

# PRUグッドライフ2040（年金）

（愛称：ゴールデン・ゲート）

追加型投信／内外／資産複合

**PGIMジャパン株式会社**

本書は金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書です。

1. 「PRUグッドライフ2040（年金）」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条の規定により有価証券届出書を2021年3月15日に関東財務局長に提出しており、2021年3月16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（年金）」の受益権の価額は、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せんが、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。
3. 「PRUグッドライフ2040（年金）」は、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

## 投資信託説明書（請求目論見書）

### 目 次

|                    |     |
|--------------------|-----|
| 第一部 証券情報           | 1   |
| 第二部 ファンド情報         | 3   |
| 第1 ファンドの状況         | 3   |
| 第2 管理及び運営          | 49  |
| 第3 ファンドの経理状況       | 57  |
| 第4 内国投資信託受益証券事務の概要 | 161 |
| 第三部 委託会社等の情報       | 163 |
| 第1 委託会社等の概況        | 163 |
| （添付）約款             | 202 |

発 行 者 名： P G I Mジャパン株式会社

代表者の役職氏名： 代表取締役社長 國澤 太作

本店の所在の場所： 東京都千代田区永田町二丁目13番10号 プルデンシャルタワー

有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所： 該当事項はありません。

※“Prudential”、“PGIM”、それぞれのロゴおよびロック・シンボルは、プルデンシャル・ファイナンシャル・インクおよびその関連会社のサービスマークであり、多数の国・地域で登録されています。

※P G I Mジャパン株式会社は、世界最大級の金融サービス機関プルデンシャル・ファイナンシャルの一員であり、英国プルデンシャル社とはなんら関係がありません。

## 第一部【証券情報】

### (1) 【ファンドの名称】

PRUグッドライフ2040（年金）（以下「当ファンド」といいます。）

当ファンドとともに「PRUグッドライフ2030（年金）」および「PRUグッドライフ2050（年金）」を総称して「PRUグッドライフ・ファンド（年金）」という名称を使用することがあります。また、これらのファンドを総称して、または各ファンドについて「ゴールデン・ゲート」という愛称を用いることがあります。

### (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

当初元本は1口当たり1円です。

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

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

### (3) 【発行（売出）価額の総額】

1,000億円を上限とします。

### (4) 【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

なお、収益分配金の自動再投資の場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

\* 基準価額は、原則として毎営業日計算されます。

\* 基準価額は、組入有価証券の値動き等により、日々変動します。

基準価額は、委託会社にお問合わせください。なお、委託会社の指定する第一種金融商品取引業者（委託会社の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。）および銀行、保険会社等の登録金融機関（以下総称して「販売会社」といいます。）でも入手できます。また、基準価額は、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」欄に、「年金グッド40」として掲載されます。

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

(5) 【申込手数料】

申込手数料は販売会社が独自に定めるものとします。  
有価証券届出書提出日現在、手数料はありません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位とします。

(7) 【申込期間】

2021年3月16日から2021年9月15日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

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

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

申込みの取扱いを行った販売会社において払込みを取扱います。

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### ①ファンドの目的

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

###### ②信託金の限度額

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

###### ③基本的性格

当ファンドは追加型投信／内外／資産複合に属します。

当ファンドが該当する商品分類および属性区分を**網掛け表示**しています。

##### 商品分類表

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

##### <商品分類表（上記網掛け表示部分）の定義>

###### [単位型・追加型の区分]

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

###### [投資対象地域による区分]

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

###### [投資対象資産（収益の源泉）による区分]

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

属性区分表

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

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

<属性区分表(上記網掛け表示部分)の定義>

[投資対象資産による属性区分]

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分]

グローバル(日本を含む)

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

[投資形態による属性区分]

ファミリーファンド

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

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

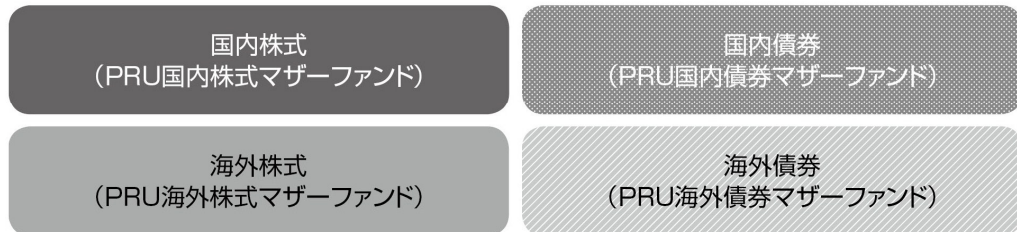
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のインターネットホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

④ファンドの特色



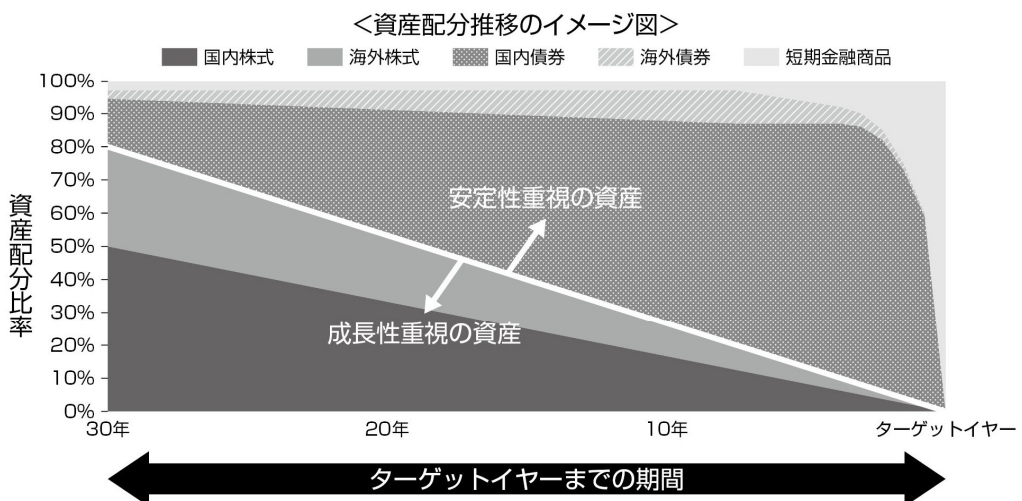
国内および海外の株式・公社債等に分散投資を行います。

▶ 以下の4資産のマザーファンドを主要投資対象とします。



予め設定した償還時期に向けて基本資産配分を段階的に変更します。

▶ 2040年の償還時期(以下、ターゲットイヤー)に向けて、徐々にリスクを低減する運用を行います。  
 ▶ ターゲットイヤーに近づくにつれ、成長性重視の資産(国内株式、海外株式)の組入比率を徐々に減らし、安定性重視の資産(国内債券、海外債券、短期金融商品)の組入比率を徐々に増やします。



※上記はファンドの資産配分の推移のイメージ図であり、実際のファンドの組入比率とは異なります。

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

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

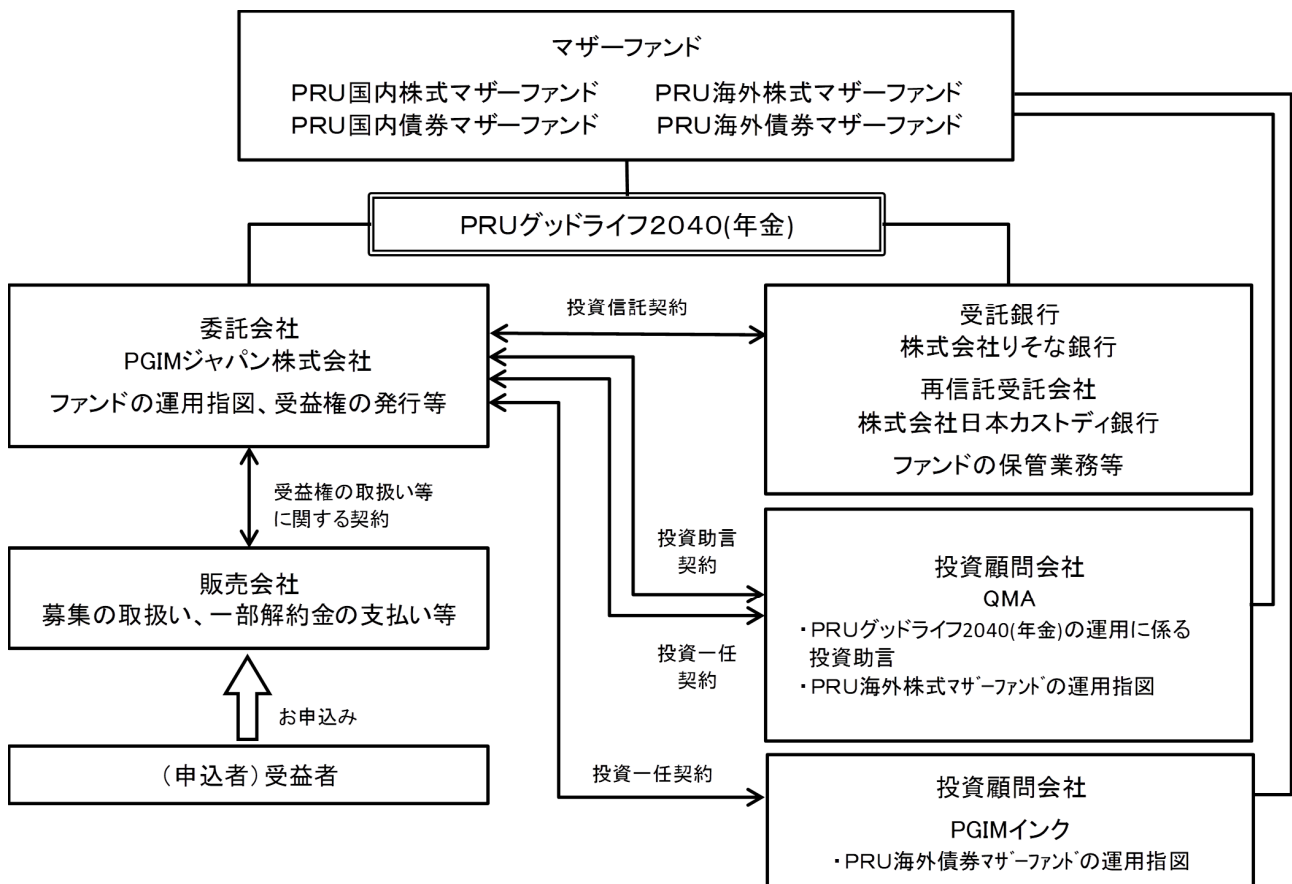
- 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- 当ファンドの償還日は2040年12月14日です。
- 年1回（原則、12月15日。）決算し、収益分配方針に基づいて分配を行います。

(2) 【ファンドの沿革】

|             |  |
|-------------|--|
| 2001年9月28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  |
| 2002年12月31日 | プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン・インク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                          |
| 2006年9月1日   | プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社（委託会社）がプルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン・インクより事業の全部を譲受け、当ファンドの運用を開始 |

(3) 【ファンドの仕組み】

①ファンドの仕組み





②ファンドの関係法人

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

③委託会社等の概況（2021年1月末現在）

a. 資本金の額：219百万円

b. 沿革

|          |  |
|----------|--|
| 2006年4月  | プルデンシャル投信投資顧問準備株式会社設立                      |
| 2006年8月  | プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社に商号変更      |
| 2006年9月  | 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・インクより事業の全部を譲受 |
| 2017年10月 | P G I Mジャパン株式会社に商号変更                       |

c. 大株主の状況

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

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

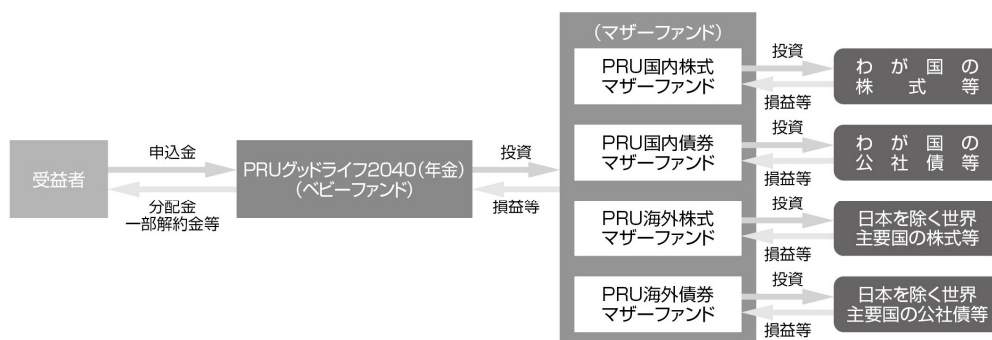
## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### ①基本方針

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

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



(注)収益分配金(税控除後)は、原則として、自動的に再投資されます。

#### ②運用方法

##### a. 投資対象

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

なお、内外の株式・公社債等に直接投資することがあります。

##### b. 投資態度

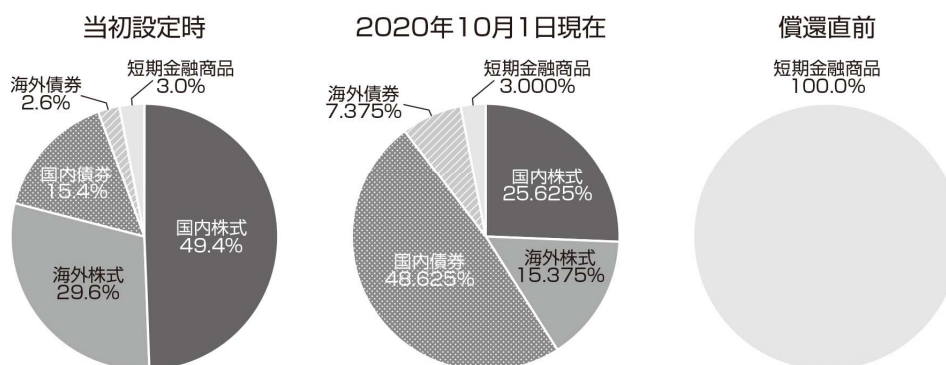
(a) 主として、「PRU国内株式マザーファンド」受益証券、「PRU国内債券マザーファンド」受益証券、「PRU海外株式マザーファンド」受益証券および「PRU海外債券マザーファンド」受益証券への投資を通じて、わが国の株式・公社債等および海外の株式・公社債等への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ投資信託財産の中・長期的な成長を目指します。

(b) 当初設定時は、「PRU国内株式マザーファンド」49.4%、「PRU国内債券マザーファンド」15.4%、「PRU海外株式マザーファンド」29.6%、「PRU海外債券マザーファンド」2.6%およびコール・ローン等の短期金融商品3%の組入比率を基本ガイドラインとし、この基本ガイドラインに基づいてポートフォリオを構築します。

(c) 当初設定後の基本ガイドラインは、償還時期に向け株式の組入比率を漸減させ、公社債および短期金融商品の組入比率を漸増させます。また、この基本ガイドラインに基づいてポートフォリオを変更します。これにより、償還日に近づくにしたがって株価等の変動リスクを低減させる運用を目指します。ただし、市況動向等の変化によっては、基本ガイドラインを見直す場合があります。

基本ガイドラインは以下のとおりです。

＜PRUグッドライフ2040(年金) 基本ガイドラインに基づく組入比率の推移＞



- 当初設定後の基本ガイドラインは、当ファンドの償還時期に向けて、実質的に組入れている株式の組入比率を漸減させ、公社債および短期金融商品の組入比率を漸増させることにより、償還直前には実質的な組入れが短期金融商品100%となるように変化します。
- この基本ガイドラインは、ポートフォリオの基準となる資産配分を意味します。なお、実際のポートフォリオ構築では、基本ガイドラインを基準に一定の範囲内でポートフォリオの構築が行われますので、基本ガイドラインと実際のポートフォリオ（各マザーファンドの組入比率）は必ずしも一致しません。
- 市況動向等の変化によっては、基本ガイドラインを見直す場合があります。

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

(2) 【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- a. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
- (a) 有価証券
  - (b) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記「(5) 投資制限⑩、⑪、⑫」に定めるものに限りません。）
  - (c) 金銭債権（前記(a)、(b)および後記(d)に掲げるものに該当するものを除きます。以下同じ。）
  - (d) 約束手形（前記(a)に掲げるものに該当するものを除きます。以下同じ。）

②有価証券の指図範囲

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

- a. 株券または新株引受権証券
- b. 国債証券
- c. 地方債証券
- d. 特別の法律により法人の発行する債券

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

### ③金融商品の指図範囲

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

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

前記②にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、前記 a. から f. までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

### (3) 【運用体制】

当ファンドは、QMAの助言に基づき、投資運用本部またはグローバル資産運用部のファンド・マネジャーが各マザーファンドへの投資配分を決定し、運用を行います。

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

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

当ファンドの主要投資対象である「PRU海外株式マザーファンド」は、投資一任契約に基づき、QMAが運用を行います。

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

#### ①投資顧問会社の運用体制

##### QMAにおける株式インデックス運用

- QMAは2004年7月に、PGIMインクのクオンティタティブ・マネジメント・チームが独立することにより設立されました。なお、同社はPGIMインクの100%子会社です（以下の説明は、同社の前身であるPGIMインクのクオンティタティブ・マネジメント・チームに関するものを含みません。）。
- 1975年よりクオンツ運用を開始し、その運用資産額は約1,100億米ドル（約11兆円）にのびります。
- 1979年より、株式インデックス運用を開始、運用経験豊富な投資プロフェッショナルにより、投資先の市場の特性に合わせた運用が行われています。

（QMAに関する情報は2020年9月末現在のものです。為替換算レート：1米ドル=105.530円）

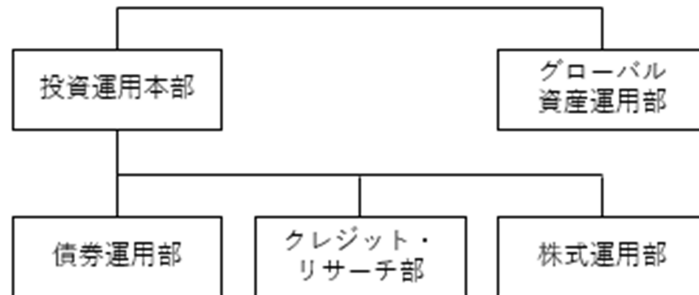
##### PGIMインクにおける債券運用

- 債券の運用額は約9,460億米ドル（約99兆円）  
運用対象としている債券の種類は米国国債、米国投資適格社債、米国ハイイールド債、米国地方債、グローバル債、エマージング債、短期金融商品（マネー・マーケット）等と多岐にわたっており、専門のマネジャーによる付加価値の高い債券運用サービスをご提供しております。
- 独自の信用調査と運用モデル、綿密な分析とリスク管理  
独自の信用調査と運用モデルを駆使して、資産配分や割安と判断される銘柄選定を行います。さらに、リスク管理の際にも綿密な信用分析および独自のモデルを活用し、徹底したリスク管理を図ります。
- 効果の高いボトムアップ・アプローチとトップダウン・アプローチの併用  
債券の種類ごと、社債の業種ごと等の相対的な価値の分析、銘柄の選定および売買執行等は、より専門的なノウハウの活かせるボトムアップ・アプローチで行います。また、投資戦略、資産配分およびリスク管理等は、グローバルで広範な視点から判断できるトップダウン・アプローチを採用しています。
- 一貫した投資プロセスで安定した投資成果の獲得

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

(PGIMインクに関する情報は2020年9月末現在のものです。為替換算レート: 1米ドル=105.530円)

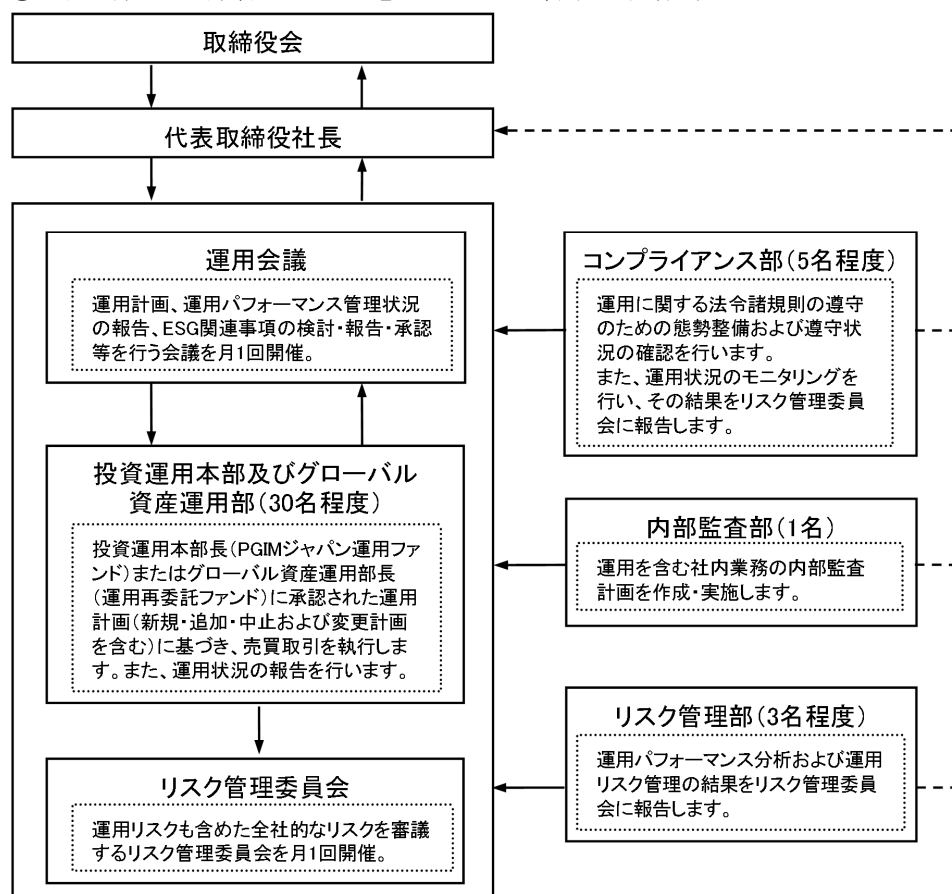
## ②委託会社の運用体制



## ③委託会社の運用体制に関する社内規則

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

## ④委託会社の内部管理および意思決定を監督する組織等



## ⑤委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く。）に対する管理体制

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

「投資顧問会社」に対しては、運用計画書の提出を受け、グローバル資産運用部長の事前承認の後、運用会議に報告を行います。また、定期的に投資顧問会社のモニタリングを行います。

※前記の運用体制等は2021年1月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

毎決算時（原則、12月15日。ただし、休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- 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、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。
  - 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、前記「(1) 投資方針」に基づき運用を行います。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

#### (5) 【投資制限】

- ①株式への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限 ①）  
株式への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限 ②、第28条）  
外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。
- ③新株引受権証券等への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限 ③、第18条）  
新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限 ④、第21条）  
同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤同一銘柄の転換社債等への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限 ⑤、第22条）  
同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑥同一銘柄の新株引受権証券等への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限 ⑥、第21条）  
同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦投資信託証券への投資（投資信託約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限 ⑦、第18条）  
投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑧デリバティブ取引等（一般社団法人投資信託協会の定める「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」に定義するデリバティブ取引等をいう。）について、その取引の目的に応じて、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第18条）
- ⑨一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。（投資信託約款第18条）
- ⑩投資する株式等の範囲（投資信託約款第20条）
  - a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所をいいます。以下同



じ。)に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

- b. 前記 a. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

⑩信用取引の運用指図・目的・範囲（投資信託約款第23条）

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

⑪先物取引等の運用指図（投資信託約款第24条）

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

⑫スワップ取引の運用指図・目的・範囲（投資信託約款第25条）

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

d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑭金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（投資信託約款第26条）

a. 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

b. 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

c. 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

d. 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑮有価証券の貸付けの指図・目的・範囲（投資信託約款第27条）

a. 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

(a) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

b. 前記 a. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

c. 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

⑯特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（投資信託約款第29条）

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

⑰外国為替予約取引の指図・目的・範囲（投資信託約款第30条）

a. 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

b. 前記 a. の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

c. 前記 b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内にその超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

d. 前記 b. において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

⑱資金の借入れの指図・目的・範囲（投資信託約款第38条）

a. 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的とし

て、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は投資信託財産中から支弁します。

⑱デリバティブ取引に係る投資制限

（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

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

⑳同一の法人の発行する株式の投資制限

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

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

(参考) マザーファンドの投資方針

| 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           | 金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。   |
| 投資態度           | <ul style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>② 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ul>  |
| 投資制限           | <ul style="list-style-type: none"> <li>① 株式への投資には制限を設けません。</li> <li>② 外貨建資産への投資は行いません。</li> <li>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。</li> <li>④ 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>⑦ デリバティブ取引等（一般社団法人投資信託協会の定める「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」に定義するデリバティブ取引等をいう。）について、その取引の目的に応じて、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> </ul> |

※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・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。
- 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。
- ⑧ 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。

2021年1月末現在において、「PRU国内株式マザーファンド」に投資しているファンドは、プルデンシャル私募国内株式マーケット・パフォーマー（適格機関投資家向け）、PRUグッドライフ2030（年金）、PRUグッドライフ2040（年金）（当ファンド）、PRUグッドライフ2050（年金）、プルデンシャル私募国内株式・債券バランスファンド（適格機関投資家向け）です。なお、この他にも、今後「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。

| 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           | <ul style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ul>   |
| 投資制限           | <ul style="list-style-type: none"> <li>① 外貨建資産への投資は行いません。</li> <li>② 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>⑧ デリバティブ取引等（一般社団法人投資信託協会の定める「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」に定義するデリバティブ取引等をいう。）について、その取引の目的に応じて、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> </ul> |

※NOMURA-BPI（総合）とは、野村証券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI（総合）の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属します。野村証券株式会社は当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

2021年1月末現在において、「PRU国内債券マザーファンド」に投資しているファンドは、PRUグッドライフ2030（年金）、PRUグッドライフ2040（年金）（当ファンド）、PRUグッドライフ2050（年金）、プルデンシャル私募国内株式・債券バランスファンド（適格機関投資家向け）、プルデンシャル私募国内債券マーケット・パフォーマー（適格機関投資家向け）です。なお、この他にも、今後「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。

| PRU海外株式マザーファンド |   |
|----------------|---|
| 基本方針           | 日本を除く世界の主要国の株式を中心に投資を行い、MSCI KOKUSAIインデックス（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。  |
| 運用方法           |   |
| 投資対象           | 原則として、MSCI KOKUSAIインデックスを構成している国の株式を主要投資対象とします。   |
| 投資態度           | <p>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。</p> <p>② 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>⑥ 運用にあたっては、投資一任契約に基づいてQMAに運用の指図に関する権限を委託します。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 委託する範囲：マザーファンドの運用指図</li> <li>● 委託先所在地：アメリカ合衆国ニュージャージー州ニューアーク、マッカーター・ハイウェイ・アンド・マーケット・ストリート、ゲートウェイ・センター2</li> <li>● 委託に係る費用：後記「4手数料等及び税金 (3) 信託報酬等」をご参照ください。</li> </ul> |
| 投資制限           | <p>① 株式への投資には制限を設けません。</p> <p>② 外貨建資産への投資には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>④ 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>⑦ デリバティブ取引等（一般社団法人投資信託協会の定める「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」に定義するデリバティブ取引等をいう。）について、その取引の目的に応じて、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p>  |

※MSCI KOKUSAIインデックスとは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国で構成されています。また、MSCI KOKUSAIインデックスに対する著作権及びその他知的財産権は、全てMSCI Inc. に帰属します。MSCIでは、かかるデータに基づく投資による損失に一切責任を負いません。「MSCI KOKUSAIインデックス（円換算ベース）」は、「MSCI KOKUSAIインデックス（米ドルベース）」をもとに、MSCI Inc. の承諾を受けたうえで委託会社で計算したものです。

2021年1月末現在において、「PRU海外株式マザーファンド」に投資しているファンドは、PRUグッドライフ2030（年金）、PRUグッドライフ2040（年金）（当ファンド）、PRUグッドライフ2050（年金）、プルデンシャル私募海外株式マーケット・パフォーマンス（適格機関投資家向け）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。

| 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、FTSE世界国債インデックス（除く日本）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。   |
| 運用方法           |   |
| 投資対象           | 日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。   |
| 投資態度           | <p>① FTSE世界国債インデックス（除く日本）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>⑤ 運用にあたっては、投資一任契約に基づいてPGIMインクに運用の指図に関する権限を委託します。</p> <p>●委託する範囲：マザーファンドの運用指図</p> <p>●委託先所在地：アメリカ合衆国ニュージャージー州ニューアーク、ブロード・ストリート655</p> <p>●委託に係る費用：後記「4手数料等及び税金（3）信託報酬等」をご参照ください。</p>  |
| 投資制限           | <p>① 外貨建資産への投資には制限を設けません。</p> <p>② 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>⑧ デリバティブ取引等（一般社団法人投資信託協会の定める「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」に定義するデリバティブ取引等をいう。）について、その取引の目的に応じて、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> |

※FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。本ファンドでは、FTSE世界国債インデックス・データに基づき、委託会社が円換算ベースに計算したものを使用します。

2021年1月末現在において、「PRU海外債券マザーファンド」に投資しているファンドは、PRU海外債券マーケット・パフォーマー、PRUグッドライフ2030（年金）、PRUグッドライフ2040（年金）（当ファンド）、PRUグッドライフ2050（年金）、プルデンシャル私募海外債

券マーケット・パフォーマー（適格機関投資家向け）です。なお、この他にも、今後「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。



### 3【投資リスク】

#### (1) 当ファンドへの投資リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

ファンドが有する主なリスクは以下のとおりです。

##### <資産配分リスク>

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

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

##### <株価変動リスク>

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

##### <金利変動リスク>

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

##### <信用リスク>

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

##### <カントリー・リスク>

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

##### <為替変動リスク>

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

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

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

## (2) 分配金に関する留意点

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

## (3) その他の留意点

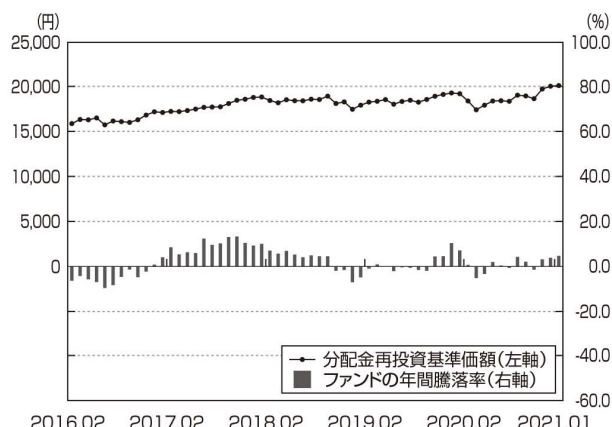
- ・ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- ・当ファンドはマザーファンドを通じて株式や債券など値動きのある証券（外貨建証券には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本を下回ることがあります。
- ・投資信託財産に生じた損益は、すべて受益者に帰属します。
- ・投資信託は預金等とは異なり、預金保険機構の保護の対象ではありません。
- ・投資信託は保険契約とは異なり、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
- ・投資信託を登録金融機関で購入した場合は、投資者保護基金の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

## (4) 投資リスクに対する管理体制

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

## (参考情報)

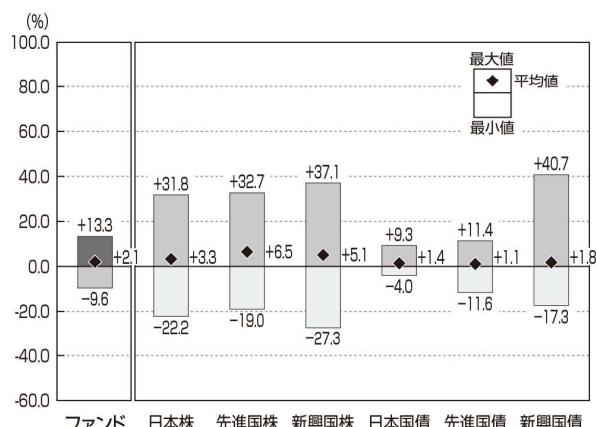
### ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



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

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

### ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2016年2月から2021年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

#### ●各資産クラスの指数

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

#### ●東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

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

#### ●MSCI KOKUSAIインデックス(配当込み)

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

#### ●MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)

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

#### ●NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村証券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属します。野村証券株式会社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

#### ●FTSE世界国債インデックス(除く日本)

「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

#### ●JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド指数

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

申込手数料は販売会社が独自に定めるものとします。  
有価証券届出書提出日現在、手数料はありません。

##### (2)【換金（解約）手数料】

解約時に手数料はかかりません。

##### (3)【信託報酬等】

①信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年0.495%（税抜0.45%）の率を乗じて得た額とします。

運用管理費用（信託報酬）＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

##### 信託報酬の配分

|      |                  |   |
|------|------------------|---|
| 委託会社 | 年0.22%（税抜0.20%）  | 委託した資金の運用の対価                                    |
| 販売会社 | 年0.22%（税抜0.20%）  | 運用報告書等各種書類の送付、<br>口座内でのファンドの管理、<br>購入後の情報提供等の対価 |
| 受託銀行 | 年0.055%（税抜0.05%） | 運用財産の管理、<br>委託会社からの指図の実行の対価                     |

②前記①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。

③信託報酬に係る消費税相当額および地方消費税相当額（以下「消費税等相当額」といいます。）を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

④委託会社は、マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬を、前記①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】

###### ①信託事務の諸費用

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

(a) 売買委託手数料等の有価証券取引等に要する費用および保管費用等

(b) 借入金の利息

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

(a) 投資信託振替制度に係る費用

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

## ②監査報酬

- a. 投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、投資信託財産の純資産総額に年0.0055%（税抜0.005%）の率を乗じて得た額を上限に、かつ当該費用の実費の額以内の額を、当該費用に係る消費税等相当額とともに、投資信託約款に規定する計算期間を通じて、毎日費用計上します。
- b. 前記 a. で定める費用および当該費用に係る消費税等相当額は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日ならびに毎計算期間末および信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

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

## (5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

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

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

- ・ 上記は、2021年1月末現在のものであり、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。
- ・ 税金の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

(2021年1月29日現在)

| 投資資産の種類                      |    | 時価 (円)        | 投資比率 (%) |
|------------------------------|----|---------------|----------|
| 投資信託受益証券<br>(PRU国内株式マザーファンド) | 日本 | 716,397,137   | 28.59    |
| 投資信託受益証券<br>(PRU国内債券マザーファンド) | 日本 | 1,011,691,429 | 40.38    |
| 投資信託受益証券<br>(PRU海外株式マザーファンド) | 日本 | 588,445,983   | 23.49    |
| 投資信託受益証券<br>(PRU海外債券マザーファンド) | 日本 | 163,125,601   | 6.51     |
| 現金、預金、その他の資産 (負債控除後)         |    | 25,847,773    | 1.03     |
| 合計 (純資産総額)                   |    | 2,505,507,923 | 100.00   |

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

#### (参考情報)

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

(2021年1月29日現在)

| 投資資産の種類              |    | 時価 (円)        | 投資比率 (%) |
|----------------------|----|---------------|----------|
| 株式                   | 日本 | 3,073,997,240 | 96.56    |
| 現金・預金・その他の資産 (負債控除後) |    | 109,657,245   | 3.44     |
| 合計 (純資産総額)           |    | 3,183,654,485 | 100.00   |

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

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

(2021年1月29日現在)

| 投資資産の種類              |    | 時価 (円)        | 投資比率 (%) |
|----------------------|----|---------------|----------|
| 国債証券                 | 日本 | 3,677,341,850 | 79.90    |
| 地方債証券                | 日本 | 418,870,200   | 9.10     |
| 特殊債券                 | 日本 | 320,334,250   | 6.96     |
| 社債券                  | 日本 | 118,360,650   | 2.57     |
| 現金・預金・その他の資産 (負債控除後) |    | 67,577,542    | 1.47     |
| 合計 (純資産総額)           |    | 4,602,484,492 | 100.00   |

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

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

(2021年1月29日現在)

| 投資資産の種類   | 時価 (円)   | 投資比率 (%)      |       |
|-----------|----------|---------------|-------|
| 株式        | アメリカ     | 1,848,995,405 | 63.85 |
|           | イギリス     | 122,282,014   | 4.22  |
|           | スイス      | 95,288,585    | 3.29  |
|           | カナダ      | 93,162,107    | 3.22  |
|           | フランス     | 90,327,328    | 3.12  |
|           | ドイツ      | 83,656,985    | 2.89  |
|           | オーストラリア  | 58,816,236    | 2.03  |
|           | オランダ     | 51,085,926    | 1.76  |
|           | アイルランド   | 48,580,635    | 1.68  |
|           | スウェーデン   | 29,971,139    | 1.03  |
|           | デンマーク    | 22,640,896    | 0.78  |
|           | 香港       | 22,570,049    | 0.78  |
|           | スペイン     | 21,578,161    | 0.75  |
|           | イタリア     | 16,583,077    | 0.57  |
|           | フィンランド   | 11,151,078    | 0.39  |
|           | ジャージー    | 9,896,286     | 0.34  |
|           | バミューダ    | 8,675,634     | 0.30  |
|           | シンガポール   | 8,669,422     | 0.30  |
|           | ベルギー     | 8,234,014     | 0.28  |
|           | イスラエル    | 5,583,666     | 0.19  |
|           | ケイマン島    | 5,226,108     | 0.18  |
|           | ノルウェー    | 5,169,201     | 0.18  |
|           | ニュージーランド | 3,415,206     | 0.12  |
|           | ルクセンブルク  | 2,275,625     | 0.08  |
|           | キュラソー    | 1,717,300     | 0.06  |
|           | ポルトガル    | 1,599,082     | 0.06  |
|           | オーストリア   | 1,528,936     | 0.05  |
| リベリア      | 793,578  | 0.03          |       |
| パナマ       | 598,106  | 0.02          |       |
| マン島       | 576,409  | 0.02          |       |
| パプアニューギニア | 422,822  | 0.01          |       |

| 投資資産の種類              |         | 時価 (円)        | 投資比率 (%) |
|----------------------|---------|---------------|----------|
| 投資証券                 | アメリカ    | 77,330,589    | 2.67     |
|                      | オーストラリア | 3,657,861     | 0.13     |
|                      | フランス    | 1,772,323     | 0.06     |
|                      | イギリス    | 1,702,191     | 0.06     |
|                      | シンガポール  | 1,320,265     | 0.05     |
|                      | 香港      | 1,102,394     | 0.04     |
|                      | カナダ     | 211,510       | 0.01     |
| 現金・預金・その他の資産 (負債控除後) |         | 127,754,150   | 4.41     |
| 合計 (純資産総額)           |         | 2,895,922,299 | 100.00   |

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

(注2) 時価は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。



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

(2021年1月29日現在)

| 投資資産の種類              | 時価 (円)        | 投資比率 (%)      |       |
|----------------------|---------------|---------------|-------|
| 国債証券                 | アメリカ          | 2,082,970,773 | 40.89 |
|                      | フランス          | 534,729,339   | 10.50 |
|                      | イタリア          | 513,003,664   | 10.07 |
|                      | ドイツ           | 384,711,646   | 7.55  |
|                      | イギリス          | 310,600,219   | 6.10  |
|                      | スペイン          | 302,948,225   | 5.95  |
|                      | オーストラリア       | 162,991,897   | 3.20  |
|                      | ベルギー          | 119,254,237   | 2.34  |
|                      | オランダ          | 96,543,033    | 1.90  |
|                      | オーストリア        | 68,083,832    | 1.34  |
|                      | カナダ           | 67,124,858    | 1.32  |
|                      | マレーシア         | 57,146,784    | 1.12  |
|                      | ポーランド         | 49,680,329    | 0.98  |
|                      | フィンランド        | 47,519,675    | 0.93  |
|                      | アイルランド        | 46,599,771    | 0.91  |
|                      | メキシコ          | 35,301,617    | 0.69  |
|                      | デンマーク         | 34,827,847    | 0.68  |
|                      | イスラエル         | 24,272,128    | 0.48  |
|                      | シンガポール        | 22,798,918    | 0.45  |
|                      | ノルウェー         | 15,383,045    | 0.30  |
| スウェーデン               | 14,109,656    | 0.28          |       |
| 小計                   | 4,990,601,493 | 97.98         |       |
| 現金・預金・その他の資産 (負債控除後) | 103,057,543   | 2.02          |       |
| 合計 (純資産総額)           | 5,093,659,036 | 100.00        |       |

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

(注2) 時価は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。

(2) 【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

(2021年1月29日現在)

主要銘柄の明細

(単位：円)

| 地域 | 種類           | 銘柄                 | 数量          | 簿価単価   | 簿価金額          | 時価単価   | 時価金額          | 投資比率 (%) |
|----|--------------|--------------------|-------------|--------|---------------|--------|---------------|----------|
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU国内債券<br>マザーファンド | 745,150,939 | 1.3613 | 1,014,447,299 | 1.3577 | 1,011,691,429 | 40.38    |
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU国内株式<br>マザーファンド | 346,537,579 | 2.0342 | 704,944,828   | 2.0673 | 716,397,137   | 28.59    |
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU海外株式<br>マザーファンド | 180,837,733 | 3.1342 | 566,793,960   | 3.2540 | 588,445,983   | 23.49    |
| 日本 | 投資信託<br>受益証券 | PRU海外債券<br>マザーファンド | 65,970,640  | 2.4801 | 163,619,734   | 2.4727 | 163,125,601   | 6.51     |

(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

|    | 地域 | 種類 | 業種     | 銘柄名               | 数量     | 簿価単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円) | 時価単価<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----|----|--------|-------------------|--------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------|
| 1  | 日本 | 株式 | 輸送用機器  | トヨタ自動車            | 13,700 | 7,204.00    | 98,694,800  | 7,300.00    | 100,010,000 | 3.14            |
| 2  | 日本 | 株式 | 電気機器   | ソニー               | 7,700  | 9,679.88    | 74,535,076  | 10,050.00   | 77,385,000  | 2.43            |
| 3  | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | ソフトバンクグループ        | 9,500  | 7,123.00    | 67,668,500  | 8,108.00    | 77,026,000  | 2.42            |
| 4  | 日本 | 株式 | 電気機器   | キーエンス             | 1,100  | 51,850.00   | 57,035,000  | 56,140.00   | 61,754,000  | 1.94            |
| 5  | 日本 | 株式 | その他製品  | 任天堂               | 800    | 57,770.00   | 46,216,000  | 60,580.00   | 48,464,000  | 1.52            |
| 6  | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 日本電信電話            | 16,100 | 2,533.50    | 40,789,350  | 2,618.00    | 42,149,800  | 1.32            |
| 7  | 日本 | 株式 | 電気機器   | 日本電産              | 3,000  | 12,790.00   | 38,370,000  | 13,850.00   | 41,550,000  | 1.31            |
| 8  | 日本 | 株式 | 銀行業    | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 82,900 | 448.52      | 37,182,308  | 469.30      | 38,904,970  | 1.22            |
| 9  | 日本 | 株式 | 化学     | 信越化学工業            | 2,100  | 17,300.00   | 36,330,000  | 18,175.00   | 38,167,500  | 1.20            |
| 10 | 日本 | 株式 | サービス業  | リクルートホールディングス     | 8,400  | 4,057.65    | 34,084,260  | 4,542.00    | 38,152,800  | 1.20            |
| 11 | 日本 | 株式 | 医薬品    | 武田薬品工業            | 10,200 | 3,870.00    | 39,474,000  | 3,698.00    | 37,719,600  | 1.18            |
| 12 | 日本 | 株式 | 電気機器   | 村田製作所             | 3,600  | 8,848.00    | 31,852,800  | 10,055.00   | 36,198,000  | 1.14            |
| 13 | 日本 | 株式 | 機械     | ダイキン工業            | 1,600  | 23,220.00   | 37,152,000  | 22,105.00   | 35,368,000  | 1.11            |
| 14 | 日本 | 株式 | 医薬品    | 第一三共              | 10,500 | 3,484.00    | 36,582,000  | 3,365.00    | 35,332,500  | 1.11            |
| 15 | 日本 | 株式 | 電気機器   | ファナック             | 1,200  | 25,865.00   | 31,038,000  | 27,365.00   | 32,838,000  | 1.03            |
| 16 | 日本 | 株式 | 精密機器   | HOYA              | 2,400  | 12,735.00   | 30,564,000  | 13,395.00   | 32,148,000  | 1.01            |
| 17 | 日本 | 株式 | 電気機器   | 東京エレクトロン          | 800    | 36,890.00   | 29,512,000  | 39,810.00   | 31,848,000  | 1.00            |
| 18 | 日本 | 株式 | 銀行業    | 三井住友フィナンシャルグループ   | 8,400  | 3,082.75    | 25,895,100  | 3,245.00    | 27,258,000  | 0.86            |
| 19 | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | KDDI              | 8,800  | 2,969.00    | 26,127,200  | 3,079.00    | 27,095,200  | 0.85            |
| 20 | 日本 | 株式 | 輸送用機器  | 本田技研工業            | 9,700  | 3,116.36    | 30,228,692  | 2,764.50    | 26,815,650  | 0.84            |
| 21 | 日本 | 株式 | 電気機器   | 日立製作所             | 5,900  | 4,064.52    | 23,980,668  | 4,306.00    | 25,405,400  | 0.80            |
| 22 | 日本 | 株式 | 機械     | SMC               | 400    | 64,510.00   | 25,804,000  | 63,360.00   | 25,344,000  | 0.80            |
| 23 | 日本 | 株式 | 卸売業    | 伊藤忠商事             | 8,400  | 2,902.50    | 24,381,000  | 2,997.50    | 25,179,000  | 0.79            |
| 24 | 日本 | 株式 | サービス業  | エムスリー             | 2,600  | 8,450.00    | 21,970,000  | 8,811.00    | 22,908,600  | 0.72            |
| 25 | 日本 | 株式 | 銀行業    | みずほフィナンシャルグループ    | 16,400 | 1,332.50    | 21,853,000  | 1,378.50    | 22,607,400  | 0.71            |
| 26 | 日本 | 株式 | 保険業    | 東京海上ホールディングス      | 4,300  | 5,273.00    | 22,673,900  | 5,133.00    | 22,071,900  | 0.69            |
| 27 | 日本 | 株式 | 化学     | 花王                | 2,900  | 7,767.00    | 22,524,300  | 7,597.00    | 22,031,300  | 0.69            |
| 28 | 日本 | 株式 | 卸売業    | 三菱商事              | 7,900  | 2,516.00    | 19,876,400  | 2,647.50    | 20,915,250  | 0.66            |
| 29 | 日本 | 株式 | 医薬品    | 中外製薬              | 3,800  | 5,038.00    | 19,144,400  | 5,472.00    | 20,793,600  | 0.65            |
| 30 | 日本 | 株式 | 卸売業    | 三井物産              | 10,400 | 1,910.00    | 19,864,000  | 1,936.50    | 20,139,600  | 0.63            |

(注) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

PRU国内債券マザーファンド

|    | 地域 | 種類   | 銘柄名            | 利率<br>(%) | 償還期限       | 数量         | 簿価単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円) | 時価単価<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----|------|----------------|-----------|------------|------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------|
| 1  | 日本 | 国債証券 | 第419回利付国債（2年）  | 0.1       | 2022/12/1  | 50,000,000 | 100.42      | 50,212,000  | 100.43      | 50,215,500  | 1.09            |
| 2  | 日本 | 国債証券 | 第334回利付国債（10年） | 0.6       | 2024/6/20  | 45,000,000 | 102.60      | 46,173,600  | 102.46      | 46,107,450  | 1.00            |
| 3  | 日本 | 国債証券 | 第347回利付国債（10年） | 0.1       | 2027/6/20  | 45,000,000 | 101.28      | 45,576,450  | 101.25      | 45,562,950  | 0.99            |
| 4  | 日本 | 国債証券 | 第352回利付国債（10年） | 0.1       | 2028/9/20  | 45,000,000 | 101.29      | 45,580,500  | 101.18      | 45,534,600  | 0.99            |
| 5  | 日本 | 国債証券 | 第329回利付国債（10年） | 0.8       | 2023/6/20  | 40,000,000 | 102.38      | 40,955,200  | 102.20      | 40,883,200  | 0.89            |
| 6  | 日本 | 国債証券 | 第331回利付国債（10年） | 0.6       | 2023/9/20  | 40,000,000 | 102.06      | 40,826,800  | 101.91      | 40,766,000  | 0.89            |
| 7  | 日本 | 国債証券 | 第350回利付国債（10年） | 0.1       | 2028/3/20  | 40,000,000 | 101.35      | 40,542,000  | 101.25      | 40,501,600  | 0.88            |
| 8  | 日本 | 国債証券 | 第346回利付国債（10年） | 0.1       | 2027/3/20  | 40,000,000 | 101.26      | 40,505,200  | 101.23      | 40,493,200  | 0.88            |
| 9  | 日本 | 国債証券 | 第351回利付国債（10年） | 0.1       | 2028/6/20  | 40,000,000 | 101.32      | 40,530,000  | 101.22      | 40,489,200  | 0.88            |
| 10 | 日本 | 国債証券 | 第344回利付国債（10年） | 0.1       | 2026/9/20  | 40,000,000 | 101.16      | 40,465,200  | 101.16      | 40,464,400  | 0.88            |
| 11 | 日本 | 国債証券 | 第355回利付国債（10年） | 0.1       | 2029/6/20  | 40,000,000 | 101.19      | 40,479,200  | 101.04      | 40,419,600  | 0.88            |
| 12 | 日本 | 国債証券 | 第358回利付国債（10年） | 0.1       | 2030/3/20  | 40,000,000 | 100.97      | 40,389,600  | 100.82      | 40,328,000  | 0.88            |
| 13 | 日本 | 国債証券 | 第138回利付国債（5年）  | 0.1       | 2023/12/20 | 40,000,000 | 100.74      | 40,298,400  | 100.66      | 40,266,000  | 0.87            |
| 14 | 日本 | 国債証券 | 第134回利付国債（5年）  | 0.1       | 2022/12/20 | 40,000,000 | 100.50      | 40,203,600  | 100.43      | 40,173,200  | 0.87            |
| 15 | 日本 | 国債証券 | 第330回利付国債（10年） | 0.8       | 2023/9/20  | 35,000,000 | 102.62      | 35,919,100  | 102.42      | 35,850,150  | 0.78            |
| 16 | 日本 | 国債証券 | 第340回利付国債（10年） | 0.4       | 2025/9/20  | 35,000,000 | 102.47      | 35,866,950  | 102.42      | 35,847,700  | 0.78            |
| 17 | 日本 | 国債証券 | 第335回利付国債（10年） | 0.5       | 2024/9/20  | 35,000,000 | 102.41      | 35,844,900  | 102.28      | 35,798,000  | 0.78            |
| 18 | 日本 | 国債証券 | 第338回利付国債（10年） | 0.4       | 2025/3/20  | 35,000,000 | 102.30      | 35,805,700  | 102.17      | 35,762,300  | 0.78            |
| 19 | 日本 | 国債証券 | 第332回利付国債（10年） | 0.6       | 2023/12/20 | 35,000,000 | 102.25      | 35,788,550  | 102.09      | 35,733,950  | 0.78            |
| 20 | 日本 | 国債証券 | 第141回利付国債（5年）  | 0.1       | 2024/9/20  | 35,000,000 | 100.93      | 35,326,200  | 100.83      | 35,293,650  | 0.77            |
| 21 | 日本 | 国債証券 | 第33回利付国債（30年）  | 2         | 2040/9/20  | 25,000,000 | 130.64      | 32,662,250  | 129.00      | 32,251,750  | 0.70            |
| 22 | 日本 | 国債証券 | 第339回利付国債（10年） | 0.4       | 2025/6/20  | 30,000,000 | 102.39      | 30,717,600  | 102.31      | 30,693,600  | 0.67            |
| 23 | 日本 | 国債証券 | 第349回利付国債（10年） | 0.1       | 2027/12/20 | 30,000,000 | 101.34      | 30,403,200  | 101.28      | 30,384,000  | 0.66            |
| 24 | 日本 | 国債証券 | 第343回利付国債（10年） | 0.1       | 2026/6/20  | 30,000,000 | 101.14      | 30,342,000  | 101.13      | 30,340,800  | 0.66            |
| 25 | 日本 | 国債証券 | 第142回利付国債（5年）  | 0.1       | 2024/12/20 | 30,000,000 | 100.97      | 30,291,900  | 100.89      | 30,269,100  | 0.66            |
| 26 | 日本 | 国債証券 | 第360回利付国債（10年） | 0.1       | 2030/9/20  | 30,000,000 | 100.78      | 30,234,300  | 100.62      | 30,187,200  | 0.66            |
| 27 | 日本 | 国債証券 | 第136回利付国債（5年）  | 0.1       | 2023/6/20  | 30,000,000 | 100.60      | 30,182,700  | 100.54      | 30,164,700  | 0.66            |
| 28 | 日本 | 国債証券 | 第113回利付国債（20年） | 2.1       | 2029/9/20  | 25,000,000 | 118.75      | 29,689,500  | 118.28      | 29,570,500  | 0.64            |
| 29 | 日本 | 国債証券 | 第149回利付国債（20年） | 1.5       | 2034/6/20  | 25,000,000 | 117.90      | 29,476,000  | 117.01      | 29,254,250  | 0.64            |
| 30 | 日本 | 国債証券 | 第150回利付国債（20年） | 1.4       | 2034/9/20  | 25,000,000 | 116.72      | 29,180,500  | 115.84      | 28,962,000  | 0.63            |

(注) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

PRU海外株式マザーファンド

|    | 地域   | 種類   | 業種                     | 銘柄名                        | 数量    | 簿価単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円) | 時価単価<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|------|------------------------|----------------------------|-------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------|
| 1  | アメリカ | 株式   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | APPLE INC                  | 9,410 | 12,805.36   | 120,498,450 | 14,323.16   | 134,780,966 | 4.65            |
| 2  | アメリカ | 株式   | ソフトウェア・サービス            | MICROSOFT CORP             | 3,955 | 22,426.57   | 88,697,119  | 24,963.40   | 98,730,272  | 3.41            |
| 3  | アメリカ | 株式   | 小売                     | AMAZON.COM INC             | 234   | 330,534.60  | 77,345,097  | 338,266.53  | 79,154,370  | 2.73            |
| 4  | アメリカ | 株式   | メディア・娯楽                | FACEBOOK INC-A             | 1,320 | 29,197.98   | 38,541,335  | 27,687.20   | 36,547,104  | 1.26            |
| 5  | アメリカ | 株式   | 自動車・自動車部品              | TESLA INC                  | 410   | 62,638.89   | 25,681,947  | 87,285.72   | 35,787,148  | 1.24            |
| 6  | アメリカ | 株式   | メディア・娯楽                | ALPHABET INC-CL C          | 165   | 190,794.06  | 31,481,020  | 194,657.73  | 32,118,526  | 1.11            |
| 7  | アメリカ | 株式   | メディア・娯楽                | ALPHABET INC-CL A          | 165   | 190,354.20  | 31,408,443  | 193,622.33  | 31,947,685  | 1.10            |
| 8  | アメリカ | 投資証券 | —                      | iShares Core S&P 500 ETF   | 700   | 39,018.46   | 27,312,927  | 39,603.14   | 27,722,201  | 0.96            |
| 9  | アメリカ | 株式   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | JOHNSON & JOHNSON          | 1,443 | 15,704.38   | 22,661,434  | 17,673.83   | 25,503,347  | 0.88            |
| 10 | アメリカ | 株式   | 銀行                     | JPMORGAN CHASE & CO        | 1,670 | 12,779.99   | 21,342,589  | 13,593.89   | 22,701,801  | 0.78            |
| 11 | アメリカ | 株式   | ソフトウェア・サービス            | VISA INC                   | 925   | 22,210.35   | 20,544,582  | 20,710.02   | 19,156,774  | 0.66            |
| 12 | スイス  | 株式   | 食品・飲料・タバコ              | NESTLE SA-REGISTERED       | 1,578 | 11,643.25   | 18,373,063  | 12,070.92   | 19,047,916  | 0.66            |
| 13 | アメリカ | 株式   | 家庭用品・パーソナル用品           | PROCTER & GAMBLE CO        | 1,364 | 14,360.77   | 19,588,098  | 13,620.01   | 18,577,697  | 0.64            |
| 14 | アメリカ | 株式   | 半導体・半導体製造装置            | NVIDIA CORP                | 340   | 56,629.20   | 19,253,929  | 54,542.73   | 18,544,531  | 0.64            |
| 15 | アメリカ | 株式   | 各種金融                   | BERKSHIRE HATHAWAY INC     | 765   | 24,152.64   | 18,476,771  | 24,129.65   | 18,459,187  | 0.64            |
| 16 | アメリカ | 株式   | ヘルスケア機器・サービス           | UNITEDHEALTH GROUP INC     | 520   | 36,519.93   | 18,990,368  | 35,329.91   | 18,371,554  | 0.63            |
| 17 | アメリカ | 株式   | メディア・娯楽                | WALT DISNEY CO             | 991   | 16,136.93   | 15,991,703  | 17,958.02   | 17,796,400  | 0.61            |
| 18 | アメリカ | 株式   | 小売                     | HOME DEPOT INC             | 595   | 27,592.12   | 16,417,313  | 29,050.66   | 17,285,145  | 0.60            |
| 19 | アメリカ | 株式   | ソフトウェア・サービス            | MASTERCARD INC-CLASS A     | 495   | 35,940.07   | 17,790,337  | 33,880.77   | 16,770,983  | 0.58            |
| 20 | アメリカ | 株式   | ソフトウェア・サービス            | PAYPAL HOLDINGS INC        | 620   | 22,845.57   | 14,164,254  | 24,844.30   | 15,403,466  | 0.53            |
| 21 | スイス  | 株式   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | ROCHE HOLDING AG-GENUSSS   | 390   | 35,570.29   | 13,872,416  | 37,250.20   | 14,527,580  | 0.50            |
| 22 | アメリカ | 株式   | メディア・娯楽                | NETFLIX INC                | 245   | 52,176.04   | 12,783,130  | 56,272.92   | 13,786,867  | 0.48            |
| 23 | アメリカ | 株式   | 半導体・半導体製造装置            | INTEL CORP                 | 2,330 | 5,417.28    | 12,622,281  | 5,857.67    | 13,648,374  | 0.47            |
| 24 | アメリカ | 株式   | 銀行                     | BANK OF AMERICA CORP       | 4,271 | 3,059.17    | 13,065,734  | 3,167.83    | 13,529,817  | 0.47            |
| 25 | アメリカ | 株式   | メディア・娯楽                | COMCAST CORP-CL A          | 2,494 | 5,398.48    | 13,463,813  | 5,391.16    | 13,445,573  | 0.46            |
| 26 | オランダ | 株式   | 半導体・半導体製造装置            | ASML HOLDING NV            | 233   | 47,895.44   | 11,159,639  | 56,789.51   | 13,231,958  | 0.46            |
| 27 | アメリカ | 株式   | 電気通信サービス               | VERIZON COMMUNICATIONS INC | 2,270 | 6,424.47    | 14,583,559  | 5,785.05    | 13,132,081  | 0.45            |
| 28 | アメリカ | 株式   | ソフトウェア・サービス            | ADOBE INC                  | 264   | 50,846.23   | 13,423,406  | 48,653.20   | 12,844,445  | 0.44            |
| 29 | アメリカ | 株式   | ヘルスケア機器・サービス           | ABBOTT LABORATORIES        | 969   | 11,273.39   | 10,923,916  | 12,578.34   | 12,188,418  | 0.42            |
| 30 | アメリカ | 株式   | ソフトウェア・サービス            | SALESFORCE.COM INC         | 503   | 23,613.52   | 11,877,603  | 23,664.71   | 11,903,354  | 0.41            |

(注1) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

(注2) 時価は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。

PRU海外債券マザーファンド

|    | 地域    | 種類   | 銘柄名                      | 利率 (%) | 償還期限       | 数量        | 簿価単価 (円)  | 簿価金額 (円)    | 時価単価 (円)  | 時価金額 (円)    | 投資比率 (%) |
|----|-------|------|--------------------------|--------|------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|----------|
| 1  | アメリカ  | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2.25   | 2024/11/15 | 2,260,000 | 11,242.21 | 254,074,063 | 11,224.66 | 253,677,373 | 4.98     |
| 2  | アメリカ  | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2.5    | 2024/5/15  | 1,335,000 | 11,248.74 | 150,170,747 | 11,230.78 | 149,930,980 | 2.94     |
| 3  | アメリカ  | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2      | 2021/11/15 | 1,130,000 | 10,633.28 | 120,156,118 | 10,605.94 | 119,847,149 | 2.35     |
| 4  | アメリカ  | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2.125  | 2025/5/15  | 915,000   | 11,254.46 | 102,978,311 | 11,244.25 | 102,884,910 | 2.02     |
| 5  | フランス  | 国債証券 | FRANCE O. A. T.          | 8.5    | 2023/4/25  | 645,000   | 15,448.26 | 99,641,323  | 15,276.65 | 98,534,451  | 1.93     |
| 6  | アメリカ  | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 1.75   | 2022/3/31  | 890,000   | 10,669.20 | 94,955,925  | 10,648.80 | 94,774,321  | 1.86     |
| 7  | アメリカ  | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 6.375  | 2027/8/15  | 640,000   | 14,378.65 | 92,023,376  | 14,288.86 | 91,448,719  | 1.80     |
| 8  | イタリア  | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5      | 2039/8/1   | 435,000   | 20,797.52 | 90,469,215  | 20,749.34 | 90,259,644  | 1.77     |
| 9  | フランス  | 国債証券 | FRANCE O. A. T.          | 5.75   | 2032/10/25 | 390,000   | 21,823.07 | 85,109,989  | 21,709.72 | 84,667,919  | 1.66     |
| 10 | アメリカ  | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2.875  | 2046/11/15 | 625,000   | 13,133.86 | 82,086,671  | 12,880.01 | 80,500,076  | 1.58     |
| 11 | イタリア  | 国債証券 | REPUBLIC OF ITALY GOVERN | 5.125  | 2024/7/31  | 535,000   | 14,989.01 | 80,191,248  | 14,879.73 | 79,606,607  | 1.56     |
| 12 | ドイツ   | 国債証券 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA | 3.25   | 2042/7/4   | 335,000   | 22,586.79 | 75,665,774  | 22,540.72 | 75,511,417  | 1.48     |
| 13 | アメリカ  | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 5.25   | 2028/11/15 | 520,000   | 14,060.72 | 73,115,744  | 13,948.89 | 72,534,254  | 1.42     |
| 14 | アメリカ  | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 3      | 2045/5/15  | 540,000   | 13,342.82 | 72,051,268  | 13,098.77 | 70,733,372  | 1.39     |
| 15 | アメリカ  | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 1.625  | 2022/8/15  | 610,000   | 10,707.97 | 65,318,663  | 10,692.88 | 65,226,569  | 1.28     |
| 16 | ドイツ   | 国債証券 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA | 1      | 2025/8/15  | 465,000   | 13,715.12 | 63,775,328  | 13,693.53 | 63,674,934  | 1.25     |
| 17 | イギリス  | 国債証券 | UNITED KINGDOM GILT      | 1.75   | 2049/1/22  | 330,000   | 17,300.24 | 57,090,794  | 17,606.34 | 58,100,937  | 1.14     |
| 18 | スペイン  | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.75   | 2032/7/30  | 275,000   | 20,776.86 | 57,136,391  | 20,676.25 | 56,859,700  | 1.12     |
| 19 | イタリア  | 国債証券 | ITALY BUONI POLIENNALI D | 6.5    | 2027/11/1  | 315,000   | 18,008.12 | 56,725,582  | 17,886.16 | 56,341,433  | 1.11     |
| 20 | スペイン  | 国債証券 | SPAIN GOVERNMENT BOND    | 4.65   | 2025/7/30  | 360,000   | 15,673.84 | 56,425,840  | 15,575.05 | 56,070,183  | 1.10     |
| 21 | アメリカ  | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 4.75   | 2041/2/15  | 325,000   | 16,538.45 | 53,749,971  | 16,232.35 | 52,755,162  | 1.04     |
| 22 | マレーシア | 国債証券 | MALAYSIA GOVERNMENT BOND | 3.48   | 2023/3/15  | 1,955,000 | 2,669.66  | 52,191,989  | 2,665.32  | 52,107,035  | 1.02     |
| 23 | フランス  | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT BOND O | 3.5    | 2026/4/25  | 335,000   | 15,508.75 | 51,954,313  | 15,440.67 | 51,726,273  | 1.02     |
| 24 | イタリア  | 国債証券 | ITALY BUONI POLIENNALI D | 4.5    | 2026/3/1   | 330,000   | 15,586.76 | 51,436,317  | 15,495.69 | 51,135,801  | 1.00     |
| 25 | イギリス  | 国債証券 | UNITED KINGDOM GILT      | 3.5    | 2045/1/22  | 220,000   | 22,371.95 | 49,218,309  | 22,686.52 | 49,910,362  | 0.98     |
| 26 | アメリカ  | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 3.375  | 2044/5/15  | 360,000   | 14,090.51 | 50,725,864  | 13,831.35 | 49,792,878  | 0.98     |
| 27 | フランス  | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT BOND O | 4      | 2038/10/25 | 230,000   | 21,708.69 | 49,929,991  | 21,587.46 | 49,651,174  | 0.97     |
| 28 | アメリカ  | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2.5    | 2045/2/15  | 410,000   | 12,258.44 | 50,259,604  | 12,029.48 | 49,320,878  | 0.97     |
| 29 | イタリア  | 国債証券 | ITALY BUONI POLIENNALI D | 3.75   | 2021/3/1   | 385,000   | 12,774.44 | 49,181,602  | 12,690.71 | 48,859,242  | 0.96     |
| 30 | イギリス  | 国債証券 | UNITED KINGDOM GILT      | 4.25   | 2040/12/7  | 200,000   | 23,383.93 | 46,767,860  | 23,616.72 | 47,233,447  | 0.93     |

(注1) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

(注2) 時価は、対顧客電信売買相場の仲値により円換算しております。

全銘柄の種類別投資比率

| 種類       | 投資比率 (%) |
|----------|----------|
| 投資信託受益証券 | 98.97    |
| 合計       | 98.97    |

(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         | 0.14     |
|    | 建設業        | 2.20     |
|    | 食料品        | 3.41     |
|    | 繊維製品       | 0.45     |
|    | パルプ・紙      | 0.23     |
|    | 化学         | 7.22     |
|    | 医薬品        | 5.73     |
|    | 石油・石炭製品    | 0.40     |
|    | ゴム製品       | 0.53     |
|    | ガラス・土石製品   | 0.76     |
|    | 鉄鋼         | 0.56     |
|    | 非鉄金属       | 0.72     |
|    | 金属製品       | 0.55     |
|    | 機械         | 5.65     |
|    | 電気機器       | 17.37    |
|    | 輸送用機器      | 6.84     |
|    | 精密機器       | 2.53     |
|    | その他製品      | 2.68     |
|    | 電気・ガス業     | 1.28     |
|    | 陸運業        | 3.28     |
|    | 海運業        | 0.17     |
|    | 空運業        | 0.35     |
|    | 倉庫・運輸関連業   | 0.14     |
|    | 情報・通信業     | 8.77     |
|    | 卸売業        | 4.39     |
|    | 小売業        | 4.73     |
|    | 銀行業        | 4.39     |
|    | 証券、商品先物取引業 | 0.78     |
|    | 保険業        | 1.81     |
|    | その他金融業     | 1.06     |
|    | 不動産業       | 1.87     |
|    | サービス業      | 5.48     |
|    | 合計         | 96.56    |

(注) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

PRU国内債券マザーファンド

| 種類    | 投資比率 (%) |
|-------|----------|
| 国債証券  | 79.90    |
| 地方債証券 | 9.10     |
| 特殊債券  | 6.96     |
| 社債券   | 2.57     |
| 合計    | 98.53    |

(注) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。

PRU海外株式マザーファンド

| 業種          |                        | 投資比率 (%) |
|-------------|------------------------|----------|
| 株式          | エネルギー                  | 2.90     |
|             | 素材                     | 4.17     |
|             | 資本財                    | 6.05     |
|             | 商業・専門サービス              | 1.07     |
|             | 運輸                     | 1.84     |
|             | 自動車・自動車部品              | 2.13     |
|             | 耐久消費財・アパレル             | 1.82     |
|             | 消費者サービス                | 1.45     |
|             | メディア・娯楽                | 6.59     |
|             | 小売                     | 5.73     |
|             | 食品・生活必需品小売り            | 1.36     |
|             | 食品・飲料・タバコ              | 3.82     |
|             | 家庭用品・パーソナル用品           | 1.79     |
|             | ヘルスケア機器・サービス           | 5.00     |
|             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.57     |
|             | 銀行                     | 5.28     |
|             | 各種金融                   | 4.14     |
|             | 保険                     | 2.96     |
|             | 不動産                    | 0.42     |
|             | ソフトウェア・サービス            | 11.40    |
|             | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 6.07     |
|             | 電気通信サービス               | 1.72     |
|             | 公益事業                   | 3.05     |
| 半導体・半導体製造装置 | 4.28                   |          |
| 投資証券        | —                      | 3.01     |
| 合計          |                        | 95.59    |

(注) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価金額の比率です。



PRU海外債券マザーファンド

| 種類   | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 国債証券 | 97.98    |
| 合計   | 97.98    |

(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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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

(2021年1月29日現在)

| 種類           | 取引所 | 資産名      | 買建/<br>売建 | 数量<br>(枚) | 通貨  | 簿価金額<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|--------------|-----|----------|-----------|-----------|-----|-------------|-------------|-------------|
| 株価指数<br>先物取引 | 大証  | 東証株価指数先物 | 買建        | 5         | 日本円 | 87,680,500  | 90,200,000  | 2.83        |

(注) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価比率です。

PRU海外株式マザーファンド

(2021年1月29日現在)

| 種類       | 取引所  | 資産名          | 買建/<br>売建 | 数量<br>(枚) | 簿価金額<br>(円) | 時価金額<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|----------|------|--------------|-----------|-----------|-------------|-------------|-------------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | S&P EMINI FU | 買建        | 5         | 96,309,356  | 98,715,316  | 3.41        |
| 株価指数先物取引 | ドイツ  | EURO STOXX50 | 買建        | 3         | 13,385,281  | 13,462,531  | 0.46        |
| 株価指数先物取引 | イギリス | FTSE 100 IDX | 買建        | 1         | 9,257,779   | 9,280,519   | 0.32        |

(注1) 投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価比率です。

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

## (3) 【運用実績】

## ① 【純資産の推移】

|               |       | 純資産総額 (円)     | 1 万口当たりの純資産額<br>(基準価額) (円) |
|---------------|-------|---------------|----------------------------|
| 第 1 計算期間末     | (分配付) | 1,041,017     | 10,410                     |
| (2001年12月17日) | (分配落) | 1,041,017     | 10,410                     |
| 第 2 計算期間末     | (分配付) | 5,333,880     | 8,740                      |
| (2002年12月16日) | (分配落) | 5,333,880     | 8,740                      |
| 第 3 計算期間末     | (分配付) | 17,876,944    | 10,017                     |
| (2003年12月15日) | (分配落) | 17,876,944    | 10,017                     |
| 第 4 計算期間末     | (分配付) | 91,399,814    | 10,820                     |
| (2004年12月15日) | (分配落) | 91,399,814    | 10,820                     |
| 第 5 計算期間末     | (分配付) | 246,373,257   | 13,956                     |
| (2005年12月15日) | (分配落) | 246,373,257   | 13,956                     |
| 第 6 計算期間末     | (分配付) | 351,971,821   | 15,149                     |
| (2006年12月15日) | (分配落) | 351,971,821   | 15,149                     |
| 第 7 計算期間末     | (分配付) | 423,504,006   | 14,721                     |
| (2007年12月17日) | (分配落) | 423,504,006   | 14,721                     |
| 第 8 計算期間末     | (分配付) | 571,396,492   | 9,702                      |
| (2008年12月15日) | (分配落) | 571,396,492   | 9,702                      |
| 第 9 計算期間末     | (分配付) | 789,392,277   | 10,728                     |
| (2009年12月15日) | (分配落) | 789,392,277   | 10,728                     |
| 第10計算期間末      | (分配付) | 914,817,292   | 10,989                     |
| (2010年12月15日) | (分配落) | 914,817,292   | 10,989                     |
| 第11計算期間末      | (分配付) | 923,397,299   | 9,913                      |
| (2011年12月15日) | (分配落) | 923,397,299   | 9,913                      |
| 第12計算期間末      | (分配付) | 1,094,876,341 | 11,127                     |
| (2012年12月17日) | (分配落) | 1,094,876,341 | 11,127                     |
| 第13計算期間末      | (分配付) | 1,439,315,364 | 14,518                     |
| (2013年12月16日) | (分配落) | 1,439,315,364 | 14,518                     |
| 第14計算期間末      | (分配付) | 1,662,267,781 | 16,162                     |
| (2014年12月15日) | (分配落) | 1,662,267,781 | 16,162                     |
| 第15計算期間末      | (分配付) | 1,770,933,742 | 16,768                     |
| (2015年12月15日) | (分配落) | 1,770,933,742 | 16,768                     |
| 第16計算期間末      | (分配付) | 1,886,268,360 | 17,270                     |
| (2016年12月15日) | (分配落) | 1,886,268,360 | 17,270                     |
| 第17計算期間末      | (分配付) | 2,100,665,632 | 18,613                     |
| (2017年12月15日) | (分配落) | 2,100,665,632 | 18,613                     |

|                     |  | 純資産総額 (円)     | 1 万口当たりの純資産額<br>(基準価額) (円) |
|---------------------|--|---------------|----------------------------|
| 第18計算期間末 (分配付)      |  | 2,134,733,738 | 17,934                     |
| (2018年12月17日) (分配落) |  | 2,134,733,738 | 17,934                     |
| 第19計算期間末 (分配付)      |  | 2,355,903,184 | 19,228                     |
| (2019年12月16日) (分配落) |  | 2,355,903,184 | 19,228                     |
| 2020年1月末日           |  | 2,376,506,310 | 19,184                     |
| 2020年2月末日           |  | 2,287,550,754 | 18,378                     |
| 2020年3月末日           |  | 2,129,928,201 | 17,398                     |
| 2020年4月末日           |  | 2,193,001,299 | 17,910                     |
| 2020年5月末日           |  | 2,247,419,766 | 18,376                     |
| 2020年6月末日           |  | 2,252,532,212 | 18,403                     |
| 2020年7月末日           |  | 2,247,242,199 | 18,339                     |
| 2020年8月末日           |  | 2,308,643,763 | 19,019                     |
| 2020年9月末日           |  | 2,309,402,638 | 18,937                     |
| 2020年10月末日          |  | 2,285,085,860 | 18,631                     |
| 2020年11月末日          |  | 2,432,148,290 | 19,709                     |
| 第20計算期間末 (分配付)      |  | 2,459,036,281 | 19,871                     |
| (2020年12月15日) (分配落) |  | 2,459,036,281 | 19,871                     |
| 2020年12月末日          |  | 2,476,428,957 | 20,013                     |
| 2021年1月末日           |  | 2,505,507,923 | 20,087                     |

## ②【分配の推移】

| 決算期      |             | 1万口当たりの分配金<br>(円) |
|----------|-------------|-------------------|
| 第1計算期間末  | 2001年12月17日 | 0                 |
| 第2計算期間末  | 2002年12月16日 | 0                 |
| 第3計算期間末  | 2003年12月15日 | 0                 |
| 第4計算期間末  | 2004年12月15日 | 0                 |
| 第5計算期間末  | 2005年12月15日 | 0                 |
| 第6計算期間末  | 2006年12月15日 | 0                 |
| 第7計算期間末  | 2007年12月17日 | 0                 |
| 第8計算期間末  | 2008年12月15日 | 0                 |
| 第9計算期間末  | 2009年12月15日 | 0                 |
| 第10計算期間末 | 2010年12月15日 | 0                 |
| 第11計算期間末 | 2011年12月15日 | 0                 |
| 第12計算期間末 | 2012年12月17日 | 0                 |
| 第13計算期間末 | 2013年12月16日 | 0                 |
| 第14計算期間末 | 2014年12月15日 | 0                 |
| 第15計算期間末 | 2015年12月15日 | 0                 |
| 第16計算期間末 | 2016年12月15日 | 0                 |
| 第17計算期間末 | 2017年12月15日 | 0                 |
| 第18計算期間末 | 2018年12月17日 | 0                 |
| 第19計算期間末 | 2019年12月16日 | 0                 |
| 第20計算期間末 | 2020年12月15日 | 0                 |

③【収益率の推移】

| 期間                                    | 収益率 (%) |
|---------------------------------------|---------|
| 第1計算期間<br>(2001年9月28日から2001年12月17日)   | 4.1     |
| 第2計算期間<br>(2001年12月18日から2002年12月16日)  | △16.0   |
| 第3計算期間<br>(2002年12月17日から2003年12月15日)  | 14.6    |
| 第4計算期間<br>(2003年12月16日から2004年12月15日)  | 8.0     |
| 第5計算期間<br>(2004年12月16日から2005年12月15日)  | 29.0    |
| 第6計算期間<br>(2005年12月16日から2006年12月15日)  | 8.5     |
| 第7計算期間<br>(2006年12月16日から2007年12月17日)  | △2.8    |
| 第8計算期間<br>(2007年12月18日から2008年12月15日)  | △34.1   |
| 第9計算期間<br>(2008年12月16日から2009年12月15日)  | 10.6    |
| 第10計算期間<br>(2009年12月16日から2010年12月15日) | 2.4     |
| 第11計算期間<br>(2010年12月16日から2011年12月15日) | △9.8    |
| 第12計算期間<br>(2011年12月16日から2012年12月17日) | 12.2    |
| 第13計算期間<br>(2012年12月18日から2013年12月16日) | 30.5    |
| 第14計算期間<br>(2013年12月17日から2014年12月15日) | 11.3    |
| 第15計算期間<br>(2014年12月16日から2015年12月15日) | 3.7     |
| 第16計算期間<br>(2015年12月16日から2016年12月15日) | 3.0     |
| 第17計算期間<br>(2016年12月16日から2017年12月15日) | 7.8     |

| 期間                                    | 収益率 (%) |
|---------------------------------------|---------|
| 第18計算期間<br>(2017年12月16日から2018年12月17日) | △3.6    |
| 第19計算期間<br>(2018年12月18日から2019年12月16日) | 7.2     |
| 第20計算期間<br>(2019年12月17日から2020年12月15日) | 3.3     |

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

| 期間                                    | 設定数量 (口)    | 解約数量 (口)    |
|---------------------------------------|-------------|-------------|
| 第1計算期間<br>(2001年9月28日から2001年12月17日)   | 1,000,000   | —           |
| 第2計算期間<br>(2001年12月18日から2002年12月16日)  | 5,180,466   | 77,842      |
| 第3計算期間<br>(2002年12月17日から2003年12月15日)  | 14,757,376  | 3,012,677   |
| 第4計算期間<br>(2003年12月16日から2004年12月15日)  | 71,008,463  | 4,384,116   |
| 第5計算期間<br>(2004年12月16日から2005年12月15日)  | 141,107,843 | 49,044,007  |
| 第6計算期間<br>(2005年12月16日から2006年12月15日)  | 141,919,897 | 86,111,011  |
| 第7計算期間<br>(2006年12月16日から2007年12月17日)  | 145,684,384 | 90,346,723  |
| 第8計算期間<br>(2007年12月18日から2008年12月15日)  | 399,618,213 | 98,332,145  |
| 第9計算期間<br>(2008年12月16日から2009年12月15日)  | 188,988,168 | 42,137,915  |
| 第10計算期間<br>(2009年12月16日から2010年12月15日) | 182,452,120 | 85,799,993  |
| 第11計算期間<br>(2010年12月16日から2011年12月15日) | 174,306,875 | 75,283,772  |
| 第12計算期間<br>(2011年12月16日から2012年12月17日) | 150,810,110 | 98,313,048  |
| 第13計算期間<br>(2012年12月18日から2013年12月16日) | 204,565,130 | 197,152,217 |
| 第14計算期間<br>(2013年12月17日から2014年12月15日) | 159,077,489 | 121,969,073 |
| 第15計算期間<br>(2014年12月16日から2015年12月15日) | 189,913,220 | 162,297,287 |
| 第16計算期間<br>(2015年12月16日から2016年12月15日) | 114,995,296 | 78,929,556  |

| 期間                                    | 設定数量（口）     | 解約数量（口）     |
|---------------------------------------|-------------|-------------|
| 第17計算期間<br>(2016年12月16日から2017年12月15日) | 161,179,128 | 124,789,716 |
| 第18計算期間<br>(2017年12月16日から2018年12月17日) | 155,492,057 | 93,733,525  |
| 第19計算期間<br>(2018年12月18日から2019年12月16日) | 140,643,525 | 105,734,037 |
| 第20計算期間<br>(2019年12月17日から2020年12月15日) | 168,763,332 | 156,485,624 |

(注) 本邦外における設定・解約の実績はありません。



## 基準価額・純資産の推移



|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 20,087円 |
| 純資産総額 | 25.05億円 |

## 分配の推移 (1万口当たり、税引前)

|             |    |
|-------------|----|
| 2016年12月15日 | 0円 |
| 2017年12月15日 | 0円 |
| 2018年12月17日 | 0円 |
| 2019年12月16日 | 0円 |
| 2020年12月15日 | 0円 |
| 設定来累計       | 0円 |

(注)基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## 主要な資産の状況

## PRUグッドライフ2040(年金)

| 資産の種類               | 投資比率    |
|---------------------|---------|
| PRU国内株式マザーファンド      | 28.59%  |
| PRU国内債券マザーファンド      | 40.38%  |
| PRU海外株式マザーファンド      | 23.49%  |
| PRU海外債券マザーファンド      | 6.51%   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | 1.03%   |
| 合計(純資産総額)           | 100.00% |

## PRU国内株式マザーファンド

|    | 組入上位業種 | 投資比率  |
|----|--------|-------|
| 1  | 電気機器   | 17.4% |
| 2  | 情報・通信業 | 8.8%  |
| 3  | 化学     | 7.2%  |
| 4  | 輸送用機器  | 6.8%  |
| 5  | 医薬品    | 5.7%  |
| 6  | 機械     | 5.7%  |
| 7  | サービス業  | 5.5%  |
| 8  | 小売業    | 4.7%  |
| 9  | 銀行業    | 4.4%  |
| 10 | 卸売業    | 4.4%  |

|    | 種類 | 組入上位10銘柄          | 業種     | 投資比率  |
|----|----|-------------------|--------|-------|
| 1  | 株式 | トヨタ自動車            | 輸送用機器  | 3.14% |
| 2  | 株式 | ソニー               | 電気機器   | 2.43% |
| 3  | 株式 | ソフトバンクグループ        | 情報・通信業 | 2.42% |
| 4  | 株式 | キーエンス             | 電気機器   | 1.94% |
| 5  | 株式 | 任天堂               | その他製品  | 1.52% |
| 6  | 株式 | 日本電信電話            | 情報・通信業 | 1.32% |
| 7  | 株式 | 日本電産              | 電気機器   | 1.31% |
| 8  | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 1.22% |
| 9  | 株式 | 信越化学工業            | 化学     | 1.20% |
| 10 | 株式 | リクルートホールディングス     | サービス業  | 1.20% |

## PRU国内債券マザーファンド

| 種類別構成               | 投資比率    |
|---------------------|---------|
| 国債証券                | 79.90%  |
| 地方債証券               | 9.10%   |
| 特殊債券                | 6.96%   |
| 社債券                 | 2.57%   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | 1.47%   |
| 合計(純資産総額)           | 100.00% |

|    | 種類   | 組入上位10銘柄       | 投資比率  |
|----|------|----------------|-------|
| 1  | 国債証券 | 第419回利付国債(2年)  | 1.09% |
| 2  | 国債証券 | 第334回利付国債(10年) | 1.00% |
| 3  | 国債証券 | 第347回利付国債(10年) | 0.99% |
| 4  | 国債証券 | 第352回利付国債(10年) | 0.99% |
| 5  | 国債証券 | 第329回利付国債(10年) | 0.89% |
| 6  | 国債証券 | 第331回利付国債(10年) | 0.89% |
| 7  | 国債証券 | 第350回利付国債(10年) | 0.88% |
| 8  | 国債証券 | 第346回利付国債(10年) | 0.88% |
| 9  | 国債証券 | 第351回利付国債(10年) | 0.88% |
| 10 | 国債証券 | 第344回利付国債(10年) | 0.88% |

## 主要な資産の状況

### PRU海外株式マザーファンド

| 通貨別構成   | 投資比率   |
|---------|--------|
| 米ドル     | 71.8%  |
| ユーロ     | 10.5%  |
| 英ポンド    | 4.7%   |
| 加ドル     | 3.3%   |
| スイス・フラン | 3.2%   |
| その他     | 6.6%   |
| 合計      | 100.0% |

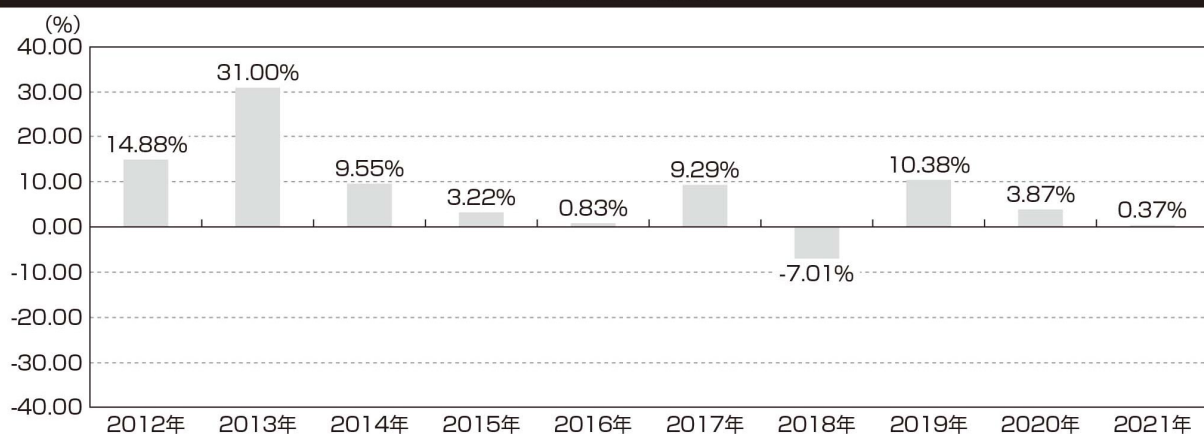
|    | 国    | 組入上位10銘柄                 | 業種                     | 投資比率  |
|----|------|--------------------------|------------------------|-------|
| 1  | アメリカ | APPLE INC                | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 4.65% |
| 2  | アメリカ | MICROSOFT CORP           | ソフトウェア・サービス            | 3.41% |
| 3  | アメリカ | AMAZON.COM INC           | 小売                     | 2.73% |
| 4  | アメリカ | FACEBOOK INC-A           | メディア・娯楽                | 1.26% |
| 5  | アメリカ | TESLA INC                | 自動車・自動車部品              | 1.24% |
| 6  | アメリカ | ALPHABET INC-CL C        | メディア・娯楽                | 1.11% |
| 7  | アメリカ | ALPHABET INC-CL A        | メディア・娯楽                | 1.10% |
| 8  | アメリカ | iShares Core S&P 500 ETF | —                      | 0.96% |
| 9  | アメリカ | JOHNSON & JOHNSON        | 医薬品/バイオテクノロジー/ライフサイエンス | 0.88% |
| 10 | アメリカ | JPMORGAN CHASE & CO      | 銀行                     | 0.78% |

### PRU海外債券マザーファンド

| 通貨別構成 | 投資比率   |
|-------|--------|
| 米ドル   | 42.2%  |
| ユーロ   | 41.6%  |
| 英ポンド  | 6.8%   |
| その他   | 9.4%   |
| 合計    | 100.0% |

|    | 国    | 種類   | 組入上位10銘柄                 | クーポン   | 償還日         | 投資比率  |
|----|------|------|--------------------------|--------|-------------|-------|
| 1  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2.250% | 2024年11月15日 | 4.98% |
| 2  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2.500% | 2024年5月15日  | 2.94% |
| 3  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2.000% | 2021年11月15日 | 2.35% |
| 4  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2.125% | 2025年5月15日  | 2.02% |
| 5  | フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T.            | 8.500% | 2023年4月25日  | 1.93% |
| 6  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 1.750% | 2022年3月31日  | 1.86% |
| 7  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 6.375% | 2027年8月15日  | 1.80% |
| 8  | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.000% | 2039年8月1日   | 1.77% |
| 9  | フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T.            | 5.750% | 2032年10月25日 | 1.66% |
| 10 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 2.875% | 2046年11月15日 | 1.58% |

## 年間収益率の推移



(注1) ファンドの年間収益率は、基準価額を使用して計算しております。

(注2) 2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

(注3) 当ファンドにはベンチマークはありません。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### (1) 申込方法

- ①当ファンドの取得申込者は、販売会社取引口座を開設し、取得の申込みを行うものとします。
- ②当ファンドの取得申込みは、「自動けいぞく投資コース」によるものとします。
- ③原則として、毎営業日に取得の申込みができます。ただし、ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所またはニューヨークもしくはロンドンの銀行の休業日の場合には、お申込みの受付はいたしません。

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

(注2) 2021年9月末までの日本における営業日でニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所またはニューヨークもしくはロンドンの銀行の休業日に該当する日は以下のとおりです。

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

2021年4月2日                      2021年4月5日                      2021年5月31日                      2021年7月5日  
2021年8月30日                      2021年9月6日

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

#### (2) 申込価額

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

- \* 「基準価額」とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。ただし、便宜上1万口当たり換算した価額で表示されることがあります。
- \* 基準価額は、原則として毎営業日計算されます。
- \* 基準価額は、組入有価証券の値動き等により、日々変動します。

基準価額は、前記「(1) 申込方法」に記載の委託会社にお問合わせください。なお、各販売会社でも入手できます。また、基準価額は、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」欄に、「年金グッド40」として掲載されます。

#### (3) 申込手数料

申込手数料は販売会社が独自に定めるものとします。  
有価証券届出書提出日現在、手数料はありません。

(4) 申込単位

1円以上1円単位とします。

(5) 申込取扱場所

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

(6) 申込代金の支払い

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

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

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

### 一部解約

- ①受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。
- ②前記①の規定にかかわらず、ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所またはニューヨークもしくはロンドンの銀行の休業日においては、一部解約の実行の請求を受付けないものとします。
- ③受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ④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。
- ⑤一部解約の価額は、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。

- ⑥委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。
- ⑦一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして前記⑤に準じて計算された価額とします。
- ⑧一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において受益者に支払われます。
- ⑨一部解約の価額は、前記「1申込（販売）手続等（1）申込方法」に記載の委託会社にお問合わせください。
- ⑩一部解約の実行の請求の受け付けは営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合には、翌営業日の取扱いとなります。
- ⑪一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。受益証券をお手元で保有されている方は、一部解約の実行の請求に際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

当ファンドの主要投資対象の評価方法は以下のとおりです。

マザーファンド受益証券：計算日における基準価額で評価します。

(参考) マザーファンドの主要投資対象の評価方法

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

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

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

- ②基準価額は、原則として毎営業日計算されます。
- ③基準価額は、組入有価証券の値動き等により、日々変動します。
- ④基準価額は、前記「1申込（販売）手続等（1）申込方法」に記載の委託会社にお問合わせください。なお、各販売会社でも入手できます。また、基準価額は、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」欄に、「年金グッド40」として掲載されます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

当ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日（2001年9月28日）から2040年12月14日までとします。ただし、後記「(5) その他 ①信託の終了」の場合には、当該信託の終了の日までとなります。

(4) 【計算期間】

①当ファンドの計算期間は、毎年12月16日から翌年12月15日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は2001年9月28日から2001年12月17日までとします。

②前記①の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

①信託の終了

a. 投資信託契約の解約

(a) 委託会社は、信託期間中において、当ファンドの投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託銀行と合意のうえ、当ファンドの投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

(b) 委託会社は、前記(a)の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を当ファンドの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドの投資信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(c) 前記(b)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

(d) 前記(c)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記(a)の投資信託契約の解約をしません。

(e) 委託会社は、当ファンドの投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(f) 前記(c)から(e)までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記(c)の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

b. 投資信託契約に関する監督官庁の命令

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

c. 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

(a) 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、当ファンドの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

(b) 前記(a)の規定にかかわらず、監督官庁が当ファンドの投資信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、後記「②投

資信託約款の変更」のd. に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託銀行との間において存続します。

d. 受託銀行の辞任および解任に伴う取扱い

- (a) 受託銀行は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託銀行がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託銀行の解任を請求することができます。受託銀行が辞任した場合、または裁判所が受託銀行を解任した場合、委託会社は、後記「②投資信託約款の変更」にしたがい、新受託銀行を選任します。
- (b) 委託会社が新受託銀行を選任できないときは、委託会社は当ファンドの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

③運用報告書等の作成

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

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

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受託銀行による資金の立替え

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

c. 立替金の決済および利息については、受託銀行と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

⑥委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

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

⑦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。

⑧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。

⑨ファンド資産の保管

a. 保管業務の委任

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

b. 有価証券の保管

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

c. 混蔵寄託

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

d. 投資信託財産の登記等および記載等の留保等

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

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

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

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

⑩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。

⑪関係法人との契約の更新に関する手続き

a. 販売会社との「投資信託受益権の取扱い等に関する契約書」（別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含みます。）に係る契約の有効期間は、契約締結の日から1年間とします。ただし、期間満了の3ヵ月前までに委託会社、販売会社のいずれからも別段の意思表示



のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。ただし、期間中において、必要のあるときは、契約の一部を変更することができるものとします。

- b. 投資顧問会社との「投資助言契約」に係る契約の有効期間は、契約締結の日から、当ファンドの信託の終了する日までとします。ただし、期間中において、必要のあるときは、契約の一部を変更することができるものとします。
- c. 前記 a.、b. の契約の一部を変更する場合、その変更の内容が重大であるものに関しては、有価証券届出書の訂正届出書または臨時報告書を提出することにより開示します。

#### 4【受益者の権利等】

当ファンドの投資信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。委託会社は、当初設定に係る信託の受益権については100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど追加口数に、それぞれ均等に分割します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生じることはありません。受益者の有する主な権利は次のとおりです。

##### (1) 収益分配金に対する請求権

受託銀行が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に支払われます。この場合、販売会社は、別に定める契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、投資信託約款の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

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

##### (2) 償還金に対する請求権

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

②受益者が償還金について、前記①の支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託銀行から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

##### (3) 一部解約の実行の請求権

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

(4) 反対者の買取請求権

①前記「3 資産管理等の概要 (5) その他 ①信託の終了 a. 投資信託契約の解約」の投資信託契約の解約または「②投資信託約款の変更」の投資信託約款の変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を經由して、受託銀行に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

②前記①の買取請求の事務取扱い等については、委託会社と受託銀行との協議により定めます。

(5) 受益者集会

受益者集会は開催しません。

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期計算期間（2019年12月17日から2020年12月15日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

# 独立監査人の監査報告書

2021年2月24日

PGIMジャパン株式会社

取締役会 御中

## PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士



### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているPRUグッドライフ2040（年金）の2019年12月17日から2020年12月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、PRUグッドライフ2040（年金）の2020年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、PGIMジャパン株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取

引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

PGIMジャパン株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

# 1 【財務諸表】

## 【PRUグッドライフ2040（年金）】

### （1）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第19期<br>(2019年12月16日現在) | 第20期<br>(2020年12月15日現在) |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                         |                         |
| 流動資産            |                         |                         |
| コール・ローン         | 39,533,782              | 27,406,878              |
| 親投資信託受益証券       | 2,322,512,382           | 2,431,685,916           |
| 未収入金            | 527,376                 | 6,356,865               |
| 流動資産合計          | 2,362,573,540           | 2,465,449,659           |
| 資産合計            | 2,362,573,540           | 2,465,449,659           |
| <b>負債の部</b>     |                         |                         |
| 流動負債            |                         |                         |
| 未払解約金           | 535,135                 | 67,827                  |
| 未払受託者報酬         | 612,438                 | 633,995                 |
| 未払委託者報酬         | 4,899,462               | 5,071,845               |
| 未払利息            | 108                     | 75                      |
| その他未払費用         | 623,213                 | 639,636                 |
| 流動負債合計          | 6,670,356               | 6,413,378               |
| 負債合計            | 6,670,356               | 6,413,378               |
| <b>純資産の部</b>    |                         |                         |
| 元本等             |                         |                         |
| 元本              | 1,225,251,100           | 1,237,528,808           |
| 剰余金             |                         |                         |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 1,130,652,084           | 1,221,507,473           |
| （分配準備積立金）       | 506,812,977             | 533,364,963             |
| 元本等合計           | 2,355,903,184           | 2,459,036,281           |
| 純資産合計           | 2,355,903,184           | 2,459,036,281           |
| 負債純資産合計         | 2,362,573,540           | 2,465,449,659           |

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|   | 第19期 |               | 第20期 |               |
|---|------|---------------|------|---------------|
|   | 自    | 2018年12月18日   | 自    | 2019年12月17日   |
|   | 至    | 2019年12月16日   | 至    | 2020年12月15日   |
| 営業収益                                      |      |               |      |               |
| 有価証券売買等損益                                 |      | 169,467,443   |      | 88,886,694    |
| 営業収益合計                                    |      | 169,467,443   |      | 88,886,694    |
| 営業費用                                      |      |               |      |               |
| 支払利息                                      |      | 56,335        |      | 30,024        |
| 受託者報酬                                     |      | 1,195,357     |      | 1,254,489     |
| 委託者報酬                                     |      | 9,562,758     |      | 10,035,722    |
| その他費用                                     |      | 1,222,831     |      | 1,265,854     |
| 営業費用合計                                    |      | 12,037,281    |      | 12,586,089    |
| 営業利益又は営業損失(△)                             |      | 157,430,162   |      | 76,300,605    |
| 経常利益又は経常損失(△)                             |      | 157,430,162   |      | 76,300,605    |
| 当期純利益又は当期純損失(△)                           |      | 157,430,162   |      | 76,300,605    |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△) |      | 4,761,630     |      | △11,043,141   |
| 期首剰余金又は期首欠損金(△)                           |      | 944,392,126   |      | 1,130,652,084 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |      | 117,617,231   |      | 147,276,810   |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |      | 117,617,231   |      | 147,276,810   |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |      | 84,025,805    |      | 143,765,167   |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |      | 84,025,805    |      | 143,765,167   |
| 分配金                                       |      | —             |      | —             |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△)                           |      | 1,130,652,084 |      | 1,221,507,473 |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                            |  |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間の取扱い<br>2019年12月15日が休日のため、当ファンドの当計算期間を2019年12月17日から2020年12月15日としております。     |

(貸借対照表に関する注記)

| 第19期<br>(2019年12月16日現在)  | 第20期<br>(2020年12月15日現在)  |
|--|--|
| <p>※1 1. 投資信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中解約元本額</p> <p>期首元本額 1,190,341,612円<br/>期中追加設定元本額 140,643,525円<br/>期中解約元本額 105,734,037円</p> <p>2. 計算期間末日における受益権の総数<br/>1,225,251,100口</p> | <p>※1 1. 投資信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中解約元本額</p> <p>期首元本額 1,225,251,100円<br/>期中追加設定元本額 168,763,332円<br/>期中解約元本額 156,485,624円</p> <p>2. 計算期間末日における受益権の総数<br/>1,237,528,808口</p> |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第19期<br>自 2018年12月18日<br>至 2019年12月16日  | 第20期<br>自 2019年12月17日<br>至 2020年12月15日   |
|---|--|
| <p>※1. 「PRU海外株式マザーファンド」及び「PRU海外債券マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託する場合の当該委託費用は、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に年10,000分の10の率を乗じて得た額とします。</p> <p>※2. 分配金の計算過程<br/>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(34,248,366円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(29,629,607円)、投資信託約款に規定される収益調整金(870,492,896円)及び分配準備積立金(442,935,004円)より分配対象額は1,377,305,873円(1万口当たり11,240円)ですが、分配を行っておりません。</p> | <p>※1. 同左</p> <p>※2. 分配金の計算過程<br/>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(31,329,222円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(56,014,524円)、投資信託約款に規定される収益調整金(945,490,270円)及び分配準備積立金(446,021,217円)より分配対象額は1,478,855,233円(1万口当たり11,950円)ですが、分配を行っておりません。</p> |



(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

| 項目                       | 第19期<br>自 2018年12月18日<br>至 2019年12月16日   | 第20期<br>自 2019年12月17日<br>至 2020年12月15日 |
|--------------------------|--|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を投資信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。   | 同左                                     |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じて価格変動リスクや為替変動リスク等があります。 | 同左                                     |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | コンプライアンス部では、運用状況のモニタリング、運用に関する法令諸規則の遵守状況の確認を行っております。<br>また、リスク管理部では、運用に関するリスク管理を行っております。   | 同左                                     |

## II 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | 第19期<br>(2019年12月16日現在)  | 第20期<br>(2020年12月15日現在)  |
|----------------------------|--|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。  | 同左   |
| 2. 時価の算定方法                 | <p>① 有価証券<br/>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>② デリバティブ取引等<br/>該当事項はありません。</p> <p>③ 上記以外の金融商品<br/>短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> | <p>① 有価証券<br/>同左</p> <p>② デリバティブ取引等<br/>同左</p> <p>③ 上記以外の金融商品<br/>同左</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価格のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。  | 同左   |

(有価証券に関する注記)

第19期 (2019年12月16日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

| 種類        | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 親投資信託受益証券 | 161,692,240       |
| 合計        | 161,692,240       |

第20期 (2020年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

| 種類        | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 親投資信託受益証券 | 110,463,698       |
| 合計        | 110,463,698       |

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| 第19期<br>(2019年12月16日現在) |          | 第20期<br>(2020年12月15日現在) |          |
|-------------------------|----------|-------------------------|----------|
| 1口当たり純資産額               | 1.9228円  | 1口当たり純資産額               | 1.9871円  |
| (1万口当たり純資産額             | 19,228円) | (1万口当たり純資産額             | 19,871円) |

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

① 株式 (2020年12月15日現在)

該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券 (2020年12月15日現在)

| 種類        | 通貨  | 銘柄             | 口数            | 評価額           |
|-----------|-----|----------------|---------------|---------------|
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | PRU国内株式マザーファンド | 349,881,030   | 711,693,003   |
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | PRU国内債券マザーファンド | 730,113,651   | 995,509,963   |
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | PRU海外株式マザーファンド | 185,296,574   | 580,571,225   |
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | PRU海外債券マザーファンド | 57,944,808    | 143,911,725   |
|           | 合計  |                | 1,323,236,063 | 2,431,685,916 |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考情報)

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

「PRU国内株式マザーファンド」の状況

なお、以下に掲載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

(単位：円)

| 区 分         | 注記<br>番号 | (2020年12月15日現在) |
|-------------|----------|-----------------|
|             |          | 金 額             |
| 資産の部        |          |                 |
| 流動資産        |          |                 |
| コール・ローン     |          | 89,585,475      |
| 株式          |          | 3,066,104,260   |
| 派生商品評価勘定    |          | 1,194,500       |
| 未収配当金       |          | 1,043,531       |
| 差入委託証拠金     |          | 4,350,000       |
| 流動資産合計      |          | 3,162,277,766   |
| 資産合計        |          | 3,162,277,766   |
| 負債の部        |          |                 |
| 流動負債        |          |                 |
| 前受金         |          | 1,650,000       |
| 未払解約金       |          | 3,884,267       |
| 未払利息        |          | 245             |
| 流動負債合計      |          | 5,534,512       |
| 負債合計        |          | 5,534,512       |
| 純資産の部       |          |                 |
| 元本等         |          |                 |
| 元本          | ※1       | 1,551,895,404   |
| 剰余金         |          |                 |
| 剰余金又は欠損金(△) |          | 1,604,847,850   |
| 元本等合計       |          | 3,156,743,254   |
| 純資産合計       |          | 3,156,743,254   |
| 負債純資産合計     |          | 3,162,277,766   |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

(2020年12月15日現在)

|    |  |                |
|----|--|----------------|
| ※1 | 1. 本報告書における開示対象ファンドの<br>期首における当該親投資信託の元本額        | 1,688,416,096円 |
|    | 同期中における追加設定元本額                                   | 252,147,200円   |
|    | 同期中における解約元本額                                     | 388,667,892円   |
|    | 同期末における元本の内訳                                     |                |
|    | PRUグッドライフ2030 (年金)                               | 291,978,444円   |
|    | PRUグッドライフ2040 (年金)                               | 349,881,030円   |
|    | PRUグッドライフ2050 (年金)                               | 65,827,622円    |
|    | プルデンシャル私募国内株式マーケット・パ<br>フォーマー (適格機関投資家向け)        | 841,059,481円   |
|    | プルデンシャル私募国内株式・債券バランス<br>ファンド (適格機関投資家向け)         | 3,148,827円     |
|    | 計  | 1,551,895,404円 |
|    | 2. 本報告書における開示対象ファンドの<br>期末における当該親投資信託の受益権の<br>総数 | 1,551,895,404口 |

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

| 項目                       | 自 2019年12月17日<br>至 2020年12月15日   |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を投資信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。   |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じて価格変動リスクや為替変動リスク等があります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | コンプライアンス部では、運用状況のモニタリング、運用に関する法令諸規則の遵守状況の確認を行っております。<br>また、リスク管理部では、運用に関するリスク管理を行っております。   |

## II 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | (2020年12月15日現在)   |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。   |
| 2. 時価の算定方法                 | <p>① 有価証券<br/>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>② デリバティブ取引等<br/>「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。</p> <p>③ 上記以外の金融商品<br/>短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価格のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。   |



(有価証券に関する注記)

(2020年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

| 種類 | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
|----|-----------------|
| 株式 | 36,679,775      |
| 合計 | 36,679,775      |

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

株式関連

(単位：円)

| 種類       | (2020年12月15日現在) |       |            |           |
|----------|-----------------|-------|------------|-----------|
|          | 契約額等            | うち1年超 | 時価         | 評価損益      |
| 市場取引     |                 |       |            |           |
| 株価指数先物取引 |                 |       |            |           |
| 買建       | 87,680,500      | —     | 88,875,000 | 1,194,500 |
| 合計       | 87,680,500      | —     | 88,875,000 | 1,194,500 |

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| (2020年12月15日現在)                          |          |
|--|----------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 | 2,034円   |
| (1万口当たり純資産額)                             | 20,341円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

① 株式

(2020年12月15日現在)

| 種類 | 通貨  | 銘柄               | 株数    | 評価額単価    | 評価額金額     |
|----|-----|------------------|-------|----------|-----------|
| 株式 | 日本円 | 日本水産             | 1,700 | 428.00   | 727,600   |
|    |     | マルハニチロ           | 200   | 2,161.00 | 432,200   |
|    |     | 雪国まいたけ           | 100   | 1,675.00 | 167,500   |
|    |     | カネコ種苗            | 100   | 1,551.00 | 155,100   |
|    |     | サカタのタネ           | 200   | 3,525.00 | 705,000   |
|    |     | ホクト              | 100   | 2,111.00 | 211,100   |
|    |     | 住石ホールディングス       | 600   | 115.00   | 69,000    |
|    |     | 国際石油開発帝石         | 6,200 | 579.00   | 3,589,800 |
|    |     | 石油資源開発           | 200   | 1,871.00 | 374,200   |
|    |     | K&Oエナジーグループ      | 100   | 1,492.00 | 149,200   |
|    |     | ヒノキヤグループ         | 100   | 2,192.00 | 219,200   |
|    |     | ショーボンドホールディングス   | 300   | 5,150.00 | 1,545,000 |
|    |     | ミライト・ホールディングス    | 500   | 1,674.00 | 837,000   |
|    |     | タマホーム            | 100   | 1,439.00 | 143,900   |
|    |     | ファーストコーポレーション    | 100   | 717.00   | 71,700    |
|    |     | スペースバリューホールディングス | 200   | 642.00   | 128,400   |
|    |     | 安藤・間             | 1,000 | 720.00   | 720,000   |
|    |     | 東急建設             | 500   | 509.00   | 254,500   |
|    |     | コムシスホールディングス     | 600   | 3,170.00 | 1,902,000 |
|    |     | ビーアールホールディングス    | 200   | 699.00   | 139,800   |
|    |     | 高松コンストラクショングループ  | 100   | 2,067.00 | 206,700   |
|    |     | 東建コーポレーション       | 100   | 8,090.00 | 809,000   |
|    |     | ヤマウラ             | 100   | 936.00   | 93,600    |
|    |     | 大成建設             | 1,300 | 3,715.00 | 4,829,500 |
|    |     | 大林組              | 3,800 | 928.00   | 3,526,400 |
|    |     | 清水建設             | 4,000 | 814.00   | 3,256,000 |
|    |     | 飛島建設             | 200   | 1,098.00 | 219,600   |
|    |     | 長谷工コーポレーション      | 1,500 | 1,172.00 | 1,758,000 |
|    |     | 松井建設             | 200   | 797.00   | 159,400   |
|    |     | 鹿島建設             | 3,000 | 1,380.00 | 4,140,000 |
|    |     | 不動テトラ            | 100   | 1,735.00 | 173,500   |
|    |     | 大末建設             | 100   | 884.00   | 88,400    |
|    |     | 鉄建建設             | 100   | 1,833.00 | 183,300   |
|    |     | 西松建設             | 300   | 2,062.00 | 618,600   |
|    |     | 三井住友建設           | 1,100 | 429.00   | 471,900   |
|    |     | 大豊建設             | 100   | 3,515.00 | 351,500   |
|    |     | 前田建設工業           | 1,000 | 958.00   | 958,000   |
|    |     | 奥村組              | 200   | 2,495.00 | 499,000   |
|    |     | 東鉄工業             | 200   | 2,782.00 | 556,400   |
|    |     | 戸田建設             | 1,600 | 653.00   | 1,044,800 |
|    |     | 熊谷組              | 200   | 2,543.00 | 508,600   |
|    |     | 矢作建設工業           | 200   | 858.00   | 171,600   |
|    |     | ピーエス三菱           | 100   | 606.00   | 60,600    |
|    |     | 日本ハウスホールディングス    | 300   | 286.00   | 85,800    |
|    |     | 大東建託             | 400   | 9,640.00 | 3,856,000 |
|    |     | 新日本建設            | 200   | 851.00   | 170,200   |
|    |     | N I P P O        | 300   | 2,775.00 | 832,500   |
|    |     | 前田道路             | 400   | 1,736.00 | 694,400   |
|    |     | 東亜建設工業           | 100   | 1,947.00 | 194,700   |
|    |     | 日本国土開発           | 400   | 557.00   | 222,800   |
|    |     | 若築建設             | 100   | 1,178.00 | 117,800   |
|    |     | 東洋建設             | 500   | 427.00   | 213,500   |
|    |     | 五洋建設             | 1,500 | 847.00   | 1,270,500 |

| 種類          | 通貨  | 銘柄           | 株数        | 評価額単価    | 評価額金額      |
|-------------|-----|--------------|-----------|----------|------------|
| 株式          | 日本円 | 世紀東急工業       | 200       | 836.00   | 167,200    |
|             |     | 住友林業         | 1,000     | 1,972.00 | 1,972,000  |
|             |     | 巴コーポレーション    | 200       | 423.00   | 84,600     |
|             |     | 大和ハウス工業      | 3,800     | 3,143.00 | 11,943,400 |
|             |     | ライト工業        | 200       | 1,770.00 | 354,000    |
|             |     | 積水ハウス        | 4,200     | 1,984.00 | 8,332,800  |
|             |     | 日特建設         | 200       | 789.00   | 157,800    |
|             |     | 北陸電気工事       | 100       | 1,291.00 | 129,100    |
|             |     | ユアテック        | 300       | 786.00   | 235,800    |
|             |     | 日本リーテック      | 100       | 2,379.00 | 237,900    |
|             |     | 中電工          | 200       | 2,154.00 | 430,800    |
|             |     | 関電工          | 600       | 807.00   | 484,200    |
|             |     | きんでん         | 900       | 1,641.00 | 1,476,900  |
|             |     | 東京エネシス       | 100       | 859.00   | 85,900     |
|             |     | 住友電設         | 100       | 2,614.00 | 261,400    |
|             |     | 日本電設工業       | 200       | 2,123.00 | 424,600    |
|             |     | 協和エクシオ       | 600       | 2,882.00 | 1,729,200  |
|             |     | 新日本空調        | 100       | 2,190.00 | 219,000    |
|             |     | 九電工          | 300       | 3,165.00 | 949,500    |
|             |     | 三機工業         | 200       | 1,183.00 | 236,600    |
|             |     | 日揮ホールディングス   | 1,200     | 978.00   | 1,173,600  |
|             |     | ヤマト          | 100       | 750.00   | 75,000     |
|             |     | 太平電業         | 100       | 2,416.00 | 241,600    |
|             |     | 高砂熱学工業       | 300       | 1,487.00 | 446,100    |
|             |     | 明星工業         | 300       | 781.00   | 234,300    |
|             |     | 大気社          | 200       | 2,774.00 | 554,800    |
|             |     | ダイダン         | 100       | 2,856.00 | 285,600    |
|             |     | 日比谷総合設備      | 100       | 1,879.00 | 187,900    |
|             |     | OSJBホールディングス | 700       | 274.00   | 191,800    |
|             |     | 東洋エンジニアリング   | 200       | 423.00   | 84,600     |
|             |     | レイズネクスト      | 300       | 1,181.00 | 354,300    |
|             |     | 日本製粉         | 300       | 1,621.00 | 486,300    |
|             |     | 日清製粉グループ本社   | 1,400     | 1,659.00 | 2,322,600  |
|             |     | 昭和産業         | 100       | 3,085.00 | 308,500    |
|             |     | 鳥越製粉         | 100       | 1,025.00 | 102,500    |
|             |     | 中部飼料         | 200       | 1,420.00 | 284,000    |
|             |     | フィード・ワン      | 200       | 894.00   | 178,800    |
|             |     | 日本甜菜製糖       | 100       | 1,640.00 | 164,000    |
|             |     | 三井製糖         | 100       | 1,795.00 | 179,500    |
|             |     | 日新製糖         | 100       | 1,843.00 | 184,300    |
|             |     | 森永製菓         | 300       | 3,840.00 | 1,152,000  |
|             |     | 江崎グリコ        | 300       | 4,565.00 | 1,369,500  |
|             |     | 井村屋グループ      | 100       | 2,635.00 | 263,500    |
|             |     | 不二家          | 100       | 2,471.00 | 247,100    |
|             |     | 山崎製パン        | 900       | 1,730.00 | 1,557,000  |
|             |     | 亀田製菓         | 100       | 4,840.00 | 484,000    |
|             |     | 寿スピリッツ       | 100       | 5,230.00 | 523,000    |
| カルビー        | 600 | 3,075.00     | 1,845,000 |          |            |
| 森永乳業        | 200 | 4,995.00     | 999,000   |          |            |
| 六甲バター       | 100 | 1,942.00     | 194,200   |          |            |
| ヤクルト本社      | 900 | 5,160.00     | 4,644,000 |          |            |
| 明治ホールディングス  | 800 | 7,280.00     | 5,824,000 |          |            |
| 雪印メグミルク     | 300 | 2,212.00     | 663,600   |          |            |
| プリマハム       | 200 | 3,160.00     | 632,000   |          |            |
| 日本ハム        | 500 | 4,715.00     | 2,357,500 |          |            |
| 丸大食品        | 100 | 1,686.00     | 168,600   |          |            |
| S F o o d s | 100 | 3,340.00     | 334,000   |          |            |

| 種類             | 通貨    | 銘柄                   | 株数        | 評価額単価    | 評価額金額      |
|----------------|-------|----------------------|-----------|----------|------------|
| 株式             | 日本円   | 伊藤ハム米久ホールディングス       | 800       | 683.00   | 546,400    |
|                |       | サッポロホールディングス         | 400       | 2,055.00 | 822,000    |
|                |       | アサヒグループホールディングス      | 2,700     | 4,292.00 | 11,588,400 |
|                |       | キリンホールディングス          | 5,300     | 2,389.50 | 12,664,350 |
|                |       | 宝ホールディングス            | 900       | 1,245.00 | 1,120,500  |
|                |       | オエノンホールディングス         | 400       | 402.00   | 160,800    |
|                |       | 養命酒製造                | 100       | 1,896.00 | 189,600    |
|                |       | コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ | 900       | 1,613.00 | 1,451,700  |
|                |       | サントリー食品インターナショナル     | 800       | 3,795.00 | 3,036,000  |
|                |       | ダイドーグループホールディングス     | 100       | 5,710.00 | 571,000    |
|                |       | 伊藤園                  | 400       | 6,650.00 | 2,660,000  |
|                |       | キーコーヒー               | 200       | 2,142.00 | 428,400    |
|                |       | 日清オイリオグループ           | 200       | 3,005.00 | 601,000    |
|                |       | 不二製油グループ本社           | 300       | 2,889.00 | 866,700    |
|                |       | J-オイルミルズ             | 100       | 3,535.00 | 353,500    |
|                |       | キッコーマン               | 900       | 6,530.00 | 5,877,000  |
|                |       | 味の素                  | 2,800     | 2,356.50 | 6,598,200  |
|                |       | キューピー                | 700       | 2,209.00 | 1,546,300  |
|                |       | ハウス食品グループ本社          | 500       | 3,840.00 | 1,920,000  |
|                |       | カゴメ                  | 500       | 3,735.00 | 1,867,500  |
|                |       | アリアケジャパン             | 100       | 7,090.00 | 709,000    |
|                |       | ニチレイ                 | 600       | 2,801.00 | 1,680,600  |
|                |       | 東洋水産                 | 600       | 5,110.00 | 3,066,000  |
|                |       | 日清食品ホールディングス         | 500       | 8,560.00 | 4,280,000  |
|                |       | 永谷園ホールディングス          | 100       | 2,286.00 | 228,600    |
|                |       | フジッコ                 | 100       | 2,036.00 | 203,600    |
|                |       | ロック・フィールド            | 100       | 1,615.00 | 161,500    |
|                |       | 日本たばこ産業              | 6,700     | 2,200.00 | 14,740,000 |
|                |       | ケンコーマヨネーズ            | 100       | 1,876.00 | 187,600    |
|                |       | わらべや日洋ホールディングス       | 100       | 1,421.00 | 142,100    |
|                |       | なとり                  | 100       | 1,940.00 | 194,000    |
|                |       | 北の達人コーポレーション         | 500       | 482.00   | 241,000    |
|                |       | ユーグレナ                | 600       | 821.00   | 492,600    |
|                |       | ミヨシ油脂                | 100       | 1,272.00 | 127,200    |
|                |       | 理研ビタミン               | 100       | 1,382.00 | 138,200    |
|                |       | 片倉工業                 | 200       | 1,474.00 | 294,800    |
|                |       | グンゼ                  | 100       | 3,505.00 | 350,500    |
|                |       | 東洋紡                  | 500       | 1,368.00 | 684,000    |
|                |       | ユニチカ                 | 400       | 414.00   | 165,600    |
|                |       | 富士紡ホールディングス          | 100       | 3,835.00 | 383,500    |
|                |       | 倉敷紡績                 | 100       | 1,896.00 | 189,600    |
|                |       | シキボウ                 | 100       | 1,032.00 | 103,200    |
|                |       | 日本毛織                 | 400       | 1,032.00 | 412,800    |
|                |       | 帝国繊維                 | 100       | 2,574.00 | 257,400    |
| 帝人             | 1,000 | 1,943.00             | 1,943,000 |          |            |
| 東レ             | 8,700 | 619.00               | 5,385,300 |          |            |
| セーレン           | 300   | 1,606.00             | 481,800   |          |            |
| ソトー            | 100   | 899.00               | 89,900    |          |            |
| 小松マテーレ         | 300   | 1,000.00             | 300,000   |          |            |
| ワコールホールディングス   | 300   | 2,083.00             | 624,900   |          |            |
| ホギメディカル        | 100   | 3,390.00             | 339,000   |          |            |
| T S I ホールディングス | 300   | 219.00               | 65,700    |          |            |
| ワールド           | 200   | 1,260.00             | 252,000   |          |            |
| オンワードホールディングス  | 800   | 210.00               | 168,000   |          |            |
| ゴールドウイン        | 200   | 7,170.00             | 1,434,000 |          |            |
| デサント           | 200   | 1,873.00             | 374,600   |          |            |
| 特種東海製紙         | 100   | 5,260.00             | 526,000   |          |            |

| 種類       | 通貨    | 銘柄             | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額      |
|----------|-------|----------------|-----------|-----------|------------|
| 株式       | 日本円   | 王子ホールディングス     | 5,100     | 551.00    | 2,810,100  |
|          |       | 日本製紙           | 500       | 1,200.00  | 600,000    |
|          |       | 三菱製紙           | 300       | 324.00    | 97,200     |
|          |       | 北越コーポレーション     | 800       | 387.00    | 309,600    |
|          |       | 中越パルプ工業        | 100       | 1,319.00  | 131,900    |
|          |       | 大王製紙           | 600       | 1,843.00  | 1,105,800  |
|          |       | レンゴー           | 1,100     | 827.00    | 909,700    |
|          |       | トーモク           | 100       | 1,711.00  | 171,100    |
|          |       | ザ・バック          | 100       | 3,015.00  | 301,500    |
|          |       | クラレ            | 1,900     | 1,136.00  | 2,158,400  |
|          |       | 旭化成            | 8,000     | 1,031.50  | 8,252,000  |
|          |       | 共和レザー          | 200       | 688.00    | 137,600    |
|          |       | 昭和電工           | 900       | 2,218.00  | 1,996,200  |
|          |       | 住友化学           | 8,900     | 411.00    | 3,657,900  |
|          |       | 日産化学           | 700       | 6,130.00  | 4,291,000  |
|          |       | ラサ工業           | 100       | 2,286.00  | 228,600    |
|          |       | クレハ            | 100       | 6,790.00  | 679,000    |
|          |       | テイカ            | 100       | 1,608.00  | 160,800    |
|          |       | 石原産業           | 300       | 641.00    | 192,300    |
|          |       | 日本曹達           | 200       | 2,946.00  | 589,200    |
|          |       | 東ソー            | 1,900     | 1,732.00  | 3,290,800  |
|          |       | トクヤマ           | 300       | 2,354.00  | 706,200    |
|          |       | セントラル硝子        | 200       | 2,317.00  | 463,400    |
|          |       | 東亜合成           | 800       | 1,283.00  | 1,026,400  |
|          |       | 大阪ソーダ          | 100       | 2,653.00  | 265,300    |
|          |       | 関東電化工業         | 300       | 799.00    | 239,700    |
|          |       | デンカ            | 400       | 3,880.00  | 1,552,000  |
|          |       | 信越化学工業         | 2,100     | 17,160.00 | 36,036,000 |
|          |       | 堺化学工業          | 100       | 2,028.00  | 202,800    |
|          |       | 第一稀元素化学工業      | 200       | 823.00    | 164,600    |
|          |       | エア・ウォーター       | 1,100     | 1,845.00  | 2,029,500  |
|          |       | 日本酸素ホールディングス   | 1,200     | 1,982.00  | 2,378,400  |
|          |       | 日本パーカライズン      | 600       | 1,098.00  | 658,800    |
|          |       | 高压ガス工業         | 200       | 820.00    | 164,000    |
|          |       | 四国化成工業         | 200       | 1,209.00  | 241,800    |
|          |       | ステラ ケミファ       | 100       | 3,370.00  | 337,000    |
|          |       | 日本触媒           | 200       | 5,600.00  | 1,120,000  |
|          |       | 大日精化工業         | 100       | 2,355.00  | 235,500    |
|          |       | カネカ            | 300       | 3,475.00  | 1,042,500  |
|          |       | 三菱瓦斯化学         | 1,100     | 2,300.00  | 2,530,000  |
|          |       | 三井化学           | 1,100     | 2,854.00  | 3,139,400  |
|          |       | J S R          | 1,100     | 2,724.00  | 2,996,400  |
|          |       | 東京応化工業         | 200       | 6,860.00  | 1,372,000  |
|          |       | 大阪有機化学工業       | 100       | 2,986.00  | 298,600    |
|          |       | 三菱ケミカルホールディングス | 8,100     | 654.50    | 5,301,450  |
|          |       | KHネオケム         | 200       | 2,799.00  | 559,800    |
| ダイセル     | 1,500 | 742.00         | 1,113,000 |           |            |
| 住友ベークライト | 200   | 3,555.00       | 711,000   |           |            |
| 積水化学工業   | 2,600 | 1,936.00       | 5,033,600 |           |            |
| 日本ゼオン    | 1,100 | 1,401.00       | 1,541,100 |           |            |
| アイカ工業    | 400   | 3,640.00       | 1,456,000 |           |            |
| 宇部興産     | 600   | 1,906.00       | 1,143,600 |           |            |
| 積水樹脂     | 200   | 2,184.00       | 436,800   |           |            |
| タキロンシーアイ | 300   | 708.00         | 212,400   |           |            |
| 旭有機材     | 100   | 1,561.00       | 156,100   |           |            |
| ニチバン     | 100   | 1,658.00       | 165,800   |           |            |
| リケンテクノス  | 300   | 464.00         | 139,200   |           |            |

| 種類       | 通貨  | 銘柄               | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額      |
|----------|-----|------------------|-----------|-----------|------------|
| 株式       | 日本円 | 大倉工業             | 100       | 1,900.00  | 190,000    |
|          |     | 積水化成成品工業         | 200       | 543.00    | 108,600    |
|          |     | ミライアル            | 100       | 1,187.00  | 118,700    |
|          |     | ダイキョーニシカワ        | 200       | 827.00    | 165,400    |
|          |     | 森六ホールディングス       | 100       | 2,268.00  | 226,800    |
|          |     | 日本化薬             | 700       | 967.00    | 676,900    |
|          |     | カーリットホールディングス    | 200       | 745.00    | 149,000    |
|          |     | 日本精化             | 100       | 1,462.00  | 146,200    |
|          |     | 扶桑化学工業           | 100       | 3,835.00  | 383,500    |
|          |     | ADEKA            | 600       | 1,820.00  | 1,092,000  |
|          |     | 日油               | 500       | 5,100.00  | 2,550,000  |
|          |     | 新日本理化学           | 400       | 301.00    | 120,400    |
|          |     | ハリマ化成グループ        | 100       | 1,139.00  | 113,900    |
|          |     | 花王               | 3,000     | 7,762.00  | 23,286,000 |
|          |     | 第一工業製薬           | 100       | 4,405.00  | 440,500    |
|          |     | 三洋化成工業           | 100       | 4,950.00  | 495,000    |
|          |     | 大日本塗料            | 100       | 980.00    | 98,000     |
|          |     | 日本ペイントホールディングス   | 1,000     | 11,250.00 | 11,250,000 |
|          |     | 関西ペイント           | 1,400     | 3,010.00  | 4,214,000  |
|          |     | 中国塗料             | 300       | 1,023.00  | 306,900    |
|          |     | 日本特殊塗料           | 100       | 1,292.00  | 129,200    |
|          |     | 藤倉化成             | 200       | 561.00    | 112,200    |
|          |     | 太陽ホールディングス       | 100       | 6,300.00  | 630,000    |
|          |     | DIC              | 500       | 2,652.00  | 1,326,000  |
|          |     | サカタインクス          | 200       | 1,218.00  | 243,600    |
|          |     | 東洋インキSCホールディングス  | 300       | 2,038.00  | 611,400    |
|          |     | 富士フイルムホールディングス   | 2,400     | 5,740.00  | 13,776,000 |
|          |     | 資生堂              | 2,500     | 7,345.00  | 18,362,500 |
|          |     | ライオン             | 1,600     | 2,455.00  | 3,928,000  |
|          |     | 高砂香料工業           | 100       | 2,593.00  | 259,300    |
|          |     | マンダム             | 300       | 1,681.00  | 504,300    |
|          |     | ミルボン             | 200       | 6,300.00  | 1,260,000  |
|          |     | ファンケル            | 500       | 4,425.00  | 2,212,500  |
|          |     | コーセー             | 200       | 17,580.00 | 3,516,000  |
|          |     | コタ               | 100       | 1,399.00  | 139,900    |
|          |     | ポーラ・オルビスホールディングス | 500       | 2,072.00  | 1,036,000  |
|          |     | ノエビアホールディングス     | 100       | 4,390.00  | 439,000    |
|          |     | エステー             | 100       | 2,029.00  | 202,900    |
|          |     | アグロ カネショウ        | 100       | 1,666.00  | 166,600    |
|          |     | コニシ              | 200       | 1,683.00  | 336,600    |
|          |     | 長谷川香料            | 200       | 2,114.00  | 422,800    |
|          |     | 小林製薬             | 400       | 12,790.00 | 5,116,000  |
|          |     | 荒川化学工業           | 100       | 1,178.00  | 117,800    |
|          |     | メック              | 100       | 2,311.00  | 231,100    |
|          |     | 日本高純度化学          | 100       | 2,683.00  | 268,300    |
|          |     | タカラバイオ           | 300       | 2,902.00  | 870,600    |
|          |     | JCU              | 200       | 3,925.00  | 785,000    |
| 新田ゼラチン   | 100 | 698.00           | 69,800    |           |            |
| デクセリアルズ  | 400 | 1,332.00         | 532,800   |           |            |
| アース製薬    | 100 | 5,980.00         | 598,000   |           |            |
| 北興化学工業   | 100 | 1,115.00         | 111,500   |           |            |
| クミアイ化学工業 | 600 | 993.00           | 595,800   |           |            |
| 日本農薬     | 300 | 532.00           | 159,600   |           |            |
| アキレス     | 100 | 1,470.00         | 147,000   |           |            |
| 有沢製作所    | 200 | 1,009.00         | 201,800   |           |            |
| 日東電工     | 900 | 8,830.00         | 7,947,000 |           |            |
| レック      | 100 | 1,395.00         | 139,500   |           |            |

| 種類               | 通貨     | 銘柄              | 株数         | 評価額単価    | 評価額金額      |
|------------------|--------|-----------------|------------|----------|------------|
| 株式               | 日本円    | 三光合成            | 200        | 378.00   | 75,600     |
|                  |        | 藤森工業            | 100        | 4,775.00 | 477,500    |
|                  |        | 前澤化成工業          | 100        | 988.00   | 98,800     |
|                  |        | 未来工業            | 100        | 1,805.00 | 180,500    |
|                  |        | J S P           | 100        | 1,714.00 | 171,400    |
|                  |        | エフピコ            | 300        | 4,210.00 | 1,263,000  |
|                  |        | 天馬              | 100        | 2,035.00 | 203,500    |
|                  |        | 信越ポリマー          | 200        | 976.00   | 195,200    |
|                  |        | ニフコ             | 500        | 3,815.00 | 1,907,500  |
|                  |        | バルカー            | 100        | 2,079.00 | 207,900    |
|                  |        | ユニ・チャーム         | 2,600      | 4,825.00 | 12,545,000 |
|                  |        | 協和キリン           | 1,300      | 2,734.00 | 3,554,200  |
|                  |        | 武田薬品工業          | 10,300     | 3,856.00 | 39,716,800 |
|                  |        | アステラス製薬         | 10,700     | 1,526.50 | 16,333,550 |
|                  |        | 大日本住友製薬         | 900        | 1,391.00 | 1,251,900  |
|                  |        | 塩野義製薬           | 1,600      | 5,492.00 | 8,787,200  |
|                  |        | わかもと製薬          | 300        | 267.00   | 80,100     |
|                  |        | あすか製薬           | 200        | 1,742.00 | 348,400    |
|                  |        | 日本新薬            | 300        | 7,250.00 | 2,175,000  |
|                  |        | 中外製薬            | 3,900      | 4,993.00 | 19,472,700 |
|                  |        | 科研製薬            | 200        | 3,910.00 | 782,000    |
|                  |        | エーザイ            | 1,500      | 7,576.00 | 11,364,000 |
|                  |        | ロート製薬           | 600        | 3,145.00 | 1,887,000  |
|                  |        | 小野薬品工業          | 2,800      | 3,183.00 | 8,912,400  |
|                  |        | 久光製薬            | 300        | 6,240.00 | 1,872,000  |
|                  |        | 持田製薬            | 200        | 3,995.00 | 799,000    |
|                  |        | 参天製薬            | 2,300      | 1,714.00 | 3,942,200  |
|                  |        | 扶桑薬品工業          | 100        | 2,862.00 | 286,200    |
|                  |        | ツムラ             | 400        | 3,300.00 | 1,320,000  |
|                  |        | 日医工             | 400        | 1,007.00 | 402,800    |
|                  |        | キッセイ薬品工業        | 200        | 2,250.00 | 450,000    |
|                  |        | 生化学工業           | 300        | 1,048.00 | 314,400    |
|                  |        | 栄研化学            | 200        | 2,021.00 | 404,200    |
|                  |        | 日水製薬            | 100        | 991.00   | 99,100     |
|                  |        | 鳥居薬品            | 100        | 3,340.00 | 334,000    |
|                  |        | J C R ファーマ      | 400        | 2,553.00 | 1,021,200  |
|                  |        | 東和薬品            | 100        | 1,874.00 | 187,400    |
|                  |        | 富士製薬工業          | 100        | 1,272.00 | 127,200    |
|                  |        | 沢井製薬            | 300        | 4,870.00 | 1,461,000  |
|                  |        | ゼリア新薬工業         | 200        | 1,913.00 | 382,600    |
|                  |        | 第一三共            | 10,600     | 3,419.00 | 36,241,400 |
|                  |        | キョーリン製薬ホールディングス | 300        | 1,932.00 | 579,600    |
|                  |        | 大幸薬品            | 200        | 1,622.00 | 324,400    |
|                  |        | ダイト             | 100        | 3,845.00 | 384,500    |
|                  |        | 大塚ホールディングス      | 2,600      | 4,424.00 | 11,502,400 |
|                  |        | 大正製薬ホールディングス    | 300        | 6,740.00 | 2,022,000  |
|                  |        | ペプチドリーム         | 600        | 5,430.00 | 3,258,000  |
| 日本コークス工業         | 1,400  | 72.00           | 100,800    |          |            |
| ニチレキ             | 100    | 1,631.00        | 163,100    |          |            |
| ユシロ化学工業          | 100    | 1,200.00        | 120,000    |          |            |
| ビーピー・カストロール      | 100    | 1,283.00        | 128,300    |          |            |
| 出光興産             | 1,400  | 2,229.00        | 3,120,600  |          |            |
| ENEOSホールディングス    | 18,800 | 358.70          | 6,743,560  |          |            |
| コスモエネルギーホールディングス | 300    | 1,793.00        | 537,900    |          |            |
| 横浜ゴム             | 700    | 1,608.00        | 1,125,600  |          |            |
| TOYO TIRE        | 700    | 1,661.00        | 1,162,700  |          |            |
| ブリヂストン           | 3,300  | 3,590.00        | 11,847,000 |          |            |



| 種類            | 通貨  | 銘柄                 | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額     |
|---------------|-----|--------------------|-----------|-----------|-----------|
| 株式            | 日本円 | 住友ゴム工業             | 1,100     | 927.00    | 1,019,700 |
|               |     | オカモト               | 100       | 4,000.00  | 400,000   |
|               |     | フコク                | 100       | 690.00    | 69,000    |
|               |     | ニッタ                | 100       | 2,368.00  | 236,800   |
|               |     | 住友理工               | 300       | 578.00    | 173,400   |
|               |     | 三ツ星ベルト             | 100       | 1,712.00  | 171,200   |
|               |     | バンドー化学             | 200       | 634.00    | 126,800   |
|               |     | 日東紡績               | 200       | 4,420.00  | 884,000   |
|               |     | AGC                | 1,100     | 3,550.00  | 3,905,000 |
|               |     | 日本板硝子              | 600       | 460.00    | 276,000   |
|               |     | 日本山村硝子             | 100       | 902.00    | 90,200    |
|               |     | 日本電気硝子             | 500       | 2,360.00  | 1,180,000 |
|               |     | オハラ                | 100       | 1,650.00  | 165,000   |
|               |     | 住友大阪セメント           | 200       | 3,145.00  | 629,000   |
|               |     | 太平洋セメント            | 800       | 2,746.00  | 2,196,800 |
|               |     | 日本ヒューム             | 200       | 804.00    | 160,800   |
|               |     | 日本コンクリート工業         | 300       | 333.00    | 99,900    |
|               |     | 三谷セキサン             | 100       | 4,070.00  | 407,000   |
|               |     | アジアパイルホールディングス     | 200       | 478.00    | 95,600    |
|               |     | 東海カーボン             | 1,200     | 1,204.00  | 1,444,800 |
|               |     | 日本カーボン             | 100       | 4,035.00  | 403,500   |
|               |     | 東洋炭素               | 100       | 1,876.00  | 187,600   |
|               |     | ノリタケカンパニーリミテド      | 100       | 3,005.00  | 300,500   |
|               |     | TOTO               | 900       | 5,870.00  | 5,283,000 |
|               |     | 日本碍子               | 1,500     | 1,675.00  | 2,512,500 |
|               |     | 日本特殊陶業             | 1,000     | 1,859.00  | 1,859,000 |
|               |     | MARUWA             | 100       | 11,390.00 | 1,139,000 |
|               |     | 東京窯業               | 200       | 368.00    | 73,600    |
|               |     | フジインコーポレーテッド       | 100       | 3,850.00  | 385,000   |
|               |     | ニチアス               | 300       | 2,471.00  | 741,300   |
|               |     | ニチハ                | 200       | 3,150.00  | 630,000   |
|               |     | 日本製鉄               | 5,500     | 1,300.00  | 7,150,000 |
|               |     | 神戸製鋼所              | 2,300     | 539.00    | 1,239,700 |
|               |     | 中山製鋼所              | 300       | 416.00    | 124,800   |
|               |     | 合同製鉄               | 100       | 1,968.00  | 196,800   |
|               |     | ジェイ エフ イー ホールディングス | 3,300     | 1,022.00  | 3,372,600 |
|               |     | 東京製鉄               | 600       | 655.00    | 393,000   |
|               |     | 共英製鋼               | 200       | 1,487.00  | 297,400   |
|               |     | 大和工業               | 300       | 2,734.00  | 820,200   |
|               |     | 東京製鋼               | 100       | 2,177.00  | 217,700   |
|               |     | 大阪製鉄               | 100       | 1,292.00  | 129,200   |
|               |     | 淀川製鋼所              | 200       | 2,027.00  | 405,400   |
|               |     | 丸一鋼管               | 400       | 2,275.00  | 910,000   |
|               |     | 大同特殊鋼              | 200       | 4,535.00  | 907,000   |
|               |     | 日本冶金工業             | 100       | 1,810.00  | 181,000   |
|               |     | 山陽特殊製鋼             | 100       | 1,310.00  | 131,000   |
|               |     | 愛知製鋼               | 100       | 2,949.00  | 294,900   |
|               |     | 日立金属               | 1,300     | 1,520.00  | 1,976,000 |
|               |     | 大平洋金属              | 100       | 2,139.00  | 213,900   |
|               |     | 新日本電工              | 800       | 310.00    | 248,000   |
| 栗本鐵工所         | 100 | 1,703.00           | 170,300   |           |           |
| 日亜鋼業          | 300 | 303.00             | 90,900    |           |           |
| 大紀アルミニウム工業所   | 200 | 767.00             | 153,400   |           |           |
| 日本軽金属ホールディングス | 300 | 1,953.00           | 585,900   |           |           |
| 三井金属鉱業        | 300 | 3,560.00           | 1,068,000 |           |           |
| 東邦亜鉛          | 100 | 2,351.00           | 235,100   |           |           |
| 三菱マテリアル       | 800 | 2,120.00           | 1,696,000 |           |           |

| 種類          | 通貨    | 銘柄               | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額     |
|-------------|-------|------------------|-----------|-----------|-----------|
| 株式          | 日本円   | 住友金属鉱山           | 1,600     | 4,316.00  | 6,905,600 |
|             |       | DOWAホールディングス     | 300       | 3,665.00  | 1,099,500 |
|             |       | 古河機械金属           | 300       | 1,257.00  | 377,100   |
|             |       | 大阪チタニウムテクノロジーズ   | 200       | 980.00    | 196,000   |
|             |       | 東邦チタニウム          | 200       | 823.00    | 164,600   |
|             |       | UACJ             | 200       | 1,894.00  | 378,800   |
|             |       | 古河電気工業           | 400       | 2,899.00  | 1,159,600 |
|             |       | 住友電気工業           | 4,600     | 1,279.50  | 5,885,700 |
|             |       | フジクラ             | 1,500     | 474.00    | 711,000   |
|             |       | 昭和電線ホールディングス     | 100       | 1,822.00  | 182,200   |
|             |       | タツタ電線            | 200       | 743.00    | 148,600   |
|             |       | 平河ヒューテック         | 100       | 1,173.00  | 117,300   |
|             |       | リョービ             | 200       | 1,351.00  | 270,200   |
|             |       | アサヒホールディングス      | 200       | 3,320.00  | 664,000   |
|             |       | 稲葉製作所            | 100       | 1,387.00  | 138,700   |
|             |       | トーカロ             | 300       | 1,387.00  | 416,100   |
|             |       | SUMCO            | 1,600     | 2,273.00  | 3,636,800 |
|             |       | 信和               | 100       | 694.00    | 69,400    |
|             |       | 東洋製罐グループホールディングス | 800       | 1,130.00  | 904,000   |
|             |       | ホッカンホールディングス     | 100       | 1,442.00  | 144,200   |
|             |       | コロナ              | 100       | 974.00    | 97,400    |
|             |       | 横河ブリッジホールディングス   | 200       | 2,134.00  | 426,800   |
|             |       | 三和ホールディングス       | 1,100     | 1,193.00  | 1,312,300 |
|             |       | 文化シャッター          | 400       | 948.00    | 379,200   |
|             |       | 三協立山             | 200       | 775.00    | 155,000   |
|             |       | アルインコ            | 100       | 923.00    | 92,300    |
|             |       | LIXIL            | 1,800     | 2,259.00  | 4,066,200 |
|             |       | ノーリツ             | 300       | 1,670.00  | 501,000   |
|             |       | 長府製作所            | 200       | 2,100.00  | 420,000   |
|             |       | リンナイ             | 200       | 11,980.00 | 2,396,000 |
|             |       | 日東精工             | 200       | 444.00    | 88,800    |
|             |       | 岡部               | 300       | 790.00    | 237,000   |
|             |       | ジーテクト            | 100       | 1,540.00  | 154,000   |
|             |       | 東プレ              | 200       | 1,545.00  | 309,000   |
|             |       | 高周波熱錬            | 300       | 481.00    | 144,300   |
|             |       | 東京製綱             | 100       | 861.00    | 86,100    |
|             |       | パイオラックス          | 200       | 1,691.00  | 338,200   |
|             |       | エイチワン            | 200       | 892.00    | 178,400   |
|             |       | 日本発條             | 1,300     | 710.00    | 923,000   |
|             |       | 立川ブラインド工業        | 100       | 1,390.00  | 139,000   |
|             |       | 三益半導体工業          | 100       | 2,767.00  | 276,700   |
|             |       | 日本製鋼所            | 400       | 2,873.00  | 1,149,200 |
|             |       | 三浦工業             | 500       | 5,560.00  | 2,780,000 |
|             |       | タクマ              | 400       | 1,825.00  | 730,000   |
|             |       | ツガミ              | 300       | 1,622.00  | 486,600   |
|             |       | オークマ             | 100       | 5,960.00  | 596,000   |
|             |       | 芝浦機械             | 100       | 2,260.00  | 226,000   |
| アマダ         | 1,500 | 1,080.00         | 1,620,000 |           |           |
| アイダエンジニアリング | 400   | 979.00           | 391,600   |           |           |
| FUJ I       | 500   | 2,663.00         | 1,331,500 |           |           |
| 牧野フライス製作所   | 100   | 4,035.00         | 403,500   |           |           |
| オーエスジー      | 600   | 1,869.00         | 1,121,400 |           |           |
| 旭ダイヤモンド工業   | 400   | 449.00           | 179,600   |           |           |
| DMG森精機      | 800   | 1,660.00         | 1,328,000 |           |           |
| ソディック       | 300   | 870.00           | 261,000   |           |           |
| ディスコ        | 200   | 34,400.00        | 6,880,000 |           |           |
| 日東工器        | 100   | 1,828.00         | 182,800   |           |           |

| 種類              | 通貨  | 銘柄             | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額      |
|-----------------|-----|----------------|-----------|-----------|------------|
| 株式              | 日本円 | 日進工具           | 100       | 2,667.00  | 266,700    |
|                 |     | 島精機製作所         | 200       | 1,776.00  | 355,200    |
|                 |     | オプトラン          | 200       | 2,303.00  | 460,600    |
|                 |     | イワキポンプ         | 100       | 837.00    | 83,700     |
|                 |     | フリー            | 100       | 1,105.00  | 110,500    |
|                 |     | ヤマシンフィルタ       | 300       | 1,100.00  | 330,000    |
|                 |     | 日阪製作所          | 100       | 845.00    | 84,500     |
|                 |     | やまびこ           | 200       | 1,353.00  | 270,600    |
|                 |     | 平田機工           | 100       | 8,360.00  | 836,000    |
|                 |     | ペガサスマシン製造      | 300       | 348.00    | 104,400    |
|                 |     | タツモ            | 100       | 1,512.00  | 151,200    |
|                 |     | ナブテスコ          | 700       | 4,365.00  | 3,055,500  |
|                 |     | 三井海洋開発         | 100       | 1,889.00  | 188,900    |
|                 |     | レオン自動機         | 100       | 1,133.00  | 113,300    |
|                 |     | SMC            | 400       | 64,770.00 | 25,908,000 |
|                 |     | オイレス工業         | 100       | 1,663.00  | 166,300    |
|                 |     | サトーホールディングス    | 200       | 2,224.00  | 444,800    |
|                 |     | 技研製作所          | 100       | 4,320.00  | 432,000    |
|                 |     | 日精樹脂工業         | 100       | 889.00    | 88,900     |
|                 |     | オカダアイヨン        | 100       | 1,082.00  | 108,200    |
|                 |     | ワイエイシイホールディングス | 100       | 1,143.00  | 114,300    |
|                 |     | 小松製作所          | 5,600     | 2,781.00  | 15,573,600 |
|                 |     | 住友重機械工業        | 700       | 2,469.00  | 1,728,300  |
|                 |     | 日立建機           | 500       | 2,892.00  | 1,446,000  |
|                 |     | 日工             | 200       | 688.00    | 137,600    |
|                 |     | 巴工業            | 100       | 2,019.00  | 201,900    |
|                 |     | 井関農機           | 100       | 1,409.00  | 140,900    |
|                 |     | TOWA           | 100       | 1,951.00  | 195,100    |
|                 |     | ローツェ           | 100       | 5,680.00  | 568,000    |
|                 |     | クボタ            | 6,500     | 2,190.50  | 14,238,250 |
|                 |     | 月島機械           | 200       | 1,354.00  | 270,800    |
|                 |     | 帝国電機製作所        | 100       | 1,287.00  | 128,700    |
|                 |     | 新東工業           | 200       | 785.00    | 157,000    |
|                 |     | 澁谷工業           | 100       | 3,600.00  | 360,000    |
|                 |     | アイチ コーポレーション   | 200       | 945.00    | 189,000    |
|                 |     | 小森コーポレーション     | 400       | 745.00    | 298,000    |
|                 |     | 鶴見製作所          | 100       | 1,806.00  | 180,600    |
|                 |     | 荏原製作所          | 500       | 3,420.00  | 1,710,000  |
|                 |     | 西島製作所          | 200       | 876.00    | 175,200    |
|                 |     | 北越工業           | 100       | 1,064.00  | 106,400    |
|                 |     | ダイキン工業         | 1,600     | 22,550.00 | 36,080,000 |
|                 |     | トーヨーカネツ        | 100       | 2,139.00  | 213,900    |
|                 |     | 栗田工業           | 700       | 3,985.00  | 2,789,500  |
|                 |     | 椿本チエイン         | 200       | 2,819.00  | 563,800    |
|                 |     | 木村化工機          | 100       | 614.00    | 61,400     |
| アネスト岩田          | 200 | 1,049.00       | 209,800   |           |            |
| ダイフク            | 600 | 12,300.00      | 7,380,000 |           |            |
| 加藤製作所           | 100 | 1,030.00       | 103,000   |           |            |
| タダノ             | 600 | 893.00         | 535,800   |           |            |
| フジテック           | 400 | 2,233.00       | 893,200   |           |            |
| CKD             | 300 | 2,243.00       | 672,900   |           |            |
| キトー             | 100 | 1,609.00       | 160,900   |           |            |
| 平和              | 400 | 1,461.00       | 584,400   |           |            |
| 理想科学工業          | 100 | 1,339.00       | 133,900   |           |            |
| SANKYO          | 300 | 2,675.00       | 802,500   |           |            |
| 日本金銭機械          | 200 | 533.00         | 106,600   |           |            |
| マースグループホールディングス | 100 | 1,590.00       | 159,000   |           |            |

| 種類             | 通貨    | 銘柄            | 株数         | 評価額単価    | 評価額金額      |
|----------------|-------|---------------|------------|----------|------------|
| 株式             | 日本円   | フクシマガリレイ      | 100        | 4,540.00 | 454,000    |
|                |       | 竹内製作所         | 200        | 2,436.00 | 487,200    |
|                |       | アマノ           | 300        | 2,672.00 | 801,600    |
|                |       | JUKI          | 200        | 538.00   | 107,600    |
|                |       | サンデンホールディングス  | 300        | 371.00   | 111,300    |
|                |       | 蛇の目ミシン工業      | 100        | 818.00   | 81,800     |
|                |       | マックス          | 200        | 1,414.00 | 282,800    |
|                |       | グローリー         | 300        | 2,108.00 | 632,400    |
|                |       | 新晃工業          | 100        | 1,727.00 | 172,700    |
|                |       | 大和冷機工業        | 200        | 1,126.00 | 225,200    |
|                |       | セガサミーホールディングス | 1,200      | 1,558.00 | 1,869,600  |
|                |       | 日本ピストンリング     | 100        | 1,048.00 | 104,800    |
|                |       | リケン           | 100        | 2,278.00 | 227,800    |
|                |       | T P R         | 200        | 1,506.00 | 301,200    |
|                |       | ツバキ・ナカシマ      | 300        | 963.00   | 288,900    |
|                |       | ホシザキ          | 400        | 9,950.00 | 3,980,000  |
|                |       | 大豊工業          | 100        | 826.00   | 82,600     |
|                |       | 日本精工          | 2,300      | 917.00   | 2,109,100  |
|                |       | N T N         | 2,900      | 257.00   | 745,300    |
|                |       | ジェイテクト        | 1,200      | 817.00   | 980,400    |
|                |       | 不二越           | 100        | 4,430.00 | 443,000    |
|                |       | 日本トムソン        | 500        | 380.00   | 190,000    |
|                |       | T H K         | 800        | 3,320.00 | 2,656,000  |
|                |       | ユーシン精機        | 100        | 901.00   | 90,100     |
|                |       | 前澤給装工業        | 100        | 2,348.00 | 234,800    |
|                |       | イーグル工業        | 200        | 1,010.00 | 202,000    |
|                |       | 前澤工業          | 200        | 445.00   | 89,000     |
|                |       | 日本ピラー工業       | 100        | 1,585.00 | 158,500    |
|                |       | キッツ           | 500        | 646.00   | 323,000    |
|                |       | マキタ           | 1,600      | 5,270.00 | 8,432,000  |
|                |       | 日立造船          | 900        | 443.00   | 398,700    |
|                |       | 三菱重工業         | 2,100      | 2,983.00 | 6,264,300  |
|                |       | I H I         | 900        | 2,036.00 | 1,832,400  |
|                |       | スター精密         | 200        | 1,662.00 | 332,400    |
|                |       | 日清紡ホールディングス   | 800        | 802.00   | 641,600    |
|                |       | イビデン          | 800        | 5,020.00 | 4,016,000  |
|                |       | コニカミノルタ       | 2,700      | 398.00   | 1,074,600  |
|                |       | ブラザー工業        | 1,500      | 2,096.00 | 3,144,000  |
|                |       | ミネベアミツミ       | 2,300      | 2,172.00 | 4,995,600  |
|                |       | 日立製作所         | 6,000      | 4,168.00 | 25,008,000 |
|                |       | 三菱電機          | 12,400     | 1,535.50 | 19,040,200 |
|                |       | 富士電機          | 800        | 3,650.00 | 2,920,000  |
|                |       | 東洋電機製造        | 100        | 1,176.00 | 117,600    |
|                |       | 安川電機          | 1,300      | 4,755.00 | 6,181,500  |
| シンフォニアテクノロジー   | 200   | 1,504.00      | 300,800    |          |            |
| 明電舎            | 200   | 2,158.00      | 431,600    |          |            |
| 山洋電気           | 100   | 5,330.00      | 533,000    |          |            |
| デンヨー           | 100   | 2,104.00      | 210,400    |          |            |
| 東芝テック          | 200   | 3,860.00      | 772,000    |          |            |
| マブチモーター        | 300   | 4,515.00      | 1,354,500  |          |            |
| 日本電産           | 3,000 | 12,620.00     | 37,860,000 |          |            |
| トレックス・セミコンダクター | 100   | 1,382.00      | 138,200    |          |            |
| 東光高岳           | 100   | 1,767.00      | 176,700    |          |            |
| ダブル・スコープ       | 200   | 891.00        | 178,200    |          |            |
| ダイヘン           | 100   | 4,980.00      | 498,000    |          |            |
| ヤーマン           | 200   | 2,085.00      | 417,000    |          |            |
| J V Cケンウッド     | 1,100 | 151.00        | 166,100    |          |            |

| 種類          | 通貨    | 銘柄                | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額      |
|-------------|-------|-------------------|-----------|-----------|------------|
| 株式          | 日本円   | ミマキエンジニアリング       | 200       | 531.00    | 106,200    |
|             |       | I-P-E-X           | 100       | 2,076.00  | 207,600    |
|             |       | 日新電機              | 300       | 1,151.00  | 345,300    |
|             |       | 大崎電気工業            | 200       | 575.00    | 115,000    |
|             |       | オムロン              | 1,100     | 9,040.00  | 9,944,000  |
|             |       | 日東工業              | 200       | 2,006.00  | 401,200    |
|             |       | I D E C           | 200       | 1,880.00  | 376,000    |
|             |       | ジーエス・ユアサ コーポレーション | 400       | 2,765.00  | 1,106,000  |
|             |       | サクサホールディングス       | 100       | 1,420.00  | 142,000    |
|             |       | テクノメディカ           | 100       | 1,482.00  | 148,200    |
|             |       | 日本電気              | 1,500     | 5,380.00  | 8,070,000  |
|             |       | 富士通               | 1,200     | 13,600.00 | 16,320,000 |
|             |       | 沖電気工業             | 500       | 934.00    | 467,000    |
|             |       | 岩崎通信機             | 200       | 853.00    | 170,600    |
|             |       | 電気興業              | 100       | 2,782.00  | 278,200    |
|             |       | サンケン電気            | 100       | 4,145.00  | 414,500    |
|             |       | アイホン              | 100       | 1,637.00  | 163,700    |
|             |       | ルネサスエレクトロニクス      | 5,300     | 1,057.00  | 5,602,100  |
|             |       | セイコーエプソン          | 1,600     | 1,631.00  | 2,609,600  |
|             |       | ワコム               | 800       | 948.00    | 758,400    |
|             |       | アルバック             | 200       | 4,425.00  | 885,000    |
|             |       | E I Z O           | 100       | 3,770.00  | 377,000    |
|             |       | 日本信号              | 300       | 975.00    | 292,500    |
|             |       | 京三製作所             | 400       | 441.00    | 176,400    |
|             |       | 能美防災              | 200       | 2,358.00  | 471,600    |
|             |       | ホーチキ              | 100       | 1,301.00  | 130,100    |
|             |       | 星和電機              | 100       | 715.00    | 71,500     |
|             |       | エレコム              | 100       | 4,930.00  | 493,000    |
|             |       | パナソニック            | 14,100    | 1,161.00  | 16,370,100 |
|             |       | シャープ              | 1,400     | 1,458.00  | 2,041,200  |
|             |       | アンリツ              | 800       | 2,348.00  | 1,878,400  |
|             |       | 富士通ゼネラル           | 300       | 2,824.00  | 847,200    |
|             |       | ソニー               | 7,800     | 9,730.00  | 75,894,000 |
|             |       | T D K             | 600       | 14,210.00 | 8,526,000  |
|             |       | 帝国通信工業            | 100       | 1,164.00  | 116,400    |
|             |       | タムラ製作所            | 500       | 588.00    | 294,000    |
|             |       | アルプスアルパイン         | 1,100     | 1,288.00  | 1,416,800  |
|             |       | 日本電波工業            | 200       | 719.00    | 143,800    |
|             |       | ローランド ディー. ジー.    | 100       | 1,905.00  | 190,500    |
|             |       | フォスター電機           | 200       | 1,238.00  | 247,600    |
|             |       | ヨコオ               | 100       | 2,669.00  | 266,900    |
|             |       | ホシデン              | 300       | 977.00    | 293,100    |
|             |       | ヒロセ電機             | 200       | 15,150.00 | 3,030,000  |
|             |       | 日本航空電子工業          | 300       | 1,603.00  | 480,900    |
|             |       | T O A             | 200       | 890.00    | 178,000    |
|             |       | マクセルホールディングス      | 300       | 1,322.00  | 396,600    |
|             |       | 古野電気              | 100       | 1,194.00  | 119,400    |
| スミダコーポレーション | 100   | 1,096.00          | 109,600   |           |            |
| アイコム        | 100   | 2,709.00          | 270,900   |           |            |
| リオン         | 100   | 3,320.00          | 332,000   |           |            |
| 横河電機        | 1,200 | 1,936.00          | 2,323,200 |           |            |
| アズビル        | 800   | 5,190.00          | 4,152,000 |           |            |
| 東亜ディーケーケー   | 100   | 900.00            | 90,000    |           |            |
| 日本光電工業      | 500   | 3,455.00          | 1,727,500 |           |            |
| チノー         | 100   | 1,428.00          | 142,800   |           |            |
| 日本電子材料      | 100   | 1,738.00          | 173,800   |           |            |
| 堀場製作所       | 200   | 5,840.00          | 1,168,000 |           |            |

| 種類            | 通貨    | 銘柄             | 株数         | 評価額単価     | 評価額金額      |
|---------------|-------|----------------|------------|-----------|------------|
| 株式            | 日本円   | アドバンテスト        | 900        | 7,420.00  | 6,678,000  |
|               |       | エスペック          | 100        | 1,993.00  | 199,300    |
|               |       | キーエンス          | 1,100      | 51,700.00 | 56,870,000 |
|               |       | 日置電機           | 100        | 4,175.00  | 417,500    |
|               |       | シスメックス         | 900        | 11,580.00 | 10,422,000 |
|               |       | 日本マイクロニクス      | 200        | 1,205.00  | 241,000    |
|               |       | メガチップス         | 100        | 3,070.00  | 307,000    |
|               |       | OBARA GROUP    | 100        | 3,965.00  | 396,500    |
|               |       | コーセル           | 200        | 1,249.00  | 249,800    |
|               |       | イリソ電子工業        | 100        | 4,785.00  | 478,500    |
|               |       | オプテックスグループ     | 200        | 1,981.00  | 396,200    |
|               |       | 千代田インテグレ       | 100        | 1,654.00  | 165,400    |
|               |       | アイ・オー・データ機器    | 100        | 1,092.00  | 109,200    |
|               |       | レーザーテック        | 500        | 11,330.00 | 5,665,000  |
|               |       | スタンレー電気        | 900        | 3,430.00  | 3,087,000  |
|               |       | 岩崎電気           | 100        | 1,437.00  | 143,700    |
|               |       | ウシオ電機          | 700        | 1,303.00  | 912,100    |
|               |       | 日本セラミック        | 100        | 2,980.00  | 298,000    |
|               |       | 古河電池           | 100        | 1,488.00  | 148,800    |
|               |       | 山一電機           | 100        | 1,600.00  | 160,000    |
|               |       | 図研             | 100        | 2,908.00  | 290,800    |
|               |       | 日本電子           | 200        | 4,590.00  | 918,000    |
|               |       | カシオ計算機         | 1,100      | 1,915.00  | 2,106,500  |
|               |       | ファナック          | 1,200      | 26,150.00 | 31,380,000 |
|               |       | 日本シイエムケイ       | 300        | 419.00    | 125,700    |
|               |       | エンプラス          | 100        | 4,250.00  | 425,000    |
|               |       | 大真空            | 100        | 2,535.00  | 253,500    |
|               |       | ローム            | 500        | 9,600.00  | 4,800,000  |
|               |       | 浜松ホトニクス        | 900        | 5,970.00  | 5,373,000  |
|               |       | 三井ハイテック        | 100        | 4,005.00  | 400,500    |
|               |       | 新光電気工業         | 400        | 2,319.00  | 927,600    |
|               |       | 京セラ            | 1,800      | 6,300.00  | 11,340,000 |
|               |       | 太陽誘電           | 600        | 4,620.00  | 2,772,000  |
|               |       | 村田製作所          | 3,600      | 8,898.00  | 32,032,800 |
|               |       | 双葉電子工業         | 200        | 943.00    | 188,600    |
|               |       | 北陸電気工業         | 100        | 932.00    | 93,200     |
|               |       | ニチコン           | 500        | 1,249.00  | 624,500    |
|               |       | 日本ケミコン         | 100        | 1,949.00  | 194,900    |
|               |       | KOA            | 200        | 1,520.00  | 304,000    |
|               |       | 市光工業           | 200        | 644.00    | 128,800    |
|               |       | 小糸製作所          | 700        | 7,100.00  | 4,970,000  |
|               |       | ミツバ            | 200        | 508.00    | 101,600    |
|               |       | SCREENホールディングス | 200        | 7,020.00  | 1,404,000  |
|               |       | キャノン電子         | 100        | 1,517.00  | 151,700    |
| キャノン          | 6,100 | 2,050.50       | 12,508,050 |           |            |
| リコー           | 3,100 | 709.00         | 2,197,900  |           |            |
| 象印マホービン       | 300   | 1,869.00       | 560,700    |           |            |
| 東京エレクトロン      | 800   | 36,450.00      | 29,160,000 |           |            |
| トヨタ紡織         | 400   | 1,764.00       | 705,600    |           |            |
| ユニプレス         | 200   | 1,048.00       | 209,600    |           |            |
| 豊田自動織機        | 1,000 | 8,120.00       | 8,120,000  |           |            |
| モリタホールディングス   | 200   | 1,718.00       | 343,600    |           |            |
| 三櫻工業          | 200   | 915.00         | 183,000    |           |            |
| デンソー          | 2,700 | 5,800.00       | 15,660,000 |           |            |
| 東海理化電機製作所     | 300   | 1,752.00       | 525,600    |           |            |
| 三井E&Sホールディングス | 500   | 373.00         | 186,500    |           |            |
| 川崎重工業         | 1,000 | 2,104.00       | 2,104,000  |           |            |

| 種類        | 通貨    | 銘柄         | 株数         | 評価額単価     | 評価額金額       |
|-----------|-------|------------|------------|-----------|-------------|
| 株式        | 日本円   | 名村造船所      | 400        | 171.00    | 68,400      |
|           |       | 日本車輛製造     | 100        | 2,460.00  | 246,000     |
|           |       | 三菱ロジスネクスト  | 200        | 1,248.00  | 249,600     |
|           |       | 日産自動車      | 14,600     | 566.80    | 8,275,280   |
|           |       | いすゞ自動車     | 3,600      | 1,054.00  | 3,794,400   |
|           |       | トヨタ自動車     | 13,800     | 7,905.00  | 109,089,000 |
|           |       | 日野自動車      | 1,500      | 1,039.00  | 1,558,500   |
|           |       | 三菱自動車工業    | 4,600      | 208.00    | 956,800     |
|           |       | 武蔵精密工業     | 300        | 1,626.00  | 487,800     |
|           |       | 日産車体       | 200        | 937.00    | 187,400     |
|           |       | 新明和工業      | 400        | 937.00    | 374,800     |
|           |       | 極東開発工業     | 200        | 1,466.00  | 293,200     |
|           |       | トピー工業      | 100        | 1,231.00  | 123,100     |
|           |       | ティラド       | 100        | 1,366.00  | 136,600     |
|           |       | 曙ブレーキ工業    | 900        | 133.00    | 119,700     |
|           |       | タチエス       | 200        | 1,256.00  | 251,200     |
|           |       | NOK        | 700        | 1,179.00  | 825,300     |
|           |       | フタバ産業      | 400        | 546.00    | 218,400     |
|           |       | 大同メタル工業    | 300        | 491.00    | 147,300     |
|           |       | プレス工業      | 600        | 327.00    | 196,200     |
|           |       | 太平洋工業      | 300        | 1,101.00  | 330,300     |
|           |       | 河西工業       | 300        | 412.00    | 123,600     |
|           |       | アイシン精機     | 1,000      | 3,130.00  | 3,130,000   |
|           |       | マツダ        | 3,700      | 679.00    | 2,512,300   |
|           |       | 今仙電機製作所    | 100        | 821.00    | 82,100      |
|           |       | 本田技研工業     | 9,800      | 3,061.00  | 29,997,800  |
|           |       | スズキ        | 2,500      | 5,263.00  | 13,157,500  |
|           |       | SUBARU     | 3,800      | 2,175.00  | 8,265,000   |
|           |       | 安永         | 100        | 1,383.00  | 138,300     |
|           |       | ヤマハ発動機     | 1,800      | 2,127.00  | 3,828,600   |
|           |       | TBK        | 200        | 465.00    | 93,000      |
|           |       | エクセディ      | 200        | 1,345.00  | 269,000     |
|           |       | 豊田合成       | 400        | 3,030.00  | 1,212,000   |
|           |       | 愛三工業       | 300        | 524.00    | 157,200     |
|           |       | ヨロズ        | 100        | 1,198.00  | 119,800     |
|           |       | エフ・シー・シー   | 200        | 2,034.00  | 406,800     |
|           |       | シマノ        | 500        | 24,185.00 | 12,092,500  |
|           |       | テイ・エス テック  | 300        | 3,260.00  | 978,000     |
|           |       | テルモ        | 3,500      | 3,990.00  | 13,965,000  |
|           |       | クリエートメディック | 100        | 1,000.00  | 100,000     |
|           |       | 日機装        | 400        | 1,056.00  | 422,400     |
|           |       | 日本エム・ディ・エム | 100        | 2,371.00  | 237,100     |
|           |       | 島津製作所      | 1,500      | 3,755.00  | 5,632,500   |
| JMS       | 100   | 945.00     | 94,500     |           |             |
| 長野計器      | 100   | 919.00     | 91,900     |           |             |
| ブイ・テクノロジー | 100   | 5,740.00   | 574,000    |           |             |
| 東京計器      | 100   | 1,009.00   | 100,900    |           |             |
| インターアクション | 100   | 1,970.00   | 197,000    |           |             |
| 東京精密      | 200   | 4,955.00   | 991,000    |           |             |
| マニー       | 500   | 2,627.00   | 1,313,500  |           |             |
| ニコン       | 1,900 | 686.00     | 1,303,400  |           |             |
| トプコン      | 600   | 1,291.00   | 774,600    |           |             |
| オリンパス     | 6,900 | 2,156.50   | 14,879,850 |           |             |
| 理研計器      | 100   | 2,972.00   | 297,200    |           |             |
| タムロン      | 100   | 1,772.00   | 177,200    |           |             |
| HOYA      | 2,500 | 13,235.00  | 33,087,500 |           |             |
| ノーリツ鋼機    | 100   | 2,515.00   | 251,500    |           |             |

| 種類           | 通貨     | 銘柄                | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額      |
|--------------|--------|-------------------|-----------|-----------|------------|
| 株式           | 日本円    | エー・アンド・デイ         | 100       | 1,041.00  | 104,100    |
|              |        | 朝日インテック           | 1,400     | 3,545.00  | 4,963,000  |
|              |        | シチズン時計            | 1,500     | 296.00    | 444,000    |
|              |        | 大研医器              | 100       | 534.00    | 53,400     |
|              |        | メニコン              | 200       | 6,320.00  | 1,264,000  |
|              |        | 松風                | 100       | 1,738.00  | 173,800    |
|              |        | セイコーホールディングス      | 200       | 1,389.00  | 277,800    |
|              |        | ニプロ               | 800       | 1,243.00  | 994,400    |
|              |        | スノーピーク            | 100       | 1,815.00  | 181,500    |
|              |        | パラマウントベッドホールディングス | 100       | 4,470.00  | 447,000    |
|              |        | トランザクション          | 100       | 937.00    | 93,700     |
|              |        | ニホンフラッシュ          | 100       | 1,322.00  | 132,200    |
|              |        | 前田工織              | 100       | 2,602.00  | 260,200    |
|              |        | アートネイチャー          | 100       | 644.00    | 64,400     |
|              |        | バンダイナムコホールディングス   | 1,300     | 9,501.00  | 12,351,300 |
|              |        | SHOEI             | 100       | 3,610.00  | 361,000    |
|              |        | フランスベッドホールディングス   | 200       | 901.00    | 180,200    |
|              |        | パイロットコーポレーション     | 200       | 2,970.00  | 594,000    |
|              |        | 萩原工業              | 100       | 1,520.00  | 152,000    |
|              |        | トッパン・フォームズ        | 300       | 1,049.00  | 314,700    |
|              |        | フジシールインターナショナル    | 300       | 2,043.00  | 612,900    |
|              |        | タカラトミー            | 600       | 941.00    | 564,600    |
|              |        | プロネクサス            | 100       | 1,045.00  | 104,500    |
|              |        | ウッドワン             | 100       | 1,150.00  | 115,000    |
|              |        | 大建工業              | 100       | 1,885.00  | 188,500    |
|              |        | 凸版印刷              | 1,800     | 1,508.00  | 2,714,400  |
|              |        | 大日本印刷             | 1,600     | 1,905.00  | 3,048,000  |
|              |        | 共同印刷              | 100       | 3,185.00  | 318,500    |
|              |        | NISSHA            | 300       | 1,496.00  | 448,800    |
|              |        | TAKARA & COMPANY  | 100       | 1,957.00  | 195,700    |
|              |        | アシックス             | 1,100     | 2,058.00  | 2,263,800  |
|              |        | ツツミ               | 100       | 2,095.00  | 209,500    |
|              |        | ヤマハ               | 700       | 6,070.00  | 4,249,000  |
|              |        | 河合楽器製作所           | 100       | 2,939.00  | 293,900    |
|              |        | クリナップ             | 200       | 490.00    | 98,000     |
|              |        | ピジョン              | 800       | 4,565.00  | 3,652,000  |
|              |        | オリバー              | 100       | 2,313.00  | 231,300    |
|              |        | キングジム             | 100       | 912.00    | 91,200     |
|              |        | リンテック             | 300       | 2,260.00  | 678,000    |
|              |        | イトーキ              | 300       | 359.00    | 107,700    |
|              |        | 任天堂               | 800       | 61,620.00 | 49,296,000 |
|              |        | 三菱鉛筆              | 200       | 1,469.00  | 293,800    |
|              |        | タカラスタンダード         | 300       | 1,493.00  | 447,900    |
|              |        | コクヨ               | 600       | 1,462.00  | 877,200    |
|              |        | ナカバヤシ             | 200       | 623.00    | 124,600    |
|              |        | グローブライド           | 100       | 4,300.00  | 430,000    |
|              |        | オカムラ              | 400       | 949.00    | 379,600    |
| 美津濃          | 100    | 1,992.00          | 199,200   |           |            |
| 東京電力ホールディングス | 10,000 | 272.00            | 2,720,000 |           |            |
| 中部電力         | 3,800  | 1,224.50          | 4,653,100 |           |            |
| 関西電力         | 4,700  | 943.60            | 4,434,920 |           |            |
| 中国電力         | 1,800  | 1,233.00          | 2,219,400 |           |            |
| 北陸電力         | 1,100  | 671.00            | 738,100   |           |            |
| 東北電力         | 3,000  | 840.00            | 2,520,000 |           |            |
| 四国電力         | 1,100  | 681.00            | 749,100   |           |            |
| 九州電力         | 2,600  | 867.00            | 2,254,200 |           |            |
| 北海道電力        | 1,100  | 380.00            | 418,000   |           |            |



| 種類          | 通貨    | 銘柄               | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額      |
|-------------|-------|------------------|-----------|-----------|------------|
| 株式          | 日本円   | 沖縄電力             | 300       | 1,372.00  | 411,600    |
|             |       | 電源開発             | 1,000     | 1,365.00  | 1,365,000  |
|             |       | エフオン             | 100       | 1,145.00  | 114,500    |
|             |       | イーレックス           | 200       | 1,937.00  | 387,400    |
|             |       | レノバ              | 200       | 3,125.00  | 625,000    |
|             |       | 東京瓦斯             | 2,400     | 2,265.50  | 5,437,200  |
|             |       | 大阪瓦斯             | 2,400     | 2,034.00  | 4,881,600  |
|             |       | 東邦瓦斯             | 600       | 6,450.00  | 3,870,000  |
|             |       | 広島ガス             | 400       | 367.00    | 146,800    |
|             |       | 西部瓦斯             | 100       | 3,315.00  | 331,500    |
|             |       | 静岡ガス             | 400       | 1,016.00  | 406,400    |
|             |       | メタウォーター          | 100       | 2,303.00  | 230,300    |
|             |       | SBSホールディングス      | 100       | 2,527.00  | 252,700    |
|             |       | 東武鉄道             | 1,300     | 3,115.00  | 4,049,500  |
|             |       | 相鉄ホールディングス       | 400       | 2,636.00  | 1,054,400  |
|             |       | 東急               | 3,100     | 1,292.00  | 4,005,200  |
|             |       | 京浜急行電鉄           | 1,600     | 1,789.00  | 2,862,400  |
|             |       | 小田急電鉄            | 1,800     | 3,300.00  | 5,940,000  |
|             |       | 京王電鉄             | 600       | 7,790.00  | 4,674,000  |
|             |       | 京成電鉄             | 900       | 3,725.00  | 3,352,500  |
|             |       | 富士急行             | 200       | 4,570.00  | 914,000    |
|             |       | 東日本旅客鉄道          | 2,200     | 6,965.00  | 15,323,000 |
|             |       | 西日本旅客鉄道          | 1,100     | 5,417.00  | 5,958,700  |
|             |       | 東海旅客鉄道           | 1,000     | 14,465.00 | 14,465,000 |
|             |       | 西武ホールディングス       | 1,600     | 1,064.00  | 1,702,400  |
|             |       | 鴻池運輸             | 200       | 1,010.00  | 202,000    |
|             |       | 西日本鉄道            | 300       | 3,020.00  | 906,000    |
|             |       | ハマキョウレックス        | 100       | 2,868.00  | 286,800    |
|             |       | サカイ引越センター        | 100       | 5,350.00  | 535,000    |
|             |       | 近鉄グループホールディングス   | 1,200     | 4,660.00  | 5,592,000  |
|             |       | 阪急阪神ホールディングス     | 1,600     | 3,460.00  | 5,536,000  |
|             |       | 南海電気鉄道           | 600       | 2,662.00  | 1,597,200  |
|             |       | 京阪ホールディングス       | 500       | 4,975.00  | 2,487,500  |
|             |       | 名古屋鉄道            | 1,000     | 2,768.00  | 2,768,000  |
|             |       | 山陽電気鉄道           | 100       | 1,987.00  | 198,700    |
|             |       | 日本通運             | 400       | 7,010.00  | 2,804,000  |
|             |       | ヤマトホールディングス      | 1,900     | 2,578.00  | 4,898,200  |
|             |       | 山九               | 300       | 4,015.00  | 1,204,500  |
|             |       | 丸全昭和運輸           | 100       | 3,410.00  | 341,000    |
|             |       | センコーグループホールディングス | 700       | 1,023.00  | 716,100    |
|             |       | ニッコンホールディングス     | 400       | 2,084.00  | 833,600    |
|             |       | 福山通運             | 200       | 4,445.00  | 889,000    |
|             |       | セイノーホールディングス     | 900       | 1,438.00  | 1,294,200  |
|             |       | 日立物流             | 200       | 3,035.00  | 607,000    |
|             |       | 丸和運輸機関           | 100       | 4,355.00  | 435,500    |
|             |       | C&Fロジホールディングス    | 100       | 1,861.00  | 186,100    |
|             |       | 九州旅客鉄道           | 1,000     | 2,284.00  | 2,284,000  |
|             |       | SGホールディングス       | 2,500     | 2,861.00  | 7,152,500  |
|             |       | 日本郵船             | 1,000     | 2,290.00  | 2,290,000  |
|             |       | 商船三井             | 800       | 3,025.00  | 2,420,000  |
| 川崎汽船        | 400   | 1,949.00         | 779,600   |           |            |
| NSユニテッド海運   | 100   | 1,398.00         | 139,800   |           |            |
| 飯野海運        | 500   | 427.00           | 213,500   |           |            |
| 乾汽船         | 100   | 948.00           | 94,800    |           |            |
| 日本航空        | 2,600 | 1,944.00         | 5,054,400 |           |            |
| ANAホールディングス | 2,100 | 2,275.50         | 4,778,550 |           |            |
| 日新          | 100   | 1,221.00         | 122,100   |           |            |

| 種類                   | 通貨  | 銘柄                      | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額     |
|----------------------|-----|-------------------------|-----------|-----------|-----------|
| 株式                   | 日本円 | 三菱倉庫                    | 400       | 2,940.00  | 1,176,000 |
|                      |     | 三井倉庫ホールディングス            | 200       | 2,276.00  | 455,200   |
|                      |     | 住友倉庫                    | 400       | 1,359.00  | 543,600   |
|                      |     | 澁澤倉庫                    | 100       | 2,368.00  | 236,800   |
|                      |     | 東陽倉庫                    | 300       | 327.00    | 98,100    |
|                      |     | 日本トランスシティ               | 300       | 586.00    | 175,800   |
|                      |     | 中央倉庫                    | 100       | 1,162.00  | 116,200   |
|                      |     | 安田倉庫                    | 100       | 986.00    | 98,600    |
|                      |     | 宇徳                      | 200       | 487.00    | 97,400    |
|                      |     | 上組                      | 600       | 1,884.00  | 1,130,400 |
|                      |     | 近鉄エクスプレス                | 300       | 2,269.00  | 680,700   |
|                      |     | エーアイテイー                 | 100       | 1,009.00  | 100,900   |
|                      |     | 内外トランスライン               | 100       | 1,378.00  | 137,800   |
|                      |     | 日本コンセプト                 | 100       | 1,757.00  | 175,700   |
|                      |     | NEC ネットエスアイ             | 300       | 1,776.00  | 532,800   |
|                      |     | システナ                    | 400       | 2,127.00  | 850,800   |
|                      |     | デジタルアーツ                 | 100       | 8,520.00  | 852,000   |
|                      |     | 日鉄ソリューションズ              | 200       | 2,955.00  | 591,000   |
|                      |     | キューブシステム                | 100       | 1,278.00  | 127,800   |
|                      |     | コア                      | 100       | 1,448.00  | 144,800   |
|                      |     | ラクターンホールディングス           | 100       | 1,761.00  | 176,100   |
|                      |     | ソリトンシステムズ               | 100       | 1,895.00  | 189,500   |
|                      |     | ソフトクリエイティブホールディングス      | 100       | 2,834.00  | 283,400   |
|                      |     | T I S                   | 1,200     | 2,067.00  | 2,480,400 |
|                      |     | 電算システム                  | 100       | 3,260.00  | 326,000   |
|                      |     | グリーン                    | 800       | 606.00    | 484,800   |
|                      |     | コーエーテクモホールディングス         | 200       | 6,370.00  | 1,274,000 |
|                      |     | AGS                     | 200       | 863.00    | 172,600   |
|                      |     | ファインデックス                | 100       | 1,268.00  | 126,800   |
|                      |     | KL a b                  | 200       | 1,001.00  | 200,200   |
|                      |     | ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス | 200       | 1,065.00  | 213,000   |
|                      |     | ネクソン                    | 3,100     | 3,090.00  | 9,579,000 |
|                      |     | アイスタイル                  | 400       | 404.00    | 161,600   |
|                      |     | エイチーム                   | 100       | 1,165.00  | 116,500   |
|                      |     | エニグモ                    | 100       | 1,370.00  | 137,000   |
|                      |     | テクノスジャパン                | 100       | 710.00    | 71,000    |
|                      |     | コロプラ                    | 400       | 975.00    | 390,000   |
|                      |     | ブロードリーフ                 | 600       | 724.00    | 434,400   |
|                      |     | デジタルハーツホールディングス         | 100       | 1,240.00  | 124,000   |
|                      |     | システム情報                  | 100       | 1,106.00  | 110,600   |
|                      |     | じげん                     | 500       | 363.00    | 181,500   |
|                      |     | ブイキューブ                  | 100       | 3,200.00  | 320,000   |
|                      |     | フィックスターズ                | 100       | 958.00    | 95,800    |
|                      |     | CARTA HOLDINGS          | 100       | 1,250.00  | 125,000   |
|                      |     | オブティム                   | 100       | 2,869.00  | 286,900   |
|                      |     | SHIFT                   | 100       | 13,670.00 | 1,367,000 |
|                      |     | ティーガイア                  | 100       | 1,850.00  | 185,000   |
| 日本アジアグループ            | 100 | 747.00                  | 74,700    |           |           |
| テクマトリックス             | 200 | 2,042.00                | 408,400   |           |           |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 300 | 2,670.00                | 801,000   |           |           |
| GMOペイメントゲートウェイ       | 300 | 13,890.00               | 4,167,000 |           |           |
| インターネットイニシアティブ       | 200 | 4,165.00                | 833,000   |           |           |
| さくらインターネット           | 200 | 701.00                  | 140,200   |           |           |
| SRAホールディングス          | 100 | 2,517.00                | 251,700   |           |           |
| 朝日ネット                | 100 | 869.00                  | 86,900    |           |           |
| eBASE                | 200 | 1,065.00                | 213,000   |           |           |
| アバント                 | 200 | 1,154.00                | 230,800   |           |           |

| 種類                      | 通貨  | 銘柄                    | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額      |
|-------------------------|-----|-----------------------|-----------|-----------|------------|
| 株式                      | 日本円 | フリービット                | 100       | 1,010.00  | 101,000    |
|                         |     | コムチュア                 | 100       | 2,998.00  | 299,800    |
|                         |     | サイバーコム                | 100       | 1,755.00  | 175,500    |
|                         |     | アステリア                 | 100       | 1,049.00  | 104,900    |
|                         |     | アイル                   | 100       | 1,603.00  | 160,300    |
|                         |     | マークラインズ               | 100       | 2,770.00  | 277,000    |
|                         |     | メディカル・データ・ビジョン        | 100       | 2,606.00  | 260,600    |
|                         |     | g u m i               | 200       | 840.00    | 168,000    |
|                         |     | デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 100       | 1,551.00  | 155,100    |
|                         |     | P C Iホールディングス         | 100       | 1,378.00  | 137,800    |
|                         |     | オープンドア                | 100       | 1,321.00  | 132,100    |
|                         |     | アカツキ                  | 100       | 4,400.00  | 440,000    |
|                         |     | L I N E               | 300       | 5,360.00  | 1,608,000  |
|                         |     | カナミックネットワーク           | 100       | 768.00    | 76,800     |
|                         |     | チェンジ                  | 100       | 7,710.00  | 771,000    |
|                         |     | オークネット                | 100       | 1,420.00  | 142,000    |
|                         |     | マクロミル                 | 300       | 699.00    | 209,700    |
|                         |     | ソルクシーズ                | 100       | 1,007.00  | 100,700    |
|                         |     | プロトコーポレーション           | 100       | 1,026.00  | 102,600    |
|                         |     | 野村総合研究所               | 1,700     | 3,380.00  | 5,746,000  |
|                         |     | サイバネットシステム            | 100       | 996.00    | 99,600     |
|                         |     | インテージホールディングス         | 200       | 1,143.00  | 228,600    |
|                         |     | ソースネクスト               | 700       | 301.00    | 210,700    |
|                         |     | インフォコム                | 100       | 3,285.00  | 328,500    |
|                         |     | ラクスル                  | 100       | 4,635.00  | 463,500    |
|                         |     | F I G                 | 300       | 281.00    | 84,300     |
|                         |     | イーソル                  | 100       | 1,328.00  | 132,800    |
|                         |     | アルテリア・ネットワークス         | 100       | 1,535.00  | 153,500    |
|                         |     | フォーカスシステムズ            | 100       | 919.00    | 91,900     |
|                         |     | クレスコ                  | 100       | 1,340.00  | 134,000    |
|                         |     | フジ・メディア・ホールディングス      | 1,200     | 1,131.00  | 1,357,200  |
|                         |     | オービック                 | 400       | 21,060.00 | 8,424,000  |
|                         |     | ジャストシステム              | 200       | 7,140.00  | 1,428,000  |
|                         |     | T D Cソフト              | 200       | 1,006.00  | 201,200    |
|                         |     | Zホールディングス             | 16,700    | 613.40    | 10,243,780 |
|                         |     | トレンドマイクロ              | 700       | 5,740.00  | 4,018,000  |
|                         |     | 日本オラクル                | 200       | 11,340.00 | 2,268,000  |
|                         |     | フューチャー                | 100       | 1,779.00  | 177,900    |
|                         |     | C A C H o l d i n g s | 100       | 1,490.00  | 149,000    |
|                         |     | オービックビジネスコンサルタント      | 100       | 6,800.00  | 680,000    |
|                         |     | 伊藤忠テクノソリューションズ        | 600       | 3,785.00  | 2,271,000  |
|                         |     | アイティフォー               | 200       | 945.00    | 189,000    |
|                         |     | 大塚商会                  | 700       | 5,100.00  | 3,570,000  |
|                         |     | サイボウズ                 | 200       | 2,604.00  | 520,800    |
|                         |     | 電通国際情報サービス            | 100       | 6,660.00  | 666,000    |
|                         |     | A C C E S S           | 100       | 783.00    | 78,300     |
|                         |     | デジタルガレージ              | 200       | 4,210.00  | 842,000    |
| EMシステムズ                 | 200 | 859.00                | 171,800   |           |            |
| C I J                   | 100 | 943.00                | 94,300    |           |            |
| スカラ                     | 100 | 840.00                | 84,000    |           |            |
| インテリジェント ウェイブ           | 100 | 700.00                | 70,000    |           |            |
| I M A G I C A G R O U P | 300 | 360.00                | 108,000   |           |            |
| ネットワンシステムズ              | 500 | 3,870.00              | 1,935,000 |           |            |
| アルゴグラフィックス              | 100 | 3,105.00              | 310,500   |           |            |
| マーベラス                   | 200 | 864.00                | 172,800   |           |            |
| エイベックス                  | 200 | 1,025.00              | 205,000   |           |            |
| 日本ユニシス                  | 400 | 3,875.00              | 1,550,000 |           |            |

| 種類                  | 通貨  | 銘柄                   | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額      |
|---------------------|-----|----------------------|-----------|-----------|------------|
| 株式                  | 日本円 | 兼松エレクトロニクス           | 100       | 4,095.00  | 409,500    |
|                     |     | TBSホールディングス          | 700       | 1,948.00  | 1,363,600  |
|                     |     | 日本テレビホールディングス        | 1,000     | 1,160.00  | 1,160,000  |
|                     |     | 朝日放送グループホールディングス     | 200       | 692.00    | 138,400    |
|                     |     | テレビ朝日ホールディングス        | 300       | 1,728.00  | 518,400    |
|                     |     | スカパーJ SATホールディングス    | 800       | 513.00    | 410,400    |
|                     |     | テレビ東京ホールディングス        | 100       | 2,304.00  | 230,400    |
|                     |     | 日本BS放送               | 100       | 1,092.00  | 109,200    |
|                     |     | ビジョン                 | 200       | 1,104.00  | 220,800    |
|                     |     | コネクシオ                | 100       | 1,380.00  | 138,000    |
|                     |     | 日本通信                 | 1,300     | 191.00    | 248,300    |
|                     |     | 日本電信電話               | 16,300    | 2,650.00  | 43,195,000 |
|                     |     | KDDI                 | 8,900     | 2,960.50  | 26,348,450 |
|                     |     | ソフトバンク               | 11,000    | 1,341.50  | 14,756,500 |
|                     |     | 光通信                  | 100       | 25,070.00 | 2,507,000  |
|                     |     | エムティーアイ              | 100       | 816.00    | 81,600     |
|                     |     | GMOインターネット           | 400       | 2,925.00  | 1,170,000  |
|                     |     | KADOKAWA             | 300       | 3,575.00  | 1,072,500  |
|                     |     | 学研ホールディングス           | 200       | 1,751.00  | 350,200    |
|                     |     | ゼンリン                 | 300       | 1,279.00  | 383,700    |
|                     |     | アイネット                | 100       | 1,535.00  | 153,500    |
|                     |     | 松竹                   | 100       | 14,300.00 | 1,430,000  |
|                     |     | 東宝                   | 700       | 4,385.00  | 3,069,500  |
|                     |     | エヌ・ティ・ティ・データ         | 3,200     | 1,362.00  | 4,358,400  |
|                     |     | ビジネスブレイン太田昭和         | 100       | 1,520.00  | 152,000    |
|                     |     | DTS                  | 300       | 2,238.00  | 671,400    |
|                     |     | スクウェア・エニックス・ホールディングス | 500       | 6,420.00  | 3,210,000  |
|                     |     | シーイーシー               | 100       | 1,543.00  | 154,300    |
|                     |     | カプコン                 | 600       | 6,590.00  | 3,954,000  |
|                     |     | ジャステック               | 100       | 1,337.00  | 133,700    |
|                     |     | SCSK                 | 300       | 5,760.00  | 1,728,000  |
|                     |     | アイネス                 | 100       | 1,428.00  | 142,800    |
|                     |     | TKC                  | 100       | 6,900.00  | 690,000    |
|                     |     | 富士ソフト                | 100       | 5,020.00  | 502,000    |
|                     |     | NSD                  | 400       | 2,021.00  | 808,400    |
|                     |     | コナミホールディングス          | 400       | 6,000.00  | 2,400,000  |
|                     |     | JBC Cホールディングス        | 100       | 1,483.00  | 148,300    |
|                     |     | ミロク情報サービス            | 100       | 2,027.00  | 202,700    |
|                     |     | ソフトバンクグループ           | 9,700     | 7,999.00  | 77,590,300 |
|                     |     | 高千穂交易                | 100       | 1,172.00  | 117,200    |
|                     |     | エレマテック               | 100       | 1,058.00  | 105,800    |
|                     |     | あらた                  | 100       | 5,060.00  | 506,000    |
|                     |     | 双日                   | 6,900     | 236.00    | 1,628,400  |
|                     |     | アルフレッサホールディングス       | 1,400     | 2,064.00  | 2,889,600  |
|                     |     | 横浜冷凍                 | 300       | 873.00    | 261,900    |
|                     |     | ラサ商事                 | 100       | 909.00    | 90,900     |
|                     |     | アルコニックス              | 100       | 1,465.00  | 146,500    |
| 神戸物産                | 800 | 3,205.00             | 2,564,000 |           |            |
| あいホールディングス          | 200 | 2,185.00             | 437,000   |           |            |
| ダイワボウホールディングス       | 100 | 8,420.00             | 842,000   |           |            |
| マクニカ・富士エレホールディングス   | 300 | 2,011.00             | 603,300   |           |            |
| ラクト・ジャパン            | 100 | 2,977.00             | 297,700   |           |            |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 200 | 865.00               | 173,000   |           |            |
| 八洲電機                | 100 | 980.00               | 98,000    |           |            |
| メディアスホールディングス       | 100 | 797.00               | 79,700    |           |            |
| レスターホールディングス        | 100 | 2,214.00             | 221,400   |           |            |
| TOKAIホールディングス       | 600 | 1,013.00             | 607,800   |           |            |

| 種類              | 通貨  | 銘柄               | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額      |
|-----------------|-----|------------------|-----------|-----------|------------|
| 株式              | 日本円 | 三洋貿易             | 100       | 996.00    | 99,600     |
|                 |     | ウイン・パートナーズ       | 100       | 1,228.00  | 122,800    |
|                 |     | シップヘルスケアホールディングス | 200       | 5,520.00  | 1,104,000  |
|                 |     | コメダホールディングス      | 300       | 1,839.00  | 551,700    |
|                 |     | 小野建              | 100       | 1,204.00  | 120,400    |
|                 |     | 佐島電機             | 100       | 807.00    | 80,700     |
|                 |     | 伯東               | 100       | 1,083.00  | 108,300    |
|                 |     | コンドーテック          | 100       | 1,059.00  | 105,900    |
|                 |     | ナガイレーベン          | 200       | 2,756.00  | 551,200    |
|                 |     | 三菱食品             | 100       | 2,874.00  | 287,400    |
|                 |     | 松田産業             | 100       | 1,831.00  | 183,100    |
|                 |     | 第一興商             | 200       | 3,695.00  | 739,000    |
|                 |     | メディopalホールディングス  | 1,300     | 2,029.00  | 2,637,700  |
|                 |     | S P K            | 100       | 1,294.00  | 129,400    |
|                 |     | 萩原電気ホールディングス     | 100       | 2,452.00  | 245,200    |
|                 |     | アズワン             | 100       | 15,070.00 | 1,507,000  |
|                 |     | シモジマ             | 100       | 1,417.00  | 141,700    |
|                 |     | ドウシシャ            | 100       | 1,921.00  | 192,100    |
|                 |     | 高速               | 100       | 1,622.00  | 162,200    |
|                 |     | リックス             | 100       | 1,665.00  | 166,500    |
|                 |     | ハピネット            | 100       | 1,535.00  | 153,500    |
|                 |     | 日本ライフライン         | 300       | 1,585.00  | 475,500    |
|                 |     | タカショー            | 100       | 881.00    | 88,100     |
|                 |     | I D O M          | 300       | 539.00    | 161,700    |
|                 |     | 進和               | 100       | 2,201.00  | 220,100    |
|                 |     | ダイトロン            | 100       | 1,654.00  | 165,400    |
|                 |     | シークス             | 200       | 1,584.00  | 316,800    |
|                 |     | オーハシテクニカ         | 100       | 1,445.00  | 144,500    |
|                 |     | 伊藤忠商事            | 8,600     | 2,906.50  | 24,995,900 |
|                 |     | 丸紅               | 12,700    | 670.30    | 8,512,810  |
|                 |     | 長瀬産業             | 700       | 1,487.00  | 1,040,900  |
|                 |     | 蝶理               | 100       | 1,617.00  | 161,700    |
|                 |     | 豊田通商             | 1,400     | 3,895.00  | 5,453,000  |
|                 |     | 三共生興             | 200       | 485.00    | 97,000     |
|                 |     | 兼松               | 500       | 1,277.00  | 638,500    |
|                 |     | 三井物産             | 10,600    | 1,881.50  | 19,943,900 |
|                 |     | 日本紙パルプ商事         | 100       | 3,610.00  | 361,000    |
|                 |     | カメイ              | 100       | 1,212.00  | 121,200    |
|                 |     | スターゼン            | 100       | 4,130.00  | 413,000    |
|                 |     | 山善               | 500       | 1,064.00  | 532,000    |
|                 |     | 住友商事             | 7,700     | 1,332.50  | 10,260,250 |
|                 |     | 三菱商事             | 8,000     | 2,528.50  | 20,228,000 |
|                 |     | 第一実業             | 100       | 4,085.00  | 408,500    |
| キャノンマーケティングジャパン | 300 | 2,330.00         | 699,000   |           |            |
| 西華産業            | 100 | 1,334.00         | 133,400   |           |            |
| 佐藤商事            | 100 | 997.00           | 99,700    |           |            |
| 菱洋エレクトロ         | 100 | 2,798.00         | 279,800   |           |            |
| 東京産業            | 200 | 586.00           | 117,200   |           |            |
| ユアサ商事           | 100 | 3,485.00         | 348,500   |           |            |
| 神鋼商事            | 100 | 1,867.00         | 186,700   |           |            |
| 阪和興業            | 200 | 2,788.00         | 557,600   |           |            |
| 正栄食品工業          | 100 | 3,725.00         | 372,500   |           |            |
| カナデン            | 100 | 1,331.00         | 133,100   |           |            |
| 菱電商事            | 100 | 1,512.00         | 151,200   |           |            |
| 岩谷産業            | 300 | 6,180.00         | 1,854,000 |           |            |
| ナイス             | 100 | 1,622.00         | 162,200   |           |            |
| 極東貿易            | 100 | 1,311.00         | 131,100   |           |            |

| 種類           | 通貨  | 銘柄                | 株数      | 評価額単価    | 評価額金額     |
|--------------|-----|-------------------|---------|----------|-----------|
| 株式           | 日本円 | イワキ               | 300     | 530.00   | 159,000   |
|              |     | 三愛石油              | 300     | 1,219.00 | 365,700   |
|              |     | 稲畑産業              | 300     | 1,453.00 | 435,900   |
|              |     | ヤマエ久野             | 100     | 1,222.00 | 122,200   |
|              |     | ワキタ               | 300     | 1,121.00 | 336,300   |
|              |     | 東邦ホールディングス        | 400     | 1,885.00 | 754,000   |
|              |     | サンゲツ              | 400     | 1,536.00 | 614,400   |
|              |     | ミツウロコグループホールディングス | 200     | 1,407.00 | 281,400   |
|              |     | シナネンホールディングス      | 100     | 2,967.00 | 296,700   |
|              |     | 伊藤忠エネクス           | 200     | 1,018.00 | 203,600   |
|              |     | サンリオ              | 300     | 1,498.00 | 449,400   |
|              |     | リョーサン             | 100     | 1,894.00 | 189,400   |
|              |     | 新光商事              | 200     | 740.00   | 148,000   |
|              |     | トーホー              | 100     | 2,055.00 | 205,500   |
|              |     | 三信電気              | 100     | 2,162.00 | 216,200   |
|              |     | 東陽テクニカ            | 200     | 1,125.00 | 225,000   |
|              |     | モスフードサービス         | 100     | 2,894.00 | 289,400   |
|              |     | 加賀電子              | 100     | 2,295.00 | 229,500   |
|              |     | 立花エレテック           | 100     | 1,668.00 | 166,800   |
|              |     | PALTAC            | 200     | 5,740.00 | 1,148,000 |
|              |     | 国際紙パルプ商事          | 300     | 251.00   | 75,300    |
|              |     | ヤマタネ              | 100     | 1,373.00 | 137,300   |
|              |     | 日鉄物産              | 100     | 3,830.00 | 383,000   |
|              |     | トラスコ中山            | 300     | 2,857.00 | 857,100   |
|              |     | オートバックスセブン        | 500     | 1,379.00 | 689,500   |
|              |     | モリト               | 200     | 642.00   | 128,400   |
|              |     | 加藤産業              | 200     | 3,420.00 | 684,000   |
|              |     | イエローハット           | 200     | 1,561.00 | 312,200   |
|              |     | J Kホールディングス       | 100     | 867.00   | 86,700    |
|              |     | 日伝                | 100     | 2,271.00 | 227,100   |
|              |     | 杉本商事              | 100     | 2,474.00 | 247,400   |
|              |     | 因幡電機産業            | 400     | 2,501.00 | 1,000,400 |
|              |     | ミスミグループ本社         | 1,500   | 3,420.00 | 5,130,000 |
|              |     | タキヒヨー             | 100     | 1,962.00 | 196,200   |
|              |     | スズケン              | 500     | 3,940.00 | 1,970,000 |
|              |     | グローセル             | 200     | 443.00   | 88,600    |
|              |     | ローソン              | 300     | 4,735.00 | 1,420,500 |
|              |     | サンエー              | 100     | 4,215.00 | 421,500   |
|              |     | カワチ薬品             | 100     | 2,998.00 | 299,800   |
|              |     | エービーシー・マート        | 200     | 5,440.00 | 1,088,000 |
|              |     | アスクル              | 100     | 4,290.00 | 429,000   |
|              |     | ゲオホールディングス        | 200     | 1,241.00 | 248,200   |
|              |     | アダストリア            | 200     | 1,932.00 | 386,400   |
|              |     | くら寿司              | 100     | 6,540.00 | 654,000   |
|              |     | キャンドウ             | 100     | 1,890.00 | 189,000   |
|              |     | パルグループホールディングス    | 200     | 1,199.00 | 239,800   |
|              |     | エディオオン            | 500     | 1,005.00 | 502,500   |
| サーラコーポレーション  | 300 | 564.00            | 169,200 |          |           |
| ワッツ          | 100 | 840.00            | 84,000  |          |           |
| フジオフードグループ本社 | 100 | 1,365.00          | 136,500 |          |           |
| ひらまつ         | 400 | 179.00            | 71,600  |          |           |
| ハニーズホールディングス | 100 | 978.00            | 97,800  |          |           |
| アルペン         | 100 | 2,431.00          | 243,100 |          |           |
| クオールホールディングス | 200 | 1,145.00          | 229,000 |          |           |
| ジンズホールディングス  | 100 | 6,760.00          | 676,000 |          |           |
| ビックカメラ       | 700 | 1,137.00          | 795,900 |          |           |
| DCMホールディングス  | 800 | 1,185.00          | 948,000 |          |           |

| 種類                   | 通貨    | 銘柄                   | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額      |
|----------------------|-------|----------------------|-----------|-----------|------------|
| 株式                   | 日本円   | Monotaro             | 900       | 5,380.00  | 4,842,000  |
|                      |       | アークランドサービスホールディングス   | 100       | 2,131.00  | 213,100    |
|                      |       | J. フロント リテイリング       | 1,500     | 894.00    | 1,341,000  |
|                      |       | ドトール・日レスホールディングス     | 200       | 1,514.00  | 302,800    |
|                      |       | マツモトキヨシホールディングス      | 500       | 4,610.00  | 2,305,000  |
|                      |       | ブロンコビリー              | 100       | 2,429.00  | 242,900    |
|                      |       | ZOZO                 | 800       | 2,637.00  | 2,109,600  |
|                      |       | ココカラファイン             | 100       | 7,600.00  | 760,000    |
|                      |       | 三越伊勢丹ホールディングス        | 2,200     | 618.00    | 1,359,600  |
|                      |       | ウエルシアホールディングス        | 700       | 3,935.00  | 2,754,500  |
|                      |       | クリエイトSDホールディングス      | 200       | 3,800.00  | 760,000    |
|                      |       | シュッピン                | 100       | 866.00    | 86,600     |
|                      |       | オイシックス・ラ・大地          | 100       | 3,015.00  | 301,500    |
|                      |       | ネクステージ               | 200       | 1,325.00  | 265,000    |
|                      |       | ジョイフル本田              | 400       | 1,469.00  | 587,600    |
|                      |       | ホットランド               | 100       | 1,311.00  | 131,100    |
|                      |       | すかいらくホールディングス        | 1,400     | 1,634.00  | 2,287,600  |
|                      |       | SFPホールディングス          | 100       | 1,273.00  | 127,300    |
|                      |       | 綿半ホールディングス           | 100       | 1,349.00  | 134,900    |
|                      |       | ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 400       | 1,134.00  | 453,600    |
|                      |       | BEENOS               | 100       | 2,587.00  | 258,700    |
|                      |       | あさひ                  | 100       | 1,711.00  | 171,100    |
|                      |       | 日本調剤                 | 100       | 1,504.00  | 150,400    |
|                      |       | コスモス薬品               | 100       | 17,050.00 | 1,705,000  |
|                      |       | トーエル                 | 100       | 799.00    | 79,900     |
|                      |       | セブン&アイ・ホールディングス      | 4,800     | 3,594.00  | 17,251,200 |
|                      |       | クリエイト・レストランツ・ホールディング | 700       | 610.00    | 427,000    |
|                      |       | ツルハホールディングス          | 300       | 16,050.00 | 4,815,000  |
|                      |       | サンマルクホールディングス        | 100       | 1,408.00  | 140,800    |
|                      |       | トリドールホールディングス        | 300       | 1,385.00  | 415,500    |
|                      |       | TOKYO BASE           | 100       | 517.00    | 51,700     |
|                      |       | JMホールディングス           | 100       | 2,348.00  | 234,800    |
|                      |       | アレンザホールディングス         | 100       | 1,305.00  | 130,500    |
|                      |       | 串カツ田中ホールディングス        | 100       | 1,554.00  | 155,400    |
|                      |       | バロックジャパンリミテッド        | 200       | 676.00    | 135,200    |
|                      |       | クスリのアオキホールディングス      | 100       | 8,930.00  | 893,000    |
|                      |       | 力の源ホールディングス          | 100       | 592.00    | 59,200     |
|                      |       | スシローグローバルホールディングス    | 700       | 3,550.00  | 2,485,000  |
|                      |       | メディカルシステムネットワーク      | 100       | 652.00    | 65,200     |
|                      |       | ノジマ                  | 200       | 2,664.00  | 532,800    |
|                      |       | カップ・クリエイト            | 200       | 1,480.00  | 296,000    |
|                      |       | 良品計画                 | 1,600     | 2,035.00  | 3,256,000  |
|                      |       | アドヴァン                | 200       | 1,268.00  | 253,600    |
|                      |       | アルビス                 | 100       | 2,510.00  | 251,000    |
|                      |       | コナカ                  | 300       | 290.00    | 87,000     |
|                      |       | G-7ホールディングス          | 100       | 2,305.00  | 230,500    |
|                      |       | イオン北海道               | 100       | 937.00    | 93,700     |
| コジマ                  | 200   | 729.00               | 145,800   |           |            |
| コーナン商事               | 200   | 3,205.00             | 641,000   |           |            |
| ワタミ                  | 200   | 886.00               | 177,200   |           |            |
| パン・パシフィック・インターナショナルホ | 2,700 | 2,386.00             | 6,442,200 |           |            |
| 西松屋チェーン              | 300   | 1,519.00             | 455,700   |           |            |
| ゼンショーホールディングス        | 600   | 2,682.00             | 1,609,200 |           |            |
| 幸楽苑ホールディングス          | 100   | 1,710.00             | 171,000   |           |            |
| サイゼリヤ                | 200   | 1,880.00             | 376,000   |           |            |
| VTホールディングス           | 500   | 389.00               | 194,500   |           |            |
| 魚力                   | 100   | 1,825.00             | 182,500   |           |            |

| 種類            | 通貨    | 銘柄                | 株数         | 評価額単価     | 評価額金額      |
|---------------|-------|-------------------|------------|-----------|------------|
| 株式            | 日本円   | ユナイテッドアローズ        | 100        | 1,652.00  | 165,200    |
|               |       | ハイデイ日高            | 200        | 1,723.00  | 344,600    |
|               |       | コロワイド             | 400        | 1,612.00  | 644,800    |
|               |       | ピーシーデポコーポレーション    | 100        | 591.00    | 59,100     |
|               |       | 老番屋               | 100        | 5,080.00  | 508,000    |
|               |       | スギホールディングス        | 300        | 7,170.00  | 2,151,000  |
|               |       | スクロール             | 200        | 726.00    | 145,200    |
|               |       | ヨンドシーホールディングス     | 100        | 1,959.00  | 195,900    |
|               |       | 木曽路               | 200        | 2,408.00  | 481,600    |
|               |       | SRSホールディングス       | 200        | 848.00    | 169,600    |
|               |       | 千趣会               | 400        | 350.00    | 140,000    |
|               |       | リテールパートナーズ        | 200        | 1,438.00  | 287,600    |
|               |       | ケーヨー              | 200        | 746.00    | 149,200    |
|               |       | 上新電機              | 200        | 2,775.00  | 555,000    |
|               |       | 日本瓦斯              | 200        | 5,630.00  | 1,126,000  |
|               |       | ロイヤルホールディングス      | 200        | 1,935.00  | 387,000    |
|               |       | いなげや              | 200        | 1,904.00  | 380,800    |
|               |       | 島忠                | 200        | 5,480.00  | 1,096,000  |
|               |       | チヨダ               | 100        | 932.00    | 93,200     |
|               |       | ライフコーポレーション       | 100        | 3,555.00  | 355,500    |
|               |       | リンガーハット           | 200        | 2,339.00  | 467,800    |
|               |       | MrMaxHD           | 200        | 840.00    | 168,000    |
|               |       | AOKIホールディングス      | 300        | 502.00    | 150,600    |
|               |       | オークワ              | 200        | 1,337.00  | 267,400    |
|               |       | コメリ               | 200        | 2,853.00  | 570,600    |
|               |       | 青山商事              | 300        | 523.00    | 156,900    |
|               |       | しまむら              | 100        | 10,450.00 | 1,045,000  |
|               |       | 高島屋               | 900        | 861.00    | 774,900    |
|               |       | 松屋                | 300        | 777.00    | 233,100    |
|               |       | エイチ・ツー・オー リテイリング  | 500        | 695.00    | 347,500    |
|               |       | 近鉄百貨店             | 100        | 3,335.00  | 333,500    |
|               |       | 丸井グループ            | 1,100      | 1,928.00  | 2,120,800  |
|               |       | アクシアル リテイリング      | 100        | 4,865.00  | 486,500    |
|               |       | イオン               | 4,700      | 3,050.00  | 14,335,000 |
|               |       | イズミ               | 200        | 3,815.00  | 763,000    |
|               |       | 平和堂               | 300        | 2,153.00  | 645,900    |
|               |       | フジ                | 100        | 1,966.00  | 196,600    |
|               |       | ヤオコー              | 100        | 6,980.00  | 698,000    |
|               |       | ゼビオホールディングス       | 200        | 835.00    | 167,000    |
|               |       | ケーズホールディングス       | 1,200      | 1,319.00  | 1,582,800  |
|               |       | Genky DrugStores  | 100        | 4,065.00  | 406,500    |
|               |       | ブックオフグループホールディングス | 100        | 835.00    | 83,500     |
|               |       | アインホールディングス       | 200        | 6,420.00  | 1,284,000  |
| ヤマダホールディングス   | 3,800 | 529.00            | 2,010,200  |           |            |
| アークランドサカモト    | 200   | 1,765.00          | 353,000    |           |            |
| ニトリホールディングス   | 500   | 21,430.00         | 10,715,000 |           |            |
| グルメ杵屋         | 100   | 1,004.00          | 100,400    |           |            |
| 吉野家ホールディングス   | 400   | 1,921.00          | 768,400    |           |            |
| 松屋フーズホールディングス | 100   | 3,385.00          | 338,500    |           |            |
| サガミホールディングス   | 200   | 1,261.00          | 252,200    |           |            |
| 関西スーパーマーケット   | 100   | 1,265.00          | 126,500    |           |            |
| 王将フードサービス     | 100   | 5,930.00          | 593,000    |           |            |
| プレナス          | 200   | 1,742.00          | 348,400    |           |            |
| ミニストップ        | 100   | 1,416.00          | 141,600    |           |            |
| アークス          | 200   | 2,235.00          | 447,000    |           |            |
| バローホールディングス   | 300   | 2,624.00          | 787,200    |           |            |
| ベルク           | 100   | 6,200.00          | 620,000    |           |            |



| 種類              | 通貨    | 銘柄                  | 株数        | 評価額単価     | 評価額金額      |
|-----------------|-------|---------------------|-----------|-----------|------------|
| 株式              | 日本円   | 大庄                  | 100       | 1,011.00  | 101,100    |
|                 |       | ファーストリテイリング         | 200       | 84,380.00 | 16,876,000 |
|                 |       | サンドラッグ              | 500       | 4,245.00  | 2,122,500  |
|                 |       | ベルーナ                | 300       | 934.00    | 280,200    |
|                 |       | じもとホールディングス         | 100       | 874.00    | 87,400     |
|                 |       | めぶきフィナンシャルグループ      | 6,200     | 202.00    | 1,252,400  |
|                 |       | 東京きらぼしフィナンシャルグループ   | 200       | 1,163.00  | 232,600    |
|                 |       | 九州フィナンシャルグループ       | 2,700     | 461.00    | 1,244,700  |
|                 |       | ゆうちょ銀行              | 3,500     | 858.00    | 3,003,000  |
|                 |       | 富山第一銀行              | 500       | 288.00    | 144,000    |
|                 |       | コンコルディア・フィナンシャルグループ | 6,900     | 372.00    | 2,566,800  |
|                 |       | 西日本フィナンシャルホールディングス  | 900       | 713.00    | 641,700    |
|                 |       | 関西みらいフィナンシャルグループ    | 700       | 514.00    | 359,800    |
|                 |       | 三十三フィナンシャルグループ      | 100       | 1,262.00  | 126,200    |
|                 |       | 第四北越フィナンシャルグループ     | 200       | 2,350.00  | 470,000    |
|                 |       | ひろぎんホールディングス        | 1,800     | 613.00    | 1,103,400  |
|                 |       | 新生銀行                | 900       | 1,234.00  | 1,110,600  |
|                 |       | あおぞら銀行              | 700       | 1,894.00  | 1,325,800  |
|                 |       | 三菱UFJフィナンシャル・グループ   | 83,800    | 445.60    | 37,341,280 |
|                 |       | りそなホールディングス         | 13,200    | 371.20    | 4,899,840  |
|                 |       | 三井住友トラスト・ホールディングス   | 2,300     | 3,145.00  | 7,233,500  |
|                 |       | 三井住友フィナンシャルグループ     | 8,500     | 3,123.00  | 26,545,500 |
|                 |       | 千葉銀行                | 4,000     | 587.00    | 2,348,000  |
|                 |       | 群馬銀行                | 2,500     | 327.00    | 817,500    |
|                 |       | 武蔵野銀行               | 200       | 1,564.00  | 312,800    |
|                 |       | 千葉興業銀行              | 300       | 264.00    | 79,200     |
|                 |       | 筑波銀行                | 700       | 195.00    | 136,500    |
|                 |       | 七十七銀行               | 400       | 1,441.00  | 576,400    |
|                 |       | 青森銀行                | 100       | 2,471.00  | 247,100    |
|                 |       | 秋田銀行                | 100       | 1,381.00  | 138,100    |
|                 |       | 山形銀行                | 200       | 1,053.00  | 210,600    |
|                 |       | 岩手銀行                | 100       | 2,083.00  | 208,300    |
|                 |       | 東邦銀行                | 1,000     | 219.00    | 219,000    |
|                 |       | みちのく銀行              | 100       | 1,114.00  | 111,400    |
|                 |       | ふくおかフィナンシャルグループ     | 1,000     | 1,882.00  | 1,882,000  |
|                 |       | 静岡銀行                | 2,900     | 765.00    | 2,218,500  |
|                 |       | 十六銀行                | 100       | 1,938.00  | 193,800    |
|                 |       | 八十二銀行               | 3,000     | 353.00    | 1,059,000  |
|                 |       | 山梨中央銀行              | 100       | 769.00    | 76,900     |
|                 |       | 大垣共立銀行              | 200       | 2,247.00  | 449,400    |
|                 |       | 福井銀行                | 100       | 1,865.00  | 186,500    |
|                 |       | 北國銀行                | 100       | 2,775.00  | 277,500    |
|                 |       | 滋賀銀行                | 200       | 2,315.00  | 463,000    |
|                 |       | 南都銀行                | 200       | 1,831.00  | 366,200    |
|                 |       | 百五銀行                | 1,100     | 308.00    | 338,800    |
|                 |       | 京都銀行                | 400       | 5,370.00  | 2,148,000  |
|                 |       | 紀陽銀行                | 400       | 1,532.00  | 612,800    |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 800   | 1,036.00            | 828,800   |           |            |
| 山陰合同銀行          | 700   | 529.00              | 370,300   |           |            |
| 中国銀行            | 1,000 | 856.00              | 856,000   |           |            |
| 鳥取銀行            | 100   | 1,126.00            | 112,600   |           |            |
| 伊予銀行            | 1,800 | 673.00              | 1,211,400 |           |            |
| 百十四銀行           | 200   | 1,565.00            | 313,000   |           |            |
| 四国銀行            | 200   | 704.00              | 140,800   |           |            |
| 阿波銀行            | 200   | 2,455.00            | 491,000   |           |            |
| 大分銀行            | 100   | 2,184.00            | 218,400   |           |            |
| 宮崎銀行            | 100   | 2,245.00            | 224,500   |           |            |

| 種類             | 通貨    | 銘柄                   | 株数        | 評価額単価    | 評価額金額      |
|----------------|-------|----------------------|-----------|----------|------------|
| 株式             | 日本円   | 佐賀銀行                 | 100       | 1,351.00 | 135,100    |
|                |       | 沖縄銀行                 | 100       | 2,914.00 | 291,400    |
|                |       | 琉球銀行                 | 300       | 825.00   | 247,500    |
|                |       | セブン銀行                | 4,000     | 220.00   | 880,000    |
|                |       | みずほフィナンシャルグループ       | 16,700    | 1,324.00 | 22,110,800 |
|                |       | 山口フィナンシャルグループ        | 1,500     | 624.00   | 936,000    |
|                |       | 名古屋銀行                | 100       | 2,626.00 | 262,600    |
|                |       | 北洋銀行                 | 1,900     | 233.00   | 442,700    |
|                |       | 愛知銀行                 | 100       | 3,125.00 | 312,500    |
|                |       | 中京銀行                 | 100       | 1,997.00 | 199,700    |
|                |       | 愛媛銀行                 | 200       | 1,026.00 | 205,200    |
|                |       | 京葉銀行                 | 600       | 442.00   | 265,200    |
|                |       | 栃木銀行                 | 600       | 182.00   | 109,200    |
|                |       | 東和銀行                 | 300       | 621.00   | 186,300    |
|                |       | 大東銀行                 | 200       | 628.00   | 125,600    |
|                |       | トモニホールディングス          | 1,000     | 332.00   | 332,000    |
|                |       | フィデアホールディングス         | 1,400     | 111.00   | 155,400    |
|                |       | 池田泉州ホールディングス         | 1,700     | 149.00   | 253,300    |
|                |       | F P G                | 400       | 506.00   | 202,400    |
|                |       | ジャパンインベストメントアドバイザー   | 100       | 1,463.00 | 146,300    |
|                |       | S B I ホールディングス       | 1,400     | 2,770.00 | 3,878,000  |
|                |       | ジャフコ グループ            | 200       | 4,770.00 | 954,000    |
|                |       | 大和証券グループ本社           | 9,800     | 469.20   | 4,598,160  |
|                |       | 野村ホールディングス           | 21,400    | 537.50   | 11,502,500 |
|                |       | 岡三証券グループ             | 1,000     | 377.00   | 377,000    |
|                |       | 丸三証券                 | 400       | 476.00   | 190,400    |
|                |       | 東洋証券                 | 600       | 139.00   | 83,400     |
|                |       | 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 1,500     | 309.00   | 463,500    |
|                |       | 水戸証券                 | 400       | 237.00   | 94,800     |
|                |       | いちよし証券               | 300       | 478.00   | 143,400    |
|                |       | 松井証券                 | 700       | 812.00   | 568,400    |
|                |       | マネックスグループ            | 900       | 341.00   | 306,900    |
|                |       | 極東証券                 | 200       | 701.00   | 140,200    |
|                |       | 岩井コスモホールディングス        | 200       | 1,278.00 | 255,600    |
|                |       | 藍澤證券                 | 200       | 740.00   | 148,000    |
|                |       | スパークス・グループ           | 800       | 258.00   | 206,400    |
|                |       | かんぽ生命保険              | 400       | 1,886.00 | 754,400    |
|                |       | S O M P O ホールディングス   | 2,300     | 4,050.00 | 9,315,000  |
|                |       | アニコム ホールディングス        | 400       | 1,052.00 | 420,800    |
|                |       | MS&ADインシュアランスグループホール | 3,200     | 3,093.00 | 9,897,600  |
|                |       | 第一生命ホールディングス         | 6,900     | 1,605.00 | 11,074,500 |
|                |       | 東京海上ホールディングス         | 4,300     | 5,208.00 | 22,394,400 |
|                |       | T&Dホールディングス          | 3,700     | 1,180.00 | 4,366,000  |
|                |       | 全国保証                 | 300       | 4,640.00 | 1,392,000  |
|                |       | イントラスト               | 100       | 882.00   | 88,200     |
|                |       | 日本モーゲージサービス          | 100       | 1,143.00 | 114,300    |
|                |       | アルヒ                  | 200       | 1,812.00 | 362,400    |
| プレミアグループ       | 100   | 2,183.00             | 218,300   |          |            |
| クレディセゾン        | 900   | 1,237.00             | 1,113,300 |          |            |
| 芙蓉総合リース        | 100   | 6,550.00             | 655,000   |          |            |
| みずほリース         | 200   | 2,966.00             | 593,200   |          |            |
| 東京センチュリー       | 200   | 7,310.00             | 1,462,000 |          |            |
| 日本証券金融         | 600   | 523.00               | 313,800   |          |            |
| アイフル           | 2,000 | 262.00               | 524,000   |          |            |
| リコーリース         | 100   | 3,050.00             | 305,000   |          |            |
| イオンフィナンシャルサービス | 700   | 1,230.00             | 861,000   |          |            |
| アコム            | 2,500 | 461.00               | 1,152,500 |          |            |

| 種類          | 通貨    | 銘柄               | 株数        | 評価額単価    | 評価額金額      |
|-------------|-------|------------------|-----------|----------|------------|
| 株式          | 日本円   | ジャックス            | 100       | 1,838.00 | 183,800    |
|             |       | オリエントコーポレーション    | 3,500     | 114.00   | 399,000    |
|             |       | 日立キャピタル          | 300       | 2,403.00 | 720,900    |
|             |       | オリックス            | 7,600     | 1,565.00 | 11,894,000 |
|             |       | 三菱UFJリース         | 3,000     | 478.00   | 1,434,000  |
|             |       | 日本取引所グループ        | 3,500     | 2,464.50 | 8,625,750  |
|             |       | イー・ギャランティ        | 100       | 2,082.00 | 208,200    |
|             |       | NECキャピタルソリューション  | 100       | 1,853.00 | 185,300    |
|             |       | いちご              | 1,700     | 316.00   | 537,200    |
|             |       | 日本駐車場開発          | 1,200     | 147.00   | 176,400    |
|             |       | スター・マイカ・ホールディングス | 100       | 1,404.00 | 140,400    |
|             |       | ADワークスグループ       | 700       | 164.00   | 114,800    |
|             |       | ヒューリック           | 2,600     | 1,119.00 | 2,909,400  |
|             |       | 三栄建築設計           | 100       | 1,624.00 | 162,400    |
|             |       | 野村不動産ホールディングス    | 700       | 2,251.00 | 1,575,700  |
|             |       | 三重交通グループホールディングス | 300       | 477.00   | 143,100    |
|             |       | サムティ             | 200       | 1,720.00 | 344,000    |
|             |       | ディア・ライフ          | 300       | 419.00   | 125,700    |
|             |       | 日本商業開発           | 100       | 1,761.00 | 176,100    |
|             |       | 日本管理センター         | 100       | 1,255.00 | 125,500    |
|             |       | フージャースホールディングス   | 200       | 734.00   | 146,800    |
|             |       | オープンハウス          | 400       | 3,795.00 | 1,518,000  |
|             |       | 東急不動産ホールディングス    | 3,400     | 525.00   | 1,785,000  |
|             |       | 飯田グループホールディングス   | 1,000     | 2,098.00 | 2,098,000  |
|             |       | ムゲンエステート         | 200       | 503.00   | 100,600    |
|             |       | ビーロッド            | 100       | 713.00   | 71,300     |
|             |       | ハウズドゥ            | 100       | 1,209.00 | 120,900    |
|             |       | グッドコムアセット        | 100       | 1,250.00 | 125,000    |
|             |       | パーク24            | 700       | 1,706.00 | 1,194,200  |
|             |       | バラカ              | 100       | 1,596.00 | 159,600    |
|             |       | 三井不動産            | 6,000     | 2,265.50 | 13,593,000 |
|             |       | 三菱地所             | 8,600     | 1,738.00 | 14,946,800 |
|             |       | 平和不動産            | 200       | 3,495.00 | 699,000    |
|             |       | 東京建物             | 1,200     | 1,468.00 | 1,761,600  |
|             |       | ダイビル             | 300       | 1,344.00 | 403,200    |
|             |       | 住友不動産            | 2,800     | 3,461.00 | 9,690,800  |
|             |       | テーオーシー           | 300       | 692.00   | 207,600    |
|             |       | スターツコーポレーション     | 200       | 3,010.00 | 602,000    |
|             |       | フジ住宅             | 100       | 650.00   | 65,000     |
|             |       | 空港施設             | 100       | 481.00   | 48,100     |
|             |       | ゴールドクレスト         | 100       | 1,582.00 | 158,200    |
|             |       | エスリード            | 100       | 1,348.00 | 134,800    |
|             |       | 日神グループホールディングス   | 200       | 418.00   | 83,600     |
|             |       | 日本エスコン           | 300       | 907.00   | 272,100    |
|             |       | タカラレーベン          | 600       | 309.00   | 185,400    |
|             |       | イオンモール           | 700       | 1,660.00 | 1,162,000  |
|             |       | ファースト住建          | 100       | 1,055.00 | 105,500    |
| ランド         | 8,800 | 9.00             | 79,200    |          |            |
| カチタス        | 300   | 3,125.00         | 937,500   |          |            |
| トーセイ        | 200   | 1,204.00         | 240,800   |          |            |
| 穴吹興産        | 100   | 1,664.00         | 166,400   |          |            |
| サンフロンティア不動産 | 200   | 897.00           | 179,400   |          |            |
| エフ・ジェー・ネクスト | 100   | 1,026.00         | 102,600   |          |            |
| サンネクスタグループ  | 100   | 983.00           | 98,300    |          |            |
| 日本空港ビルデング   | 400   | 6,720.00         | 2,688,000 |          |            |
| 日本工営        | 100   | 2,758.00         | 275,800   |          |            |
| LIFULL      | 400   | 401.00           | 160,400   |          |            |

| 種類                 | 通貨    | 銘柄                | 株数         | 評価額単価    | 評価額金額      |
|--------------------|-------|-------------------|------------|----------|------------|
| 株式                 | 日本円   | ミクシィ              | 200        | 2,641.00 | 528,200    |
|                    |       | ジェイエイシーリクルートメント   | 100        | 1,901.00 | 190,100    |
|                    |       | 日本M&Aセンター         | 900        | 6,750.00 | 6,075,000  |
|                    |       | UTグループ            | 200        | 3,330.00 | 666,000    |
|                    |       | アイティメディア          | 100        | 2,318.00 | 231,800    |
|                    |       | タケエイ              | 100        | 1,288.00 | 128,800    |
|                    |       | ビーネックスグループ        | 200        | 1,145.00 | 229,000    |
|                    |       | コシダカホールディングス      | 300        | 472.00   | 141,600    |
|                    |       | パソナグループ           | 100        | 2,147.00 | 214,700    |
|                    |       | リンクアンドモチベーション     | 300        | 576.00   | 172,800    |
|                    |       | G C A             | 200        | 739.00   | 147,800    |
|                    |       | エス・エム・エス          | 400        | 3,640.00 | 1,456,000  |
|                    |       | パーソルホールディングス      | 1,200      | 2,003.00 | 2,403,600  |
|                    |       | リニカル              | 100        | 727.00   | 72,700     |
|                    |       | クックパッド            | 400        | 321.00   | 128,400    |
|                    |       | アイ・ケイ・ケイ          | 100        | 633.00   | 63,300     |
|                    |       | スタジオアリス           | 100        | 2,037.00 | 203,700    |
|                    |       | シミックホールディングス      | 100        | 1,358.00 | 135,800    |
|                    |       | N J S             | 100        | 2,188.00 | 218,800    |
|                    |       | 総合警備保障            | 500        | 5,360.00 | 2,680,000  |
|                    |       | カカクコム             | 900        | 2,884.00 | 2,595,600  |
|                    |       | セントケア・ホールディング     | 100        | 879.00   | 87,900     |
|                    |       | ルネサンス             | 100        | 936.00   | 93,600     |
|                    |       | ディップ              | 200        | 2,777.00 | 555,400    |
|                    |       | デジタルホールディングス      | 100        | 1,984.00 | 198,400    |
|                    |       | 新日本科学             | 200        | 664.00   | 132,800    |
|                    |       | ツクイホールディングス       | 300        | 563.00   | 168,900    |
|                    |       | ベネフィット・ワン         | 400        | 3,050.00 | 1,220,000  |
|                    |       | エムスリー             | 2,600      | 9,179.00 | 23,865,400 |
|                    |       | アウトソーシング          | 700        | 1,498.00 | 1,048,600  |
|                    |       | ディー・エヌ・エー         | 500        | 1,904.00 | 952,000    |
|                    |       | 博報堂DYホールディングス     | 1,600      | 1,412.00 | 2,259,200  |
|                    |       | ぐるなび              | 200        | 525.00   | 105,000    |
|                    |       | タカミヤ              | 100        | 520.00   | 52,000     |
|                    |       | ジャパンベストレスキューシステム  | 100        | 929.00   | 92,900     |
|                    |       | ファンコミュニケーションズ     | 400        | 432.00   | 172,800    |
|                    |       | エスプール             | 400        | 746.00   | 298,400    |
|                    |       | WDBホールディングス       | 100        | 2,785.00 | 278,500    |
|                    |       | バリューコマース          | 100        | 3,600.00 | 360,000    |
|                    |       | インフォマート           | 1,200      | 931.00   | 1,117,200  |
|                    |       | J Pホールディングス       | 300        | 294.00   | 88,200     |
|                    |       | E P Sホールディングス     | 200        | 1,015.00 | 203,000    |
|                    |       | プレスステージ・インターナショナル | 500        | 913.00   | 456,500    |
| アミューズ              | 100   | 2,580.00          | 258,000    |          |            |
| クイック               | 100   | 1,184.00          | 118,400    |          |            |
| ケネディクス             | 1,000 | 748.00            | 748,000    |          |            |
| 電通グループ             | 1,300 | 3,295.00          | 4,283,500  |          |            |
| イオンファンタジー          | 100   | 2,379.00          | 237,900    |          |            |
| シーティーエス            | 100   | 1,017.00          | 101,700    |          |            |
| H. U. グループホールディングス | 300   | 2,931.00          | 879,300    |          |            |
| アルプス技研             | 100   | 2,335.00          | 233,500    |          |            |
| サニックス              | 300   | 263.00            | 78,900     |          |            |
| 日本空調サービス           | 100   | 787.00            | 78,700     |          |            |
| オリエンタルランド          | 1,300 | 17,615.00         | 22,899,500 |          |            |
| ダスキン               | 300   | 2,938.00          | 881,400    |          |            |
| 明光ネットワークジャパン       | 200   | 568.00            | 113,600    |          |            |
| ファルコホールディングス       | 100   | 1,654.00          | 165,400    |          |            |

| 種類           | 通貨  | 銘柄                    | 株数      | 評価額単価     | 評価額金額      |
|--------------|-----|-----------------------|---------|-----------|------------|
| 株式           | 日本円 | ラウンドワン                | 300     | 946.00    | 283,800    |
|              |     | リゾートトラスト              | 500     | 1,586.00  | 793,000    |
|              |     | ビー・エム・エル              | 100     | 3,575.00  | 357,500    |
|              |     | りらいあコミュニケーションズ        | 200     | 1,337.00  | 267,400    |
|              |     | リソー教育                 | 600     | 309.00    | 185,400    |
|              |     | ユー・エス・エス              | 1,300   | 2,092.00  | 2,719,600  |
|              |     | サイバーエージェント            | 700     | 6,800.00  | 4,760,000  |
|              |     | 楽天                    | 5,500   | 1,020.00  | 5,610,000  |
|              |     | クリーク・アンド・リバー社         | 100     | 1,081.00  | 108,100    |
|              |     | モーニングスター              | 200     | 457.00    | 91,400     |
|              |     | テー・オー・ダブリュー           | 300     | 283.00    | 84,900     |
|              |     | 山田コンサルティンググループ        | 100     | 977.00    | 97,700     |
|              |     | セントラルスポーツ             | 100     | 2,298.00  | 229,800    |
|              |     | フルキャストホールディングス        | 100     | 1,755.00  | 175,500    |
|              |     | エン・ジャパン               | 200     | 3,385.00  | 677,000    |
|              |     | テクノプロ・ホールディングス        | 200     | 8,260.00  | 1,652,000  |
|              |     | Keepers 技研            | 100     | 2,135.00  | 213,500    |
|              |     | イー・ガーディアン             | 100     | 3,045.00  | 304,500    |
|              |     | ジャパンマテリアル             | 400     | 1,390.00  | 556,000    |
|              |     | ベクトル                  | 200     | 931.00    | 186,200    |
|              |     | チャーム・ケア・コーポレーション      | 100     | 1,231.00  | 123,100    |
|              |     | I B J                 | 100     | 794.00    | 79,400     |
|              |     | N・フィールド               | 100     | 857.00    | 85,700     |
|              |     | バリューHR                | 100     | 1,808.00  | 180,800    |
|              |     | M&Aキャピタルパートナーズ        | 100     | 6,250.00  | 625,000    |
|              |     | シグマクシス                | 100     | 1,768.00  | 176,800    |
|              |     | ウィルグループ               | 100     | 1,059.00  | 105,900    |
|              |     | エスクロー・エージェント・ジャパン     | 300     | 316.00    | 94,800     |
|              |     | メドピア                  | 100     | 6,360.00  | 636,000    |
|              |     | リクルートホールディングス         | 8,500   | 4,100.00  | 34,850,000 |
|              |     | エラン                   | 100     | 3,065.00  | 306,500    |
|              |     | 日本郵政                  | 9,700   | 772.90    | 7,497,130  |
|              |     | ベルシステム24ホールディングス      | 200     | 1,724.00  | 344,800    |
|              |     | 鎌倉新書                  | 100     | 1,050.00  | 105,000    |
|              |     | エアトリ                  | 100     | 1,271.00  | 127,100    |
|              |     | ソラスト                  | 300     | 1,449.00  | 434,700    |
|              |     | ベイカレント・コンサルティング       | 100     | 15,250.00 | 1,525,000  |
|              |     | アイモバイル                | 100     | 1,318.00  | 131,800    |
|              |     | グレイステクノロジー            | 100     | 6,720.00  | 672,000    |
|              |     | ジャパンエレベーターサービスホールディング | 100     | 4,750.00  | 475,000    |
|              |     | キュービーネットホールディングス      | 100     | 1,486.00  | 148,600    |
|              |     | RPAホールディングス           | 100     | 648.00    | 64,800     |
|              |     | マネジメントソリューションズ        | 100     | 1,675.00  | 167,500    |
|              |     | カーブスホールディングス          | 400     | 774.00    | 309,600    |
|              |     | ダイレクトマーケティングミックス      | 100     | 2,821.00  | 282,100    |
|              |     | アドバンテッジリスクマネジメント      | 100     | 679.00    | 67,900     |
|              |     | リログループ                | 600     | 2,670.00  | 1,602,000  |
|              |     | 東祥                    | 100     | 1,588.00  | 158,800    |
|              |     | エイチ・アイ・エス             | 200     | 1,683.00  | 336,600    |
|              |     | ラックランド                | 100     | 2,372.00  | 237,200    |
| 共立メンテナンス     | 200 | 3,805.00              | 761,000 |           |            |
| イチネンホールディングス | 100 | 1,314.00              | 131,400 |           |            |
| 建設技術研究所      | 100 | 2,116.00              | 211,600 |           |            |
| スペース         | 100 | 797.00                | 79,700  |           |            |
| 燦ホールディングス    | 100 | 1,262.00              | 126,200 |           |            |
| 東京テアトル       | 100 | 1,300.00              | 130,000 |           |            |
| 東京都競馬        | 100 | 4,705.00              | 470,500 |           |            |

| 種類 | 通貨  | 銘柄             | 株数    | 評価額単価    | 評価額金額         |
|----|-----|----------------|-------|----------|---------------|
| 株式 | 日本円 | 常磐興産           | 100   | 1,489.00 | 148,900       |
|    |     | カナモト           | 200   | 2,306.00 | 461,200       |
|    |     | 東京ドーム          | 500   | 1,301.00 | 650,500       |
|    |     | 西尾レントオール       | 100   | 2,181.00 | 218,100       |
|    |     | トランス・コスモス      | 100   | 2,741.00 | 274,100       |
|    |     | 乃村工藝社          | 500   | 881.00   | 440,500       |
|    |     | 藤田観光           | 100   | 1,493.00 | 149,300       |
|    |     | KNT-CTホールディングス | 100   | 953.00   | 95,300        |
|    |     | 日本管財           | 100   | 2,046.00 | 204,600       |
|    |     | トーカイ           | 100   | 2,060.00 | 206,000       |
|    |     | セコム            | 1,300 | 9,762.00 | 12,690,600    |
|    |     | セントラル警備保障      | 100   | 3,660.00 | 366,000       |
|    |     | 丹青社            | 300   | 867.00   | 260,100       |
|    |     | メイテック          | 100   | 5,160.00 | 516,000       |
|    |     | 応用地質           | 200   | 1,265.00 | 253,000       |
|    |     | 船井総研ホールディングス   | 200   | 2,575.00 | 515,000       |
|    |     | オオバ            | 100   | 750.00   | 75,000        |
|    |     | 学究社            | 100   | 1,263.00 | 126,300       |
|    |     | ベネッセホールディングス   | 400   | 2,119.00 | 847,600       |
|    |     | イオンディライト       | 200   | 2,569.00 | 513,800       |
|    |     | ダイセキ           | 200   | 3,020.00 | 604,000       |
|    |     | ステップ           | 100   | 1,636.00 | 163,600       |
|    |     |                | 小計    |          |               |
|    |     | 銘柄数:           | 1,557 |          |               |
|    |     | 組入時価比率:        | 97.1% |          | 100.0%        |
|    | 合計  |                |       |          | 3,066,104,260 |

(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 (2020年12月15日現在)  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記表 (デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

「PRU国内債券マザーファンド」の状況  
 なお、以下に掲載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

| 区 分         | 注記<br>番号 | (2020年12月15日現在) |
|-------------|----------|-----------------|
|             |          | 金 額             |
| 資産の部        |          |                 |
| 流動資産        |          |                 |
| コール・ローン     |          | 47,224,823      |
| 国債証券        |          | 3,629,788,700   |
| 地方債証券       |          | 430,951,030     |
| 特殊債券        |          | 341,300,130     |
| 社債券         |          | 118,547,000     |
| 未収利息        |          | 14,260,152      |
| 前払費用        |          | 77,639          |
| 流動資産合計      |          | 4,582,149,474   |
| 資産合計        |          | 4,582,149,474   |
| 負債の部        |          |                 |
| 流動負債        |          |                 |
| 未払解約金       |          | 8,194,520       |
| 未払利息        |          | 129             |
| 流動負債合計      |          | 8,194,649       |
| 負債合計        |          | 8,194,649       |
| 純資産の部       |          |                 |
| 元本等         |          |                 |
| 元本          | ※1       | 3,354,610,054   |
| 剰余金         |          |                 |
| 剰余金又は欠損金(△) |          | 1,219,344,771   |
| 元本等合計       |          | 4,573,954,825   |
| 純資産合計       |          | 4,573,954,825   |
| 負債純資産合計     |          | 4,582,149,474   |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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



(貸借対照表に関する注記)

(2020年12月15日現在)

|    |  |                |
|----|--|----------------|
| ※1 | 1. 本報告書における開示対象ファンドの<br>期首における当該親投資信託の元本額        | 4,390,302,709円 |
|    | 同期中における追加設定元本額                                   | 502,924,365円   |
|    | 同期中における解約元本額                                     | 1,538,617,020円 |
|    | 同期末における元本の内訳                                     |                |
|    | PRUグッドライフ2030 (年金)                               | 1,473,574,748円 |
|    | PRUグッドライフ2040 (年金)                               | 730,113,651円   |
|    | PRUグッドライフ2050 (年金)                               | 54,804,399円    |
|    | プルデンシャル私募国内株式・債券バランス<br>ファンド (適格機関投資家向け)         | 4,624,060円     |
|    | プルデンシャル私募国内債券マーケット・パ<br>フォーマー (適格機関投資家向け)        | 1,091,493,196円 |
|    | 計  | 3,354,610,054円 |
|    | 2. 本報告書における開示対象ファンドの<br>期末における当該親投資信託の受益権の<br>総数 | 3,354,610,054口 |

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

| 項目                       | 自 2019年12月17日<br>至 2020年12月15日   |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を投資信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。   |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じて価格変動リスクや為替変動リスク等があります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | コンプライアンス部では、運用状況のモニタリング、運用に関する法令諸規則の遵守状況の確認を行っております。<br>また、リスク管理部では、運用に関するリスク管理を行っております。   |

## II 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | (2020年12月15日現在)  |
|----------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。  |
| 2. 時価の算定方法                 | <p>① 有価証券<br/>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>② デリバティブ取引等<br/>該当事項はありません。</p> <p>③ 上記以外の金融商品<br/>短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価格のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。  |

(有価証券に関する注記)

(2020年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

| 種類    | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
|-------|-----------------|
| 国債証券  | 5,093,900       |
| 地方債証券 | 128,810         |
| 特殊債証券 | 93,620          |
| 社債証券  | 51,250          |
| 合計    | 5,367,580       |

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| (2020年12月15日現在)                          |          |
|--|----------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 | 1,3635円  |
| (1万口当たり純資産額)                             | 13,635円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

① 株式 (2020年12月15日現在)  
該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券  
(2020年12月15日現在)

| 種類              | 通貨  | 銘柄              | 銘柄数<br>比率  | 券面総額       | 評価額        |
|-----------------|-----|-----------------|------------|------------|------------|
| 国債証券            | 日本円 | 第131回利付国債 (5年)  |            | 20,000,000 | 20,057,800 |
|                 |     | 第132回利付国債 (5年)  |            | 20,000,000 | 20,072,600 |
|                 |     | 第133回利付国債 (5年)  |            | 20,000,000 | 20,088,200 |
|                 |     | 第134回利付国債 (5年)  |            | 40,000,000 | 40,205,600 |
|                 |     | 第135回利付国債 (5年)  |            | 20,000,000 | 20,113,200 |
|                 |     | 第136回利付国債 (5年)  |            | 30,000,000 | 30,185,100 |
|                 |     | 第137回利付国債 (5年)  |            | 25,000,000 | 25,173,250 |
|                 |     | 第138回利付国債 (5年)  |            | 40,000,000 | 40,302,400 |
|                 |     | 第141回利付国債 (5年)  |            | 35,000,000 | 35,330,750 |
|                 |     | 第142回利付国債 (5年)  |            | 30,000,000 | 30,302,400 |
|                 |     | 第143回利付国債 (5年)  |            | 10,000,000 | 10,104,900 |
|                 |     | 第144回利付国債 (5年)  |            | 20,000,000 | 20,217,800 |
|                 |     | 第1回利付国債 (40年)   |            | 5,000,000  | 7,331,600  |
|                 |     | 第2回利付国債 (40年)   |            | 10,000,000 | 14,226,700 |
|                 |     | 第3回利付国債 (40年)   |            | 5,000,000  | 7,142,150  |
|                 |     | 第4回利付国債 (40年)   |            | 10,000,000 | 14,335,900 |
|                 |     | 第5回利付国債 (40年)   |            | 10,000,000 | 13,885,900 |
|                 |     | 第6回利付国債 (40年)   |            | 10,000,000 | 13,698,500 |
|                 |     | 第7回利付国債 (40年)   |            | 10,000,000 | 13,177,600 |
|                 |     | 第8回利付国債 (40年)   |            | 10,000,000 | 12,325,800 |
|                 |     | 第9回利付国債 (40年)   |            | 20,000,000 | 18,459,800 |
|                 |     | 第10回利付国債 (40年)  |            | 15,000,000 | 16,219,200 |
|                 |     | 第11回利付国債 (40年)  |            | 15,000,000 | 15,745,650 |
|                 |     | 第12回利付国債 (40年)  |            | 5,000,000  | 4,748,350  |
|                 |     | 第13回利付国債 (40年)  |            | 10,000,000 | 9,471,600  |
|                 |     | 第321回利付国債 (10年) |            | 25,000,000 | 25,355,750 |
|                 |     | 第323回利付国債 (10年) |            | 20,000,000 | 20,314,600 |
|                 |     | 第329回利付国債 (10年) |            | 40,000,000 | 40,946,800 |
|                 |     | 第330回利付国債 (10年) |            | 35,000,000 | 35,912,100 |
|                 |     | 第331回利付国債 (10年) |            | 40,000,000 | 40,820,400 |
|                 |     | 第332回利付国債 (10年) |            | 35,000,000 | 35,782,950 |
|                 |     | 第333回利付国債 (10年) |            | 20,000,000 | 20,484,200 |
|                 |     | 第334回利付国債 (10年) |            | 45,000,000 | 46,174,050 |
|                 |     | 第335回利付国債 (10年) |            | 35,000,000 | 35,847,000 |
|                 |     | 第336回利付国債 (10年) |            | 15,000,000 | 15,387,150 |
| 第337回利付国債 (10年) |     | 20,000,000      | 20,354,800 |            |            |
| 第338回利付国債 (10年) |     | 35,000,000      | 35,809,200 |            |            |
| 第339回利付国債 (10年) |     | 30,000,000      | 30,735,000 |            |            |
| 第340回利付国債 (10年) |     | 35,000,000      | 35,897,050 |            |            |
| 第342回利付国債 (10年) |     | 25,000,000      | 25,297,500 |            |            |
| 第343回利付国債 (10年) |     | 30,000,000      | 30,374,400 |            |            |
| 第344回利付国債 (10年) |     | 40,000,000      | 40,522,000 |            |            |
| 第346回利付国債 (10年) |     | 40,000,000      | 40,554,800 |            |            |
| 第347回利付国債 (10年) |     | 45,000,000      | 45,634,500 |            |            |
| 第349回利付国債 (10年) |     | 30,000,000      | 30,455,700 |            |            |
| 第350回利付国債 (10年) |     | 40,000,000      | 40,614,400 |            |            |

| 種類 | 通貨 | 銘柄              | 銘柄数<br>比率 | 券面総額       | 評価額        |
|----|----|-----------------|-----------|------------|------------|
|    |    | 第351回利付国債 (10年) |           | 40,000,000 | 40,605,200 |
|    |    | 第352回利付国債 (10年) |           | 45,000,000 | 45,668,250 |
|    |    | 第354回利付国債 (10年) |           | 20,000,000 | 20,282,200 |
|    |    | 第355回利付国債 (10年) |           | 40,000,000 | 40,547,200 |
|    |    | 第356回利付国債 (10年) |           | 25,000,000 | 25,330,000 |
|    |    | 第358回利付国債 (10年) |           | 40,000,000 | 40,463,600 |
|    |    | 第359回利付国債 (10年) |           | 20,000,000 | 20,209,400 |
|    |    | 第360回利付国債 (10年) |           | 30,000,000 | 30,292,800 |
|    |    | 第6回利付国債 (30年)   |           | 10,000,000 | 12,567,900 |
|    |    | 第8回利付国債 (30年)   |           | 10,000,000 | 12,033,200 |
|    |    | 第10回利付国債 (30年)  |           | 5,000,000  | 5,605,450  |
|    |    | 第13回利付国債 (30年)  |           | 10,000,000 | 12,400,500 |
|    |    | 第15回利付国債 (30年)  |           | 5,000,000  | 6,568,850  |
|    |    | 第17回利付国債 (30年)  |           | 10,000,000 | 13,078,600 |
|    |    | 第18回利付国債 (30年)  |           | 10,000,000 | 12,974,000 |
|    |    | 第19回利付国債 (30年)  |           | 5,000,000  | 6,508,050  |
|    |    | 第20回利付国債 (30年)  |           | 5,000,000  | 6,668,000  |
|    |    | 第21回利付国債 (30年)  |           | 5,000,000  | 6,539,700  |
|    |    | 第22回利付国債 (30年)  |           | 10,000,000 | 13,405,300 |
|    |    | 第23回利付国債 (30年)  |           | 5,000,000  | 6,724,850  |
|    |    | 第25回利付国債 (30年)  |           | 10,000,000 | 13,206,700 |
|    |    | 第26回利付国債 (30年)  |           | 10,000,000 | 13,390,200 |
|    |    | 第27回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 20,429,400 |
|    |    | 第28回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 20,532,450 |
|    |    | 第29回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 20,363,250 |
|    |    | 第30回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 20,192,700 |
|    |    | 第31回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 20,026,500 |
|    |    | 第32回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 20,387,400 |
|    |    | 第33回利付国債 (30年)  |           | 25,000,000 | 32,684,500 |
|    |    | 第34回利付国債 (30年)  |           | 20,000,000 | 27,024,600 |
|    |    | 第36回利付国債 (30年)  |           | 20,000,000 | 26,424,600 |
|    |    | 第37回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 19,582,650 |
|    |    | 第38回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 19,331,400 |
|    |    | 第39回利付国債 (30年)  |           | 10,000,000 | 13,111,000 |
|    |    | 第40回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 19,381,050 |
|    |    | 第42回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 19,108,500 |
|    |    | 第43回利付国債 (30年)  |           | 10,000,000 | 12,752,400 |
|    |    | 第44回利付国債 (30年)  |           | 10,000,000 | 12,765,400 |
|    |    | 第45回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 18,493,050 |
|    |    | 第46回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 18,505,200 |
|    |    | 第47回利付国債 (30年)  |           | 10,000,000 | 12,566,300 |
|    |    | 第48回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 18,174,750 |
|    |    | 第49回利付国債 (30年)  |           | 10,000,000 | 12,122,000 |
|    |    | 第50回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 16,045,050 |
|    |    | 第51回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 14,240,700 |
|    |    | 第53回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 15,274,800 |
|    |    | 第54回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 15,988,650 |
|    |    | 第55回利付国債 (30年)  |           | 10,000,000 | 10,652,300 |
|    |    | 第56回利付国債 (30年)  |           | 10,000,000 | 10,645,200 |
|    |    | 第57回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 15,956,850 |
|    |    | 第58回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 15,926,550 |
|    |    | 第60回利付国債 (30年)  |           | 10,000,000 | 10,856,000 |
|    |    | 第61回利付国債 (30年)  |           | 10,000,000 | 10,326,400 |
|    |    | 第62回利付国債 (30年)  |           | 5,000,000  | 4,896,900  |
|    |    | 第63回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 14,269,500 |

| 種類 | 通貨 | 銘柄              | 銘柄数<br>比率 | 券面総額       | 評価額        |
|----|----|-----------------|-----------|------------|------------|
|    |    | 第64回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 14,229,150 |
|    |    | 第66回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 14,182,650 |
|    |    | 第67回利付国債 (30年)  |           | 15,000,000 | 14,943,750 |
|    |    | 第55回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 10,268,800 |
|    |    | 第59回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 10,372,100 |
|    |    | 第60回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 10,311,600 |
|    |    | 第61回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 10,258,100 |
|    |    | 第62回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 10,236,700 |
|    |    | 第63回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 10,488,500 |
|    |    | 第64回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 10,565,500 |
|    |    | 第66回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 10,586,500 |
|    |    | 第67回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 10,667,500 |
|    |    | 第68回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 10,765,700 |
|    |    | 第70回利付国債 (20年)  |           | 20,000,000 | 21,791,600 |
|    |    | 第71回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 10,825,200 |
|    |    | 第72回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 10,847,000 |
|    |    | 第73回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 10,863,100 |
|    |    | 第75回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 10,959,400 |
|    |    | 第76回利付国債 (20年)  |           | 5,000,000  | 5,436,850  |
|    |    | 第77回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 10,916,500 |
|    |    | 第78回利付国債 (20年)  |           | 5,000,000  | 5,461,650  |
|    |    | 第79回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 10,968,600 |
|    |    | 第80回利付国債 (20年)  |           | 20,000,000 | 22,028,000 |
|    |    | 第81回利付国債 (20年)  |           | 15,000,000 | 16,530,750 |
|    |    | 第82回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 11,068,400 |
|    |    | 第84回利付国債 (20年)  |           | 20,000,000 | 22,143,000 |
|    |    | 第85回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 11,177,500 |
|    |    | 第86回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 11,283,300 |
|    |    | 第87回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 11,230,400 |
|    |    | 第88回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 11,345,300 |
|    |    | 第89回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 11,289,800 |
|    |    | 第90回利付国債 (20年)  |           | 15,000,000 | 17,023,800 |
|    |    | 第91回利付国債 (20年)  |           | 5,000,000  | 5,703,650  |
|    |    | 第92回利付国債 (20年)  |           | 15,000,000 | 17,016,150 |
|    |    | 第93回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 11,336,600 |
|    |    | 第94回利付国債 (20年)  |           | 15,000,000 | 17,099,400 |
|    |    | 第95回利付国債 (20年)  |           | 10,000,000 | 11,583,900 |
|    |    | 第96回利付国債 (20年)  |           | 20,000,000 | 22,905,400 |
|    |    | 第99回利付国債 (20年)  |           | 20,000,000 | 23,131,000 |
|    |    | 第100回利付国債 (20年) |           | 15,000,000 | 17,528,550 |
|    |    | 第101回利付国債 (20年) |           | 10,000,000 | 11,831,900 |
|    |    | 第102回利付国債 (20年) |           | 10,000,000 | 11,887,100 |
|    |    | 第103回利付国債 (20年) |           | 5,000,000  | 5,905,700  |
|    |    | 第104回利付国債 (20年) |           | 10,000,000 | 11,660,100 |
|    |    | 第105回利付国債 (20年) |           | 10,000,000 | 11,707,100 |
|    |    | 第106回利付国債 (20年) |           | 15,000,000 | 17,677,950 |
|    |    | 第107回利付国債 (20年) |           | 10,000,000 | 11,752,900 |
|    |    | 第108回利付国債 (20年) |           | 5,000,000  | 5,795,850  |
|    |    | 第109回利付国債 (20年) |           | 10,000,000 | 11,636,100 |
|    |    | 第110回利付国債 (20年) |           | 10,000,000 | 11,802,300 |
|    |    | 第111回利付国債 (20年) |           | 10,000,000 | 11,933,000 |
|    |    | 第112回利付国債 (20年) |           | 10,000,000 | 11,847,500 |
|    |    | 第113回利付国債 (20年) |           | 25,000,000 | 29,730,000 |
|    |    | 第114回利付国債 (20年) |           | 10,000,000 | 11,929,900 |
|    |    | 第115回利付国債 (20年) |           | 5,000,000  | 6,010,150  |

| 種類 | 通貨 | 銘柄              | 銘柄数<br>比率 | 券面総額          | 評価額           |
|----|----|-----------------|-----------|---------------|---------------|
|    |    | 第116回利付国債 (20年) |           | 15,000,000    | 18,096,750    |
|    |    | 第117回利付国債 (20年) |           | 20,000,000    | 23,943,400    |
|    |    | 第118回利付国債 (20年) |           | 10,000,000    | 11,913,200    |
|    |    | 第119回利付国債 (20年) |           | 10,000,000    | 11,722,800    |
|    |    | 第120回利付国債 (20年) |           | 15,000,000    | 17,298,750    |
|    |    | 第121回利付国債 (20年) |           | 10,000,000    | 11,854,700    |
|    |    | 第122回利付国債 (20年) |           | 10,000,000    | 11,757,000    |
|    |    | 第123回利付国債 (20年) |           | 15,000,000    | 18,135,150    |
|    |    | 第124回利付国債 (20年) |           | 10,000,000    | 11,990,100    |
|    |    | 第125回利付国債 (20年) |           | 5,000,000     | 6,115,750     |
|    |    | 第126回利付国債 (20年) |           | 5,000,000     | 6,013,400     |
|    |    | 第127回利付国債 (20年) |           | 10,000,000    | 11,924,400    |
|    |    | 第128回利付国債 (20年) |           | 5,000,000     | 5,979,550     |
|    |    | 第129回利付国債 (20年) |           | 15,000,000    | 17,781,450    |
|    |    | 第130回利付国債 (20年) |           | 10,000,000    | 11,885,900    |
|    |    | 第131回利付国債 (20年) |           | 10,000,000    | 11,778,700    |
|    |    | 第132回利付国債 (20年) |           | 15,000,000    | 17,719,950    |
|    |    | 第134回利付国債 (20年) |           | 5,000,000     | 5,976,150     |
|    |    | 第135回利付国債 (20年) |           | 5,000,000     | 5,920,200     |
|    |    | 第136回利付国債 (20年) |           | 5,000,000     | 5,864,250     |
|    |    | 第137回利付国債 (20年) |           | 5,000,000     | 5,933,900     |
|    |    | 第138回利付国債 (20年) |           | 5,000,000     | 5,819,650     |
|    |    | 第139回利付国債 (20年) |           | 10,000,000    | 11,753,600    |
|    |    | 第141回利付国債 (20年) |           | 10,000,000    | 11,920,100    |
|    |    | 第142回利付国債 (20年) |           | 15,000,000    | 18,058,500    |
|    |    | 第143回利付国債 (20年) |           | 20,000,000    | 23,647,000    |
|    |    | 第144回利付国債 (20年) |           | 15,000,000    | 17,553,450    |
|    |    | 第145回利付国債 (20年) |           | 20,000,000    | 23,938,800    |
|    |    | 第147回利付国債 (20年) |           | 5,000,000     | 5,944,200     |
|    |    | 第148回利付国債 (20年) |           | 20,000,000    | 23,555,600    |
|    |    | 第149回利付国債 (20年) |           | 25,000,000    | 29,488,250    |
|    |    | 第150回利付国債 (20年) |           | 25,000,000    | 29,193,750    |
|    |    | 第151回利付国債 (20年) |           | 25,000,000    | 28,543,250    |
|    |    | 第153回利付国債 (20年) |           | 20,000,000    | 23,167,400    |
|    |    | 第154回利付国債 (20年) |           | 25,000,000    | 28,625,500    |
|    |    | 第155回利付国債 (20年) |           | 15,000,000    | 16,736,550    |
|    |    | 第156回利付国債 (20年) |           | 5,000,000     | 5,129,050     |
|    |    | 第157回利付国債 (20年) |           | 20,000,000    | 19,895,200    |
|    |    | 第158回利付国債 (20年) |           | 20,000,000    | 20,789,600    |
|    |    | 第159回利付国債 (20年) |           | 5,000,000     | 5,269,400     |
|    |    | 第160回利付国債 (20年) |           | 25,000,000    | 26,715,750    |
|    |    | 第161回利付国債 (20年) |           | 15,000,000    | 15,782,250    |
|    |    | 第162回利付国債 (20年) |           | 25,000,000    | 26,280,750    |
|    |    | 第164回利付国債 (20年) |           | 15,000,000    | 15,492,150    |
|    |    | 第165回利付国債 (20年) |           | 20,000,000    | 20,631,000    |
|    |    | 第167回利付国債 (20年) |           | 15,000,000    | 15,433,500    |
|    |    | 第168回利付国債 (20年) |           | 15,000,000    | 15,154,650    |
|    |    | 第170回利付国債 (20年) |           | 20,000,000    | 19,806,400    |
|    |    | 第171回利付国債 (20年) |           | 10,000,000    | 9,893,200     |
|    |    | 第172回利付国債 (20年) |           | 15,000,000    | 15,094,350    |
|    |    | 第173回利付国債 (20年) |           | 15,000,000    | 15,068,100    |
|    |    | 第174回利付国債 (20年) |           | 5,000,000     | 5,018,350     |
|    | 小計 |                 |           | 3,295,000,000 | 3,629,788,700 |
|    |    | 銘柄数 :           | 208       |               |               |
|    |    | 組入時価比率 :        | 79.4%     |               | 80.3%         |



| 種類                    | 通貨               | 銘柄                     | 銘柄数<br>比率  | 券面総額        | 評価額         |
|-----------------------|------------------|------------------------|------------|-------------|-------------|
| 地方債証券                 | 日本円              | 第715回東京都公募公債           |            | 20,000,000  | 20,302,000  |
|                       |                  | 第733回東京都公募公債           |            | 10,000,000  | 10,200,500  |
|                       |                  | 第762回東京都公募公債           |            | 10,000,000  | 10,071,800  |
|                       |                  | 平成29年度第15回北海道公募公債      |            | 10,000,000  | 10,103,800  |
|                       |                  | 第4回神奈川県公募公債(30年)       |            | 10,000,000  | 13,736,600  |
|                       |                  | 第10回大阪府公募公債(20年)       |            | 10,000,000  | 11,761,300  |
|                       |                  | 第13回大阪府公募公債(20年)       |            | 10,000,000  | 11,287,100  |
|                       |                  | 平成27年度第13回京都府公募公債      |            | 10,000,000  | 10,036,600  |
|                       |                  | 平成30年度第13回京都府公募公債      |            | 10,000,000  | 10,073,800  |
|                       |                  | 第5回兵庫県公募公債(15年)        |            | 10,000,000  | 10,914,000  |
|                       |                  | 第9回兵庫県公募公債(15年)        |            | 10,000,000  | 10,795,800  |
|                       |                  | 第12回静岡県公募公債(20年)       |            | 10,000,000  | 11,930,300  |
|                       |                  | 平成28年度第1回静岡県公募公債       |            | 10,000,000  | 10,020,900  |
|                       |                  | 平成23年度第5回広島県公募公債       |            | 20,000,000  | 20,219,000  |
|                       |                  | 平成28年度第9回埼玉県公募公債       |            | 10,000,000  | 10,119,700  |
|                       |                  | 平成29年度第8回福岡県公募公債       |            | 10,000,000  | 10,118,100  |
|                       |                  | 第16回千葉県公募公債(20年)       |            | 10,000,000  | 11,713,600  |
|                       |                  | 平成25年度第10回千葉県公募公債      |            | 10,000,000  | 10,230,200  |
|                       |                  | 平成25年度第1回新潟県公募公債       |            | 10,000,000  | 10,189,100  |
|                       |                  | 平成30年度第1回岐阜県公募公債(10年)  |            | 10,000,000  | 10,175,500  |
|                       |                  | 平成26年度第1回大分県公募公債       |            | 10,000,000  | 10,204,900  |
|                       |                  | 第149回共同発行市場公募地方債       |            | 10,000,000  | 10,229,800  |
|                       |                  | 第153回共同発行市場公募地方債       |            | 10,000,000  | 10,233,200  |
|                       |                  | 第201回共同発行市場公募地方債       |            | 10,000,000  | 10,008,900  |
|                       |                  | 平成25年度第2回島根県公募公債       |            | 10,000,000  | 10,194,700  |
|                       |                  | 平成24年度第1回静岡市公募公債       |            | 20,000,000  | 20,313,600  |
|                       |                  | 第488回名古屋市公募公債(10年)     |            | 10,000,000  | 10,221,200  |
|                       |                  | 平成23年度第4回京都市公募公債       |            | 10,000,000  | 10,107,700  |
|                       |                  | 第12回横浜市公募公債(20年)       |            | 10,000,000  | 11,349,900  |
|                       |                  | 第89回川崎市公募公債            |            | 10,000,000  | 10,062,800  |
|                       |                  | 平成22年度第2回北九州市公募公債      |            | 11,000,000  | 11,002,970  |
|                       |                  | 平成23年度第9回福岡市公募公債       |            | 10,000,000  | 10,128,200  |
|                       | 平成26年度第2回広島市公募公債 |                        | 12,000,000 | 12,215,160  |             |
| 平成22年度第2回福井県公募公債      |                  | 10,000,000             | 10,049,200 |             |             |
| 平成27年度第1回岡山市公募公債(10年) |                  | 10,000,000             | 10,181,400 |             |             |
| 第50回地方公共団体金融機構債券(20年) |                  | 10,000,000             | 10,268,700 |             |             |
| 第51回地方公共団体金融機構債券      |                  | 10,000,000             | 10,221,700 |             |             |
| 第122回地方公共団体金融機構債券     |                  | 10,000,000             | 9,957,300  |             |             |
|                       | 小計               |                        |            | 413,000,000 | 430,951,030 |
|                       |                  | 銘柄数 :                  | 38         |             |             |
|                       |                  | 組入時価比率 :               | 9.4%       |             | 9.5%        |
| 特殊債券                  | 日本円              | 第23回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 |            | 10,000,000  | 10,208,200  |
|                       |                  | 第26回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 |            | 10,000,000  | 10,183,800  |
|                       |                  | 第27回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 |            | 20,000,000  | 20,004,800  |
|                       |                  | 第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 |            | 10,000,000  | 10,047,900  |
|                       |                  | 第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券   |            | 10,000,000  | 11,082,200  |
|                       |                  | 第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券   |            | 10,000,000  | 11,249,500  |
|                       |                  | 第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券  |            | 10,000,000  | 14,926,400  |
|                       |                  |                        |            |             |             |

| 種類  | 通貨  | 銘柄                         | 銘柄数<br>比率  | 券面総額        | 評価額                 |
|-----|-----|----------------------------|------------|-------------|---------------------|
|     |     | 第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券      |            | 10,000,000  | 11,878,100          |
|     |     | 第92回日本高速道路保有・債務返済機構債券      |            | 10,000,000  | 10,124,600          |
|     |     | 第146回日本高速道路保有・債務返済機構債券     |            | 10,000,000  | 10,122,000          |
|     |     | 第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |            | 10,000,000  | 10,139,900          |
|     |     | 第172回日本高速道路保有・債務返済機構債券     |            | 10,000,000  | 9,887,400           |
|     |     | 第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |            | 10,000,000  | 10,149,400          |
|     |     | 第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |            | 10,000,000  | 10,150,400          |
|     |     | 第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |            | 10,000,000  | 10,232,200          |
|     |     | 第263回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |            | 10,000,000  | 10,188,000          |
|     |     | 第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |            | 10,000,000  | 10,088,000          |
|     |     | 第315回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |            | 10,000,000  | 10,081,700          |
|     |     | 第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |            | 10,000,000  | 10,077,200          |
|     |     | 第37回政府保証地方公共団体金融機構債券       |            | 10,000,000  | 10,138,400          |
|     |     | 第75回政府保証地方公共団体金融機構債券       |            | 10,000,000  | 10,202,900          |
|     |     | 第80回政府保証地方公共団体金融機構債券       |            | 6,000,000   | 6,096,240           |
|     |     | 第110回政府保証地方公共団体金融機構債券      |            | 9,000,000   | 9,078,390           |
|     |     | 第15回政府保証日本政策金融公庫債券         |            | 20,000,000  | 20,001,200          |
|     |     | 第22回政府保証民間都市開発債券           |            | 10,000,000  | 9,687,600           |
|     |     | 第342回東京交通債券                |            | 10,000,000  | 10,359,700          |
|     |     | 第3回一般担保住宅金融支援機構債券          |            | 10,000,000  | 11,353,600          |
|     |     | 第62回一般担保住宅金融支援機構債券         |            | 10,000,000  | 11,955,700          |
|     |     | い第794号農林債                  |            | 10,000,000  | 9,999,700           |
|     |     | 第36回中日本高速道路株式会社社債（一般担保付）   |            | 10,000,000  | 10,079,800          |
|     |     | 第69回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券      |            | 10,000,000  | 11,525,200          |
|     | 小計  | 銘柄数：<br>組入時価比率：            | 31<br>7.5% | 325,000,000 | 341,300,130<br>7.5% |
| 社債券 | 日本円 | 第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債        |            | 5,000,000   | 5,143,600           |
|     |     | 第9回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債       |            | 10,000,000  | 10,301,500          |
|     |     | 第548回東京電力株式会社社債（一般担保付）     |            | 10,000,000  | 11,097,600          |
|     |     | 第530回中部電力株式会社社債（一般担保付）     |            | 10,000,000  | 10,032,600          |
|     |     | 第495回関西電力株式会社社債（一般担保付）     |            | 10,000,000  | 10,051,800          |
|     |     | 第497回関西電力株式会社社債（一般担保付）     |            | 10,000,000  | 10,384,100          |
|     |     | 第381回中国電力株式会社社債（一般担保付）     |            | 10,000,000  | 10,290,700          |

| 種類 | 通貨 | 銘柄                      | 銘柄数<br>比率 | 券面総額        | 評価額           |
|----|----|-------------------------|-----------|-------------|---------------|
|    |    | 第471回東北電力株式会社社債（一般担保付）  |           | 10,000,000  | 10,327,000    |
|    |    | 第473回東北電力株式会社社債（一般担保付）  |           | 10,000,000  | 10,020,000    |
|    |    | 第371回九州電力株式会社社債（一般担保付）  |           | 10,000,000  | 10,275,200    |
|    |    | 第427回九州電力株式会社社債（一般担保付）  |           | 10,000,000  | 10,316,600    |
|    |    | 第317回北海道電力株式会社社債（一般担保付） |           | 10,000,000  | 10,306,300    |
|    | 小計 |                         |           | 115,000,000 | 118,547,000   |
|    |    | 銘柄数：                    | 12        |             |               |
|    |    | 組入時価比率：                 | 2.6%      |             | 2.6%          |
|    | 合計 |                         |           |             | 4,520,586,860 |

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「PRU海外株式マザーファンド」の状況  
 なお、以下に掲載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

| 区 分         | 注記<br>番号 | (2020年12月15日現在) |
|-------------|----------|-----------------|
|             |          | 金 額             |
| 資産の部        |          |                 |
| 流動資産        |          |                 |
| 預金          |          | 91,218,657      |
| コール・ローン     |          | 14,069,073      |
| 株式          |          | 2,600,195,849   |
| 投資証券        |          | 74,955,537      |
| 派生商品評価勘定    |          | 6,163,061       |
| 未収入金        |          | 5,523,945       |
| 未収配当金       |          | 3,108,035       |
| 前払金         |          | 10,275,800      |
| 差入委託証拠金     |          | 9,446,896       |
| 流動資産合計      |          | 2,814,956,853   |
| 資産合計        |          | 2,814,956,853   |
| 負債の部        |          |                 |
| 流動負債        |          |                 |
| 派生商品評価勘定    |          | 239,476         |
| 未払解約金       |          | 3,255,148       |
| 未払利息        |          | 38              |
| 流動負債合計      |          | 3,494,662       |
| 負債合計        |          | 3,494,662       |
| 純資産の部       |          |                 |
| 元本等         |          |                 |
| 元本          | ※1       | 897,327,115     |
| 剰余金         |          |                 |
| 剰余金又は欠損金(△) |          | 1,914,135,076   |
| 元本等合計       |          | 2,811,462,191   |
| 純資産合計       |          | 2,811,462,191   |
| 負債純資産合計     |          | 2,814,956,853   |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                                   |  |
|-----------------------------------|--|
| <p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>         | <p>株式及び投資証券<br/> 移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。<br/> 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、または金融商品取引業者等から提示される気配相場等に基づいて評価しております。</p>                       |
| <p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p>      | <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>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> | <p>外貨建取引等の処理基準<br/> 外貨建取引については「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令133号）第60条及び第61条に基づき処理しております。</p>  |

(貸借対照表に関する注記)

(2020年12月15日現在)

|    |  |                |
|----|--|----------------|
| ※1 | 1. 本報告書における開示対象ファンドの<br>期首における当該親投資信託の元本額        | 1,603,530,692円 |
|    | 同期中における追加設定元本額                                   | 249,790,402円   |
|    | 同期中における解約元本額                                     | 955,993,979円   |
|    | 同期末における元本の内訳                                     |                |
|    | PRUグッドライフ2030 (年金)                               | 171,202,869円   |
|    | PRUグッドライフ2040 (年金)                               | 185,296,574円   |
|    | PRUグッドライフ2050 (年金)                               | 31,812,759円    |
|    | プルデンシャル私募海外株式マーケット・パ<br>フォーマー (適格機関投資家向け)        | 509,014,913円   |
|    | 計  | 897,327,115円   |
|    | 2. 本報告書における開示対象ファンドの<br>期末における当該親投資信託の受益権の<br>総数 | 897,327,115口   |

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

| 項目                       | 自 2019年12月17日<br>至 2020年12月15日   |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を投資信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。   |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じて価格変動リスクや為替変動リスク等があります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | コンプライアンス部では、運用状況のモニタリング、運用に関する法令諸規則の遵守状況の確認を行っております。<br>また、リスク管理部では、運用に関するリスク管理を行っております。   |

## II 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | (2020年12月15日現在)   |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。   |
| 2. 時価の算定方法                 | <p>① 有価証券<br/>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>② デリバティブ取引等<br/>「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。</p> <p>③ 上記以外の金融商品<br/>短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価格のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。   |



(有価証券に関する注記)

(2020年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

| 種類   | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
|------|-----------------|
| 株式   | △21,645,736     |
| 投資証券 | △2,197,454      |
| 合計   | △23,843,190     |

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

1. 株式関連

(単位：円)

| 種類       | (2020年12月15日現在) |       |             |           |
|----------|-----------------|-------|-------------|-----------|
|          | 契約額等            | うち1年超 | 時価          | 評価損益      |
| 市場取引     |                 |       |             |           |
| 株価指数先物取引 |                 |       |             |           |
| 買建       | 130,374,370     | —     | 136,297,956 | 5,923,586 |
| 合計       | 130,374,370     | —     | 136,297,956 | 5,923,586 |

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| (2020年12月15日現在)                          |          |
|--|----------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 | 3,1332円  |
| (1万口当たり純資産額)                             | 31,332円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

① 株式

(2020年12月15日現在)

| 種類                                       | 通貨     | 銘柄                            | 株数        | 評価額単価  | 評価額       |
|--|--------|-------------------------------|-----------|--------|-----------|
| 株式                                       | アメリカドル | BAKER HUGHES A GE COMPANY     | 350       | 21.68  | 7,588.00  |
|  |        | CABOT OIL & GAS CORPORATION   | 250       | 17.25  | 4,312.50  |
|  |        | CHENIERE ENERGY INC           | 140       | 59.18  | 8,285.20  |
|  |        | CHEVRON CORP                  | 1,060     | 89.44  | 94,806.40 |
|  |        | CONCHO RRESOURCES INC         | 100       | 61.59  | 6,159.00  |
|  |        | CONOCOPHILLIPS                | 610       | 42.32  | 25,815.20 |
|  |        | EOG RESOURCES INC             | 320       | 52.08  | 16,665.60 |
|  |        | EXXON MOBIL CORPORATION       | 2,359     | 42.22  | 99,596.98 |
|  |        | HALLIBURTON CO                | 470       | 18.96  | 8,911.20  |
|  |        | HESS CORP                     | 150       | 53.90  | 8,085.00  |
|  |        | KINDER MORGAN INC             | 1,121     | 14.31  | 16,041.51 |
|  |        | MARATHON PETROLEUM CORP       | 340       | 40.76  | 13,858.40 |
|  |        | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP     | 520       | 19.17  | 9,968.40  |
|  |        | ONEOK INC                     | 250       | 40.14  | 10,035.00 |
|  |        | PHILLIPS 66                   | 245       | 67.19  | 16,461.55 |
|  |        | PIONEER NATURAL RESOURCES CO  | 90        | 113.11 | 10,179.90 |
|  |        | SCHLUMBERGER LTD              | 726       | 22.18  | 16,102.68 |
|  |        | VALERO ENERGY CORP            | 226       | 56.39  | 12,744.14 |
|  |        | WILLIAMS COMPANIES INC        | 690       | 21.51  | 14,841.90 |
|  |        | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC  | 115       | 265.40 | 30,521.00 |
|  |        | ALBEMARLE CORP                | 55        | 134.57 | 7,401.35  |
|  |        | AMCOR PLC                     | 730       | 11.27  | 8,227.10  |
|  |        | AVERY DENNISON CORP           | 50        | 148.77 | 7,438.50  |
|  |        | AXALTA COATING SYSTEMS LTD    | 140       | 28.71  | 4,019.40  |
|  |        | BALL CORP                     | 186       | 90.30  | 16,795.80 |
|  |        | CELANESE CORPORATION          | 65        | 128.99 | 8,384.35  |
|  |        | CF INDUSTRIES HOLDINGS INC    | 130       | 38.82  | 5,046.60  |
|  |        | CORTEVA INC                   | 430       | 38.76  | 16,666.80 |
|  |        | CROWN HOLDINGS INC            | 70        | 95.19  | 6,663.30  |
|  |        | DOW INC                       | 403       | 53.06  | 21,383.18 |
|  |        | DUPONT DE NEMOURS INC         | 410       | 65.76  | 26,961.60 |
|  |        | EASTMAN CHEMICAL COMPANY      | 70        | 100.19 | 7,013.30  |
|  |        | ECOLAB INC                    | 135       | 217.00 | 29,295.00 |
|  |        | FMC CORP                      | 70        | 114.52 | 8,016.40  |
|  |        | FREEPORT-MCMORAN INC          | 762       | 23.80  | 18,135.60 |
|  |        | INTERNATIONAL PAPER CO        | 210       | 48.01  | 10,082.10 |
|  |        | INTL FLAVORS & FRAGRANCES     | 46        | 109.25 | 5,025.50  |
|  |        | LINDE PUBLIC LIMITED COMPANY  | 290       | 247.60 | 71,804.00 |
|  |        | LYONDELLBASELL INDU-CL A      | 160       | 87.10  | 13,936.00 |
|  |        | MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | 30        | 259.70 | 7,791.00  |
|  |        | NEWMONT CORPORATION           | 460       | 57.56  | 26,477.60 |
|  |        | NUCOR CORP                    | 170       | 55.66  | 9,462.20  |
|  |        | PACKAGING CORP OF AMERICA     | 60        | 131.68 | 7,900.80  |
|  |        | PPG INDUSTRIES INC            | 130       | 141.76 | 18,428.80 |
| RPM INTERNATIONAL INC                    | 80     | 86.44                         | 6,915.20  |        |           |
| SEALED AIR CORP                          | 100    | 43.70                         | 4,370.00  |        |           |
| SHERWIN-WILLIAMS CO                      | 44     | 718.85                        | 31,629.40 |        |           |
| STEEL DYNAMICS INC                       | 100    | 37.94                         | 3,794.00  |        |           |
| THE MOSAIC COMPANY PRODUCES & DISTRIB-WI | 160    | 22.68                         | 3,628.80  |        |           |

| 種類                         | 通貨     | 銘柄                                 | 株数        | 評価額単価  | 評価額       |
|----------------------------|--------|------------------------------------|-----------|--------|-----------|
| 株式                         | アメリカドル | VULCAN MATERIALS CO                | 70        | 135.44 | 9,480.80  |
|                            |        | WESTROCK CO                        | 127       | 43.02  | 5,463.54  |
|                            |        | 3M CO                              | 320       | 173.08 | 55,385.60 |
|                            |        | ALLEGION PLC                       | 50        | 109.69 | 5,484.50  |
|                            |        | AMETEK INC                         | 130       | 116.30 | 15,119.00 |
|                            |        | BOEING CO                          | 295       | 228.62 | 67,442.90 |
|                            |        | CARRIER GLOBAL CORP                | 457       | 36.62  | 16,735.34 |
|                            |        | CATERPILLAR INC                    | 295       | 178.05 | 52,524.75 |
|                            |        | CUMMINS INC                        | 80        | 216.41 | 17,312.80 |
|                            |        | DEERE & CO                         | 160       | 252.72 | 40,435.20 |
|                            |        | DOVER CORP                         | 80        | 120.13 | 9,610.40  |
|                            |        | EATON CORP PLC                     | 221       | 113.84 | 25,158.64 |
|                            |        | EMERSON ELECTRIC CO                | 330       | 80.41  | 26,535.30 |
|                            |        | FASTENAL CO                        | 340       | 49.22  | 16,734.80 |
|                            |        | FORTIVE CORP                       | 185       | 68.26  | 12,628.10 |
|                            |        | FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 80        | 83.07  | 6,645.60  |
|                            |        | GENERAC HOLDINGS INC               | 35        | 218.06 | 7,632.10  |
|                            |        | GENERAL DYNAMICS CORP              | 140       | 153.34 | 21,467.60 |
|                            |        | GENERAL ELECTRIC CO.               | 4,769     | 10.83  | 51,648.27 |
|                            |        | GRAINGER (W.W.) INC                | 25        | 400.46 | 10,011.50 |
|                            |        | HD SUPPLY HOLDINGS INC             | 110       | 55.86  | 6,144.60  |
|                            |        | HEICO CORP                         | 25        | 132.33 | 3,308.25  |
|                            |        | HEICO CORP-CLASS A                 | 35        | 120.55 | 4,219.25  |
|                            |        | HONEYWELL INTERNATIONAL INC        | 390       | 211.85 | 82,621.50 |
|                            |        | HOWMET AEROSPACE INC               | 200       | 26.81  | 5,362.00  |
|                            |        | HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE       | 25        | 174.98 | 4,374.50  |
|                            |        | IDEX CORP                          | 35        | 192.67 | 6,743.45  |
|                            |        | ILLINOIS TOOL WORKS                | 180       | 199.67 | 35,940.60 |
|                            |        | INGERSOLL-RAND INC                 | 207       | 43.86  | 9,079.02  |
|                            |        | JACOBS ENGINEERING GROUP INC       | 70        | 105.26 | 7,368.20  |
|                            |        | JARDINE MATHESON HLDGS LTD         | 130       | 55.95  | 7,273.50  |
|                            |        | JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD        | 100       | 25.83  | 2,583.00  |
|                            |        | JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL     | 410       | 45.10  | 18,491.00 |
|                            |        | L3HARRIS TECHNOLOGIES INC          | 124       | 189.95 | 23,553.80 |
|                            |        | LENNOX INTERNATIONAL INC           | 16        | 273.00 | 4,368.00  |
|                            |        | LOCKHEED MARTIN CORPORATION        | 140       | 357.66 | 50,072.40 |
|                            |        | MASCO CORP                         | 150       | 55.06  | 8,259.00  |
|                            |        | NORDSON CORP                       | 30        | 199.72 | 5,991.60  |
|                            |        | NORTHROP GRUMMAN CORP              | 90        | 298.00 | 26,820.00 |
|                            |        | OTIS WORLDWIDE CORP                | 218       | 62.78  | 13,686.04 |
|                            |        | OWENS CORNING                      | 60        | 72.65  | 4,359.00  |
|                            |        | PACCAR INC                         | 205       | 84.46  | 17,314.30 |
|                            |        | PARKER HANNIFIN CORP               | 70        | 270.09 | 18,906.30 |
|                            |        | PENTAIR PLC-REGISTERED             | 85        | 51.36  | 4,365.60  |
|                            |        | RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP         | 840       | 70.80  | 59,472.00 |
|                            |        | ROCKWELL INTL CORP                 | 65        | 242.99 | 15,794.35 |
|                            |        | ROPER TECHNOLOGIES INC             | 60        | 422.89 | 25,373.40 |
|                            |        | SENSATA TECHNOLOGIES HOLDINGS PLC  | 100       | 49.94  | 4,994.00  |
|                            |        | SMITH (A.O.) CORP                  | 70        | 55.41  | 3,878.70  |
|                            |        | SNAP-ON INC                        | 30        | 175.18 | 5,255.40  |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 89     | 170.40                             | 15,165.60 |        |           |
| SUNRUN INC                 | 70     | 57.10                              | 3,997.00  |        |           |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC  | 20     | 380.90                             | 7,618.00  |        |           |
| TEXTRON INC                | 120    | 46.74                              | 5,608.80  |        |           |

| 種類              | 通貨     | 銘柄                             | 株数        | 評価額単価    | 評価額        |
|-----------------|--------|--------------------------------|-----------|----------|------------|
| 株式              | アメリカドル | TRANE TECHNOLOGIES PLC         | 135       | 137.71   | 18,590.85  |
|                 |        | TRANSDIGM GROUP INC            | 30        | 595.82   | 17,874.60  |
|                 |        | UNITED RENTALS INC             | 39        | 238.89   | 9,316.71   |
|                 |        | WABTEC CORP                    | 100       | 73.26    | 7,326.00   |
|                 |        | XYLEM INC                      | 100       | 97.14    | 9,714.00   |
|                 |        | CINTAS CORP                    | 50        | 347.26   | 17,363.00  |
|                 |        | COPART INC                     | 120       | 118.29   | 14,194.80  |
|                 |        | COSTAR GROUP INC               | 20        | 853.20   | 17,064.00  |
|                 |        | EQUIFAX INC                    | 70        | 189.12   | 13,238.40  |
|                 |        | IHS MARKIT LIMITED             | 220       | 88.97    | 19,573.40  |
|                 |        | REPUBLIC SERVICES INC          | 130       | 94.90    | 12,337.00  |
|                 |        | ROBERT HALF INTL INC           | 70        | 63.08    | 4,415.60   |
|                 |        | ROLLINS INC                    | 150       | 38.46    | 5,769.00   |
|                 |        | TRANSUNION                     | 110       | 97.64    | 10,740.40  |
|                 |        | VERISK ANALYTICS INC           | 90        | 194.77   | 17,529.30  |
|                 |        | WASTE CONNECTIONS INC          | 148       | 101.22   | 14,980.56  |
|                 |        | WASTE MANAGEMENT INC           | 240       | 114.78   | 27,547.20  |
|                 |        | AMERCO                         | 5         | 429.10   | 2,145.50   |
|                 |        | C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC   | 70        | 91.78    | 6,424.60   |
|                 |        | CSX CORP                       | 420       | 88.92    | 37,346.40  |
|                 |        | DELTA AIR LINES INC            | 105       | 40.69    | 4,272.45   |
|                 |        | EXPEDITORS INTL WASH INC       | 90        | 90.18    | 8,116.20   |
|                 |        | FEDEX CORPORATION              | 140       | 285.54   | 39,975.60  |
|                 |        | JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 50        | 133.78   | 6,689.00   |
|                 |        | KANSAS CITY SOUTHERN           | 45        | 192.02   | 8,640.90   |
|                 |        | KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION    | 90        | 40.68    | 3,661.20   |
|                 |        | NORFOLK SOUTHERN CORP          | 144       | 229.25   | 33,012.00  |
|                 |        | OLD DOMINION FREIGHT LINE      | 55        | 195.35   | 10,744.25  |
|                 |        | SOUTHWEST AIRLINES             | 70        | 45.26    | 3,168.20   |
|                 |        | UBER TECHNOLOGIES INC          | 550       | 51.46    | 28,303.00  |
|                 |        | UNION PACIFIC CORP             | 375       | 198.00   | 74,250.00  |
|                 |        | UNITED PARCEL SERVICE          | 390       | 166.62   | 64,981.80  |
|                 |        | XPO LOGISTICS INC              | 45        | 120.00   | 5,400.00   |
|                 |        | APTIV PLC                      | 145       | 121.65   | 17,639.25  |
|                 |        | AUTOLIV INC                    | 50        | 90.54    | 4,527.00   |
|                 |        | BORGWARNER INC                 | 150       | 36.34    | 5,451.00   |
|                 |        | FORD MOTOR COMPANY             | 2,000     | 8.91     | 17,820.00  |
|                 |        | GENERAL MOTORS CO              | 740       | 41.62    | 30,798.80  |
|                 |        | LEAR CORP                      | 30        | 156.07   | 4,682.10   |
|                 |        | TESLA INC                      | 415       | 639.83   | 265,529.45 |
|                 |        | DR HORTON INC                  | 190       | 70.40    | 13,376.00  |
|                 |        | GARMIN LTD                     | 75        | 117.21   | 8,790.75   |
|                 |        | HASBRO INC                     | 70        | 90.11    | 6,307.70   |
|                 |        | LENNAR CORP-CL A               | 140       | 74.68    | 10,455.20  |
|                 |        | LULULEMON ATHLETICA INC        | 70        | 352.37   | 24,665.90  |
|                 |        | MOHAWK INDUSTRIES INC          | 30        | 131.53   | 3,945.90   |
|                 |        | NEWELL BRANDS INC              | 195       | 20.32    | 3,962.40   |
|                 |        | NIKE INC -CL B                 | 690       | 136.28   | 94,033.20  |
|                 |        | NVR INC                        | 2         | 4,022.00 | 8,044.00   |
|                 |        | PELOTON INTERACTIVE INC-A      | 110       | 121.91   | 13,410.10  |
| PULTE GROUP INC | 160    | 42.12                          | 6,739.20  |          |            |
| VF CORP         | 190    | 85.75                          | 16,292.50 |          |            |
| WHIRLPOOL CORP  | 30     | 184.03                         | 5,520.90  |          |            |
| ARAMARK         | 120    | 37.24                          | 4,468.80  |          |            |
| CARNIVAL CORP   | 290    | 20.93                          | 6,069.70  |          |            |

| 種類                   | 通貨     | 銘柄                                    | 株数         | 評価額単価    | 評価額        |
|----------------------|--------|---------------------------------------|------------|----------|------------|
| 株式                   | アメリカドル | CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC            | 15         | 1,309.52 | 19,642.80  |
|                      |        | DARDEN RESTAURANTS INC                | 75         | 112.51   | 8,438.25   |
|                      |        | DOMINO'S PIZZA INC                    | 20         | 383.23   | 7,664.60   |
|                      |        | DRAFTKINGS INC - CL A                 | 85         | 50.58    | 4,299.30   |
|                      |        | HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN          | 160        | 103.04   | 16,486.40  |
|                      |        | LAS VEGAS SANDS CORP                  | 210        | 56.53    | 11,871.30  |
|                      |        | MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A           | 150        | 126.62   | 18,993.00  |
|                      |        | MCDONALD'S CORPORATION                | 402        | 211.92   | 85,191.84  |
|                      |        | MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR | 100        | 18.00    | 1,800.00   |
|                      |        | MGM RESORTS INTERNATIONAL             | 250        | 29.51    | 7,377.50   |
|                      |        | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD           | 110        | 74.06    | 8,146.60   |
|                      |        | STARBUCKS CORP                        | 650        | 103.32   | 67,158.00  |
|                      |        | VAIL RESORTS INC                      | 25         | 278.76   | 6,969.00   |
|                      |        | WYNN RESORTS LTD                      | 60         | 107.54   | 6,452.40   |
|                      |        | YUM! BRANDS INC                       | 165        | 105.50   | 17,407.50  |
|                      |        | ACTIVISION BLIZZARD INC               | 430        | 85.94    | 36,954.20  |
|                      |        | ALPHABET INC-CL A                     | 166        | 1,752.26 | 290,875.16 |
|                      |        | ALPHABET INC-CL C                     | 166        | 1,760.06 | 292,169.96 |
|                      |        | ALTICE USA INC- A                     | 140        | 34.59    | 4,842.60   |
|                      |        | CABLE ONE INC                         | 2          | 2,144.01 | 4,288.02   |
|                      |        | CHARTER COMMUNICATION-A               | 80         | 649.67   | 51,973.60  |
|                      |        | COMCAST CORP-CL A                     | 2,544      | 50.99    | 129,718.56 |
|                      |        | DISCOVERY INC-A                       | 55         | 28.65    | 1,575.75   |
|                      |        | DISCOVERY INC-C                       | 165        | 25.21    | 4,159.65   |
|                      |        | DISH NETWORK CORPORATION-A            | 145        | 35.03    | 5,079.35   |
|                      |        | ELECTRONIC ARTS INC                   | 160        | 137.54   | 22,006.40  |
|                      |        | FACEBOOK INC-A                        | 1,330      | 274.19   | 364,672.70 |
|                      |        | FOX CORPORATION CLASS A               | 192        | 28.78    | 5,525.76   |
|                      |        | FOX CORPORATION CLASS B               | 90         | 28.34    | 2,550.60   |
|                      |        | IAC/INTERACTIVECORP                   | 50         | 150.75   | 7,537.50   |
|                      |        | INTERPUBLIC GROUP COS INC             | 200        | 23.70    | 4,740.00   |
|                      |        | LIBERTY BROADBAND-A                   | 15         | 158.59   | 2,378.85   |
|                      |        | LIBERTY BROADBAND-CORP-C              | 60         | 161.22   | 9,673.20   |
|                      |        | LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C          | 100        | 42.66    | 4,266.00   |
|                      |        | LIBERTY SIRIUSXM GROUP                | 40         | 42.52    | 1,700.80   |
|                      |        | LIBERTY SIRIUSXM GROUP C              | 80         | 42.76    | 3,420.80   |
|                      |        | LIVE NATION ENTERTAINMENT IN          | 90         | 70.35    | 6,331.50   |
|                      |        | MATCH GROUP INC                       | 142        | 144.81   | 20,563.02  |
|                      |        | NETFLIX INC                           | 245        | 522.42   | 127,992.90 |
|                      |        | NEWS CORP NEW-CL A-W/I                | 181        | 17.75    | 3,212.75   |
|                      |        | OMNICOM GROUP                         | 110        | 63.58    | 6,993.80   |
|                      |        | PINTEREST INC- CLASS A                | 260        | 69.79    | 18,145.40  |
|                      |        | ROKU INC                              | 60         | 324.32   | 19,459.20  |
|                      |        | SIRIUS XM HOLDINGS INC                | 430        | 6.33     | 2,721.90   |
|                      |        | SNAP INC - A                          | 520        | 51.60    | 26,832.00  |
|                      |        | TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE         | 65         | 195.20   | 12,688.00  |
|                      |        | TWITTER INC                           | 450        | 52.02    | 23,409.00  |
| VIACOMCBS INC        | 316    | 34.67                                 | 10,955.72  |          |            |
| WALT DISNEY CO       | 1,001  | 169.30                                | 169,469.30 |          |            |
| ZILLOW GROUP INC - A | 35     | 137.65                                | 4,817.75   |          |            |
| ZILLOW GROUP INC - C | 75     | 134.17                                | 10,062.75  |          |            |
| ADVANCE AUTO PARTS   | 40     | 157.56                                | 6,302.40   |          |            |
| AMAZON.COM INC       | 236    | 3,156.97                              | 745,044.92 |          |            |
| AUTOZONE INC         | 13     | 1,151.13                              | 14,964.69  |          |            |

| 種類                          | 通貨     | 銘柄                                | 株数         | 評価額単価    | 評価額        |
|-----------------------------|--------|-----------------------------------|------------|----------|------------|
| 株式                          | アメリカドル | BEST BUY COMPANY INC              | 130        | 101.28   | 13,166.40  |
|                             |        | BOOKING HOLDINGS INC              | 23         | 2,066.01 | 47,518.23  |
|                             |        | BURLINGTON STORES INC             | 40         | 230.51   | 9,220.40   |
|                             |        | CARMAX INC                        | 83         | 92.54    | 7,680.82   |
|                             |        | CARVANA CO                        | 35         | 250.97   | 8,783.95   |
|                             |        | CHEWY INC - CLASS A               | 20         | 82.81    | 1,656.20   |
|                             |        | DOLLAR GENERAL CORP               | 140        | 205.90   | 28,826.00  |
|                             |        | DOLLAR TREE INC                   | 134        | 107.68   | 14,429.12  |
|                             |        | EBAY INC                          | 410        | 49.57    | 20,323.70  |
|                             |        | ETSY INC                          | 70         | 169.97   | 11,897.90  |
|                             |        | EXPEDIA GROUP INC                 | 77         | 123.33   | 9,496.41   |
|                             |        | GENUINE PARTS CO                  | 90         | 95.82    | 8,623.80   |
|                             |        | HOME DEPOT INC                    | 595        | 265.58   | 158,020.10 |
|                             |        | LKQ CORP                          | 170        | 36.61    | 6,223.70   |
|                             |        | LOWE'S COMPANIES                  | 420        | 160.09   | 67,237.80  |
|                             |        | MERCADOLIBRE INC                  | 25         | 1,618.06 | 40,451.50  |
|                             |        | O'REILLY AUTOMOTIVE INC           | 40         | 447.55   | 17,902.00  |
|                             |        | POOL CORP                         | 20         | 346.58   | 6,931.60   |
|                             |        | ROSS STORES INC                   | 195        | 110.55   | 21,557.25  |
|                             |        | TARGET CORP                       | 280        | 170.99   | 47,877.20  |
|                             |        | TIFFANY & CO                      | 60         | 131.11   | 7,866.60   |
|                             |        | TJX COMPANIES INC                 | 670        | 65.34    | 43,777.80  |
|                             |        | TRACTOR SUPPLY COMPANY            | 60         | 140.53   | 8,431.80   |
|                             |        | ULTA BEAUTY INC                   | 25         | 265.79   | 6,644.75   |
|                             |        | WAYFAIR INC- CLASS A              | 35         | 253.48   | 8,871.80   |
|                             |        | COSTCO WHOLESALE CORP             | 242        | 374.38   | 90,599.96  |
|                             |        | KROGER CO                         | 450        | 31.30    | 14,085.00  |
|                             |        | SYSCO CORP                        | 260        | 73.43    | 19,091.80  |
|                             |        | WALGREEN CO                       | 420        | 41.48    | 17,421.60  |
|                             |        | WALMART INC                       | 790        | 145.65   | 115,063.50 |
|                             |        | ALTRIA GROUP INC                  | 1,020      | 42.90    | 43,758.00  |
|                             |        | ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO         | 325        | 48.69    | 15,824.25  |
|                             |        | BROWN-FORMAN CORP-CLASS B         | 172        | 75.53    | 12,991.16  |
|                             |        | BUNGE LIMITED                     | 90         | 63.78    | 5,740.20   |
|                             |        | CAMPBELL SOUP CO                  | 90         | 46.71    | 4,203.90   |
|                             |        | COCA-COLA COMPANY                 | 2,280      | 53.27    | 121,455.60 |
|                             |        | COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS INC   | 100        | 47.00    | 4,700.00   |
|                             |        | CONAGRA BRANDS INC                | 250        | 35.63    | 8,907.50   |
|                             |        | CONSTELLATION BRANDS INC          | 90         | 207.00   | 18,630.00  |
|                             |        | GENERAL MILLS INC                 | 330        | 59.35    | 19,585.50  |
|                             |        | HORMEL FOODS CORPORATION          | 160        | 47.20    | 7,552.00   |
|                             |        | JM SMUCKER CO/THE-NEW COM         | 65         | 113.25   | 7,361.25   |
|                             |        | KELLOGG CO                        | 160        | 61.92    | 9,907.20   |
|                             |        | KEURIG DR PEPPER INC              | 320        | 30.35    | 9,712.00   |
|                             |        | KRAFT HEINZ COMPANY               | 392        | 34.42    | 13,492.64  |
|                             |        | LAMB WESTON HOLDINGS INC          | 70         | 76.54    | 5,357.80   |
|                             |        | MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS       | 140        | 93.28    | 13,059.20  |
|                             |        | MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY - B | 130        | 45.92    | 5,969.60   |
|                             |        | MONDELEZ INTERNATIONAL INC        | 798        | 57.29    | 45,717.42  |
|                             |        | MONSTER BEVARAGE CORP             | 220        | 88.42    | 19,452.40  |
| PEPSICO INC                 | 773    | 144.23                            | 111,489.79 |          |            |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 870    | 84.40                             | 73,428.00  |          |            |
| THE HERSHEY COMPANY         | 85     | 149.14                            | 12,676.90  |          |            |
| TYSON FOODS INC             | 180    | 69.78                             | 12,560.40  |          |            |
| CHURCH & DWIGHT CO INC      | 140    | 86.06                             | 12,048.40  |          |            |

| 種類                          | 通貨     | 銘柄                           | 株数         | 評価額単価  | 評価額        |
|-----------------------------|--------|------------------------------|------------|--------|------------|
| 株式                          | アメリカドル | CLOROX COMPANY               | 70         | 202.38 | 14,166.60  |
|                             |        | COLGATE-PALMOLIVE COMPANY    | 450        | 84.19  | 37,885.50  |
|                             |        | ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 120        | 247.45 | 29,694.00  |
|                             |        | KIMBERLY-CLARK CORP          | 185        | 136.00 | 25,160.00  |
|                             |        | PROCTER & GAMBLE CO          | 1,379      | 135.85 | 187,337.15 |
|                             |        | ABBOTT LABORATORIES          | 979        | 106.79 | 104,547.41 |
|                             |        | ABIOMED INC                  | 27         | 267.62 | 7,225.74   |
|                             |        | ALIGN TECHNOLOGY INC         | 40         | 504.31 | 20,172.40  |
|                             |        | AMERISOURCEBERGEN CORP       | 85         | 97.12  | 8,255.20   |
|                             |        | ANTHEM INC                   | 135        | 310.10 | 41,863.50  |
|                             |        | BAXTER INTERNATIONAL INC     | 280        | 78.83  | 22,072.40  |
|                             |        | BECTON DICKINSON & CO        | 158        | 240.00 | 37,920.00  |
|                             |        | BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 811        | 33.45  | 27,127.95  |
|                             |        | CARDINAL HEALTH INC          | 180        | 53.55  | 9,639.00   |
|                             |        | CENTENE CORP                 | 329        | 59.73  | 19,651.17  |
|                             |        | CERNER CORP                  | 170        | 74.25  | 12,622.50  |
|                             |        | CIGNA CORP                   | 196        | 203.15 | 39,817.40  |
|                             |        | COOPER COS INC/THE           | 30         | 342.85 | 10,285.50  |
|                             |        | CVS HEALTH CORPORATION       | 717        | 69.72  | 49,989.24  |
|                             |        | DANAHER CORP                 | 345        | 221.10 | 76,279.50  |
|                             |        | DAVITA INC                   | 50         | 109.19 | 5,459.50   |
|                             |        | DENTSPLY SIRONA INC          | 110        | 52.23  | 5,745.30   |
|                             |        | DEXCOM INC                   | 55         | 353.59 | 19,447.45  |
|                             |        | EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | 340        | 83.57  | 28,413.80  |
|                             |        | HCA HEALTHCARE INC           | 150        | 160.86 | 24,129.00  |
|                             |        | HENRY SCHEIN INC             | 80         | 68.07  | 5,445.60   |
|                             |        | HOLOGIC INC                  | 138        | 74.17  | 10,235.46  |
|                             |        | HUMANA INC                   | 75         | 388.23 | 29,117.25  |
|                             |        | IDEXX LABORATORIES INC       | 45         | 458.17 | 20,617.65  |
|                             |        | INSULET CORP                 | 35         | 239.05 | 8,366.75   |
|                             |        | INTUITIVE SURGICAL INC       | 66         | 764.79 | 50,476.14  |
|                             |        | LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 50         | 204.11 | 10,205.50  |
|                             |        | MASIMO CORP                  | 25         | 263.00 | 6,575.00   |
|                             |        | MCKESSON HBOC INC            | 90         | 172.33 | 15,509.70  |
|                             |        | MEDTRONIC PLC                | 741        | 111.97 | 82,969.77  |
|                             |        | MOLINA HEALTHCARE INC        | 35         | 199.68 | 6,988.80   |
|                             |        | NOVOCURE LTD                 | 45         | 168.99 | 7,604.55   |
|                             |        | QUEST DIAGNOSTICS INC        | 70         | 123.16 | 8,621.20   |
|                             |        | RESMED INC                   | 80         | 206.38 | 16,510.40  |
|                             |        | STERIS PLC                   | 50         | 186.33 | 9,316.50   |
|                             |        | STRYKER CORP                 | 185        | 230.95 | 42,725.75  |
|                             |        | TELADOC HEALTH INC           | 55         | 194.63 | 10,704.65  |
|                             |        | TELEFLEX INC                 | 25         | 380.67 | 9,516.75   |
|                             |        | UNITEDHEALTH GROUP INC       | 525        | 336.13 | 176,468.25 |
|                             |        | UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 50         | 134.56 | 6,728.00   |
|                             |        | VARIAN MEDICAL SYSTEMS       | 50         | 174.13 | 8,706.50   |
|                             |        | VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 75         | 264.78 | 19,858.50  |
|                             |        | WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 40         | 264.92 | 10,596.80  |
|                             |        | ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 110        | 142.59 | 15,684.90  |
|                             |        | 10X GENOMICS INC-CLASS A     | 25         | 151.75 | 3,793.75   |
| ABBVIE INC                  | 972    | 104.20                       | 101,282.40 |        |            |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC    | 180    | 116.74                       | 21,013.20  |        |            |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 130    | 156.31                       | 20,320.30  |        |            |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 60     | 132.69                       | 7,961.40   |        |            |
| AMGEN INC                   | 328    | 229.46                       | 75,262.88  |        |            |



| 種類                           | 通貨     | 銘柄                           | 株数        | 評価額単価    | 評価額        |
|------------------------------|--------|------------------------------|-----------|----------|------------|
| 株式                           | アメリカドル | AVANTOR INC                  | 310       | 26.80    | 8,308.00   |
|                              |        | BIO-RAD LABORATORIES-A       | 12        | 579.65   | 6,955.80   |
|                              |        | BIOGEN INC                   | 84        | 245.25   | 20,601.00  |
|                              |        | BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 100       | 82.85    | 8,285.00   |
|                              |        | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 1,261     | 59.97    | 75,622.17  |
|                              |        | CATALENT INC                 | 95        | 97.93    | 9,303.35   |
|                              |        | ELANCO ANIMAL HEALTH INC     | 260       | 28.71    | 7,464.60   |
|                              |        | EXACT SCIENCES CORP          | 95        | 129.80   | 12,331.00  |
|                              |        | GILEAD SCIENCES INC          | 690       | 59.84    | 41,289.60  |
|                              |        | HORIZON THERAPEUTICS PLC     | 120       | 77.87    | 9,344.40   |
|                              |        | ILLUMINA INC                 | 75        | 347.11   | 26,033.25  |
|                              |        | INCYTE CORP                  | 100       | 86.81    | 8,681.00   |
|                              |        | IONIS PHARMACEUTICALS INC    | 90        | 47.83    | 4,304.70   |
|                              |        | IQIVA HOLDINGS INC           | 98        | 167.30   | 16,395.40  |
|                              |        | JAZZ PHARMACEUTICALS PLC     | 30        | 149.23   | 4,476.90   |
|                              |        | JOHNSON & JOHNSON            | 1,458     | 149.07   | 217,344.06 |
|                              |        | LILLY (ELI) & CO             | 480       | 157.91   | 75,796.80  |
|                              |        | MERCK & CO. INC.             | 1,397     | 80.32    | 112,207.04 |
|                              |        | METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 13        | 1,139.26 | 14,810.38  |
|                              |        | MODERNA INC                  | 145       | 155.07   | 22,485.15  |
|                              |        | NEUROCRINE BIOSCIENCES INC   | 50        | 93.46    | 4,673.00   |
|                              |        | PERKINELMER INC              | 55        | 145.32   | 7,992.60   |
|                              |        | PERRIGO CO PLC               | 70        | 46.63    | 3,264.10   |
|                              |        | PFIZER INC                   | 3,102     | 39.21    | 121,629.42 |
|                              |        | PPD INC                      | 70        | 34.04    | 2,382.80   |
|                              |        | REGENERON PHARMACEUTICALS    | 55        | 500.38   | 27,520.90  |
|                              |        | ROYALTY PHARMA PLC- CL A     | 60        | 43.12    | 2,587.20   |
|                              |        | SAREPTA THERAPEUTICS INC     | 40        | 169.54   | 6,781.60   |
|                              |        | SEAGEN INC/WA                | 70        | 193.59   | 13,551.30  |
|                              |        | TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | 615       | 10.31    | 6,340.65   |
|                              |        | THERMO ELECTRON CORP         | 220       | 467.13   | 102,768.60 |
|                              |        | VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 135       | 228.13   | 30,797.55  |
|                              |        | VIATRIS INC                  | 684       | 17.33    | 11,853.72  |
|                              |        | WATERS CORP                  | 25        | 240.75   | 6,018.75   |
|                              |        | ZOETIS INC                   | 255       | 159.50   | 40,672.50  |
|                              |        | BANK OF AMERICA CORP         | 4,291     | 28.22    | 121,092.02 |
|                              |        | CITIGROUP INC                | 1,163     | 58.74    | 68,314.62  |
|                              |        | CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 250       | 34.62    | 8,655.00   |
|                              |        | FIFTH THIRD BANCORP          | 400       | 26.62    | 10,648.00  |
|                              |        | FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 100       | 129.26   | 12,926.00  |
|                              |        | HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 550       | 12.51    | 6,880.50   |
|                              |        | JPMORGAN CHASE & CO          | 1,685     | 118.30   | 199,335.50 |
|                              |        | KEYCORP                      | 550       | 15.43    | 8,486.50   |
|                              |        | M&T BANK CORP                | 66        | 124.76   | 8,234.16   |
|                              |        | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 230       | 141.79   | 32,611.70  |
|                              |        | REGIONS FINANCIAL CORP       | 511       | 15.15    | 7,741.65   |
|                              |        | SVB FINANCIAL GROUP          | 25        | 349.49   | 8,737.25   |
|                              |        | TRUIST FINANCIAL CORP        | 769       | 45.91    | 35,304.79  |
|                              |        | US BANCORP                   | 750       | 44.81    | 33,607.50  |
|                              |        | WELLS FARGO COMPANY          | 2,174     | 28.64    | 62,263.36  |
|                              |        | ALLY FINANCIAL INC           | 190       | 33.67    | 6,397.30   |
| AMERICAN EXPRESS COMPANY     | 384    | 117.36                       | 45,066.24 |          |            |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 70     | 190.99                       | 13,369.30 |          |            |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 100    | 47.83                        | 4,783.00  |          |            |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 428    | 39.83                        | 17,047.24 |          |            |

| 種類                            | 通貨     | 銘柄                              | 株数        | 評価額単価  | 評価額        |
|-------------------------------|--------|---------------------------------|-----------|--------|------------|
| 株式                            | アメリカドル | BERKSHIRE HATHAWAY INC          | 775       | 222.85 | 172,708.75 |
|                               |        | BLACKROCK INC                   | 83        | 683.92 | 56,765.36  |
|                               |        | BLACKSTONE GROUP INC/THE-A      | 380       | 63.11  | 23,981.80  |
|                               |        | CAPITAL ONE FINANCIAL CORP      | 258       | 90.42  | 23,328.36  |
|                               |        | CARLYLE GROUP INC/THE           | 80        | 29.40  | 2,352.00   |
|                               |        | CBOE GLOBAL MARKETS INC         | 60        | 88.25  | 5,295.00   |
|                               |        | CME GROUP INC                   | 195       | 177.55 | 34,622.25  |
|                               |        | DISCOVER FINANCIAL SERVICES-W/I | 170       | 82.63  | 14,047.10  |
|                               |        | EQUITABLE HOLDINGS INC          | 220       | 25.27  | 5,559.40   |
|                               |        | FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC    | 20        | 344.89 | 6,897.80   |
|                               |        | FRANKLIN RESOURCES INC          | 170       | 23.73  | 4,034.10   |
|                               |        | GOLDMAN SACHS GROUP INC         | 180       | 237.79 | 42,802.20  |
|                               |        | INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC   | 305       | 107.71 | 32,851.55  |
|                               |        | INVESCO LTD                     | 158       | 17.10  | 2,701.80   |
|                               |        | KKR & CO INC                    | 250       | 39.22  | 9,805.00   |
|                               |        | MARKETAXESS HOLDINGS INC        | 20        | 551.15 | 11,023.00  |
|                               |        | MOODY'S CORPORATION             | 100       | 274.62 | 27,462.00  |
|                               |        | MORGAN ST DEAN WITTER & CO      | 756       | 61.88  | 46,781.28  |
|                               |        | MSCI INC                        | 45        | 423.90 | 19,075.50  |
|                               |        | NASDAQ INC                      | 65        | 124.04 | 8,062.60   |
|                               |        | NORTHERN TRUST CORP             | 110       | 88.58  | 9,743.80   |
|                               |        | RAYMOND JAMES FINANCIAL INC     | 80        | 91.46  | 7,316.80   |
|                               |        | S&P GLOBAL INC                  | 130       | 323.68 | 42,078.40  |
|                               |        | SCHWAB (CHARELES) CORP          | 845       | 49.84  | 42,114.80  |
|                               |        | SEI INVESTMENT COMPANY          | 80        | 55.49  | 4,439.20   |
|                               |        | STATE STREET CORP               | 195       | 70.70  | 13,786.50  |
|                               |        | SYNCHRONY FINANCIAL             | 297       | 31.91  | 9,477.27   |
|                               |        | T ROWE PRICE GROUP INC          | 130       | 147.86 | 19,221.80  |
|                               |        | TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A    | 50        | 64.70  | 3,235.00   |
|                               |        | VOYA FINANCIAL INC              | 90        | 57.49  | 5,174.10   |
|                               |        | AFLAC INC                       | 390       | 44.20  | 17,238.00  |
|                               |        | ALLEGHANY CORP                  | 9         | 586.97 | 5,282.73   |
|                               |        | ALLSTATE CORP                   | 180       | 104.87 | 18,876.60  |
|                               |        | AMERICAN FINANCIAL GROUP INC    | 40        | 86.85  | 3,474.00   |
|                               |        | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP    | 490       | 38.16  | 18,698.40  |
|                               |        | AON PLC                         | 125       | 203.96 | 25,495.00  |
|                               |        | ARCH CAPITAL GROUP LTD          | 240       | 33.57  | 8,056.80   |
|                               |        | ARTHUR J GALLAGHER & CO         | 105       | 120.50 | 12,652.50  |
|                               |        | ASSURANT INC                    | 35        | 131.65 | 4,607.75   |
|                               |        | ATHENE HOLDING LTD-CLASS A      | 60        | 41.75  | 2,505.00   |
|                               |        | BROWN & BROWN INC               | 130       | 45.45  | 5,908.50   |
|                               |        | CHUBB LIMITED                   | 252       | 150.86 | 38,016.72  |
|                               |        | CINCINNATI FINANCIAL CORP       | 80        | 79.61  | 6,368.80   |
|                               |        | ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A     | 10        | 235.72 | 2,357.20   |
|                               |        | EVEREST RE GROUP LTD            | 25        | 229.70 | 5,742.50   |
|                               |        | FNF GROUP                       | 150       | 37.51  | 5,626.50   |
|                               |        | GLOBE LIFE INC                  | 50        | 91.77  | 4,588.50   |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP   | 220    | 45.54                           | 10,018.80 |        |            |
| LINCOLN NATIONAL CORP         | 119    | 50.05                           | 5,955.95  |        |            |
| LOEWS CORP                    | 150    | 42.87                           | 6,430.50  |        |            |
| MARKEL CORP                   | 7      | 992.69                          | 6,948.83  |        |            |
| MARSH & MCLENNAN COS          | 280    | 114.92                          | 32,177.60 |        |            |
| METLIFE INC                   | 430    | 45.84                           | 19,711.20 |        |            |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC | 160    | 47.82                           | 7,651.20  |        |            |
| PROGRESSIVE CORP              | 330    | 94.10                           | 31,053.00 |        |            |

| 種類                     | 通貨     | 銘柄                             | 株数        | 評価額単価  | 評価額        |
|------------------------|--------|--------------------------------|-----------|--------|------------|
| 株式                     | アメリカドル | PRUDENTIAL FINANCIAL INC       | 230       | 76.61  | 17,620.30  |
|                        |        | REINSURANCE GROUP OF AMERICA   | 40        | 117.63 | 4,705.20   |
|                        |        | RENAISSANCEWE HOLDINGS LTD     | 30        | 165.48 | 4,964.40   |
|                        |        | THE TRAVELERS COS INC          | 141       | 133.99 | 18,892.59  |
|                        |        | WILLIS TOWERS WATSON PLC       | 67        | 205.76 | 13,785.92  |
|                        |        | WR BERKLEY CORP                | 87        | 64.11  | 5,577.57   |
|                        |        | CBRE GROUP INC                 | 200       | 65.13  | 13,026.00  |
|                        |        | HONGKONG LAND HOLDINGS LTD     | 700       | 4.23   | 2,961.00   |
|                        |        | ACCENTURE PLC-CL A             | 355       | 243.75 | 86,531.25  |
|                        |        | ADOBE INC                      | 264       | 486.42 | 128,414.88 |
|                        |        | AKAMAI TECHNOLOGIES            | 90        | 103.27 | 9,294.30   |
|                        |        | ANSYS INC                      | 50        | 343.39 | 17,169.50  |
|                        |        | AUTODESK INC                   | 115       | 288.33 | 33,157.95  |
|                        |        | AUTOMATIC DATA PROCESSING      | 237       | 173.15 | 41,036.55  |
|                        |        | AVALARA INC                    | 45        | 169.02 | 7,605.90   |
|                        |        | BLACK KNIGHT INC               | 80        | 87.93  | 7,034.40   |
|                        |        | BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS   | 80        | 88.29  | 7,063.20   |
|                        |        | BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS | 65        | 146.10 | 9,496.50   |
|                        |        | CADENCE DESIGN SYSTEM INC      | 155       | 121.31 | 18,803.05  |
|                        |        | CERIDIAN HCM HOLDING INC       | 60        | 98.75  | 5,925.00   |
|                        |        | CHECK POINT SOFTWARE TECH      | 70        | 122.52 | 8,576.40   |
|                        |        | CITRIX SYSTEMS INC             | 65        | 128.43 | 8,347.95   |
|                        |        | CLOUDFLARE INC - CLASS A       | 70        | 81.43  | 5,700.10   |
|                        |        | COGNIZANT TECH SOLUTIONS       | 310       | 79.19  | 24,548.90  |
|                        |        | COUPA SOFTWARE INC             | 35        | 314.79 | 11,017.65  |
|                        |        | CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A   | 85        | 173.80 | 14,773.00  |
|                        |        | CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL   | 20        | 112.76 | 2,255.20   |
|                        |        | DATADOG INC - CLASS A          | 80        | 102.27 | 8,181.60   |
|                        |        | DOCUSIGN INC                   | 100       | 228.33 | 22,833.00  |
|                        |        | DROPBOX INC-CLASS A            | 200       | 23.32  | 4,664.00   |
|                        |        | DYNATRACE INC                  | 120       | 38.45  | 4,614.00   |
|                        |        | EPAM SYSTEMS INC               | 33        | 325.22 | 10,732.26  |
|                        |        | FAIR ISAAC CORP                | 15        | 517.64 | 7,764.60   |
|                        |        | FIDELITY NATIONAL INFORMATION  | 347       | 144.22 | 50,044.34  |
|                        |        | FISERV INC                     | 316       | 113.63 | 35,907.08  |
|                        |        | FLEETCOR TECHNOLOGIES INC      | 50        | 271.16 | 13,558.00  |
|                        |        | FORTINET INC                   | 80        | 130.69 | 10,455.20  |
|                        |        | GARTNER INC                    | 50        | 154.59 | 7,729.50   |
|                        |        | GLOBAL PAYMENTS INC            | 164       | 191.88 | 31,468.32  |
|                        |        | GODADDY INC - CLASS A          | 100       | 84.60  | 8,460.00   |
|                        |        | GUIDEWIRE SOFTWARE INC         | 50        | 126.23 | 6,311.50   |
|                        |        | HUBSPOT INC                    | 25        | 381.97 | 9,549.25   |
|                        |        | INTL BUSINESS MACHINES CORP    | 495       | 123.53 | 61,147.35  |
|                        |        | INTUIT INC                     | 145       | 365.51 | 52,998.95  |
|                        |        | JACK HENRY & ASSOCIATES INC    | 40        | 157.38 | 6,295.20   |
|                        |        | LEIDOS HOLDINGS INC            | 70        | 104.13 | 7,289.10   |
|                        |        | MASTERCARD INC-CLASS A         | 490       | 331.15 | 162,263.50 |
|                        |        | MICROSOFT CORP                 | 3,975     | 214.20 | 851,445.00 |
|                        |        | MONGODB INC                    | 30        | 340.12 | 10,203.60  |
|                        |        | NORTONLIFELOCK INC             | 340       | 19.87  | 6,755.80   |
| OKTA INC               | 65     | 251.54                         | 16,350.10 |        |            |
| ORACLE CORPORATION     | 1,100  | 60.76                          | 66,836.00 |        |            |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 50     | 314.28                         | 15,714.00 |        |            |
| PAYCHEX INC            | 180    | 91.33                          | 16,439.40 |        |            |
| PAYCOM SOFTWARE INC    | 25     | 425.98                         | 10,649.50 |        |            |

| 種類                         | 通貨     | 銘柄                                 | 株数         | 評価額単価  | 評価額          |
|----------------------------|--------|------------------------------------|------------|--------|--------------|
| 株式                         | アメリカドル | PAYPAL HOLDINGS INC                | 615        | 220.79 | 135,785.85   |
|                            |        | PTC INC                            | 70         | 113.83 | 7,968.10     |
|                            |        | RINGCENTRAL INC-CLASS A            | 35         | 352.52 | 12,338.20    |
|                            |        | SALESFORCE.COM INC                 | 503        | 221.27 | 111,298.81   |
|                            |        | SERVICENOW INC                     | 105        | 532.48 | 55,910.40    |
|                            |        | SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A       | 200        | 42.26  | 8,452.00     |
|                            |        | SNOWFLAKE INC-CLASS A              | 15         | 329.15 | 4,937.25     |
|                            |        | SPLUNK INC                         | 90         | 159.38 | 14,344.20    |
|                            |        | SQUARE INC - A                     | 200        | 215.86 | 43,172.00    |
|                            |        | SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS         | 120        | 71.49  | 8,578.80     |
|                            |        | SYNOPSIS INC                       | 75         | 238.86 | 17,914.50    |
|                            |        | TRADE DESK INC/THE -CLASS A        | 22         | 922.42 | 20,293.24    |
|                            |        | TWILIO INC - A                     | 70         | 350.09 | 24,506.30    |
|                            |        | TYLER TECHNOLOGIES INC             | 20         | 446.49 | 8,929.80     |
|                            |        | VERISIGN INC                       | 60         | 212.11 | 12,726.60    |
|                            |        | VISA INC                           | 935        | 207.25 | 193,778.75   |
|                            |        | VMWARC INC-CLASS A                 | 50         | 143.66 | 7,183.00     |
|                            |        | WESTERN UNION COMPANY-W/I          | 231        | 22.07  | 5,098.17     |
|                            |        | WIX.COM LTD                        | 30         | 260.94 | 7,828.20     |
|                            |        | WORKDAY INC-CLASS A                | 100        | 220.37 | 22,037.00    |
|                            |        | ZENDESK INC                        | 65         | 137.30 | 8,924.50     |
|                            |        | ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A        | 95         | 395.99 | 37,619.05    |
|                            |        | ZSCALER INC                        | 40         | 183.45 | 7,338.00     |
|                            |        | AMPHENOL CORP-CL A                 | 165        | 130.30 | 21,499.50    |
|                            |        | APPLE INC                          | 9,460      | 121.78 | 1,152,038.80 |
|                            |        | ARISTA NETWORKS INC                | 30         | 274.48 | 8,234.40     |
|                            |        | ARROW ELECTRONICS INC              | 40         | 95.08  | 3,803.20     |
|                            |        | CDW CORP/DE                        | 80         | 131.73 | 10,538.40    |
|                            |        | CISCO SYSTEMS INC                  | 2,340      | 44.24  | 103,521.60   |
|                            |        | COGNEX CORP                        | 100        | 77.84  | 7,784.00     |
|                            |        | CORNING INC                        | 450        | 36.81  | 16,564.50    |
|                            |        | DELL TECHNOLOGIES INC-C            | 129        | 72.43  | 9,343.47     |
|                            |        | F5 NETWORKS INC                    | 30         | 171.20 | 5,136.00     |
|                            |        | HEWLETT-PACKARD ENTERPRISE COMPANY | 700        | 11.87  | 8,309.00     |
|                            |        | HP INC                             | 810        | 23.21  | 18,800.10    |
|                            |        | IPG PHOTONICS CORP                 | 20         | 209.11 | 4,182.20     |
|                            |        | JUNIPER NETWORKS INC               | 210        | 22.08  | 4,636.80     |
|                            |        | KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN           | 100        | 123.72 | 12,372.00    |
|                            |        | MOTOROLA SOLUTIONS INC             | 98         | 165.92 | 16,260.16    |
|                            |        | NETAPP INC                         | 120        | 61.67  | 7,400.40     |
|                            |        | SEAGATE TECHNOLOGY                 | 120        | 64.64  | 7,756.80     |
|                            |        | TE CONNECTIVITY LTD                | 190        | 117.17 | 22,262.30    |
|                            |        | TRIMBLE INC                        | 150        | 64.64  | 9,696.00     |
|                            |        | WESTERN DIGITAL CORPORATION        | 182        | 51.14  | 9,307.48     |
|                            |        | ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A       | 30         | 383.46 | 11,503.80    |
|                            |        | AT&T INC                           | 3,939      | 30.55  | 120,336.45   |
|                            |        | CENTURYLINK INC                    | 524        | 10.42  | 5,460.08     |
|                            |        | LIBERTY GLOBAL PLC-A               | 82         | 24.57  | 2,014.74     |
|                            |        | LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C        | 162        | 23.63  | 3,828.06     |
|                            |        | T-MOBILE US INC                    | 304        | 129.36 | 39,325.44    |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 2,280  | 59.98                              | 136,754.40 |        |              |
| AES CORPORATION            | 350    | 21.30                              | 7,455.00   |        |              |
| ALLIANT ENERGY CORPORATION | 140    | 51.34                              | 7,187.60   |        |              |
| AMEREN CORPORATION         | 140    | 77.24                              | 10,813.60  |        |              |
| AMERICAN ELECTRIC POWER    | 270    | 82.21                              | 22,196.70  |        |              |

| 種類                        | 通貨     | 銘柄                           | 株数        | 評価額単価  | 評価額                              |
|---------------------------|--------|------------------------------|-----------|--------|----------------------------------|
| 株式                        | アメリカドル | AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 100       | 148.55 | 14,855.00                        |
|                           |        | ATMOS ENERGY CORP            | 70        | 99.51  | 6,965.70                         |
|                           |        | CENTERPOINT ENERGY INC       | 270       | 21.64  | 5,842.80                         |
|                           |        | CMS ENERGY CORP              | 170       | 59.22  | 10,067.40                        |
|                           |        | CONSOLIDATED EDISON INC      | 190       | 72.41  | 13,757.90                        |
|                           |        | DOMINION ENERGY INC          | 480       | 74.47  | 35,745.60                        |
|                           |        | DTE ENERGY COMPANY           | 110       | 123.52 | 13,587.20                        |
|                           |        | DUKE ENERGY CORP             | 402       | 91.13  | 36,634.26                        |
|                           |        | EDISON INTERNATIONAL         | 200       | 62.26  | 12,452.00                        |
|                           |        | ENTERGY CORP                 | 110       | 101.41 | 11,155.10                        |
|                           |        | ESSENTIAL UTILITIES INC      | 140       | 47.07  | 6,589.80                         |
|                           |        | EVERGY INC                   | 140       | 54.41  | 7,617.40                         |
|                           |        | EVERSOURCE ENERGY            | 183       | 85.46  | 15,639.18                        |
|                           |        | EXELON CORPORATION           | 544       | 41.06  | 22,336.64                        |
|                           |        | FIRSTENERGY CORP             | 266       | 30.35  | 8,073.10                         |
|                           |        | NEXTERA ENERGY INC           | 1,090     | 73.55  | 80,169.50                        |
|                           |        | NISOURCE INC                 | 180       | 22.65  | 4,077.00                         |
|                           |        | NRG ENERGY INC               | 110       | 32.63  | 3,589.30                         |
|                           |        | OGE ENERGY CORP              | 100       | 32.08  | 3,208.00                         |
|                           |        | P G & E CORP                 | 680       | 11.85  | 8,058.00                         |
|                           |        | PINNACLE WEST CAPITAL        | 60        | 79.14  | 4,748.40                         |
|                           |        | PPL CORPORATION              | 450       | 27.60  | 12,420.00                        |
|                           |        | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 280       | 56.43  | 15,800.40                        |
|                           |        | SEMPRA ENERGY                | 160       | 128.04 | 20,486.40                        |
|                           |        | SOUTHERN CO                  | 590       | 59.66  | 35,199.40                        |
|                           |        | UGI CORP                     | 90        | 34.98  | 3,148.20                         |
|                           |        | VISTRA CORP                  | 250       | 18.14  | 4,535.00                         |
|                           |        | WISCONSIN ENERGY CORPORATION | 182       | 91.58  | 16,667.56                        |
|                           |        | XCEL ENERGY INC              | 280       | 65.04  | 18,211.20                        |
|                           |        | ADVANCED MICRO DEVICES       | 655       | 94.78  | 62,080.90                        |
|                           |        | ANALOG DEVICES               | 204       | 142.33 | 29,035.32                        |
|                           |        | APPLIED MATERIALS INC        | 500       | 88.50  | 44,250.00                        |
|                           |        | BROADCOM INC                 | 223       | 411.80 | 91,831.40                        |
|                           |        | ENPHASE ENERGY INC           | 65        | 145.07 | 9,429.55                         |
|                           |        | INTEL CORP                   | 2,350     | 50.47  | 118,604.50                       |
|                           |        | KLA CORPORATION              | 80        | 260.13 | 20,810.40                        |
|                           |        | LAM RESEARCH CORP            | 80        | 491.87 | 39,349.60                        |
|                           |        | MARVELL TECHNOLOGY           | 400       | 44.33  | 17,732.00                        |
|                           |        | MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 160       | 85.31  | 13,649.60                        |
|                           |        | MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 140       | 141.50 | 19,810.00                        |
|                           |        | MICRON TECHNOLOGY INC        | 620       | 71.54  | 44,354.80                        |
|                           |        | MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 22        | 319.46 | 7,028.12                         |
|                           |        | NVIDIA CORP                  | 340       | 532.35 | 180,999.00                       |
|                           |        | NXP SEMICONDUCTORS NV        | 155       | 158.46 | 24,561.30                        |
|                           |        | ON SEMICONDUCTOR CORP        | 250       | 30.82  | 7,705.00                         |
|                           |        | QORVO INC                    | 65        | 154.51 | 10,043.15                        |
|                           |        | QUALCOMM INC                 | 625       | 146.29 | 91,431.25                        |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC    | 90     | 139.26                       | 12,533.40 |        |                                  |
| SOLAREGE TECHNOLOGIES INC | 30     | 293.32                       | 8,799.60  |        |                                  |
| TERADYNE INC              | 100    | 117.18                       | 11,718.00 |        |                                  |
| TEXAS INSTRUMENTS INC     | 510    | 160.12                       | 81,661.20 |        |                                  |
| XILINX INC                | 140    | 149.03                       | 20,864.20 |        |                                  |
|                           | 小計     |                              |           |        | 17,812,767.43<br>(1,854,665,344) |

| 種類 | 通貨     | 銘柄                                  | 株数           | 評価額単価  | 評価額       |
|----|--------|-------------------------------------|--------------|--------|-----------|
| 株式 | アメリカドル | 銘柄数：<br>組入時価比率：                     | 594<br>66.0% |        | 71.3%     |
|    | カナダドル  | CAMECO CORP                         | 186          | 16.96  | 3,154.56  |
|    |        | CANADIAN NATURAL RESOURCES          | 686          | 31.27  | 21,451.22 |
|    |        | CENOVUS ENERGY INC                  | 400          | 7.70   | 3,080.00  |
|    |        | ENBRIDGE INC                        | 1,122        | 42.53  | 47,718.66 |
|    |        | IMPERIAL OIL LTD                    | 209          | 24.52  | 5,124.68  |
|    |        | INTER PIPELINE LTD                  | 200          | 13.29  | 2,658.00  |
|    |        | KEYERA CORP                         | 200          | 23.39  | 4,678.00  |
|    |        | PARKLAND CORP                       | 60           | 41.31  | 2,478.60  |
|    |        | PEMBINA PIPELINE CORP               | 312          | 33.55  | 10,467.60 |
|    |        | SUNCOR ENERGY INC                   | 867          | 23.08  | 20,010.36 |
|    |        | TC ENERGY CORPORATION               | 550          | 56.41  | 31,025.50 |
|    |        | AGNICO EAGLE MINES                  | 141          | 87.66  | 12,360.06 |
|    |        | B2GOLD CORP                         | 400          | 6.88   | 2,752.00  |
|    |        | BARRICK GOLD CORP                   | 1,049        | 28.62  | 30,022.38 |
|    |        | CCL INDUSTRIES INC - CL B           | 70           | 59.46  | 4,162.20  |
|    |        | FIRST QUANTUM MINERALS LTD          | 344          | 20.42  | 7,024.48  |
|    |        | FRANCO-NEVADA CORP                  | 100          | 165.76 | 16,576.00 |
|    |        | KINROSS GOLD CORP                   | 500          | 8.79   | 4,395.00  |
|    |        | KIRKLAND LAKE GOLD LTD              | 150          | 49.78  | 7,467.00  |
|    |        | LUNDIN MINING CORP                  | 350          | 9.84   | 3,444.00  |
|    |        | NUTRIEN LTD                         | 301          | 62.39  | 18,779.39 |
|    |        | PAN AMERICAN SILVER CORP            | 100          | 36.86  | 3,686.00  |
|    |        | SSR MINING INC                      | 150          | 22.89  | 3,433.50  |
|    |        | TECK RESOURCES LTD-CL B             | 250          | 22.64  | 5,660.00  |
|    |        | WHEATON PRECIOUS METALS CORP        | 250          | 51.34  | 12,835.00 |
|    |        | YAMANA GOLD INC                     | 250          | 6.71   | 1,677.50  |
|    |        | CAE INC                             | 150          | 31.28  | 4,692.00  |
|    |        | TOROMONT INDUSTRIES LTD             | 30           | 93.40  | 2,802.00  |
|    |        | WSP GLOBAL INC                      | 50           | 125.12 | 6,256.00  |
|    |        | GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT        | 50           | 34.45  | 1,722.50  |
|    |        | RITCHIE BROS AUCTIONEERS            | 50           | 89.45  | 4,472.50  |
|    |        | THOMSON REUTERS CORP                | 97           | 102.63 | 9,955.11  |
|    |        | CANADIAN NATL RAILWAY CO            | 398          | 139.63 | 55,572.74 |
|    |        | CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD        | 75           | 427.60 | 32,070.00 |
|    |        | MAGNA INTERNATIONAL INC             | 148          | 79.44  | 11,757.12 |
|    |        | GILDAN ACTIVIWEAR                   | 120          | 34.51  | 4,141.20  |
|    |        | RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 154          | 78.37  | 12,068.98 |
|    |        | QUEBECOR INC -CL B                  | 100          | 33.62  | 3,362.00  |
|    |        | SHAW COMMUNICATIONS INC-B           | 324          | 23.18  | 7,510.32  |
|    |        | CANADIAN TIRE CORP -CL A            | 39           | 164.61 | 6,419.79  |
|    |        | DOLLARAMA INC                       | 190          | 53.94  | 10,248.60 |
|    |        | ALIMENTATION COUCHE-TARD INC        | 510          | 44.65  | 22,771.50 |
|    |        | EMPIRE COMPANY LTD                  | 100          | 35.54  | 3,554.00  |
|    |        | LOBLAW COMPANIES LTD                | 115          | 65.20  | 7,498.00  |
|    |        | METRO INC                           | 130          | 59.00  | 7,670.00  |
|    |        | WESTON (GEORGE) LTD                 | 45           | 99.15  | 4,461.75  |
|    |        | SAPUTO INC                          | 170          | 37.00  | 6,290.00  |
|    |        | BAUSCH HEALTH COMPANISE INC         | 140          | 26.29  | 3,680.60  |
|    |        | CANOPY GROWTH CORP                  | 100          | 32.31  | 3,231.00  |
|    |        | BANK OF MONTREAL                    | 323          | 96.12  | 31,046.76 |
|    |        | BANK OF NOVA SCOTIA                 | 659          | 68.16  | 44,917.44 |
|    |        | CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE         | 246          | 110.75 | 27,244.50 |

| 種類 | 通貨    | 銘柄  | 株数    | 評価額単価    | 評価額       |  |                              |
|----|-------|---|-------|----------|-----------|--|------------------------------|
| 株式 | カナダドル | NATIONAL BANK OF CANADA                     | 206   | 72.39    | 14,912.34 |  |                              |
|    |       | ROYAL BANK OF CANADA                        | 792   | 104.86   | 83,049.12 |  |                              |
|    |       | TORONTO-DOMINION BANK                       | 982   | 71.69    | 70,399.58 |  |                              |
|    |       | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC-<br>CLASS A | 740   | 51.84    | 38,361.60 |  |                              |
|    |       | CI FINANCIAL CORP                           | 200   | 16.64    | 3,328.00  |  |                              |
|    |       | IGM FINANCIAL INC                           | 50    | 35.17    | 1,758.50  |  |                              |
|    |       | ONEX CORPORATION                            | 55    | 72.64    | 3,995.20  |  |                              |
|    |       | TMX GROUP LTD                               | 40    | 125.98   | 5,039.20  |  |                              |
|    |       | FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD                 | 16    | 448.02   | 7,168.32  |  |                              |
|    |       | GREAT-WEST LIFE CO INC                      | 190   | 29.14    | 5,536.60  |  |                              |
|    |       | IA FINANCIAL CORPORATION INC                | 50    | 56.35    | 2,817.50  |  |                              |
|    |       | INTACT FINANCIAL CORP                       | 80    | 149.00   | 11,920.00 |  |                              |
|    |       | MANULIFE FINANCIAL CORP                     | 1,100 | 22.40    | 24,640.00 |  |                              |
|    |       | POWER CORP OF CANADA                        | 288   | 29.46    | 8,484.48  |  |                              |
|    |       | SUN LIFE FINANCIAL INC                      | 348   | 56.59    | 19,693.32 |  |                              |
|    |       | FIRSTSERVICE CORP                           | 10    | 166.12   | 1,661.20  |  |                              |
|    |       | BLACKBERRY LTD                              | 300   | 10.54    | 3,162.00  |  |                              |
|    |       | CGI INC                                     | 109   | 96.97    | 10,569.73 |  |                              |
|    |       | CONSTELLATION SOFTWARE INC                  | 11    | 1,668.18 | 18,349.98 |  |                              |
|    |       | OPEN TEXT CORP                              | 180   | 58.68    | 10,562.40 |  |                              |
|    |       | SHOPIFY INC - CLASS A                       | 59    | 1,350.26 | 79,665.34 |  |                              |
|    |       | BCE INC                                     | 104   | 56.52    | 5,878.08  |  |                              |
|    |       | ROGERS COMMUNICATIONS -CL B                 | 220   | 60.10    | 13,222.00 |  |                              |
|    |       | TELUS CORP                                  | 200   | 25.47    | 5,094.00  |  |                              |
|    |       | ALGONQUIN POWER & UTILITIES                 | 300   | 20.38    | 6,114.00  |  |                              |
|    |       | ALTAGAS LTD                                 | 150   | 18.77    | 2,815.50  |  |                              |
|    |       | ATCO LTD -CLASS I                           | 50    | 38.16    | 1,908.00  |  |                              |
|    |       | BROOKFIELD RENEWABLE COR-A                  | 75    | 63.11    | 4,733.25  |  |                              |
|    |       | CANADIAN UTILITIES LTD                      | 130   | 31.99    | 4,158.70  |  |                              |
|    |       | EMERA INC                                   | 120   | 54.55    | 6,546.00  |  |                              |
|    |       | FORTIS INC                                  | 280   | 53.11    | 14,870.80 |  |                              |
|    |       | HYDRO ONE LTD                               | 200   | 29.09    | 5,818.00  |  |                              |
|    |       | NORHLAND POWER INC                          | 50    | 44.73    | 2,236.50  |  |                              |
|    |       | 小計  |       |          |           |  | 1,120,007.34<br>(91,437,399) |
|    |       |   |       | 銘柄数 :    | 85        |  |                              |
|    |       | 組入時価比率 :                                    | 3.3%  |          | 3.5%      |  |                              |
|    | ユーロ   | ENI SPA                                     | 1,409 | 8.67     | 12,227.30 |  |                              |
|    |       | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHARES               | 273   | 8.96     | 2,447.17  |  |                              |
|    |       | KONINKLIJKE VOPAK NV                        | 39    | 42.67    | 1,664.13  |  |                              |
|    |       | NESTE OYJ                                   | 235   | 57.64    | 13,545.40 |  |                              |
|    |       | OMV AG                                      | 82    | 32.34    | 2,651.88  |  |                              |
|    |       | REPSOL SA                                   | 788   | 8.62     | 6,792.56  |  |                              |
|    |       | TENARIS SA                                  | 316   | 6.71     | 2,120.99  |  |                              |
|    |       | TOTAL SE                                    | 1,416 | 36.60    | 51,825.60 |  |                              |
|    |       | AIR LIQUIDE                                 | 261   | 136.20   | 35,548.20 |  |                              |
|    |       | AKZO NOBEL                                  | 113   | 86.44    | 9,767.72  |  |                              |
|    |       | ARCELORMITTAL                               | 370   | 17.38    | 6,433.56  |  |                              |
|    |       | ARKEMA                                      | 38    | 95.00    | 3,610.00  |  |                              |
|    |       | BASF SE                                     | 512   | 63.90    | 32,716.80 |  |                              |
|    |       | COVESTRO AG                                 | 97    | 50.54    | 4,902.38  |  |                              |
|    |       | CRH PLC                                     | 443   | 32.73    | 14,499.39 |  |                              |
|    |       | EVONIK INDUSTRIES AG                        | 117   | 26.10    | 3,053.70  |  |                              |
|    |       | FUCHS PETROLUB SE -PREF                     | 33    | 45.96    | 1,516.68  |  |                              |

| 種類                           | 通貨  | 銘柄                              | 株数        | 評価額単価  | 評価額       |
|------------------------------|-----|---------------------------------|-----------|--------|-----------|
| 株式                           | ユーロ | HEIDELBERGCEMENT AG             | 83        | 58.54  | 4,858.82  |
|                              |     | KONINKLIJKE DSM NV              | 101       | 135.10 | 13,645.10 |
|                              |     | LANXESS AG                      | 55        | 60.74  | 3,340.70  |
|                              |     | SMURFIT KAPPA GROUP PLC         | 126       | 37.76  | 4,757.76  |
|                              |     | SOLVAY SA                       | 36        | 97.40  | 3,506.40  |
|                              |     | STORA ENSO OYJ-R SHS            | 408       | 14.87  | 6,069.00  |
|                              |     | SYMRISE AG                      | 67        | 106.35 | 7,125.45  |
|                              |     | UMICORE                         | 110       | 36.90  | 4,059.00  |
|                              |     | UPM-KYMMENE OYJ                 | 297       | 29.28  | 8,696.16  |
|                              |     | VOESTALPINE AG                  | 68        | 28.13  | 1,912.84  |
|                              |     | ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV     | 187       | 26.52  | 4,959.24  |
|                              |     | AIRBUS SE                       | 327       | 92.05  | 30,100.35 |
|                              |     | ALSTOM                          | 136       | 45.91  | 6,243.76  |
|                              |     | BOUYGUES                        | 125       | 33.85  | 4,231.25  |
|                              |     | BRENTAG AG                      | 86        | 63.34  | 5,447.24  |
|                              |     | CNH INDUSTRIAL NV               | 564       | 9.12   | 5,148.19  |
|                              |     | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN       | 286       | 38.54  | 11,022.44 |
|                              |     | DASSAULT AVIATION SA            | 2         | 896.50 | 1,793.00  |
|                              |     | EIFFAGE                         | 44        | 80.28  | 3,532.32  |
|                              |     | FERROVIAL SA                    | 275       | 23.29  | 6,404.75  |
|                              |     | GEA GROUP AG                    | 85        | 27.49  | 2,336.65  |
|                              |     | KINGSPAN GROUP PLC              | 86        | 71.45  | 6,144.70  |
|                              |     | KION GROUP AG                   | 36        | 69.04  | 2,485.44  |
|                              |     | KNORR-BREMSE AG                 | 42        | 106.06 | 4,454.52  |
|                              |     | KONE OYJ                        | 187       | 67.22  | 12,570.14 |
|                              |     | LEGRAND SA                      | 149       | 70.88  | 10,561.12 |
|                              |     | MTU AERO ENGINES AG             | 30        | 206.00 | 6,180.00  |
|                              |     | PRYSMIAN SPA                    | 134       | 27.52  | 3,687.68  |
|                              |     | RATIONAL AG                     | 2         | 718.50 | 1,437.00  |
|                              |     | SAFRAN S. A.                    | 182       | 119.30 | 21,712.60 |
|                              |     | SCHNEIDER ELECTRIC SE           | 295       | 116.15 | 34,264.25 |
|                              |     | SIEMENS AG                      | 428       | 112.70 | 48,235.60 |
|                              |     | SIEMENS ENERGY AG               | 229       | 25.65  | 5,873.85  |
|                              |     | SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY | 160       | 28.50  | 4,560.00  |
|                              |     | THALES                          | 59        | 76.64  | 4,521.76  |
|                              |     | VINCI S. A.                     | 289       | 84.96  | 24,553.44 |
|                              |     | WARTSILA OYJ                    | 247       | 8.20   | 2,026.88  |
|                              |     | BUREAU VERITAS SA               | 164       | 22.57  | 3,701.48  |
|                              |     | RANDSTAD NV                     | 57        | 53.20  | 3,032.40  |
|                              |     | TELEPERFORMANCE                 | 30        | 264.60 | 7,938.00  |
|                              |     | WOLTERS KLUWER-CVA              | 152       | 68.16  | 10,360.32 |
|                              |     | AENA SME SA                     | 37        | 135.90 | 5,028.30  |
|                              |     | AEROPORTS DE PARIS              | 17        | 105.00 | 1,785.00  |
|                              |     | ATLANTIA SPA                    | 276       | 14.50  | 4,002.00  |
|                              |     | DEUTSCHE LUFTHANSA-REG          | 240       | 9.75   | 2,340.00  |
|                              |     | DEUTSCHE POST AG                | 552       | 39.25  | 21,666.00 |
|                              |     | GETLINK SE                      | 308       | 13.41  | 4,130.28  |
|                              |     | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG     | 185       | 71.91  | 13,303.35 |
|                              |     | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG     | 28        | 54.30  | 1,520.40  |
|                              |     | CONTINENTAL AG                  | 61        | 110.00 | 6,710.00  |
| DAIMLER AG-REG               | 477 | 56.37                           | 26,888.49 |        |           |
| FAURECIA                     | 42  | 40.21                           | 1,688.82  |        |           |
| FERRARI NV                   | 70  | 178.90                          | 12,523.00 |        |           |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 611 | 13.82                           | 8,444.02  |        |           |
| MICHELIN (CGDE)-B            | 95  | 106.70                          | 10,136.50 |        |           |



| 種類                             | 通貨  | 銘柄   | 株数       | 評価額単価  | 評価額       |
|--------------------------------|-----|--|----------|--------|-----------|
| 株式                             | ユーロ | PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE               | 85       | 54.02  | 4,591.70  |
|                                |     | PSA PEUGEOT CITROEN                        | 327      | 21.06  | 6,886.62  |
|                                |     | RENAULT SA                                 | 107      | 35.73  | 3,823.64  |
|                                |     | VALEO SA                                   | 134      | 31.70  | 4,247.80  |
|                                |     | VOLKSWAGEN AG                              | 12       | 154.50 | 1,854.00  |
|                                |     | VOLKSWAGEN AG PFD                          | 104      | 139.68 | 14,526.72 |
|                                |     | ADIDAS AG                                  | 106      | 287.50 | 30,475.00 |
|                                |     | ESSILORLUXOTTICA                           | 157      | 129.55 | 20,339.35 |
|                                |     | HERMES INTERNATIONAL                       | 17       | 844.60 | 14,358.20 |
|                                |     | KERING                                     | 40       | 564.10 | 22,564.00 |
|                                |     | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI               | 154      | 509.20 | 78,416.80 |
|                                |     | MONCLER SPA                                | 101      | 47.88  | 4,835.88  |
|                                |     | PUMA SE                                    | 59       | 84.44  | 4,981.96  |
|                                |     | SEB SA                                     | 10       | 145.00 | 1,450.00  |
|                                |     | ACCOR SA                                   | 98       | 29.48  | 2,889.04  |
|                                |     | FLUTTER ENTERTAINMENT PLC                  | 92       | 165.65 | 15,239.80 |
|                                |     | LA FRANCAISE DES JEUX SAEM                 | 49       | 35.56  | 1,742.44  |
|                                |     | SODEXO                                     | 49       | 72.14  | 3,534.86  |
|                                |     | BOLLORE                                    | 437      | 3.39   | 1,484.05  |
|                                |     | PUBLICIS GROUPE                            | 120      | 40.92  | 4,910.40  |
|                                |     | SCOUT24 AG                                 | 62       | 66.45  | 4,119.90  |
|                                |     | SES  | 205      | 7.78   | 1,594.90  |
|                                |     | UBISOFT ENTERTAINMENT                      | 50       | 77.00  | 3,850.00  |
|                                |     | VIVENDI SA                                 | 459      | 25.73  | 11,810.07 |
|                                |     | DELIVERY HERO SE                           | 79       | 114.65 | 9,057.35  |
|                                |     | HELLOFRESH SE                              | 73       | 60.70  | 4,431.10  |
|                                |     | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA<br>(INDITEX) | 603      | 27.45  | 16,552.35 |
|                                |     | JUST EAT TAKEAWAY                          | 80       | 87.26  | 6,980.80  |
|                                |     | PROSUS                                     | 272      | 90.08  | 24,501.76 |
|                                |     | ZALANDO SE                                 | 99       | 84.52  | 8,367.48  |
|                                |     | CARREFOUR SA                               | 337      | 13.75  | 4,633.75  |
|                                |     | COLRUYT SA                                 | 37       | 49.20  | 1,820.40  |
|                                |     | JERONIMO MARTINS                           | 140      | 14.58  | 2,041.20  |
|                                |     | KESKO OYJ-B SHS                            | 152      | 20.66  | 3,140.32  |
|                                |     | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV              | 612      | 23.43  | 14,339.16 |
|                                |     | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV                 | 425      | 57.60  | 24,480.00 |
|                                |     | DANONE                                     | 342      | 52.46  | 17,941.32 |
|                                |     | DAVIDE CAMPARI-MILANO NV                   | 323      | 9.36   | 3,025.21  |
|                                |     | HEINEKEN HOLDING NV                        | 64       | 79.80  | 5,107.20  |
|                                |     | HEINEKEN NV                                | 145      | 91.98  | 13,337.10 |
|                                |     | KERRY GROUP PLC-A                          | 87       | 120.90 | 10,518.30 |
|                                |     | PERNOD-RICARD                              | 120      | 160.65 | 19,278.00 |
|                                |     | REMY COINTREAU                             | 20       | 151.00 | 3,020.00  |
|                                |     | BEIERSDORF AG                              | 59       | 92.24  | 5,442.16  |
|                                |     | HENKEL AG & CO KGAA                        | 58       | 78.20  | 4,535.60  |
|                                |     | HENKEL AG & CO KGAA                        | 99       | 88.56  | 8,767.44  |
|                                |     | L'OREAL                                    | 137      | 302.70 | 41,469.90 |
|                                |     | UNILEVER PLC                               | 815      | 47.84  | 38,989.60 |
|                                |     | AMPLIFON SPA                               | 50       | 33.61  | 1,680.50  |
|                                |     | BIOMERIEUX                                 | 28       | 119.70 | 3,351.60  |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR     | 22  | 108.00                                     | 2,376.00 |        |           |
| DIASORIN SPA                   | 7   | 170.70                                     | 1,194.90 |        |           |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO | 115 | 67.78                                      | 7,794.70 |        |           |
| FRESENIUS SE & CO KGAA         | 233 | 38.02                                      | 8,858.66 |        |           |

| 種類            | 通貨  | 銘柄                              | 株数       | 評価額単価  | 評価額       |
|---------------|-----|---------------------------------|----------|--------|-----------|
| 株式            | ユーロ | KONINKLIJKE PHILIPS NV          | 517      | 43.03  | 22,249.09 |
|               |     | ORPEA                           | 30       | 107.10 | 3,213.00  |
|               |     | SARTORIUS AG-VORZUG             | 20       | 362.60 | 7,252.00  |
|               |     | SIEMENS HEALTHINEERS AG         | 156      | 40.45  | 6,310.98  |
|               |     | ARGENX SE                       | 20       | 254.00 | 5,080.00  |
|               |     | BAYER AG                        | 536      | 47.16  | 25,277.76 |
|               |     | EUROFINS SCIENTIFIC             | 70       | 66.63  | 4,664.10  |
|               |     | GALAPAGOS NV                    | 20       | 98.12  | 1,962.40  |
|               |     | GRIFOLS SA                      | 166      | 24.68  | 4,096.88  |
|               |     | IPSEN                           | 34       | 69.00  | 2,346.00  |
|               |     | MERCK KGAA                      | 69       | 135.95 | 9,380.55  |
|               |     | ORION OYJ                       | 57       | 38.04  | 2,168.28  |
|               |     | QIAGEN N.V.                     | 126      | 42.79  | 5,391.54  |
|               |     | RECORDATI SPA                   | 77       | 44.77  | 3,447.29  |
|               |     | SANOFI                          | 632      | 77.85  | 49,201.20 |
|               |     | SARTORIUS STEDIM BIOTECH        | 10       | 291.40 | 2,914.00  |
|               |     | UCB SA                          | 70       | 87.40  | 6,118.00  |
|               |     | ABN AMRO BANK NV-CVA            | 186      | 8.09   | 1,505.48  |
|               |     | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA | 3,387    | 4.02   | 13,642.83 |
|               |     | BANCO SANTANDER SA              | 9,148    | 2.62   | 23,995.20 |
|               |     | BNP PARIBAS                     | 627      | 44.15  | 27,682.05 |
|               |     | CAIXABANK                       | 1,487    | 2.23   | 3,316.01  |
|               |     | COMMERZBANK AG                  | 460      | 5.13   | 2,360.72  |
|               |     | CREDIT AGRICOLE SA              | 642      | 10.48  | 6,731.37  |
|               |     | ERSTE GROUP BANK AG             | 167      | 25.04  | 4,181.68  |
|               |     | FINECOBANK SPA                  | 339      | 13.11  | 4,444.29  |
|               |     | ING GROEP N.V.                  | 2,175    | 7.90   | 17,195.55 |
|               |     | INTESA SANPAOLO                 | 9,223    | 1.93   | 17,885.24 |
|               |     | KBC GROUPE                      | 139      | 60.34  | 8,387.26  |
|               |     | MEDIOBANCA SPA                  | 303      | 7.35   | 2,227.65  |
|               |     | SOCIETE GENERALE-A              | 451      | 16.99  | 7,663.39  |
|               |     | UNICREDIT SPA                   | 1,297    | 7.69   | 9,979.11  |
|               |     | AMUNDI SA                       | 34       | 66.55  | 2,262.70  |
|               |     | DEUTSCHE BANK AG-REG            | 1,093    | 8.79   | 9,612.93  |
|               |     | DEUTSCHE BOERSE AG              | 107      | 138.55 | 14,824.85 |
|               |     | EURAZEO                         | 31       | 55.00  | 1,705.00  |
|               |     | EXOR NV                         | 60       | 59.64  | 3,578.40  |
|               |     | GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA     | 66       | 81.72  | 5,393.52  |
|               |     | NATIXIS                         | 659      | 2.61   | 1,725.26  |
|               |     | SOFINA                          | 7        | 264.50 | 1,851.50  |
|               |     | WENDEL                          | 20       | 98.60  | 1,972.00  |
|               |     | AEGON NV                        | 610      | 2.97   | 1,815.36  |
|               |     | AGEAS                           | 99       | 42.15  | 4,172.85  |
|               |     | ALLIANZ SE-REG                  | 228      | 191.98 | 43,771.44 |
|               |     | ASSICURAZIONI GENERALI          | 612      | 14.26  | 8,727.12  |
|               |     | AXA SA                          | 1,070    | 19.67  | 21,055.46 |
|               |     | CNP ASSURANCES                  | 129      | 12.95  | 1,670.55  |
|               |     | HANNOVER RUECK SE               | 30       | 132.10 | 3,963.00  |
|               |     | MUENCHENER RUECKVER AG-REG      | 84       | 238.40 | 20,025.60 |
|               |     | NN GROUP NV                     | 172      | 33.50  | 5,762.00  |
|               |     | POSTE ITALIANE SPA              | 291      | 8.35   | 2,429.85  |
| SAMPO OYJ     | 286 | 34.50                           | 9,867.00 |        |           |
| SCOR SE       | 84  | 27.04                           | 2,271.36 |        |           |
| AROUNDTOWN SA | 361 | 6.18                            | 2,233.86 |        |           |

| 種類                       | 通貨  | 銘柄                           | 株数        | 評価額単価    | 評価額       |
|--------------------------|-----|------------------------------|-----------|----------|-----------|
| 株式                       | ユーロ | DEUTSCHE WOHNEN SE-BEARER    | 200       | 42.72    | 8,544.00  |
|                          |     | LEG IMMOBILIEN AG            | 40        | 121.34   | 4,853.60  |
|                          |     | VONOVIA SE                   | 287       | 57.62    | 16,536.94 |
|                          |     | ADYEN NV                     | 11        | 1,837.00 | 20,207.00 |
|                          |     | AMADEUS IT GROUP SA-A        | 268       | 59.92    | 16,058.56 |
|                          |     | ATOS SE                      | 55        | 73.18    | 4,024.90  |
|                          |     | BECHTLE AG                   | 10        | 174.90   | 1,749.00  |
|                          |     | CAPGEMINI SA                 | 88        | 115.10   | 10,128.80 |
|                          |     | DASSAULT SYSTEMES SA         | 75        | 156.30   | 11,722.50 |
|                          |     | E DENRED                     | 135       | 46.01    | 6,211.35  |
|                          |     | NEMETSCHEK SE                | 33        | 57.10    | 1,884.30  |
|                          |     | NEXI SPA                     | 217       | 16.10    | 3,493.70  |
|                          |     | SAP SE                       | 583       | 99.93    | 58,259.19 |
|                          |     | TEAMVIEWER AG                | 75        | 39.80    | 2,985.00  |
|                          |     | WORLDLINE SA                 | 140       | 75.14    | 10,519.60 |
|                          |     | NOKIA                        | 2,571     | 3.27     | 8,412.31  |
|                          |     | ALTICE EUROPE NV             | 272       | 4.40     | 1,197.61  |
|                          |     | CELLNEX TELECOM SA           | 197       | 51.28    | 10,102.16 |
|                          |     | DEUTSCHE TELEKOM REGD        | 1,844     | 14.79    | 27,272.76 |
|                          |     | ELISA CORP-A SHARES          | 79        | 44.81    | 3,539.99  |
|                          |     | ILIAD SA                     | 10        | 174.15   | 1,741.50  |
|                          |     | INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 148       | 9.90     | 1,465.20  |
|                          |     | KONINKLIJKE KPN NV           | 1,410     | 2.46     | 3,470.01  |
|                          |     | ORANGE S. A.                 | 1,088     | 10.00    | 10,880.00 |
|                          |     | PROXIMUS SA                  | 129       | 17.32    | 2,234.28  |
|                          |     | TELECOM ITALIA SPA           | 6,045     | 0.38     | 2,327.92  |
|                          |     | TELECOM ITALIA-RNC           | 5,000     | 0.41     | 2,093.50  |
|                          |     | TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 923       | 2.27     | 2,097.97  |
|                          |     | TELEFONICA S. A.             | 2,422     | 3.52     | 8,539.97  |
|                          |     | TELEFONICA SA-RTS            | 2,422     | 0.19     | 472.53    |
|                          |     | UNITED INTERNET AG           | 63        | 33.74    | 2,125.62  |
|                          |     | E. ON SE                     | 1,237     | 8.85     | 10,957.34 |
|                          |     | ELECTRICITE DE FRANCE        | 340       | 12.37    | 4,205.80  |
|                          |     | ELIA GROUP SA/NV             | 20        | 94.00    | 1,880.00  |
|                          |     | ENAGAS                       | 139       | 20.38    | 2,832.82  |
|                          |     | ENDESA SA                    | 177       | 22.75    | 4,026.75  |
|                          |     | ENEL SPA                     | 4,536     | 8.12     | 36,841.39 |
|                          |     | ENERGIAS DE PORTUGAL SA      | 1,617     | 4.80     | 7,761.60  |
|                          |     | ENGIE                        | 1,019     | 12.52    | 12,762.97 |
|                          |     | FORTUM OYJ                   | 247       | 18.79    | 4,641.13  |
|                          |     | IBERDROLA SA                 | 3,423     | 11.28    | 38,628.55 |
|                          |     | NATURGY ENERGY GROUP SA      | 164       | 19.41    | 3,183.24  |
|                          |     | RED ELECTRICA CORPORATION SA | 241       | 16.86    | 4,063.26  |
|                          |     | RWE AG                       | 371       | 33.14    | 12,294.94 |
|                          |     | SNAM SPA                     | 1,134     | 4.56     | 5,174.44  |
|                          |     | SUEZ                         | 190       | 15.90    | 3,021.00  |
|                          |     | TERNA SPA                    | 783       | 6.10     | 4,779.43  |
| UNIPER SE                | 112 | 27.90                        | 3,124.80  |          |           |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT     | 300 | 19.61                        | 5,884.50  |          |           |
| VERBUND AG               | 38  | 59.65                        | 2,266.70  |          |           |
| ASML HOLDING NV          | 238 | 376.00                       | 89,488.00 |          |           |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 741 | 29.45                        | 21,822.45 |          |           |

| 種類 | 通貨          | 銘柄                            | 株数     | 評価額単価  | 評価額                           |
|----|-------------|-------------------------------|--------|--------|-------------------------------|
| 株式 | ユーロ<br>小計   | STMICROELECTRONICS NV         | 380    | 28.95  | 11,001.00                     |
|    |             |                               |        |        | 2,303,298.60<br>(291,597,602) |
|    |             | 銘柄数 :                         | 233    |        |                               |
|    |             | 組入時価比率 :                      | 10.4%  |        | 11.2%                         |
|    | イギリスポ<br>ンド | BP PLC                        | 11,299 | 2.69   | 30,479.05                     |
|    |             | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS   | 2,287  | 13.60  | 31,107.77                     |
|    |             | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS   | 2,050  | 13.09  | 26,842.70                     |
|    |             | ANGLO AMERICAN PLC            | 707    | 24.05  | 17,003.35                     |
|    |             | ANTOFAGASTA PLC               | 297    | 14.16  | 4,205.52                      |
|    |             | BHP GROUP PLC                 | 1,168  | 19.40  | 22,663.87                     |
|    |             | CRODA INTERNATIONAL PLC       | 72     | 64.04  | 4,610.88                      |
|    |             | EVRAZ PLC                     | 400    | 4.55   | 1,821.20                      |
|    |             | GLENCORE PLC                  | 5,731  | 2.35   | 13,522.29                     |
|    |             | JOHNSON MATTHEY PLC           | 108    | 24.10  | 2,602.80                      |
|    |             | MONDI PLC                     | 270    | 17.85  | 4,819.50                      |
|    |             | RIO TINTO PLC                 | 626    | 55.42  | 34,692.92                     |
|    |             | ASHTED GROUP PLC              | 254    | 33.48  | 8,503.92                      |
|    |             | BAE SYSTEMS PLC               | 1,779  | 5.04   | 8,966.16                      |
|    |             | BUNZL PLC                     | 187    | 24.79  | 4,635.73                      |
|    |             | DCC PLC                       | 55     | 54.98  | 3,023.90                      |
|    |             | FERGUSON PLC                  | 129    | 87.56  | 11,295.24                     |
|    |             | MELROSE INDUSTRIES PLC        | 1,896  | 1.63   | 3,090.48                      |
|    |             | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC      | 3,945  | 1.18   | 4,684.68                      |
|    |             | SMITHS GROUP PLC              | 221    | 15.88  | 3,509.48                      |
|    |             | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC  | 40     | 115.00 | 4,600.00                      |
|    |             | EXPERIAN PLC                  | 549    | 27.51  | 15,102.99                     |
|    |             | INTERTEK GROUP PLC            | 90     | 57.90  | 5,211.00                      |
|    |             | RELX PLC                      | 1,069  | 17.95  | 19,188.55                     |
|    |             | RENTOKIL INITIAL PLC          | 1,029  | 5.00   | 5,153.23                      |
|    |             | BARRATT DEVELOPMENTS PLC      | 567    | 6.05   | 3,433.75                      |
|    |             | BERKLEY GRP HOLDINGS          | 67     | 43.25  | 2,897.75                      |
|    |             | BURBERRY GROUP PLC            | 227    | 18.26  | 4,146.15                      |
|    |             | PERSIMMON PLC                 | 177    | 25.84  | 4,573.68                      |
|    |             | TAYLOR WIMPEY PLC             | 1,189  | 1.56   | 1,863.75                      |
|    |             | COMPASS GROUP PLC             | 1,054  | 14.49  | 15,272.46                     |
|    |             | ENTAIN PLC                    | 324    | 10.88  | 3,525.12                      |
|    |             | INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP | 96     | 46.79  | 4,491.84                      |
|    |             | WHITBREAD PLC                 | 123    | 31.05  | 3,819.15                      |
|    |             | AUTO TRADER GROUP PLC         | 540    | 5.74   | 3,099.60                      |
|    |             | INFORMA PLC                   | 836    | 5.54   | 4,634.78                      |
|    |             | PEARSON PLC                   | 407    | 6.62   | 2,695.15                      |
|    |             | WPP PLC                       | 702    | 7.83   | 5,502.27                      |
|    |             | JD SPORTS FASHION PLC         | 222    | 7.90   | 1,755.13                      |
|    |             | KINGFISHER PLC                | 1,174  | 2.70   | 3,170.97                      |
|    |             | NEXT PLC                      | 74     | 67.46  | 4,992.04                      |
|    |             | OCADO GROUP PLC               | 253    | 22.75  | 5,755.75                      |
|    |             | MORRISON(WM) SUPERMARKETS     | 1,422  | 1.80   | 2,568.84                      |
|    |             | SAINSBURY (J) PLC             | 996    | 2.26   | 2,250.96                      |
|    |             | TESCO PLC                     | 5,424  | 2.26   | 12,274.51                     |
|    |             | ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC  | 198    | 22.84  | 4,522.32                      |
|    |             | BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC  | 1,279  | 28.85  | 36,905.54                     |
|    |             | COCA-COLA HBC AG-CDI          | 140    | 23.32  | 3,264.80                      |
|    |             | DIAGEO PLC                    | 1,303  | 29.94  | 39,011.82                     |
|    |             | IMPERIAL BRANDS PLC           | 527    | 15.64  | 8,242.28                      |

| 種類                   | 通貨          | 銘柄                                   | 株数       | 評価額単価    | 評価額                         |
|----------------------|-------------|--------------------------------------|----------|----------|-----------------------------|
| 株式                   | イギリスポ<br>ンド | RECKITT BENCKISER GROUP PLC          | 392      | 65.44    | 25,652.48                   |
|                      |             | UNILEVER PLC                         | 652      | 43.63    | 28,446.76                   |
|                      |             | SMITH & NEPHEW PLC                   | 487      | 15.28    | 7,441.36                    |
|                      |             | ASTRAZENECA PLC                      | 733      | 76.92    | 56,382.36                   |
|                      |             | GLAXOSMITHKLINE PLC                  | 2,776    | 13.92    | 38,664.12                   |
|                      |             | HIKMA PHARMACEUTICALS PLC            | 82       | 25.16    | 2,063.12                    |
|                      |             | BARCLAYS PLC                         | 8,821    | 1.42     | 12,557.57                   |
|                      |             | HSBC HOLDINGS PLC                    | 11,358   | 4.03     | 45,818.17                   |
|                      |             | LLOYDS BANKING GROUP PLC             | 35,128   | 0.35     | 12,551.23                   |
|                      |             | NATWEST GROUP PLC                    | 1,915    | 1.57     | 3,022.82                    |
|                      |             | STANDARD CHARTERED PLC               | 1,512    | 4.74     | 7,177.46                    |
|                      |             | 3I GROUP PLC                         | 542      | 11.36    | 6,159.83                    |
|                      |             | HARGREAVES LANSDOWN PLC              | 162      | 14.44    | 2,340.09                    |
|                      |             | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC      | 175      | 87.10    | 15,242.50                   |
|                      |             | M&G PLC                              | 1,348    | 1.89     | 2,553.11                    |
|                      |             | SCHRODERS PLC                        | 96       | 32.10    | 3,081.60                    |
|                      |             | ST JAMES' S PLACE PLC                | 297      | 10.81    | 3,210.57                    |
|                      |             | STANDARD LIFE ABERDEEN PLC           | 1,633    | 2.78     | 4,547.90                    |
|                      |             | ADMIRAL GROUP PLC                    | 106      | 28.65    | 3,036.90                    |
|                      |             | AVIVA PLC                            | 2,180    | 3.20     | 6,982.54                    |
|                      |             | DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC      | 1,080    | 2.97     | 3,216.24                    |
|                      |             | LEGAL & GENERAL GROUP PLC            | 3,320    | 2.48     | 8,263.48                    |
|                      |             | PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC           | 209      | 7.07     | 1,478.46                    |
|                      |             | PRUDENTIAL PLC                       | 1,443    | 13.13    | 18,946.59                   |
|                      |             | RSA INSURANCE GROUP PLC              | 574      | 6.76     | 3,880.24                    |
|                      |             | AVEVA GROUP PLC                      | 71       | 31.70    | 2,250.70                    |
|                      |             | SAGE GROUP PLC/THE                   | 606      | 5.86     | 3,551.16                    |
|                      |             | HALMA PLC                            | 211      | 23.63    | 4,985.93                    |
|                      |             | BT GROUP PLC                         | 3,806    | 1.34     | 5,111.45                    |
|                      |             | VODAFONE GROUP PLC                   | 14,033   | 1.31     | 18,405.68                   |
|                      |             | NATIONAL GRID PLC                    | 2,071    | 8.80     | 18,241.36                   |
|                      |             | SEVERN TRENT PLC                     | 132      | 23.10    | 3,049.20                    |
|                      | SSE PLC     | 576                                  | 14.44    | 8,320.32 |                             |
| UNITED UTILITIES PLC | 380         | 9.31                                 | 3,540.84 |          |                             |
| 小計                   |             |                                      |          |          | 866,181.76<br>(120,338,631) |
|                      |             | 銘柄数 :                                | 84       |          |                             |
|                      |             | 組入時価比率 :                             | 4.3%     |          | 4.6%                        |
| 株式                   | スイスフラ<br>ン  | CLARIANT AG-REG                      | 146      | 17.96    | 2,622.89                    |
|                      |             | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG            | 3        | 821.00   | 2,463.00                    |
|                      |             | GIVAUDAN-REG                         | 5        | 3,632.00 | 18,160.00                   |
|                      |             | LAFARGEHOLCIM LTD-REG                | 310      | 46.47    | 14,405.70                   |
|                      |             | SIKA AG-REG                          | 80       | 230.90   | 18,472.00                   |
|                      |             | ABB LTD                              | 1,028    | 23.88    | 24,548.64                   |
|                      |             | GEBERIT AG-REG                       | 22       | 527.00   | 11,594.00                   |
|                      |             | SCHINDLER HOLDING AG-REG             | 13       | 242.40   | 3,151.20                    |
|                      |             | SCHINDLER HOLDING-PART CERT          | 18       | 247.00   | 4,446.00                    |
|                      |             | ADECCO GROUP AG-REG                  | 84       | 57.00    | 4,788.00                    |
|                      |             | SGS SA                               | 3        | 2,600.00 | 7,800.00                    |
|                      |             | KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG           | 25       | 199.55   | 4,988.75                    |
|                      |             | CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG WRT     | 604      | 0.20     | 120.80                      |
|                      |             | CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-(REGD) A | 302      | 77.34    | 23,356.68                   |
|                      |             | THE SWATCH GROUP AG-B                | 20       | 228.80   | 4,576.00                    |
|                      |             | BARRY CALLEBAUT AG-REG               | 1        | 2,030.00 | 2,030.00                    |
|                      |             | LINDT & SPRUENGLI AG                 | 1        | 8,305.00 | 8,305.00                    |

| 種類 | 通貨             | 銘柄                           | 株数    | 評価額単価    | 評価額                        |
|----|----------------|------------------------------|-------|----------|----------------------------|
| 株式 | スイスフラン         | NESTLE SA-REGISTERED         | 1,593 | 99.70    | 158,822.10                 |
|    |                | ALCON INC                    | 291   | 57.42    | 16,709.22                  |
|    |                | SONOVA HOLDING AG            | 27    | 222.20   | 5,999.40                   |
|    |                | STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 5     | 1,020.00 | 5,100.00                   |
|    |                | LONZA AG-REG                 | 39    | 552.40   | 21,543.60                  |
|    |                | NOVARTIS AG-REG SHS          | 1,238 | 81.26    | 100,599.88                 |
|    |                | ROCHE HOLDING AG-GENUSSS     | 390   | 304.25   | 118,657.50                 |
|    |                | VIFOR PHARMA AG REG          | 28    | 132.60   | 3,712.80                   |
|    |                | BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 18    | 94.80    | 1,706.40                   |
|    |                | CREDIT SUISSE GROUP-REG AG   | 1,391 | 11.12    | 15,467.92                  |
|    |                | JULIUS BAER GROUP LTD        | 125   | 49.44    | 6,180.00                   |
|    |                | PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 10    | 971.60   | 9,716.00                   |
|    |                | UBS GROUP AG                 | 1,973 | 12.43    | 24,534.25                  |
|    |                | BALOISE HOLDINGS AG          | 30    | 151.40   | 4,542.00                   |
|    |                | SWISS LIFE HOLDING AG        | 18    | 398.20   | 7,167.60                   |
|    |                | SWISS RE LTD                 | 172   | 80.58    | 13,859.76                  |
|    |                | ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 86    | 357.00   | 30,702.00                  |
|    |                | SWISS PRIME SITE AG          | 42    | 86.35    | 3,626.70                   |
|    |                | TEMENOS AG                   | 45    | 114.60   | 5,157.00                   |
|    |                | LOGITECH INTERNATIONAL-REG   | 95    | 79.54    | 7,556.30                   |
|    |                | SWISSCOM AG-REG              | 16    | 475.90   | 7,614.40                   |
| 小計 |                |                              |       |          | 724,803.49<br>(85,135,417) |
|    |                | 銘柄数 :                        | 38    |          |                            |
|    |                | 組入時価比率 :                     | 3.0%  |          | 3.3%                       |
| 株式 | スウェーデン<br>クローネ | LUNDIN ENERGY AB             | 120   | 224.70   | 26,964.00                  |
|    |                | BOLIDEN AB                   | 152   | 279.90   | 42,544.80                  |
|    |                | SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B   | 349   | 141.60   | 49,418.40                  |
|    |                | ALFA LAVAL AB                | 168   | 222.70   | 37,413.60                  |
|    |                | ASSA ABLOY AB-B              | 560   | 205.00   | 114,800.00                 |
|    |                | ATLAS COPCO AB-A SHS         | 376   | 427.70   | 160,815.20                 |
|    |                | ATLAS COPCO AB-B SHS         | 217   | 372.80   | 80,897.60                  |
|    |                | EPIROC AB-A                  | 367   | 148.45   | 54,481.15                  |
|    |                | EPIROC AB-B                  | 208   | 140.80   | 29,286.40                  |
|    |                | INVESTMENT AB LATOUR-B SHS   | 85    | 193.20   | 16,422.00                  |
|    |                | NIBE INDUSTRIER AB-B SHS     | 180   | 260.70   | 46,926.00                  |
|    |                | SANDVIK AB                   | 628   | 199.60   | 125,348.80                 |
|    |                | SKANSKA AB-B SHS             | 189   | 204.80   | 38,707.20                  |
|    |                | SKF AB-B SHS                 | 212   | 217.60   | 46,131.20                  |
|    |                | VOLVO AB-B SHS               | 829   | 192.30   | 159,416.70                 |
|    |                | SECURITAS AB-B SHS           | 174   | 135.20   | 23,524.80                  |
|    |                | ELECTROLUX AB-SER B          | 126   | 197.55   | 24,891.30                  |
|    |                | HUSQVARNA AB-B SHS           | 228   | 105.30   | 24,008.40                  |
|    |                | EVOLUTION GAMING GROUP       | 90    | 813.20   | 73,188.00                  |
|    |                | HENNES & MAURITZ             | 447   | 183.00   | 81,801.00                  |
|    |                | ICA GRUPPEN AB               | 50    | 411.20   | 20,560.00                  |
|    |                | SWEDISH MATCH AB             | 95    | 648.80   | 61,636.00                  |
|    |                | ESSITY AKTIEBOLAG-B          | 338   | 271.40   | 91,733.20                  |
|    |                | NORDEA BANK ABP              | 1,612 | 73.17    | 117,950.04                 |
|    |                | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 906   | 88.50    | 80,181.00                  |
|    |                | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 697   | 82.98    | 57,837.06                  |
|    |                | SWEDBANK AB                  | 504   | 155.96   | 78,603.84                  |
|    |                | EQT AB                       | 137   | 191.65   | 26,256.05                  |
|    |                | INDUSTRIVARDEN AB-A SHS      | 30    | 267.60   | 8,028.00                   |
|    |                | INDUSTRIVARDEN AB-C          | 93    | 260.30   | 24,207.90                  |

| 種類                          | 通貨                     | 銘柄                          | 株数         | 評価額単価                        | 評価額        |                              |
|-----------------------------|------------------------|-----------------------------|------------|------------------------------|------------|------------------------------|
| 株式                          | スウェーデン<br>クローネ         | INVESTOR AB                 | 254        | 587.20                       | 149,148.80 |                              |
|                             |                        | KINNEVIK AB-B SHS           | 135        | 390.95                       | 52,778.25  |                              |
|                             |                        | LUNDBERGS AB-B SHS          | 60         | 433.00                       | 25,980.00  |                              |
|                             |                        | FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS | 37         | 427.30                       | 15,810.10  |                              |
|                             |                        | ERICSSON LM TEL, SEK1 SER B | 1,566      | 99.38                        | 155,629.08 |                              |
|                             |                        | HEXAGON AB-B SHS            | 153        | 694.00                       | 106,182.00 |                              |
|                             |                        | TELE2 AB-B SHS              | 365        | 111.35                       | 40,642.75  |                              |
|                             |                        | TELIA CO AB                 | 1,033      | 34.58                        | 35,721.14  |                              |
|                             |                        | 小計                          |            |                              |            | 2,405,871.76<br>(29,856,868) |
|                             |                        |                             | 銘柄数 :      | 38                           |            |                              |
|                             |                        |                             | 組入時価比率 :   | 1.1%                         |            | 1.1%                         |
|                             | ノルウェー<br>クローネ          | EQUINOR ASA                 | 566        | 147.25                       | 83,343.50  |                              |
|                             |                        | NORSK HYDRO ASA             | 779        | 39.49                        | 30,762.71  |                              |
|                             |                        | YARA INTERNATIONAL ASA      | 77         | 348.40                       | 26,826.80  |                              |
|                             |                        | ADEVINTA ASA                | 158        | 133.20                       | 21,045.60  |                              |
|                             |                        | SCHIBSTED ASA-B SHS         | 64         | 294.20                       | 18,828.80  |                              |
|                             |                        | MOWI ASA                    | 249        | 178.35                       | 44,409.15  |                              |
|                             |                        | ORKLA ASA                   | 425        | 85.28                        | 36,244.00  |                              |
|                             |                        | DNB ASA                     | 536        | 162.30                       | 86,992.80  |                              |
|                             |                        | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA   | 113        | 184.30                       | 20,825.90  |                              |
|                             |                        | TELENOR ASA                 | 408        | 150.90                       | 61,567.20  |                              |
|                             |                        | 小計                          |            |                              |            | 430,846.46<br>(5,144,306)    |
|                             |                        |                             | 銘柄数 :      | 10                           |            |                              |
|                             |                        |                             | 組入時価比率 :   | 0.2%                         |            | 0.2%                         |
|                             | デンマーク<br>クローネ          | CHR HANSEN HOLDING A/S      | 60         | 610.80                       | 36,648.00  |                              |
|                             |                        | NOVOZYMES A/S-B SHARES      | 121        | 341.20                       | 41,285.20  |                              |
|                             |                        | VESTAS WIND SYSTEMS A/S     | 107        | 1,268.50                     | 135,729.50 |                              |
| A P MOLLER - MAERSK A/S     |                        | 4                           | 13,485.00  | 53,940.00                    |            |                              |
| A P MOLLER - MAERSK A/S - A |                        | 2                           | 12,670.00  | 25,340.00                    |            |                              |
| DSV PANALPINA A S           |                        | 124                         | 980.00     | 121,520.00                   |            |                              |
| PANDORA A/S                 |                        | 50                          | 618.40     | 30,920.00                    |            |                              |
| CARLSBERG AS-B              |                        | 58                          | 953.00     | 55,274.00                    |            |                              |
| AMBU A/S-B                  |                        | 96                          | 213.00     | 20,448.00                    |            |                              |
| COLOPLAST-B                 |                        | 63                          | 936.20     | 58,980.60                    |            |                              |
| DEMANT AS                   |                        | 45                          | 230.50     | 10,372.50                    |            |                              |
| GN STORE NORD A/S           |                        | 76                          | 493.50     | 37,506.00                    |            |                              |
| GENMAB A/S                  |                        | 39                          | 2,420.00   | 94,380.00                    |            |                              |
| NOVO NORDISK A/S-B          |                        | 960                         | 426.70     | 409,632.00                   |            |                              |
| DANSKE BANK A/S             |                        | 363                         | 101.05     | 36,681.15                    |            |                              |
| TRYG A/S                    |                        | 68                          | 182.20     | 12,389.60                    |            |                              |
| DONG ENERGY A/S             | 106                    | 1,076.00                    | 114,056.00 |                              |            |                              |
| 小計                          |                        |                             |            | 1,295,102.55<br>(22,029,694) |            |                              |
|                             |                        | 銘柄数 :                       | 17         |                              |            |                              |
|                             |                        | 組入時価比率 :                    | 0.8%       |                              | 0.8%       |                              |
| オーストラ<br>リアドル               | AMPOL LTD              | 141                         | 30.64      | 4,320.24                     |            |                              |
|                             | OIL SEARCH LTD         | 1,320                       | 3.75       | 4,950.00                     |            |                              |
|                             | ORIGIN ENERGY LIMITED  | 996                         | 5.05       | 5,029.80                     |            |                              |
|                             | SANTOS LIMITED         | 1,001                       | 6.57       | 6,576.57                     |            |                              |
|                             | WOODSIDE PETROLEUM LTD | 533                         | 23.19      | 12,360.27                    |            |                              |
|                             | BHP GROUP LIMITED      | 1,643                       | 42.74      | 70,221.82                    |            |                              |
|                             | BLUESCOPE STEEL LTD    | 288                         | 17.03      | 4,904.64                     |            |                              |
|                             | EVOLUTION MINING LTD   | 932                         | 4.80       | 4,473.60                     |            |                              |

| 種類 | 通貨         | 銘柄                              | 株数    | 評価額単価  | 評価額       |
|----|------------|---------------------------------|-------|--------|-----------|
| 株式 | オーストラリアドル  | FORTESCUE METALS GROUP LIMITED  | 975   | 22.16  | 21,606.00 |
|    |            | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI | 250   | 37.26  | 9,315.00  |
|    |            | NEWCREST MINING LIMITED         | 446   | 26.81  | 11,957.26 |
|    |            | NORTHERN STAR RESOURCES LTD     | 426   | 12.17  | 5,184.42  |
|    |            | ORICA LIMITED                   | 229   | 15.56  | 3,563.24  |
|    |            | RIO TINTO LIMITED               | 210   | 113.94 | 23,927.40 |
|    |            | SOUTH32 LTD                     | 1,955 | 2.60   | 5,083.00  |
|    |            | BRAMBLES LIMITED                | 879   | 10.57  | 9,291.03  |
|    |            | AURIZON HOLDINGS LTD            | 1,110 | 4.18   | 4,639.80  |
|    |            | QANTAS AIRWAYS LIMITED          | 616   | 5.07   | 3,123.12  |
|    |            | SYDNEY AIRPORT                  | 626   | 6.59   | 4,125.34  |
|    |            | TRANSURBAN GROUP                | 1,546 | 13.75  | 21,257.50 |
|    |            | ARISTOCRAT LEISURE LIMITED      | 325   | 30.01  | 9,753.25  |
|    |            | TABCORP HOLDINGS LIMITED        | 1,145 | 3.95   | 4,522.75  |
|    |            | REA GROUP LTD                   | 30    | 143.74 | 4,312.20  |
|    |            | SEEK LTD                        | 189   | 26.69  | 5,044.41  |
|    |            | WESFARMERS LIMITED              | 632   | 50.94  | 32,194.08 |
|    |            | COLES GROUP LIMITED             | 754   | 18.18  | 13,707.72 |
|    |            | WOOLWORTHS GROUP LTD            | 704   | 39.17  | 27,575.68 |
|    |            | COCA-COLA AMATIL LIMITED        | 275   | 12.79  | 3,517.25  |
|    |            | TREASURY WINE ESTATES LTD       | 407   | 9.39   | 3,821.73  |
|    |            | COCHLEAR LTD                    | 29    | 195.72 | 5,675.88  |
|    |            | RAMSAY HEALTH CARE LTD          | 101   | 63.00  | 6,363.00  |
|    |            | SONIC HEALTHCARE LTD            | 255   | 32.54  | 8,297.70  |
|    |            | CSL LIMITED                     | 249   | 286.50 | 71,338.50 |
|    |            | AUST AND NZ BANKING GROUP LT    | 1,582 | 23.18  | 36,670.76 |
|    |            | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA  | 987   | 83.92  | 82,829.04 |
|    |            | NATIONAL AUSTRALIA BANK & LTD   | 1,783 | 23.55  | 41,989.65 |
|    |            | WESTPAC BANKING CORPORATION     | 2,014 | 20.03  | 40,340.42 |
|    |            | AMP LIMITED                     | 2,350 | 1.74   | 4,100.75  |
|    |            | ASX LIMITED                     | 109   | 75.06  | 8,181.54  |
|    |            | MACQUARIE GROUP LIMITED         | 190   | 137.80 | 26,182.00 |
|    |            | MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD    | 72    | 54.83  | 3,947.76  |
|    |            | INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD   | 1,307 | 5.12   | 6,691.84  |
|    |            | MEDIBANK PRIVATE LTD            | 1,468 | 2.87   | 4,213.16  |
|    |            | QBE INSURANCE GROUP LIMITED     | 823   | 9.86   | 8,114.78  |
|    |            | SUNCORP GROUP LTD               | 713   | 10.16  | 7,244.08  |
|    |            | LENLEASE GROUP                  | 374   | 13.61  | 5,090.14  |
|    |            | AFTERPAY LTD                    | 123   | 109.93 | 13,521.39 |
|    |            | COMPUTERSHARE LIMITED           | 275   | 14.35  | 3,946.25  |
|    |            | WISETECH GLOBAL LTD             | 84    | 30.46  | 2,558.64  |
|    |            | XERO LTD                        | 58    | 143.94 | 8,348.52  |
|    |            | TELSTRA CORPORATION LTD         | 2,354 | 3.03   | 7,132.62  |
|    |            | AGL ENERGY LTD                  | 365   | 13.51  | 4,931.15  |
|    |            | APA GROUP                       | 667   | 10.25  | 6,836.75  |
|    |            | AUSNET SERVICES                 | 1,000 | 1.84   | 1,845.00  |
|    |            | 小計                              |       |        |           |
|    |            | 銘柄数 :                           | 54    |        |           |
|    |            | 組入時価比率 :                        | 2.1%  |        | 2.3%      |
|    | ニュージーランドドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD       | 727   | 7.95   | 5,779.65  |
|    |            | A2 MILK CO LTD                  | 410   | 14.06  | 5,764.60  |
|    |            | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C    | 318   | 32.07  | 10,198.26 |
|    |            | RYMAN HEALTHCARE LTD            | 223   | 15.00  | 3,345.00  |



| 種類 | 通貨         | 銘柄                                 | 株数    | 評価額単価  | 評価額                      |
|----|------------|------------------------------------|-------|--------|--------------------------|
| 株式 | ニュージーランドドル | SPARK NEW ZEALAND LIMITED          | 1,022 | 4.50   | 4,604.11                 |
|    |            | MERCURY NZ LTD                     | 487   | 6.25   | 3,043.75                 |
|    |            | MERIDIAN ENERGY LTD                | 713   | 6.53   | 4,655.89                 |
|    | 小計         |                                    |       |        | 37,391.26<br>(2,757,605) |
|    |            | 銘柄数 :                              | 7     |        |                          |
|    |            | 組入時価比率 :                           | 0.1%  |        | 0.1%                     |
| 株式 | 香港ドル       | CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED      | 1,536 | 55.05  | 84,556.80                |
|    |            | TECHTRONIC INDUSTRIES CO           | 1,000 | 103.50 | 103,500.00               |
|    |            | XINYI GLASS HOLDINGS LTD           | 500   | 18.76  | 9,380.00                 |
|    |            | MTR CORPORATION                    | 800   | 42.55  | 34,040.00                |
|    |            | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD     | 1,000 | 60.65  | 60,650.00                |
|    |            | SANDS CHINA LTD                    | 1,500 | 34.45  | 51,675.00                |
|    |            | WYNN MACAU LTD                     | 900   | 13.64  | 12,276.00                |
|    |            | BUDWEISER BREWING CO APAC LT       | 1,300 | 26.65  | 34,645.00                |
|    |            | WH GROUP LTD                       | 4,200 | 6.50   | 27,300.00                |
|    |            | BANK OF EAST ASIA                  | 800   | 17.02  | 13,616.00                |
|    |            | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD         | 2,000 | 24.65  | 49,300.00                |
|    |            | HANG SENG BANK                     | 400   | 136.90 | 54,760.00                |
|    |            | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR        | 700   | 387.80 | 271,460.00               |
|    |            | AIA GROUP LTD                      | 6,800 | 90.00  | 612,000.00               |
|    |            | CK ASSET HOLDINGS LTD              | 1,636 | 42.95  | 70,266.20                |
|    |            | ESR CAYMAN LTD                     | 500   | 23.95  | 11,975.00                |
|    |            | HANG LUNG PROPERTIES LTD           | 1,500 | 19.84  | 29,760.00                |
|    |            | HENDERSON LAND DEVELOPMENT         | 565   | 31.15  | 17,599.75                |
|    |            | NEW WORLD DEVELOPMENT              | 1,018 | 37.00  | 37,666.00                |
|    |            | SINO LAND CO                       | 1,860 | 10.68  | 19,864.80                |
|    |            | SUN HUNG KAI PROPERTIES            | 900   | 105.30 | 94,770.00                |
|    |            | SWIRE PACIFIC LTD 'A'              | 100   | 44.90  | 4,490.00                 |
|    |            | SWIRE PROPERTIES LTD               | 800   | 23.35  | 18,680.00                |
|    |            | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT       | 800   | 40.05  | 32,040.00                |
|    |            | HKT TRUST AND HKD LTD              | 2,400 | 10.32  | 24,768.00                |
|    |            | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED | 300   | 39.80  | 11,940.00                |
|    |            | CLP HOLDINGS LIMITED               | 900   | 70.85  | 63,765.00                |
|    |            | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS        | 1,000 | 7.71   | 7,710.00                 |
|    |            | HONG KONG & CHINA GAS              | 5,882 | 11.72  | 68,937.04                |
|    |            | POWER ASSETS HOLDINGS LTD          | 500   | 40.90  | 20,450.00                |
|    |            | ASM PACIFIC TECHNOLOGY             | 200   | 98.55  | 19,710.00                |
|    |            |                                    | 小計    |        |                          |
|    |            | 銘柄数 :                              | 31    |        |                          |
|    |            | 組入時価比率 :                           | 0.9%  |        | 1.0%                     |
| 株式 | シンガポールドル   | KEPPEL CORP                        | 800   | 5.29   | 4,232.00                 |
|    |            | SINGAPORE TECH ENGINEERING         | 900   | 3.87   | 3,483.00                 |
|    |            | SINGAPORE AIRLINES LTD             | 800   | 4.42   | 3,536.00                 |
|    |            | GENTING SINGAPORE LTD              | 3,400 | 0.85   | 2,890.00                 |
|    |            | WILMAR INTERNATIONAL LIMITED       | 1,100 | 4.23   | 4,653.00                 |
|    |            | DBS GROUP HLDG LTD                 | 1,000 | 25.45  | 25,450.00                |
|    |            | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP       | 1,894 | 10.13  | 19,186.22                |
|    |            | UNITED OVERSEAS BANK               | 700   | 22.92  | 16,044.00                |
|    |            | SINGAPORE EXCHANGE                 | 500   | 9.35   | 4,675.00                 |
|    |            | CAPITALAND LIMITED                 | 1,500 | 3.27   | 4,905.00                 |
|    |            | CITY DEVELOPMENTS                  | 300   | 7.97   | 2,391.00                 |
|    |            | UOL GROUP LTD                      | 300   | 7.71   | 2,313.00                 |
|    |            | VENTURE CORP LTD                   | 200   | 18.95  | 3,790.00                 |

| 種類 | 通貨                  | 銘柄                           | 株数    | 評価額単価  | 評価額       |
|----|---------------------|------------------------------|-------|--------|-----------|
| 株式 | シンガポール<br>ドル<br>小計  | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 4,620 | 2.35   | 10,857.00 |
|    |                     | 銘柄数：                         | 14    |        |           |
|    |                     | 組入時価比率：                      | 0.3%  |        | 0.3%      |
| 株式 | イスラエル<br>シユケル<br>小計 | ISRAEL CHEMICALS LTD         | 396   | 15.41  | 6,102.36  |
|    |                     | ELBIT SYSTEMS LTD            | 13    | 390.20 | 5,072.60  |
|    |                     | BANK HAPOALIM BM             | 642   | 22.39  | 14,374.38 |
|    |                     | BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 829   | 19.60  | 16,248.40 |
|    |                     | ISRAEL DISCOUNT BANK         | 932   | 12.13  | 11,305.16 |
|    |                     | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     | 122   | 71.00  | 8,662.00  |
|    |                     | NICE LTD                     | 35    | 796.80 | 27,888.00 |
|    |                     | 銘柄数：                         | 7     |        |           |
|    |                     | 組入時価比率：                      | 0.1%  |        | 0.1%      |
|    |                     | 合計                           |       |        |           |

(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

(2020年12月15日現在)

| 種類   | 通貨          | 銘柄                                       | 銘柄数比率 | 口数  | 評価額                   |
|------|-------------|--|-------|-----|-----------------------|
| 投資証券 | アメリカドル      | AGNC INVESTMENT CORPORATION              |       | 300 | 4,590.00              |
|      |             | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT             |       | 75  | 12,962.25             |
|      |             | AMERICAN TOWER CORP                      |       | 240 | 52,012.80             |
|      |             | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC            |       | 570 | 4,696.80              |
|      |             | AVALONBAY COMMUNITIES INC                |       | 77  | 12,294.59             |
|      |             | BOSTON PROPERTIES INC                    |       | 80  | 7,880.00              |
|      |             | CAMDEN PROPERTY TRUST                    |       | 50  | 4,825.00              |
|      |             | CROWN CASTLE INTL CORP                   |       | 245 | 38,021.55             |
|      |             | DIGITAL REALTY TRUST INC                 |       | 150 | 19,213.50             |
|      |             | DUKE REALTY CORP                         |       | 200 | 7,742.00              |
|      |             | EQUINIX INC                              |       | 47  | 32,431.41             |
|      |             | Equity LifeStyle Properties Inc          |       | 110 | 6,707.80              |
|      |             | EQUITY RESIDENTIAL PROPS TR              |       | 220 | 12,738.00             |
|      |             | ESSEX PROPERTY TRUST INC                 |       | 40  | 9,610.40              |
|      |             | EXTRA SPACE STORAGE INC                  |       | 70  | 7,691.60              |
|      |             | HEALTHPEAK PROPERTIES INC                |       | 300 | 8,664.00              |
|      |             | HOST HOTELS & RESORTS INC                |       | 396 | 5,555.88              |
|      |             | INVITATION HOMES INC                     |       | 300 | 8,634.00              |
|      |             | IRON MOUNTAIN INCORPORATED               |       | 183 | 5,356.41              |
|      |             | iShares Core S&P 500 ETF                 |       | 450 | 163,957.50            |
|      |             | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC             |       | 275 | 5,720.00              |
|      |             | MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES<br>INC |       | 60  | 7,286.40              |
|      |             | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS               |       | 110 | 4,123.90              |
|      |             | PROLOGIS INC                             |       | 413 | 40,007.31             |
|      |             | PUBLIC STORAGE                           |       | 90  | 20,136.60             |
|      |             | REALTY INCOME CORPORATION                |       | 190 | 11,517.80             |
|      |             | REGENCY CENTERS CORPORATION              |       | 100 | 4,688.00              |
|      |             | SBA COMMUNICATIONS CORP                  |       | 60  | 16,450.20             |
|      |             | SIMON PROPERTY GROUP INC                 |       | 186 | 16,241.52             |
|      |             | SUN COMMUNITIES INC                      |       | 50  | 7,161.00              |
|      |             | UDR INC                                  |       | 160 | 6,014.40              |
|      |             | VENTAS INC                               |       | 220 | 10,524.80             |
|      |             | VEREIT INC                               |       | 369 | 2,771.19              |
|      |             | VICI PROPERTIES INC                      |       | 310 | 7,867.80              |
|      |             | VORNADO REALTY TRUST                     |       | 106 | 4,036.48              |
|      |             | WELLTOWER INC                            |       | 220 | 13,912.80             |
|      |             | WEYERHAEUSER CO                          |       | 420 | 13,591.20             |
|      |             | WP CAREY INC                             |       | 100 | 6,916.00              |
|      | 小計          |  |       |     | 7,542                 |
|      |             | 銘柄数 :                                    | 38    |     |                       |
|      |             | 組入時価比率 :                                 | 2.3%  |     | 86.8%                 |
|      | カナダドル<br>小計 | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA             |       | 50  | 2,538.00              |
|      |             |  |       | 50  | 2,538.00<br>(207,202) |
|      |             | 銘柄数 :                                    | 1     |     |                       |
|      |             | 組入時価比率 :                                 | 0.0%  |     | 0.3%                  |

| 種類   | 通貨        | 銘柄                                     | 銘柄数比率 | 口数     | 評価額          |
|------|-----------|--|-------|--------|--------------|
| 投資証券 | ユーロ       | COVIVIO                                |       | 40     | 3,008.00     |
|      |           | GECINA SA                              |       | 20     | 2,520.00     |
|      |           | KLEPIERRE                              |       | 110    | 2,042.70     |
|      |           | UNIBAIL RODAMCO WESTFIELD              |       | 77     | 4,686.22     |
|      | 小計        |  |       | 247    | 12,256.92    |
|      |           | 銘柄数 :                                  | 4     |        | (1,551,726)  |
|      |           | 組入時価比率 :                               | 0.1%  |        | 2.1%         |
|      | イギリスポンド   | BRITISH LAND COMPANY PLC               |       | 490    | 2,362.78     |
|      |           | LAND SECURITIES GROUP                  |       | 392    | 2,736.16     |
|      |           | SEGRE PLC                              |       | 747    | 6,788.73     |
|      | 小計        |  |       | 1,629  | 11,887.67    |
|      |           | 銘柄数 :                                  | 3     |        | (1,651,553)  |
|      |           | 組入時価比率 :                               | 0.1%  |        | 2.2%         |
|      | オーストラリアドル | DEXUS                                  |       | 620    | 6,094.60     |
|      |           | GOODMAN GROUP                          |       | 918    | 16,340.40    |
|      |           | GPT GROUP                              |       | 1,135  | 5,379.90     |
|      |           | MIRVAC GROUP                           |       | 2,341  | 6,390.93     |
|      |           | SCENTRE GROUP                          |       | 3,153  | 8,796.87     |
|      |           | STOCKLAND                              |       | 1,348  | 5,971.64     |
|      |           | VICINITY CENTRES                       |       | 1,920  | 3,225.60     |
|      | 小計        |  |       | 11,435 | 52,199.94    |
|      |           | 銘柄数 :                                  | 7     |        | (4,097,173)  |
|      |           | 組入時価比率 :                               | 0.1%  |        | 5.5%         |
|      | 香港ドル      | LINK REIT                              |       | 1,200  | 83,040.00    |
|      |           |  |       | 1,200  | 83,040.00    |
|      | 小計        |  |       |        | (1,115,227)  |
|      |           | 銘柄数 :                                  | 1     |        |              |
|      |           | 組入時価比率 :                               | 0.0%  |        | 1.5%         |
|      | シンガポールドル  | ASCENDAS REAL ESTATE                   |       | 1,600  | 4,752.00     |
|      |           | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST |       | 3,214  | 6,942.24     |
|      |           | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST             |       | 1,000  | 2,110.00     |
|      |           | MAPLETREE LOGISTICS TRUST              |       | 1,500  | 2,895.00     |
|      | 小計        |  |       | 7,314  | 16,699.24    |
|      |           | 銘柄数 :                                  | 4     |        | (1,304,210)  |
|      |           | 組入時価比率 :                               | 0.0%  |        | 1.7%         |
|      | 合計        |  |       |        | 74,955,537   |
|      |           |  |       |        | (74,955,537) |

(注1) 通貨種類毎の小計欄の ( ) 内は、邦貨換算額であります。

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表 (デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

「PRU海外債券マザーファンド」の状況  
 なお、以下に掲載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

| 区 分         | 注記<br>番号 | (2020年12月15日現在) |
|-------------|----------|-----------------|
|             |          | 金 額             |
| 資産の部        |          |                 |
| 流動資産        |          |                 |
| 預金          |          | 379             |
| 金銭信託        |          | 71,930          |
| コール・ローン     |          | 24,826,285      |
| 国債証券        |          | 5,024,678,017   |
| 派生商品評価勘定    |          | 4,522,177       |
| 未収入金        |          | 77,784          |
| 未収利息        |          | 36,573,266      |
| 前払費用        |          | 280,434         |
| 流動資産合計      |          | 5,091,030,272   |
| 資産合計        |          | 5,091,030,272   |
| 負債の部        |          |                 |
| 流動負債        |          |                 |
| 派生商品評価勘定    |          | 5,434,631       |
| 未払金         |          | 906,810         |
| 未払解約金       |          | 2,600,103       |
| 未払利息        |          | 68              |
| 流動負債合計      |          | 8,941,612       |
| 負債合計        |          | 8,941,612       |
| 純資産の部       |          |                 |
| 元本等         |          |                 |
| 元本          | ※1       | 2,046,234,851   |
| 剰余金         |          |                 |
| 剰余金又は欠損金(△) |          | 3,035,853,809   |
| 元本等合計       |          | 5,082,088,660   |
| 純資産合計       |          | 5,082,088,660   |
| 負債純資産合計     |          | 5,091,030,272   |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

(2020年12月15日現在)

|    |  |                |
|----|--|----------------|
| ※1 | 1. 本報告書における開示対象ファンドの<br>期首における当該親投資信託の元本額        | 2,173,843,634円 |
|    | 同期中における追加設定元本額                                   | 162,714,092円   |
|    | 同期中における解約元本額                                     | 290,322,875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                              | 1,814,283,147円 |
|    | PRUグッドライフ2030 (年金)                               | 110,719,100円   |
|    | PRUグッドライフ2040 (年金)                               | 57,944,808円    |
|    | PRUグッドライフ2050 (年金)                               | 4,532,713円     |
|    | プルデンシャル私募海外債券マーケット・パ<br>フォーマー (適格機関投資家向け)        | 58,755,083円    |
|    | 計  | 2,046,234,851円 |
|    | 2. 本報告書における開示対象ファンドの<br>期末における当該親投資信託の受益権の<br>総数 | 2,046,234,851口 |

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

| 項目                       | 自 2019年12月17日<br>至 2020年12月15日   |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を投資信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。   |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じて価格変動リスクや為替変動リスク等があります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | コンプライアンス部では、運用状況のモニタリング、運用に関する法令諸規則の遵守状況の確認を行っております。<br>また、リスク管理部では、運用に関するリスク管理を行っております。   |



## II 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | (2020年12月15日現在)   |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。   |
| 2. 時価の算定方法                 | <p>① 有価証券<br/>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>② デリバティブ取引等<br/>「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。</p> <p>③ 上記以外の金融商品<br/>短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価格のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。   |

(有価証券に関する注記)

(2020年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

| 種類   | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
|------|-----------------|
| 国債証券 | 32,897,926      |
| 合計   | 32,897,926      |

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況  
通貨関連

(単位：円)

| 種類         | (2020年12月15日現在) |       |             |            |
|------------|-----------------|-------|-------------|------------|
|            | 契約額等            | うち1年超 | 時価          | 評価損益       |
| 市場取引以外の取引  |                 |       |             |            |
| 為替予約取引     |                 |       |             |            |
| 買建         |                 |       |             |            |
| アメリカドル     | 195,229,223     | —     | 194,031,303 | △1,197,920 |
| カナダドル      | 42,476,219      | —     | 43,276,391  | 800,172    |
| メキシコペソ     | 13,540,247      | —     | 13,872,076  | 331,829    |
| ユーロ        | 48,052,353      | —     | 48,754,143  | 701,790    |
| イギリスポンド    | 45,215,321      | —     | 45,899,110  | 683,789    |
| スウェーデンクローネ | 2,763,805       | —     | 2,851,160   | 87,355     |
| オーストラリアドル  | 4,709,509       | —     | 4,901,536   | 192,027    |
| 売建         |                 |       |             |            |
| アメリカドル     | 178,683,505     | —     | 177,218,013 | 1,465,492  |
| カナダドル      | 6,610,768       | —     | 6,866,614   | △255,846   |
| メキシコペソ     | 6,460,999       | —     | 6,374,191   | 86,808     |
| ユーロ        | 54,959,807      | —     | 56,124,424  | △1,164,617 |
| イギリスポンド    | 24,029,326      | —     | 24,672,477  | △643,151   |
| スウェーデンクローネ | 1,390,003       | —     | 1,471,838   | △81,835    |
| ノルウェークローネ  | 3,078,224       | —     | 3,204,469   | △126,245   |
| デンマーククローネ  | 9,134,958       | —     | 9,304,427   | △169,469   |
| ポーランドズロチ   | 16,721,026      | —     | 17,111,029  | △390,003   |
| オーストラリアドル  | 24,048,507      | —     | 25,241,758  | △1,193,251 |
| イスラエルシェケル  | 2,220,313       | —     | 2,262,821   | △42,508    |
| 合計         | 679,324,113     | —     | 683,437,780 | △915,583   |

(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. 契約額等及び時価の合計欄の金額は各々の合計金額であります。
3. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

(単位：アメリカドル)

| 種類  | (2020年12月15日現在)            |          |                            |                  |
|---|----------------------------|----------|----------------------------|------------------|
|   | 契約額等                       | うち1年超    | 時価                         | 評価損益             |
| 市場取引以外の取引<br>直物為替先渡取引<br>売建<br>マレーシアリングット | 305,327.51<br>(31,790,700) | —<br>(—) | 305,297.46<br>(31,787,571) | 30.05<br>(3,129) |
| 合計<br>(邦貨換算額)                             | 305,327.51<br>(31,790,700) | —<br>(—) | 305,297.46<br>(31,787,571) | 30.05<br>(3,129) |

(注) 時価の算定方法

1. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額により評価しております。
2. ( ) 内の金額は邦貨換算額であります。  
邦貨換算額は計算期間末日の対顧客相場の仲値で換算しております。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| (2020年12月15日現在)                          |          |
|--|----------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 | 2,4836円  |
| (1万口当たり純資産額)                             | 24,836円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

① 株式 (2020年12月15日現在)  
該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券  
(2020年12月15日現在)

| 種類              | 通貨     | 銘柄              | 銘柄数<br>比率  | 券面総額         | 評価額          |
|-----------------|--------|-----------------|------------|--------------|--------------|
| 国債証券            | アメリカドル | US TREASURY N/B |            | 575,000.00   | 582,187.50   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 375,000.00   | 381,181.50   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 1,130,000.00 | 1,149,598.72 |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 890,000.00   | 908,843.08   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 610,000.00   | 625,368.95   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 325,000.00   | 334,458.15   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 335,000.00   | 346,018.48   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 285,000.00   | 295,453.80   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 110,000.00   | 113,806.99   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 400,000.00   | 431,172.00   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 1,335,000.00 | 1,439,661.33 |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 2,260,000.00 | 2,435,855.12 |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 290,000.00   | 318,886.61   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 915,000.00   | 988,057.26   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 165,000.00   | 177,781.06   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 350,000.00   | 382,224.50   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 195,000.00   | 207,378.01   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 155,000.00   | 165,044.77   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 145,000.00   | 196,197.47   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 250,000.00   | 268,759.75   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 190,000.00   | 201,407.41   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 90,000.00    | 99,527.31    |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 640,000.00   | 884,000.00   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 275,000.00   | 270,875.00   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 390,000.00   | 453,710.01   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 520,000.00   | 702,934.44   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 210,000.00   | 285,673.92   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 310,000.00   | 356,269.98   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 170,000.00   | 166,440.54   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 295,000.00   | 288,039.77   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 140,000.00   | 213,702.30   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 10,000.00    | 15,102.73    |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 195,000.00   | 193,446.04   |
|                 |        | US TREASURY N/B |            | 325,000.00   | 521,891.50   |
| US TREASURY N/B |        | 200,000.00      | 263,461.00 |              |              |
| US TREASURY N/B |        | 250,000.00      | 317,295.00 |              |              |
| US TREASURY N/B |        | 90,000.00       | 127,620.72 |              |              |
| US TREASURY N/B |        | 360,000.00      | 494,170.20 |              |              |
| US TREASURY N/B |        | 410,000.00      | 490,526.46 |              |              |
| US TREASURY N/B |        | 540,000.00      | 702,907.20 |              |              |
| US TREASURY N/B |        | 270,000.00      | 344,745.72 |              |              |
| US TREASURY N/B |        | 115,000.00      | 137,901.21 |              |              |
| US TREASURY N/B |        | 625,000.00      | 801,513.75 |              |              |
| US TREASURY N/B |        | 30,000.00       | 37,794.15  |              |              |
| US TREASURY N/B |        | 190,000.00      | 207,062.95 |              |              |

| 種類               | 通貨  | 銘柄  | 銘柄数<br>比率   | 券面総額   | 評価額   |
|------------------|---|---|-------------|--|---|
| 国債証券             | アメリカドル<br>小計  | US TREASURY N/B   |             | 65,000.00  | 59,139.86   |
|                  |   |   |             | 18,000,000.00  | 20,385,094.22<br>(2,122,496,010)  |
|                  |   | 銘柄数：<br>組入時価比率：   | 46<br>41.8% |  | 42.2%   |
|                  | カナダドル<br><br>小計   | CANADIAN GOVERNMENT<br>CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>CANADIAN GOVERNMENT BOND |             | 265,000.00<br>10,000.00<br>25,000.00<br>85,000.00<br>160,000.00<br>20,000.00<br>565,000.00   | 417,666.50<br>10,368.20<br>25,087.75<br>84,069.25<br>244,452.80<br>29,858.20<br>811,502.70<br>(66,251,080)  |
|                  | 銘柄数：<br>組入時価比率：   | 6<br>1.3%   |             | 1.3%   |   |
| メキシコペソ<br><br>小計 | MEXICAN BONOS<br>MEXICAN BONOS<br>MEXICAN BONOS<br>MEXICAN BONOS  |   |             | 1,080,000.00   | 1,090,283.12  |
|                  |   |   |             | 2,500,000.00   | 2,818,025.00  |
|                  |   |   |             | 1,000,000.00   | 1,380,420.00  |
|                  |   |   |             | 1,330,000.00   | 1,492,792.00  |
|                  | 小計  |   |             | 5,910,000.00   | 6,781,520.12<br>(34,924,828)  |
|                  | 銘柄数：<br>組入時価比率：   | 4<br>0.7%   |             | 0.7%   |   |
| ユーロ              | AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>BONOS Y OBLIG DEL ESTADO<br>BONOS Y OBLIG DEL ESTADO<br>BUNDESobligation<br>BUNDESREPUB DEUTSCHLAND<br>BUNDESREPUB DEUTSCHLAND<br>BUNDESREPUB DEUTSCHLAND<br>BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA<br>BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA<br>BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA<br>BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA<br>BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA<br>BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA<br>BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLA<br>BUONI POLIENNALI DEL TES<br>FINLAND GOVERNMENT BOND<br>FINLAND GOVERNMENT BOND<br>FINLAND GOVERNMENT BOND<br>FINLAND GOVERNMENT BOND<br>FINLAND GOVERNMENT BOND<br>FRANCE GOVERNMENT BOND O<br>FRANCE GOVERNMENT BOND O<br>FRANCE GOVERNMENT BOND O<br>FRANCE GOVERNMENT BOND O<br>FRANCE GOVERNMENT BOND O<br>FRANCE GOVERNMENT BOND O<br>FRANCE O. A. T.<br>FRANCE O. A. T. |   |             | 10,000.00<br>90,000.00<br>115,000.00<br>45,000.00<br>225,000.00<br>115,000.00<br>65,000.00<br>15,000.00<br>285,000.00<br>260,000.00<br>170,000.00<br>174,000.00<br>35,000.00<br>270,000.00<br>465,000.00<br>260,000.00<br>190,000.00<br>345,000.00<br>60,000.00<br>50,000.00<br>425,000.00<br>90,000.00<br>195,000.00<br>20,000.00<br>35,000.00<br>10,000.00<br>70,000.00<br>55,000.00<br>335,000.00<br>260,000.00<br>215,000.00<br>160,000.00<br>645,000.00<br>390,000.00 | 10,718.96<br>155,102.85<br>122,066.75<br>48,157.42<br>246,233.92<br>210,961.29<br>111,163.78<br>22,579.62<br>471,478.35<br>262,663.18<br>207,330.64<br>285,536.78<br>61,172.79<br>292,387.86<br>505,241.10<br>372,036.08<br>201,808.88<br>626,225.37<br>104,571.56<br>53,269.65<br>706,476.65<br>91,250.82<br>207,801.36<br>20,887.88<br>41,684.47<br>16,059.91<br>70,214.69<br>58,014.00<br>411,583.68<br>276,865.16<br>372,341.30<br>248,358.08<br>787,246.01<br>676,902.33 |

| 種類                    | 通貨  | 銘柄                       | 銘柄数<br>比率  | 券面総額       | 評価額        |
|-----------------------|-----|--------------------------|------------|------------|------------|
| 国債証券                  | ユーロ | FRENCH REPUBLIC GOVERNME |            | 85,000.00  | 87,608.68  |
|                       |     | FRENCH REPUBLIC GOVERNME |            | 50,000.00  | 52,690.80  |
|                       |     | FRENCH REPUBLIC GOVERNME |            | 95,000.00  | 105,106.86 |
|                       |     | FRENCH REPUBLIC GOVERNME |            | 265,000.00 | 327,377.82 |
|                       |     | FRENCH REPUBLIC GOVERNME |            | 55,000.00  | 60,451.71  |
|                       |     | FRENCH REPUBLIC GOVERNME |            | 45,000.00  | 57,724.74  |
|                       |     | FRENCH REPUBLIC GOVERNME |            | 70,000.00  | 72,652.09  |
|                       |     | FRENCH REPUBLIC GOVERNME |            | 30,000.00  | 35,942.31  |
|                       |     | FRENCH REPUBLIC GOVERNME |            | 210,000.00 | 251,477.39 |
|                       |     | FRENCH REPUBLIC GOVERNME |            | 105,000.00 | 182,835.24 |
|                       |     | FRENCH REPUBLIC GOVERNME |            | 60,000.00  | 88,192.32  |
|                       |     | IRELAND GOVERNMENT BOND  |            | 50,000.00  | 55,264.56  |
|                       |     | IRELAND GOVERNMENT BOND  |            | 45,000.00  | 56,743.76  |
|                       |     | IRELAND GOVERNMENT BOND  |            | 25,000.00  | 27,220.06  |
|                       |     | IRELAND GOVERNMENT BOND  |            | 135,000.00 | 149,081.04 |
|                       |     | IRELAND GOVERNMENT BOND  |            | 5,000.00   | 5,952.22   |
|                       |     | IRELAND GOVERNMENT BOND  |            | 20,000.00  | 25,705.96  |
|                       |     | IRELAND GOVERNMENT BOND  |            | 35,000.00  | 50,334.76  |
|                       |     | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 385,000.00 | 388,499.26 |
|                       |     | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 335,000.00 | 357,294.61 |
|                       |     | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 45,000.00  | 49,673.25  |
|                       |     | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 330,000.00 | 407,929.50 |
|                       |     | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 95,000.00  | 103,348.12 |
|                       |     | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 75,000.00  | 106,706.64 |
|                       |     | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 80,000.00  | 89,928.00  |
|                       |     | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 315,000.00 | 450,075.00 |
|                       |     | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 330,000.00 | 345,296.48 |
|                       |     | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 10,000.00  | 15,400.30  |
|                       |     | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 30,000.00  | 40,148.92  |
|                       |     | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 85,000.00  | 145,382.64 |
|                       |     | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 5,000.00   | 6,498.12   |
|                       |     | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 140,000.00 | 206,507.70 |
|                       |     | ITALY BUONI POLIENNALI D |            | 20,000.00  | 26,860.36  |
|                       |     | KINGDOM OF BELGIUM GOVER |            | 40,000.00  | 44,212.92  |
|                       |     | KINGDOM OF BELGIUM GOVER |            | 135,000.00 | 154,691.10 |
|                       |     | NETHERLANDS GOVERNMENT B |            | 115,000.00 | 135,052.55 |
|                       |     | NETHERLANDS GOVERNMENT B |            | 260,000.00 | 278,153.20 |
|                       |     | NETHERLANDS GOVERNMENT B |            | 10,000.00  | 11,085.53  |
|                       |     | NETHERLANDS GOVERNMENT B |            | 100,000.00 | 105,269.70 |
|                       |     | NETHERLANDS GOVERNMENT B |            | 90,000.00  | 169,462.89 |
|                       |     | NETHERLANDS GOVERNMENT B |            | 40,000.00  | 72,244.84  |
|                       |     | REPUBLIC OF AUSTRIA GOVE |            | 10,000.00  | 23,056.98  |
|                       |     | REPUBLIC OF AUSTRIA GOVE |            | 65,000.00  | 70,554.44  |
|                       |     | REPUBLIC OF AUSTRIA GOVE |            | 110,000.00 | 118,247.14 |
|                       |     | REPUBLIC OF AUSTRIA GOVE |            | 40,000.00  | 54,777.28  |
|                       |     | REPUBLIC OF AUSTRIA GOVE |            | 30,000.00  | 53,251.24  |
|                       |     | REPUBLIC OF AUSTRIA GOVE |            | 35,000.00  | 48,965.21  |
|                       |     | REPUBLIC OF ITALY GOVERN |            | 535,000.00 | 634,848.65 |
|                       |     | SPAIN GOVERNMENT BOND    |            | 45,000.00  | 45,041.62  |
|                       |     | SPAIN GOVERNMENT BOND    |            | 230,000.00 | 264,366.87 |
|                       |     | SPAIN GOVERNMENT BOND    |            | 25,000.00  | 28,241.74  |
| SPAIN GOVERNMENT BOND |     | 360,000.00               | 447,024.63 |            |            |
| SPAIN GOVERNMENT BOND |     | 110,000.00               | 149,606.82 |            |            |
| SPAIN GOVERNMENT BOND |     | 110,000.00               | 156,679.71 |            |            |
| SPAIN GOVERNMENT BOND |     | 50,000.00                | 59,614.85  |            |            |
| SPAIN GOVERNMENT BOND |     | 215,000.00               | 241,542.10 |            |            |
| SPAIN GOVERNMENT BOND |     | 35,000.00                | 44,450.88  |            |            |

| 種類                      | 通貨                       | 銘柄                    | 銘柄数<br>比率 | 券面総額          | 評価額                              |            |
|-------------------------|--------------------------|-----------------------|-----------|---------------|----------------------------------|------------|
| 国債証券                    | ユーロ                      | SPAIN GOVERNMENT BOND |           | 120,000.00    | 216,838.78                       |            |
|                         |                          | SPAIN GOVERNMENT BOND |           | 30,000.00     | 59,774.69                        |            |
|                         |                          | SPAIN GOVERNMENT BOND |           | 30,000.00     | 45,443.15                        |            |
|                         |                          | SPAIN GOVERNMENT BOND |           | 60,000.00     | 110,720.40                       |            |
|                         | 小計                       |                       |           | 12,849,000.00 | 16,631,524.30<br>(2,105,550,976) |            |
|                         |                          | 銘柄数 :                 | 95        |               |                                  |            |
|                         |                          | 組入時価比率 :              | 41.4%     |               | 41.9%                            |            |
|                         | イギリスポンド                  | UNITED KINGDOM GILT   |           |               | 110,000.00                       | 110,198.06 |
|                         |                          | UNITED KINGDOM GILT   |           |               | 35,000.00                        | 35,779.38  |
|                         |                          | UNITED KINGDOM GILT   |           |               | 235,000.00                       | 236,621.87 |
| UNITED KINGDOM GILT     |                          |                       |           | 10,000.00     | 10,863.76                        |            |
| UNITED KINGDOM GILT     |                          |                       |           | 30,000.00     | 35,464.85                        |            |
| UNITED KINGDOM GILT     |                          |                       |           | 15,000.00     | 24,597.00                        |            |
| UNITED KINGDOM GILT     |                          |                       |           | 200,000.00    | 334,039.84                       |            |
| UNITED KINGDOM GILT     |                          |                       |           | 10,000.00     | 17,723.79                        |            |
| UNITED KINGDOM GILT     |                          |                       |           | 15,000.00     | 22,996.82                        |            |
| UNITED KINGDOM GILT     |                          |                       |           | 220,000.00    | 353,453.98                       |            |
| UNITED KINGDOM GILT     |                          |                       |           | 170,000.00    | 310,192.20                       |            |
| UNITED KINGDOM GILT     |                          |                       |           | 10,000.00     | 11,780.21                        |            |
| UNITED KINGDOM GILT     |                          |                       |           | 330,000.00    | 413,203.56                       |            |
| UNITED KINGDOM GILT     |                          |                       |           | 15,000.00     | 32,564.31                        |            |
| UNITED KINGDOM TREASURY |                          |                       |           | 230,000.00    | 331,640.45                       |            |
| 小計                      |                          |                       |           | 1,635,000.00  | 2,281,120.08<br>(316,916,012)    |            |
|                         | 銘柄数 :                    | 15                    |           |               |                                  |            |
|                         | 組入時価比率 :                 | 6.2%                  |           | 6.3%          |                                  |            |
| スウェーデンクローネ              | SWEDEN GOVERNMENT BOND   |                       |           | 630,000.00    | 711,190.87                       |            |
|                         | SWEDEN GOVERNMENT BOND   |                       |           | 110,000.00    | 118,108.56                       |            |
|                         | SWEDEN GOVERNMENT BOND   |                       |           | 195,000.00    | 308,736.36                       |            |
|                         | 小計                       |                       |           | 935,000.00    | 1,138,035.79<br>(14,123,024)     |            |
|                         | 銘柄数 :                    | 3                     |           |               |                                  |            |
|                         | 組入時価比率 :                 | 0.3%                  |           | 0.3%          |                                  |            |
| ノルウェークローネ               | NORWAY GOVERNMENT BOND   |                       |           | 410,000.00    | 427,266.90                       |            |
|                         | NORWAY GOVERNMENT BOND   |                       |           | 415,000.00    | 450,329.78                       |            |
|                         | NORWAY GOVERNMENT BOND   |                       |           | 380,000.00    | 398,355.52                       |            |
|                         | 小計                       |                       |           | 1,205,000.00  | 1,275,952.20<br>(15,234,869)     |            |
|                         | 銘柄数 :                    | 3                     |           |               |                                  |            |
|                         | 組入時価比率 :                 | 0.3%                  |           | 0.3%          |                                  |            |
| デンマーククローネ               | DENMARK GOVERNMENT BOND  |                       |           | 150,000.00    | 159,625.95                       |            |
|                         | DENMARK GOVERNMENT BOND  |                       |           | 1,210,000.00  | 1,355,161.76                     |            |
|                         | DENMARK GOVERNMENT BOND  |                       |           | 285,879.00    | 551,115.59                       |            |
|                         | 小計                       |                       |           | 1,645,879.00  | 2,065,903.30<br>(35,141,015)     |            |
|                         | 銘柄数 :                    | 3                     |           |               |                                  |            |
|                         | 組入時価比率 :                 | 0.7%                  |           | 0.7%          |                                  |            |
| ポーランドズロチ                | POLAND GOVERNMENT BOND   |                       |           | 660,000.00    | 667,125.99                       |            |
|                         | POLAND GOVERNMENT BOND   |                       |           | 140,000.00    | 155,757.00                       |            |
|                         | POLAND GOVERNMENT BOND   |                       |           | 855,000.00    | 963,812.70                       |            |
|                         | 小計                       |                       |           | 1,655,000.00  | 1,786,695.69<br>(50,974,428)     |            |
|                         | 銘柄数 :                    | 3                     |           |               |                                  |            |
|                         | 組入時価比率 :                 | 1.0%                  |           | 1.0%          |                                  |            |
| オーストラリアドル               | AUSTRALIA GOVERNMENT BON |                       |           | 360,000.00    | 405,501.16                       |            |

| 種類   | 通貨         | 銘柄                       | 銘柄数<br>比率 | 券面総額         | 評価額                              |                              |      |
|------|------------|--------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|------------------------------|------|
| 国債証券 | オーストラリアドル  | AUSTRALIA GOVERNMENT BON |           | 175,000.00   | 197,565.82                       |                              |      |
|      |            | AUSTRALIA GOVERNMENT BON |           | 490,000.00   | 590,360.82                       |                              |      |
|      |            | AUSTRALIA GOVERNMENT BON |           | 395,000.00   | 473,860.74                       |                              |      |
|      |            | AUSTRALIA GOVERNMENT BON |           | 125,000.00   | 145,394.27                       |                              |      |
|      |            | AUSTRALIA GOVERNMENT BON |           | 70,000.00    | 93,523.63                        |                              |      |
|      | 小計         | AUSTRALIA GOVERNMENT BON |           | 35,000.00    | 44,266.89                        |                              |      |
|      |            | AUSTRALIA GOVERNMENT BON |           | 45,000.00    | 55,541.90                        |                              |      |
|      |            | AUSTRALIA GOVERNMENT BON |           | 20,000.00    | 19,077.16                        |                              |      |
|      |            |                          |           | 1,715,000.00 | 2,025,092.39<br>(158,949,501)    |                              |      |
|      |            | 銘柄数 :                    | 9         |              |                                  |                              |      |
|      |            | 組入時価比率 :                 | 3.1%      |              | 3.2%                             |                              |      |
|      | シンガポールドル   | SINGAPORE GOVERNMENT BON |           | 100,000.00   | 109,450.00                       |                              |      |
|      |            | SINGAPORE GOVERNMENT BON |           | 135,000.00   | 159,495.75                       |                              |      |
|      |            | SINGAPORE GOVERNMENT BON |           | 20,000.00    | 23,209.00                        |                              |      |
|      |            |                          | 小計        |              | 255,000.00                       | 292,154.75<br>(22,817,285)   |      |
|      |            |                          |           | 銘柄数 :        | 3                                |                              |      |
|      |            | 組入時価比率 :                 | 0.4%      |              | 0.5%                             |                              |      |
|      | マレーシアリンギット | MALAYSIA GOVERNMENT BOND |           | 1,955,000.00 | 2,021,770.07                     |                              |      |
|      |            | MALAYSIA GOVERNMENT BOND |           | 185,000.00   | 196,794.14                       |                              |      |
|      |            |                          | 小計        |              | 2,140,000.00                     | 2,218,564.21<br>(56,906,171) |      |
|      |            |                          |           | 銘柄数 :        | 2                                |                              |      |
|      |            |                          |           | 組入時価比率 :     | 1.1%                             |                              | 1.1% |
|      | イスラエルシェケル  | ISRAEL GOVERNMENT BOND - |           | 425,000.00   | 441,128.75                       |                              |      |
|      |            | ISRAEL GOVERNMENT BOND - |           | 110,000.00   | 123,579.50                       |                              |      |
|      |            | ISRAEL GOVERNMENT BOND - |           | 115,000.00   | 198,760.25                       |                              |      |
|      |            |                          | 小計        |              | 650,000.00                       | 763,468.50<br>(24,392,818)   |      |
|      |            |                          |           | 銘柄数 :        | 3                                |                              |      |
|      |            | 組入時価比率 :                 | 0.5%      |              | 0.5%                             |                              |      |
|      | 合計         |                          |           |              | 5,024,678,017<br>(5,024,678,017) |                              |      |

(注1) 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。



## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

2021年1月29日現在

|                      |                |
|----------------------|----------------|
| I 資産総額               | 2,507,409,753円 |
| II 負債総額              | 1,901,830円     |
| III 純資産総額 (I-II)     | 2,505,507,923円 |
| IV 発行済数量             | 1,247,346,694口 |
| V 1口当たり純資産額 (III/IV) | 2.0087円        |

(参考情報)

#### PRU国内株式マザーファンド

|                      |                |
|----------------------|----------------|
| I 資産総額               | 3,185,406,374円 |
| II 負債総額              | 1,751,889円     |
| III 純資産総額 (I-II)     | 3,183,654,485円 |
| IV 発行済数量             | 1,540,022,872口 |
| V 1口当たり純資産額 (III/IV) | 2.0673円        |

#### PRU国内債券マザーファンド

|                      |                |
|----------------------|----------------|
| I 資産総額               | 4,633,912,683円 |
| II 負債総額              | 31,428,191円    |
| III 純資産総額 (I-II)     | 4,602,484,492円 |
| IV 発行済数量             | 3,389,947,065口 |
| V 1口当たり純資産額 (III/IV) | 1.3577円        |

#### PRU海外株式マザーファンド

|                      |                |
|----------------------|----------------|
| I 資産総額               | 2,911,701,730円 |
| II 負債総額              | 15,779,431円    |
| III 純資産総額 (I-II)     | 2,895,922,299円 |
| IV 発行済数量             | 889,950,234口   |
| V 1口当たり純資産額 (III/IV) | 3.2540円        |

PRU海外債券マザーファンド

|                        |                |
|------------------------|----------------|
| I 資産総額                 | 5,096,883,689円 |
| II 負債総額                | 3,224,653円     |
| III 純資産総額 (I - II)     | 5,093,659,036円 |
| IV 発行済数量               | 2,059,949,826口 |
| V 1口当たり純資産額 (III / IV) | 2.4727円        |

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

(1) 名義書換等

該当事項はありません。

(2) 受益者名簿の閉鎖の時期

受益者名簿は作成しません。したがって、該当事項はありません。

(3) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(4) 譲渡制限

該当事項はありません。ただし、受益権の譲渡等は以下によるものとします。

①受益権の譲渡

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

②受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益証券の再発行

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

2021年1月末現在の資本金の額：219百万円

会社が発行する株式総数：30,000株

発行済株式総数：7,360株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2) 委託会社等の機構

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

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

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

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

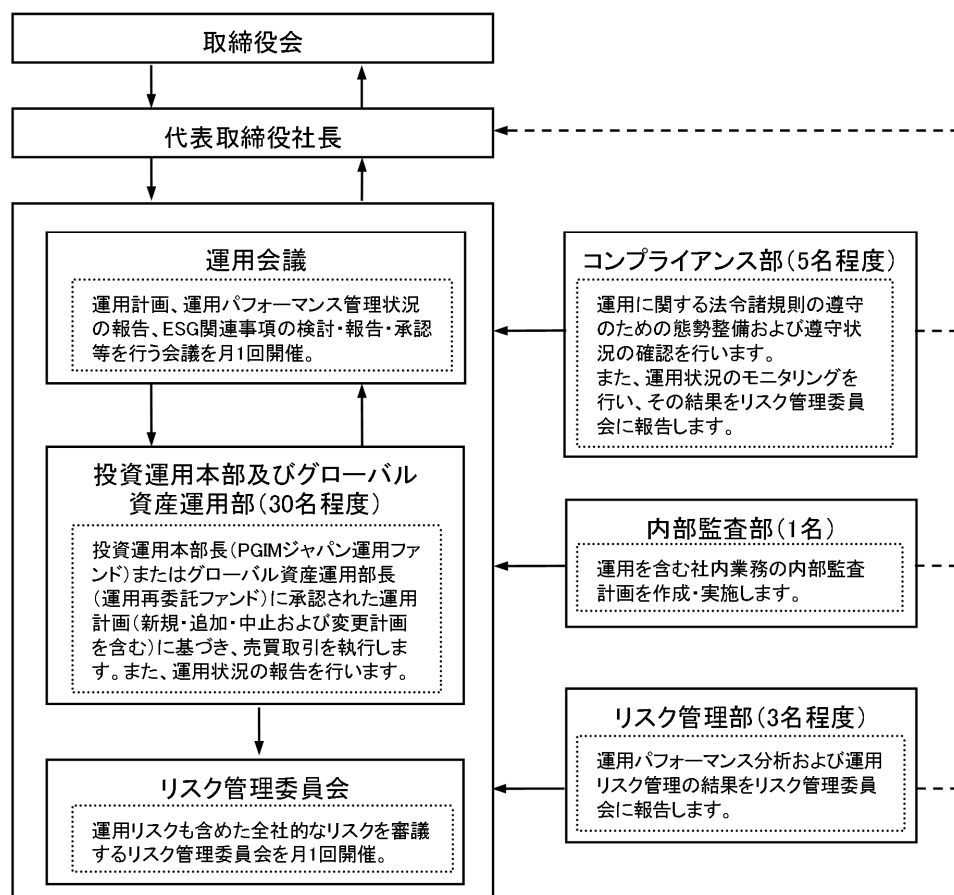
取締役会を招集するには、各取締役及び監査役に対し、会日の少なくとも1週間前に招集通知を發します。ただし、取締役及び監査役全員の同意を得て、招集期間を短縮しまたは招集手続を省略することができます。法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会は代表取締役の1名が招集し、議長となります。代表取締役のいずれにも事故ある場合には、予め取締役会の決議によって定められた順序に従って他の取締役がこの任にあたります。

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

##### ①委託会社の運用体制



②委託会社の内部管理および意思決定を監督する組織等



※前記の運用体制等は2021年1月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託会社は、1875年に設立された米プルデンシャル保険を中核とする大手総合金融グループの一員です。グループ全体の運用資産は約173兆円（16.481億米ドル、円換算レート1米ドル＝105.530円、2020年9月末現在）にのぼります。グループの運用部門は、ポートフォリオ・マネジャーとアナリストを世界に配し、グローバルな運用を行っています。

なお、2021年1月末現在、委託会社が運用を行っている証券投資信託（親投資信託は除きます。）は29本、純資産総額の合計金額は約4兆1,854億円です。以下はその種類別の内訳です。

|            |     |
|------------|-----|
| 追加型株式投資信託  | 25本 |
| 単位型株式投資信託  | 4本  |
| 追加型公社債投資信託 | 0本  |
| 単位型公社債投資信託 | 0本  |

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期事業年度（2019年4月1日から2020年3月31日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。


# 独立監査人の監査報告書

2020年6月12日

PGIMジャパン株式会社  
取締役会 御中

## PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所  
指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士

奈良昌彦 

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士

久保直毅 

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているPGIMジャパン株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第14期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、PGIMジャパン株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。



- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

|          | 第13期<br>(2019年3月31日) | 第14期<br>(2020年3月31日) |
|----------|----------------------|----------------------|
| (資産の部)   |                      |                      |
| 流動資産     |                      |                      |
| 現金及び預金   | 1,673,222            | 2,150,439            |
| 前払費用     | 42,256               | 55,229               |
| 立替金      | 6,003                | 2,580                |
| 未収委託者報酬  | 138,816              | 152,977              |
| 未収運用受託報酬 | 3,316,008            | 2,958,539            |
| 未収収益     | 34,565               | 32,297               |
| 流動資産計    | 5,210,872            | 5,352,063            |
| 固定資産     |                      |                      |
| 有形固定資産   | 86,301               | 306,161              |
| 建物附属設備   | * 1 58,392           | 207,977              |
| 器具備品     | * 1 27,909           | 98,184               |
| 無形固定資産   | 131,401              | 107,512              |
| ソフトウェア   | 131,401              | 107,512              |
| 投資その他の資産 | 447,187              | 407,399              |
| 長期差入保証金  | 9,972                | 9,972                |
| 繰延税金資産   | 437,214              | 397,427              |
| 固定資産計    | 664,890              | 821,073              |
| 資産合計     | 5,875,763            | 6,173,137            |

(単位：千円)

|           | 第13期<br>(2019年3月31日) | 第14期<br>(2020年3月31日) |
|-----------|----------------------|----------------------|
| (負債の部)    |                      |                      |
| 流動負債      |                      |                      |
| 未払金       | 99,113               | 85,439               |
| 未払手数料     | 14,572               | 15,433               |
| その他未払金    | 84,540               | 70,005               |
| 未払費用      | 2,096,913            | 2,194,693            |
| 未払法人税等    | 384,949              | 337,029              |
| 未払消費税等    | 63,270               | 76,765               |
| 預り金       | 46,876               | 32,901               |
| 賞与引当金     | 138,616              | 145,651              |
| 役員賞与引当金   | 14,389               | 23,140               |
| その他流動負債   | 124                  | 768                  |
| 流動負債計     | 2,844,254            | 2,896,390            |
| 固定負債      |                      |                      |
| 長期末払費用    | 150,266              | 129,943              |
| 退職給付引当金   | 769,248              | 748,447              |
| 役員退職慰労引当金 | 79,973               | 91,533               |
| 資産除去債務    | 73,931               | 73,931               |
| 固定負債計     | 1,073,420            | 1,043,856            |
| 負債合計      | 3,917,674            | 3,940,246            |

(単位：千円)

|          | 第13期<br>(2019年3月31日) | 第14期<br>(2020年3月31日) |
|----------|----------------------|----------------------|
| (純資産の部)  |                      |                      |
| 株主資本     |                      |                      |
| 資本金      | 219,000              | 219,000              |
| 資本剰余金    | 149,000              | 149,000              |
| 資本準備金    | 149,000              | 149,000              |
| 利益剰余金    | 1,590,088            | 1,864,891            |
| 利益準備金    | 54,750               | 54,750               |
| その他利益剰余金 | 1,535,338            | 1,810,141            |
| 繰越利益剰余金  | 1,535,338            | 1,810,141            |
| 株主資本合計   | 1,958,088            | 2,232,891            |
| 純資産合計    | 1,958,088            | 2,232,891            |
| 負債・純資産合計 | 5,875,763            | 6,173,137            |

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

|         | 第13期<br>(自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31日) | 第14期<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) |
|---------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益    |                                       |                                       |
| 委託者報酬   | 1,563,194                             | 1,798,567                             |
| 運用受託報酬  | 10,295,270                            | 10,200,962                            |
| その他営業収益 | 113,409                               | 130,229                               |
| 営業収益計   | 11,971,874                            | 12,129,759                            |
| 営業費用    |                                       |                                       |
| 支払手数料   | 68,489                                | 70,155                                |
| 広告宣伝費   | 4,836                                 | 15,181                                |
| 調査費     | 6,435,190                             | 6,366,577                             |
| 調査費     | 331,720                               | 361,172                               |
| 委託調査費   | 6,102,568                             | 6,004,490                             |
| 図書費     | 901                                   | 914                                   |
| 営業雑経費   | 33,967                                | 38,969                                |
| 通信費     | 10,306                                | 10,163                                |
| 印刷費     | 6,047                                 | 6,401                                 |
| 協会費     | 16,541                                | 20,457                                |
| 諸会費     | 1,071                                 | 1,945                                 |
| 営業費用計   | 6,542,483                             | 6,490,883                             |

(単位：千円)

|             | 第13期<br>(自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31日) | 第14期<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) |
|-------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 一般管理費       |                                       |                                       |
| 給料          | 2,040,745                             | 2,132,816                             |
| 役員報酬        | 44,950                                | 51,432                                |
| 給料・手当       | 1,346,499                             | 1,350,437                             |
| 賞与          | 449,740                               | 519,984                               |
| 賞与引当金繰入     | 138,616                               | 145,651                               |
| 役員賞与        | 46,547                                | 42,170                                |
| 役員賞与引当金繰入   | 14,389                                | 23,140                                |
| 福利厚生費       | 252,240                               | 237,548                               |
| 交際費         | 7,022                                 | 4,827                                 |
| 旅費交通費       | 73,502                                | 83,219                                |
| 水道光熱費       | 7,327                                 | 7,119                                 |
| 租税公課        | 54,570                                | 53,831                                |
| 不動産賃借料      | 171,513                               | 179,516                               |
| 退職給付費用      | 304,414                               | 228,471                               |
| 役員退職慰労引当金繰入 | 15,587                                | 12,962                                |
| 募集費         | 44,385                                | 62,247                                |
| 固定資産減価償却費   | 72,110                                | 93,852                                |
| 業務委託費       | 358,092                               | 410,952                               |
| 専門家報酬       | 35,156                                | 25,295                                |
| 消耗器具備品費     | 8,558                                 | 33,548                                |
| 修繕維持費       | 3,621                                 | 801                                   |
| 諸経費         | 37,384                                | 35,850                                |
| 一般管理費計      | 3,486,234                             | 3,602,860                             |

(単位：千円)

|              | 第13期<br>(自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31日) | 第14期<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業利益         | 1,943,156                             | 2,036,015                             |
| 営業外収益        |                                       |                                       |
| 受取利息         | 1,467                                 | 899                                   |
| 為替差益         | 11,917                                | —                                     |
| 営業外収益計       | 13,384                                | 899                                   |
| 営業外費用        |                                       |                                       |
| 為替差損         | —                                     | 5,605                                 |
| 営業外費用計       | —                                     | 5,605                                 |
| 経常利益         | 1,956,541                             | 2,031,309                             |
| 特別損失         |                                       |                                       |
| 固定資産除却損      | —                                     | 514                                   |
| 特別損失計        | —                                     | 514                                   |
| 税引前当期純利益     | 1,956,541                             | 2,030,794                             |
| 法人税、住民税及び事業税 | 739,416                               | 612,204                               |
| 法人税等調整額      | △102,748                              | 39,787                                |
| 当期純利益        | 1,319,873                             | 1,378,802                             |

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第13期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)

(単位：千円)

|         | 株主資本    |         |         |        |            |            |            | 純資産合計      |
|---------|---------|---------|---------|--------|------------|------------|------------|------------|
|         | 資本金     | 資本剰余金   |         | 利益準備金  | 利益剰余金      |            | 株主資本合計     |            |
|         |         | 資本準備金   | 資本剰余金合計 |        | その他利益剰余金   | 利益剰余金合計    |            |            |
| 当期首残高   | 219,000 | 149,000 | 149,000 | 54,750 | 2,055,464  | 2,110,214  | 2,478,214  | 2,478,214  |
| 当期変動額   |         |         |         |        |            |            |            |            |
| 剰余金の配当  | -       | -       | -       | -      | △1,840,000 | △1,840,000 | △1,840,000 | △1,840,000 |
| 当期純利益   | -       | -       | -       | -      | 1,319,873  | 1,319,873  | 1,319,873  | 1,319,873  |
| 当期変動額合計 | -       | -       | -       | -      | △520,126   | △520,126   | △520,126   | △520,126   |
| 当期末残高   | 219,000 | 149,000 | 149,000 | 54,750 | 1,535,338  | 1,590,088  | 1,958,088  | 1,958,088  |

第14期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)

(単位：千円)

|         | 株主資本    |         |         |        |            |            |            | 純資産合計      |
|---------|---------|---------|---------|--------|------------|------------|------------|------------|
|         | 資本金     | 資本剰余金   |         | 利益準備金  | 利益剰余金      |            | 株主資本合計     |            |
|         |         | 資本準備金   | 資本剰余金合計 |        | その他利益剰余金   | 利益剰余金合計    |            |            |
| 当期首残高   | 219,000 | 149,000 | 149,000 | 54,750 | 1,535,338  | 1,590,088  | 1,958,088  | 1,958,088  |
| 当期変動額   |         |         |         |        |            |            |            |            |
| 剰余金の配当  | -       | -       | -       | -      | △1,104,000 | △1,104,000 | △1,104,000 | △1,104,000 |
| 当期純利益   | -       | -       | -       | -      | 1,378,802  | 1,378,802  | 1,378,802  | 1,378,802  |
| 当期変動額合計 | -       | -       | -       | -      | 274,802    | 274,802    | 274,802    | 274,802    |
| 当期末残高   | 219,000 | 149,000 | 149,000 | 54,750 | 1,810,141  | 1,864,891  | 2,232,891  | 2,232,891  |



注記事項

(重要な会計方針)

|                                   |   |
|-----------------------------------|---|
| <p>1. 固定資産の減価償却の方法</p>            | <p>(1) 有形固定資産（リース資産を除く）<br/>定率法を採用しております。ただし、2017年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。<br/>なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。<br/>建物附属設備 8～38年<br/>器具備品 5～20年</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く）<br/>定額法を採用しております。<br/>なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づいております。</p>   |
| <p>2. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準</p>   | <p>外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>   |
| <p>3. 引当金の計上基準</p>                | <p>(1) 賞与引当金<br/>従業員に対して支給する賞与の支出に備えて、賞与支給見込額の当会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金<br/>役員に対して支給する賞与の支出に備えて、当事業年度における支給見込額の当会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金<br/>従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。<br/>なお、当社は従業員数300人未満の企業に該当することから、簡便法を適用し、退職一時金制度について退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法によっております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金<br/>役員に対して支給する退職慰労金の支出に備えて、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p> |
| <p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> | <p>消費税等の会計処理<br/>消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。</p>  |

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 平成30年3月30日)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日)

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(貸借対照表関係)

| 第13期<br>(2019年3月31日) |         | 第14期<br>(2020年3月31日) |     |         |           |
|----------------------|---------|----------------------|-----|---------|-----------|
| * 1                  | 減価償却累計額 | 230,297千円            | * 1 | 減価償却累計額 | 250,302千円 |
|                      | 有形固定資産  |                      |     | 有形固定資産  |           |
|                      | 建物附属設備  | 149,192千円            |     | 建物附属設備  | 163,602千円 |
|                      | 器具備品    | 81,104千円             |     | 器具備品    | 86,699千円  |

(株主資本等変動計算書関係)

| 第13期<br>(自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31日) |         |         |         |        |
|---------------------------------------|---------|---------|---------|--------|
| 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項                 |         |         |         |        |
| 株式の種類                                 | 当事業年度期首 | 当事業年度増加 | 当事業年度減少 | 当事業年度末 |
|                                       | (株)     | (株)     | (株)     | (株)    |
| 普通株式                                  | 7,360   | —       | —       | 7,360  |

| 2. 配当に関する事項         |       |                |                      |                |                 |
|---------------------|-------|----------------|----------------------|----------------|-----------------|
| 決議                  | 株式の種類 | 配当金の総額<br>(千円) | 1株当たり<br>配当額<br>(千円) | 基準日            | 効力発生日           |
| 2018年6月26日<br>取締役会  | 普通株式  | 1,472,000      | 200                  | 2018年<br>3月31日 | 2018年<br>6月27日  |
| 2018年12月19日<br>取締役会 | 普通株式  | 368,000        | 50                   | 2018年<br>9月30日 | 2018年<br>12月19日 |

| 第14期<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) |         |         |         |        |
|---------------------------------------|---------|---------|---------|--------|
| 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項                 |         |         |         |        |
| 株式の種類                                 | 当事業年度期首 | 当事業年度増加 | 当事業年度減少 | 当事業年度末 |
|                                       | (株)     | (株)     | (株)     | (株)    |
| 普通株式                                  | 7,360   | —       | —       | 7,360  |

| 2. 配当に関する事項         |       |                |                      |                |                 |
|---------------------|-------|----------------|----------------------|----------------|-----------------|
| 決議                  | 株式の種類 | 配当金の総額<br>(千円) | 1株当たり<br>配当額<br>(千円) | 基準日            | 効力発生日           |
| 2019年6月18日<br>取締役会  | 普通株式  | 736,000        | 100                  | 2019年<br>3月31日 | 2019年<br>6月18日  |
| 2019年12月17日<br>取締役会 | 普通株式  | 368,000        | 50                   | 2019年<br>9月30日 | 2019年<br>12月17日 |

## (金融商品関係)

| 第13期<br>(自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31日)   | 第14期<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日)   |                  |            |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |   |  |                  |            |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |
|---|---|------------------|------------|------------|------------|-----------|-----------|---|--------------|-----------|-----------|---|-----|-----------|-----------|---|----------|-----------|-----------|---|-----|-----------|-----------|---|---|--|------------------|------------|------------|------------|-----------|-----------|---|--------------|-----------|-----------|---|-----|-----------|-----------|---|----------|-----------|-----------|---|-----|-----------|-----------|---|
| <p>1. 金融商品の状況に関する事項</p> <p>(1) 金融商品に対する取組方針</p> <p>当社は主として国内の機関投資家を顧客とする投資一任業務を行っております。財務体質を毀損させようおそれのある投機的な金融商品取引を行わないこととしております。</p> <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制</p> <p>現金及び預金並びに営業債権である未収運用受託報酬は、預入先金融機関および顧客の信用リスクに晒されております。また、それらのうち外貨建てのものは為替の変動リスクに晒されております。</p> <p>営業債務である未払費用のうち外貨建てのものは為替の変動リスクに晒されております。</p> <p>顧客の信用リスクについては、顧客からの預り資産残高の推移等に基づいてモニターしております。</p> <p>外貨建債権・債務については、その残高および為替相場の変動による影響を定期的にモニターしております。</p> <p>2. 金融商品の時価等に関する事項</p> <p>2019年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。</p>                               | <p>1. 金融商品の状況に関する事項</p> <p>(1) 金融商品に対する取組方針</p> <p>当社は主として国内の機関投資家を顧客とする投資一任業務を行っております。財務体質を毀損させようおそれのある投機的な金融商品取引を行わないこととしております。</p> <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制</p> <p>現金及び預金並びに営業債権である未収運用受託報酬は、預入先金融機関および顧客の信用リスクに晒されております。また、それらのうち外貨建てのものは為替の変動リスクに晒されております。</p> <p>営業債務である未払費用のうち外貨建てのものは為替の変動リスクに晒されております。</p> <p>顧客の信用リスクについては、顧客からの預り資産残高の推移等に基づいてモニターしております。</p> <p>外貨建債権・債務については、その残高および為替相場の変動による影響を定期的にモニターしております。</p> <p>2. 金融商品の時価等に関する事項</p> <p>2020年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。</p> |                  |            |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |   |  |                  |            |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |
| <table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>貸借対照表計上額<br/>(千円)</th> <th>時価<br/>(千円)</th> <th>差額<br/>(千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>(1) 現金及び預金</td> <td>1,673,222</td> <td>1,673,222</td> <td>—</td> </tr> <tr> <td>(2) 未収運用受託報酬</td> <td>3,316,008</td> <td>3,316,008</td> <td>—</td> </tr> <tr> <td>資産計</td> <td>4,989,231</td> <td>4,989,231</td> <td>—</td> </tr> <tr> <td>(1) 未払費用</td> <td>2,096,913</td> <td>2,096,913</td> <td>—</td> </tr> <tr> <td>負債計</td> <td>2,096,913</td> <td>2,096,913</td> <td>—</td> </tr> </tbody> </table> |   | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 時価<br>(千円) | 差額<br>(千円) | (1) 現金及び預金 | 1,673,222 | 1,673,222 | — | (2) 未収運用受託報酬 | 3,316,008 | 3,316,008 | — | 資産計 | 4,989,231 | 4,989,231 | — | (1) 未払費用 | 2,096,913 | 2,096,913 | — | 負債計 | 2,096,913 | 2,096,913 | — | <table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>貸借対照表計上額<br/>(千円)</th> <th>時価<br/>(千円)</th> <th>差額<br/>(千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>(1) 現金及び預金</td> <td>2,150,439</td> <td>2,150,439</td> <td>—</td> </tr> <tr> <td>(2) 未収運用受託報酬</td> <td>2,958,539</td> <td>2,958,539</td> <td>—</td> </tr> <tr> <td>資産計</td> <td>5,108,979</td> <td>5,108,979</td> <td>—</td> </tr> <tr> <td>(1) 未払費用</td> <td>2,194,693</td> <td>2,194,693</td> <td>—</td> </tr> <tr> <td>負債計</td> <td>2,194,693</td> <td>2,194,693</td> <td>—</td> </tr> </tbody> </table> |  | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 時価<br>(千円) | 差額<br>(千円) | (1) 現金及び預金 | 2,150,439 | 2,150,439 | — | (2) 未収運用受託報酬 | 2,958,539 | 2,958,539 | — | 資産計 | 5,108,979 | 5,108,979 | — | (1) 未払費用 | 2,194,693 | 2,194,693 | — | 負債計 | 2,194,693 | 2,194,693 | — |
|   | 貸借対照表計上額<br>(千円)  | 時価<br>(千円)       | 差額<br>(千円) |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |   |  |                  |            |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |
| (1) 現金及び預金  | 1,673,222   | 1,673,222        | —          |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |   |  |                  |            |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |
| (2) 未収運用受託報酬  | 3,316,008   | 3,316,008        | —          |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |   |  |                  |            |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |
| 資産計   | 4,989,231   | 4,989,231        | —          |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |   |  |                  |            |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |
| (1) 未払費用  | 2,096,913   | 2,096,913        | —          |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |   |  |                  |            |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |
| 負債計   | 2,096,913   | 2,096,913        | —          |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |   |  |                  |            |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |
|   | 貸借対照表計上額<br>(千円)  | 時価<br>(千円)       | 差額<br>(千円) |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |   |  |                  |            |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |
| (1) 現金及び預金  | 2,150,439   | 2,150,439        | —          |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |   |  |                  |            |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |
| (2) 未収運用受託報酬  | 2,958,539   | 2,958,539        | —          |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |   |  |                  |            |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |
| 資産計   | 5,108,979   | 5,108,979        | —          |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |   |  |                  |            |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |
| (1) 未払費用  | 2,194,693   | 2,194,693        | —          |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |   |  |                  |            |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |
| 負債計   | 2,194,693   | 2,194,693        | —          |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |   |  |                  |            |            |            |           |           |   |              |           |           |   |     |           |           |   |          |           |           |   |     |           |           |   |

| 第13期<br>(自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31日)   | 第14期<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) |           |        |           |          |           |    |           |   |  |           |        |           |          |           |    |           |
|---|---------------------------------------|-----------|--------|-----------|----------|-----------|----|-----------|---|--|-----------|--------|-----------|----------|-----------|----|-----------|
| <p>(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項</p> <p><u>資産</u></p> <p>(1) 現金及び預金、(2) 未収運用受託報酬</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p><u>負債</u></p> <p>(1) 未払費用</p> <p>これは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>(注2) 金銭債権の決算日後の回収予定額</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 60%;"></th> <th style="text-align: center;">1年以内 (千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>現金及び預金</td> <td style="text-align: right;">1,673,222</td> </tr> <tr> <td>未収運用受託報酬</td> <td style="text-align: right;">3,316,008</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">合計</td> <td style="text-align: right;">4,989,230</td> </tr> </tbody> </table> |                                       | 1年以内 (千円) | 現金及び預金 | 1,673,222 | 未収運用受託報酬 | 3,316,008 | 合計 | 4,989,230 | <p>(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項</p> <p><u>資産</u></p> <p>(1) 現金及び預金、(2) 未収運用受託報酬</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p><u>負債</u></p> <p>(1) 未払費用</p> <p>これは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>(注2) 金銭債権の決算日後の回収予定額</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 60%;"></th> <th style="text-align: center;">1年以内 (千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>現金及び預金</td> <td style="text-align: right;">2,150,439</td> </tr> <tr> <td>未収運用受託報酬</td> <td style="text-align: right;">2,958,539</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">合計</td> <td style="text-align: right;">5,108,979</td> </tr> </tbody> </table> |  | 1年以内 (千円) | 現金及び預金 | 2,150,439 | 未収運用受託報酬 | 2,958,539 | 合計 | 5,108,979 |
|   | 1年以内 (千円)                             |           |        |           |          |           |    |           |   |  |           |        |           |          |           |    |           |
| 現金及び預金  | 1,673,222                             |           |        |           |          |           |    |           |   |  |           |        |           |          |           |    |           |
| 未収運用受託報酬  | 3,316,008                             |           |        |           |          |           |    |           |   |  |           |        |           |          |           |    |           |
| 合計  | 4,989,230                             |           |        |           |          |           |    |           |   |  |           |        |           |          |           |    |           |
|   | 1年以内 (千円)                             |           |        |           |          |           |    |           |   |  |           |        |           |          |           |    |           |
| 現金及び預金  | 2,150,439                             |           |        |           |          |           |    |           |   |  |           |        |           |          |           |    |           |
| 未収運用受託報酬  | 2,958,539                             |           |        |           |          |           |    |           |   |  |           |        |           |          |           |    |           |
| 合計  | 5,108,979                             |           |        |           |          |           |    |           |   |  |           |        |           |          |           |    |           |

(退職給付関係)

第13期  
(自 2018年4月1日  
至 2019年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

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

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

|              |             |
|--------------|-------------|
| 退職給付引当金の期首残高 | 574,189 千円  |
| 退職給付費用       | 304,414 千円  |
| 退職給付の支払額     | △109,355 千円 |
| 制度への拠出額      | － 千円        |
| <hr/>        |             |
| 退職給付引当金の期末残高 | 769,248 千円  |

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

|                     |            |
|---------------------|------------|
| 積立型制度の退職給付債務        | － 千円       |
| 年金資産                | － 千円       |
| <hr/>               |            |
|                     | － 千円       |
| 非積立型制度の退職給付債務       | 769,248 千円 |
| <hr/>               |            |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 769,248 千円 |
| <hr/>               |            |
| 退職給付に係る負債           | 769,248 千円 |
| <hr/>               |            |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 769,248 千円 |

(3) 退職給付費用

|                |            |
|----------------|------------|
| 簡便法で計算した退職給付費用 | 304,414 千円 |
|----------------|------------|

第14期  
(自 2019年4月1日  
至 2020年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員の退職給付に充てるため、非積立型の確定給付制度を採用しております。  
退職一時金制度（非積立型制度であります。）では、退職給付として、給与と勤務期間に基づいた一時金を支給しております。

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

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

|              |             |
|--------------|-------------|
| 退職給付引当金の期首残高 | 769,248 千円  |
| 退職給付費用       | 228,471 千円  |
| 退職給付の支払額     | △249,272 千円 |
| 制度への拠出額      | － 千円        |
| <hr/>        |             |
| 退職給付引当金の期末残高 | 748,447 千円  |

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

|                     |            |
|---------------------|------------|
| 積立型制度の退職給付債務        | － 千円       |
| 年金資産                | － 千円       |
| <hr/>               |            |
|                     | － 千円       |
| 非積立型制度の退職給付債務       | 748,447 千円 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 748,447 千円 |
| <hr/>               |            |
| 退職給付に係る負債           | 748,447 千円 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 748,447 千円 |

(3) 退職給付費用

|                |            |
|----------------|------------|
| 簡便法で計算した退職給付費用 | 228,471 千円 |
|----------------|------------|

## (税効果会計関係)

| 第13期<br>(2019年3月31日)   | 第14期<br>(2020年3月31日)  |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
|--|-----------------------|-----------------------|----------------|-----------|-----------------------|-----------|-------|-----------|-----------------------|--------------|---|------------|--------|-----------|-----------|-----------|--------|-----------|-----|-------|----------|-------------------|--------|-------------|----------|------------|--------|--|--------|------|----------|-------------|-----------|------------|---|--------|--|-------|-----------|------|-----------|-------|-----------|--------|-----------|---------|------------|-----------|-----------|--------|-----------|-----|-------|----------|-------------------|--------|-------------|----------|------------|--------|--|--------|------|----------|-------------|-----------|------------|
| <p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生<br/>の主な原因別内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td colspan="2">繰延税金資産</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">20,349 千円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td style="text-align: right;">55,123 千円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">42,444 千円</td> </tr> <tr> <td>長期未払費用</td> <td style="text-align: right;">31,770 千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">197,603 千円</td> </tr> <tr> <td>実績連動報酬</td> <td style="text-align: right;">42,723 千円</td> </tr> <tr> <td>役員退職慰労引当金</td> <td style="text-align: right;">24,487 千円</td> </tr> <tr> <td>資産除去債務</td> <td style="text-align: right;">22,637 千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">74 千円</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right;"><u>437,214 千円</u></td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td style="text-align: right;"><u>— 千円</u></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right;">437,214 千円</td> </tr> <tr> <td colspan="2">繰延税金負債</td> </tr> <tr> <td>資産除去債務</td> <td style="text-align: right;">— 千円</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right;"><u>— 千円</u></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right;">437,214 千円</td> </tr> </table> | 繰延税金資産                |                       | 未払事業税          | 20,349 千円 | 未払費用                  | 55,123 千円 | 賞与引当金 | 42,444 千円 | 長期未払費用                | 31,770 千円    | 退職給付引当金   | 197,603 千円 | 実績連動報酬 | 42,723 千円 | 役員退職慰労引当金 | 24,487 千円 | 資産除去債務 | 22,637 千円 | その他 | 74 千円 | 繰延税金資産小計 | <u>437,214 千円</u> | 評価性引当額 | <u>— 千円</u> | 繰延税金資産合計 | 437,214 千円 | 繰延税金負債 |  | 資産除去債務 | — 千円 | 繰延税金負債合計 | <u>— 千円</u> | 繰延税金資産の純額 | 437,214 千円 | <p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生<br/>の主な原因別内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td colspan="2">繰延税金資産</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">19,529 千円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td style="text-align: right;">30,979 千円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">44,598 千円</td> </tr> <tr> <td>長期未払費用</td> <td style="text-align: right;">22,394 千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">229,174 千円</td> </tr> <tr> <td>役員退職慰労引当金</td> <td style="text-align: right;">28,027 千円</td> </tr> <tr> <td>資産除去債務</td> <td style="text-align: right;">22,637 千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">85 千円</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right;"><u>397,427 千円</u></td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td style="text-align: right;"><u>— 千円</u></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right;">397,427 千円</td> </tr> <tr> <td colspan="2">繰延税金負債</td> </tr> <tr> <td>資産除去債務</td> <td style="text-align: right;">— 千円</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right;"><u>— 千円</u></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right;">397,427 千円</td> </tr> </table> | 繰延税金資産 |  | 未払事業税 | 19,529 千円 | 未払費用 | 30,979 千円 | 賞与引当金 | 44,598 千円 | 長期未払費用 | 22,394 千円 | 退職給付引当金 | 229,174 千円 | 役員退職慰労引当金 | 28,027 千円 | 資産除去債務 | 22,637 千円 | その他 | 85 千円 | 繰延税金資産小計 | <u>397,427 千円</u> | 評価性引当額 | <u>— 千円</u> | 繰延税金資産合計 | 397,427 千円 | 繰延税金負債 |  | 資産除去債務 | — 千円 | 繰延税金負債合計 | <u>— 千円</u> | 繰延税金資産の純額 | 397,427 千円 |
| 繰延税金資産   |                       |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 未払事業税  | 20,349 千円             |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 未払費用   | 55,123 千円             |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 賞与引当金  | 42,444 千円             |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 長期未払費用   | 31,770 千円             |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 退職給付引当金  | 197,603 千円            |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 実績連動報酬   | 42,723 千円             |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 役員退職慰労引当金  | 24,487 千円             |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 資産除去債務   | 22,637 千円             |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| その他  | 74 千円                 |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 繰延税金資産小計   | <u>437,214 千円</u>     |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 評価性引当額   | <u>— 千円</u>           |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 繰延税金資産合計   | 437,214 千円            |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 繰延税金負債   |                       |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 資産除去債務   | — 千円                  |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 繰延税金負債合計   | <u>— 千円</u>           |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 繰延税金資産の純額  | 437,214 千円            |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 繰延税金資産   |                       |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 未払事業税  | 19,529 千円             |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 未払費用   | 30,979 千円             |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 賞与引当金  | 44,598 千円             |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 長期未払費用   | 22,394 千円             |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 退職給付引当金  | 229,174 千円            |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 役員退職慰労引当金  | 28,027 千円             |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 資産除去債務   | 22,637 千円             |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| その他  | 85 千円                 |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 繰延税金資産小計   | <u>397,427 千円</u>     |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 評価性引当額   | <u>— 千円</u>           |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 繰延税金資産合計   | 397,427 千円            |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 繰延税金負債   |                       |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 資産除去債務   | — 千円                  |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 繰延税金負債合計   | <u>— 千円</u>           |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 繰延税金資産の純額  | 397,427 千円            |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税<br/>等の負担率との間に重要な差異があるとき<br/>の、当該差異の原因となった主要な項目別<br/>の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td></td> <td style="text-align: center;">当事業年度<br/>(2019年3月31日)</td> </tr> <tr> <td>法定実効税率<br/>(調整)</td> <td style="text-align: center;">30.6%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金算<br/>入されない項目</td> <td style="text-align: center;">1.3%</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: center;">0.6%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法<br/>人税等の負担率</td> <td style="text-align: center;"><u>32.5%</u></td> </tr> </table>   |                       | 当事業年度<br>(2019年3月31日) | 法定実効税率<br>(調整) | 30.6%     | 交際費等永久に損金算<br>入されない項目 | 1.3%      | その他   | 0.6%      | 税効果会計適用後の法<br>人税等の負担率 | <u>32.5%</u> | <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税<br/>等の負担率との間に重要な差異があるとき<br/>の、当該差異の原因となった主要な項目別<br/>の内訳</p> <p>法定実効税率と税効果会計適用後の法人税<br/>等の負担率との間の差異が法定実効税率の<br/>100分の5以下であるため注記を省略して<br/>おります。</p> |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
|  | 当事業年度<br>(2019年3月31日) |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 法定実効税率<br>(調整)   | 30.6%                 |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 交際費等永久に損金算<br>入されない項目  | 1.3%                  |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| その他  | 0.6%                  |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |
| 税効果会計適用後の法<br>人税等の負担率  | <u>32.5%</u>          |                       |                |           |                       |           |       |           |                       |              |   |            |        |           |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |   |        |  |       |           |      |           |       |           |        |           |         |            |           |           |        |           |     |       |          |                   |        |             |          |            |        |  |        |      |          |             |           |            |



(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

本社として使用する事務所の定期建物賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3. 当該資産除去債務の総額の増減

|                 | 第13期<br>(自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31日) | 第14期<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) |
|-----------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 期首残高            | 73,931千円                              | 73,931千円                              |
| 有形固定資産の取得に伴う増加額 | －千円                                   | －千円                                   |
| 時の経過による調整額      | －千円                                   | －千円                                   |
| 資産除去債務の履行による減少額 | －千円                                   | －千円                                   |
| その他増減額 (△は減少)   | －千円                                   | －千円                                   |
| 期末残高            | 73,931千円                              | 73,931千円                              |

(セグメント情報等)

| <p>[セグメント情報]</p> <p>第13期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)</p> <p>当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。</p> <p>なお、前事業年度についても当社は資産運用業の単一セグメントであり、記載を省略しております。</p> <p>[関連情報]</p> <p>第13期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)</p> <p>1. 製品及びサービスごとの情報</p> <p>資産運用業のサービスに関する外部顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>2. 地域ごとの情報</p> <p>(1) 営業収益</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr> <th>日本</th> <th>ケイマン</th> <th>その他</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>10,240,220</td> <td>1,610,834</td> <td>120,820</td> <td>11,971,874</td> </tr> </tbody> </table> <p>(2) 有形固定資産</p> <p>本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr> <th>顧客の名称又は氏名</th> <th>営業収益</th> <th>関連するセグメント名</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>ジブラルタ生命保険株式会社</td> <td>5,651,929</td> <td>資産運用業</td> </tr> <tr> <td>プルデンシャル生命保険株式会社</td> <td>1,611,139</td> <td>資産運用業</td> </tr> </tbody> </table> | 日本        | ケイマン       | その他        | 合計 | 10,240,220 | 1,610,834 | 120,820 | 11,971,874 | 顧客の名称又は氏名 | 営業収益 | 関連するセグメント名 | ジブラルタ生命保険株式会社 | 5,651,929 | 資産運用業 | プルデンシャル生命保険株式会社 | 1,611,139 | 資産運用業 | <p>[セグメント情報]</p> <p>第14期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)</p> <p>当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。</p> <p>なお、前事業年度についても当社は資産運用業の単一セグメントであり、記載を省略しております。</p> <p>[関連情報]</p> <p>第14期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)</p> <p>1. 製品及びサービスごとの情報</p> <p>資産運用業のサービスに関する外部顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>2. 地域ごとの情報</p> <p>(1) 営業収益</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr> <th>日本</th> <th>ケイマン</th> <th>その他</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>10,937,522</td> <td>1,004,332</td> <td>187,904</td> <td>12,129,759</td> </tr> </tbody> </table> <p>(2) 有形固定資産</p> <p>本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr> <th>顧客の名称又は氏名</th> <th>営業収益</th> <th>関連するセグメント名</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>ジブラルタ生命保険株式会社</td> <td>5,989,654</td> <td>資産運用業</td> </tr> <tr> <td>プルデンシャル生命保険株式会社</td> <td>1,692,144</td> <td>資産運用業</td> </tr> </tbody> </table> | 日本 | ケイマン | その他 | 合計 | 10,937,522 | 1,004,332 | 187,904 | 12,129,759 | 顧客の名称又は氏名 | 営業収益 | 関連するセグメント名 | ジブラルタ生命保険株式会社 | 5,989,654 | 資産運用業 | プルデンシャル生命保険株式会社 | 1,692,144 | 資産運用業 |
|--|-----------|------------|------------|----|------------|-----------|---------|------------|-----------|------|------------|---------------|-----------|-------|-----------------|-----------|-------|--|----|------|-----|----|------------|-----------|---------|------------|-----------|------|------------|---------------|-----------|-------|-----------------|-----------|-------|
| 日本   | ケイマン      | その他        | 合計         |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |  |    |      |     |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |
| 10,240,220   | 1,610,834 | 120,820    | 11,971,874 |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |  |    |      |     |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |
| 顧客の名称又は氏名  | 営業収益      | 関連するセグメント名 |            |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |  |    |      |     |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |
| ジブラルタ生命保険株式会社  | 5,651,929 | 資産運用業      |            |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |  |    |      |     |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |
| プルデンシャル生命保険株式会社  | 1,611,139 | 資産運用業      |            |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |  |    |      |     |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |
| 日本   | ケイマン      | その他        | 合計         |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |  |    |      |     |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |
| 10,937,522   | 1,004,332 | 187,904    | 12,129,759 |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |  |    |      |     |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |
| 顧客の名称又は氏名  | 営業収益      | 関連するセグメント名 |            |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |  |    |      |     |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |
| ジブラルタ生命保険株式会社  | 5,989,654 | 資産運用業      |            |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |  |    |      |     |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |
| プルデンシャル生命保険株式会社  | 1,692,144 | 資産運用業      |            |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |  |    |      |     |    |            |           |         |            |           |      |            |               |           |       |                 |           |       |

(関連当事者情報)

第13期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

| 種類  | 会社等の名称                     | 所在地                                   | 資本金又は出資金 | 事業の内容   | 議決権等の所有〔被所有〕割合 | 関連当事者との関係               | 取引の内容 | 取引金額(千円) | 科目     | 期末残高(千円) |
|-----|----------------------------|---------------------------------------|----------|---------|----------------|-------------------------|-------|----------|--------|----------|
| 親会社 | Prudential Financial, Inc. | Broad Street, Newark, New Jersey, USA | 6百万米ドル   | 金融サービス業 | 〔被所有〕間接100%    | 親会社株式によるストック・オプション等(注1) | 福利厚生費 | 69,591   | 未払費用   | 557      |
|     |                            |                                       |          |         |                |                         |       |          | 長期未払費用 | 67,125   |

(2) 兄弟会社等

| 種類      | 会社等の名称          | 所在地                                   | 資本金又は出資金  | 事業の内容    | 議決権等の所有〔被所有〕割合 | 関連当事者との関係     | 取引の内容         | 取引金額(千円)  | 科目       | 期末残高(千円)  |
|---------|-----------------|---------------------------------------|-----------|----------|----------------|---------------|---------------|-----------|----------|-----------|
| 親会社の子会社 | ブルデンシャル生命保険株式会社 | 東京都千代田区永田町                            | 29,000百万円 | 生命保険業    | 無し             | 投資顧問契約        | 運用受託報酬の受取(注2) | 1,611,139 | 未収運用受託報酬 | 458,256   |
| 親会社の子会社 | ジブラルタ生命保険株式会社   | 東京都千代田区永田町                            | 75,500百万円 | 生命保険業    | 無し             | 投資顧問契約        | 運用受託報酬の受取(注2) | 5,651,929 | 未収運用受託報酬 | 1,469,795 |
| 親会社の子会社 | PGIM, Inc.      | Broad Street, Newark, New Jersey, USA | 98米ドル     | 投信・投資顧問業 | 無し             | 投資顧問業務の再委託契約等 | 投資顧問報酬の支払(注2) | 5,873,188 | 未払費用     | 1,753,121 |
|         |                 |                                       |           |          |                | サービス契約        | サービス料         | 116,825   | 未収収益     | 33,206    |

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

取引の条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社に関する注記

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

Prudential International Investments Company, LLC

第14期（自2019年4月1日 至2020年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

| 種類  | 会社等の名称                     | 所在地                                   | 資本金又は出資金 | 事業の内容   | 議決権等の所有〔被所有〕割合  | 関連当事者との関係                   | 取引の内容 | 取引金額<br>(千円) | 科目     | 期末残高<br>(千円) |
|-----|----------------------------|---------------------------------------|----------|---------|-----------------|-----------------------------|-------|--------------|--------|--------------|
| 親会社 | Prudential Financial, Inc. | Broad Street, Newark, New Jersey, USA | 6百万米ドル   | 金融サービス業 | 〔被所有〕<br>間接100% | 親会社株式によるストック・オプション等<br>(注1) | 福利厚生費 | 46,179       | 未払費用   | 339          |
|     |                            |                                       |          |         |                 |                             |       |              | 長期未払費用 | 85,003       |

(2) 兄弟会社等

| 種類      | 会社等の名称          | 所在地                                   | 資本金又は出資金  | 事業の内容    | 議決権等の所有〔被所有〕割合 | 関連当事者との関係     | 取引の内容             | 取引金額<br>(千円) | 科目       | 期末残高<br>(千円) |
|---------|-----------------|---------------------------------------|-----------|----------|----------------|---------------|-------------------|--------------|----------|--------------|
| 親会社の子会社 | プルデンシャル生命保険株式会社 | 東京都千代田区永田町                            | 29,000百万円 | 生命保険業    | 無し             | 投資顧問契約        | 運用受託報酬の受取<br>(注2) | 1,692,144    | 未収運用受託報酬 | 479,082      |
| 親会社の子会社 | ジブラルタ生命保険株式会社   | 東京都千代田区永田町                            | 75,500百万円 | 生命保険業    | 無し             | 投資顧問契約        | 運用受託報酬の受取<br>(注2) | 5,989,654    | 未収運用受託報酬 | 1,588,512    |
| 親会社の子会社 | PGIM, Inc.      | Broad Street, Newark, New Jersey, USA | 98米ドル     | 投信・投資顧問業 | 無し             | 投資顧問業務の再委託契約等 | 投資顧問報酬の支払<br>(注2) | 5,732,208    | 未払費用     | 1,746,303    |
|         |                 |                                       |           |          |                | サービス契約        | サービス料             | 122,584      | 未収収益     | 30,918       |

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

取引の条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社に関する注記

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

Prudential International Investments Company, LLC

## (1株当たり情報)

| 第13期<br>(自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31日)                    |             | 第14期<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日)                    |             |
|--|-------------|--|-------------|
| 1株当たり純資産額  | 266,044.63円 | 1株当たり純資産額  | 303,381.96円 |
| 1株当たり当期純利益   | 179,330.68円 | 1株当たり当期純利益   | 187,337.33円 |
| (注) 1株当たり純利益金額の算定上の基礎は、<br>以下のとおりであります。                  |             | (注) 1株当たり純利益金額の算定上の基礎は、<br>以下のとおりであります。                  |             |
| 当期純利益  | 1,319,873千円 | 当期純利益  | 1,378,802千円 |
| 普通株主に帰属しない金額   | －千円         | 普通株主に帰属しない金額   | －千円         |
| 普通株式に係る当期純利益   | 1,319,873千円 | 普通株式に係る当期純利益   | 1,378,802千円 |
| 期中平均株式数  | 7,360株      | 期中平均株式数  | 7,360株      |
| なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益に<br>ついては、潜在株式が存在しないため記載して<br>おりません。 |             | なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益に<br>ついては、潜在株式が存在しないため記載して<br>おりません。 |             |


# 独立監査人の中間監査報告書

2020年12月15日


PGIMジャパン株式会社  
取締役会御中

## PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所  
指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士

奈良昌彦 

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士

久保直毅 

### 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているPGIMジャパン株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第15期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、PGIMジャパン株式会社の2020年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 中間財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

### 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第15期中間会計期間  
(2020年9月30日)

資産の部

流動資産

|          |  |           |
|----------|--|-----------|
| 現金及び預金   |  | 2,033,008 |
| 前払費用     |  | 74,487    |
| 立替金      |  | 12,299    |
| 未収委託者報酬  |  | 136,640   |
| 未収運用受託報酬 |  | 3,001,557 |
| 未収収益     |  | 59,892    |
| その他流動資産  |  | 1,901     |
| 流動資産合計   |  | 5,319,787 |

固定資産

有形固定資産

|          |    |         |
|----------|----|---------|
| 建物附属設備   | *1 | 199,355 |
| 器具備品     | *1 | 86,151  |
| 有形固定資産合計 |    | 285,507 |

無形固定資産

|          |  |        |
|----------|--|--------|
| ソフトウェア   |  | 98,340 |
| 無形固定資産合計 |  | 98,340 |

投資その他の資産

|            |  |         |
|------------|--|---------|
| 差入保証金      |  | 9,972   |
| 繰延税金資産     |  | 520,832 |
| 投資その他の資産合計 |  | 530,804 |

固定資産合計

914,652

資産合計

6,234,439



(単位：千円)

第15期中間会計期間  
(2020年9月30日)

負債の部

流動負債

|         |    |           |
|---------|----|-----------|
| 未払金     |    | 88,062    |
| 未払手数料   |    | 13,212    |
| その他未払金  |    | 74,850    |
| 未払費用    |    | 1,938,141 |
| 未払法人税等  |    | 441,688   |
| 未払消費税等  | *2 | 196,601   |
| 預り金     |    | 17,454    |
| 賞与引当金   |    | 437,462   |
| 役員賞与引当金 |    | 42,045    |
| その他流動負債 |    | 123       |
| 流動負債合計  |    | 3,161,579 |

固定負債

|           |  |           |
|-----------|--|-----------|
| 長期未払費用    |  | 155,171   |
| 退職給付引当金   |  | 832,705   |
| 役員退職慰労引当金 |  | 12,009    |
| 資産除去債務    |  | 73,931    |
| 固定負債合計    |  | 1,073,817 |

負債合計

4,235,396

(単位：千円)

第15期中間会計期間  
(2020年9月30日)

純資産の部

株主資本

資本金 219,000

資本剰余金 149,000

資本準備金 149,000

利益剰余金 1,631,042

利益準備金 54,750

その他利益剰余金 1,576,292

繰越利益剰余金 1,576,292

株主資本合計 1,999,042

純資産合計 1,999,042

負債・純資産合計 6,234,439

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

|           | 第15期中間会計期間<br>(自 2020年4月1日<br>至 2020年9月30日) |
|-----------|---|
| 営業収益      |   |
| 委託者報酬     | 905,707                                     |
| 運用受託報酬    | 5,119,576                                   |
| その他営業収益   | 95,552                                      |
| 営業収益計     | 6,120,836                                   |
| 営業費用      |   |
| 支払手数料     | 32,641                                      |
| 広告宣伝費     | 5,980                                       |
| 調査費       | 3,238,635                                   |
| 調査費       | 188,487                                     |
| 委託調査費     | 3,049,523                                   |
| 図書費       | 624   |
| 営業雑経費     | 15,385                                      |
| 通信費       | 4,051                                       |
| 印刷費       | 1,645                                       |
| 協会費       | 8,434                                       |
| 諸会費       | 1,254                                       |
| 営業費用計     | 3,292,643                                   |
| 一般管理費     |   |
| 給料        | 1,103,543                                   |
| 役員報酬      | 26,435                                      |
| 給料・手当     | 740,330                                     |
| 賞与        | 26,062                                      |
| 賞与引当金繰入   | 291,810                                     |
| 役員賞与引当金繰入 | 18,904                                      |
| 福利厚生費     | 117,764                                     |
| 交際費       | 916   |
| 旅費交通費     | 338   |

(単位：千円)

|              |    | 第15期中間会計期間<br>(自 2020年4月1日<br>至 2020年9月30日) |
|--------------|----|---|
| 水道光熱費        |    | 2,277                                       |
| 租税公課         |    | 31,807                                      |
| 不動産賃借料       |    | 89,758                                      |
| 退職給付費用       |    | 100,377                                     |
| 役員退職慰労引当金繰入  |    | 71,483                                      |
| 募集費          |    | 7,162                                       |
| 固定資産減価償却費    | *1 | 45,418                                      |
| 業務委託費        |    | 191,381                                     |
| 専門家報酬        |    | 23,294                                      |
| 消耗器具備品費      |    | 2,615                                       |
| 諸経費          |    | 18,675                                      |
| 一般管理費計       |    | 1,806,814                                   |
| 営業利益         |    | 1,021,379                                   |
| 営業外収益        |    |   |
| 受取利息         |    | 131   |
| 営業外収益計       |    | 131   |
| 営業外費用        |    |   |
| 為替差損         |    | 7,019                                       |
| 営業外費用計       |    | 7,019                                       |
| 経常利益         |    | 1,014,491                                   |
| 税引前中間純利益     |    | 1,014,491                                   |
| 法人税、住民税及び事業税 |    | 414,944                                     |
| 法人税等調整額      |    | △123,404                                    |
| 中間純利益        |    | 722,951                                     |

注記事項

(重要な会計方針)

|                              | 第15期中間会計期間<br>(自 2020年4月1日<br>至 2020年9月30日)  |
|------------------------------|--|
| 1. 固定資産の減価償却の方法              | <p>(1) 有形固定資産（リース資産を除く）<br/>定率法を採用しております。ただし、2017年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く）<br/>定額法を採用しております。<br/>なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づいております。</p>   |
| 2. 引当金の計上基準                  | <p>(1) 賞与引当金<br/>従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、賞与支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金<br/>役員賞与の支出に備えて、当事業年度における支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金<br/>従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。<br/>なお、当社は従業員300人未満の企業に該当することから、簡便法を適用し、退職一時金制度について退職給付に係る当中間会計期間末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法によっております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金<br/>役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づく中間期末要支給額を計上しております。</p> |
| 3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準     | <p>外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>  |
| 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>消費税等の会計処理<br/>消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。</p>   |

(中間貸借対照表関係)

| 第15期中間会計期間<br>(2020年9月30日) |   |           |
|----------------------------|---|-----------|
| * 1                        | 減価償却累計額   | 270,957千円 |
|                            | 有形固定資産  |           |
|                            | 建物附属設備  | 172,224千円 |
|                            | 器具備品  | 98,732千円  |
| * 2                        | 消費税等の取扱い  |           |
|                            | 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺の<br>うえ、未払消費税等として表示しており<br>ます。 |           |

(中間損益計算書関係)

| 第15期中間会計期間<br>(自 2020年4月1日<br>至 2020年9月30日) |         |          |
|---|---------|----------|
| * 1   | 減価償却実施額 | 45,418千円 |
|   | 有形固定資産  | 20,654千円 |
|   | 無形固定資産  | 24,763千円 |

(金融商品関係)

第15期中間会計期間  
(2020年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

2020年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

|              | 中間貸借対照表計上額 (千円) | 時価 (千円)   | 差額 (千円) |
|--------------|-----------------|-----------|---------|
| (1) 現金及び預金   | 2,033,008       | 2,033,008 | —       |
| (2) 未収運用受託報酬 | 3,001,557       | 3,001,557 | —       |
| 資産計          | 5,034,565       | 5,034,565 | —       |
| (1) 未払費用     | 1,938,141       | 1,938,141 | —       |
| 負債計          | 1,938,141       | 1,938,141 | —       |

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

資産

(1) 現金及び預金、(2) 未収運用受託報酬

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

負債

(1) 未払費用

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

(資産除去債務関係)

第15期中間会計期間  
(自 2020年4月1日  
至 2020年9月30日)

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当該資産除去債務の総額の増減

|                     |                 |
|---------------------|-----------------|
| 当事業年度期首残高           | 73,931千円        |
| 有形固定資産の取得に伴う<br>増加額 | －千円             |
| 時の経過による調整額          | －千円             |
| 資産除去債務の履行による<br>減少額 | －千円             |
| その他増減額 (△は減少)       | －千円             |
| 当中間会計期間末残高          | <u>73,931千円</u> |



(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第15期中間会計期間（自2020年4月1日 至2020年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第15期中間会計期間（自2020年4月1日 至2020年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

(単位：千円)

| 日本        | ケイマン    | その他     | 合計        |
|-----------|---------|---------|-----------|
| 5,522,086 | 456,649 | 142,101 | 6,120,836 |

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

| 顧客の名称又は氏名       | 営業収益      | 関連するセグメント名 |
|-----------------|-----------|------------|
| ジブラルタ生命保険株式会社   | 3,094,719 | 資産運用業      |
| プルデンシャル生命保険株式会社 | 841,495   | 資産運用業      |

(1株当たり情報)

第15期中間会計期間  
(自 2020年4月1日  
至 2020年9月30日)

1株当たり純資産額 271,609.09円

1株当たり中間純利益金額 98,227.13円

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎  
は、以下のとおりであります。

中間純利益 722,951千円

普通株主に帰属しない金額 一千円

普通株式に係る中間純利益 722,951千円

期中平均株式数 7,360株

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額  
については、潜在株式が存在しないため記載して  
おりません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5 【その他】

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

追加型証券投資信託  
PRU グッドライフ 2040 (年金)

運用の基本方針

投資信託約款第 19 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 49.4%、PRU 国内債券マザーファンド 15.4%、PRU 海外株式マザーファンド 29.6%、PRU 海外債券マザーファンド 2.6%およびコール・ローン等の短期金融商品 3.0%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、QMA 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、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 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を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）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、必ず分配を行うものではありません。

③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。

約 款

(信託の種類、委託者および受託者)

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、PGIM ジャパン株式会社を委託者とし、株式会社りそな銀行を受託者とします。

②この信託は、投資信託財産に属する財産についての對抗要件に関する事項を除き、信託法（大正 11 年法律第 62 号）の適用を受けます。

(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 100 万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 14 日までとします。

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

第 6 条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第 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 8 項で定める公募により行われます。

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

(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権取得申込者とし、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 100 万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 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、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）に定めるところにしたがい、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るものとします。

(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この投資信託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。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。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

貨建価値証券」といいます。)、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30条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

(信託日時の異なる受益権の内容)

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

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第11条 この信託の受益権は、社振法の規定の適用を受けるとし、追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関(社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。)および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)

②委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③委託者は、第8条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

④委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権(受益権につき、既に投資信託契約の一部解約が行われたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含まず。)を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預りではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行うものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する第一種金融商品取引業者(委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。)および登録金融機関(委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。)(以下総称して「販売会社」といいます。))に当該申請の手続きを委任することができます。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第12条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

(受益権の申込単位、価額および手数料等)

第13条 販売会社は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、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対し、1円以上1円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。なお、ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所またはニューヨークもしくはロンドンの銀行が休業日の場合は、追加信託の申込みを受付けないものとします。ただし、第46条第2項に規定する収益分配金の再投資に係る追加信託金の申込みに限ってこれを受付けるものとします。

この投資信託約款において「自動けいぞく投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と販売会社が締結する「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。

②前項の取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、

自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口座の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金(第3項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。)の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口座の増加の記載または記録を行うことができます。

③第1項の受益権の価額は、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、取得日がこの投資信託契約締結の日であるときは、受益権の価額は、1口につき1円とします。

④前項の手数料の額は、販売会社が独自に定めることができるものとします。

⑤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権の価額は、原則として、第41条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥前各項の規定にかかわらず、金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所をいいます。以下同じ。))における取引の停止、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、販売会社は、受益権の取得申込みの受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みを取消することができます。

(受益権の譲渡に係る記載または記録)

第13条の2 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権に記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等(当該他の振替機関等の上位機関を含みます。))に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権に記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第13条の3 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

第14条 (削除)

第15条 (削除)

第16条 (削除)

(投資の対象とする資産の種類)

第17条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1.次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。))

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、第24条、第25条および第26条に定めるものに限ります。)

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

ニ.約束手形(イ.に掲げるものに該当するものを除きます。以下同じ。)

(運用の指図範囲)

第18条 委託者は、信託金を、主としてPGIM ジャパン株式会社を委託者とし、株式会社りそな銀行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(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみ

なされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

- 1.株券または新株引受権証券
  - 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(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  - 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(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
  - 8.協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
  - 9.資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
  - 10.コマースヤル・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.外国または外国の者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.投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  - 14.投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
  - 15.外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  - 16.オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをい、有価証券に係るものに限り。)
  - 17.預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  - 18.外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 19.指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り。)
  - 20.抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
  - 21.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - 22.外国の者に対する権利で前号の有価証券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(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。
- 1.預金
  - 2.指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  - 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.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  - 6.外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- 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、前項各号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。

⑧デリバティブ取引等(一般社団法人投資信託協会の定める「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」に定義するデリバティブ取引等をいう。)について、その取引の目的に応じて、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が投資信託財産の純資産総額を超えないものとしてします。

⑨一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(運用の基本方針)

第19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20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、金融商品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、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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るものとします。

(同一銘柄の株式等への投資制限)

第21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22条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債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、ならびに転換社債型新株予約権付社債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、ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

(信用取引の運用指図・目的・範囲)

第23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ることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しによ

り行うことの指図をすることができるものとします。

- 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（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り。）の行使により取得可能な株券
  - 6.投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債の新株引受権の行使、または投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### （先物取引等の運用指図）

- 第24条 委託者は、わが国の金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「金融商品取引所等」といいます。以下同じ。）における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）
- ②委託者は、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ③委託者は、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所等における金利に係るこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### （スワップ取引の運用指図・目的・範囲）

- 第25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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### （金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の運用指図・目的・範囲）

- 第26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、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ②金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第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、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ④委託者は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### （有価証券の貸付けの指図・目的・範囲）

- 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、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るときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### （外貨建有価証券への投資制限）

- 第28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29条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### （外国為替予約取引の指図・目的・範囲）

- 第30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ことをします。
- 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31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32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33条 金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業者を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマース・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

- 第34条 （削除）

(投資信託財産の登記等および記載等の留保等)

第35条 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することができます。

②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をすることがあります。

③投資信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載または記録をすることともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産(金銭を除きます。)については、外形上区別することができる方法のほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(有価証券売却等の指図)

第36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37条 委託者は、前条の規定による売却代金、一部解約金、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。

(資金の借入れの指図・目的・範囲)

第38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高めるため、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等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

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39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40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41条 この信託の計算期間は、毎年12月16日から翌年12月15日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成13年9月28日から平成13年12月17日までとします。

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42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43条 投資信託財産に関する租税、次の各号に掲げる諸費用その他の信託事務の処理に要する費用ならびに当該費用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。)ならびに受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、投資信託財産中からその都度支弁します。

1. 売買委託手数料等の有価証券取引等に要する費用および保管費用等

2. 借入金の利息

②前項の定めにかかわらず、委託者は、信託事務の処理に要する費用のうち、次の各号に掲げる費用および当該費用に係る消費税等については、投資信託財産の純資産総額に年10,000分の5の率を乗じて得た額を上限に、かつその実費の額以内の額の支払いにつき、次項の定めるところにしたがって、投資信託財産から受けることができます。

1. 投資信託振替制度に係る費用

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

3. この信託の受益者に対して行う公告に要する費用ならびに投資信託約款の変更または投資信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成等に要する費用

4. この信託の設定および運営・管理に関し、法務・税務等につき要する費用

③前項で定める費用および当該費用に係る消費税等は、第41条に規定する計算期間を通じて、毎日費用計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日ならびに毎計算期間末および信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

(監査報酬)

第43条の2 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10,000分の0.5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に相当する額とともに、第41条に規定する計算期間を通じて、毎日費用計上します。

②前条第3項の規定は、前項の場合に準用するものとします。

(信託報酬等の額および支弁の方法)

第44条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第41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年10,000分の45の率を乗じて得た額とします。

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18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41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45条 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額(以下「配当等収益」といいます。)は、信託事務の諸費用、監査報酬、信託報酬およびこれらの費用等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、信託事務の諸費用、監査報酬、信託報酬およびこれらの費用等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。

(収益分配金の再投資等)

第46条 受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に支払われます。

②販売会社は、別に定める契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

(償還金および一部解約金の支払い)

第47条 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、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(信託終了日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引換えに当該受益者に支払います。

②一部解約金は、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。

③前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

④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権の価額等に応じて計算されるものとします。

(償還金の時効)

第48条 受益者が、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、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払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第49条 受託者は、収益分配金については、第46条第1項に規定する交付開始前日、償還金については第47条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第47条第2項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

第50条 (削除)

(一部解約)

第51条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、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、ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所またはニューヨークもしくはロンドンの銀行の休業日においては、一部解約の実行の請求を受付けないものとします。

③受益者が平成19年1月4日以降の投資信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日前に行われる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行うものとします。

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。なお、第1項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対し

て当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

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ます。

⑥委託者は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。

⑦前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして第5項の規定に準じて計算された価額とします。

(質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第51条の2 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(投資信託契約の解約)

第52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53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57条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第54条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、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会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第57条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第55条 委託者は、事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事業を譲渡することがあります。

②委託者は、分割により事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事業を承継させることがあり

ます。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第56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。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第57条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

(投資信託約款の変更)

第57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。

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。

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項の投資信託約款の変更をしません。

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。

(反対者の買取請求権)

第58条 第52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52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、販売会社を経由して、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

②前項の買取請求の事務取扱い等については、委託者と受託者との協議により定めます。

(公告)

第59条 委託者が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

(投資信託約款に関する疑義の取扱い)

第60条 この投資信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第61条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②前項の規定にかかわらず、委託者は受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

(付則)

第1条 第46条第3項および第47条第4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権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権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、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。

第2条 平成18年12月29日現在の投資信託約款第11条、第12条、第14条から第16条の規定および受益権と読み替えられた受益証

券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

第3条 第26条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第4条 第26条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第5条 第26条に規定する「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

上記条項により投資信託契約を締結します。

投資信託契約締結日 平成13年9月28日

東京都千代田区永田町二丁目13番10号  
ブルデンシャルタワー  
委託者 ブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社  
(現 PGIM ジャパン株式会社)  
東京都千代田区大手町一丁目1番2号  
受託者 りそな信託銀行株式会社  
(現 株式会社りそな銀行)