# 【表紙】

| | |
|---|---|
| 【提出書類】 | 半期報告書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 平成26年９月12日 |
| 【計算期間】 | 第５期中<br>（自　平成25年12月17日　至　平成26年６月16日） |
| 【ファンド名】 | ＰＲＵグッドライフ２０５０（年金） |
| 【発行者名】 | プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・<br>ジャパン株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 代表取締役社長　　新田　恭久 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区永田町二丁目13番10号<br>プルデンシャルタワー |
| 【事務連絡者氏名】 | 宮島　靖郎 |
| 【連絡場所】 | 東京都千代田区永田町二丁目13番10号<br>プルデンシャルタワー |
| 【電話番号】 | 03-6832-7150 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません |

# １【ファンドの運用状況】

## （１）【投資状況】

（平成26年７月31日現在）

| 投資資産の種類 | | 時価（円） | 投資比率（％） |
|---|---|---|---|
| 投資信託受益証券<br>（ＰＲＵ国内株式マザーファンド） | 日本 | 41,613,431 | 47.77 |
| 投資信託受益証券<br>（ＰＲＵ国内債券マザーファンド） | 日本 | 16,464,130 | 18.90 |
| 投資信託受益証券<br>（ＰＲＵ海外株式マザーファンド） | 日本 | 25,874,483 | 29.70 |
| 投資信託受益証券<br>（ＰＲＵ海外債券マザーファンド） | 日本 | 1,405,901 | 1.61 |
| 現金、預金、その他の資産（負債控除後） | | 1,762,332 | 2.02 |
| 合計（純資産総額） | | 87,120,277 | 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26年７月31日現在）

| 投資資産の種類 | | 時価（円） | 投資比率（％） |
|---|---|---|---|
| 株式 | 日本 | 2,383,588,430 | 96.27 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 92,224,109 | 3.72 |
| 合計（純資産総額） | | 2,475,812,539 | 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26年７月31日現在）

| 投資資産の種類 | | 時価（円） | 投資比率（％） |
|---|---|---|---|
| 国債証券 | 日本 | 3,439,410,600 | 85.10 |
| 地方債証券 | 日本 | 268,017,301 | 6.63 |
| 特殊債券 | 日本 | 216,611,290 | 5.36 |
| 社債券 | 日本 | 78,815,000 | 1.95 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 38,819,129 | 0.96 |
| 合計（純資産総額） | | 4,041,673,320 | 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26年７月31日現在）**

| 投資資産の種類 | | 時価（円） | 投資比率（％） |
|---|---|---|---|
| 株式 | アメリカ | 2,490,063,065 | 53.62 |
| | イギリス | 406,839,666 | 8.76 |
| | カナダ | 209,029,851 | 4.50 |
| | スイス | 191,774,140 | 4.13 |
| | フランス | 176,574,731 | 3.80 |
| | ドイツ | 174,986,673 | 3.77 |
| | オーストラリア | 146,273,260 | 3.15 |
| | スペイン | 71,844,553 | 1.55 |
| | オランダ | 68,423,838 | 1.47 |
| | スウェーデン | 59,369,401 | 1.28 |
| | 香港 | 49,662,060 | 1.07 |
| | イタリア | 46,906,384 | 1.01 |
| | アイルランド | 42,533,291 | 0.92 |
| | シンガポール | 30,833,483 | 0.66 |
| | デンマーク | 29,058,303 | 0.63 |
| | ベルギー | 23,950,974 | 0.52 |
| | ジャージー | 20,882,050 | 0.45 |
| | キュラソー | 20,482,333 | 0.44 |
| | フィンランド | 17,503,695 | 0.38 |
| | バミューダ | 16,268,731 | 0.35 |
| | ノルウェー | 14,156,013 | 0.30 |
| | イスラエル | 11,311,234 | 0.24 |
| | ルクセンブルク | 7,383,375 | 0.16 |
| | ケイマン島 | 5,210,209 | 0.11 |
| | オーストリア | 4,760,283 | 0.10 |
| | ポルトガル | 2,943,548 | 0.06 |
| | パナマ | 2,368,923 | 0.05 |
| | ニュージーランド | 2,207,449 | 0.05 |
| | 英ヴァージン諸島 | 2,115,367 | 0.05 |
| | リベリア | 1,271,226 | 0.03 |
| | ガーンジー | 1,015,723 | 0.02 |
| | マン島 | 769,285 | 0.02 |
| | モーリシャス | 294,493 | 0.00 |

| 投資資産の種類 | | 時価（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカ | 67,482,980 | 1.45 |
| | オーストラリア | 9,259,589 | 0.20 |
| | フランス | 6,016,507 | 0.13 |
| | イギリス | 5,853,460 | 0.13 |
| | 香港 | 1,739,697 | 0.04 |
| | カナダ | 1,221,717 | 0.03 |
| | シンガポール | 1,154,341 | 0.02 |
| | オランダ | 601,621 | 0.01 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 201,249,467 | 4.33 |
| 合計（純資産総額） | | 4,643,646,989 | 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26年７月31日現在）

| 投資資産の種類 | | 時価（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 国債証券 | アメリカ | 2,473,640,005 | 36.11 |
| | イタリア | 781,412,564 | 11.41 |
| | フランス | 746,311,382 | 10.89 |
| | ドイツ | 645,333,305 | 9.42 |
| | イギリス | 533,313,476 | 7.79 |
| | スペイン | 375,554,886 | 5.48 |
| | ベルギー | 219,752,834 | 3.21 |
| | オランダ | 194,556,448 | 2.84 |
| | カナダ | 139,985,327 | 2.04 |
| | オーストリア | 121,249,823 | 1.77 |
| | オーストラリア | 101,696,918 | 1.48 |
| | メキシコ | 82,080,069 | 1.20 |
| | デンマーク | 65,017,311 | 0.95 |
| | アイルランド | 62,386,902 | 0.91 |
| | 南アフリカ | 40,594,835 | 0.59 |
| | マレーシア | 37,415,986 | 0.55 |
| | フィンランド | 29,484,292 | 0.43 |
| | ポーランド | 26,230,396 | 0.38 |
| | 小計 | 6,676,016,759 | 97.46 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 174,076,704 | 2.54 |
| 合計（純資産総額） | | 6,850,093,463 | 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】**

**①【純資産の推移】**

| | 純資産総額（円） | １万口当たりの純資産額（基準価額）（円） |
|---|---|---|
| 第１計算期間末　（分配付） | 1,040,719 | 10,407 |
| （平成22年12月15日）　（分配落） | 1,040,719 | 10,407 |
| 第２計算期間末　（分配付） | 16,157,015 | 9,011 |
| （平成23年12月15日）　（分配落） | 16,157,015 | 9,011 |
| 第３計算期間末　（分配付） | 25,185,193 | 10,391 |
| （平成24年12月17日）　（分配落） | 25,185,193 | 10,391 |
| 平成25年７月末日 | 54,943,364 | 13,609 |
| 平成25年８月末日 | 52,124,782 | 13,395 |
| 平成25年９月末日 | 69,441,348 | 14,154 |
| 平成25年10月末日 | 71,043,421 | 14,365 |
| 平成25年11月末日 | 71,871,653 | 14,988 |
| 第４計算期間末　（分配付） | 75,348,281 | 14,686 |
| （平成25年12月16日）　（分配落） | 75,348,281 | 14,686 |
| 平成25年12月末日 | 79,567,138 | 15,449 |
| 平成26年１月末日 | 78,405,418 | 14,723 |
| 平成26年２月末日 | 77,374,422 | 14,819 |
| 平成26年３月末日 | 76,673,429 | 14,876 |
| 平成26年４月末日 | 79,206,632 | 14,693 |
| 平成26年５月末日 | 81,489,479 | 14,975 |
| 平成26年６月末日 | 80,576,213 | 15,390 |
| 平成26年７月末日 | 87,120,277 | 15,604 |

**②【分配の推移】**

| 決算期 | | １万口当たりの分配金（円） |
|---|---|---|
| 第１計算期間末 | 平成22年12月15日 | 0 |
| 第２計算期間末 | 平成23年12月15日 | 0 |
| 第３計算期間末 | 平成24年12月17日 | 0 |
| 第４計算期間末 | 平成25年12月16日 | 0 |

**③【収益率の推移】**

| 期間 | 収益率（%） |
|---|---|
| 第１計算期間<br>（平成22年６月16日から平成22年12月15日） | 4.1 |
| 第２計算期間<br>（平成22年12月16日から平成23年12月15日） | △13.4 |
| 第３計算期間<br>（平成23年12月16日から平成24年12月17日） | 15.3 |
| 第４計算期間<br>（平成24年12月18日から平成25年12月16日） | 41.3 |
| 第５計算期間中間期<br>（平成25年12月17日から平成26年６月16日） | 3.6 |

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

## 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<br>（平成22年６月16日から平成22年12月15日） | 1,000,000 | － |
| 第２計算期間<br>（平成22年12月16日から平成23年12月15日） | 34,270,416 | 17,340,588 |
| 第３計算期間<br>（平成23年12月16日から平成24年12月17日） | 11,996,274 | 5,689,418 |
| 第４計算期間<br>（平成24年12月18日から平成25年12月16日） | 45,821,094 | 18,749,898 |
| 第５計算期間中間期<br>（平成25年12月17日から平成26年６月16日） | 14,592,510 | 12,692,307 |

（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25年12月17日から平成26年６月16日まで）について、あらた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２０５０（年金）】

### （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 前計算期間末<br>(平成25年12月16日現在) | 当中間計算期間末<br>(平成26年６月16日現在) |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 2,618,437 | 2,016,500 |
| 親投資信託受益証券 | 72,990,176 | 79,262,136 |
| 未収利息 | 2 | 1 |
| 流動資産合計 | 75,608,615 | 81,278,637 |
| 資産合計 | 75,608,615 | 81,278,637 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払受託者報酬 | 25,026 | 33,389 |
| 未払委託者報酬 | 218,960 | 292,098 |
| その他未払費用 | 16,348 | 21,583 |
| 流動負債合計 | 260,334 | 347,070 |
| 負債合計 | 260,334 | 347,070 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 51,307,880 | 53,208,083 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 24,040,401 | 27,723,484 |
| （分配準備積立金） | 9,640,331 | 7,556,613 |
| 元本等合計 | 75,348,281 | 80,931,567 |
| 純資産合計 | 75,348,281 | 80,931,567 |
| 負債純資産合計 | 75,608,615 | 81,278,637 |

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 前中間計算期間<br>自　平成24年12月18日<br>至　平成25年６月17日 | 当中間計算期間<br>自　平成25年12月17日<br>至　平成26年６月16日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 95 | 254 |
| 有価証券売買等損益 | 6,236,480 | 2,790,956 |
| 営業収益合計 | 6,236,575 | 2,791,210 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 13,635 | 33,389 |
| 委託者報酬 | 119,235 | 292,098 |
| その他費用 | 8,844 | 21,583 |
| 営業費用合計 | 141,714 | 347,070 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 6,094,861 | 2,444,140 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 6,094,861 | 2,444,140 |
| 中間純利益又は中間純損失（△） | 6,094,861 | 2,444,140 |
| 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（△） | 2,282,572 | △51,923 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 948,509 | 24,040,401 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 5,636,491 | 7,182,210 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 5,636,491 | 7,182,210 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,162,837 | 5,995,190 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,162,837 | 5,995,190 |
| 分配金 | － | － |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 9,234,452 | 27,723,484 |

**（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<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。 |

**（中間貸借対照表に関する注記）**

| 前計算期間末<br>（平成25年12月16日現在） | 当中間計算期間末<br>（平成26年６月16日現在） |
|---|---|
| ※１１．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<br>期首元本額　24,236,684円<br>期中追加設定元本額　45,821,094円<br>期中解約元本額　18,749,898円<br>２．計算期間末日における受益権の総数<br>51,307,880口 | ※１１．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<br>期首元本額　51,307,880円<br>期中追加設定元本額　14,592,510円<br>期中解約元本額　12,692,307円<br>２．中間計算期間末日における受益権の総数<br>53,208,083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<br>自　平成24年12月18日<br>至　平成25年６月17日 | 当中間計算期間<br>自　平成25年12月17日<br>至　平成26年６月16日 |
|---|---|
| ※１．資産運用の権限を再委託又は一部再委託する場合の当該委託費用<br>5,426円 | ※１．資産運用の権限を再委託又は一部再委託する場合の当該委託費用<br>12,680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<br>（平成25年12月16日現在） | 当中間計算期間末<br>（平成26年６月16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ん。 | 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ん。 |
| 2.時価の算定方法 | ①　有価証券<br>「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。<br>②　デリバティブ取引等<br>該当事項はありません。<br>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。 | ①　有価証券<br>同左<br>②　デリバティブ取引等<br>同左<br>③　上記以外の金融商品<br>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）**

| 前計算期間末<br>（平成25年12月16日現在） | | 当中間計算期間末<br>（平成26年６月16日現在） | |
|---|---|---|---|
| １口当たり純資産額 | 1.4686円 | １口当たり純資産額 | 1.5210円 |
| （１万口当たり純資産額 | 14,686円） | （１万口当たり純資産額 | 15,210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25年12月16日現在) | (平成26年６月16日現在) |
|---|---|---|---|
| | | 金額 | 金額 |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 73,870,237 | 54,734,512 |
| 株式 | | 2,419,839,220 | 2,373,758,300 |
| 新株予約権証券 | | 125,100 | ― |
| 未収配当金 | | 337,442 | 19,496,149 |
| 未収利息 | | 60 | 29 |
| 前払金 | | 675,000 | ― |
| 差入委託証拠金 | | 2,790,000 | 1,875,000 |
| 流動資産合計 | | 2,497,637,059 | 2,449,863,990 |
| 資産合計 | | 2,497,637,059 | 2,449,863,990 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 1,611,300 | 210,400 |
| 前受金 | | ― | 595,000 |
| 未払解約金 | | 1,140,485 | 3,778,539 |
| 流動負債合計 | | 2,751,785 | 4,583,939 |
| 負債合計 | | 2,751,785 | 4,583,939 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | ※１ | 2,052,226,960 | 1,971,297,765 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（△） | | 442,658,314 | 473,982,286 |
| 元本等合計 | | 2,494,885,274 | 2,445,280,051 |
| 純資産合計 | | 2,494,885,274 | 2,445,280,051 |
| 負債純資産合計 | | 2,497,637,059 | 2,449,863,990 |

**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** | **株式及び新株予約権証券**<br>**移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。**<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）**

| （平成25年12月16日現在） | （平成26年６月16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<br>2,492,948,412円<br>同期中における追加設定元本額<br>504,994,470円<br>同期中における解約元本額<br>945,715,922円<br>同期末における元本の内訳<br>PRU国内株式マーケット・パフォーマー<br>82,442,188円<br>PRUグッドライフ2020<br>2,608,051円<br>PRUグッドライフ2030<br>3,492,699円<br>PRUグッドライフ2040<br>11,457,733円<br>PRUグッドライフ2020（年金）<br>140,928,902円<br>PRUグッドライフ2030（年金）<br>407,148,713円<br>PRUグッドライフ2040（年金）<br>429,681,327円<br>PRUグッドライフ2050（年金）<br>30,819,255円<br>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）<br>925,161,372円<br>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）<br>18,486,720円<br>計　2,052,226,960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<br>2,052,226,960円<br>同期中における追加設定元本額<br>190,432,792円<br>同期中における解約元本額<br>271,361,987円<br>同中間期末における元本の内訳<br>PRU国内株式マーケット・パフォーマー<br>73,584,069円<br>PRUグッドライフ2020<br>2,388,343円<br>PRUグッドライフ2030<br>3,092,916円<br>PRUグッドライフ2040<br>11,164,144円<br>PRUグッドライフ2020（年金）<br>130,120,029円<br>PRUグッドライフ2030（年金）<br>400,202,105円<br>PRUグッドライフ2040（年金）<br>422,430,753円<br>PRUグッドライフ2050（年金）<br>31,147,381円<br>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）<br>883,601,183円<br>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）<br>13,566,842円<br>計　1,971,297,765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<br>2,052,226,960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<br>1,971,297,765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25年12月16日現在） | （平成26年６月16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 | 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。<br>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。<br>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。 | ①　有価証券<br>同左<br>②　デリバティブ取引等<br>同左<br>③　上記以外の金融商品<br>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）**

**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25年12月16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 | 75,351,300 | － | 73,740,000 | △1,611,300 |
| 合計 | 75,351,300 | － | 73,740,000 | △1,611,300 |

**（単位：円）**

| 種類 | （平成26年６月16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 | 61,885,400 | － | 61,675,000 | △210,400 |
| 合計 | 61,885,400 | － | 61,675,000 | △210,400 |

**（注）１．時価の算定方法**

**株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。**
**原則として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25年12月16日現在） | （平成26年６月16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 |
| 1.2157円 | 1.2404円 |
| （１万口当たり純資産額 12,157円） | （１万口当たり純資産額 12,404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25年12月16日現在） | （平成26年６月16日現在） |
|---|---|---|---|
| | | 金額 | 金額 |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 20,960,358 | 44,817,860 |
| 国債証券 | | 3,166,138,950 | 3,363,905,400 |
| 地方債証券 | | 277,573,730 | 277,613,055 |
| 特殊債券 | | 247,359,320 | 216,636,080 |
| 社債券 | | 79,764,100 | 78,996,500 |
| 未収利息 | | 15,964,021 | 16,337,404 |
| 前払費用 | | 528,292 | 612,706 |
| 流動資産合計 | | 3,808,288,771 | 3,998,919,005 |
| 資産合計 | | 3,808,288,771 | 3,998,919,005 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払金 | | － | 10,049,200 |
| 未払解約金 | | 2,312,232 | 1,696,850 |
| 流動負債合計 | | 2,312,232 | 11,746,050 |
| 負債合計 | | 2,312,232 | 11,746,050 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | ※１ | 3,085,114,036 | 3,197,896,966 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（△） | | 720,862,503 | 789,275,989 |
| 元本等合計 | | 3,805,976,539 | 3,987,172,955 |
| 純資産合計 | | 3,805,976,539 | 3,987,172,955 |
| 負債純資産合計 | | 3,808,288,771 | 3,998,919,005 |

**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）**

| （平成25年12月16日現在） | （平成26年６月16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<br>2,682,632,427円<br>同期中における追加設定元本額<br>973,173,617円<br>同期中における解約元本額<br>570,692,008円<br>同期末における元本の内訳<br>PRU国内債券マーケット・パフォーマー<br>528,177,999円<br>PRUグッドライフ2020<br>18,648,461円<br>PRUグッドライフ2030<br>7,967,448円<br>PRUグッドライフ2040<br>11,230,246円<br>PRUグッドライフ2020（年金）<br>1,007,671,685円<br>PRUグッドライフ2030（年金）<br>928,775,351円<br>PRUグッドライフ2040（年金）<br>421,118,753円<br>PRUグッドライフ2050（年金）<br>8,913,535円<br>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）<br>18,647,919円<br>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）<br>133,962,639円<br>計　3,085,114,036円<br>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<br>3,085,114,036口 | ※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<br>3,085,114,036円<br>同期中における追加設定元本額<br>346,895,810円<br>同期中における解約元本額<br>234,112,880円<br>同中間期末における元本の内訳<br>PRU国内債券マーケット・パフォーマー<br>525,829,550円<br>PRUグッドライフ2020<br>19,175,128円<br>PRUグッドライフ2030<br>7,667,214円<br>PRUグッドライフ2040<br>11,855,951円<br>PRUグッドライフ2020（年金）<br>1,044,769,154円<br>PRUグッドライフ2030（年金）<br>991,966,423円<br>PRUグッドライフ2040（年金）<br>448,611,400円<br>PRUグッドライフ2050（年金）<br>12,284,577円<br>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）<br>13,115,627円<br>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）<br>122,621,942円<br>計　3,197,896,966円<br>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<br>3,197,896,966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25年12月16日現在） | （平成26年６月16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 | 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。<br>② デリバティブ取引等<br>該当事項はありません。<br>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。 | ① 有価証券<br>同左<br>② デリバティブ取引等<br>同左<br>③ 上記以外の金融商品<br>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25年12月16日現在） | （平成26年６月16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<br>1.2337円<br>（１万口当たり純資産額　12,337円） | 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<br>1.2468円<br>（１万口当たり純資産額　12,468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25年12月16日現在） | （平成26年６月16日現在） |
|---|---|---|---|
| | | 金額 | 金額 |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 121,036,991 | 108,767,131 |
| 金銭信託 | | 850,869 | 888,696 |
| コール・ローン | | 26,198,742 | 30,938,918 |
| 株式 | | 4,652,211,249 | 4,387,463,629 |
| 投資証券 | | 87,494,181 | 92,732,859 |
| 派生商品評価勘定 | | 1,601,240 | 9,390,498 |
| 未収入金 | | 99,906,688 | 13,381,968 |
| 未収配当金 | | 9,232,777 | 9,363,262 |
| 未収利息 | | 21 | 16 |
| 前払金 | | 12,725,281 | 10,833,389 |
| 差入委託証拠金 | | 19,249,621 | 31,699,858 |
| 流動資産合計 | | 5,030,507,660 | 4,695,460,224 |
| 資産合計 | | 5,030,507,660 | 4,695,460,224 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 2,763,388 | － |
| 未払金 | | － | 508,273 |
| 未払解約金 | | 21,010,533 | 11,346,834 |
| 流動負債合計 | | 23,773,921 | 11,855,107 |
| 負債合計 | | 23,773,921 | 11,855,107 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | ※１ | 3,092,107,343 | 2,643,985,775 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（△） | | 1,914,626,396 | 2,039,619,342 |
| 元本等合計 | | 5,006,733,739 | 4,683,605,117 |
| 純資産合計 | | 5,006,733,739 | 4,683,605,117 |
| 負債純資産合計 | | 5,030,507,660 | 4,695,460,224 |

**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、新株予約権証券及び投資証券**<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。** |
| **２．デリバティブ等の評価基準及び評価方法** | **①先物取引**<br>**個別法に基づき、原則として時価で評価しております。**<br>**時価評価にあたっては、原則として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。** |
| **３．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項** | **外貨建取引等の処理基準**<br>**外貨建取引については「投資信託財産の計算に関する規則」（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25年12月16日現在） | （平成26年６月16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 |
| 4,937,181,558円 | 3,092,107,343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 |
| 266,327,777円 | 111,123,197円 |
| 同期中における解約元本額 | 同期中における解約元本額 |
| 2,111,401,992円 | 559,244,765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 |
| 2,164,139,713円 | 1,781,678,863円 |
| PRUグッドライフ2020 | PRUグッドライフ2020 |
| 1,189,040円 | 1,040,402円 |
| PRUグッドライフ2030 | PRUグッドライフ2030 |
| 1,592,426円 | 1,346,018円 |
| PRUグッドライフ2040 | PRUグッドライフ2040 |
| 5,223,221円 | 4,860,317円 |
| PRUグッドライフ2020（年金） | PRUグッドライフ2020（年金） |
| 64,264,472円 | 56,680,847円 |
| PRUグッドライフ2030（年金） | PRUグッドライフ2030（年金） |
| 185,603,258円 | 174,149,944円 |
| PRUグッドライフ2040（年金） | PRUグッドライフ2040（年金） |
| 195,893,498円 | 183,909,642円 |
| PRUグッドライフ2050（年金） | PRUグッドライフ2050（年金） |
| 14,045,996円 | 13,557,754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） |
| 460,155,719円 | 426,761,988円 |
| 計　3,092,107,343円 | 計　2,643,985,775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 |
| 3,092,107,343口 | 2,643,985,775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25年12月16日現在） | （平成26年６月16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 | 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。<br>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。<br>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。 | ①　有価証券<br>同左<br>②　デリバティブ取引等<br>同左<br>③　上記以外の金融商品<br>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）**

**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25年12月16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 | 252,511,174 | － | 251,398,230 | △1,112,944 |
| 合計 | 252,511,174 | － | 251,398,230 | △1,112,944 |

**（単位：円）**

| 種類 | （平成26年６月16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 | 189,660,260 | － | 199,050,758 | 9,390,498 |
| 合計 | 189,660,260 | － | 199,050,758 | 9,390,498 |

**（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25年12月16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 | 23,863,938 | － | 23,736,000 | △127,938 |
| 売建 | | | | |
| アメリカドル | 14,441,000 | － | 14,448,000 | △7,000 |
| カナダドル | 4,143,581 | － | 4,142,731 | 850 |
| ユーロ | 8,303,701 | － | 8,271,640 | 32,061 |
| イギリスポンド | 4,163,961 | － | 4,134,709 | 29,252 |
| スイスフラン | 3,110,940 | － | 3,100,785 | 10,155 |
| オーストラリアドル | 4,141,755 | － | 4,128,339 | 13,416 |
| 合計 | 62,168,876 | － | 61,962,204 | △49,204 |

**（平成26年６月16日現在）**

**該当事項はありません。**

**（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25年12月16日現在） | （平成26年６月16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<br>1.6192円<br>（１万口当たり純資産額　16,192円） | 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<br>1.7714円<br>（１万口当たり純資産額　17,714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25年12月16日現在） | （平成26年６月16日現在） |
|---|---|---|---|
| | | 金額 | 金額 |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 10,770,931 | 18,958,584 |
| コール・ローン | | 74,078,308 | 53,121,592 |
| 国債証券 | | 6,855,930,771 | 6,619,231,327 |
| 派生商品評価勘定 | | 40,539,256 | 6,943,401 |
| 未収入金 | | 29,065,614 | ― |
| 未収利息 | | 72,234,296 | 79,204,396 |
| 前払費用 | | 10,143,477 | 5,112,584 |
| 流動資産合計 | | 7,092,762,653 | 6,782,571,884 |
| 資産合計 | | 7,092,762,653 | 6,782,571,884 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 36,515,633 | 4,074,127 |
| 未払解約金 | | 29,225,814 | 9,163,794 |
| 流動負債合計 | | 65,741,447 | 13,237,921 |
| 負債合計 | | 65,741,447 | 13,237,921 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | ※１ | 3,485,329,977 | 3,284,476,385 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（△） | | 3,541,691,229 | 3,484,857,578 |
| 元本等合計 | | 7,027,021,206 | 6,769,333,963 |
| 純資産合計 | | 7,027,021,206 | 6,769,333,963 |
| 負債純資産合計 | | 7,092,762,653 | 6,782,571,884 |

**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**<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。** |
| **２．デリバティブ等の評価基準及び評価方法** | **為替予約取引**<br>**原則としてわが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。** |
| **３．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項** | **外貨建取引等の処理基準**<br>**外貨建取引については「投資信託財産の計算に関する規則」（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25年12月16日現在） | （平成26年６月16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 |
| 6,004,045,074円 | 3,485,329,977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 |
| 283,636,341円 | 139,842,791円 |
| 同期中における解約元本額 | 同期中における解約元本額 |
| 2,802,351,438円 | 340,696,383円 |
| 同期末における元本の内訳<br>PRU海外債券マーケット・パフォーマー | 同中間期末における元本の内訳<br>PRU海外債券マーケット・パフォーマー |
| 3,199,377,255円 | 3,012,992,287円 |
| PRUグッドライフ2020 | PRUグッドライフ2020 |
| 1,209,622円 | 1,007,556円 |
| PRUグッドライフ2030 | PRUグッドライフ2030 |
| 622,141円 | 566,535円 |
| PRUグッドライフ2040 | PRUグッドライフ2040 |
| 466,285円 | 636,011円 |
| PRUグッドライフ2020（年金） | PRUグッドライフ2020（年金） |
| 65,372,701円 | 54,883,428円 |
| PRUグッドライフ2030（年金） | PRUグッドライフ2030（年金） |
| 72,548,813円 | 73,297,148円 |
| PRUグッドライフ2040（年金） | PRUグッドライフ2040（年金） |
| 17,483,650円 | 24,070,440円 |
| PRUグッドライフ2050（年金） | PRUグッドライフ2050（年金） |
| 884,488円 | 628,001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） |
| 127,365,022円 | 116,394,979円 |
| 計　3,485,329,977円 | 計　3,284,476,385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 |
| 3,485,329,977口 | 3,284,476,385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25年12月16日現在） | （平成26年６月16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 | 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。<br>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。<br>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。 | ①　有価証券<br>同左<br>②　デリバティブ取引等<br>同左<br>③　上記以外の金融商品<br>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）**

**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25年12月16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 | 493,344,340 | － | 515,273,122 | 21,928,782 |
| カナダドル | 21,136,699 | － | 21,556,036 | 419,337 |
| ユーロ | 287,406,668 | － | 301,683,471 | 14,276,803 |
| イギリスポンド | 35,213,163 | － | 35,372,437 | 159,274 |
| スイスフラン | 28,149,049 | － | 29,818,897 | 1,669,848 |
| デンマーククローネ | 32,909,151 | － | 33,675,822 | 766,671 |
| ポーランドズロチ | 21,609,594 | － | 22,497,004 | 887,410 |
| オーストラリアドル | 14,228,396 | － | 13,957,129 | △271,267 |
| 売建 | | | | |
| アメリカドル | 457,697,318 | － | 474,843,721 | △17,146,403 |
| カナダドル | 4,260,438 | － | 4,304,196 | △43,758 |
| メキシコペソ | 5,482,613 | － | 5,689,639 | △207,026 |
| ユーロ | 349,719,146 | － | 365,678,662 | △15,959,516 |
| イギリスポンド | 22,964,854 | － | 23,200,884 | △236,030 |
| スイスフラン | 2,778,000 | － | 2,784,720 | △6,720 |
| スウェーデンクローネ | 2,661,367 | － | 2,713,381 | △52,014 |
| デンマーククローネ | 25,904,827 | － | 26,940,725 | △1,035,898 |
| ポーランドズロチ | 20,152,274 | － | 21,173,039 | △1,020,765 |
| オーストラリアドル | 4,839,984 | － | 4,804,488 | 35,496 |
| シンガポールドル | 3,630,177 | － | 3,763,373 | △133,196 |
| 南アフリカランド | 7,361,385 | － | 7,368,790 | △7,405 |
| 合計 | 1,841,449,443 | － | 1,917,099,536 | 4,023,623 |

（単位：円）

| 種類 | （平成26年６月16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 | 317,654,459 | － | 316,165,378 | △1,489,081 |
| カナダドル | 20,444,822 | － | 20,654,038 | 209,216 |
| メキシコペソ | 2,713,891 | － | 2,702,260 | △11,631 |
| ユーロ | 45,932,924 | － | 45,302,922 | △630,002 |
| イギリスポンド | 20,538,262 | － | 20,648,517 | 110,255 |
| スイスフラン | 27,065,752 | － | 26,402,766 | △662,986 |
| スウェーデンクローネ | 38,856,922 | － | 38,206,777 | △650,145 |
| ノルウェークローネ | 24,161,212 | － | 23,980,735 | △180,477 |
| ポーランドズロチ | 21,893,414 | － | 21,683,056 | △210,358 |
| オーストラリアドル | 15,646,177 | － | 15,740,596 | 94,419 |
| シンガポールドル | 23,629,893 | － | 23,691,941 | 62,048 |
| 売建 | | | | |
| アメリカドル | 262,300,291 | － | 261,237,689 | 1,062,602 |
| メキシコペソ | 9,490,124 | － | 9,441,766 | 48,358 |
| ユーロ | 211,330,005 | － | 206,670,231 | 4,659,774 |
| イギリスポンド | 6,011,966 | － | 6,031,136 | △19,170 |
| デンマーククローネ | 13,614,854 | － | 13,295,048 | 319,806 |
| オーストラリアドル | 4,746,500 | － | 4,775,000 | △28,500 |
| 南アフリカランド | 7,198,457 | － | 7,013,311 | 185,146 |
| 合計 | 1,073,229,925 | － | 1,063,643,167 | 2,869,274 |

（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25年12月16日現在） | （平成26年６月16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<br>2.0162円<br>（１万口当たり純資産額 20,162円） | 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<br>2.0610円<br>（１万口当たり純資産額 20,610円） |

# 4【委託会社等の概況】

## （1）【資本金の額】

平成26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116兆円（11,309億米ドル、円換算レート１米ドル＝102.98円、平成26年３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・マネー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26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30本、純資産総額の合計金額は約903,665百万円です。以下はその種類別の内訳です。

| | |
|---|---|
| 追加型株式投資信託 | 27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。**

**なお、当事業年度（平成25年４月１日から平成26年３月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年９月21日内閣府令第61号）附則第２条第２項により、改正前の財務諸表等規則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８期事業年度（平成25年４月１日から平成26年３月31日まで）の財務諸表について、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７期<br>（平成25年３月31日） | 第８期<br>（平成26年３月31日） |
|---|---|---|
| （資産の部） | | |
| 流動資産 | | |
| 現金及び預金 | 2,459,775 | 1,948,488 |
| 前払費用 | 36,835 | 43,773 |
| 未収入金 | 3,027 | 2,844 |
| 立替金 | 343 | 3 |
| 未収委託者報酬 | 66,014 | 59,504 |
| 未収運用受託報酬 | 1,842,346 | 1,925,685 |
| 未収収益 | 49,868 | 39,484 |
| 繰延税金資産 | 66,167 | 70,572 |
| 流動資産計 | 4,524,378 | 4,090,355 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | 108,250 | 96,562 |
| 建物附属設備 ＊２ | 85,386 | 72,672 |
| 器具備品 ＊２ | 22,863 | 23,889 |
| 無形固定資産 | 167,205 | 142,900 |
| ソフトウエア | 167,205 | 142,900 |
| 投資その他の資産 | 135,660 | 138,215 |
| 長期差入保証金 | 4,496 | 4,496 |
| 繰延税金資産 | 131,164 | 133,719 |
| 固定資産計 | 411,117 | 377,678 |
| 資産合計 | 4,935,496 | 4,468,034 |

（単位：千円）

| | | 第７期<br>（平成25年３月31日） | 第８期<br>（平成26年３月31日） |
|---|---|---|---|
| （負債の部） | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払金 | | 49,304 | 38,946 |
| 未払手数料 | | 18,300 | 16,166 |
| その他未払金 | | 31,004 | 22,780 |
| 未払費用 | ＊１ | 1,474,723 | 1,530,985 |
| 未払法人税等 | | 300,262 | 407,227 |
| 未払消費税等 | | 64,420 | 76,804 |
| 預り金 | | 20,065 | 12,500 |
| 賞与引当金 | | 59,436 | 71,555 |
| 役員賞与引当金 | | 5,000 | 13,500 |
| その他流動負債 | | ― | 105 |
| 流動負債計 | | 1,973,212 | 2,151,626 |
| 固定負債 | | | |
| 長期未払費用 | ＊１ | 48,039 | 60,811 |
| 退職給付引当金 | | 331,297 | 320,564 |
| 役員退職慰労引当金 | | 13,535 | 21,782 |
| 資産除去債務 | | 61,113 | 61,968 |
| 固定負債計 | | 453,986 | 465,126 |
| 負債合計 | | 2,427,198 | 2,616,752 |

（単位：千円）

| | 第７期<br>（平成25年３月31日） | 第８期<br>（平成26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 | 2,140,297 | 1,483,281 |
| 利益準備金 | 54,750 | 54,750 |
| その他利益剰余金 | 2,085,547 | 1,428,531 |
| 繰越利益剰余金 | 2,085,547 | 1,428,531 |
| 株主資本合計 | 2,508,297 | 1,851,281 |
| 純資産合計 | 2,508,297 | 1,851,281 |
| 負債・純資産合計 | 4,935,496 | 4,468,034 |

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

| | 第７期<br>（自　平成24年４月１日<br>至　平成25年３月31日） | 第８期<br>（自　平成25年４月１日<br>至　平成26年３月31日） |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 423,987 | 453,184 |
| 運用受託報酬 | 6,067,148 | 7,117,163 |
| その他営業収益 | 218,791 | 174,130 |
| 営業収益計 | 6,709,927 | 7,744,478 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 77,177 | 75,722 |
| 広告宣伝費 | 3,732 | － |
| 受益証券発行費 | 354 | 343 |
| 調査費 | 3,422,444 | 4,077,990 |
| 調査費 | 247,658 | 278,029 |
| 委託調査費 | 3,171,455 | 3,797,313 |
| 図書費 | 3,330 | 2,647 |
| 営業雑経費 | 40,629 | 40,690 |
| 通信費 | 6,641 | 7,322 |
| 印刷費 | 20,934 | 20,558 |
| 協会費 | 10,969 | 10,675 |
| 諸会費 | 2,084 | 2,134 |
| 営業費用計 | 3,544,337 | 4,194,746 |

（単位：千円）

| | 第７期<br>（自　平成24年４月１日<br>至　平成25年３月31日） | 第８期<br>（自　平成25年４月１日<br>至　平成26年３月31日） |
|---|---|---|
| 一般管理費 | | |
| 給料 | 988,906 | 1,084,442 |
| 役員報酬 | 23,125 | 34,631 |
| 給料・手当 | 750,877 | 775,088 |
| 賞与 | 134,666 | 159,041 |
| 賞与引当金繰入 | 59,436 | 71,555 |
| 役員賞与 | 15,800 | 30,625 |
| 役員賞与引当金繰入 | 5,000 | 13,500 |
| 福利厚生費 | 104,633 | 138,747 |
| 交際費 | 3,660 | 4,839 |
| 旅費交通費 | 34,711 | 33,404 |
| 水道光熱費 | 6,966 | 6,734 |
| 租税公課 | 14,723 | 17,369 |
| 不動産賃借料 | 161,883 | 151,408 |
| 退職給付費用 | 70,636 | 89,290 |
| 役員退職慰労引当金繰入 | 3,240 | 8,247 |
| 退職金 | 24,024 | ― |
| 募集費 | 17,790 | 23,954 |
| 固定資産減価償却費 | 60,831 | 68,898 |
| 業務委託費 | 36,102 | 33,521 |
| 専門家報酬 | 46,147 | 59,796 |
| 消耗器具備品費 | 16,057 | 20,076 |
| 修繕維持費 | 17,979 | 15,898 |
| 諸経費 | 26,937 | 27,172 |
| 一般管理費計 | 1,635,233 | 1,783,802 |

（単位：千円）

| | 第７期<br>（自　平成24年４月１日<br>至　平成25年３月31日） | 第８期<br>（自　平成25年４月１日<br>至　平成26年３月31日） |
|---|---|---|
| 営業利益 | 1,530,356 | 1,765,928 |
| 営業外収益 | | |
| 受取利息 | 304 | 394 |
| その他営業外収益 | 1,387 | 2,065 |
| 営業外収益計 | 1,691 | 2,459 |
| 営業外費用 | | |
| 為替差損 | 57,919 | 54,280 |
| その他営業外費用 | 43 | 150 |
| 営業外費用計 | 57,962 | 54,430 |
| 経常利益 | 1,474,085 | 1,713,957 |
| 特別損失 | | |
| 固定資産除却損 | 548 | 149 |
| 特別損失計 | 548 | 149 |
| 税引前当期純利益 | 1,473,537 | 1,713,807 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 604,764 | 684,984 |
| 法人税等調整額 | △32,476 | △6,960 |
| 当期純利益 | 901,248 | 1,035,783 |

## （３）【株主資本等変動計算書】

### 第７期（自平成24年４月１日　至平成25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<br>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 | 14,720 | 1,636,489 | 1,651,209 | 2,019,209 | － | － | 2,019,209 |
| 当期変動額 | | | | | | | | | | |
| 利益準備金の積立 | － | － | － | 40,030 | △40,030 | － | － | － | － | － |
| 剰余金の配当 | － | － | － | － | △412,160 | △412,160 | △412,160 | － | － | △412,160 |
| 当期純利益 | － | － | － | － | 901,248 | 901,248 | 901,248 | － | － | 901,248 |
| 当期変動額合計 | － | － | － | 40,030 | 449,058 | 489,088 | 489,088 | － | － | 489,088 |
| 当期末残高 | 219,000 | 149,000 | 149,000 | 54,750 | 2,085,547 | 2,140,297 | 2,508,297 | － | － | 2,508,297 |

### 第８期（自平成25年４月１日　至平成26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<br>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 | 2,085,547 | 2,140,297 | 2,508,297 | － | － | 2,508,297 |
| 当期変動額 | | | | | | | | | | |
| 利益準備金の積立 | － | － | － | － | － | － | － | － | － | － |
| 剰余金の配当 | － | － | － | － | △1,692,800 | △1,692,800 | △1,692,800 | － | － | △1,692,800 |
| 当期純利益 | － | － | － | － | 1,035,783 | 1,035,783 | 1,035,783 | － | － | 1,035,783 |
| 当期変動額合計 | － | － | － | － | △657,016 | △657,016 | △657,016 | － | － | △657,016 |
| 当期末残高 | 219,000 | 149,000 | 149,000 | 54,750 | 1,428,531 | 1,483,281 | 1,851,281 | － | － | 1,851,281 |

**重要な会計方針**

| | |
|---|---|
| １．固定資産の減価償却方法 | (1) 有形固定資産（リース資産を除く）<br>定率法によっております。<br>(2) 無形固定資産（リース資産を除く）<br>ソフトウェア（自社利用）については、社内における利用可能期間（５年）による定額法、それ以外の無形固定資産については、５年間にわたる定額法を採用しております。 |
| 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 | (1) 賞与引当金<br>従業員に対する賞与の支給に備えるため、次回支給見込み額のうち当会計期間対応分を計上しております。<br>(2) 役員賞与引当金<br>役員に対する賞与の支給に備えるため、次回支給見込み額のうち当会計期間対応分を計上しております。<br>(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。<br>(4) 役員退職慰労引当金<br>役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規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。 |
| ４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 消費税等の会計処理<br>消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。 |

**表示方法の変更**

（退職給付に関する会計基準）

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号　平成24年５月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針（企業会計基準適用指針第25号　平成24年５月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を当事業年度より適用し、（退職給付関係）注記の表示方法を変更しております。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っており、（退職給付関係）の注記の組替えは行っておりません。

**注記事項**

**（貸借対照表関係）**

| 第７期<br>（平成25年３月31日） | 第８期<br>（平成26年３月31日） |
|---|---|
| ＊１　関係会社項目<br>未払費用　18,246千円<br>長期未払費用　46,389千円 | ＊１　関係会社項目<br>－ |
| ＊２　減価償却累計額　99,756千円<br>有形固定資産<br>建物附属設備　66,184千円<br>器具備品　33,571千円 | ＊２　減価償却累計額　112,547千円<br>有形固定資産<br>建物附属設備　78,899千円<br>器具備品　33,648千円 |

**（株主資本等変動計算書関係）**

**第７期**
**（自　平成24年４月１日**
**至　平成25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24年６月28日株主総会 | 普通株式 | 412,160 | 56 | 平成24年３月31日 | 平成24年６月28日 |

**第８期**
**（自　平成25年４月１日**
**至　平成26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25年６月25日株主総会 | 普通株式 | 1,104,000 | 150 | 平成25年３月31日 | 平成25年６月25日 |
| 平成25年12月19日取締役会 | 普通株式 | 588,800 | 80 | 平成25年９月30日 | 平成25年12月19日 |

**（金融商品関係）**

**第７期**
**（自　平成24年４月１日**
**至　平成25年３月31日）**

**１．金融商品の状況に関する事項**

**(1) 金融商品に対する取組方針**

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うる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。

**(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**

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。

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。

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。

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。

**２．金融商品の時価等に関する事項**

平成25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。

| | 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 | 2,459,775 | 2,459,775 | － |
| (2) 未収運用受託報酬 | 1,842,346 | 1,842,346 | － |
| 資産計 | 4,302,121 | 4,302,121 | － |
| (1) 未払費用 | 1,474,723 | 1,474,723 | － |
| 負債計 | 1,474,723 | 1,474,723 | － |

**第８期**
**（自　平成25年４月１日**
**至　平成26年３月31日）**

**１．金融商品の状況に関する事項**

**(1) 金融商品に対する取組方針**

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うる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。

**(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**

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。

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。

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。

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。

**２．金融商品の時価等に関する事項**

平成26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。

| | 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 | 1,948,488 | 1,948,488 | － |
| (2) 未収運用受託報酬 | 1,925,685 | 1,925,685 | － |
| 資産計 | 3,874,173 | 3,874,173 | － |
| (1) 未払費用 | 1,530,985 | 1,530,985 | － |
| 負債計 | 1,530,985 | 1,530,985 | － |

**第７期**
**（自　平成24年４月１日**
**至　平成25年３月31日）**

**（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。**

**（注２）金銭債権の決算日後の回収予定額**

| | １年以内（千円） |
|---|---|
| 現金及び預金 | 2,459,775 |
| 未収運用受託報酬 | 1,842,346 |
| 合計 | 4,302,121 |

**第８期**
**（自　平成25年４月１日**
**至　平成26年３月31日）**

**（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。**

**（注２）金銭債権の決算日後の回収予定額**

| | １年以内（千円） |
|---|---|
| 現金及び預金 | 1,948,488 |
| 未収運用受託報酬 | 1,925,685 |
| 合計 | 3,874,173 |

**（退職給付関係）**

**第７期**
**（自　平成24年４月１日**
**至　平成25年３月31日）**

**１．採用している退職給付制度の概要**

**当社は確定給付型の制度として、退職一時金制度を採用しております。**

**２．退職給付債務及びその内訳**

**（単位：千円）**

| | |
|---|---|
| **(1) 退職給付債務** | **331,297** |
| **(2) 退職給付引当金** | **331,297** |

**３．退職給付費用の内訳**

**（単位：千円）**

| | |
|---|---|
| **勤務費用** | **70,636** |

**第８期**
**（自　平成25年４月１日**
**至　平成26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** | **331,297 千円** |
| **退職給付費用** | **89,290 千円** |
| **退職給付の支払額** | **△100,024 千円** |
| **制度への拠出額** | **－ 千円** |
| **退職給付引当金の期末残高** | **320,564 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** | **320,564 千円** |
| **貸借対照表に計上された負債と資産の純額** | **320,564 千円** |

| | |
|---|---|
| **退職給付に係る負債** | **320,564 千円** |
| **貸借対照表に計上された負債と資産の純額** | **320,564 千円** |

**(3) 退職給付費用**

| | |
|---|---|
| **簡便法で計算した退職給付費用** | **89,290 千円** |

**（税効果会計関係）**

| 第７期<br>（平成25年３月31日） | 第８期<br>（平成26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　24,634 千円 | 未払事業税　28,412 千円 |
| 未払費用　18,358 千円 | 未払費用　16,572 千円 |
| 賞与引当金　22,591 千円 | 賞与引当金　25,502 千円 |
| 長期未払費用　13,765 千円 | 長期未払費用　14,118 千円 |
| 退職給付引当金　99,978 千円 | 退職給付引当金　96,153 千円 |
| 資産除去債務　21,783 千円 | 資産除去債務　22,085 千円 |
| その他　6,693 千円 | その他　9,791 千円 |
| 繰延税金資産小計　207,806 千円 | 繰延税金資産小計　212,635 千円 |
| 評価性引当額　－ 千円 | 評価性引当額　－ 千円 |
| 繰延税金資産合計　207,806 千円 | 繰延税金資産合計　212,635 千円 |
| 繰延税金負債 | 繰延税金負債 |
| 資産除去債務　△10,474 千円 | 資産除去債務　△8,344 千円 |
| その他　－ 千円 | その他　－ 千円 |
| 繰延税金負債合計　△10,474 千円 | 繰延税金負債合計　△8,344 千円 |
| 繰延税金資産の純額　197,331 千円 | 繰延税金資産の純額　204,291 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<br>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。 | 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<br>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。 |
| | 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<br>「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年３月31日に公布され、平成26年４月１日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないことになりました。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、平成26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従来の38.0%から35.6%になります。<br>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4,692千円減少し、法人税等調整額が同額増加しております。 |

**（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７期<br>（自　平成24年４月１日<br>至　平成25年３月31日） | 第８期<br>（自　平成25年４月１日<br>至　平成26年３月31日） |
|---|---|---|
| 期首残高 | 42,973千円 | 61,113千円 |
| 有形固定資産の取得に伴う増加額 | 17,343千円 | －千円 |
| 時の経過による調整額 | 803千円 | 855千円 |
| 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） | △6千円 | －千円 |
| 期末残高 | 61,113千円 | 61,968千円 |

**（セグメント情報等）**

［セグメント情報］

第７期（自平成24年４月１日　至平成25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７期（自平成24年４月１日　至平成25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 |
|---|---|---|---|
| 5,617,793 | 870,951 | 221,182 | 6,709,927 |

(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 | 4,159,003 | 資産運用業 |
| プルデンシャル生命保険株式会社 | 900,583 | 資産運用業 |
| A社 | 870,951 | 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８期（自平成25年４月１日　至平成26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８期（自平成25年４月１日　至平成26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 |
|---|---|---|---|
| 6,331,364 | 1,235,701 | 177,411 | 7,744,478 |

(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 | 4,503,969 | 資産運用業 |
| プルデンシャル生命保険株式会社 | 1,084,173 | 資産運用業 |
| A社 | 1,235,701 | 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７期（自平成24年４月１日　至平成25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 | 23,310 | 未払費用 | 18,246 |
| | | | | | | | | | 長期未払費用 | 46,389 |

**(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） | 900,583 | 未収運用受託報酬 | 275,071 |
| 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） | 4,159,003 | 未収運用受託報酬 | 1,194,184 |
| 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） | 3,108,864 | 未払費用 | 1,368,924 |
| | | | | | | サービス契約 | サービス料 | 218,791 | 未収収益 | 49,868 |

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８期（自平成25年４月１日　至平成26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 | 29,281 | 未払費用 | 672 |
| | | | | | | | | | 長期未払費用 | 59,161 |

**(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） | 1,084,173 | 未収運用受託報酬 | 317,459 |
| 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） | 4,503,969 | 未収運用受託報酬 | 1,195,824 |
| 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） | 3,768,546 | 未払費用 | 1,445,167 |
| | | | | | | サービス契約 | サービス料 | 174,130 | 未収収益 | 39,484 |

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７期<br>（自　平成24年４月１日<br>至　平成25年３月31日） | | 第８期<br>（自　平成25年４月１日<br>至　平成26年３月31日） | |
|---|---|---|---|
| １株当たり純資産額 | 340,801.32円 | １株当たり純資産額 | 251,532.82円 |
| １株当たり当期純利益 | 122,452.26円 | １株当たり当期純利益 | 140,731.50円 |
| 損益計算書上の当期純利益 | 901,248千円 | 損益計算書上の当期純利益 | 1,035,783千円 |
| １株当たり当期純利益の算定に用いられた普通株式に係る当期純利益 | 901,248千円 | １株当たり当期純利益の算定に用いられた普通株式に係る当期純利益 | 1,035,783千円 |
| 差額 | －千円 | 差額 | －千円 |
| 期中平均株式数・普通株式 | 7,360株 | 期中平均株式数・普通株式 | 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 中 間 監 査 報 告 書

平成26年７月30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

あ ら た 監 査 法 人

指定社員
業務執行社員　公認会計士　大 畑　茂

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2050（年金）の平成25年12月17日から平成26年６月16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2050（年金）の平成26年６月16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25年12月17日から平成26年６月16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．財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれておりません。

次へ

# 独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

平成26年６月13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

あ ら た 監 査 法 人

| | | |
|---|---|---|
| 指定社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 大 畑　　茂 |
| 指定社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 男 澤　　顕 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているプルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社の平成25年４月１日から平成26年３月31日までの第８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26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

---

（※）　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。