40 (バランス指向)</p> <p style="text-align: right;">11,604,327円</p> <p>ワールド・ミックス60 (成長指向)</p> <p style="text-align: right;">6,812,417円</p> <p>ワールド・ミックス80 (積極指向)</p> <p style="text-align: right;">11,822,041円</p> <p>計</p> <p style="text-align: right;">3,073,240,467円</p> <p>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。</p> |

(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<br>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<br>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)

I 取引の状況に関する事項

| 〔 自 平成13年 3月16日<br>至 平成13年12月10日 〕                                                                                                              | 〔 自 平成13年12月11日<br>至 平成14年12月10日 〕 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|
| 1. 取引の内容<br>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<br>同左                     |
| 2. 取引に対する取組みと利用目的<br>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<br>同左            |
| 3. 取引に係るリスクの内容<br>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<br>同左               |
| 4. 取引に係るリスク管理体制<br>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。<br>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<br>同左              |
| 5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明<br>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<br>同左     |

## II 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<br>0.8419 円<br>(1万口当たり純資産額 8,419 円)<br>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<br>0.7131 円<br>(1万口当たり純資産額 7,131 円)<br>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

① 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 |    |
|    |    | 日本鋪道       | 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 |    |
|    |    | ブリマハム           | 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   |    |
|    |    | カルビス            | 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 |    |
|    |    | キューピー           | 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    |    |
|    |    | アリアケジャパン        | 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    |    |
|    |    | エアー・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    |    |
|    |    | 日本パーカライジング     | 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    |    |
|    |    | 太陽東洋酸素         | 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    |    |
|    |    | 積水化成成品工業       | 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    |    |
|    |    | オートタイヤ             | 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  |    |
|    |    | MARUWA             | 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 |    |
|    |    | 東京製鋼                  | 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   |    |
|    |    | SMC                   | 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    |    |
|    |    | TCM         | 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  |    |
|    |    | SANKYO      | 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    |    |
|    |    | JUKI        | 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  |    |
|    |    | NTN         | 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    |    |
|    |    | THK         | 1,000  | 1,436.00  | 1,436,000  |    |
|    |    | ユーシン精機      | 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    |    |
|    |    | NEC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    |    |
|    |    | 図研           | 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    |    |
|    |    | エンブラス        | 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    |    |
|    |    | KOA                | 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    |    |
|    |    | トピー工業              | 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    |    |
|    |    | NOK                | 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  |    |
|    |    | ノーリツ銅機               | 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  |    |
|    |    | 日本電産コパル              | 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ANDARD          | 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    |    |
|    |    | ハピネット          | 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   |    |
|    |    | ニチメン          | 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 I 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   |    |
|    |    | オートバックスセブン    | 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   |    |
|    |    | インパクト二十一      | 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    |    |
|    |    | パルコ           | 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  |    |
|    |    | ホームマック        | 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。

- ② 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<br>項目             | 〔 自 平成13年 3月16日<br>至 平成13年12月10日 〕                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 〔 自 平成13年12月11日<br>至 平成14年12月10日 〕                                                                                                                         |
|-------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 有価証券の評価<br>基準及び評価方<br>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>①証券取引所に上場されている有価証券<br/>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>②証券取引所に上場されていない有価証券<br/>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>①証券取引所に上場されている有価証券<br/>同左</p> <p>②証券取引所に上場されていない有価証券<br/>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<br>項目 | 〔 自 平成13年 3月16日<br>至 平成13年12月10日 〕                                                                                                                                                                                             | 〔 自 平成13年12月11日<br>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>③時価が入手できなかった有価証券<br/>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>③時価が入手できなかった有価証券<br/>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</p> <p style="text-align: right;">2,000,000,000 円</p> <p>同期中における追加設定元本額</p> <p style="text-align: right;">550,566,626 円</p> <p>同期中における解約元本額</p> <p style="text-align: right;">442,888,396 円</p> <p>同期末における元本の内訳</p> <p>PRU 国内債券マーケット・パフォーマー</p> <p style="text-align: right;">1,606,635,957円</p> <p>PRU グッドライフ2010</p> <p style="text-align: right;">379,886,962円</p> <p>PRU グッドライフ2020</p> <p style="text-align: right;">67,609,088円</p> <p>PRU グッドライフ2030</p> <p style="text-align: right;">34,940,239円</p> <p>PRU グッドライフ2040</p> <p style="text-align: right;">16,998,241円</p> <p>PRU グッドライフ2010（年金）</p> <p style="text-align: right;">694,002円</p> <p>PRU グッドライフ2020（年金）</p> <p style="text-align: right;">504,195円</p> <p>PRU グッドライフ2030（年金）</p> <p style="text-align: right;">306,973円</p> <p>PRU グッドライフ2040（年金）</p> <p style="text-align: right;">102,573円</p> <p>計</p> <p style="text-align: right;">2,107,678,230円</p> <p>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。</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</p> <p style="text-align: right;">2,107,678,230 円</p> <p>同期中における追加設定元本額</p> <p style="text-align: right;">494,397,819 円</p> <p>同期中における解約元本額</p> <p style="text-align: right;">157,818,508 円</p> <p>同期末における元本の内訳</p> <p>PRU 国内債券マーケット・パフォーマー</p> <p style="text-align: right;">1,665,562,926円</p> <p>PRU グッドライフ2010</p> <p style="text-align: right;">623,103,403円</p> <p>PRU グッドライフ2020</p> <p style="text-align: right;">65,658,933円</p> <p>PRU グッドライフ2030</p> <p style="text-align: right;">30,959,896円</p> <p>PRU グッドライフ2040</p> <p style="text-align: right;">6,845,825円</p> <p>PRU グッドライフ2010（年金）</p> <p style="text-align: right;">12,875,727円</p> <p>PRU グッドライフ2020（年金）</p> <p style="text-align: right;">15,362,103円</p> <p>PRU グッドライフ2030（年金）</p> <p style="text-align: right;">3,501,826円</p> <p>PRU グッドライフ2040（年金）</p> <p style="text-align: right;">531,055円</p> <p>ワールド・ミックス40（バランス指向）</p> <p style="text-align: right;">14,180,771円</p> <p>ワールド・ミックス60（成長指向）</p> <p style="text-align: right;">3,639,382円</p> <p>ワールド・ミックス80（積極指向）</p> <p style="text-align: right;">2,035,694円</p> <p>計</p> <p style="text-align: right;">2,444,257,541円</p> <p>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。</p> |

(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<br>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<br>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<br>1.0082 円<br>(1万口当たり純資産額 10,082 円)<br>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<br>1.0368 円<br>(1万口当たり純資産額 10,368 円)<br>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

###### ① 株式

該当事項はありません。

###### ② 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<br>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           |  | 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  |
| 負債の部         |  |                |                |
| 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        |
| 純資産の部        |  |                |                |
| 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<br>項目        | 〔 自 平成13年 3月16日<br>至 平成13年12月10日 〕                                                                                                                                       | 〔 自 平成13年12月11日<br>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<br>移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。<br>①証券取引所に上場されている有価証券<br>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。<br>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<br>同左<br>①証券取引所に上場されている有価証券<br>同左 |

| 対象年月日<br>項目               | 〔 自 平成13年 3月16日<br>至 平成13年12月10日 〕                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 〔 自 平成13年12月11日<br>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>②証券取引所に上場されていない有価証券<br/>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>③時価が入手できなかった有価証券<br/>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>②証券取引所に上場されていない有価証券<br/>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>③時価が入手できなかった有価証券<br/>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<br/>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br/>時価評価にあたっては、原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は、最終相場によっております。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | <p>先物取引<br/>同左</p>                                                                                                                                                                 |
| 3.収益及び費用の計上基準             | <p>受取配当金<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>3,000,000,000 円<br/>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<br/>3,010,473,059 円<br/>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)                                       |                |
|-------------------------------------------------------|----------------|-------------------------------------------------------|----------------|
|                                                       | 272,834,029 円  |                                                       | 470,960,819 円  |
| 同期中における解約元本額                                          | 262,360,970 円  | 同期中における解約元本額                                          | 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・パフォーマー                                  |                | PRU 海外株式マーケット・パフォーマー                                  |                |
|                                                       | 2,838,197,367円 |                                                       | 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)

I 取引の状況に関する事項

| 〔 自 平成13年 3月16日<br>至 平成13年12月10日 〕                        | 〔 自 平成13年12月11日<br>至 平成14年12月10日 〕 |
|-----------------------------------------------------------|------------------------------------|
| 1. 取引の内容<br>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<br>同左                     |
| 2. 取引に対する取組みと利用目的<br>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<br>同左            |

| 〔 自 平成13年 3月16日<br>至 平成13年12月10日 〕                                                                                                              | 〔 自 平成13年12月11日<br>至 平成14年12月10日 〕 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|
| 3. 取引に係るリスクの内容<br>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<br>同左               |
| 4. 取引に係るリスク管理体制<br>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。<br>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<br>同左              |
| 5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明<br>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<br>同左     |

## II 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       | 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           | 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       | 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<br>0.9781 円<br>(1万口当たり純資産額 9,781 円)<br>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<br>0.7676 円<br>(1万口当たり純資産額 7,676 円)<br>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

① 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  |    |
|    |    | GLOBALSANTAFE 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   |    |
|    |    | SAFEWAY 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   |    |
|    |    | SOLETRON 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     |    |
|    |     | AUTOSTRADA 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 SCHWEPPE'S 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<br>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,SEKI 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<br>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<br>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<br>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。

## ② 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<br>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。

「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)

| 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) |
|----------|--|----------------|----------------|
| 科 目      |  | 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<br>項目        | 〔 自 平成13年 3月16日<br>至 平成13年12月10日 〕                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 〔 自 平成13年12月11日<br>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<br/>個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>①証券取引所に上場されている有価証券<br/>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>②証券取引所に上場されていない有価証券</p> | <p>国債証券<br/>同左</p> <p>①証券取引所に上場されている有価証券<br/>同左</p> <p>②証券取引所に上場されていない有価証券</p> |

| 対象年月日<br>項目                | 〔 自 平成13年 3月16日<br>至 平成13年12月10日 〕                                                                                                                                                                                                                                                 | 〔 自 平成13年12月11日<br>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>③時価が入手できなかった有価証券<br/>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>③時価が入手できなかった有価証券<br/>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<br/>原則としてわが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>                                                                                                                                                                                                                        | <p>為替予約取引<br/>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<br/>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<br/>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</p> <p>2,000,000,000 円</p> <p>同期中における追加設定元本額</p> <p>5,260,906,540 円</p> <p>同期中における解約元本額</p> <p>2,013,071,596 円</p> <p>同期末における元本の内訳</p> <p>PRU 海外債券マーケット・パフォーマー</p> <p>5,175,078,451円</p> <p>PRU グッドライフ2010 52,754,045円</p> <p>PRU グッドライフ2020 9,868,814円</p> <p>PRU グッドライフ2030 5,683,276円</p> <p>PRU グッドライフ2040 4,205,090円</p> <p>PRU グッドライフ2010（年金） 96,366円</p> <p>PRU グッドライフ2020（年金） 73,597円</p> <p>PRU グッドライフ2030（年金） 49,929円</p> <p>PRU グッドライフ2040（年金） 25,376円</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</p> <p>5,247,834,944 円</p> <p>同期中における追加設定元本額</p> <p>5,732,557,811 円</p> <p>同期中における解約元本額</p> <p>5,643,352,341 円</p> <p>同期末における元本の内訳</p> <p>PRU 海外債券マーケット・パフォーマー</p> <p>5,229,965,101円</p> <p>PRU グッドライフ2010 81,056,474円</p> <p>PRU グッドライフ2020 9,966,101円</p> <p>PRU グッドライフ2030 5,446,704円</p> <p>PRU グッドライフ2040 1,849,204円</p> <p>PRU グッドライフ2010（年金） 1,664,409円</p> <p>PRU グッドライフ2020（年金） 2,313,294円</p> <p>PRU グッドライフ2030（年金） 601,130円</p> <p>PRU グッドライフ2040（年金） 142,631円</p> <p>ワールド・ミックス40（バランス指向）</p> <p>2,672,088円</p> <p>ワールド・ミックス60（成長指向） 854,645円</p> <p>ワールド・ミックス80（積極指向） 508,633円</p> |

| (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 | 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)

I 取引の状況に関する事項

| 〔 自 平成13年 3月16日<br>至 平成13年12月10日 〕                                                                                                              | 〔 自 平成13年12月11日<br>至 平成14年12月10日 〕 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|
| 1. 取引の内容<br>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<br>同左                     |
| 2. 取引に対する取組みと利用目的<br>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<br>同左            |
| 3. 取引に係るリスクの内容<br>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<br>同左               |
| 4. 取引に係るリスク管理体制<br>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。<br>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<br>同左              |
| 5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明<br>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<br>同左     |

## II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<br>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<br>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。

① 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。

② 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<br>1.0625 円<br>(1万口当たり純資産額 10,625 円)<br>なお、純資産額は、投資信託財産純資産額を用いて<br>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<br>1.2182 円<br>(1万口当たり純資産額 12,182 円)<br>なお、純資産額は、投資信託財産純資産額を用いて<br>おります。 |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## ① 株式

該当事項はありません。

## ② 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<br>クロネ | 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<br>クロネ  | 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）

|                     |              |
|---------------------|--------------|
| I 資産総額              | 68,234,769 円 |
| II 負債総額             | 176,218 円    |
| III 純資産総額（I-II）     | 68,058,551 円 |
| IV 発行済数量            | 92,420,986 口 |
| V 1口当たり純資産額（III/IV） | 0.7364 円     |

(参考情報)

#### PRU 国内株式マザーファンド

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

#### PRU 国内債券マザーファンド

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

#### PRU 海外株式マザーファンド

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

## PRU 海外債券マザーファンド

|                      |                 |
|----------------------|-----------------|
| I 資産総額               | 4,847,219,126 円 |
| II 負債総額              | 629,049,065 円   |
| III 純資産総額 (I-II)     | 4,218,170,061 円 |
| IV 発行済数量             | 3,369,527,532 口 |
| V 1口当たり純資産額 (III/IV) | 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<br>単価  | 簿価金額       | 時価<br>単価  | 時価金額       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------------|--------------------|------------|-----------|------------|-----------|------------|-----------------|
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU国内株式<br>マザーファンド | 50,165,586 | 7,121.00  | 35,726,901 | 6,828.00  | 34,253,062 | 50.33           |
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU国内債券<br>マザーファンド | 6,452,179  | 10,368.00 | 6,689,620  | 10,452.00 | 6,743,817  | 9.91            |
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU海外株式<br>マザーファンド | 35,035,686 | 7,665.00  | 26,854,854 | 7,111.00  | 24,913,876 | 36.61           |
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU海外債券<br>マザーファンド | 1,502,827  | 12,176.00 | 1,829,843  | 12,519.00 | 1,881,389  | 2.76            |

(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<br>(株) | 簿価<br>単価   | 簿価<br>金額   | 時価<br>単価   | 時価<br>金額   | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----|----------------|----------------------|-----|-----------|------------|------------|------------|------------|-----------------|
| 1  | 日本 | 通信業            | エヌ・ティ・ティ・<br>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<br>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<br>先物取引業 | 野村ホール<br>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<br>・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<br>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<br>(株) | 簿価<br>単価   | 簿価<br>金額  | 時価<br>単価   | 時価<br>金額  | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----|--------|-------------|-----|-----------|------------|-----------|------------|-----------|-----------------|
| 23 | 日本 | 保険業    | ミレ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<br>(%) | 償還<br>期限   | 通貨  | 額面金額       | 簿価<br>単価 | 簿価金額       | 時価<br>単価 | 時価金額       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----|------|---------------------|-----------|------------|-----|------------|----------|------------|----------|------------|-----------------|
| 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 | 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<br>(%) | 償還<br>期限  | 通貨  | 額面金額       | 簿価<br>単価 | 簿価金額       | 時価<br>単価 | 時価金額       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----|----------|---------------------------|-----------|-----------|-----|------------|----------|------------|----------|------------|-----------------|
| 20 | 日本 | 社債<br>券  | 第18回日石<br>三菱株式会社<br>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<br>債券 | 第91回東京<br>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<br>債券 | 第109回神奈<br>川県公募公債         | 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<br>証券 | 第27回利付<br>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<br>証券 | 第22回利付<br>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<br>券  | 第262回<br>北陸電力株式<br>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<br>証券 | 第37回利付<br>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<br>債券 | 第36回政府<br>保証関西国際<br>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<br>証券 | 第40回利付<br>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<br>証券 | 第49回利付<br>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<br>証券 | 第50回利付<br>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<br>(株) | 簿価<br>単価 | 簿価<br>金額   | 時価<br>単価 | 時価<br>金額   | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|-------------------|--------------------------------|-----|-----------|----------|------------|----------|------------|-----------------|
| 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<br>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<br>・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<br>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<br>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<br>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<br>製品・機器   | INTL BUSINESS<br>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<br>サービス      | VODAFONE<br>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<br>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<br>テクノロジー | GLAXOSMITHKLINE<br>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<br>(株) | 簿価<br>単価  | 簿価<br>金額   | 時価<br>単価  | 時価<br>金額   | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------|-------------------|---------------------------|-----|-----------|-----------|------------|-----------|------------|-----------------|
| 13 | アメリカ   | 保険                | AMERICAN<br>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<br>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<br>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<br>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<br>テクノロジー | NOVARTIS<br>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<br>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<br>サービス      | VERIZON<br>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<br>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<br>・タバコ     | COCA-COLA<br>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<br>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<br>サービス      | SBC<br>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<br>・タバコ     | NESTLE<br>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<br>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<br>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<br>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・<br>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<br>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<br>(%) | 償還<br>期限  | 通貨  | 額面金額      | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円) | 時価<br>単価<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|------|----------|--------------------------|-----------|-----------|-----|-----------|-----------------|-------------|-----------------|-------------|-----------------|
| 1 | イタリア | 国債<br>証券 | BUONI<br>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<br>証券 | DEUTSCHLAN<br>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<br>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<br>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<br>証券 | BUONI<br>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<br>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<br>(%) | 償還<br>期限   | 通貨  | 額面金額      | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円) | 時価<br>単価<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------|------|--------------------------|-----------|------------|-----|-----------|-----------------|-------------|-----------------|-------------|-----------------|
| 7  | ベルギー   | 国債証券 | BELGIUM<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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 | BUNDESOBL<br>-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<br>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<br>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<br>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<br>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 | 99.61    |
| 合計       | 99.61    |

(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/<br>売建 | 数量<br>(枚) | 簿価金額<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|----|---------------|-----------|-----------|-------------|-------------|-----------------|
| 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/<br>売建 | 数量<br>(枚) | 簿価金額<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|----------|------|---------------------------------|-----------|-----------|-------------|-------------|-------------|
| 株価指数先物取引 | シカゴ  | S&P500 EMINI<br>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<br>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<br>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 2040

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 2040 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 2040 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。

## I. 目論見書の訂正理由

「PRU グッドライフ 2040 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。

## II. 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                                 | 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 (当ファンド)                         | 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・パフォーマンス                           | 追加型株式投資信託・国内株式型 (一般型)        |
| <u>プルデンシャル私募国内株式マーケット・パフォーマンス (適格機関投資家向け私募)</u> | <u>追加型株式投資信託・国内株式型 (一般型)</u> |
| 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＞

①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。

②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。

③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「②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>

①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。

②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「①平成 15 年 12 月 31 日まで」と同様の取扱いとなります。

③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「①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 | 26,477,207 | 49.64    |
| 投資信託受益証券 (PRU国内債券マザーファンド) | 日 本 | 4,270,150  | 8.00     |
| 投資信託受益証券 (PRU海外株式マザーファンド) | 日 本 | 19,488,756 | 36.54    |
| 投資信託受益証券 (PRU海外債券マザーファンド) | 日 本 | 1,483,310  | 2.78     |
| 現金、預金、その他資産 (負債控除後)       |     | 1,619,467  | 3.04     |
| 合計 (純資産総額)                |     | 53,338,890 | 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

### ① 純資産の推移

|                                    | 純資産総額<br>（円）               | 1万口当たりの純資産額<br>（基準価額）（円） |
|------------------------------------|----------------------------|--------------------------|
| 第1計算期間末（分配付）<br>（平成13年12月10日）（分配落） | 176,295,376<br>176,295,376 | 9,189<br>9,189           |
| 平成14年7月末                           | 75,439,252                 | 8,174                    |
| 平成14年8月末                           | 74,463,694                 | 8,047                    |
| 平成14年9月末                           | 72,222,110                 | 7,786                    |
| 平成14年10月末                          | 71,988,851                 | 7,735                    |
| 平成14年11月末                          | 74,858,811                 | 8,013                    |
| 第2計算期間末（分配付）<br>（平成14年12月10日）（分配落） | 70,958,579<br>70,958,579   | 7,743<br>7,743           |
| 平成14年12月末                          | 69,212,325                 | 7,546                    |
| 平成15年1月末                           | 68,058,551                 | 7,364                    |
| 平成15年2月末                           | 66,931,925                 | 7,253                    |
| 平成15年3月末                           | 67,398,037                 | 7,266                    |
| 平成15年4月末                           | 69,633,111                 | 7,482                    |
| 平成15年5月末                           | 49,490,916                 | 7,788                    |
| 平成15年6月末                           | 51,736,952                 | 8,115                    |
| 平成15年7月末                           | 53,338,890                 | 8,296                    |

### ② 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             |

### ③ 収益率の推移

| 期 間                                    | 収益率（％） |
|----------------------------------------|--------|
| 第1計算期間<br>（平成13年3月16日から平成13年12月10日）    | △ 8.1  |
| 第2計算期間<br>（平成13年12月11日から平成14年12月10日）   | △ 15.7 |
| 第3計算期間中間期<br>（平成14年12月11日から平成15年6月10日） | 3.2    |

\* 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<br>（平成13年3月16日から平成13年12月10日）    | 195,423,951 | 3,559,357   |
| 第2計算期間<br>（平成13年12月11日から平成14年12月10日）   | 10,492,067  | 110,711,121 |
| 第3計算期間中間期<br>（平成14年12月11日から平成15年6月10日） | 3,139,219   | 31,241,649  |

\* 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

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 2040（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 2040 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。

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  
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)

| 区 分       | 当中間計算期間<br>(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   | 1,816,599                 |
| 親投資信託受益証券 | 49,533,708                |
| 未収入金      | 101,026                   |
| 流動資産合計    | 51,451,333                |
| 資産合計      | 51,451,333                |
| 負債の部      |                           |
| 流動負債      |                           |
| 未払解約金     | 102,355                   |
| 未払受託者報酬   | 28,222                    |
| 未払委託者報酬   | 564,357                   |
| その他未払費用   | 1,701                     |
| 流動負債合計    | 696,635                   |
| 負債合計      | 696,635                   |
| 純資産の部     |                           |
| 元本        |                           |
| 元本        | 63,543,110                |
| 欠損金       |                           |
| 剰余金       |                           |
| 中間欠損金     | 12,788,412                |
| (うち中間損失)  | —                         |
| 欠損金合計     | —                         |
| 剰余金合計     | △12,788,412               |
| 純資産合計     | 50,754,698                |
| 負債・純資産合計  | 51,451,333                |

## (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<br>自 平成14年12月11日<br>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         | 1,901,818                                 |
| 営業収益合計            | 1,901,818                                 |
| 営業費用              |                                           |
| 受託者報酬             | 28,222                                    |
| 委託者報酬             | 564,357                                   |
| その他費用             | 1,701                                     |
| 営業費用合計            | 594,280                                   |
| 営業利益又は営業損失 (△)    | 1,307,538                                 |
| 経常利益又は経常損失 (△)    | 1,307,538                                 |
| 中間損失              | —                                         |
| 中間純利益             | 1,307,538                                 |
| 一部解約に伴う中間損失分配額    | —                                         |
| 一部解約に伴う中間純損失分配額   | 300,860                                   |
| 期首欠損金             | 20,686,961                                |
| 欠損金減少額            | 7,078,396                                 |
| (中間一部解約に伴う欠損金減少額) | (7,078,396)                               |

| 区 分               | 当中間計算期間<br>自 平成14年12月11日<br>至 平成15年 6月10日 |
|-------------------|-------------------------------------------|
|                   | 金 額                                       |
| 欠損金増加額            | 788,245                                   |
| (中間追加信託に伴う欠損金増加額) | (788,245)                                 |
| 中間欠損金             | 12,788,412                                |

重要な会計方針

| 区 分             | 当中間計算期間<br>自 平成14年12月11日<br>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<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

注記事項

(中間貸借対照表関係)

| 当中間計算期間<br>(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                                            | 91,645,540 円 |
| 期中追加設定元本額                                        | 3,139,219 円  |
| 期中解約元本額                                          | 31,241,649 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12,788,412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<br>自 平成14年12月11日<br>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             | 16,180 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<br>(平成15年6月10日現在) |          |
|---------------------------|----------|
| 1口当たり純資産額                 | 0.7987 円 |
| (1万口当たり純資産額)              | 7,987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      |                |
| 剰余金      |                |
| 欠損金      | 125,692,252    |
| 欠損金合計    | —              |
| 剰余金合計    | △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<br>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>①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<br>至 平成15年 6月10日                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|----------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                      | <p>②証券取引所に上場されていない有価証券<br/>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>③時価が入手できなかった有価証券<br/>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<br/>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br/>時価評価にあたっては、原則として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<br/>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<br>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<br/>個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>①証券取引所に上場されている有価証券<br/>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。<br/>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と認められた場合は、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>②証券取引所に上場されていない有価証券<br/>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>③時価が入手できなかった有価証券<br/>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<br>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<br/>移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>①証券取引所に上場されている有価証券<br/>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。<br/>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と認められた場合は、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>②証券取引所に上場されていない有価証券<br/>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>③時価が入手できなかった有価証券<br/>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>①先物取引<br/>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br/>時価評価にあたっては、原則として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>②為替予約取引<br/>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<br/>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<br/>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                                  |                 |
| PRU海外株式マーケット・パフォーマー                             | 819,995,964 円   |
| PRUグットライフ2010                                   | 108,674,702 円   |
| PRUグットライフ2020                                   | 45,509,424 円    |
| PRUグットライフ2030                                   | 42,551,094 円    |
| PRUグットライフ2040                                   | 22,129,906 円    |
| PRUグットライフ2010 (年金)                              | 5,894,674 円     |
| PRUグットライフ2020 (年金)                              | 10,624,488 円    |
| PRUグットライフ2030 (年金)                              | 6,770,283 円     |
| PRU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<br>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<br/>個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>①証券取引所に上場されている有価証券<br/>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。<br/>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と認められた場合は、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<br>至 平成15年 6月10日                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                            | <p>②証券取引所に上場されていない有価証券<br/>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>③時価が入手できなかった有価証券<br/>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>①先物取引<br/>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br/>時価評価にあたっては、原則として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>②為替予約取引<br/>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<br/>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<br>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。

① 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。

② 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）

|                     |              |
|---------------------|--------------|
| I 資産総額              | 53,468,426 円 |
| II 負債総額             | 129,536 円    |
| III 純資産総額（I - II）   | 53,338,890 円 |
| IV 発行済数量            | 64,291,697 口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 0.8296 円     |

（参考情報）

PRU 国内株式マザーファンド

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

PRU 国内債券マザーファンド

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

PRU 海外株式マザーファンド

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

PRU 海外債券マザーファンド

|                     |                 |
|---------------------|-----------------|
| I 資産総額              | 4,844,909,761 円 |
| II 負債総額             | 4,531,554 円     |
| III 純資産総額（I - II）   | 4,840,378,207 円 |
| IV 発行済数量            | 3,673,837,504 口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 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<br>単価  | 簿価金額       | 時価<br>単価  | 時価金額       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------------|--------------------|------------|-----------|------------|-----------|------------|-----------------|
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU国内株式<br>マザーファンド | 34,067,431 | 7,080.00  | 24,122,256 | 7,772.00  | 26,477,207 | 49.64           |
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU国内債券<br>マザーファンド | 23,261,825 | 7,666.00  | 17,832,525 | 8,378.00  | 19,488,756 | 36.54           |
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU海外株式<br>マザーファンド | 4,083,533  | 10,396.00 | 4,245,342  | 10,457.00 | 4,270,150  | 8.00            |
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU海外債券<br>マザーファンド | 1,125,852  | 12,365.00 | 1,392,155  | 13,175.00 | 1,483,310  | 2.78            |

（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<br>(株) | 簿価<br>単価   | 簿価<br>金額   | 時価<br>単価     | 時価<br>金額   | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----|------------|------------------|-----|-----------|------------|------------|--------------|------------|-----------------|
| 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<br>(%) | 償還<br>期限   | 通貨  | 額面金額       | 簿価<br>単価 | 簿価金額       | 時価<br>単価 | 時価金額       | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|----|------|----------------|-----------|------------|-----|------------|----------|------------|----------|------------|-----------------|
| 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<br>(%) | 償還<br>期限   | 通貨  | 額面金額       | 簿価<br>単価 | 簿価金額       | 時価<br>単価 | 時価金額       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----|-----------|----------------------------|-----------|------------|-----|------------|----------|------------|----------|------------|-----------------|
| 5  | 日本 | 特殊<br>債券  | 第1回政府保証<br>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<br>券   | 第463回東京電<br>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<br>証券  | 第190回利付国<br>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<br>証券  | 第194回利付国<br>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<br>証券  | 第193回利付国<br>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<br>証券  | 第177回利付国<br>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<br>証券  | 第201回利付国<br>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<br>券   | 第2回昭和シェ<br>ル石油(株)無担<br>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<br>証券  | 第237回利付国<br>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<br>証券  | 第234回利付国<br>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<br>証券  | 第174回利付国<br>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<br>証券  | 第240回利付国<br>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<br>証券  | 第207回利付国<br>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<br>券   | 第18回日石三<br>菱(株)無担保社<br>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<br>証券  | 第244回利付国<br>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<br>債券  | 第597号興業<br>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<br>証券  | 第247回利付国<br>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<br>債証券 | 第109回神奈川<br>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<br>証券  | 第250回利付国<br>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<br>証券  | 第27回利付国<br>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<br>証券  | 第22回利付国<br>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<br>証券  | 第33回利付国<br>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<br>券   | 第262回北陸電<br>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<br>証券  | 第37回利付国<br>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<br>債券  | 第36回政府保<br>証関西国際空港<br>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<br>証券  | 第42回利付国<br>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<br>(株) | 簿価<br>単価  | 簿価<br>金額   | 時価<br>単価  | 時価<br>金額   | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|-------------------|------------------------------------|-----|-----------|-----------|------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | アメリカ | 資本財               | GENERAL ELECTRIC<br>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<br>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・<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>INTERNATIONAL<br>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<br>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<br>製品・機器   | INTL BUSINESS<br>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<br>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<br>ビス      | VODAFONE GROUP<br>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<br>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<br>テクノロジー | GLAXOSMITHKLINE<br>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<br>ソナル用品  | PROCTER & GAMBLE<br>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<br>バコ     | COCA-COLA<br>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<br>ビス      | VERIZON<br>COMMUNICATIONS<br>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<br>テクノロジー | NOVARTIS AG-REG<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>(株) | 簿価<br>単価  | 簿価<br>金額  | 時価<br>単価  | 時価<br>金額  | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------|-----------------|------------------------------|-----|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------------|
| 27 | スイス    | 食品・飲料・タバコ       | NESTLE<br>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<br>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<br>COMMUNICATIONS<br>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<br>(%) | 償還<br>期限   | 通貨  | 額面金額      | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円) | 時価<br>単価<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|----------|--------------------------------|-----------|------------|-----|-----------|-----------------|-------------|-----------------|-------------|-----------------|
| 1  | フランス | 国債<br>証券 | FRENCH<br>TREASURY<br>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<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>証券 | BONOS Y<br>OBLIG<br>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<br>証券 | BUONIPOLIEN<br>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<br>証券 | BUNDESREPUB<br>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<br>証券 | BELGIUM<br>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<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>証券 | BUND<br>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<br>証券 | BUONIPOLIEN<br>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<br>証券 | BUONIPOLIENN<br>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<br>証券 | BUNDESREPUB<br>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<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>証券 | FRANCE<br>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<br>証券 | BUND<br>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<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>証券 | UNITED<br>KINGDOM<br>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<br>証券 | UNITED<br>KINGDOM<br>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<br>証券 | HELLENIC<br>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<br>(%)  | 償還<br>期限   | 通貨  | 額面金額    | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円) | 時価<br>単価<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----------|----------|--------------------------------|------------|------------|-----|---------|-----------------|-------------|-----------------|-------------|-----------------|
| 19 | アメ<br>リカ | 国債<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>リカ | 国債<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>リカ | 国債<br>証券 | US TREASURY<br>N/B             | 11.62<br>5 | 2004/11/15 | USD | 584,000 | 14,074.60       | 82,195,714  | 13,602.32       | 79,437,550  | 1.64            |
| 22 | アメ<br>リカ | 国債<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>リカ | 国債<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>ツ  | 国債<br>証券 | BUNDESREPUB<br>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<br>イン | 国債<br>証券 | BONOS Y<br>OBLIG<br>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<br>リカ | 国債<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>リカ | 国債<br>証券 | US TREASURY<br>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<br>ダ  | 国債<br>証券 | CANADIAN<br>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<br>リス | 国債<br>証券 | UNITED<br>KINGDOM<br>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<br>リカ | 国債<br>証券 | US TREASURY<br>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 | 96.96    |
| 合計       | 96.96    |

(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/<br>売建 | 数量<br>(枚) | 簿価金額<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|----|---------------|-----------|-----------|-------------|-------------|-----------------|
| 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/<br>売建 | 数量<br>(枚) | 簿価金額<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|----------|------|---------------------------------|-----------|-----------|-------------|-------------|-------------|
| 株価指数先物取引 | シカゴ  | S&P500 EMINI<br>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<br>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。



