

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	半期報告書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	平成28年9月9日
<b>【計算期間】</b>	第16期中 (自 平成27年12月11日 至 平成28年6月10日)
<b>【ファンド名】</b>	PRUグッドライフ2040
<b>【発行者名】</b>	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
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 新田 恭久
<b>【本店の所在の場所】</b>	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
<b>【事務連絡者氏名】</b>	小林 雅彦
<b>【連絡場所】</b>	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
<b>【電話番号】</b>	03-6832-7150
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません

## 1【ファンドの運用状況】

## (1)【投資状況】

(平成28年7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 （PRU国内株式マザーファンド）	日本	12,513,352	31.36
投資信託受益証券 （PRU国内債券マザーファンド）	日本	16,282,807	40.81
投資信託受益証券 （PRU海外株式マザーファンド）	日本	7,523,348	18.85
投資信託受益証券 （PRU海外債券マザーファンド）	日本	2,469,970	6.19
現金、預金、その他資産（負債控除後）		1,113,844	2.79
合計（純資産総額）		39,903,321	100.00

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

## (参考情報)

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

(平成28年7月29日現在)

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
株式	日本	3,770,583,280	96.72
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		127,870,213	3.28
合計（純資産総額）		3,898,453,493	100.00

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

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

(平成28年7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	5,436,460,850	83.96
地方債証券	日本	445,894,978	6.89
特殊債券	日本	382,961,630	5.91
社債券	日本	164,055,450	2.53
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		45,456,132	0.70
合計（純資産総額）		6,474,829,040	100.00

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

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

（平成28年7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	2,607,030,681	56.93
	イギリス	328,050,519	7.16
	スイス	170,992,298	3.73
	カナダ	167,728,980	3.66
	ドイツ	153,653,952	3.36
	フランス	153,008,289	3.34
	オーストラリア	116,271,870	2.54
	オランダ	74,073,964	1.62
	アイルランド	71,979,870	1.57
	スペイン	51,495,844	1.12
	スウェーデン	47,180,421	1.03
	香港	40,735,854	0.89
	デンマーク	34,539,619	0.75
	シンガポール	32,111,629	0.70
	イタリア	30,635,837	0.67
	ベルギー	22,605,535	0.49
	フィンランド	17,297,353	0.38
	キュラソー	15,980,520	0.35
	バミューダ	15,465,285	0.34
	ジャージー	14,867,714	0.32
	イスラエル	12,809,527	0.28
	ケイマン島	11,435,647	0.25
	ノルウェー	10,650,309	0.23
	ルクセンブルク	4,409,124	0.10
	ニュージーランド	3,389,667	0.07
	パナマ	2,961,873	0.06
	オーストリア	2,850,001	0.06
	ポルトガル	2,688,192	0.06
	英ヴァージン諸島	1,576,471	0.03
	リベリア	1,376,590	0.03
パプアニューギニア	1,243,840	0.03	
マン島	607,040	0.01	
モーリシャス	334,066	0.01	

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	119,497,133	2.61
	オーストラリア	12,999,574	0.28
	フランス	7,163,367	0.16
	イギリス	4,743,908	0.10
	香港	2,746,513	0.06
	シンガポール	2,262,714	0.05
	カナダ	951,520	0.02
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		206,908,481	4.52
合計（純資産総額）		4,579,311,591	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。

(平成28年7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	2,652,739,185	41.02
	フランス	640,808,628	9.91
	イタリア	616,253,814	9.53
	イギリス	512,106,193	7.92
	スペイン	405,728,310	6.27
	ドイツ	391,556,602	6.06
	ベルギー	173,963,111	2.69
	オランダ	156,506,689	2.42
	オーストラリア	127,701,483	1.97
	カナダ	109,889,070	1.70
	オーストリア	104,087,523	1.61
	アイルランド	79,214,769	1.23
	メキシコ	58,035,000	0.90
	ポーランド	48,117,896	0.74
	デンマーク	45,239,812	0.70
	マレーシア	38,197,511	0.59
	フィンランド	36,490,311	0.56
	南アフリカ	33,597,304	0.52
	スウェーデン	26,919,033	0.42
	シンガポール	23,954,761	0.37
ノルウェー	18,220,401	0.28	
小計	6,299,327,406	97.42	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	166,881,632	2.58	
合計(純資産総額)	6,466,209,038	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 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

		純資産総額（円）	1万口当たりの純資産額 （基準価額）（円）
第1計算期間末	（分配付）	176,295,376	9,189
（平成13年12月10日）	（分配落）	176,295,376	9,189
第2計算期間末	（分配付）	70,958,579	7,743
（平成14年12月10日）	（分配落）	70,958,579	7,743
第3計算期間末	（分配付）	55,190,731	8,429
（平成15年12月10日）	（分配落）	55,190,731	8,429
第4計算期間末	（分配付）	56,199,735	9,183
（平成16年12月10日）	（分配落）	56,199,735	9,183
第5計算期間末	（分配付）	63,244,230	12,080
（平成17年12月12日）	（分配落）	63,244,230	12,080
第6計算期間末	（分配付）	55,592,061	12,573
（平成18年12月11日）	（分配落）	55,592,061	12,573
第7計算期間末	（分配付）	34,266,509	12,667
（平成19年12月10日）	（分配落）	34,266,509	12,667
第8計算期間末	（分配付）	22,605,172	8,021
（平成20年12月10日）	（分配落）	22,605,172	8,021
第9計算期間末	（分配付）	35,117,104	8,725
（平成21年12月10日）	（分配落）	35,117,104	8,725
第10計算期間末	（分配付）	36,609,837	8,857
（平成22年12月10日）	（分配落）	36,609,837	8,857
第11計算期間末	（分配付）	34,901,715	8,152
（平成23年12月12日）	（分配落）	34,901,715	8,152
第12計算期間末	（分配付）	33,785,837	8,787
（平成24年12月10日）	（分配落）	33,785,837	8,787
第13計算期間末	（分配付）	38,940,969	11,720
（平成25年12月10日）	（分配落）	38,940,969	11,720
第14計算期間末	（分配付）	41,941,048	12,938
（平成26年12月10日）	（分配落）	41,941,048	12,938
平成27年7月末日		44,241,882	13,838
平成27年8月末日		41,477,759	13,239
平成27年9月末日		39,946,894	12,729
平成27年10月末日		42,141,167	13,410

	純資産総額(円)	1万口当たりの純資産額 (基準価額)(円)
平成27年11月末日	42,395,818	13,480
第15計算期間末 (分配付)	41,871,637	13,303
(平成27年12月10日) (分配落)	41,871,637	13,303
平成27年12月末日	41,998,881	13,340
平成28年1月末日	40,541,826	12,859
平成28年2月末日	39,141,157	12,410
平成28年3月末日	40,288,853	12,756
平成28年4月末日	40,216,680	12,723
平成28年5月末日	40,725,681	12,875
平成28年6月末日	38,837,673	12,267
平成28年7月末日	39,903,321	12,593

## 【分配の推移】

決算期	1万口当たりの分配金 (円)
第1計算期間末 平成13年12月10日	0
第2計算期間末 平成14年12月10日	0
第3計算期間末 平成15年12月10日	0
第4計算期間末 平成16年12月10日	0
第5計算期間末 平成17年12月12日	0
第6計算期間末 平成18年12月11日	0
第7計算期間末 平成19年12月10日	0
第8計算期間末 平成20年12月10日	0
第9計算期間末 平成21年12月10日	0
第10計算期間末 平成22年12月10日	0
第11計算期間末 平成23年12月12日	0
第12計算期間末 平成24年12月10日	0
第13計算期間末 平成25年12月10日	0
第14計算期間末 平成26年12月10日	0
第15計算期間末 平成27年12月10日	0

## 【収益率の推移】

期間	収益率（％）
第1計算期間 （平成13年3月16日から平成13年12月10日）	8.1
第2計算期間 （平成13年12月11日から平成14年12月10日）	15.7
第3計算期間 （平成14年12月11日から平成15年12月10日）	8.9
第4計算期間 （平成15年12月11日から平成16年12月10日）	8.9
第5計算期間 （平成16年12月11日から平成17年12月12日）	31.5
第6計算期間 （平成17年12月13日から平成18年12月11日）	4.1
第7計算期間 （平成18年12月12日から平成19年12月10日）	0.7
第8計算期間 （平成19年12月11日から平成20年12月10日）	36.7
第9計算期間 （平成20年12月11日から平成21年12月10日）	8.8
第10計算期間 （平成21年12月11日から平成22年12月10日）	1.5
第11計算期間 （平成22年12月11日から平成23年12月12日）	8.0
第12計算期間 （平成23年12月13日から平成24年12月10日）	7.8
第13計算期間 （平成24年12月11日から平成25年12月10日）	33.4
第14計算期間 （平成25年12月11日から平成26年12月10日）	10.4
第15計算期間 （平成26年12月11日から平成27年12月10日）	2.8
第16計算期間中間期 （平成27年12月11日から平成28年6月10日）	4.8



- (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。

## 2【設定及び解約の実績】

期間	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間 （平成13年3月16日から平成13年12月10日）	195,423,951	3,559,357
第2計算期間 （平成13年12月11日から平成14年12月10日）	10,492,067	110,711,121
第3計算期間 （平成14年12月11日から平成15年12月10日）	6,997,961	33,163,463
第4計算期間 （平成15年12月11日から平成16年12月10日）	3,216,282	7,499,608
第5計算期間 （平成16年12月11日から平成17年12月12日）	2,141,311	10,982,714
第6計算期間 （平成17年12月13日から平成18年12月11日）	1,558,947	9,698,553
第7計算期間 （平成18年12月12日から平成19年12月10日）	4,622,034	21,786,858
第8計算期間 （平成19年12月11日から平成20年12月10日）	3,156,826	2,023,827
第9計算期間 （平成20年12月11日から平成21年12月10日）	12,330,470	264,447
第10計算期間 （平成21年12月11日から平成22年12月10日）	7,898,701	6,813,808
第11計算期間 （平成22年12月11日から平成23年12月12日）	3,762,083	2,281,953
第12計算期間 （平成23年12月13日から平成24年12月10日）	3,277,439	7,644,210
第13計算期間 （平成24年12月11日から平成25年12月10日）	1,421,607	6,642,695
第14計算期間 （平成25年12月11日から平成26年12月10日）	675,120	1,486,199
第15計算期間 （平成26年12月11日から平成27年12月10日）	617,975	1,558,465
第16計算期間中間期 （平成27年12月11日から平成28年6月10日）	181,113	18,051

（注）本邦外における設定・解約の実績はありません。

### 3【ファンドの経理状況】

1．当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（平成27年12月11日から平成28年6月10日まで）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。

## 中間財務諸表

【PRUグッドライフ2040】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 (平成27年12月10日現在)	当中間計算期間末 (平成28年6月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,620,289	1,529,979
親投資信託受益証券	40,603,839	38,883,615
流動資産合計	42,224,128	40,413,594
資産合計	42,224,128	40,413,594
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	18,424	17,344
未払委託者報酬	322,368	303,462
未払利息	-	4
その他未払費用	11,699	10,980
流動負債合計	352,491	331,790
負債合計	352,491	331,790
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	31,475,496	31,638,558
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	10,396,141	8,443,246
（分配準備積立金）	10,903,900	10,897,670
元本等合計	41,871,637	40,081,804
純資産合計	41,871,637	40,081,804
負債純資産合計	42,224,128	40,413,594

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自	平成26年12月11日 至 平成27年6月10日	自	平成27年12月11日 至 平成28年6月10日
<b>営業収益</b>				
受取利息		2		2
有価証券売買等損益		2,935,400		1,665,299
<b>営業収益合計</b>		<b>2,935,402</b>		<b>1,665,297</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		-		182
受託者報酬		18,504		17,344
委託者報酬		323,753		303,462
その他費用		11,758		10,980
<b>営業費用合計</b>		<b>354,015</b>		<b>331,968</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>		<b>2,581,387</b>		<b>1,997,265</b>
経常利益又は経常損失( )		2,581,387		1,997,265
<b>中間純利益又は中間純損失( )</b>		<b>2,581,387</b>		<b>1,997,265</b>
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )		44,565		1,203
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>		<b>9,525,062</b>		<b>10,396,141</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		95,489		49,125
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		95,489		49,125
剰余金減少額又は欠損金増加額		214,280		5,958
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		214,280		5,958
分配金		-		-
<b>中間剰余金又は中間欠損金( )</b>		<b>11,943,093</b>		<b>8,443,246</b>

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
-----------------	--

## (中間貸借対照表に関する注記)

前計算期間末 (平成27年12月10日現在)	当中間計算期間末 (平成28年6月10日現在)
1 1. 投資信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中解約元本額	1 1. 投資信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中解約元本額
期首元本額 32,415,986円	期首元本額 31,475,496円
期中追加設定元本額 617,975円	期中追加設定元本額 181,113円
期中解約元本額 1,558,465円	期中解約元本額 18,051円
2. 計算期間末日における受益権の総数 31,475,496口	2. 中間計算期間末日における受益権の総数 31,638,558口

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 平成26年12月11日 至 平成27年6月10日	当中間計算期間 自 平成27年12月11日 至 平成28年6月10日
1. 資産運用の権限を再委託又は一部再委託する場合の当該委託費用 38,019円	1. 資産運用の権限を再委託又は一部再委託する場合の当該委託費用 35,116円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	前計算期間末 （平成27年12月10日現在）	当中間計算期間末 （平成28年6月10日現在）
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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ぬ。	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	有価証券 「中間注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 デリバティブ取引等 該当事項はありませぬ。 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	有価証券 同左  デリバティブ取引等 同左 上記以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価格のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、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）

該当事項はありませぬ。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありませぬ。

## （1口当たり情報に関する注記）

前計算期間末 （平成27年12月10日現在）		当中間計算期間末 （平成28年6月10日現在）	
1口当たり純資産額	1,3303円	1口当たり純資産額	1,2669円
（1万口当たり純資産額	13,303円）	（1万口当たり純資産額	12,669円）

## (参考情報)

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

## 「PRU国内株式マザーファンド」の状況

なお、以下に掲載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

(単位：円)

区分	注記 番号	(平成27年12月10日現在)	(平成28年6月10日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		83,188,393	979,193,084
株式		2,338,540,440	3,009,624,210
未収入金		44,149,352	-
未収配当金		554,135	15,896,040
未収利息		22	-
前払金		1,585,000	32,000
差入委託証拠金		2,625,000	4,680,000
流動資産合計		2,470,642,342	4,009,425,334
資産合計		2,470,642,342	4,009,425,334
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,365,400	640,640
未払金		21,102,586	863,106,773
未払解約金		25,432,418	1,274,359
未払利息		-	2,682
流動負債合計		48,900,404	865,024,454
負債合計		48,900,404	865,024,454
純資産の部			
元本等			
元本	1	1,530,097,258	2,273,349,015
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		891,644,680	871,051,865
元本等合計		2,421,741,938	3,144,400,880
純資産合計		2,421,741,938	3,144,400,880
負債純資産合計		2,470,642,342	4,009,425,334



## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## （貸借対照表に関する注記）

（平成27年12月10日現在）	（平成28年6月10日現在）
1 1 . 本報告書における開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額 1,813,560,300円	1 1 . 本報告書における開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額 1,530,097,258円
同期中における追加設定元本額 290,452,822円	同期中における追加設定元本額 911,775,050円
同期中における解約元本額 573,915,864円	同期中における解約元本額 168,523,293円
同期末における元本の内訳 PRU国内株式マーケット・パフォーマー 56,635,125円	同中間期末における元本の内訳 PRU国内株式マーケット・パフォーマー 57,508,660円
PRUグッドライフ2020 882,302円	PRUグッドライフ2020 937,922円
PRUグッドライフ2030 1,933,876円	PRUグッドライフ2030 2,279,592円
PRUグッドライフ2040 8,346,721円	PRUグッドライフ2040 8,949,281円
PRUグッドライフ2020（年金） 80,882,038円	PRUグッドライフ2020（年金） 87,505,008円
PRUグッドライフ2030（年金） 310,646,524円	PRUグッドライフ2030（年金） 344,372,772円
PRUグッドライフ2040（年金） 357,621,420円	PRUグッドライフ2040（年金） 390,893,892円
PRUグッドライフ2050（年金） 31,247,897円	PRUグッドライフ2050（年金） 34,026,350円
ブルデンシャル私募国内株式マーケット・パ フォーマー（適格機関投資家向け） 674,099,794円	ブルデンシャル私募国内株式マーケット・パ フォーマー（適格機関投資家向け） 1,339,243,956円
ブルデンシャル私募国内株式・債券バランス ファンド（適格機関投資家向け） 7,801,561円	ブルデンシャル私募国内株式・債券バランス ファンド（適格機関投資家向け） 7,631,582円
計 1,530,097,258円	計 2,273,349,015円
2 . 本報告書における開示対象ファンドの 期末における当該親投資信託の受益権の 総数 1,530,097,258口	2 . 本報告書における開示対象ファンドの 中間計算期末における当該親投資信託の 受益権の総数 2,273,349,015口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成27年12月10日現在）	（平成28年6月10日現在）
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法	<p>有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引等 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。</p> <p>上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>有価証券 同左</p> <p>デリバティブ取引等 同左</p> <p>上記以外の金融商品 同左</p>
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価格のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

## 株式関連

（単位：円）

種類	（平成27年12月10日現在）			
	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引 株価指数先物取引 買建	79,340,400	-	76,975,000	2,365,400
合計	79,340,400	-	76,975,000	2,365,400

（単位：円）

種類	（平成28年6月10日現在）			
	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引 株価指数先物取引 買建	106,640,640	-	106,000,000	640,640
合計	106,640,640	-	106,000,000	640,640

## （注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## （1口当たり情報に関する注記）

（平成27年12月10日現在）		（平成28年6月10日現在）	
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額		本報告書における開示対象ファンドの中間計算期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額	
	1.5827円		1.3832円
（1万口当たり純資産額	15,827円）	（1万口当たり純資産額	13,832円）

## 「PRU国内債券マザーファンド」の状況

なお、以下に掲載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

(単位：円)

区分	注記 番号	(平成27年12月10日現在)	(平成28年6月10日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		57,314,845	33,879,141
国債証券		3,689,268,750	3,791,280,300
地方債証券		359,799,001	396,386,787
特殊債券		318,030,950	348,191,100
社債券		98,457,900	131,406,600
未収利息		15,581,064	15,425,834
前払費用		512,794	448,420
流動資産合計		4,538,965,304	4,717,018,182
資産合計		4,538,965,304	4,717,018,182
負債の部			
流動負債			
未払解約金		3,263,507	2,451,183
未払利息		-	92
流動負債合計		3,263,507	2,451,275
負債合計		3,263,507	2,451,275
純資産の部			
元本等			
元本	1	3,511,523,342	3,445,354,054
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		1,024,178,455	1,269,212,853
元本等合計		4,535,701,797	4,714,566,907
純資産合計		4,535,701,797	4,714,566,907
負債純資産合計		4,538,965,304	4,717,018,182

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## （貸借対照表に関する注記）

（平成27年12月10日現在）	（平成28年6月10日現在）
1 1 . 本報告書における開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額 3,303,692,439円	1 1 . 本報告書における開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額 3,511,523,342円
同期中における追加設定元本額 719,571,523円	同期中における追加設定元本額 290,676,749円
同期中における解約元本額 511,740,620円	同期中における解約元本額 356,846,037円
同期末における元本の内訳 PRU国内債券マーケット・パフォーマー 496,154,797円	同中間期末における元本の内訳 PRU国内債券マーケット・パフォーマー 494,063,249円
PRUグッドライフ2020 12,338,842円	PRUグッドライフ2020 11,996,687円
PRUグッドライフ2030 7,240,211円	PRUグッドライフ2030 7,352,665円
PRUグッドライフ2040 13,204,790円	PRUグッドライフ2040 12,116,200円
PRUグッドライフ2020（年金） 1,131,221,725円	PRUグッドライフ2020（年金） 1,119,321,438円
PRUグッドライフ2030（年金） 1,163,105,633円	PRUグッドライフ2030（年金） 1,110,832,115円
PRUグッドライフ2040（年金） 565,758,252円	PRUグッドライフ2040（年金） 529,251,778円
PRUグッドライフ2050（年金） 19,921,334円	PRUグッドライフ2050（年金） 18,774,374円
プルデンシャル私募国内株式・債券バランス ファンド（適格機関投資家向け） 9,661,792円	プルデンシャル私募国内株式・債券バランス ファンド（適格機関投資家向け） 8,003,467円
プルデンシャル私募国内債券マーケット・パ フォーマー（適格機関投資家向け） 92,915,966円	プルデンシャル私募国内債券マーケット・パ フォーマー（適格機関投資家向け） 133,642,081円
計 3,511,523,342円	計 3,445,354,054円
2 . 本報告書における開示対象ファンドの 期末における当該親投資信託の受益権の 総数 3,511,523,342口	2 . 本報告書における開示対象ファンドの 中間計算期末における当該親投資信託の 受益権の総数 3,445,354,054口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成27年12月10日現在）	（平成28年6月10日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 デリバティブ取引等 該当事項はありません。 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	有価証券 同左  デリバティブ取引等 同左 上記以外の金融商品 同左
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価格のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

（平成27年12月10日現在）		（平成28年6月10日現在）	
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額		本報告書における開示対象ファンドの中間計算期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額	
	1.2917円		1.3684円
（1万口当たり純資産額	12,917円）	（1万口当たり純資産額	13,684円）



## 「PRU海外株式マザーファンド」の状況

なお、以下に掲載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

(単位：円)

区分	注記 番号	(平成27年12月10日現在)	(平成28年6月10日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		122,548,643	103,531,765
コール・ローン		34,607,959	783,584,122
株式		3,486,275,297	3,727,630,231
投資証券		89,114,034	118,225,448
派生商品評価勘定		5,959,489	9,551,315
未収入金		21,304,323	247,725
未収配当金		7,026,141	7,368,842
未収利息		9	-
前払金		10,920,584	17,652,836
差入委託証拠金		21,207,862	9,533,308
流動資産合計		3,798,964,341	4,777,325,592
資産合計		3,798,964,341	4,777,325,592
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		26,972	872,847
未払金		-	666,165,114
未払解約金		40,009,299	11,150,411
未払利息		-	2,146
流動負債合計		40,036,271	678,190,518
負債合計		40,036,271	678,190,518
純資産の部			
元本等			
元本	1	1,812,759,869	2,173,855,245
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		1,946,168,201	1,925,279,829
元本等合計		3,758,928,070	4,099,135,074
純資産合計		3,758,928,070	4,099,135,074
負債純資産合計		3,798,964,341	4,777,325,592

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1．有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券 移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、または金融商品取引業者等から提示される気配相場等に基づいて評価しております。
2．デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は、最終相場によっております。 為替予約取引 原則としてわが国における計算期間末日の対顧客先物売買の仲値で評価しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令133号）第60条及び第61条に基づき処理しております。

## （貸借対照表に関する注記）

（平成27年12月10日現在）	（平成28年6月10日現在）
1 1 . 本報告書における開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	1 1 . 本報告書における開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額
2,218,092,839円	1,812,759,869円
同期中における追加設定元本額	同期中における追加設定元本額
220,755,285円	518,491,287円
同期中における解約元本額	同期中における解約元本額
626,088,255円	157,395,911円
同期末における元本の内訳	同中間期末における元本の内訳
PRU海外株式マーケット・パフォーマー	PRU海外株式マーケット・パフォーマー
1,051,834,582円	992,703,079円
PRUグッドライフ2020	PRUグッドライフ2020
405,349円	412,976円
PRUグッドライフ2030	PRUグッドライフ2030
886,930円	1,003,440円
PRUグッドライフ2040	PRUグッドライフ2040
3,830,734円	3,939,679円
PRUグッドライフ2020（年金）	PRUグッドライフ2020（年金）
37,163,023円	38,521,778円
PRUグッドライフ2030（年金）	PRUグッドライフ2030（年金）
142,503,684円	151,601,260円
PRUグッドライフ2040（年金）	PRUグッドライフ2040（年金）
164,131,088円	172,081,450円
PRUグッドライフ2050（年金）	PRUグッドライフ2050（年金）
14,336,324円	14,978,939円
プルデンシャル私募海外株式マーケット・パ フォーマー（適格機関投資家向け）	プルデンシャル私募海外株式マーケット・パ フォーマー（適格機関投資家向け）
397,668,155円	798,612,644円
計 1,812,759,869円	計 2,173,855,245円
2 . 本報告書における開示対象ファンドの 期末における当該親投資信託の受益権の 総数	2 . 本報告書における開示対象ファンドの 中間計算期末における当該親投資信託の 受益権の総数
1,812,759,869円	2,173,855,245円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成27年12月10日現在）	（平成28年6月10日現在）
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法	<p>有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引等 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。</p> <p>上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>有価証券 同左</p> <p>デリバティブ取引等 同左</p> <p>上記以外の金融商品 同左</p>
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価格のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

## 1. 株式関連

(単位：円)

種類	(平成27年12月10日現在)			
	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	188,364,776	-	194,268,907	5,904,131
合計	188,364,776	-	194,268,907	5,904,131

(単位：円)

種類	(平成28年6月10日現在)			
	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	181,953,959	-	187,540,900	5,586,941
合計	181,953,959	-	187,540,900	5,586,941

## (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

（単位：円）

種類	（平成27年12月10日現在）			
	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建				
アメリカドル	3,064,222	-	3,037,250	26,972
売建				
アメリカドル	12,182,000	-	12,149,000	33,000
カナダドル	1,229,041	-	1,216,414	12,627
スイスフラン	1,220,559	-	1,218,191	2,368
香港ドル	614,622	-	607,259	7,363
合計	18,310,444	-	18,228,114	28,386

（単位：円）

種類	（平成28年6月10日現在）			
	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建				
アメリカドル	720,000,000	-	723,683,296	3,683,296
カナダドル	28,538,147	-	28,594,000	55,853
ユーロ	96,752,352	-	96,800,000	47,648
イギリスポンド	61,814,358	-	61,912,000	97,642
スイスフラン	21,042,756	-	21,093,800	51,044
スウェーデンクローネ	7,582,702	-	7,580,600	2,102
ノルウェークローネ	1,966,101	-	1,966,500	399
デンマーククローネ	5,367,309	-	5,369,100	1,791
オーストラリアドル	21,436,472	-	21,424,500	11,972
香港ドル	6,875,934	-	6,895,000	19,066
シンガポールドル	2,368,572	-	2,372,700	4,128
イスラエルシェケル	833,793	-	837,300	3,507
売建				
アメリカドル	254,578,496	-	255,437,269	858,773
合計	1,229,156,992	-	1,233,966,065	3,091,527

（注）1．時価の算定方法

為替予約の時価

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

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

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

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

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

- (2) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値により評価しております。
2. 契約額等及び時価の合計欄の金額は各々の合計金額であります。
3. 換算においては円未満の端数は切り捨てております。

## (1口当たり情報に関する注記)

(平成27年12月10日現在)		(平成28年6月10日現在)	
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額		本報告書における開示対象ファンドの中間計算期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額	
	2.0736円		1.8857円
(1万口当たり純資産額	20,736円)	(1万口当たり純資産額	18,857円)



## 「PRU海外債券マザーファンド」の状況

なお、以下に掲載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

(単位：円)

区分	注記 番号	(平成27年12月10日現在)	(平成28年6月10日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		9,681,247	3,489,014
金銭信託		201,862	798,235
コール・ローン		52,882,440	56,758,809
国債証券		7,021,804,169	6,445,508,109
派生商品評価勘定		5,123,175	10,007,111
未収入金		-	33,318,709
未収利息		63,520,370	61,098,811
前払費用		1,748,349	2,568,869
流動資産合計		7,154,961,612	6,613,547,667
資産合計		7,154,961,612	6,613,547,667
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		4,796,649	11,502,507
未払解約金		30,507,976	23,242,008
未払利息		-	155
流動負債合計		35,304,625	34,744,670
負債合計		35,304,625	34,744,670
純資産の部			
元本等			
元本	1	3,053,855,221	3,049,613,743
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		4,065,801,766	3,529,189,254
元本等合計		7,119,656,987	6,578,802,997
純資産合計		7,119,656,987	6,578,802,997
負債純資産合計		7,154,961,612	6,613,547,667

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## （貸借対照表に関する注記）

（平成27年12月10日現在）	（平成28年6月10日現在）
1 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額
3,212,141,876円	3,053,855,221円
同期中における追加設定元本額	同期中における追加設定元本額
257,893,215円	108,555,156円
同期中における解約元本額	同期中における解約元本額
416,179,870円	112,796,634円
同期末における元本の内訳	同中間期末における元本の内訳
PRU海外債券マーケット・パフォーマー	PRU海外債券マーケット・パフォーマー
2,780,668,471円	2,764,552,399円
PRUグッドライフ2020	PRUグッドライフ2020
483,614円	485,030円
PRUグッドライフ2030	PRUグッドライフ2030
579,564円	688,045円
PRUグッドライフ2040	PRUグッドライフ2040
1,026,614円	1,157,053円
PRUグッドライフ2020（年金）	PRUグッドライフ2020（年金）
44,331,767円	45,262,640円
PRUグッドライフ2030（年金）	PRUグッドライフ2030（年金）
93,086,498円	103,909,538円
PRUグッドライフ2040（年金）	PRUグッドライフ2040（年金）
43,983,137円	50,548,801円
PRUグッドライフ2050（年金）	PRUグッドライフ2050（年金）
1,431,640円	1,885,727円
プルデンシャル私募海外債券マーケット・パフォーマー（適格機関投資家向け）	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）
88,263,916円	81,124,510円
計 3,053,855,221円	計 3,049,613,743円
2. 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の受益権の総数	2. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期末における当該親投資信託の受益権の総数
3,053,855,221円	3,049,613,743円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成27年12月10日現在）	（平成28年6月10日現在）
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法	<p>有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引等 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。</p> <p>上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>有価証券 同左</p> <p>デリバティブ取引等 同左</p> <p>上記以外の金融商品 同左</p>
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価格のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

通貨関連

(単位：円)

種類	(平成27年12月10日現在)			
	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建				
アメリカドル	256,850,699	-	257,140,923	290,224
カナダドル	8,509,594	-	8,299,872	209,722
メキシコペソ	15,971,350	-	15,460,247	511,103
ユーロ	17,641,210	-	17,844,216	203,006
イギリスポンド	11,148,931	-	11,020,092	128,839
スイスフラン	21,734,267	-	21,802,362	68,095
スウェーデンクローネ	14,691,585	-	14,703,024	11,439
ノルウェークローネ	2,868,463	-	2,817,765	50,698
デンマーククローネ	15,646,571	-	15,349,924	296,647
ポーランドズロチ	5,290,659	-	5,288,791	1,868
オーストラリアドル	14,458,101	-	14,653,143	195,042
シンガポールドル	17,470,927	-	17,409,052	61,875
売建				
アメリカドル	144,855,393	-	144,988,643	133,250
カナダドル	25,925,435	-	25,257,168	668,267
メキシコペソ	17,492,278	-	17,097,247	395,031
ユーロ	83,255,297	-	84,536,421	1,281,124
イギリスポンド	21,292,497	-	21,158,091	134,406
ノルウェークローネ	4,281,816	-	4,055,542	226,274
デンマーククローネ	19,989,445	-	20,312,349	322,904
ポーランドズロチ	19,419,653	-	18,825,890	593,763
オーストラリアドル	2,305,413	-	2,376,370	70,957
シンガポールドル	17,366,903	-	17,235,381	131,522
南アフリカランド	6,340,522	-	5,680,490	660,032
合計	764,807,009	-	763,313,003	508,114

（単位：円）

種類	（平成28年6月10日現在）			
	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建				
アメリカドル	296,594,995	-	288,243,473	8,351,522
カナダドル	25,706,366	-	25,518,597	187,769
メキシコペソ	3,327,455	-	3,045,533	281,922
ユーロ	18,475,669	-	17,890,104	585,565
イギリスポンド	11,351,665	-	10,892,146	459,519
スイスフラン	20,256,645	-	19,595,511	661,134
スウェーデンクローネ	10,624,373	-	10,268,942	355,431
ノルウェークローネ	506,534	-	500,692	5,842
デンマーククローネ	2,686,250	-	2,645,960	40,290
ポーランドズロチ	1,808,036	-	1,762,884	45,152
オーストラリアドル	10,515,808	-	10,101,640	414,168
売建				
アメリカドル	135,595,130	-	132,540,192	3,054,938
カナダドル	1,775,716	-	1,763,748	11,968
メキシコペソ	4,814,138	-	4,447,347	366,791
ユーロ	177,589,369	-	172,773,466	4,815,903
イギリスポンド	9,510,115	-	9,375,882	134,233
スウェーデンクローネ	7,215,529	-	7,074,791	140,738
ノルウェークローネ	1,175,797	-	1,158,975	16,822
デンマーククローネ	4,647,258	-	4,497,971	149,287
ポーランドズロチ	14,540,746	-	14,031,694	509,052
オーストラリアドル	6,740,638	-	6,398,756	341,882
南アフリカランド	3,946,581	-	3,688,634	257,947
合計	769,404,813	-	748,216,938	1,588,753

## (注) 1. 時価の算定方法

## 為替予約の時価

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

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

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

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

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

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

2. 契約額等及び時価の合計欄の金額は各々の合計金額であります。

3. 換算においては円未満の端数は切り捨てております。

(単位：アメリカドル)

種類	(平成27年12月10日現在)			
	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引 直物為替先渡取引 売建 マレーシアリングット	65,637.51 (7,974,957)	- (-)	67,132.06 (8,156,545)	1,494.55 (181,588)
合計 (邦貨換算額)	65,637.51 (7,974,957)	- (-)	67,132.06 (8,156,545)	1,494.55 (181,588)

(単位：アメリカドル)

種類	(平成28年6月10日現在)			
	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引 直物為替先渡取引 売建 マレーシアリングット	71,606.79 (7,669,087)	- (-)	70,735.11 (7,575,730)	871.68 (93,357)
合計 (邦貨換算額)	71,606.79 (7,669,087)	- (-)	70,735.11 (7,575,730)	871.68 (93,357)

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

(平成27年12月10日現在)		(平成28年6月10日現在)	
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額		本報告書における開示対象ファンドの中間計算期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額	
	2.3314円		2.1573円
(1万口当たり純資産額	23,314円)	(1万口当たり純資産額	21,573円)



## 4【委託会社等の概況】

### (1)【資本金の額】

平成28年7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)【事業の内容及び営業の状況】

「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136兆円（12,179億米ドル、円換算レート1米ドル=112.39円、平成28年3月末現在）にのびります。グループの運用部門は、ポートフォリオ・マネジャーとアナリストを世界に配し、グローバルな運用を行っています。

なお、平成28年7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36本、純資産総額の合計金額は約1兆9,672億円です。以下はその種類別の内訳です。

追加型株式投資信託	33本
単位型株式投資信託	3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)【その他】

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。

## 5【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。

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

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期事業年度(平成27年4月1日から平成28年3月31日まで)の財務諸表について、PwCあらた監査法人により監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：千円 )

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

（単位：千円）

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

(単位：千円)

	第9期 (平成27年3月31日)	第10期 (平成28年3月31日)
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	219,000	219,000
資本剰余金	149,000	149,000
資本準備金	149,000	149,000
利益剰余金	1,139,997	1,516,000
利益準備金	54,750	54,750
その他利益剰余金	1,085,247	1,461,250
繰越利益剰余金	1,085,247	1,461,250
株主資本合計	1,507,997	1,884,000
純資産合計	1,507,997	1,884,000
負債・純資産合計	4,626,255	4,743,591

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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



## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第9期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

第10期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

## 重要な会計方針

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

## 注記事項

(貸借対照表関係)

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

## （株主資本等変動計算書関係）

第9期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）				
1．発行済株式の種類及び総数に関する事項				
株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
	（株）	（株）	（株）	（株）
普通株式	7,360	-	-	7,360

2．配当に関する事項					
決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額 （千円）	基準日	効力発生日
平成26年6月24日 株主総会	普通株式	736,000	100	平成26年 3月31日	平成26年 6月24日
平成26年12月19日 取締役会	普通株式	736,000	100	平成26年 9月30日	平成26年 12月19日

第10期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）				
1．発行済株式の種類及び総数に関する事項				
株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
	（株）	（株）	（株）	（株）
普通株式	7,360	-	-	7,360

2．配当に関する事項					
決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額 （千円）	基準日	効力発生日
平成27年6月25日 株主総会	普通株式	736,000	100	平成27年 3月31日	平成27年 6月25日
平成27年12月22日 取締役会	普通株式	220,800	30	平成27年 9月30日	平成27年 12月22日

## （金融商品関係）

第9期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	第10期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）																																																
<p>1. 金融商品の状況に関する事項</p> <p>(1) 金融商品に対する取組方針</p> <p>当社は主として国内の機関投資家を顧客とする投資一任業務を行っております。財務体質を毀損させようおそれのある投機的な金融商品取引を行わないこととしております。</p> <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制</p> <p>現金及び預金並びに営業債権である未収運用受託報酬は、預入先金融機関および顧客の信用リスクに晒されております。また、それらのうち外貨建てのものは為替の変動リスクに晒されております。</p> <p>営業債務である未払費用のうち外貨建てのものは為替の変動リスクに晒されております。</p> <p>顧客の信用リスクについては、顧客からの預り資産残高の推移等に基づいてモニターしております。</p> <p>外貨建債権・債務については、その残高および為替相場の変動による影響を定期的にモニターしております。</p> <p>2. 金融商品の時価等に関する事項</p> <p>平成27年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th></th> <th style="text-align: center;">貸借対照表計上額 (千円)</th> <th style="text-align: center;">時価 (千円)</th> <th style="text-align: center;">差額 (千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>(1) 現金及び預金</td> <td style="text-align: right;">1,731,947</td> <td style="text-align: right;">1,731,947</td> <td style="text-align: center;">-</td> </tr> <tr> <td>(2) 未収運用受託報酬</td> <td style="text-align: right;">2,271,378</td> <td style="text-align: right;">2,271,378</td> <td style="text-align: center;">-</td> </tr> <tr> <td>資産計</td> <td style="text-align: right;">4,003,325</td> <td style="text-align: right;">4,003,325</td> <td style="text-align: center;">-</td> </tr> <tr> <td>(1) 未払費用</td> <td style="text-align: right;">2,065,067</td> <td style="text-align: right;">2,065,067</td> <td style="text-align: center;">-</td> </tr> <tr> <td>負債計</td> <td style="text-align: right;">2,065,067</td> <td style="text-align: right;">2,065,067</td> <td style="text-align: center;">-</td> </tr> </tbody> </table>		貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)	(1) 現金及び預金	1,731,947	1,731,947	-	(2) 未収運用受託報酬	2,271,378	2,271,378	-	資産計	4,003,325	4,003,325	-	(1) 未払費用	2,065,067	2,065,067	-	負債計	2,065,067	2,065,067	-	<p>1. 金融商品の状況に関する事項</p> <p>(1) 金融商品に対する取組方針</p> <p>当社は主として国内の機関投資家を顧客とする投資一任業務を行っております。財務体質を毀損させようおそれのある投機的な金融商品取引を行わないこととしております。</p> <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制</p> <p>現金及び預金並びに営業債権である未収運用受託報酬は、預入先金融機関および顧客の信用リスクに晒されております。また、それらのうち外貨建てのものは為替の変動リスクに晒されております。</p> <p>営業債務である未払費用のうち外貨建てのものは為替の変動リスクに晒されております。</p> <p>顧客の信用リスクについては、顧客からの預り資産残高の推移等に基づいてモニターしております。</p> <p>外貨建債権・債務については、その残高および為替相場の変動による影響を定期的にモニターしております。</p> <p>2. 金融商品の時価等に関する事項</p> <p>平成28年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th></th> <th style="text-align: center;">貸借対照表計上額 (千円)</th> <th style="text-align: center;">時価 (千円)</th> <th style="text-align: center;">差額 (千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>(1) 現金及び預金</td> <td style="text-align: right;">1,437,601</td> <td style="text-align: right;">1,437,601</td> <td style="text-align: center;">-</td> </tr> <tr> <td>(2) 未収運用受託報酬</td> <td style="text-align: right;">2,549,299</td> <td style="text-align: right;">2,549,299</td> <td style="text-align: center;">-</td> </tr> <tr> <td>資産計</td> <td style="text-align: right;">3,986,900</td> <td style="text-align: right;">3,986,900</td> <td style="text-align: center;">-</td> </tr> <tr> <td>(1) 未払費用</td> <td style="text-align: right;">1,533,217</td> <td style="text-align: right;">1,533,217</td> <td style="text-align: center;">-</td> </tr> <tr> <td>負債計</td> <td style="text-align: right;">1,533,217</td> <td style="text-align: right;">1,533,217</td> <td style="text-align: center;">-</td> </tr> </tbody> </table>		貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)	(1) 現金及び預金	1,437,601	1,437,601	-	(2) 未収運用受託報酬	2,549,299	2,549,299	-	資産計	3,986,900	3,986,900	-	(1) 未払費用	1,533,217	1,533,217	-	負債計	1,533,217	1,533,217	-
	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)																																														
(1) 現金及び預金	1,731,947	1,731,947	-																																														
(2) 未収運用受託報酬	2,271,378	2,271,378	-																																														
資産計	4,003,325	4,003,325	-																																														
(1) 未払費用	2,065,067	2,065,067	-																																														
負債計	2,065,067	2,065,067	-																																														
	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)																																														
(1) 現金及び預金	1,437,601	1,437,601	-																																														
(2) 未収運用受託報酬	2,549,299	2,549,299	-																																														
資産計	3,986,900	3,986,900	-																																														
(1) 未払費用	1,533,217	1,533,217	-																																														
負債計	1,533,217	1,533,217	-																																														

第9期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第10期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)																
<p>(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項</p> <p><u>資産</u></p> <p>(1) 現金及び預金、(2) 未収運用受託報酬</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p><u>負債</u></p> <p>(1) 未払費用</p> <p>これは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>(注2) 金銭債権の決算日後の回収予定額</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th></th> <th style="text-align: center;">1年以内(千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>現金及び預金</td> <td style="text-align: right;">1,731,947</td> </tr> <tr> <td>未収運用受託報酬</td> <td style="text-align: right;">2,271,378</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">合計</td> <td style="text-align: right;">4,003,325</td> </tr> </tbody> </table>		1年以内(千円)	現金及び預金	1,731,947	未収運用受託報酬	2,271,378	合計	4,003,325	<p>(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項</p> <p><u>資産</u></p> <p>(1) 現金及び預金、(2) 未収運用受託報酬</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p><u>負債</u></p> <p>(1) 未払費用</p> <p>これは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>(注2) 金銭債権の決算日後の回収予定額</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th></th> <th style="text-align: center;">1年以内(千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>現金及び預金</td> <td style="text-align: right;">1,437,601</td> </tr> <tr> <td>未収運用受託報酬</td> <td style="text-align: right;">2,549,299</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">合計</td> <td style="text-align: right;">3,986,900</td> </tr> </tbody> </table>		1年以内(千円)	現金及び預金	1,437,601	未収運用受託報酬	2,549,299	合計	3,986,900
	1年以内(千円)																
現金及び預金	1,731,947																
未収運用受託報酬	2,271,378																
合計	4,003,325																
	1年以内(千円)																
現金及び預金	1,437,601																
未収運用受託報酬	2,549,299																
合計	3,986,900																

## （退職給付関係）

第9期  
（自 平成26年4月1日  
至 平成27年3月31日）

## 1．採用している退職給付制度の概要

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

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

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

## 2．簡便法を適用した確定給付制度

## (1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

## (3) 退職給付費用

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

第10期  
（自 平成27年4月1日  
至 平成28年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

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

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

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

2．簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用

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

## （税効果会計関係）

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



第9期 (平成27年3月31日)	第10期 (平成28年3月31日)
<p>3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.6%から平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.1%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、32.3%となります。</p> <p>この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は22,239千円減少し、法人税等調整額が同額増加しております。</p>	<p>3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立したことに伴い、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の33.1%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.9%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、30.6%となります。</p> <p>この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は16,235千円減少し、法人税等調整額が同額増加しております。</p>

## （資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## 1．当該資産除去債務の概要

本社として使用する事務所の定期建物賃貸借契約（契約期間15年）に伴う原状回復義務等があります。

## 2．当該資産除去債務の金額の算定方法

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

## 3．当該資産除去債務の総額の増減

	第9期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	第10期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）
期首残高	61,968千円	62,838千円
有形固定資産の取得に伴う増加額	- 千円	- 千円
時の経過による調整額	869千円	899千円
資産除去債務の履行による減少額	- 千円	- 千円
その他増減額（ は減少）	- 千円	8,372千円
期末残高	62,838千円	72,109千円

## （セグメント情報等）

## 〔セグメント情報〕

第9期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

なお、前事業年度についても当社は資産運用業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

## 〔関連情報〕

第9期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

（単位：千円）

日本	ケイマン	その他	合計
7,278,740	1,328,867	172,801	8,780,409

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益	関連するセグメント名
ジブラルタ生命保険株式会社	5,181,489	資産運用業
ブルデンシャル生命保険株式会社	1,254,905	資産運用業
A社	1,328,867	資産運用業

なお、A社に関しては、同社との守秘義務契約遵守のため、顧客の名称の開示を省略しております。

## 〔セグメント情報〕

第10期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

なお、前事業年度についても当社は資産運用業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

## 〔関連情報〕

第10期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

（単位：千円）

日本	ケイマン	その他	合計
8,553,185	1,219,902	178,837	9,951,925

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益	関連するセグメント名
ジブラルタ生命保険株式会社	5,567,297	資産運用業
ブルデンシャル生命保険株式会社	1,409,295	資産運用業
A社	1,219,902	資産運用業

なお、A社に関しては、同社との守秘義務契約遵守のため、顧客の名称の開示を省略しております。

## （関連当事者情報）

第9期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

## 1．関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有〔被所有〕割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	Prudential Financial, Inc.	Broad Street, Newark, New Jersey, USA	6百万米ドル	金融サービス業	〔被所有〕間接100%	親会社株式によるストック・オプション等（注1）	福利厚生費	20,761	未払費用	552
									長期未払費用	47,453

## (2) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有〔被所有〕割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社の 子会社	プルデンシャル生命保険株式会社	東京都千代田区永田町	29,000百万円	生命保険業	無し	投資顧問契約	運用受託報酬の受取（注2）	1,254,905	未収運用受託報酬	379,708
親会社の 子会社	ジブラルタ生命保険株式会社	東京都千代田区永田町	75,500百万円	生命保険業	無し	投資顧問契約	運用受託報酬の受取（注2）	5,181,489	未収運用受託報酬	1,442,444
親会社の 子会社	Prudential Investment Management, Inc.	Mulberry Street Gateway Center Three, Newark, New Jersey, USA	98米ドル	投信・投資顧問業	無し	投資顧問業務の再委託契約等	投資顧問報酬の支払（注2）	4,418,361	未払費用	1,809,336
						サービス契約	サービス料	169,508	未収収益	39,413

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

## 取引の条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2．親会社に関する注記

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

Prudential International Investments Corporation

第10期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

## 1．関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有〔被所有〕割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	Prudential Financial, Inc.	Broad Street, Newark, New Jersey, USA	6百万米ドル	金融サービス業	〔被所有〕間接100%	親会社株式によるストック・オプション等（注1）	福利厚生費	46,879	未払費用	392
									長期未払費用	46,487

## (2) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有〔被所有〕割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社の子会社	ブルデンシャル生命保険株式会社	東京都千代田区永田町	29,000百万円	生命保険業	無し	投資顧問契約	運用受託報酬の受取（注2）	1,409,295	未収運用受託報酬	399,300
親会社の子会社	ジブラルタ生命保険株式会社	東京都千代田区永田町	75,500百万円	生命保険業	無し	投資顧問契約	運用受託報酬の受取（注2）	5,567,297	未収運用受託報酬	1,383,497
親会社の子会社	PGIM, Inc.	Mulberry Street Gateway Center Three, Newark, New Jersey, USA	98米ドル	投信・投資顧問業	無し	投資顧問業務の再委託契約等	投資顧問報酬の支払（注2）	5,058,307	未払費用	1,368,688
						サービス契約	サービス料	178,837	未収収益	36,735

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

取引の条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2．親会社に関する注記

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

Prudential International Investments Corporation

## (1株当たり情報)

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

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月20日

プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社

取締役会 御中

## P W C あ ら た 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 大 畑 茂  
業務執行社員指定社員 公認会計士 男 澤 顕  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているプルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第10期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

- ( ) 1. 上記は、当社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成28年8月3日

プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社

取締役会 御中

P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員

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の平成27年12月11日から平成28年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、PRUグッドライフ2040の平成28年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成27年12月11日から平成28年6月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- 
- ( ) 1. 上記は、当社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。