

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成25年10月10日提出
【発行者名】	損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 数間 浩喜
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋二丁目2番16号
【事務連絡者氏名】	野上 英樹
【電話番号】	03-5290-3517
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ハッピーエイジング20 ハッピーエイジング30 ハッピーエイジング40 ハッピーエイジング50 ハッピーエイジング60 (以上を総称して「ハッピーエイジング・ファンド」ということがあります。)
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	募集額 各2,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

ハッピーエイジング２０ ハッピーエイジング３０ ハッピーエイジング４０
ハッピーエイジング５０ ハッピーエイジング６０

以下、上記のそれぞれをまたは上記を総称して「ファンド」または「ハッピーエイジング・ファンド」ということがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権です。

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

委託会社の依頼により信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、2,000億円を上限とします。

上記金額には申込手数料及び申込手数料に係る消費税及び地方消費税に相当する金額（以下、「消費税等相当額」といいます。）は含まれていません。

（４）【発行（売出）価格】

各ファンドについて、取得申込受付日^１の翌営業日の基準価額^２とします。

上記金額には申込手数料及び申込手数料に係る消費税等相当額は含まれていません。

１日本における委託会社および販売会社の営業日に限り、申込みの取扱いは行われます。ただし、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所、フランクフルト証券取引所、パリ証券取引所のいずれかの取引所あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、取得の申込みを受付けないものとします。

２基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入有価証券を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。ただし、便宜上１万口当たりには換算した価額で表示されることがあります。

各ファンドの基準価額については、委託会社（損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社、ホームページ：<http://www.sjnk-am.co.jp/>、電話03-5290-3519 営業部（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社（受益権の取得の申込みの取扱いを行う第一種金融商品取引業を行う者及び登録金融機関を総称して、以下「販売会社」といいます。）に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

（５）【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.1%（税抜 2.0%）を上限として販売会社が定めた手数料率を乗じて得た額です。

申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。また、消費税率が8%になった場合は、2.16%となります。

各ファンドは自動けいぞく投資専用ファンドです。自動けいぞく投資とは、収益分配の際に税引き後の収益分配金を、無手数料で自動的に再投資する方法です。

自動けいぞく投資契約に基づく定時定額購入サービスをお申込みの場合および確定拠出年金制度に基づくお申込みの場合は、上記にかかわらず、申込手数料はありません。また、同サービスおよび確定拠出年金制度に基づくお申込みの場合、「ハッピーエイジング・ファンド」の各ファンド間の乗換え（以下「スイッチング」といいます。）の申込手数料もかかりません。

(6) 【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位等の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

継続申込期間 平成25年10月11日から平成26年10月14日までです。

継続申込期間は上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

申込取扱場所は、原則として販売会社の本支店等とします。販売会社については、委託会社（ホームページ：<http://www.sjnk-am.co.jp/>、電話03-5290-3519 営業部（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））までお問い合わせください。

(9) 【払込期日】

各ファンドの受益権の取得申込者は、お申込代金を販売会社に支払います。払込期日は販売会社によって異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

投資家から申込まれた募集に係る各取得申込受付日の発行価額の総額は、追加信託が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

原則として申込取扱場所と同じです。

(11) 【振替機関に関する事項】

各ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

申込証拠金
ありません。

日本以外の地域における発行
ありません。

振替受益権について

各ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、前記「(11) 振替機関に関する事項」に記載

の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および前記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

「ハッピーエイジング・ファンド」は、リスク水準の異なる5本のファンドから構成されており、中長期的に信託財産の着実な成長を図ることを目的に、「損保ジャパン日本株マザーファンド」、「損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド」、「損保ジャパン日本債券マザーファンド」、「損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド」、「損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド」の受益証券及びエマージング株式又はエマージング株式を主要投資対象とする証券投資信託の受益証券を主要投資対象として運用を行うことを基本とします。

委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンド金2,000億円を限度として信託金を追加できます。また、委託会社は、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

一般社団法人投資信託協会が定める各ファンドの商品分類および属性区分は以下の通りです。

商品分類表

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

<各ファンドの商品分類の定義>

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書又は信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	資産複合	目論見書又は信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

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

(注1) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(注2) ファミリーファンドの場合、投資信託証券を通じて収益の源泉となる資産に投資をしますので、商品分類表と属性区分表の「投資対象資産」は異なります。

(注3) 属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

<当ファンドの属性区分の定義>

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産(投資信託証券(資産複合(株式、債券)))	目論見書又は信託約款において、投資信託証券を通じて、株式および債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年1回	目論見書又は信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル(日本を含む)	目論見書又は信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファン ド	目論見書又は信託約款において、マザーファンド(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書又は信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

各ファンドに該当しない商品分類、属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

<ファンドの特色>

ファンドの目的

各ファンドは、中長期的に信託財産の着実な成長を図ることを目的とします。

ファンドの特色

1

主として各マザーファンドの受益証券への投資を通して、国内株式・国内債券にとどまらず世界各国の株式及び債券に積極的に分散投資を行うことにより、リスクを軽減しつつ信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指します。

投資対象資産	投資対象とするマザーファンド等
国内株式	損保ジャパン日本株マザーファンド 損保ジャパン-DIAM日本株アクティブ・マザーファンド*1
国内債券	損保ジャパン日本債券マザーファンド
外国債券	損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド
外国株式	損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド*2
エマージング株式	エマージング株式またはエマージング株式を主要投資対象とする証券投資信託*3

*1日本株式の運用指図に関する権限を、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下、「DIAM」といいます。)に委託します。

*2運用スタイル毎のアロケーションと北米株式の運用指図に関する権限を、TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY(以下、「TCW」といいます。)に委託します。

*3当ファンドは平成25年8月末現在、パッシブ運用を行うETFの組入れを行っており、今後も同様の運用を行う証券投資信託受益証券を組入れる可能性があります。パッシブ運用とはベンチマーク(市場指数等)と連動する投資成果を目指す運用手法です。また、ETFとは、株価指数などへ連動することを目的に運用されている投資信託のうち、取引所等に上場されている投資信託をさします。

DIAMアセットマネジメント株式会社について

1985年設立。1999年に第一ライフ投信投資顧問、興銀NWアセットマネジメント、日本興業投信の3社が合併し、みずほフィナンシャルグループ・第一生命の両グループの運用ノウハウ、人材、グローバルなネットワークを結集した資産運用会社です。

TCWについて

1971年設立。ロサンゼルスを拠点とするTCWグループ傘下の運用会社です。2013年6月末現在の同グループの運用資産は、約1,281億ドル(約12兆6,293億円*)です。

*2013年6月末時点の為替レートで換算。

2

長期的な視点から基準資産配分比率を決定し、当該比率をめどに投資を行います。基準資産配分比率は、次の手順で決定、見直しを行います。

- 1.長期的視点から、国内外の長期的な過去データに基づく分析と将来に対する見通しに基づいて、各資産毎の長期的期待収益率、標準偏差、相関係数等を予測します。
- 2.予測した各数値を基に、各ファンドの最適な資産配分比率を求め、基準資産配分比率とします。経済情勢の変化等により長期的な各予測数値に大きな影響があると判断した場合には、基準資産配分比率の見直しを行います。

3

各ファンドの特徴は、以下のとおりです。

●ハッピーエイジング20●

国内外の株式の基準組入比率を90%とするファンドです。リスクを積極的にとりながら資産の大きな成長を目指します。5つのファンドの中では最もリスクが高く、投資期間が長く積極的運用をお考えの方に適したファンドです。

●ハッピーエイジング30●

国内外の株式の基準組入比率を70%とするファンドです。5つのファンドの中では比較的高いリスクをとり適度に高い収益を目指します。資産の成長性を重視した運用をお考えの方に適したファンドです。

●ハッピーエイジング40●

国内外の株式の基準組入比率を50%とするファンドです。5つのファンドの中では、リスクのレベルは中位に位置し、リスク・リターンバランスを重視した運用を目指します。積極性と安定性とのバランスのとれた運用をお考えの方に適したファンドです。

●ハッピーエイジング50●

国内外の株式の基準組入比率を30%とするファンドです。5つのファンドの中では比較的低位にリスクを設定し安定した運用を目指します。安定性に重点を置きつつ適度の収益性をも考慮した運用をお考えの方に適したファンドです。

●ハッピーエイジング60●

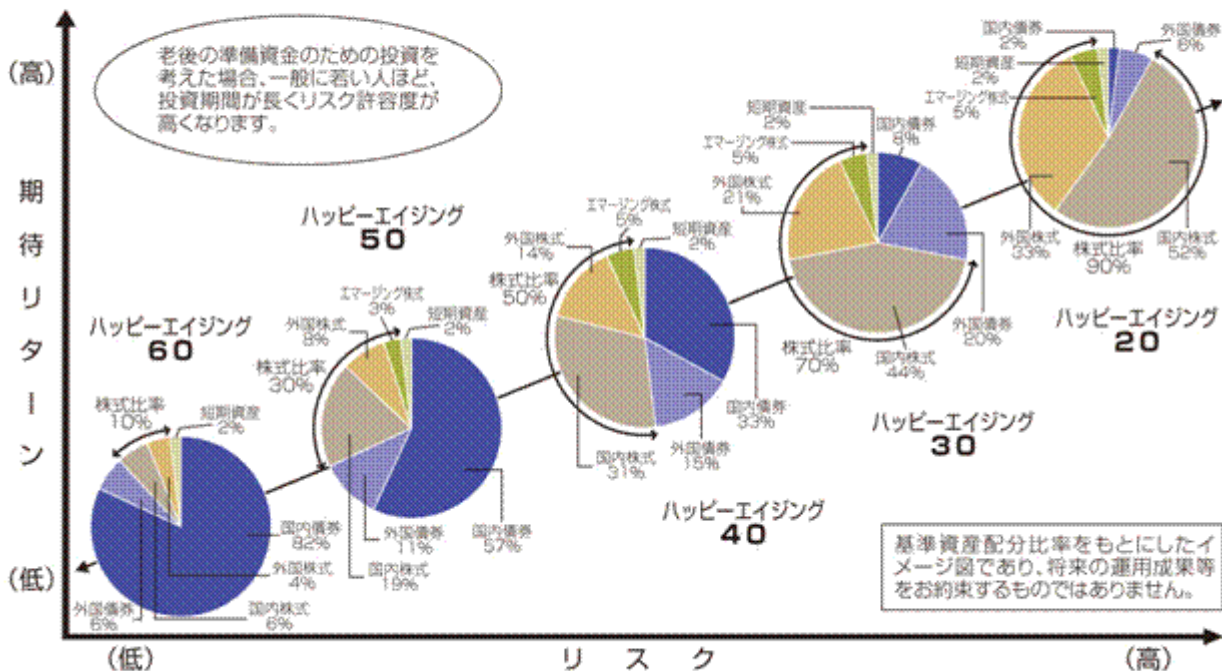
国内外の株式の基準組入比率を10%とするファンドです。5つのファンドの中では最もリスクを抑え、より安定した運用を目指します。投資期間が比較的短く安定性を重視した運用をお考えの方に適しています。

4

投資目的、投資期間、リスク許容度等に応じて、リスク水準の異なる5種類のファンドからご選択いただけます。

ハッピーエイジング20が、最も積極的(高リスク)運用を行うファンドで、ハッピーエイジング60が最も安定的(低リスク)運用を行うファンドです。

＜基準資産配分比率＞



※各マザーファンドの受益証券への投資を通じて、上記の基準資産配分比率を自認に投資を行います。ただし、各マザーファンドの組入比率は、0%を下限とし、基準資産配分比率の±5%程度の範囲とします。なお、市況動向によっては、内外の有価証券等への直接投資を行うことがあります。

5

各ファンドの運用は、以下の個別資産毎のベンチマーク(運用を評価するための指標)を基準資産配分比率で加重平均したものを総合ベンチマークとし、これを上回る運用成果を目指します。

資産	ベンチマーク
国内株式	東証株価指数(TOPIX)
国内債券	NOMURA-BPI総合指数
外国債券	シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
外国株式	MSCIコクサイ インデックス(円換算ベース)
エマーシング株式	MSCIエマーシング・マーケット・インデックス(円換算ベース)
短期資産	有担コール翌日物

※東証株価指数(TOPIX)とは、東京証券取引所第一部上場全銘柄の基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。

東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所の知的財産であり、東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

※「NOMURA-BPI総合指数」とは、野村證券が公表している、日本の公債債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づき構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

※シティグループ世界国債インデックスとは、シティグループグローバル・マーケット・インデックスが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループグローバル・マーケット・インデックスに帰属します。また、シティグループグローバル・マーケット・インデックスは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

※MSCIコクサイ インデックスとは、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。MSCIコクサイ インデックス(円換算ベース)は、MSCIコクサイ インデックス(米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

※MSCIエマーシング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。MSCIエマーシング・マーケット・インデックス(円換算ベース)は、MSCIエマーシング・マーケット・インデックス(米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

（２）【ファンドの沿革】

平成12年7月31日 信託契約締結、設定、運用開始

平成14年7月1日 ファンドの名称を下記の通り変更

<変更後>	<変更前>
ハッピーエイジング20	ライフタイム20
ハッピーエイジング30	ライフタイム30
ハッピーエイジング40	ライフタイム40
ハッピーエイジング50	ライフタイム50
ハッピーエイジング60	ライフタイム60
ハッピーエイジング・ファンド（総称）	安田火災シグナ・ライフタイム・ファンド（総称）

平成15年2月14日 「シグナ日本株アクティブ・マザーファンド」の運用委託先を、シグナ・インターナショナル・インベストメント・アドバイザーズ株式会社から興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社に変更するとともにマザーファンドの名称を「シグナ日本株アクティブ・マザーファンド」から「損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド」に変更

「シグナ日本債券マザーファンド」の運用委託先であるシグナ・インターナショナル・インベストメント・アドバイザーズ株式会社への委託を行わず、当社が運用する方法に変更するとともに、マザーファンドの名称を「シグナ日本債券マザーファンド」から「損保ジャパン日本債券マザーファンド」に変更

平成17年10月8日 ファンドの基本資産配分比率及び投資配分について、損保ジャパンDC証券株式会社からの助言を受けて当社が策定する方法から、助言を受けずに策定する方法に変更

主要投資対象とするマザーファンドのうち、「損保ジャパン外国債券マザーファンド」を「損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド」に変更

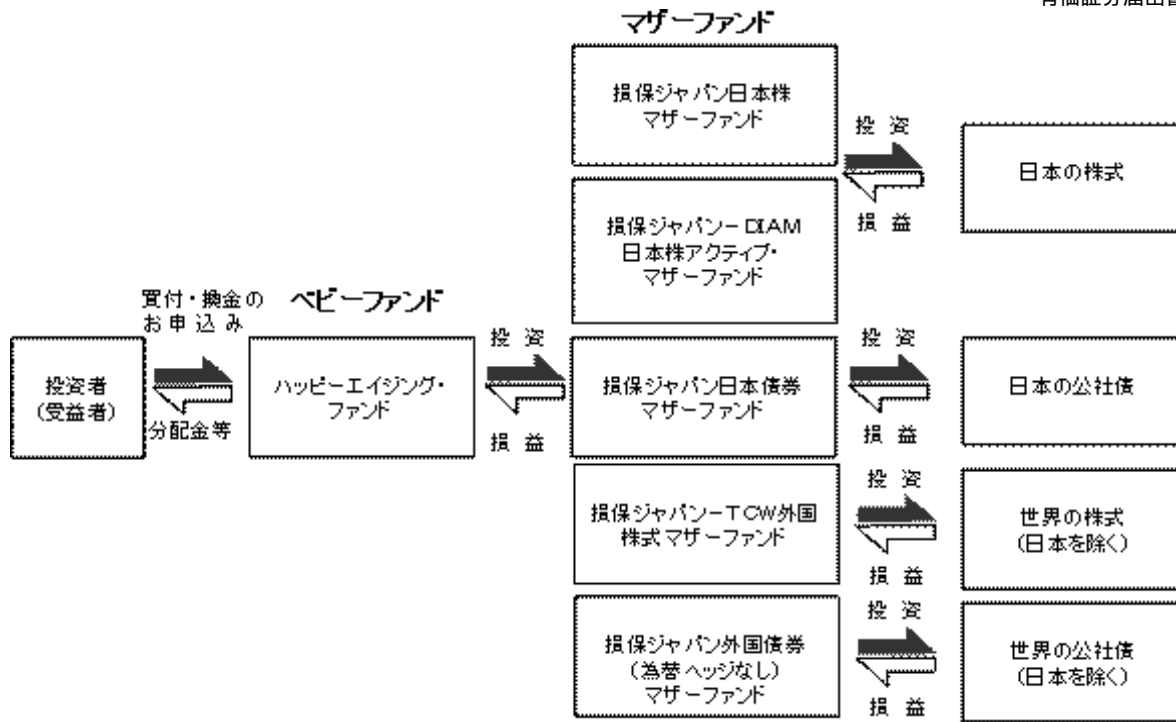
主要投資対象ごとの基本資産配分比率を規定する方法から、株式の組入比率を規定する方法に変更

平成24年3月30日 マザーファンドの評価、入れ替えを行わないこととし、その助言に関する損保ジャパンDC証券株式会社との投資顧問契約を解約。

（３）【ファンドの仕組み】

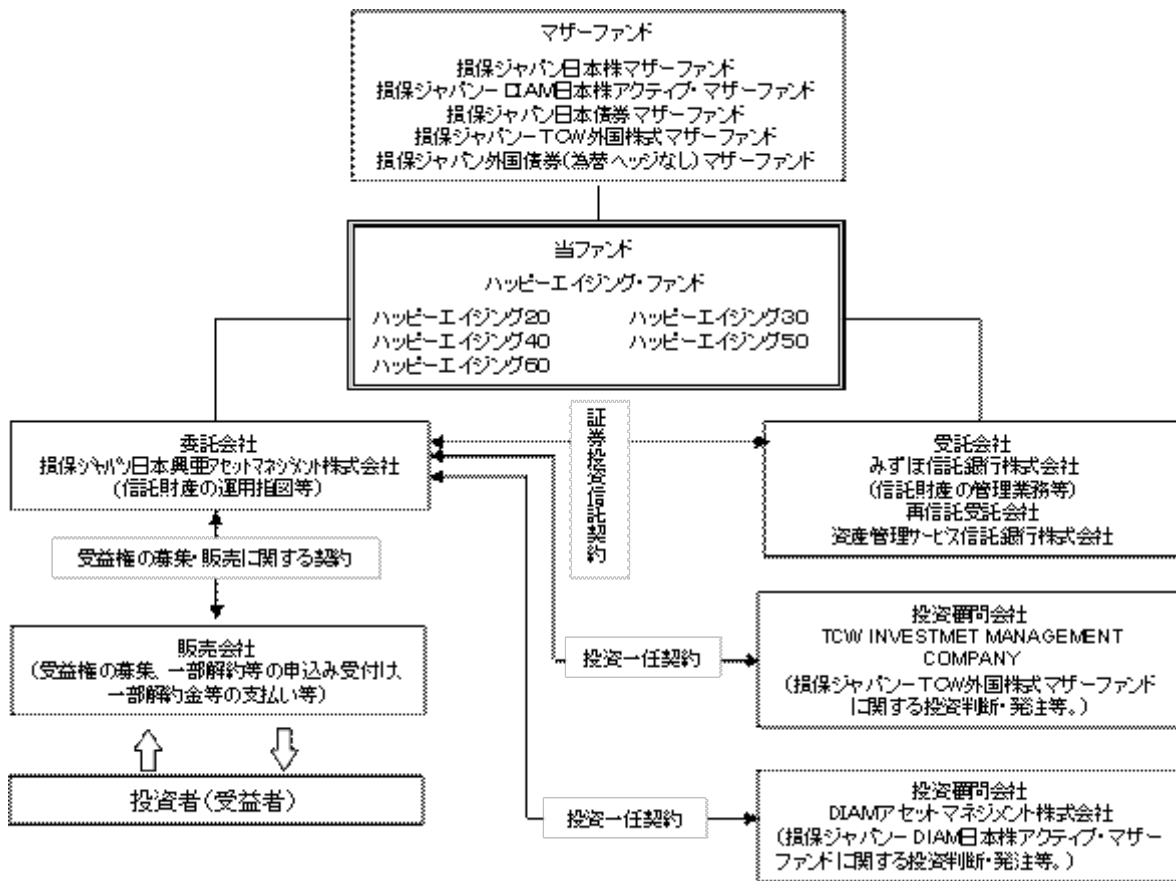
ファンドの仕組み

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」（「ハッピーエイジング・ファンド」）とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」（「損保ジャパン日本株マザーファンド」、「損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド」、「損保ジャパン日本債券マザーファンド」、「損保ジャパン-T C W外国株式マザーファンド」、「損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド」）に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。当ファンドは「ベビーファンド」にあたりません。ただし、ベビーファンドから有価証券等に直接投資することもあります。



各マザーファンドには、「ハッピーエイジング・ファンド」以外にも当該マザーファンドに投資するファンド（ベビーファンド）があります。また、今後当該各マザーファンドに投資する他のファンドが設定される場合もあります。

ファンドの関係法人図



ファンドの関係法人

() 委託会社または委託者：損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

各ファンドの委託会社として、信託財産の運用指図、目論見書及び運用報告書の作成等を行います。

() 販売会社

委託会社との受益権の募集・販売に関する契約に基づき、各ファンドの販売会社として、受益権の募集・販売の取扱い、目論見書・運用報告書の交付、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金の再投資、一部解約金・収益分配金・償還金の支払い、取引報告書等の交付等を行います。

() 受託会社または受託者：みずほ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：資産管理サービス信託銀行株式会社)

委託会社との証券投資信託契約に基づき、各ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理業務などを行い、収益分配金、一部解約金及び償還金の交付、また信託財産に関する報告書を作成し委託会社への交付を行います。なお、信託事務の処理の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。

() 投資顧問会社：TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY（以下、「TCW」といいます。）

DIAMアセットマネジメント株式会社（以下、「DIAM」といいます。）

TCWは、委託会社との投資一任契約に基づき、「損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド」に関して、委託会社より、運用スタイル毎のアロケーションと北米株式の運用の指図に関する権限の委託を受けて投資判断、発注等を行います。

D I A Mアセットマネジメント株式会社は、委託会社との投資一任契約に基づき、「損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド」に関して、委託会社より、日本株式の運用の指図に関する権限の委託を受けて投資判断、発注等を行います。

委託会社等の概況

() 資本金の額 1,550百万円(平成25年8月末現在)

() 委託会社の沿革

昭和61年	2月25日	安田火災投資顧問株式会社設立
昭和62年	2月20日	投資顧問業の登録
昭和62年	9月9日	投資一任業務の認可取得
平成3年	6月1日	プリンソン・パートナーズ投資顧問株式会社と合併し、安田火災プリンソン投資顧問株式会社に商号変更
平成10年	1月1日	安田火災グローバル・アセット・マネジメント株式会社に商号変更
平成10年	3月3日	安田火災グローバル投信投資顧問株式会社に商号変更
平成10年	3月31日	証券投資信託委託業の免許取得
平成14年	7月1日	損保ジャパン・アセットマネジメント株式会社に商号変更
平成19年	9月30日	金融商品取引業者として登録
平成22年	10月1日	ゼスト・アセットマネジメント株式会社と合併し、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社に商号変更

() 大株主の状況(平成25年8月末現在)

名称	住所(所在地)	所有株式数 (株)	持株比率 (%)
N K S Jホールディングス株式会社	東京都新宿区西新宿一丁目26番1号	24,085	100.0

2【投資方針】

(1)【投資方針】

a. 基本方針

当ファンドは、中長期的に信託財産の着実な成長を目標として運用を行います。

b. 運用方針

投資対象

「損保ジャパン日本株マザーファンド」、「損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド」、「損保ジャパン日本債券マザーファンド」、「損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド」、「損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド」の受益証券およびエマージング株式又はエマージング株式を主要投資対象とする証券投資信託を主要投資対象とします。このほか、内外の有価証券等に直接投資することがあります。

投資態度

() 主として上記のマザーファンドの受益証券等への投資を通して、国内株式・国内債券にとど

まらず世界各国の株式および債券に積極的に分散投資を行うことによって、リスクを軽減しつつ信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指します。

() 各マザーファンドを通じて実質的に投資する株式(当ファンドが直接投資する株式を含みます。)への配分比率は、ハッピーエイジング20で信託財産の純資産総額の概ね90%程度、ハッピーエイジング30で信託財産の純資産総額の概ね70%程度、ハッピーエイジング40で信託財産の純資産総額の概ね50%程度、ハッピーエイジング50で信託財産の純資産総額の概ね30%程度、ハッピーエイジング60で信託財産の純資産総額の概ね10%程度となることを目処に投資を行います。

() 資金動向、市況動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。

() 国内において行われる有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)、有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。

() 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことができます。

() 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(2) 【投資対象】

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

() 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

委託会社は、信託金を、主として後記1.から5.までの損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託(以下それぞれ「親投資信託」といいます。)の受益証券および後記6.から25.までの有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 損保ジャパン日本株マザーファンド

2. 損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド

3. 損保ジャパン日本債券マザーファンド

4. 損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

5. 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

6. 株券または新株引受権証書

7. 国債証券

8. 地方債証券
 9. 特別の法律により法人の発行する債券
 10. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下、「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 11. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 12. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 13. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 14. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 15. コマーシャル・ペーパー
 16. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 17. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前記1.から16.までの証券または証書の性質を有するもの
 18. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 19. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 20. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 21. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 22. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 23. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 24. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 25. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 26. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 27. 外国の者に対する権利で前記26.の有価証券の性質を有するもの
- なお、前記6.の証券ならびに証書、17.および22.の証券または証書のうち6.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、7.から11.までの証券ならびに17.および22.の証券または証書のうち7.から11.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、18.の証券および19.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前記5.の権利の性質を有するもの

前記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前記 1.から6.までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（３）【運用体制】

a．委託会社の運用体制と社内規程

（運用体制）

投信投資戦略会議は、ファンドの基本運用方針の分析と決定を行います。

各資産投資戦略会議は、投信投資戦略会議の基本運用方針に基づき、ファンドの運用戦略を決定し、運用計画を策定します。

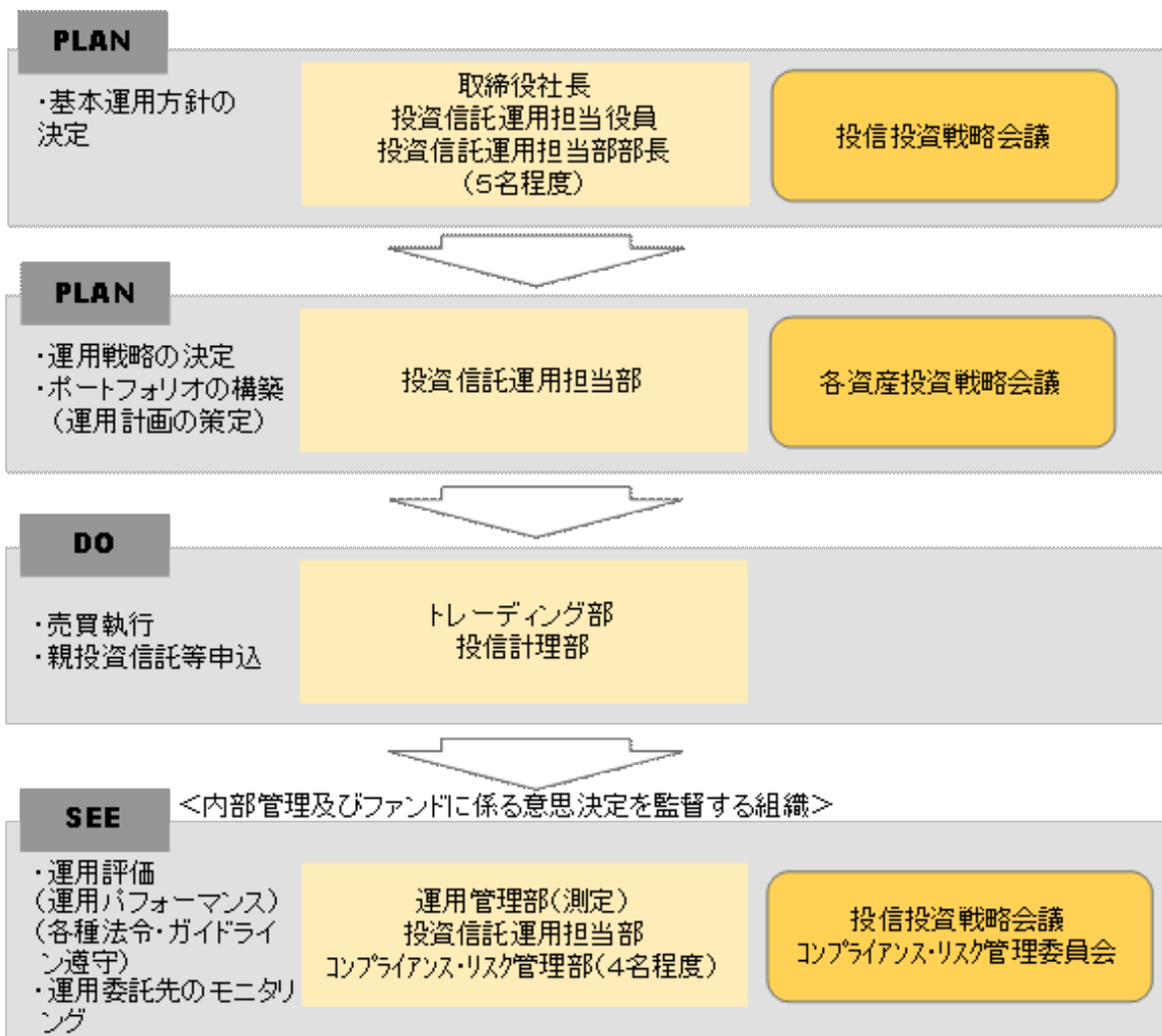
各資産投資戦略会議で策定された運用計画に基づき、トレーディング部が最良執行の観点から売買を執行します。

運用状況の分析・評価等は運用担当部で行い、投信投資戦略会議に報告されます。また、売買チェック、リスク管理、各種法令、ガイドライン遵守の状況は、コンプライアンス・リスク管理部で確認を行い、コンプライアンス・リスク管理委員会に報告されます。

（社内規程）

社内規程で当ファンドの「業務マニュアル」を定めている他、有価証券売買の発注先に関する各種規程や「有価証券の自己取引制限に関する規程」、「行動規程」、「コンプライアンス・マニュアル」等の服務規程を定め、法令遵守の徹底、インサイダー取引の防止に努めています。

また、外部委託先の管理体制については、当社が当社以外の者に業務を委託するときの基本事項等を定めた「外部委託管理規程」に従い、定期モニタリング等を実施しています。



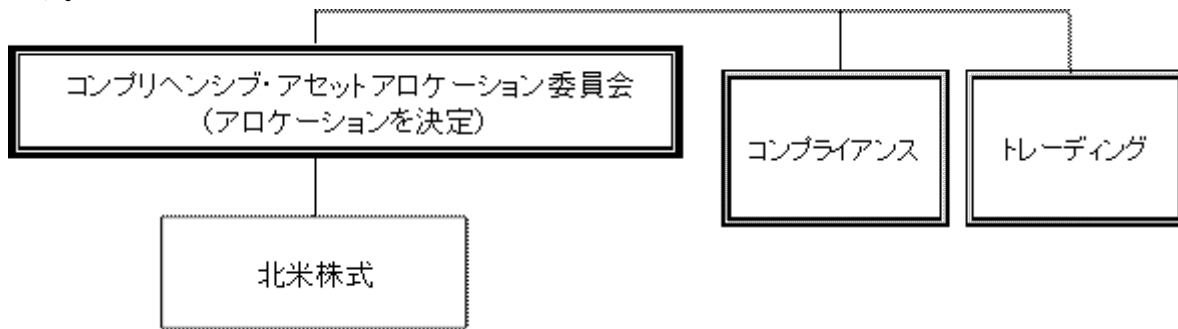
※平成25年8月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

b．運用委託先の運用体制等

損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンドの運用委託先であるTCWでは、主に資産配分を担当するコンプリヘンシブ・アセットアロケーション委員会ならびに各プロダクト毎に編成されたチームが

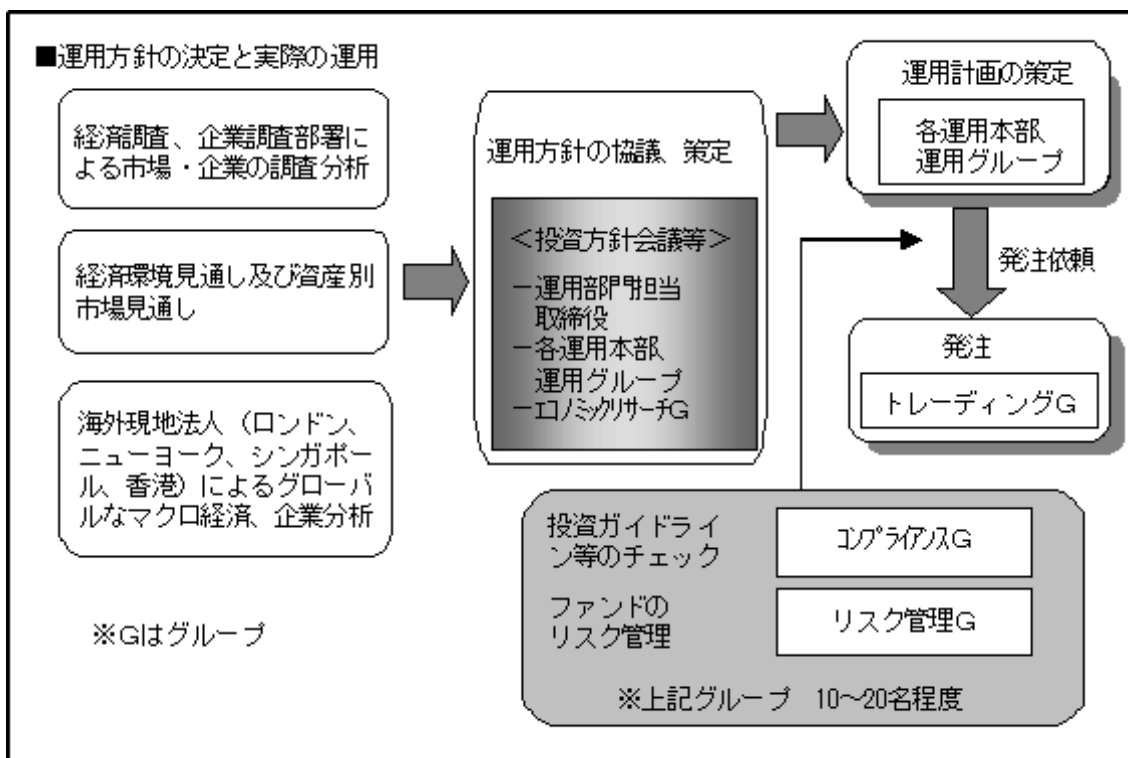
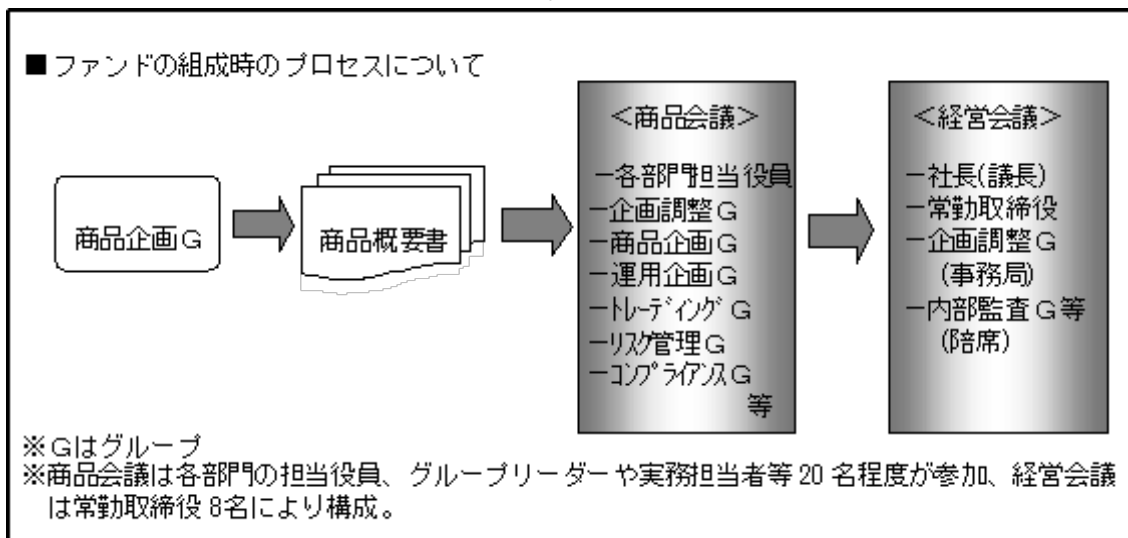
連携して運用を行っております。また、コンプライアンス部門によるチェック体制も保持していま

す。



（本組織図は、平成25年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。）

損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンドの運用委託先であるD I A Mでは、以下のような体制により運用を行っております。



< ファンドの商品概要等の決定 >

運用目標、運用プロセス、投資対象などの商品内容は、商品企画グループが関連各部署と協議のうえ、「商品概要書」として策定し、企画調整グループが事務局となる「商品会議」にて協議・検討致します。「商品会議」で協議・修正等された商品内容は「経営会議」で経営陣による討議を経て最終決定致します。なお、「経営会議」は、社長が議長を務め、常勤取締役を構成メンバーとし、監査役が同席のうえ、開催される会議であり、取締役会が決定した会社の基本方針に基づき全般的業務執行方針・計画および重要な業務の実施について協議・決定するとともに経営上の重要事項を審議しています。

< 運用方針の決定と実際の運用 >

経済環境見通し、資産別市場見通し、基本投資方針およびファンドの運用方針は、運用部門担当取締役、各運用本部、運用グループの運用担当者、エコノミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議、策定致します。

運用担当者は、「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等によって得られた情報も参考にされます。

個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループで執行されます。

なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループにて行われず、ファンドのリスク管理や分析については、リスク管理グループにて行われます。

上記体制は、平成25年7月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

(4) 【分配方針】

毎決算時（原則として7月15日）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額の範囲

繰越分を含めた利子、配当収入と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。

分配対象収益についての分配方針

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

留保益の運用方針

留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

a. 当ファンドの信託約款に基づく投資制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。以下において同じ。）への投資制限

「ハッピーエイジング２０」

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

実質投資割合とは、実質投資額（信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と親投資信託に属する当該株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額）を信託財産の純資産総額で除したものです。また、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する親投資信託の時価総額に親投資信託の信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。以下同じ。

「ハッピーエイジング３０」

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

「ハッピーエイジング４０」

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。

「ハッピーエイジング５０」

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。

「ハッピーエイジング６０」

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%未満とします。

投資する株式等の範囲

- () 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所（金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号口に規定する外国金融商品市場をいいます。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとして、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- () 前記()の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

新株引受権証券等への投資制限

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

投資信託証券への投資制限

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

信用取引の指図および範囲

- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。

- () 前記()の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額と親投資信託に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- () 信託財産の一部解約等の事由により、前記()の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

公社債の空売りの指図および範囲

- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けるとの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- () 前記()の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- () 信託財産の一部解約等の事由により、前記()の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

先物取引等の運用指図

- () 委託会社は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。
- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図

- () 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下、「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- () スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- () スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- () 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

- () 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- () 金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- () 金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- () 委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

同一銘柄の株式への投資制限

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額と親投資信託に属する当該同一銘柄の株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の5を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と親投資信託に属する当該同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の5を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

同一銘柄の転換社債等への投資制限

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の時価総額と親投資信託に属する当該同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の10を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

有価証券の貸付の指図および範囲

- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の1.および2.の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- () 前記1.および2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- () 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の借入れの指図および範囲

- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- () 前記()の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- () 信託財産の一部解約等の事由により、前記()の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- () 前記()の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

外国為替予約の指図

- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- () 前記()の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- () 前記()の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ

- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- () 一部解約に伴う支払資金の手当にかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- () 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- () 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

受託会社による資金の立替え

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

() 前記()および()の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

b. 法令に基づく投資制限

同一の法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権（株主総会において決議することができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図してはならないとされています。

デリバティブ取引に係る投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令）

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券又はオプションを表示する証券若しくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）を行い、又は継続することを指図してはならないとされています。

（参考）「損保ジャパン日本株マザーファンド」の運用の基本方針

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の長期的成長を目指して、積極的な運用を行います。

2. 運用方針

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象といたします。

(2) 投資態度

主としてわが国の上場株式及び店頭登録銘柄に投資し、長期的運用を行います。

転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債や新株引受権証券および新株予約権証券（外貨建てを含みます。）等に投資する場合があります。

株式（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式を含む。）の組入比率は原則として信託財産総額の50%超（高位に維持）を基本とします。なお、株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含む。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。ただし、資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。

有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引（以下、「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

信託財産の効率的な運用を図るため、信託財産に属する有価証券の貸付を行うことができます。

信用取引の指図は、信託財産が保有する当該銘柄の株式数、転換社債にかかる転換可能株式数、新株引受権付社債および新株引受権証券の引受権または新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権の行使可能株式数での売付（現渡しまたは買戻しによる決済も可能とします。）に限り行うことができます。

日本株式の銘柄選択は、以下のように行います。

日本株式の投資候補銘柄群を、日経株価指数300の構成銘柄をベースに全上場銘柄から、時価総額、売買流動性、信用リスク、事業内容等を勘案して決定します。

マクロ経済分析、産業動向分析により、経済のファンダメンタルズ分析を行った上で、独自の株式評価モデルを利用して、各銘柄の投資価値（適正株価）を算出します。

株式評価モデルでは、アナリストが各企業の売上高成長率、売上高営業利益率、投資資産利回りなどの予測を行い、将来の業績予想を入力します。この分析をもとに推計した将来の配当の現在価値の合計を求めたものが、株式の投資価値（適正株価）であると考えています。

各銘柄の適正株価と市場価格を比較することで、全投資候補銘柄群の相対的割安度をランキングします。

このランキングに基づいて、割安度の高い銘柄を中心に、業種ウェイトとリスク分析を加味した上でポートフォリオを構築します。最終的に組入銘柄を決定する際には、アナリストによる候補企業の業績予想を再度チェックし、信用リスク、当面の業績動向や株価に悪影響を与えるリスクシナリオなどの検討を行います。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券等への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の転換社債等への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

有価証券先物取引等は、信託約款第17条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第18条の範囲で行います。

金利先渡し取引及び為替先渡し取引は、信託約款第19条の範囲で行います。

（参考）「損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド」の運用の基本方針

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の長期的成長を目指して、積極的な運用を行います。

2. 運用方針

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象といたします。

(2) 投資態度

主としてわが国の上場株式及び店頭登録銘柄に投資し、長期的運用を行います。

運用にあたっては、D I A Mアセットマネジメント株式会社に日本株式の運用指図に関する権限を委託します。

ボトムアップ・アプローチにより厳選された銘柄群の中から、利益成長に重点をおいた銘柄選択を行い、安定的に東証株価指数（T O P I X）を上回る成果を目指します。

転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債や新株引受権証券および新株予約権証券等（外貨建を含みます。）に投資する場合があります。

株式（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式を含む。）の組入比率は原則として信託財産総額の50%超（高位に維持）を基本とします。なお、株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式

以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含む。)への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。ただし、資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。

国内において行われる有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)、有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下、「スワップ」取引といいます。)を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付を行うことができます。

D I A Mの株式運用は、企業のファンダメンタルズ分析を重視したボトムアップによる銘柄選択を行うことを原則とします。銘柄選択はファンドマネージャー自ら会社訪問を行い、企業の成長性と投資価値を総合的に判断し、以下のように組入れ銘柄を決定します。

原則として、毎月1回、投資方針会議を開催し、各種経済指標・金融指標等の分析結果に基づき、国内の経済環境見通しおよび市場見通し、ならびにポートフォリオの基本スタンスを協議・策定します。

主に組入候補銘柄群(全上場・店頭登録銘柄の中から、大型株と中小型株をセクター間の偏りを調整しつつ約600銘柄選定します。)を対象として、運用担当者および調査担当アナリストは、企業訪問活動・その他の活動によって得られた情報に基づき、企業の収益性・財務内容の面から調査・分析活動を行います。

- ・大型株 : 時価総額および信用度を基準としてスクリーニングします。
- ・中小型株 : 大型株以外の銘柄の中から、中長期成長力にフォーカスし、流動性を勘案しつつ選定します。

運用担当者は、により得られたファンダメンタルズ情報に基づき、短期的・中長期的な視点で株価への織込み度合い等から独自にレーティングし、バリュエーション評価を行ったうえ、組入銘柄を選出します。

により選出された組入銘柄を、D I A M独自に細分化したサブ・セクターに分散して運用指図を行います。

運用担当者は、日次・週次のベースで、ポートフォリオのリスクをウオッチし、必要に応じてリスクのコントロールを行い、適宜ポートフォリオの見直しを行います。

各トレーダーは、最良の執行ができるように、ブローカーを選別します。選別にあたっては、手数料、売買執行のスピード、業界での評価、財務内容および調査またはブローカーのサービス内容等の多数の要素を勘案し、決定します。

毎月開催される経営会議において、パフォーマンス評価・分析を行い、リスク管理を行います。修正が必要であれば、速やかにポートフォリオの見直しを運用担当者へ指示します。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券等への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

有価証券先物取引等は、信託約款第20条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第21条の範囲で行います。

金利先渡取引及び為替先渡取引は、信託約款第22条の範囲で行います。

（参考）「損保ジャパン日本債券マザーファンド」の運用の基本方針

1. 基本方針

この投資信託は、主に日本の公社債に投資を行い、中長期的に信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

2. 運用方針

(1) 投資対象

日本の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として、日本の公社債を中心に分散投資を行い、インカムの確保を図るとともに金利低下や格付け上昇に伴うキャピタルゲインの獲得を狙い、NOMURA - B P I 総合指数を中長期的に上回る投資成果を目指します。

投資に際しては、内外いずれかの評価機関からB B B格あるいはB B B格相当以上の格付を得ている信用度の高い銘柄とします。格付を取得していない公社債については、客観的に同等の信用力があると判断した場合には投資を行うことがあります。

運用期間を通じて、ポートフォリオの見直しを随時行い、個別組入銘柄変更やデュレーション調整等を行います。

外貨建資産については、為替変動リスクを回避するため、対円で原則100%為替ヘッジを行います。

資金動向、市況動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。

国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下、「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

ポートフォリオ構築は下記のように行います。

マクロ経済や市場に関する分析をもとに独自開発したイールドカーブ・モデルやセクターモデルにより、投資価値（適正金利水準）と市場価格（市場金利水準）の差を測定し、相対的に割安度の高い銘柄を選択します。

ポートフォリオ構築の際には、デュレーション戦略、イールドカーブ戦略、セクター戦略、個別銘柄戦略により、デュレーション、残存期間別ウェイト、債券種別別ウェイトなどをベンチマークに対してアクティブに変動させます。

* デュレーションとは、債券の利金・償還金の現在価値を、受取るまでの期間に応じて加重平均した値です。その値は、債券の平均回収年限を表していると同時に、金利に対する債券価格の変動性指標としても用いられます。この値が大きいほど、金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなり、リスクも高くなるといえます。

国債・地方債・政府保証債・金融債以外の事業債等については、内外いずれかの評価機関からB B B格あるいはB B B格相当以上の格付を得ている信用度の高い銘柄を投資対象とします。

(3) 運用制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の株式等への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

有価証券先物取引等は、信託約款第18条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第19条の範囲で行います。

金利先渡取引および為替先渡取引は、信託約款第20条の範囲で行います。

（参考）「損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド」の運用の基本方針

1. 基本方針

この投資信託は、主に外国の株式に投資し、積極的に収益の獲得を目指して運用を行います。

2. 運用方針

(1) 投資対象

日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主にモルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル・コクサイ指数（以下、「MSCIコクサイ指数」といいます。）に採用されている国の株式に積極的に投資を行い、同指数を上回る投資成果を目指します。

運用にあたっては、TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY（米国）に運用スタイル毎のアロケーションと北米株式の運用の指図に関する権限を委託します。

運用スタイル毎のアロケーションに関しては、TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANYが各市場の企業の過去及び予想業績成長率、市場間の相対的魅力度の分析、各国の金利・物価上昇率・為替レート・中央銀行の金融政策などのファンダメンタルズ分析などの情報を集約して市場間の相対的魅力度を順位付けし、リスクを考慮したうえで、決定します。

運用スタイル毎のアロケーションが決定されると、ボトム・アップ・アプローチにより銘柄を選択します。

株式への投資割合は、原則として高位とします。

資金動向、市況動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。

有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下、「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

外国株式の運用スタイル毎のアロケーション及び銘柄選択は以下のように行います。

株式の運用スタイル毎のアロケーションは、TCWが各市場の企業の過去及び予想業績成長率、市場間の相対的魅力度の分析、各国の金利・物価上昇率・為替レート・中央銀行の金融政策などのファンダメンタルズ分析などの情報を集約して市場間の相対的魅力度を順位付けし、この結果を反映させながらアセット・アロケーションの専門家により、リスクに対する収益の最適化を図りながら決定されます。

運用スタイル毎のアロケーションが決定されると、ボトム・アップ・アプローチにより銘柄を選択し、ポートフォリオを構築します。

* ボトム・アップ・アプローチとは、企業調査及び分析をもとに個別銘柄の選択に主眼を置いた投資手法の一つです。

定量的・定性的判断によって、投資対象企業のスクリーニングを行い、投資候補銘柄の絞り込みを行います。

このスクリーニングで絞られた投資先について、TCWのアナリストによる企業訪問等による情報をもとに、企業のファンダメンタルズ分析を行い最終投資候補銘柄を決定します。

ポートフォリオ全体としての、適切なリスク量を管理しながら、組入銘柄の配分等を決定します。

(3) 運用制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券等への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

有価証券先物取引等は、信託約款第20条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第21条の範囲で行います。

金利先渡取引および為替先渡取引は、信託約款第22条の範囲で行います。

（参考）「損保ジャパン外国債券（ヘッジなし）マザーファンド」の運用の基本方針

1. 基本方針

この投資信託は、主に日本を除く世界各国の公社債に投資を行い、中長期的に信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

2. 運用方針

(1) 投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として日本を除く先進各国の政府、政府機関等の発行する外国債券を中心に分散投資を行い、国内債より相対的に高いインカムを確保を図るとともに金利低下や格付け上昇に伴うキャピタルゲインの獲得を狙い、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）を中長期的に上回る投資成果を目指します。

投資対象国は、原則としてA格相当以上の長期債格付が付与された国とし、シティグループ世界国債インデックス採用国を中心とします。ポートフォリオの見直しは随時行い、各国の政治・経済動向の変化や市況動向、リスク分散等を勘案して、国別の投資比率の変更やデュレーション調整等を行います。また、債券の組入比率は高位に保つことを原則とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

資金動向、市況動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。

国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）

す。）、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

ポートフォリオ構築は下記のように行います。

マクロ経済や市場に関する分析をもとに独自開発したグローバル債券評価モデル（イールドカーブ・モデル）や為替評価モデル、セクターモデルにより、投資価値（適正金利水準等）と市場価格（市場金利水準等）の差を測定し、相対的に割安度に基づき国別配分及び銘柄選択を行います。

ポートフォリオ構築の際には、国別配分戦略、デュレーション戦略、イールドカーブ戦略、セクター戦略、個別銘柄戦略により、国別配分比率、デュレーション、残存期間別ウェイト、債券種類別ウェイトなどをベンチマークに対してアクティブに変動させます。

(3) 運用制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

有価証券先物取引等は、信託約款第20条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第21条の範囲で行います。

金利先渡取引および為替先渡取引は、信託約款第22条の範囲で行います。

3【投資リスク】

各ファンドの基準価額は、組入れられる有価証券等の値動き等による影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資者の皆様へに帰属いたします。したがって、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金とは異なります。

各ファンドの主なりスクは以下のとおりです。

基準価額の変動要因は、以下に限定されるものではありません。

<当ファンドの投資にかかるリスク>

資産配分のリスク

各ファンドの基準資産配分比率が収益の源泉となる場合もありますが、配分比率が高い資産の価格が下落した場合等には株式、債券市場全体やベンチマークの収益率を下回ることがあります。

価格変動リスク

株式や公社債の価格は、国内外の政治・経済情勢、市況等の影響を受けて変動します。

また、一般に、金利が上昇すると、公社債の価格は下落します。組入れている株式や公社債の価格の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

信用リスク

株式や公社債の価格は、発行体の財務状態、経営、業績等の悪化及びそれらに関する外部評価の悪化等により下落することがあります。組入れている株式や公社債の価格の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また発行体の倒産や債務不履行等の場合は、株式や公社債の価値がなくなることもあり、ファンドの基準価額が大きく下落する場合があります。

流動性リスク

国内外の政治・経済情勢の急変、天災地変、発行体の財務状態の悪化等により、有価証券等の取引量が減少することがあります。この場合、ファンドにとって最適な時期や価格で、有価証券等を売買できないことがあり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

また、取引量の著しい減少や取引停止の場合には、有価証券等の売買ができなかったり、想定外に不利な価格での売買となり、ファンドの基準価額が大きく下落する場合があります。

為替変動リスク

外貨建資産の価格は、当該外貨と日本円との間の為替レートの変動の影響を受けて変動します。為替レートは、各国の政治・経済情勢、外国為替市場の需給、金利変動その他の要因により、短期間に大幅に変動することがあります。当該外貨の為替レートが、円高になった場合は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

カンントリーリスク

一般的に、主要先進国以外の国では、主要先進国に比べて、経済が脆弱である可能性があり、国内外の政治・経済情勢、取引制度、税制の変化等の影響を受けやすく、また市場規模や取引量が小さいこと等から有価証券等の価格がより大きく変動することがあり、ファンドの基準価額が大きく下落することがあります。

コール・ローン等の短期金融商品の取引相手の債務不履行等により、当該金融商品等の取引ができなかった場合等は、ファンドが影響を受ける場合があります。

<その他の留意点>

クーリングオフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用はありません。

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

マザーファンドに投資する別のベビーファンドの追加設定・解約等により、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額が影響を受ける場合があります。

ファンドとベンチマークは組入銘柄や国別配分比率が異なることがあり、ファンドの運用成績はベンチマークを下回る場合があります。

ファンドに関連する法令・税制・会計等は今後変更される可能性があります。これに伴い、ファンドの基準価額が影響を受ける場合があります。

販売会社より委託会社に対して申込金額の払込みが実際になされるまでは、ファンドも委託会社もいかなる責任も負いません。

委託会社は収益分配金、償還金および一部解約金を販売会社に対して支払った後は、受益者への支払いについての責任を負いません。

委託会社はファンドの設定・運用について、販売会社はお申込代金の預かり等を含む販売について、それぞれ責任を有し、互いに他について責任を負いません。

お申込み、ご換金に関わる留意点

<お申込時>

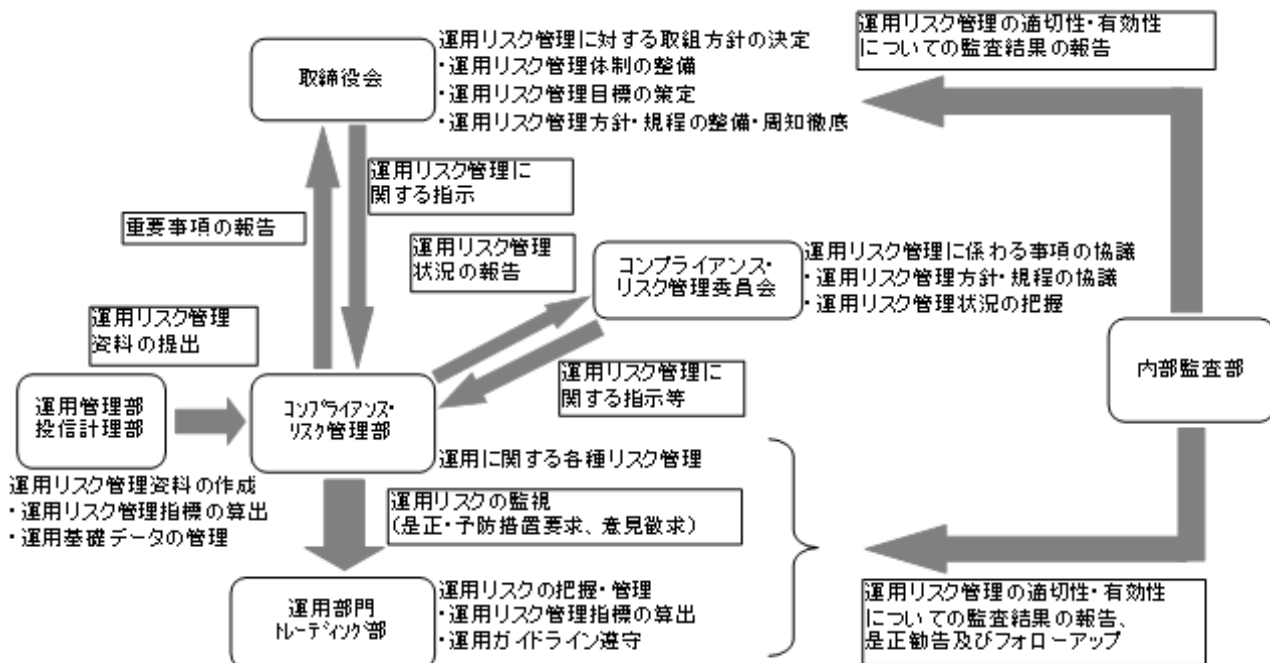
委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、取引市場における流動性が極端に減少した場合、取引市場の混乱、自然災害、テロ、大規模停電、システム障害等により基準価額の算出が困難となった場合、その他やむを得ない事情があると判断したとき（「緊急事態発生時」といいます。）は、取得申込みの受付を中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付を取り消すことができるものとします。

<ご換金時>

委託会社は、緊急事態発生時には、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、および既に受付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができるものとします。一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付け中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとし、信託約款の規定に準じて算出した価額とします。

<リスクの管理体制>

a. 委託会社のリスク管理体制

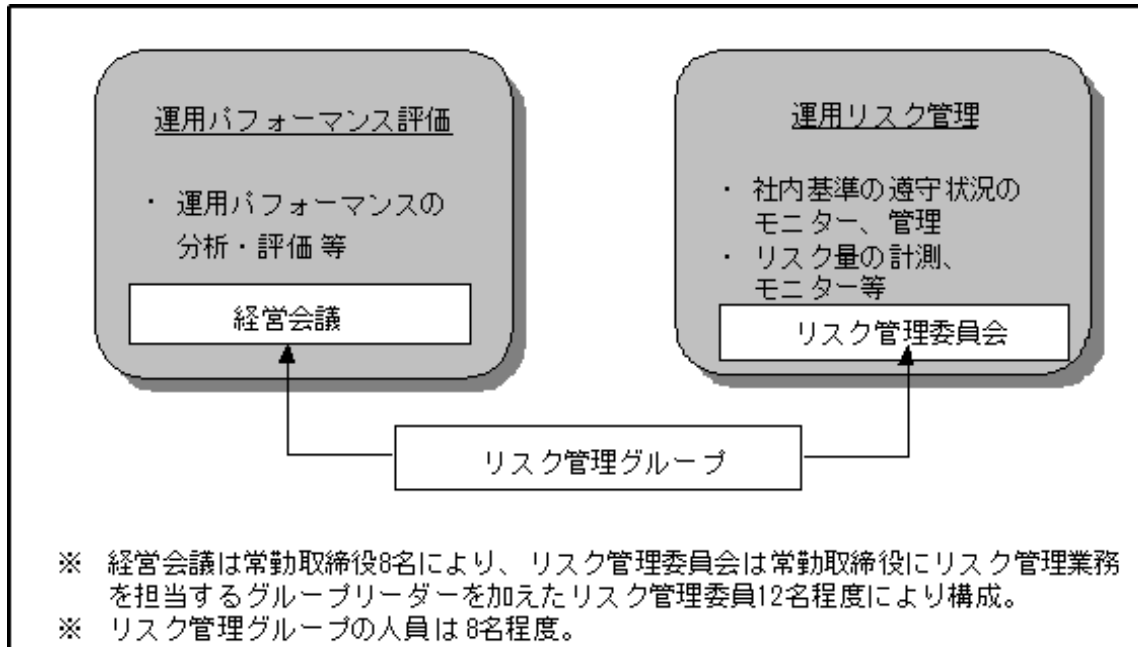


（注）上図は、平成25年8月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

b. 運用委託先のリスク管理体制等

損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンドの運用委託先であるTCWにおいては、投資制限の遵守状況について、独立の組織であるコンプライアンス部門のチェックを常に受けております。また、TCWが行った取引については、TCW社内のトレーディング委員会においてレビューが行われます。

損保ジャパン-DIAM日本株アクティブ・マザーファンドの運用委託先であるDIAMにおいては、以下のような体制のもとで、リスク管理が行われています。



運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立したリスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

運用リスク管理は、リスク管理グループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行います。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理委員会に報告致します。

上記のリスク管理体制は、平成25年7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

< 申込み時に受益者が負担する費用・税金 >

時期	項目	費用・税金
申込み時	申込手数料及び消費税等相当額	申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.1%（税抜 2.0%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。 申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。また、消費税率が8%になった場合は、2.16%となります。

- 1 基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。ただし、便宜上1万口当りに換算した価額で表示されることがあります。
- 2 税法が改正された場合は、上記の内容が変更になることがあります。
- 3 定時定額購入サービス契約を結ばれた場合および確定拠出年金制度に基づく申込みの場合、お申込手数料はありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金（解約）手数料はかかりません。ただし、ご換金時には信託財産留保額をご負担いただきます。

時期	項目	費用
解約請求時	信託財産留保額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額に対して 0.2%

(3)【信託報酬等】

委託会社及び受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.9870%（税抜0.940%）～1.7010%（税抜1.620%）を乗じて得た金額とし、委託会社と受託会社との間の配分は以下のとおりです。（下記のとおり、委託会社は販売会社への配分を一旦收受します。）消費税率が8%になった場合は、年率1.0152%～1.7496%となります。

(年率)

ファンド名	合計	純資産総額	内訳		
			委託会社 (税抜)	販売会社 (税抜)	受託会社 (税抜)
ハッピー エイジング 20	1.7010% (税抜1.620%)	10億円までの部分	0.730%	0.810%	0.080%
		10億円超20億円までの部分	0.696%	0.844%	
		20億円超30億円までの部分	0.677%	0.863%	
		30億円超50億円までの部分	0.663%	0.877%	
		50億円超150億円までの部分	0.638%	0.902%	
		150億円超300億円までの部分	0.616%	0.924%	
		300億円超の部分	0.598%	0.942%	
ハッピー エイジング 30	1.5225% (税抜1.450%)	10億円までの部分	0.650%	0.720%	0.080%
		10億円超20億円までの部分	0.629%	0.741%	
		20億円超30億円までの部分	0.612%	0.758%	
		30億円超50億円までの部分	0.599%	0.771%	
		50億円超150億円までの部分	0.577%	0.793%	
		150億円超300億円までの部分	0.558%	0.812%	
		300億円超の部分	0.543%	0.827%	
ハッピー エイジング 40	1.3440% (税抜1.280%)	10億円までの部分	0.580%	0.630%	0.070%
		10億円超20億円までの部分	0.562%	0.648%	
		20億円超30億円までの部分	0.547%	0.663%	
		30億円超50億円までの部分	0.535%	0.675%	
		50億円超150億円までの部分	0.517%	0.693%	
		150億円超300億円までの部分	0.500%	0.710%	
		300億円超の部分	0.488%	0.722%	
ハッピー エイジング 50	1.1655% (税抜1.110%)	10億円までの部分	0.510%	0.540%	0.060%
		10億円超20億円までの部分	0.495%	0.555%	
		20億円超30億円までの部分	0.482%	0.568%	
		30億円超50億円までの部分	0.471%	0.579%	
		50億円超150億円までの部分	0.456%	0.594%	
		150億円超300億円までの部分	0.442%	0.608%	
		300億円超の部分	0.433%	0.617%	

ハッピー エイジング 60	0.9870% (税抜0.940%)	10億円までの部分	0.440%	0.450%	0.050%
		10億円超20億円までの部分	0.428%	0.462%	
		20億円超30億円までの部分	0.417%	0.473%	
		30億円超50億円までの部分	0.407%	0.483%	
		50億円超150億円までの部分	0.395%	0.495%	
		150億円超300億円までの部分	0.384%	0.506%	
		300億円超の部分	0.378%	0.512%	

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日及び毎計算期末、または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬に対する消費税等相当額を信託報酬支弁のときに信託財産の中から支弁します。（税額は、税法改正時には変更となります。）

信託報酬の販売会社への配分は、販売会社の行う業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、取扱残高に応じて支払います。委託会社は、信託報酬を収受したときは、販売会社に対して代行手数料を遅滞なく支払うものとします。なお、販売会社への配分には、消費税等相当額が含まれています。

委託会社の報酬には、各マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託したD I A Mアセットマネジメント株式会社及びTCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY (T C W) への投資顧問報酬が含まれます。投資顧問報酬の額は、当ファンドに属する各マザーファンドの時価総額に当該計算期間を通じて毎日、D I A Mアセットマネジメント株式会社に対しては年0.0819%（税抜0.078%）以内、TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANYに対しては年0.1056%以内の率を乗じて得た金額とします。

消費税率が8%になった場合は、0.08424%となります。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料に対する消費税等相当額及び先物取引・オプション取引等及びコール取引等に要する費用及び外国における資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担します。信託財産の証券取引等に伴う手数料や税金は信託財産が負担しますが、売買委託手数料や有価証券取引税等証券取引に伴う手数料や税金は国や市場によって異なります。また、売買金額によっても異なります。

（4）【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

委託会社は、前記 に定める信託事務の処理に要する諸費用のうち監査費用の支払いを信託財産のために行い、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。この場合、信託財産にかかる監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、実際の費用額（年間26.25万円（税抜25万円））を上限として、純資産総額に定率（年0.00462%（税抜0.0044%））を乗じて日々計算し、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産からその支弁を受けることとします。なお、監査費用の上限金額については、変動する可能性があります。

消費税率が8%になった場合は、それぞれ27万円および0.004752%となります。

（５）【課税上の取扱い】

個人の受益者に対する課税

< 収益分配時 >

[平成25年12月31日まで]

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、10.147%（所得税7.147%および地方税3%）の税率が適用されます。

上記税率は、平成26年1月1日以降は20.315%（所得税15.315%および地方税5%）となる予定です。

< 一部解約時および償還時 >

[平成25年12月31日まで]

一部解約時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得等として課税対象となり、10.147%（所得税7.147%および地方税3%）の税率が適用されます。

上記税率は、平成26年1月1日以降は20.315%（所得税15.315%および地方税5%）となる予定です。

法人の受益者に対する課税

[平成25年12月31日まで]

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、7.147%（所得税7.147%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。

上記税率は、平成26年1月1日以降は15.315%（所得税15.315%）となる予定です。

（注1） 個別元本について

- ・追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- ・受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ・ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合等については個別元本の計算方法が異なる場合があります。受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記<収益分配金の課税について>をご参照ください。）

（注2） 収益分配金の課税について

- ・追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

配当控除、益金不算入制度の適用はありません。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です（平成26年1月1日以降）。

- ・少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」は、平成26年1月1日以降の非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

ハッピーエイジング20

平成25年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	5,736,469,314	93.39
投資信託受益証券	アメリカ	291,732,216	4.75
現金及びその他の資産(負債控除後)		114,116,847	1.86
合計(純資産総額)		6,142,318,377	100.00

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

(注2) 時価合計(円)については、平成25年7月31日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております(以下同じ)。

ハッピーエイジング30

平成25年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	6,905,269,197	93.41
投資信託受益証券	アメリカ	354,342,203	4.79
現金及びその他の資産(負債控除後)		132,659,721	1.80
合計(純資産総額)		7,392,271,121	100.00

ハッピーエイジング40

平成25年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	8,902,417,910	93.27
投資信託受益証券	アメリカ	462,089,266	4.84
現金及びその他の資産(負債控除後)		179,772,610	1.89
合計(純資産総額)		9,544,279,786	100.00

ハッピーエイジング50

平成25年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	4,215,459,921	95.10
投資信託受益証券	アメリカ	128,860,807	2.91
現金及びその他の資産(負債控除後)		88,161,322	1.99
合計(純資産総額)		4,432,482,050	100.00

ハッピーエイジング60

平成25年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,646,941,587	97.84
現金及びその他の資産(負債控除後)		58,301,615	2.16
合計(純資産総額)		2,705,243,202	100.00

<参考>

上記表における「親投資信託受益証券」は、全て「損保ジャパン日本株マザーファンド」「損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド」「損保ジャパン日本債券マザーファンド」「損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド」「損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド」の受益証券であります。同マザーファンドの全体の投資状況は以下のとおりです。

損保ジャパン日本株マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	8,925,710,800	98.58
現金及びその他の資産（負債控除後）		128,275,643	1.42
合計（純資産総額）		9,053,986,443	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	5,299,944,000	99.02
現金及びその他の資産（負債控除後）		52,524,670	0.98
合計（純資産総額）		5,352,468,670	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	5,809,672,559	74.16
	イギリス	451,329,464	5.76
	ドイツ	329,890,209	4.21
	フランス	316,765,366	4.04
	スイス	145,360,799	1.86
	オーストラリア	139,536,169	1.78
	香港	102,034,900	1.30
	オランダ	51,741,992	0.66
	シンガポール	49,352,629	0.63
	イタリア	37,331,087	0.48
	ノルウェー	24,514,160	0.31
	ベルギー	12,150,051	0.16
	デンマーク	11,558,880	0.15
	投資証券	アメリカ	138,090,755
小計		7,619,329,020	97.26
現金及びその他の資産（負債控除後）		215,021,918	2.74
合計（純資産総額）		7,834,350,938	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）時価合計（円）については、平成25年7月31日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
公社債	日本	10,238,112,315	99.07
現金及びその他の資産（負債控除後）		95,884,175	0.93
合計(純資産総額)		10,333,996,490	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
公社債	アメリカ	1,703,485,133	38.18
	イタリア	995,742,911	22.32
	フランス	359,718,716	8.06
	イギリス	343,495,930	7.70
	ドイツ	197,990,493	4.44
	スペイン	146,862,864	3.29
	カナダ	111,411,594	2.50
	ベルギー	93,870,896	2.10
	オランダ	91,730,247	2.06
	オーストラリア	59,136,926	1.33
	メキシコ	42,069,216	0.94
	マレーシア	36,494,132	0.82
	ポーランド	32,973,078	0.74
	南アフリカ	23,754,443	0.53
小計		4,238,736,579	95.01
現金及びその他の資産（負債控除後）		222,849,240	4.99
合計(純資産総額)		4,461,585,819	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）時価合計（円）については、平成25年7月31日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a . 評価額上位30銘柄

ハッピーエイジング20

平成25年7月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	保有数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	評価損益 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン-T C W外国株式マザー ファンド	1,762,552,294	1.1680	2,058,661,080	1.1531	2,032,399,050	26,262,030	33.09
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン-D I A M日本株アク ティブ・マザー ファンド	1,429,389,413	1.1985	1,713,123,211	1.1267	1,610,493,051	102,630,160	26.22
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本 株マザーファンド	1,285,880,052	1.3217	1,699,572,173	1.2461	1,602,335,132	97,237,041	26.09
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国 債券(為替ヘッジな し)マザーファンド	293,124,540	1.2714	372,678,540	1.2569	368,428,234	4,250,306	6.00
アメ リカ	投資信託受 益証券	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	75,801	3,858.5	292,475,672	3,848.7	291,732,216	743,456	4.75
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本 債券マザーファン ド	97,309,126	1.2597	122,580,381	1.2621	122,813,847	233,466	2.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です(以下同じ)。

ハッピーエイジング30

平成25年7月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	保有数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	評価損益 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン-D I A M日本株アク ティブ・マザー ファンド	1,456,733,617	1.1985	1,745,895,241	1.1267	1,641,301,766	104,593,475	22.20
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本 株マザーファンド	1,310,531,144	1.3220	1,732,522,172	1.2461	1,633,052,858	99,469,314	22.09
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン-T C W外国株式マザー ファンド	1,350,799,978	1.1680	1,577,734,374	1.1531	1,557,607,454	20,126,920	21.07
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国 債券(為替ヘッジな し)マザーファンド	1,176,683,414	1.2711	1,495,698,805	1.2569	1,478,973,383	16,725,422	20.01
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本 債券マザーファン ド	470,908,594	1.2597	593,203,556	1.2621	594,333,736	1,130,180	8.04
アメ リカ	投資信託受 益証券	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	92,069	3,858.5	355,245,216	3,848.7	354,342,203	903,013	4.79

ハッピーエイジング40

平成25年7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	保有数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	評価損益 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本 債券マザーファン ド	2,506,440,238	1.2597	3,157,362,768	1.2621	3,163,378,224	6,015,456	33.14
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン-D I A M日本株アク ティブ・マザー ファンド	1,321,835,225	1.1971	1,582,314,661	1.1267	1,489,311,748	93,002,913	15.60
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本 株マザーファンド	1,189,297,454	1.3201	1,570,039,045	1.2461	1,481,983,557	88,055,488	15.53
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国 債券(為替ヘッジな し)マザーファンド	1,137,338,638	1.2714	1,446,012,345	1.2569	1,429,520,934	16,491,411	14.98
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン-T C W外国株式マザー ファンド	1,160,544,140	1.1680	1,355,515,555	1.1531	1,338,223,447	17,292,108	14.02
アメリ カ	投資信託受 益証券	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	120,065	3,858.5	463,266,864	3,848.7	462,089,266	1,177,598	4.84

ハッピーエイジング50

平成25年7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	保有数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	評価損益 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本 債券マザーファン ド	2,003,482,974	1.2597	2,523,787,503	1.2621	2,528,595,861	4,808,358	57.05
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国 債券(為替ヘッジな し)マザーファンド	387,172,409	1.2713	492,217,157	1.2569	486,637,000	5,580,157	10.98
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン-D I A M日本株アク ティブ・マザー ファンド	375,918,847	1.1957	449,484,263	1.1267	423,547,764	25,936,499	9.56
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本 株マザーファンド	338,427,575	1.3207	446,972,015	1.2461	421,714,601	25,257,414	9.51
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン-T C W外国株式マザー ファンド	307,835,136	1.1678	359,475,385	1.1531	354,964,695	4,510,690	8.01
アメリ カ	投資信託受 益証券	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	33,482	3,858.5	129,189,198	3,848.7	128,860,807	328,391	2.91

ハッピーエイジング60

平成25年7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	保有数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	評価損益 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本 債券マザーファン ド	1,754,437,295	1.2597	2,210,064,661	1.2621	2,214,275,310	4,210,649	81.85
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国 債券(為替ヘッジな し)マザーファンド	128,742,364	1.2714	163,683,042	1.2569	161,816,277	1,866,765	5.98
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン-T C W外国株式マザー ファンド	93,830,608	1.1680	109,594,150	1.1531	108,196,074	1,398,076	4.00
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン-D I A M日本株アク ティブ・マザー ファンド	72,352,027	1.1953	86,481,553	1.1267	81,519,028	4,962,525	3.01
日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本 株マザーファンド	65,111,065	1.3182	85,826,232	1.2461	81,134,898	4,691,334	3.00

b. 種類別投資比率

ハッピーエイジング20

平成25年7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	93.39
投資信託受益証券	4.75
合計	98.14

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する種類別の時価の比率です(以下同じ)。

ハッピーエイジング30

平成25年7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	93.41
投資信託受益証券	4.79
合計	98.20

ハッピーエイジング40

平成25年7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	93.27
投資信託受益証券	4.84
合計	98.11

ハッピーエイジング50

平成25年7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.10
投資信託受益証券	2.91
合計	98.01

ハッピーエイジング60

平成25年7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.84
合計	97.84

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

<参考> 損保ジャパン日本株マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

a. 評価額上位30銘柄

平成25年7月31日現在

順位	市場	銘柄名	種類	業種	保有数量 (株)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	東証一部	日本電信電話	国内株式	情報・通信業	71,500	5,300	378,950,000	4,935	352,852,500	3.90
2	東証一部	JFEホールディングス	国内株式	鉄鋼	152,200	2,325	353,865,000	2,217	337,427,400	3.73
3	東証一部	トヨタ自動車	国内株式	輸送用機器	52,200	6,317	329,743,795	5,970	311,634,000	3.44
4	東証一部	三菱UFJフィナンシャルG	国内株式	銀行業	496,100	646	320,480,600	601	298,156,100	3.29
5	東証一部	住友商事	国内株式	卸売業	221,500	1,312	290,608,000	1,312	290,608,000	3.21
6	東証一部	みずほフィナンシャルG	国内株式	銀行業	1,398,900	213	297,965,700	203	283,976,700	3.14
7	東証一部	本田技研	国内株式	輸送用機器	73,000	3,840	280,320,000	3,630	264,990,000	2.93
8	東証一部	日本電産	国内株式	電気機器	31,100	7,040	218,944,000	8,000	248,800,000	2.75
9	東証一部	キャノン	国内株式	電気機器	81,000	3,375	273,375,000	3,025	245,025,000	2.71
10	東証一部	三井住友フィナンシャルG	国内株式	銀行業	51,700	4,760	246,092,000	4,485	231,874,500	2.56
11	東証一部	三菱電機	国内株式	電気機器	242,000	1,048	253,616,000	953	230,626,000	2.55
12	東証一部	東日本旅客鉄道	国内株式	陸運業	27,900	8,170	227,943,000	7,890	220,131,000	2.43
13	東証一部	第一生命	国内株式	保険業	1,604	154,900	248,459,600	133,700	214,454,800	2.37
14	東証一部	MS&AD	国内株式	保険業	82,300	2,751	226,407,300	2,542	209,206,600	2.31
15	東証一部	三井物産	国内株式	卸売業	133,400	1,303	173,820,200	1,315	175,421,000	1.94
16	東証一部	三菱商事	国内株式	卸売業	95,900	1,786	171,277,400	1,789	171,565,100	1.89
17	東証一部	新日鐵住金	国内株式	鉄鋼	500,000	288	144,000,000	285	142,500,000	1.57
18	東証一部	ヤマダ電機	国内株式	小売業	35,470	4,310	152,875,700	3,970	140,815,900	1.56
19	東証一部	東京海上HD	国内株式	保険業	43,900	3,435	150,796,500	3,135	137,626,500	1.52
20	東証一部	野村ホールディングス	国内株式	証券、商品先物取引業	183,600	796	146,145,600	747	137,149,200	1.51
21	東証一部	日立	国内株式	電気機器	208,000	688	143,104,000	658	136,864,000	1.51
22	東証一部	東京エレクトロン	国内株式	電気機器	27,900	4,840	135,036,000	4,465	124,573,500	1.38
23	東証一部	JXホールディングス	国内株式	石油・石炭製品	234,600	496	116,361,600	521	122,226,600	1.35
24	東証一部	アイシン精機	国内株式	輸送用機器	25,200	3,875	97,650,000	3,890	98,028,000	1.08
25	東証一部	ケーズホールディングス	国内株式	小売業	29,100	3,390	98,649,000	3,340	97,194,000	1.07
26	東証一部	住友重機械	国内株式	機械	210,000	435	91,350,000	456	95,760,000	1.06
27	東証一部	ニフコ	国内株式	化学	34,900	2,193	76,535,700	2,669	93,148,100	1.03
28	東証一部	ツムラ	国内株式	医薬品	32,500	2,897	94,142,039	2,794	90,805,000	1.00
29	東証一部	任天堂	国内株式	その他製品	7,100	11,970	84,987,000	12,420	88,182,000	0.97
30	東証一部	横浜銀行	国内株式	銀行業	162,000	547	88,614,000	538	87,156,000	0.96

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

b．種類別投資比率

平成25年7月31日現在

資産の種類	投資比率（％）
株式	98.58
合計	98.58

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する種類別の時価の比率です。

c．業種別投資比率

平成25年7月31日現在

業種	評価金額（円）	投資比率（％）
電気機器	1,230,102,100	13.59
銀行業	1,228,495,600	13.57
輸送用機器	879,580,300	9.71
卸売業	837,386,500	9.25
保険業	663,028,400	7.32
情報・通信業	588,387,700	6.50
鉄鋼	573,278,600	6.33
小売業	497,014,500	5.49
陸運業	338,674,600	3.74
化学	325,084,100	3.59
石油・石炭製品	238,862,600	2.64
その他製品	237,584,300	2.62
医薬品	214,372,000	2.37
機械	137,550,800	1.52
証券,商品先物取引業	137,149,200	1.51
建設業	128,188,600	1.42
パルプ・紙	120,661,600	1.33
サービス業	114,502,600	1.26
非鉄金属	84,218,100	0.93
電気・ガス業	78,251,500	0.86
食料品	63,360,000	0.70
ガラス・土石製品	53,227,000	0.59
その他金融業	46,035,000	0.51
精密機器	35,748,000	0.39
繊維製品	29,403,000	0.32
ゴム製品	25,100,800	0.28
水産・農林業	20,463,300	0.23
合計	8,925,710,800	98.58

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

<参考> 損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

a . 評価額上位30銘柄

平成25年7月31日現在

順位	市場	銘柄名	種類	業種	保有数量 (株)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	東証一部	トヨタ自動車	国内株式	輸送用機器	61,700	6,456	398,346,723	5,970	368,349,000	6.88
2	東証一部	三菱UFJフィナンシャルG	国内株式	銀行業	410,800	662	271,758,454	601	246,890,800	4.61
3	東証一部	三井住友フィナンシャルG	国内株式	銀行業	51,900	4,797	248,984,560	4,485	232,771,500	4.35
4	東証一部	三井不動産	国内株式	不動産業	63,000	3,220	202,860,000	2,963	186,669,000	3.49
5	東証一部	ソフトバンク	国内株式	情報・通信業	26,300	5,914	155,534,017	6,240	164,112,000	3.07
6	東証一部	東日本旅客鉄道	国内株式	陸運業	15,800	8,405	132,804,529	7,890	124,662,000	2.33
7	東証一部	日野自動車	国内株式	輸送用機器	77,000	1,680	129,366,412	1,507	116,039,000	2.17
8	東証一部	東京海上HD	国内株式	保険業	36,600	3,565	130,479,000	3,135	114,741,000	2.14
9	東証一部	KDDI	国内株式	情報・通信業	21,100	5,212	109,976,710	5,410	114,151,000	2.13
10	東証一部	日立	国内株式	電気機器	160,000	666	106,568,059	658	105,280,000	1.97
11	東証一部	デンソー	国内株式	輸送用機器	23,200	4,920	114,149,147	4,460	103,472,000	1.93
12	東証一部	住友ゴム	国内株式	ゴム製品	63,200	1,749	110,539,556	1,633	103,205,600	1.93
13	東証一部	丸紅	国内株式	卸売業	137,000	719	98,466,072	682	93,434,000	1.75
14	東証一部	日本たばこ産業	国内株式	食料品	27,200	3,673	99,901,641	3,425	93,160,000	1.74
15	東証一部	エンブラス	国内株式	電気機器	11,600	7,910	91,756,000	7,850	91,060,000	1.70
16	東証一部	オリックス	国内株式	その他金融業	61,300	1,492	91,451,593	1,455	89,191,500	1.67
17	東証一部	マツダ	国内株式	輸送用機器	211,000	442	93,229,338	410	86,510,000	1.62
18	東証一部	三菱電機	国内株式	電気機器	89,000	1,091	97,100,579	953	84,817,000	1.58
19	東証一部	エイチ・アイ・エス	国内株式	サービス業	16,100	5,117	82,384,535	4,780	76,958,000	1.44
20	東証一部	三和ホールディングス	国内株式	金属製品	142,000	598	84,979,819	540	76,680,000	1.43
21	東証一部	シップヘルスケアHD	国内株式	卸売業	19,400	3,621	70,243,662	3,620	70,228,000	1.31
22	東証一部	クボタ	国内株式	機械	49,000	1,649	80,801,000	1,430	70,070,000	1.31
23	東証一部	塩野義製薬	国内株式	医薬品	33,800	2,225	75,202,141	1,991	67,295,800	1.26
24	ジャスダック	楽天	国内株式	サービス業	49,000	1,261	61,781,655	1,323	64,827,000	1.21
25	ジャスダック	一建設	国内株式	不動産業	12,600	6,003	75,642,813	5,060	63,756,000	1.19
26	東証一部	富士重工業	国内株式	輸送用機器	26,000	2,741	71,266,000	2,422	62,972,000	1.18
27	東証一部	ウエルシアHD	国内株式	小売業	11,900	5,389	64,132,834	5,260	62,594,000	1.17
28	東証一部	野村ホールディングス	国内株式	証券、商品先物取引業	83,600	824	68,917,454	747	62,449,200	1.17
29	東証一部	ヤフー	国内株式	情報・通信業	1,163	52,997	61,635,177	52,200	60,708,600	1.13
30	東証一部	信越化学	国内株式	化学	9,800	6,990	68,502,000	6,120	59,976,000	1.12

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

b．種類別投資比率

平成25年7月31日現在

資産の種類	投資比率（％）
株式	99.02
合計	99.02

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する種類別の時価の比率です。

c．業種別投資比率

平成25年7月31日現在

業種	評価金額（円）	投資比率（％）
輸送用機器	825,885,000	15.43
電気機器	571,243,300	10.67
銀行業	515,563,000	9.63
情報・通信業	429,474,300	8.02
化学	296,011,000	5.53
不動産業	286,505,000	5.35
小売業	269,308,200	5.03
卸売業	257,663,500	4.81
機械	203,261,000	3.80
医薬品	199,150,800	3.72
サービス業	183,061,600	3.42
食料品	168,900,700	3.16
その他金融業	142,360,300	2.66
陸運業	124,662,000	2.33
精密機器	124,622,100	2.33
保険業	114,741,000	2.14
非鉄金属	110,479,500	2.06
金属製品	106,723,200	1.99
ゴム製品	103,205,600	1.93
証券,商品先物取引業	97,529,000	1.82
鉄鋼	72,986,000	1.36
建設業	43,416,900	0.81
空運業	31,720,000	0.59
鉱業	21,471,000	0.40
合計	5,299,944,000	99.02

（注）投資比率はファンドの純資産総額に対する各業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

<参考> 損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

a . 評価額上位30銘柄

平成25年 7月31日現在

順位	種類	通貨	国/地域	銘柄名	業種	保有数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	QUALCOMM INC	テクノロジー・ハードウェア	22,875	6,010	137,486,582	6,327	144,733,346	1.85
2	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	AMAZON.COM INC	小売り	4,710	30,068	141,622,096	29,660	139,700,356	1.78
3	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	STARBUCKS CORP	消費者サービス	19,505	6,832	133,263,091	7,055	137,605,715	1.76
4	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	1,565	90,694	141,935,476	87,381	136,751,944	1.75
5	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	29,525	4,117	121,566,188	4,315	127,386,770	1.63
6	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	ACE LTD	保険	14,163	9,143	129,492,558	8,958	126,867,146	1.62
7	投資証券	アメリカ・ドル	アメリカ	AMERICAN TOWER CORP	専門REIT	16,925	7,470	126,425,905	7,127	120,632,491	1.54
8	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	6,380	18,660	119,049,014	18,776	119,793,657	1.53
9	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	LINKEDIN CORP - A	ソフトウェア・サービス	5,753	19,498	112,173,743	19,868	114,300,981	1.46
10	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	CERNER CORP	ヘルスケア機器・サービス	22,906	4,859	111,297,579	4,832	110,690,991	1.41
11	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	OCEANEERING INTL INC	エネルギー	14,059	7,776	109,319,725	7,793	109,567,928	1.40
12	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	PRECISION CASTPARTS CORP	資本財	4,985	22,991	114,609,800	21,743	108,390,626	1.38
13	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	SCHLUMBERGER LTD	エネルギー	11,905	7,554	89,931,818	7,987	95,081,121	1.21
14	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	FASTENAL CO	資本財	19,774	4,608	91,114,606	4,741	93,752,236	1.20
15	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	EQUINIX INC	ソフトウェア・サービス	4,985	19,679	98,098,674	17,674	88,104,970	1.12
16	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	PRICELINE.COM INC	小売り	1,005	89,416	89,862,691	86,983	87,418,145	1.12
17	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	PRAXAIR INC	素材	7,245	11,423	82,762,371	11,836	85,753,953	1.09
18	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	ARM HOLDINGS PLC-SPONS ADR	半導体・半導体製造装置	21,773	4,061	88,409,528	3,899	84,885,960	1.08
19	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	商業・専門サービス	14,125	6,167	87,112,694	5,969	84,314,227	1.08
20	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	ALLERGAN INC	医薬品・バイオテクノロジー	8,965	9,060	81,219,759	8,926	80,023,928	1.02
21	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	医薬品・バイオテクノロジー	12,580	6,277	78,966,745	6,290	79,126,570	1.01
22	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	SPLUNK INC	ソフトウェア・サービス	15,929	4,945	78,760,949	4,897	78,006,454	1.00
23	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	TIFFANY & CO	小売り	9,650	7,821	75,470,630	7,812	75,386,495	0.96
24	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	CELGENE CORP	医薬品・バイオテクノロジー	5,165	13,235	68,358,337	14,258	73,642,000	0.94
25	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	ATHENAHEALTH INC	ヘルスケア機器・サービス	6,696	11,195	74,960,540	10,924	73,148,111	0.93
26	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	6,310	11,366	71,722,559	11,468	72,366,200	0.92
27	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー	24,145	2,823	68,162,707	2,910	70,262,761	0.90
28	外国株式	スイス・フラン	スイス	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー	2,860	25,559	73,099,787	24,430	69,870,358	0.89
29	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	VMWARE INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	8,460	6,965	58,921,030	8,097	68,496,424	0.87
30	外国株式	アメリカ・ドル	アメリカ	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	28,070	2,325	65,258,413	2,401	67,396,025	0.86

(注1) 外貨建証券の評価金額は、平成25年7月31日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

(注2) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注3) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

b．種類別投資比率

平成25年7月31日現在

資産の種類	投資比率（％）
株式	95.49
投資証券	1.76
合計	97.26

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する種類別の時価の比率です。

c．業種別投資比率

平成25年7月31日現在

業種	評価金額（円）	投資比率（％）
ソフトウェア・サービス	871,749,775	11.13
資本財	766,667,329	9.79
エネルギー	689,676,604	8.80
医薬品・バイオテクノロジー	631,027,310	8.05
小売り	529,815,149	6.76
各種金融	479,512,419	6.12
素材	448,084,947	5.72
テクノロジー・ハードウェア	384,127,547	4.90
ヘルスケア機器・サービス	359,689,137	4.59
保険	325,206,801	4.15
銀行	309,229,046	3.95
食品・飲料・たばこ	236,379,257	3.02
半導体・半導体製造装置	208,682,789	2.66
消費者サービス	192,739,357	2.46
食品・生活必需品小売り	184,023,494	2.35
自動車・自動車部品	165,502,168	2.11
耐久消費財・アパレル	139,281,231	1.78
電気通信サービス	127,105,197	1.62
公益事業	108,377,586	1.38
メディア	105,851,070	1.35
商業・専門サービス	103,353,426	1.32
不動産	51,841,577	0.66
家庭用品・パーソナル用品	46,313,906	0.59
運輸	17,001,143	0.22
合計	7,481,238,265	95.49

（注）投資比率はファンドの純資産総額に対する各業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

<参考> 損保ジャパン日本債券マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

a. 評価額上位30銘柄

平成25年7月31日現在

順位	発行地	銘柄名	種類	額面	通貨	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	利率 (%)	償還日	投資 比率 (%)
1	日本	314 10年国債	国債証券	860,000,000	円	103.21	887,647,280	103.57	890,744,140	1.10	2021/3/20	8.62
2	日本	327 2年国債	国債証券	590,000,000	円	99.96	589,764,000	99.97	589,838,930	0.10	2015/4/15	5.71
3	日本	144 20年国債	国債証券	530,000,000	円	96.48	511,354,600	96.77	512,884,710	1.50	2033/3/20	4.96
4	日本	299 10年国債	国債証券	380,000,000	円	105.35	400,316,320	105.43	400,615,000	1.30	2019/3/20	3.88
5	日本	145 20年国債	国債証券	390,000,000	円	99.72	388,914,120	99.85	389,420,850	1.70	2033/6/20	3.77
6	日本	112 5年国債	国債証券	370,000,000	円	100.53	371,961,800	100.53	371,961,370	0.40	2018/6/20	3.60
7	日本	287 10年国債	国債証券	280,000,000	円	106.57	298,407,800	106.52	298,247,320	1.90	2017/6/20	2.89
8	日本	318 10年国債	国債証券	290,000,000	円	102.24	296,502,380	102.63	297,616,560	1.00	2021/9/20	2.88
9	日本	311 10年国債	国債証券	260,000,000	円	101.52	263,943,160	101.86	264,829,240	0.80	2020/9/20	2.56
10	日本	20 ラボバンク・ ネダー	社債券	200,000,000	円	99.88	199,766,400	99.99	199,983,200	0.49	2016/5/24	1.94
11	日本	66 住宅機構 R M B S	特殊債券	194,494,000	円	99.22	192,976,946	99.34	193,210,339	1.12	2047/11/10	1.87
12	日本	121 20年国債	国債証券	170,000,000	円	105.46	179,288,970	105.74	179,761,400	1.90	2030/9/20	1.74
13	日本	326 2年国債	国債証券	170,000,000	円	99.97	169,950,400	99.97	169,953,930	0.10	2015/3/15	1.64
14	日本	100 20年国債	国債証券	140,000,000	円	112.62	157,667,160	112.59	157,625,020	2.20	2028/3/20	1.53
15	日本	137 20年国債	国債証券	150,000,000	円	100.29	150,430,800	100.72	151,079,850	1.70	2032/6/20	1.46
16	日本	316 10年国債	国債証券	110,000,000	円	103.31	113,643,320	103.53	113,884,870	1.10	2021/6/20	1.10
17	日本	87 政保道路機構	特殊債券	100,000,000	円	106.42	106,416,800	106.61	106,607,400	1.50	2019/8/30	1.03
18	日本	46 伊藤忠商事	社債券	100,000,000	円	106.10	106,104,400	106.10	106,101,000	2.02	2017/4/26	1.03
19	日本	21-15 愛知県公債	地方債証券	100,000,000	円	105.82	105,823,000	106.01	106,009,600	1.42	2020/1/28	1.03
20	日本	60東日本旅客鉄道	社債券	100,000,000	円	105.71	105,709,600	105.88	105,879,900	1.45	2019/7/24	1.02
21	日本	24 公営企業	地方債証券	100,000,000	円	105.75	105,754,800	105.69	105,686,400	1.94	2016/12/20	1.02
22	日本	56 道路機構	特殊債券	100,000,000	円	105.43	105,432,400	105.47	105,470,500	1.43	2019/12/20	1.02
23	日本	64 三菱商事	社債券	100,000,000	円	105.39	105,386,100	105.38	105,382,700	2.00	2016/9/20	1.02
24	日本	5 住友信託 劣 後	社債券	100,000,000	円	105.31	105,313,800	105.13	105,127,500	2.25	2016/4/27	1.02
25	日本	45 神戸製鋼所	社債券	100,000,000	円	104.95	104,946,000	104.93	104,930,300	2.07	2017/2/22	1.02
26	日本	17-4 静岡県公債	地方債証券	100,000,000	円	103.23	103,225,100	103.19	103,185,600	1.60	2015/10/27	1.00
27	日本	90 20年国債	国債証券	90,000,000	円	113.58	102,220,290	113.54	102,186,720	2.20	2026/9/20	0.99
28	日本	7 三井住友 B K 劣後	社債券	100,000,000	円	101.02	101,020,000	100.95	100,945,100	2.01	2014/2/5	0.98
29	日本	316 北海道電力	社債券	100,000,000	円	100.37	100,370,700	100.71	100,705,000	1.16	2020/6/25	0.97
30	日本	43 日本電気	社債券	100,000,000	円	100.55	100,546,900	100.68	100,677,500	0.65	2015/12/2	0.97

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

b. 種類別投資比率

平成25年7月31日現在

資産の種類	投資比率（％）
国債証券	59.24
社債券	23.52
特殊債券	12.86
地方債証券	3.44
合計	99.07

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する種類別の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

<参考> 損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

a. 評価額上位30銘柄

平成25年7月31日現在

順位	発行地	銘柄名	種類	額面	通貨	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	利率 (%)	償還日	投資 比率 (%)
1	イタリア	BTPS 3.0	国債証券	2,450,000	ユーロ	13,267	325,042,743	13,287	325,536,608	3.00	2015/11/1	7.30
2	イタリア	BTPS 3.75	国債証券	1,728,000	ユーロ	13,437	232,198,553	13,450	232,423,279	3.75	2015/8/1	5.21
3	アメリカ	US TREASURY N/B 0.25%	国債証券	1,650,000	アメリカ・ ドル	9,815	161,945,282	9,816	161,958,229	0.25	2014/9/30	3.63
4	アメリカ	US TREASURY N/B 0.375%	国債証券	1,430,000	アメリカ・ ドル	9,815	140,352,578	9,824	140,484,417	0.38	2015/6/30	3.15
5	イタリア	BTPS 5.5%	国債証券	830,000	ユーロ	14,063	116,722,541	14,141	117,370,190	5.50	2022/9/1	2.63
6	アメリカ	US TREASURY N/B 1.875	国債証券	1,082,000	アメリカ・ ドル	10,101	109,295,213	10,104	109,322,155	1.88	2015/6/30	2.45
7	アメリカ	US TREASURY N/B 2.875%	国債証券	1,230,000	アメリカ・ ドル	8,494	104,474,061	8,397	103,286,979	2.88	2043/5/15	2.32
8	アメリカ	US TREASURY N/B 2.125	国債証券	960,000	アメリカ・ ドル	10,199	97,908,007	10,207	97,988,982	2.13	2015/12/31	2.20
9	フランス	FRANCE O.A.T. 2.25%	国債証券	690,000	ユーロ	13,160	90,806,827	13,080	90,250,473	2.25	2022/10/25	2.02
10	アメリカ	US TREASURY N/B 1.25	国債証券	825,000	アメリカ・ ドル	9,986	82,382,198	9,997	82,476,870	1.25	2015/9/30	1.85
11	イタリア	BTPS 3.0%	国債証券	615,000	ユーロ	13,261	81,552,372	13,276	81,648,349	3.00	2015/6/15	1.83
12	アメリカ	US TREASURY N/B 1.75	国債証券	795,000	アメリカ・ ドル	10,083	80,159,980	10,086	80,184,152	1.75	2015/7/31	1.80
13	イタリア	BTPS 4.25	国債証券	590,000	ユーロ	13,435	79,269,246	13,511	79,714,278	4.25	2019/9/1	1.79
14	アメリカ	US TREASURY N/B 0.875%	国債証券	800,000	アメリカ・ ドル	9,825	78,598,173	9,845	78,758,240	0.88	2016/11/30	1.77
15	アメリカ	US TREASURY N/B 0.875	国債証券	800,000	アメリカ・ ドル	9,801	78,408,291	9,821	78,567,572	0.88	2017/1/31	1.76
16	アメリカ	US TREASURY N/B 0.75%	国債証券	795,000	アメリカ・ ドル	9,691	77,047,274	9,711	77,199,322	0.75	2017/6/30	1.73
17	アメリカ	US TREASURY N/B 1.0	国債証券	770,000	アメリカ・ ドル	9,892	76,170,331	9,910	76,306,269	1.00	2016/8/31	1.71
18	アメリカ	US TREASURY N/B 0.125%	国債証券	665,000	アメリカ・ ドル	9,805	65,202,329	9,806	65,212,764	0.13	2014/7/31	1.46
19	ドイツ	DEUTSCHLAND REP 3.25%	国債証券	355,000	ユーロ	15,058	53,457,638	14,944	53,051,362	3.25	2021/7/4	1.19
20	イギリス	TREASURY 4.0	国債証券	305,000	イギリス・ ポンド	17,075	52,077,852	17,117	52,207,778	4.00	2022/3/7	1.17
21	イギリス	TREASURY 2.75	国債証券	325,000	イギリス・ ポンド	15,485	50,326,549	15,482	50,316,833	2.75	2015/1/22	1.13
22	アメリカ	US TREASURY N/B 1.625%	国債証券	545,000	アメリカ・ ドル	9,107	49,632,202	9,072	49,440,304	1.63	2022/11/15	1.11
23	アメリカ	US TREASURY N/B 1.375	国債証券	500,000	アメリカ・ ドル	9,760	48,798,233	9,771	48,856,100	1.38	2018/9/30	1.10
24	スペイン	SPANISH GOVT 3.15	国債証券	360,000	ユーロ	13,177	47,435,998	13,211	47,560,065	3.15	2016/1/31	1.07
25	アメリカ	US TREASURY N/B 1.375%	国債証券	475,000	アメリカ・ ドル	9,732	46,227,409	9,745	46,289,371	1.38	2018/11/30	1.04
26	フランス	FRANCE O.A.T. 4.25	国債証券	300,000	ユーロ	15,345	46,035,749	15,239	45,717,777	4.25	2023/10/25	1.02
27	フランス	FRANCE O.A.T. 2.5%	国債証券	310,000	ユーロ	13,802	42,784,824	13,755	42,641,704	2.50	2020/10/25	0.96
28	イタリア	BTPS 4.5	国債証券	310,000	ユーロ	13,005	40,315,500	12,979	40,234,869	4.50	2026/3/1	0.90
29	アメリカ	US TREASURY N/B 2.75	国債証券	360,000	アメリカ・ ドル	10,429	37,545,612	10,428	37,540,316	2.75	2019/2/15	0.84
30	スペイン	SPANISH GOVT 5.5%	国債証券	250,000	ユーロ	14,001	35,001,332	14,084	35,209,412	5.50	2021/4/30	0.79

(注1) 外貨建証券の評価金額は、平成25年7月31日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

(注2) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注3) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

b. 種類別投資比率

平成25年7月31日現在

資産の種類	投資比率（％）
国債証券	94.55
特殊債券	0.45
合計	95.01

（注）投資比率はファンドの純資産総額に対する種類別の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

平成25年7月31日及び同日前1年以内における各月末の純資産の推移は以下のとおりです。

ハッピーエイジング20

	1万口当たり純資産額		ファンドの純資産総額	
	分配落ち (円)	分配付き (円)	分配落ち (円)	分配付き (円)
第1期末 (平成13年7月16日)	8,836	8,836	11,393,654	11,393,654
第2期末 (平成14年7月15日)	7,230	7,230	28,068,136	28,068,136
第3期末 (平成15年7月15日)	7,435	7,435	111,001,725	111,001,725
第4期末 (平成16年7月15日)	8,219	8,219	335,406,027	335,406,027
第5期末 (平成17年7月15日)	8,968	8,968	831,748,653	831,748,653
第6期末 (平成18年7月18日)	10,307	10,307	2,487,200,165	2,487,200,165
第7期末 (平成19年7月17日)	12,954	12,954	4,128,875,931	4,128,875,931
第8期末 (平成20年7月15日)	9,762	9,762	3,697,836,473	3,697,836,473
第9期末 (平成21年7月15日)	6,639	6,639	3,183,815,124	3,183,815,124
第10期末 (平成22年7月15日)	6,954	6,954	3,719,447,117	3,719,447,117
第11期末 (平成23年7月15日)	7,237	7,237	4,207,770,641	4,207,770,641
第12期末 (平成24年7月17日)	6,395	6,395	4,034,512,435	4,034,512,435
第13期末 (平成25年7月16日)	9,828	9,828	6,375,079,876	6,375,079,876
平成24年7月末	6,402	-	4,058,205,874	-
8月末	6,425	-	4,103,498,199	-
9月末	6,540	-	4,185,849,357	-
10月末	6,597	-	4,246,686,016	-
11月末	6,878	-	4,447,069,922	-
12月末	7,442	-	4,774,110,708	-
平成25年1月末	8,156	-	5,338,316,366	-
2月末	8,352	-	5,519,558,180	-
3月末	8,697	-	5,784,765,661	-
4月末	9,421	-	6,244,812,996	-
5月末	9,492	-	6,274,906,675	-
6月末	9,250	-	6,006,116,455	-
7月31日	9,455	-	6,142,318,377	-

ハッピーエイジング30

	1万口当たり純資産額		ファンドの純資産総額	
	分配落ち (円)	分配付き (円)	分配落ち (円)	分配付き (円)
第1期末 (平成13年7月16日)	9,136	9,136	103,920,109	103,920,109
第2期末 (平成14年7月15日)	7,872	7,872	112,249,559	112,249,559
第3期末 (平成15年7月15日)	8,087	8,087	101,740,494	101,740,494
第4期末 (平成16年7月15日)	8,706	8,706	365,663,747	365,663,747
第5期末 (平成17年7月15日)	9,400	9,400	872,905,727	872,905,727
第6期末 (平成18年7月18日)	10,513	10,513	2,543,516,633	2,543,516,633
第7期末 (平成19年7月17日)	12,794	12,794	4,607,956,609	4,607,956,609

第8期末	(平成20年7月15日)	10,294	10,294	4,587,555,192	4,587,555,192
第9期末	(平成21年7月15日)	7,546	7,546	4,078,471,431	4,078,471,431
第10期末	(平成22年7月15日)	7,782	7,782	4,610,678,881	4,610,678,881
第11期末	(平成23年7月15日)	7,985	7,985	5,192,320,517	5,192,320,517
第12期末	(平成24年7月17日)	7,258	7,258	5,099,609,632	5,099,609,632
第13期末	(平成25年7月16日)	10,552	10,552	7,661,401,181	7,661,401,181
	平成24年7月末	7,250	-	5,133,353,093	-
	8月末	7,275	-	5,175,214,882	-
	9月末	7,382	-	5,273,781,599	-
	10月末	7,465	-	5,360,044,183	-
	11月末	7,760	-	5,596,074,776	-
	12月末	8,339	-	6,010,407,438	-
	平成25年1月末	9,015	-	6,587,008,530	-
	2月末	9,193	-	6,742,311,526	-
	3月末	9,511	-	6,999,120,196	-
	4月末	10,247	-	7,494,453,791	-
	5月末	10,287	-	7,510,287,960	-
	6月末	10,035	-	7,279,354,787	-
	7月31日	10,201	-	7,392,271,121	-

ハッピーエイジング40

	1万口当たり純資産額		ファンドの純資産総額		
	分配落ち (円)	分配付き (円)	分配落ち (円)	分配付き (円)	
第1期末	(平成13年7月16日)	9,473	9,473	10,985,133	10,985,133
第2期末	(平成14年7月15日)	8,581	8,581	59,395,685	59,395,685
第3期末	(平成15年7月15日)	8,843	8,843	167,240,249	167,240,249
第4期末	(平成16年7月15日)	9,240	9,240	485,588,096	485,588,096
第5期末	(平成17年7月15日)	9,870	9,870	1,283,641,466	1,283,641,466
第6期末	(平成18年7月18日)	10,637	10,637	3,872,160,919	3,872,160,919
第7期末	(平成19年7月17日)	12,301	12,301	6,161,451,470	6,161,451,470
第8期末	(平成20年7月15日)	10,625	10,625	6,505,406,524	6,505,406,524
第9期末	(平成21年7月15日)	8,617	8,617	5,927,975,456	5,927,975,456
第10期末	(平成22年7月15日)	8,909	8,909	6,550,967,753	6,550,967,753
第11期末	(平成23年7月15日)	9,092	9,092	7,355,736,675	7,355,736,675
第12期末	(平成24年7月17日)	8,565	8,565	7,397,925,868	7,397,925,868
第13期末	(平成25年7月16日)	11,196	11,196	9,756,993,303	9,756,993,303
	平成24年7月末	8,555	-	7,441,253,968	-
	8月末	8,570	-	7,505,305,343	-
	9月末	8,669	-	7,592,841,279	-
	10月末	8,739	-	7,669,012,520	-
	11月末	8,992	-	7,889,718,959	-
	12月末	9,469	-	8,266,631,917	-
	平成25年1月末	10,019	-	8,802,675,043	-
	2月末	10,175	-	8,972,964,056	-

3月末	10,445	-	9,213,899,605	-
4月末	11,001	-	9,651,082,129	-
5月末	10,998	-	9,631,286,506	-
6月末	10,798	-	9,408,189,542	-
7月31日	10,937	-	9,544,279,786	-

ハッピーエイジング50

	1万口当たり純資産額		ファンドの純資産総額	
	分配落ち (円)	分配付き (円)	分配落ち (円)	分配付き (円)
第1期末 (平成13年7月16日)	9,788	9,788	3,267,562	3,267,562
第2期末 (平成14年7月15日)	9,294	9,294	25,737,773	25,737,773
第3期末 (平成15年7月15日)	9,540	9,540	83,030,474	83,030,474
第4期末 (平成16年7月15日)	9,726	9,726	246,787,012	246,787,012
第5期末 (平成17年7月15日)	10,258	10,258	710,074,576	710,074,576
第6期末 (平成18年7月18日)	10,637	10,637	1,956,798,569	1,956,798,569
第7期末 (平成19年7月17日)	11,662	11,662	2,866,331,796	2,866,331,796
第8期末 (平成20年7月15日)	10,787	10,787	3,118,721,807	3,118,721,807
第9期末 (平成21年7月15日)	9,621	9,621	3,057,510,606	3,057,510,606
第10期末 (平成22年7月15日)	9,927	9,927	3,309,494,331	3,309,494,331
第11期末 (平成23年7月15日)	10,057	10,057	3,702,379,934	3,702,379,934
第12期末 (平成24年7月17日)	9,795	9,795	3,809,563,912	3,809,563,912
第13期末 (平成25年7月16日)	11,555	11,555	4,480,882,597	4,480,882,597
平成24年7月末	9,780	-	3,831,257,485	-
8月末	9,787	-	3,801,173,429	-
9月末	9,861	-	3,843,846,289	-
10月末	9,911	-	3,860,131,226	-
11月末	10,097	-	3,936,040,968	-
12月末	10,415	-	4,025,381,104	-
平成25年1月末	10,796	-	4,232,273,471	-
2月末	10,924	-	4,251,491,896	-
3月末	11,133	-	4,346,929,979	-
4月末	11,482	-	4,460,617,159	-
5月末	11,433	-	4,460,480,423	-
6月末	11,300	-	4,376,665,450	-
7月31日	11,397	-	4,432,482,050	-

ハッピーエイジング60

	1万口当たり純資産額		ファンドの純資産総額	
	分配落ち (円)	分配付き (円)	分配落ち (円)	分配付き (円)
第1期末 (平成13年7月16日)	10,105	10,105	5,817,431	5,817,431
第2期末 (平成14年7月15日)	10,029	10,029	23,524,336	23,524,336
第3期末 (平成15年7月15日)	10,208	10,208	91,146,722	91,146,722
第4期末 (平成16年7月15日)	10,108	10,108	222,463,829	222,463,829
第5期末 (平成17年7月15日)	10,504	10,504	501,246,791	501,246,791
第6期末 (平成18年7月18日)	10,465	10,465	1,033,316,911	1,033,316,911
第7期末 (平成19年7月17日)	10,836	10,836	1,323,548,224	1,323,548,224
第8期末 (平成20年7月15日)	10,701	10,701	1,650,255,654	1,650,255,654
第9期末 (平成21年7月15日)	10,407	10,407	1,794,974,977	1,794,974,977
第10期末 (平成22年7月15日)	10,676	10,676	1,977,963,799	1,977,963,799
第11期末 (平成23年7月15日)	10,737	10,737	2,184,577,562	2,184,577,562
第12期末 (平成24年7月17日)	10,812	10,812	2,434,101,752	2,434,101,752
第13期末 (平成25年7月16日)	11,485	11,485	2,695,707,446	2,695,707,446
平成24年7月末	10,795	-	2,448,764,843	-
8月末	10,793	-	2,463,309,215	-
9月末	10,835	-	2,486,381,922	-
10月末	10,850	-	2,506,189,298	-
11月末	10,942	-	2,531,370,669	-
12月末	11,041	-	2,556,305,013	-
平成25年1月末	11,207	-	2,597,185,180	-
2月末	11,300	-	2,625,730,156	-
3月末	11,435	-	2,675,227,144	-
4月末	11,536	-	2,698,171,772	-
5月末	11,444	-	2,669,775,188	-
6月末	11,389	-	2,676,406,948	-
7月31日	11,444	-	2,705,243,202	-

【分配の推移】

ハッピーエイジング20

期間		1万口当たりの分配金（円）
第1期	自 平成12年7月31日 至 平成13年7月16日	0
第2期	自 平成13年7月17日 至 平成14年7月15日	0
第3期	自 平成14年7月16日 至 平成15年7月15日	0
第4期	自 平成15年7月16日 至 平成16年7月15日	0
第5期	自 平成16年7月16日 至 平成17年7月15日	0
第6期	自 平成17年7月16日 至 平成18年7月18日	0
第7期	自 平成18年7月19日 至 平成19年7月17日	0
第8期	自 平成19年7月18日 至 平成20年7月15日	0
第9期	自 平成20年7月16日 至 平成21年7月15日	0
第10期	自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	0
第11期	自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日	0
第12期	自 平成23年7月16日 至 平成24年7月17日	0
第13期	自 平成24年7月18日 至 平成25年7月16日	0

ハッピーエイジング30

期間		1万口当たりの分配金（円）
第1期	自 平成12年7月31日 至 平成13年7月16日	0
第2期	自 平成13年7月17日 至 平成14年7月15日	0
第3期	自 平成14年7月16日 至 平成15年7月15日	0
第4期	自 平成15年7月16日 至 平成16年7月15日	0
第5期	自 平成16年7月16日 至 平成17年7月15日	0
第6期	自 平成17年7月16日 至 平成18年7月18日	0
第7期	自 平成18年7月19日 至 平成19年7月17日	0
第8期	自 平成19年7月18日 至 平成20年7月15日	0
第9期	自 平成20年7月16日 至 平成21年7月15日	0

第10期	自 至	平成21年 7月16日 平成22年 7月15日	0
第11期	自 至	平成22年 7月16日 平成23年 7月15日	0
第12期	自 至	平成23年 7月16日 平成24年 7月17日	0
第13期	自 至	平成24年 7月18日 平成25年 7月16日	0

ハッピーエイジング 4 0

	期間		1万口当たりの分配金（円）
第1期	自 至	平成12年 7月31日 平成13年 7月16日	0
第2期	自 至	平成13年 7月17日 平成14年 7月15日	0
第3期	自 至	平成14年 7月16日 平成15年 7月15日	0
第4期	自 至	平成15年 7月16日 平成16年 7月15日	0
第5期	自 至	平成16年 7月16日 平成17年 7月15日	0
第6期	自 至	平成17年 7月16日 平成18年 7月18日	0
第7期	自 至	平成18年 7月19日 平成19年 7月17日	0
第8期	自 至	平成19年 7月18日 平成20年 7月15日	0
第9期	自 至	平成20年 7月16日 平成21年 7月15日	0
第10期	自 至	平成21年 7月16日 平成22年 7月15日	0
第11期	自 至	平成22年 7月16日 平成23年 7月15日	0
第12期	自 至	平成23年 7月16日 平成24年 7月17日	0
第13期	自 至	平成24年 7月18日 平成25年 7月16日	0

ハッピーエイジング 5 0

	期間		1万口当たりの分配金（円）
第1期	自 至	平成12年 7月31日 平成13年 7月16日	0
第2期	自 至	平成13年 7月17日 平成14年 7月15日	0
第3期	自 至	平成14年 7月16日 平成15年 7月15日	0
第4期	自 至	平成15年 7月16日 平成16年 7月15日	0
第5期	自 至	平成16年 7月16日 平成17年 7月15日	0

第6期	自 至	平成17年7月16日 平成18年7月18日	0
第7期	自 至	平成18年7月19日 平成19年7月17日	0
第8期	自 至	平成19年7月18日 平成20年7月15日	0
第9期	自 至	平成20年7月16日 平成21年7月15日	0
第10期	自 至	平成21年7月16日 平成22年7月15日	0
第11期	自 至	平成22年7月16日 平成23年7月15日	0
第12期	自 至	平成23年7月16日 平成24年7月17日	0
第13期	自 至	平成24年7月18日 平成25年7月16日	0

ハッピーエイジング60

	期間		1万口当たりの分配金（円）
第1期	自 至	平成12年7月31日 平成13年7月16日	0
第2期	自 至	平成13年7月17日 平成14年7月15日	0
第3期	自 至	平成14年7月16日 平成15年7月15日	0
第4期	自 至	平成15年7月16日 平成16年7月15日	0
第5期	自 至	平成16年7月16日 平成17年7月15日	0
第6期	自 至	平成17年7月16日 平成18年7月18日	0
第7期	自 至	平成18年7月19日 平成19年7月17日	0
第8期	自 至	平成19年7月18日 平成20年7月15日	0
第9期	自 至	平成20年7月16日 平成21年7月15日	0
第10期	自 至	平成21年7月16日 平成22年7月15日	0
第11期	自 至	平成22年7月16日 平成23年7月15日	0
第12期	自 至	平成23年7月16日 平成24年7月17日	0
第13期	自 至	平成24年7月18日 平成25年7月16日	0

【収益率の推移】

ハッピーエイジング20

	収益率（％）
第1期	11.64
第2期	18.18
第3期	2.84
第4期	10.54
第5期	9.11
第6期	14.93
第7期	25.68
第8期	24.64
第9期	31.99
第10期	4.74
第11期	4.07
第12期	11.63
第13期	53.68

ハッピーエイジング30

	収益率（％）
第1期	8.64
第2期	13.84
第3期	2.73
第4期	7.65
第5期	7.97
第6期	11.84
第7期	21.70
第8期	19.54
第9期	26.70
第10期	3.13
第11期	2.61
第12期	9.10
第13期	45.38

ハッピーエイジング40

	収益率（％）
第1期	5.27
第2期	9.42
第3期	3.05
第4期	4.49
第5期	6.82
第6期	7.77
第7期	15.64
第8期	13.62
第9期	18.90
第10期	3.39

第11期	2.05
第12期	5.80
第13期	30.72

ハッピーエイジング50

	収益率（％）
第1期	2.12
第2期	5.05
第3期	2.65
第4期	1.95
第5期	5.47
第6期	3.69
第7期	9.64
第8期	7.50
第9期	10.81
第10期	3.18
第11期	1.31
第12期	2.61
第13期	17.97

ハッピーエイジング60

	収益率（％）
第1期	1.05
第2期	0.75
第3期	1.78
第4期	0.98
第5期	3.92
第6期	0.37
第7期	3.55
第8期	1.25
第9期	2.75
第10期	2.58
第11期	0.57
第12期	0.70
第13期	6.22

（注）「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ちの額。以下「前期末基準価額」）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数です。

（４）【設定及び解約の実績】

当ファンドの設定日（平成12年7月31日）から第13期末（平成25年7月16日）までの設定及び解約の実績は次のとおりです。

ハッピーエイジング20

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	13,754,505	859,717
第2期	30,232,816	4,307,205
第3期	120,076,091	9,598,682
第4期	290,503,900	31,705,904
第5期	580,661,199	61,329,680
第6期	1,736,164,573	250,575,641
第7期	1,080,299,931	306,068,974
第8期	1,018,970,950	418,381,330
第9期	1,479,340,785	471,208,841
第10期	1,281,906,649	729,114,257
第11期	1,165,350,197	699,705,959
第12期	1,229,841,291	735,754,993
第13期	1,412,715,175	1,234,496,719

ハッピーエイジング30

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	114,285,101	535,526
第2期	30,628,448	1,779,684
第3期	98,075,763	114,872,024
第4期	307,760,791	13,529,389
第5期	550,852,464	42,230,848
第6期	1,744,825,572	253,983,053
第7期	1,422,618,991	240,489,638
第8期	1,227,027,693	372,033,781
第9期	1,396,839,049	448,390,635
第10期	1,119,556,593	599,737,003
第11期	1,120,303,076	542,221,678
第12期	1,095,836,730	572,539,792
第13期	1,142,944,756	908,933,490

ハッピーエイジング40

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	12,098,235	501,811
第2期	59,074,881	1,456,440
第3期	136,061,172	16,154,229
第4期	355,457,661	19,077,379
第5期	846,725,729	71,732,594
第6期	2,564,867,867	225,098,025

第7期	1,716,655,629	348,192,196
第8期	1,496,200,940	382,063,136
第9期	1,464,605,050	708,112,174
第10期	1,300,116,226	826,451,419
第11期	1,345,880,036	608,198,860
第12期	1,339,462,020	792,859,126
第13期	1,210,013,963	1,132,548,340

ハッピーエイジング50

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	3,368,235	29,970
第2期	24,724,806	368,942
第3期	65,691,538	6,351,580
第4期	177,165,982	10,469,335
第5期	490,967,000	52,457,835
第6期	1,270,937,045	123,495,310
第7期	784,743,529	166,603,954
第8期	668,475,571	235,028,492
第9期	632,755,183	345,929,308
第10期	600,002,968	444,226,284
第11期	731,775,658	384,093,994
第12期	686,143,489	478,493,200
第13期	619,762,253	631,166,681

ハッピーエイジング60

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	5,823,001	66,074
第2期	18,855,393	1,155,265
第3期	71,115,404	5,280,627
第4期	149,027,997	18,235,313
第5期	294,966,175	37,865,518
第6期	620,505,740	110,308,158
第7期	413,005,730	178,957,589
第8期	458,481,130	137,709,650
第9期	400,300,646	217,665,541
第10期	339,805,218	211,886,769
第11期	411,859,598	230,027,943
第12期	406,833,203	190,166,524
第13期	479,744,662	383,926,075

（注1）設定口数には、当初募集期間の設定口数を含みます。

（注2）本邦外における設定及び解約はありません。

< 参考情報 >

◆ハッピーエイジング20

(基準日:2013年7月31日)

基準価額・純資産の推移



- (注1) 基準価額(税引前分配金再投資)は、税引前の分配金を決算日の基準価額で再投資したものととして委託会社にて計算しており、実際の騰落率とは異なります(以下同し)。
(注2) 基準価額及び基準価額(税引前分配金再投資)の計算において信託報酬(純資産総額に対して年率1.7010%(税込))は控除されております(以下同し)。
(注3) ベンチマークの推移は、表示期間の開始の基準価額(税引前分配金再投資)をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
(注4) 分配実績がない場合、あるいは設定来累計の分配金額が少額の場合、基準価額及び基準価額(税引前分配金再投資)のグラフが重なって表示される場合があります。

基準価額	9,455円
純資産総額	61.42億円

(注) 基準価額は、分配金控除後です。

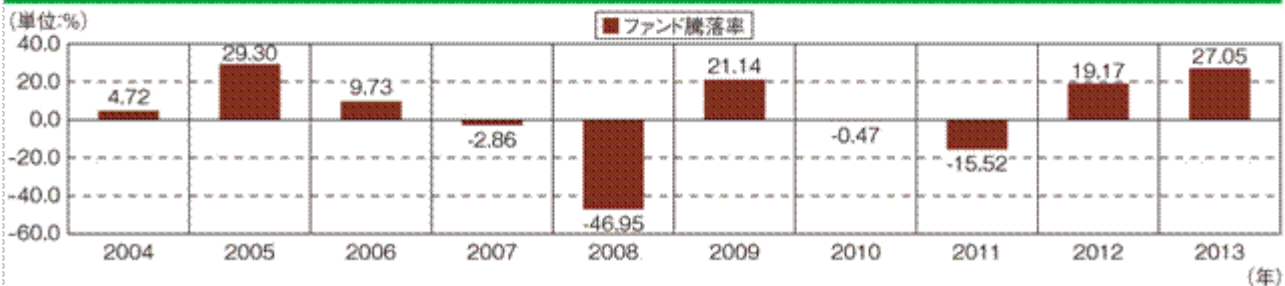
構成比率(対純資産)

損保ジャパン-TOW外国株マザーファンド	33.09%
損保ジャパン-DIAM日本株アクティブマザーファンド	26.22%
損保ジャパン日本株マザーファンド	26.09%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	6.00%
ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	4.75%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	2.00%
コール・ローン等	1.86%
合計	100.00%

分配の推移(1万口当たり、税引前)

2009年07月	0円	(注1) 直近5期分の分配実績を記載しております。
2010年07月	0円	(注2) 収益分配金額は委託会社が決定します。分配を行わないこともあります。
2011年07月	0円	
2012年07月	0円	
2013年07月	0円	
設定来累計	0円	

年間収益率の推移(暦年ベース)



- (注1) ファンド騰落率は、基準価額(税引前分配金再投資)を使用して算出しております。
(注2) 2013年は年初から基準日までの騰落率です。

◆ハッピーエイジング30

基準価額・純資産の推移



- (注1) 基準価額(税引前分配金再投資)は、税引前の分配金を決算日の基準価額で再投資したものととして委託会社にて計算しており、実際の騰落率とは異なります(以下同し)。
(注2) 基準価額及び基準価額(税引前分配金再投資)の計算において信託報酬(純資産総額に対して年率1.5225%(税込))は控除されております(以下同し)。
(注3) ベンチマークの推移は、表示期間の開始の基準価額(税引前分配金再投資)をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
(注4) 分配実績がない場合、あるいは設定来累計の分配金額が少額の場合、基準価額及び基準価額(税引前分配金再投資)のグラフが重なって表示される場合があります。

基準価額	10,201円
純資産総額	73.92億円

(注) 基準価額は、分配金控除後です。

構成比率(対純資産)

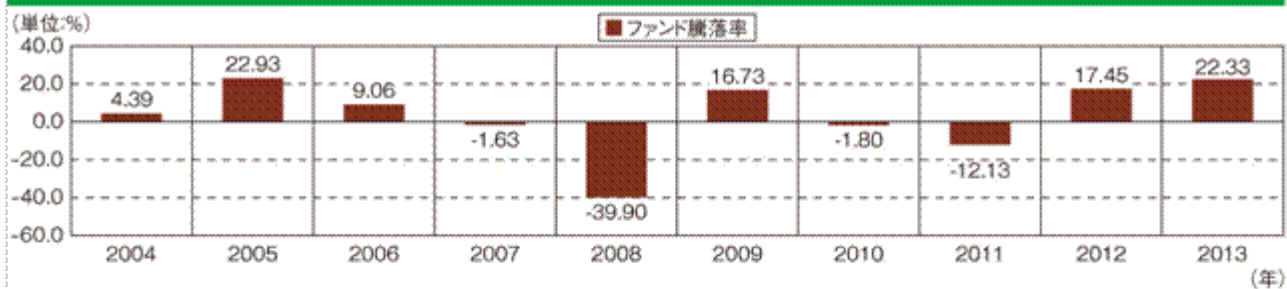
損保ジャパン-DIAM日本株アクティブマザーファンド	22.20%
損保ジャパン日本株マザーファンド	22.09%
損保ジャパン-TOW外国株マザーファンド	21.07%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	20.01%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	8.04%
ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	4.79%
コール・ローン等	1.80%
合計	100.00%

分配の推移(1万口当たり、税引前)

2009年07月	0円	(注1) 直近5期分の分配実績を記載しております。
2010年07月	0円	(注2) 収益分配金額は委託会社が決定します。分配を行わないこともあります。
2011年07月	0円	
2012年07月	0円	
2013年07月	0円	
設定来累計	0円	

※ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
 ※ベンチマークの情報はあくまで参考情報としての記載であり、当ファンドの運用実績ではありません。
 ※最新の運用実績は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
 ※表中の各数値は四捨五入して表示していることがありますので、合計が100%とならない場合があります。

年間収益率の推移（暦年ベース）



(注1) ファンド騰落率は、基準価額(税引前分配金再投資)を使用して算出しております。

(注2) 2013年は年初から基準日までの騰落率です。

◆ハッピーエイジング40

基準価額・純資産の推移



(注1) 基準価額(税引前分配金再投資)は、税引前の分配金を決算日の基準価額で再投資したものととして委託会社にて計算しており、実際の騰落率とは異なります(以下同し)。

(注2) 基準価額及び基準価額(税引前分配金再投資)の計算において信託報酬(純資産総額に対して年率1.3440%(税込み))は控除されております(以下同し)。

(注3) ベンチマークの推移は、表示期間の期首の基準価額(税引前分配金再投資)をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。

(注4) 分配実績がない場合、あるいは設定来累計の分配金額が少額の場合、基準価額及び基準価額(税引前分配金再投資)のグラフが重なって表示される場合があります。

基準価額	10,937円
純資産総額	95.44億円

(注) 基準価額は、分配金控除後です。

構成比率(対純資産)

損保ジャパン日本債券マザーファンド	33.14%
損保ジャパン-DIAM日本株アクティブ・マザーファンド	15.60%
損保ジャパン日本株マザーファンド	15.53%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	14.98%
損保ジャパン-TOW外国株式マザーファンド	14.02%
ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	4.84%
コール・ローン等	1.89%
合計	100.00%

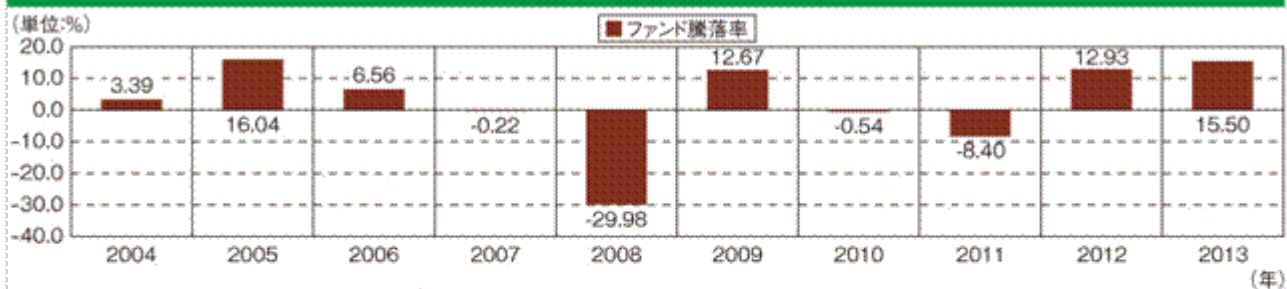
分配の推移(1万口当たり、税引前)

2009年07月	0円
2010年07月	0円
2011年07月	0円
2012年07月	0円
2013年07月	0円
設定来累計	0円

(注1) 直近5期分の分配実績を記載しております。

(注2) 収益分配金額は委託会社が決定します。分配を行わないこともあります。

年間収益率の推移（暦年ベース）



(注1) ファンド騰落率は、基準価額(税引前分配金再投資)を使用して算出しております。

(注2) 2013年は年初から基準日までの騰落率です。

※ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
 ※ベンチマークの情報はあくまで参考情報としての記載であり、当ファンドの運用実績ではありません。
 ※最新の運用実績は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
 ※表中の各数値は四捨五入して表示していることがありますので、合計が100%とならない場合があります。

◆ハッピーエイジング50

基準価額・純資産の推移



(注1) 基準価額(税引前分配金再投資)は、税引前の分配金を決算日の基準価額で再投資したものととして委託会社にて計算しており、実際の騰落率とは異なります(以下同し)。
(注2) 基準価額及び基準価額(税引前分配金再投資)の計算において信託報酬(純資産総額に対して年率1.1655%(税込み))は控除されております(以下同し)。
(注3) ベンチマークの推移は、表示期間の শেষの基準価額(税引前分配金再投資)をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
(注4) 分配実績がない場合、あるいは設定来累計の分配金額が少額の場合、基準価額及び基準価額(税引前分配金再投資)のグラフが重なって表示される場合があります。

基準価額	11,397円
純資産総額	44.32億円

(注) 基準価額は、分配金控除後です。

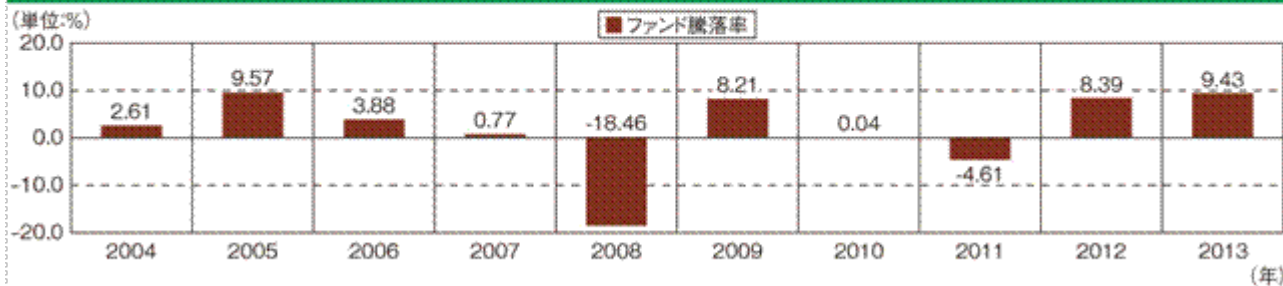
構成比率(対純資産)

損保ジャパン日本債券マザーファンド	57.05%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	10.98%
損保ジャパン-DIAM日本株アクティブマザーファンド	9.56%
損保ジャパン日本株マザーファンド	9.51%
損保ジャパン-TOW外国株式マザーファンド	8.01%
ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	2.91%
コール・ローン等	1.99%
合計	100.00%

分配の推移(1万口当たり、税引前)

2009年07月	0円	(注1) 直近5期分の分配実績を記載しております。 (注2) 収益分配金額は委託会社が決定します。分配を行わないこともあります。
2010年07月	0円	
2011年07月	0円	
2012年07月	0円	
2013年07月	0円	
設定来累計	0円	

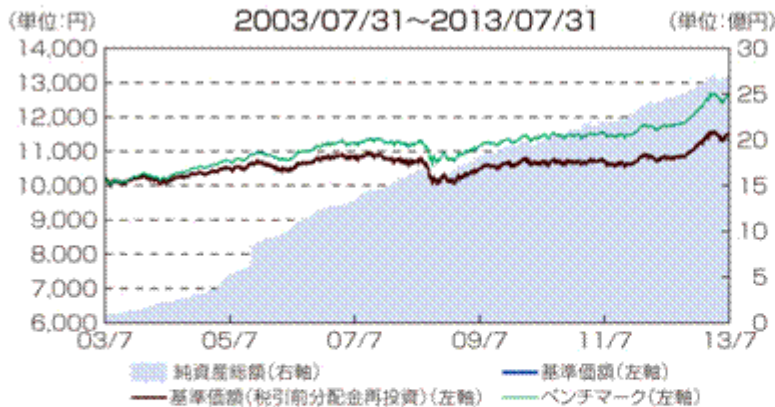
年間収益率の推移(暦年ベース)



(注1) ファンド騰落率は、基準価額(税引前分配金再投資)を使用して算出しております。
(注2) 2013年は年初から基準日までの騰落率です。

◆ハッピーエイジング60

基準価額・純資産の推移



(注1) 基準価額(税引前分配金再投資)は、税引前の分配金を決算日の基準価額で再投資したものととして委託会社にて計算しており、実際の騰落率とは異なります(以下同し)。
(注2) 基準価額及び基準価額(税引前分配金再投資)の計算において信託報酬(純資産総額に対して年率0.9870%(税込み))は控除されております(以下同し)。
(注3) ベンチマークの推移は、表示期間の শেষの基準価額(税引前分配金再投資)をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
(注4) 分配実績がない場合、あるいは設定来累計の分配金額が少額の場合、基準価額及び基準価額(税引前分配金再投資)のグラフが重なって表示される場合があります。

基準価額	11,444円
純資産総額	27.05億円

(注) 基準価額は、分配金控除後です。

構成比率(対純資産)

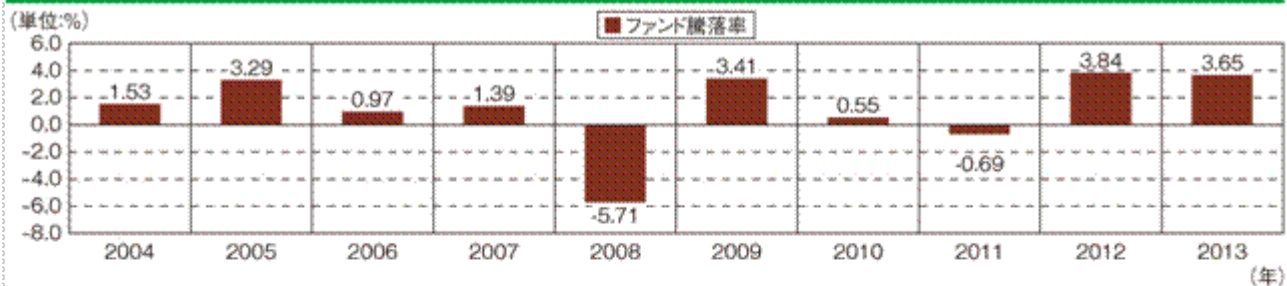
損保ジャパン日本債券マザーファンド	81.85%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	5.98%
損保ジャパン-TOW外国株式マザーファンド	4.00%
損保ジャパン-DIAM日本株アクティブマザーファンド	3.01%
損保ジャパン日本株マザーファンド	3.00%
コール・ローン等	2.16%
合計	100.00%

分配の推移(1万口当たり、税引前)

2009年07月	0円	(注1) 直近5期分の分配実績を記載しております。 (注2) 収益分配金額は委託会社が決定します。分配を行わないこともあります。
2010年07月	0円	
2011年07月	0円	
2012年07月	0円	
2013年07月	0円	
設定来累計	0円	

※ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
※ベンチマークの情報はあくまで参考情報としての記載であり、当ファンドの運用実績ではありません。
※最新の運用実績は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
※表中の各数値は四捨五入して表示していることがありますので、合計が100%とならない場合があります。

年間収益率の推移（暦年ベース）



(注1) ファンド収益率は、基準価額(税引前分配金再投資)を使用して算出しております。

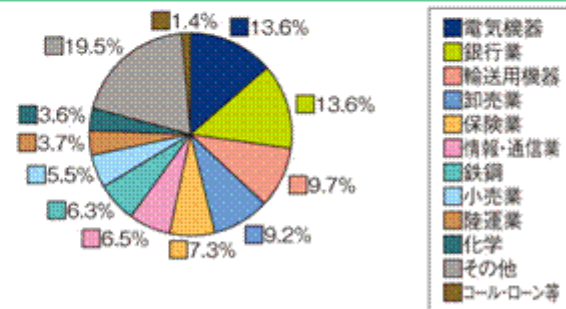
(注2) 2013年は年初から基準日までの騰落率です。

主要な資産の状況(損保ジャパン日本株マザーファンド)

構成比率(対純資産)

株式	98.58%
コールローン等	1.42%
合計	100.00%

業種別構成比率(対純資産)



組入上位10銘柄

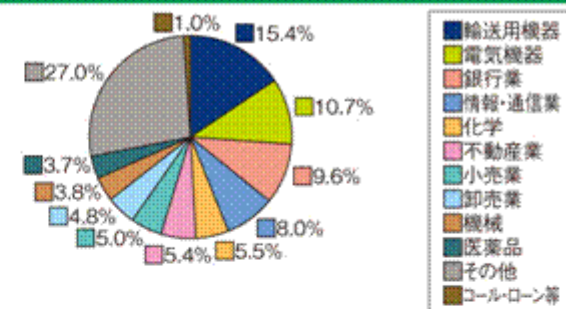
順位	銘柄名	業種	純資産比
1	日本電信電話	情報・通信業	3.9%
2	JFEホールディングス	鉄鋼	3.7%
3	トヨタ自動車	輸送用機器	3.4%
4	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	3.3%
5	住友商事	卸売業	3.2%
6	みずほフィナンシャルG	銀行業	3.1%
7	本田技研	輸送用機器	2.9%
8	日本電産	電気機器	2.8%
9	キヤノン	電気機器	2.7%
10	三井住友フィナンシャルG	銀行業	2.6%
銘柄数			113銘柄

主要な資産の状況(損保ジャパン-DIAM日本株アクティブ・マザーファンド)

構成比率(対純資産)

株式	99.02%
コールローン等	0.98%
合計	100.00%

業種別構成比率(対純資産)



組入上位10銘柄

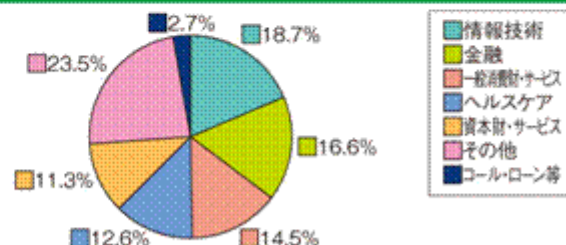
順位	銘柄名	業種	純資産比
1	トヨタ自動車	輸送用機器	6.9%
2	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	4.6%
3	三井住友フィナンシャルG	銀行業	4.4%
4	三井不動産	不動産業	3.5%
5	ソフトバンク	情報・通信業	3.1%
6	東日本旅客鉄道	陸運業	2.3%
7	日野自動車	輸送用機器	2.2%
8	東京海上HD	保険業	2.1%
9	KDDI	情報・通信業	2.1%
10	日立	電気機器	2.0%
銘柄数			89銘柄

主要な資産の状況(損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド)

構成比率(対純資産)

株式	95.49%
投資証券	1.76%
コールローン等	2.74%
合計	100.00%

業種別構成比率(対純資産)



※ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
 ※ベンチマークの情報はあくまで参考情報としての記載であり、当ファンドの運用実績ではありません。
 ※最新の運用実績は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
 ※表中の各数値は四捨五入して表示していることがありますので、合計が100%とならない場合があります。

組入上位10銘柄

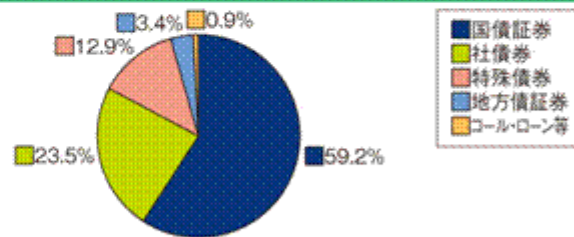
	銘柄名	通貨	発行国/地域	業種	純資産比
1	QUALCOMM INC	アメリカドル	アメリカ	情報技術	1.9%
2	AMAZON.COM INC	アメリカドル	アメリカ	一般消費財・サービス	1.8%
3	STARBUCKS CORP	アメリカドル	アメリカ	一般消費財・サービス	1.8%
4	GOOGLE INC-CL A	アメリカドル	アメリカ	情報技術	1.8%
5	SALESFORCE.COM INC	アメリカドル	アメリカ	情報技術	1.6%
6	ACE LTD	アメリカドル	アメリカ	金融	1.6%
7	AMERICAN TOWER CORP	アメリカドル	アメリカ	金融	1.5%
8	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカドル	アメリカ	情報技術	1.5%
9	LINKEDIN CORP - A	アメリカドル	アメリカ	情報技術	1.5%
10	CERNER CORP	アメリカドル	アメリカ	ヘルスケア	1.4%
銘柄数					295銘柄

主要な資産の状況(損保ジャパン日本債券マザーファンド)

構成比率(対純資産)

公社債	99.07%
コールローン等	0.93%
合計	100.00%

種類別構成比率(対純資産)



ポートフォリオの状況

平均残存期間	8.32
修正デュレーション	7.39

組入上位10銘柄

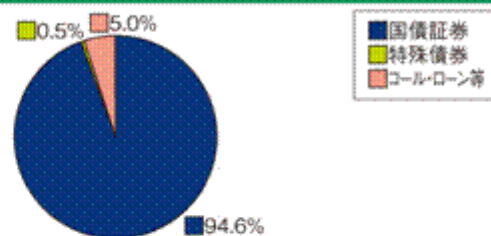
	銘柄名	種類	償還日	純資産比
1	314 10年国債	国債証券	2021/03/20	8.6%
2	327 2年国債	国債証券	2015/04/15	5.7%
3	144 20年国債	国債証券	2033/03/20	5.0%
4	299 10年国債	国債証券	2019/03/20	3.9%
5	145 20年国債	国債証券	2033/06/20	3.8%
6	112 5年国債	国債証券	2018/06/20	3.6%
7	287 10年国債	国債証券	2017/06/20	2.9%
8	318 10年国債	国債証券	2021/09/20	2.9%
9	311 10年国債	国債証券	2020/09/20	2.6%
10	20 ラボバンク・ネター	社債券	2016/05/24	1.9%
銘柄数				78銘柄

主要な資産の状況(損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド)

構成比率(対純資産)

公社債	95.01%
コールローン等	4.99%
合計	100.00%

種類別構成比率(対純資産)



ポートフォリオの状況

平均残存期間	7.65
修正デュレーション	5.80

組入上位10銘柄

	銘柄名	発行国	種類	通貨	償還日	純資産比
1	BTPS 3.0	イタリア	国債証券	ユーロ	2015/11/01	7.3%
2	BTPS 3.75	イタリア	国債証券	ユーロ	2015/08/01	5.2%
3	US TREASURY N/B 0.25%	アメリカ	国債証券	アメリカドル	2014/09/30	3.6%
4	US TREASURY N/B 0.375%	アメリカ	国債証券	アメリカドル	2015/06/30	3.2%
5	BTPS 5.5%	イタリア	国債証券	ユーロ	2022/09/01	2.6%
6	US TREASURY N/B 1.875	アメリカ	国債証券	アメリカドル	2015/06/30	2.5%
7	US TREASURY N/B 2.875%	アメリカ	国債証券	アメリカドル	2043/05/15	2.3%
8	US TREASURY N/B 2.125	アメリカ	国債証券	アメリカドル	2015/12/31	2.2%
9	FRANCE O.A.T. 2.25%	フランス	国債証券	ユーロ	2022/10/25	2.0%
10	US TREASURY N/B 1.25	アメリカ	国債証券	アメリカドル	2015/09/30	1.9%
銘柄数					148銘柄	

※ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
 ※ベンチマークの情報はあくまで参考情報としての記載であり、当ファンドの運用実績ではありません。
 ※最新の運用実績は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
 ※表中の各数値は四捨五入して表示していることがありますので、合計が100%とならない場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- (1) 申込期間内における毎営業日において、いつでも申込みいただくことができます。ただし、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所、フランクフルト証券取引所、パリ証券取引所のいずれかの取引所あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、取得の申込みを受付けないものとします。

お申込みの受付は原則として午後3時までとし、それ以降のお申込みは、翌営業日の取扱いとなります。（受付時間については、販売会社により異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社にご確認ください。）

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、取引市場における流動性が極端に減少した場合、取引市場の混乱、自然災害、テロ、大規模停電、システム障害等により基準価額の算出が困難となった場合、その他やむを得ない事情があると判断したとき（「緊急事態発生時」といいます。）は、取得申込みの受付を中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付を取り消すことができますものとします。

- (2) 受益権の取得申込者は、販売会社に取引口座を開設します。

- (3) 当該受益権の申込価額は、取得申込受付日の翌営業日における基準価額とします。

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

当ファンドの基準価額については、委託会社（損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社、ホームページ：<http://www.sjnk-am.co.jp/>、電話03-5290-3519 営業部（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

- (4) お申込みには申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額を要します。申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.1%（税抜2.0%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。

定時定額購入サービスを申込まれた場合および確定拠出年金制度に基づき申込まれた場合には、申込手数料はありません。

定時定額購入サービスを申込まれた場合および確定拠出年金制度に基づき申込まれた場合で、「ハッピーエイジング・ファンド」の各ファンド間のスイッチングの場合にも、申込手数料はありません。

申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。また、消費税率が8%になった場合は、2.16%となります。

- (5) お申込単位は販売会社が定める単位とします。

申込単位等の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

- (6) 取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託に

より分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

2【換金（解約）手続等】

- (1) 受益者は、日本における委託会社及び販売会社の各営業日に一部解約の実行を請求することができます。ただし、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所、フランクフルト証券取引所、パリ証券取引所のいずれかの取引所あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、解約請求を受けないものとします。一部解約の受付は原則として午後3時までとし、それ以降のお申込みは翌営業日の取扱いとなります。（受付時間については、販売会社により異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社にご確認ください。）
- (2) 受益者は、自己に帰属する受益権について販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。
一部解約の単位の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。
- (3) 一部解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した解約価額とします。解約代金は原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社の営業所等で支払われます。解約に係る手数料はありません。
信託財産留保額は、換金する受益者が負担するものであり、基準価額から差引かれた信託財産留保額は、信託財産に組入れられます。

ご換金時には税金が課せられます。詳しくは有価証券届出書「第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 4手数料等及び税金（5）課税上の取扱い」をご参照ください。
- (4) 委託会社は、緊急事態発生時には、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、および既に受けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができるものとします。一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受けたものとし、信託約款の規定に準じて算出した価額とします。
- (5) 換金の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。
- (6) 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求を制限する場合があります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額は、原則として各営業日に委託会社が計算します。

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入有価証券を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した価額をい

います。

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。ただし、一般社団法人投資信託協会規則に別段の定めがある場合には同規則の定めるところによります。また外国為替の予約取引の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。ただし、一般社団法人投資信託協会規則に別段の定めがある場合には同規則の定めるところによります。

基準価額は、毎営業日に委託会社及び販売会社に問い合わせることにより知ることができます。また基準価額は原則として、翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。なお基準価額は1万口単位で表示されたものが発表されます。

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、取引市場における流動性が極端に減少した場合、取引市場の混乱、自然災害、テロ、大規模停電、システム障害等により基準価額の公表を中止することがあります。

・お電話によるお問い合わせ（委託会社）

電話番号 03-5290-3519 営業部（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

・委託会社のホームページ <http://www.sjnk-am.co.jp/>

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。ただし、この信託期間中に信託約款第49条第8項、第50条第1項、第51条第1項、第52条第1項及び第54条第2項に規定する事由が生じた場合にはこの信託を終了させることができます。

（4）【計算期間】

原則として、毎年7月16日から翌年7月15日までとします。

なお、前記の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下、「該当日」といいます。）が休業日のときは各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託約款第4条に定める信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

信託契約の解約

- （ ） 委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が1億口を下回るようになった場合、またはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- （ ） 委託会社は、前記（ ）の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- （ ） 前記（ ）の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- （ ） 前記（ ）の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前記（ ）の信託契約の解約をしません。
- （ ） 委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- （ ） 前記（ ）から（ ）までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記（ ）の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

信託契約に関する監督官庁の命令

- （ ） 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- （ ） 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、信託約款第55条（信託約款の変更）の規定にしたがいます。

委託会社の登録取消等に伴う取扱い

- （ ） 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。
- （ ） 前記（ ）の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、信託約款第55条第4項に該当する場合（当該約款変更について異議を申し出た受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超える場合）を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

- （ ） 委託会社は、事業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。
- （ ） 委託会社は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- （ ） 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款第55条の規定にしたがい、新受託会社を選任します。
- （ ） 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

- () 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- () 委託会社は、前記()の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- () 前記()の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- () 前記()の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前記()の信託約款の変更をしません。
- () 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

運用に係る報告等開示方法

委託会社は、金融商品取引法の規定に基づき計算期間終了毎に有価証券報告書を、計算期間開始6ヵ月経過毎に半期報告書を作成します。また、委託会社は「投資信託及び投資法人に関する法律」の規定に基づき各計算期間の末日毎及び償還時に運用報告書を作成し、かつ知られたる受益者に交付します。

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

関係法人との契約の更改等

委託会社と販売会社との間の募集・販売の取扱い等に関する契約は、当事者の別段の意思表示のない限り、1年毎に自動的に更新されます。募集・販売の取扱い等に関する契約は、当事者間の合意により変更することができます。

委託会社と運用委託先との間の投資一任契約は、原則として、ファンドの償還日に終了するものとします。ただし、運用委託先が契約に違反した場合等には、契約の中止または変更をすることができます。

信託事務処理の再信託

受託会社は、当ファンドに係る信託事務の処理の一部について資産管理サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することができます。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

4【受益者の権利等】

当ファンドの受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。この受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。受益者の有する主な権利は次のとおりです。なお、信託約款には受益者集会に関する規定はありません。また、ファンド資産に生じた利益及び損失は、全て受益者に帰属します。

(1) 収益分配金に対する請求権

当ファンドの収益分配金は、原則として自動的に当ファンドに再投資される性格を有します。分配金は税引き後再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されま

す。また委託会社の直接募集に係る受益者に対して委託会社は遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。

なお、収益分配金を再投資しない契約を別に締結した受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持つに応じて請求する権利を有します。収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、毎計算期間の終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から販売会社を通じて受益者に支払います。ただし、委託会社自ら勧誘した受益者に対する支払いは委託会社において行うものとし、

なお、収益分配金の請求権は、支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、償還金を持ち分に応じて委託会社に請求する権利を有します。償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。償還金は、償還日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から受益者に支払われます。償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとし、

なお、委託会社自ら勧誘した受益者に対する支払いは、委託会社において行うものとし、

償還金の請求権は、支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

(3) 一部解約の実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について販売会社が定める単位をもって、受益権の一部解約の実行を請求することができます。なお、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所、フランクフルト証券取引所、パリ証券取引所のいずれかの取引所あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、解約請求を受付けないものとし、

受付は原則として午後3時までとし、それ以降の受付は翌営業日の取扱いになります（受付時間については、販売会社により異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社にご確認ください。）。一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとし、

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者に係る信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

(5) 反対者の買取請求権

信託契約の解約または重大な信託約款の変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、法令に基づき、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）（以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に掲載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、平成24年7月18日から平成25年7月16日までの財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ハッピーエイジング20】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (平成24年7月17日現在)	第13期 (平成25年7月16日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	102,969,661	151,885,169
投資信託受益証券	193,368,580	298,260,774
親投資信託受益証券	3,776,166,310	5,980,366,221
流動資産合計	4,072,504,551	6,430,512,164
資産合計		
	4,072,504,551	6,430,512,164
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,305,468	5,875,746
未払受託者報酬	1,757,567	2,440,629
未払委託者報酬	33,832,478	46,984,663
その他未払費用	96,603	131,250
流動負債合計	37,992,116	55,432,288
負債合計		
	37,992,116	55,432,288
純資産の部		
元本等		
元本	6,308,491,704	6,486,710,160
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,273,979,269	111,630,284
純資産合計	4,034,512,435	6,375,079,876
負債純資産合計	4,072,504,551	6,430,512,164

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第12期		第13期	
	自	平成23年7月16日 至 平成24年7月17日	自	平成24年7月18日 至 平成25年7月16日
営業収益				
受取配当金		3,739,359		8,535,165
受取利息		47,356		51,448
有価証券売買等損益		437,076,772		2,256,309,605
為替差損益		1,111,287		50,862,340
その他収益		-		1,856,877
営業収益合計		434,401,344		2,317,615,435
営業費用				
受託者報酬		3,372,269		4,268,424
委託者報酬		64,915,010		82,170,760
その他費用		249,388		306,009
営業費用合計		68,536,667		86,745,193
営業利益又は営業損失（ ）		502,938,011		2,230,870,242
経常利益又は経常損失（ ）		502,938,011		2,230,870,242
当期純利益又は当期純損失（ ）		502,938,011		2,230,870,242
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		42,955,428		237,904,179
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,606,634,765		2,273,979,269
剰余金増加額又は欠損金減少額		209,015,164		426,260,569
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		209,015,164		426,260,569
剰余金減少額又は欠損金増加額		416,377,085		256,877,647
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		416,377,085		256,877,647
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,273,979,269		111,630,284

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第13期	
	自 平成24年 7月18日	至 平成25年 7月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券・投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。	
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。	
3. 費用・収益の計上基準	(1) 受取配当金の計上基準 受取配当金は、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。	
5. その他	当計算期間は期末が休日のため平成24年 7月18日から平成25年 7月16日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

	第12期 (平成24年 7月17日現在)	第13期 (平成25年 7月16日現在)
1. 計算期間末日における受益権の総数	6,308,491,704口	6,486,710,160口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 2,273,979,269円	元本の欠損 111,630,284円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.6395円 (1万口当たり純資産額 6,395円)	1口当たり純資産額 0.9828円 (1万口当たり純資産額 9,828円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第12期</p> <p style="text-align: center;">自 平成23年 7月16日</p> <p style="text-align: center;">至 平成24年 7月17日</p>	<p style="text-align: center;">第13期</p> <p style="text-align: center;">自 平成24年 7月18日</p> <p style="text-align: center;">至 平成25年 7月16日</p>
<p>1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額</p> <p style="text-align: right;">7,523,886円</p> <p>2. 分配金の計算過程</p> <p>第12期計算期間末（平成24年7月17日）に収益調整金（1,796,975,949円）及び分配準備積立金（435,875,779円）を対象収益（2,232,851,728円）として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、分配を行わないことに決定しました。</p>	<p>1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額</p> <p style="text-align: right;">8,664,556円</p> <p>2. 分配金の計算過程</p> <p>第13期計算期間末（平成25年7月16日）に経費控除後の配当等収益（9,561,794円）、有価証券売買等損益（644,654,572円）、収益調整金（1,935,704,631円）及び分配準備積立金（361,264,856円）を対象収益（2,951,185,853円）として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、分配を行わないことに決定しました。</p>

（金融商品に関する注記）

	<p style="text-align: center;">第12期</p> <p style="text-align: center;">自 平成23年 7月16日</p> <p style="text-align: center;">至 平成24年 7月17日</p>	<p style="text-align: center;">第13期</p> <p style="text-align: center;">自 平成24年 7月18日</p> <p style="text-align: center;">至 平成25年 7月16日</p>
<p>1. 金融商品の状況に関する事項</p>	<p>（1）金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。</p> <p>（2）金融商品の内容およびその金融商品に係るリスク</p> <p style="text-align: center;">金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券関係）に記載しております。</p> <p style="text-align: center;">金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> <p>（3）金融商品に係るリスク管理体制</p> <p style="text-align: center;">制</p>	<p>（1）金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>（2）金融商品の内容およびその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>（3）金融商品に係るリスク管理体制</p> <p style="text-align: center;">制</p>

<p>2. 金融商品の時価等に関する事項</p>	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> <p>(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。</p> <p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>(2) 時価の算定方法</p>	<p>同左</p> <p>(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p> <p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額 同左</p> <p>(2) 時価の算定方法</p>
--------------------------	--	---

	<p>親投資信託受益証券・投資信託受益証券</p> <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	同左
--	---	----

(関連当事者との取引に関する注記)

第12期 (平成24年7月17日現在)	第13期 (平成25年7月16日現在)
該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

	第12期	第13期
	自 平成23年 7月16日 至 平成24年 7月17日	自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16日
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	5,814,405,406円	6,308,491,704円
期中追加設定元本額	1,229,841,291円	1,412,715,175円
期中解約元本額	735,754,993円	1,234,496,719円

（有価証券関係）

第12期（自平成23年 7月16日 至平成24年 7月17日）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	30,767,136
親投資信託受益証券	366,985,178
合計	397,752,314

第13期（自平成24年 7月18日 至平成25年 7月16日）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	34,300,922
親投資信託受益証券	2,119,575,041
合計	2,085,274,119

（デリバティブ取引等関係）

該当事項はございません。

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

（ ）株式

該当事項はございません。

() 株式以外の有価証券
次表の通りです。

平成25年7月16日現在

種類	銘柄	券面総額(口)	評価金額(円)	備考
投資信託受益証券	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	75,801.000	298,260,774	-
合計		75,801.000	298,260,774	-

平成25年7月16日現在

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	損保ジャパン日本株マザーファンド	1,280,099,980	1,692,292,173	-
	損保ジャパン-T C W外国株式マザーファンド	1,772,052,512	2,069,757,334	-
	損保ジャパン-D I A M日本株アクティブ・マザーファンド	1,431,909,389	1,716,143,402	-
	損保ジャパン日本債券マザーファンド	97,277,432	122,540,381	-
	損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	298,594,409	379,632,931	-
合計		-	5,980,366,221	-

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

【ハッピーエイジング30】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (平成24年7月17日現在)	第13期 (平成25年7月16日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	137,677,313	175,559,682
投資信託受益証券	245,008,487	362,271,885
親投資信託受益証券	4,757,544,189	7,178,418,420
流動資産合計	5,140,229,989	7,716,249,987
資産合計	5,140,229,989	7,716,249,987
負債の部		
流動負債		
未払解約金	438,236	1,085,397
未払受託者報酬	2,210,289	2,958,787
未払委託者報酬	37,850,333	50,673,372
その他未払費用	121,499	131,250
流動負債合計	40,620,357	54,848,806
負債合計	40,620,357	54,848,806
純資産の部		
元本等		
元本	7,026,267,220	7,260,278,486
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,926,657,588	401,122,695
純資産合計	5,099,609,632	7,661,401,181
負債純資産合計	5,140,229,989	7,716,249,987

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第12期		第13期	
	自	平成23年7月16日 至 平成24年7月17日	自	平成24年7月18日 至 平成25年7月16日
営業収益				
受取配当金		4,766,901		10,590,139
受取利息		55,071		59,783
有価証券売買等損益		405,156,063		2,411,414,470
為替差損益		1,120,675		63,075,376
その他収益		1,307		3,086,647
営業収益合計		401,453,459		2,488,226,415
営業費用				
受託者報酬		4,258,110		5,260,508
委託者報酬		72,918,934		90,094,441
その他費用		309,994		345,809
営業費用合計		77,487,038		95,700,758
営業利益又は営業損失（ ）		478,940,497		2,392,525,657
経常利益又は経常損失（ ）		478,940,497		2,392,525,657
当期純利益又は当期純損失（ ）		478,940,497		2,392,525,657
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		25,520,331		178,239,797
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,310,649,765		1,926,657,588
剰余金増加額又は欠損金減少額		119,146,715		240,594,526
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		119,146,715		240,594,526
剰余金減少額又は欠損金増加額		281,734,372		127,100,103
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		281,734,372		127,100,103
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,926,657,588		401,122,695

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第13期	
	自 平成24年 7月18日	至 平成25年 7月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券・投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。	
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。	
3. 費用・収益の計上基準	(1) 受取配当金の計上基準 受取配当金は、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。	
5. その他	当計算期間は期末が休日のため平成24年 7月18日から平成25年 7月16日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

	第12期	第13期
	(平成24年 7月17日現在)	(平成25年 7月16日現在)
1. 計算期間末日における受益権の総数	7,026,267,220口	7,260,278,486口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 1,926,657,588円	
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.7258円 (1万口当たり純資産額 7,258円)	1口当たり純資産額 1.0552円 (1万口当たり純資産額 10,552円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第12期</p> <p style="text-align: center;">自 平成23年7月16日 至 平成24年7月17日</p>	<p style="text-align: center;">第13期</p> <p style="text-align: center;">自 平成24年7月18日 至 平成25年7月16日</p>
<p>1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 6,707,044円</p> <p>2. 分配金の計算過程 第12期計算期間末（平成24年7月17日）に収益調整金（1,347,486,055円）及び分配準備積立金（469,217,116円）を対象収益（1,816,703,171円）として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、分配を行わないことに決定しました。</p>	<p>1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 7,558,201円</p> <p>2. 分配金の計算過程 第13期計算期間末（平成25年7月16日）に経費控除後の配当等収益（12,688,785円）、有価証券売買等損益（625,011,210円）、収益調整金（1,463,757,948円）及び分配準備積立金（414,437,754円）を対象収益（2,515,895,697円）として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、分配を行わないことに決定しました。</p>

（金融商品に関する注記）

	<p style="text-align: center;">第12期</p> <p style="text-align: center;">自 平成23年7月16日 至 平成24年7月17日</p>	<p style="text-align: center;">第13期</p> <p style="text-align: center;">自 平成24年7月18日 至 平成25年7月16日</p>
<p>1. 金融商品の状況に関する事項</p>	<p>（1）金融商品に対する取組方針 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。</p> <p>（2）金融商品の内容およびその金融商品に係るリスク 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券関係）に記載しております。</p> <p>金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>	<p>（1）金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>（2）金融商品の内容およびその金融商品に係るリスク 同左</p>

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。

市場リスク

金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。

信用リスク

各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。

流動性リスク

必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。

また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。

(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

同左

(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

同左

(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額

2. 金融商品の時価等に関する事項

	<p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>(2) 時価の算定方法 親投資信託受益証券・投資信託受益証券</p> <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	<p>同左</p> <p>(2) 時価の算定方法 同左</p>
--	--	-------------------------------------

(関連当事者との取引に関する注記)

第12期 (平成24年7月17日現在)	第13期 (平成25年7月16日現在)
該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

	第12期	第13期
	自 平成23年 7月16日 至 平成24年 7月17日	自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16日
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	6,502,970,282円	7,026,267,220円
期中追加設定元本額	1,095,836,730円	1,142,944,756円
期中解約元本額	572,539,792円	908,933,490円

（有価証券関係）

第12期（自平成23年 7月16日 至平成24年 7月17日）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	37,013,463
親投資信託受益証券	347,212,076
合計	384,225,539

第13期（自平成24年 7月18日 至平成25年 7月16日）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	41,694,981
親投資信託受益証券	2,218,043,040
合計	2,176,348,059

（デリバティブ取引等関係）

該当事項はございません。

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

（ ）株式

該当事項はございません。

() 株式以外の有価証券
次表の通りです。

平成25年7月16日現在

種類	銘柄	券面総額(口)	評価金額(円)	備考
投資信託受益証券	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	92,069.000	362,271,885	-
合計		92,069.000	362,271,885	-

平成25年7月16日現在

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	損保ジャパン日本株マザーファンド	1,316,803,475	1,740,814,193	-
	損保ジャパン-T C W外国株式マザーファンド	1,373,555,302	1,604,312,592	-
	損保ジャパン-D I A M日本株アクティブ・マザーファンド	1,474,838,844	1,767,594,354	-
	損保ジャパン日本債券マザーファンド	477,191,773	601,118,476	-
	損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	1,151,941,801	1,464,578,805	-
合計		-	7,178,418,420	-

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

【ハッピーエイジング40】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (平成24年7月17日現在)	第13期 (平成25年7月16日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	176,838,317	225,525,823
投資信託受益証券	358,701,147	472,430,177
親投資信託受益証券	6,914,178,756	9,138,161,832
流動資産合計	7,449,718,220	9,836,117,832
資産合計	7,449,718,220	9,836,117,832
負債の部		
流動負債		
未払解約金	996,639	17,245,911
未払受託者報酬	2,770,629	3,376,643
未払委託者報酬	47,893,834	58,370,725
その他未払費用	131,250	131,250
流動負債合計	51,792,352	79,124,529
負債合計	51,792,352	79,124,529
純資産の部		
元本等		
元本	8,637,308,057	8,714,773,680
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,239,382,189	1,042,219,623
純資産合計	7,397,925,868	9,756,993,303
負債純資産合計	7,449,718,220	9,836,117,832

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第12期		第13期	
	自	平成23年7月16日 至 平成24年7月17日	自	平成24年7月18日 至 平成25年7月16日
営業収益				
受取配当金		6,961,855		14,600,226
受取利息		78,136		82,078
有価証券売買等損益		340,227,311		2,317,688,148
為替差損益		1,326,984		86,645,593
その他収益		1,348		965,153
営業収益合計		334,512,956		2,419,981,198
営業費用				
受託者報酬		5,364,734		6,241,954
委託者報酬		92,736,170		107,902,767
その他費用		363,863		376,923
営業費用合計		98,464,767		114,521,644
営業利益又は営業損失（ ）		432,977,723		2,305,459,554
経常利益又は経常損失（ ）		432,977,723		2,305,459,554
当期純利益又は当期純損失（ ）		432,977,723		2,305,459,554
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		30,214,497		171,481,273
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		734,968,488		1,239,382,189
剰余金増加額又は欠損金減少額		76,267,593		155,553,396
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		76,267,593		155,553,396
剰余金減少額又は欠損金増加額		177,918,068		7,929,865
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		177,918,068		7,929,865
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,239,382,189		1,042,219,623

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第13期 自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券・投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	(1) 受取配当金の計上基準 受取配当金は、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。
5. その他	当計算期間は期末が休日のため平成24年 7月18日から平成25年 7月16日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第12期 （平成24年7月17日現在）	第13期 （平成25年7月16日現在）
1. 計算期間末日における受益権の総数	8,637,308,057口	8,714,773,680口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 1,239,382,189円	
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.8565円 （1万口当たり純資産額 8,565円）	1口当たり純資産額 1.1196円 （1万口当たり純資産額 11,196円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第12期 自 平成23年7月16日 至 平成24年7月17日	第13期 自 平成24年7月18日 至 平成25年7月16日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 6,297,141円	1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 6,780,075円
2. 分配金の計算過程 第12期計算期間末（平成24年7月17日）に収益調整金（1,361,811,445円）及び分配準備積立金（488,974,585円）を対象収益（1,850,786,030円）として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、分配を行わないことに決定しました。	2. 分配金の計算過程 第13期計算期間末（平成25年7月16日）に経費控除後の配当等収益（14,230,542円）、有価証券売買等損益（738,245,275円）、収益調整金（1,438,430,778円）及び分配準備積立金（430,316,386円）を対象収益（2,621,222,981円）として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、分配を行わないことに決定しました。

（金融商品に関する注記）

	第12期 自 平成23年 7月16日 至 平成24年 7月17日	第13期 自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16日
1. 金融商品の状況に関する事項	<p>（1）金融商品に対する取組方針 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。</p> <p>（2）金融商品の内容およびその金融商品に係るリスク 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券関係）に記載しております。</p> <p>金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> <p>（3）金融商品に係るリスク管理体制 委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p>	<p>（1）金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>（2）金融商品の内容およびその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>（3）金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

<p>2. 金融商品の時価等に関する事項</p>	<p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> <p>(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。</p> <p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額</p> <p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>(2) 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券・投資信託受益証券</p> <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p> <p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額</p> <p>同左</p> <p>(2) 時価の算定方法</p> <p>同左</p>
--------------------------	--	---

(関連当事者との取引に関する注記)

第12期 (平成24年7月17日現在)	第13期 (平成25年7月16日現在)
該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

	第12期 自 平成23年7月16日 至 平成24年7月17日	第13期 自 平成24年7月18日 至 平成25年7月16日

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	8,090,705,163円	8,637,308,057円
期中追加設定元本額	1,339,462,020円	1,210,013,963円
期中解約元本額	792,859,126円	1,132,548,340円

（有価証券関係）

第12期（自平成23年7月16日 至平成24年7月17日）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	50,267,296
親投資信託受益証券	264,918,681
合計	315,185,977

第13期（自平成24年7月18日 至平成25年7月16日）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	54,888,955
親投資信託受益証券	1,980,330,260
合計	1,925,441,305

（デリバティブ取引等関係）

該当事項はございません。

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

（ ）株式

該当事項はございません。

（ ）株式以外の有価証券

次表の通りです。

平成25年7月16日現在

種類	銘柄	券面総額（口）	評価金額（円）	備考
投資信託受益証券	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	120,065.000	472,430,177	-
合計		120,065.000	472,430,177	-

平成25年7月16日現在

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	損保ジャパン日本株マザーファンド	1,153,902,455	1,525,459,045	-
	損保ジャパン-T C W外国株式マザーファンド	1,194,477,213	1,395,149,384	-
	損保ジャパン-D I A M日本株アクティブ・マザーファンド	1,289,874,561	1,545,914,661	-
	損保ジャパン日本債券マザーファンド	2,549,059,682	3,211,050,481	-
	損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	1,148,803,100	1,460,588,261	-
合計		-	9,138,161,832	-

（注）券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

【ハッピーエイジング50】
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第12期 （平成24年7月17日現在）	第13期 （平成25年7月16日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	86,435,039	101,606,739
投資信託受益証券	111,152,941	131,744,531
親投資信託受益証券	3,635,030,522	4,273,677,633
流動資産合計	3,832,618,502	4,507,028,903
資産合計	3,832,618,502	4,507,028,903
負債の部		
流動負債		
未払解約金	568,964	1,010,831
未払受託者報酬	1,210,504	1,353,400
未払委託者報酬	21,186,405	23,682,889
その他未払費用	88,717	99,186
流動負債合計	23,054,590	26,146,306
負債合計	23,054,590	26,146,306
純資産の部		
元本等		
元本	3,889,202,800	3,877,798,372
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	79,638,888	603,084,225
純資産合計	3,809,563,912	4,480,882,597
負債純資産合計	3,832,618,502	4,507,028,903

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自	平成23年7月16日 至 平成24年7月17日	自	平成24年7月18日 至 平成25年7月16日
営業収益				
受取配当金		2,161,059		4,233,298
受取利息		40,091		40,433
有価証券売買等損益		55,663,364		699,147,877
為替差損益		254,386		25,320,066
その他収益		631		2,240,876
営業収益合計		53,715,969		730,982,550
営業費用				
受託者報酬		2,358,082		2,585,098
委託者報酬		41,271,654		45,235,979
その他費用		218,271		233,472
営業費用合計		43,848,007		48,054,549
営業利益又は営業損失（ ）		97,563,976		682,928,001
経常利益又は経常損失（ ）		97,563,976		682,928,001
当期純利益又は当期純損失（ ）		97,563,976		682,928,001
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		11,045,219		59,058,653
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		20,827,423		79,638,888
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		58,853,765
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		10,144,174
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		48,709,591
剰余金減少額又は欠損金増加額		13,947,554		-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		658,239		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		13,289,315		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		79,638,888		603,084,225

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

区分	第13期	
	自 平成24年 7月18日	至 平成25年 7月16日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券・投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。	
2．外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。	
3．費用・収益の計上基準	（ 1 ）受取配当金の計上基準 受取配当金は、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 （ 2 ）有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。	
4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。	
5．その他	当計算期間は期末が休日のため平成24年 7月18日から平成25年 7月16日までとなっております。	

（ 貸借対照表に関する注記 ）

	第12期	第13期
	（ 平成24年 7月17日現在 ）	（ 平成25年 7月16日現在 ）
1．計算期間末日における受益権の総数	3,889,202,800口	3,877,798,372口
2．投資信託財産計算規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 79,638,888円	
3．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9795円 （ 1万口当たり純資産額 9,795円 ）	1口当たり純資産額 1.1555円 （ 1万口当たり純資産額 11,555円 ）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第12期</p> <p style="text-align: center;">自 平成23年 7月16日</p> <p style="text-align: center;">至 平成24年 7月17日</p>	<p style="text-align: center;">第13期</p> <p style="text-align: center;">自 平成24年 7月18日</p> <p style="text-align: center;">至 平成25年 7月16日</p>
<p>1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額</p> <p style="text-align: right;">2,066,378円</p> <p>2. 分配金の計算過程</p> <p>第12期計算期間末（平成24年7月17日）に収益調整金（387,590,875円）及び分配準備積立金（133,603,199円）を対象収益（521,194,074円）として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、分配を行わないことに決定しました。</p>	<p>1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額</p> <p style="text-align: right;">2,117,250円</p> <p>2. 分配金の計算過程</p> <p>第13期計算期間末（平成25年7月16日）に経費控除後の配当等収益（5,737,149円）、有価証券売買等損益（339,227,006円）、収益調整金（406,470,373円）及び分配準備積立金（113,991,204円）を対象収益（865,425,732円）として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、分配を行わないことに決定しました。</p>

（金融商品に関する注記）

	<p style="text-align: center;">第12期</p> <p style="text-align: center;">自 平成23年 7月16日</p> <p style="text-align: center;">至 平成24年 7月17日</p>	<p style="text-align: center;">第13期</p> <p style="text-align: center;">自 平成24年 7月18日</p> <p style="text-align: center;">至 平成25年 7月16日</p>
<p>1. 金融商品の状況に関する事項</p>	<p>（1）金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。</p> <p>（2）金融商品の内容およびその金融商品に係るリスク</p> <p style="text-align: center;">金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券関係）に記載しております。</p> <p style="text-align: center;">金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> <p>（3）金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>（1）金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>（2）金融商品の内容およびその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>（3）金融商品に係るリスク管理体制</p>

<p>2. 金融商品の時価等に関する事項</p>	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> <p>(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。</p> <p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額</p> <p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>(2) 時価の算定方法</p>	<p>同左</p> <p>(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p> <p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額</p> <p>同左</p> <p>(2) 時価の算定方法</p>
--------------------------	--	---

	<p>親投資信託受益証券・投資信託受益証券</p> <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	同左
--	---	----

（関連当事者との取引に関する注記）

第12期 （平成24年7月17日現在）	第13期 （平成25年7月16日現在）
該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

	第12期	第13期
	自 平成23年 7月16日 至 平成24年 7月17日	自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16日
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	3,681,552,511円	3,889,202,800円
期中追加設定元本額	686,143,489円	619,762,253円
期中解約元本額	478,493,200円	631,166,681円

（有価証券関係）

第12期（自平成23年 7月16日 至平成24年 7月17日）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	14,682,646
親投資信託受益証券	31,031,529
合計	45,714,175

第13期（自平成24年 7月18日 至平成25年 7月16日）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	15,919,486
親投資信託受益証券	557,212,562
合計	541,293,076

（デリバティブ取引等関係）

該当事項はございません。

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

（ ）株式

該当事項はございません。

() 株式以外の有価証券
次表の通りです。

平成25年7月16日現在

種類	銘柄	券面総額(口)	評価金額(円)	備考
投資信託受益証券	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	33,482.000	131,744,531	-
合計		33,482.000	131,744,531	-

平成25年7月16日現在

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	損保ジャパン日本株マザーファンド	331,559,770	438,322,015	-
	損保ジャパン-T C W外国株式 マザーファンド	319,917,649	373,663,814	-
	損保ジャパン-D I A M日本株 アクティブ・マザーファンド	358,226,336	429,334,263	-
	損保ジャパン日本債券マザー ファンド	2,018,949,261	2,543,270,384	-
	損保ジャパン外国債券(為替 ヘッジなし)マザーファンド	384,683,937	489,087,157	-
合計		-	4,273,677,633	-

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

【ハッピーエイジング60】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (平成24年7月17日現在)	第13期 (平成25年7月16日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	58,079,534	56,923,916
親投資信託受益証券	2,389,151,850	2,658,930,662
流動資産合計	2,447,231,384	2,715,854,578
資産合計	2,447,231,384	2,715,854,578
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,327,614	7,172,185
未払受託者報酬	624,690	686,796
未払委託者報酬	11,122,401	12,227,760
その他未払費用	54,927	60,391
流動負債合計	13,129,632	20,147,132
負債合計	13,129,632	20,147,132
純資産の部		
元本等		
元本	2,251,254,264	2,347,072,851
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	182,847,488	348,634,595
純資産合計	2,434,101,752	2,695,707,446
負債純資産合計	2,447,231,384	2,715,854,578

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自	平成23年7月16日 至 平成24年7月17日	自	平成24年7月18日 至 平成25年7月16日
営業収益				
受取利息		26,660		26,989
有価証券売買等損益		40,019,078		181,078,812
その他収益		424		-
営業収益合計		40,046,162		181,105,801
営業費用				
受託者報酬		1,212,669		1,346,951
委託者報酬		21,591,429		23,981,719
その他費用		106,619		118,439
営業費用合計		22,910,717		25,447,109
営業利益		17,135,445		155,658,692
経常利益		17,135,445		155,658,692
当期純利益		17,135,445		155,658,692
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		149,230		16,599,225
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		149,989,977		182,847,488
剰余金増加額又は欠損金減少額		29,215,633		58,894,430
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		29,215,633		58,894,430
剰余金減少額又は欠損金増加額		13,642,797		32,166,790
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		13,642,797		32,166,790
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		182,847,488		348,634,595

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第13期	
	自 平成24年7月18日	至 平成25年7月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。	
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。	
3. その他	当計算期間は期末が休日のため平成24年7月18日から平成25年7月16日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

	第12期	第13期
	(平成24年7月17日現在)	(平成25年7月16日現在)
1. 計算期間末における受益権の総数	2,251,254,264口	2,347,072,851口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 1.0812円 (1万口当たり純資産額 10,812円)	1口当たり純資産額 1.1485円 (1万口当たり純資産額 11,485円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期	第13期
自 平成23年7月16日 至 平成24年7月17日	自 平成24年7月18日 至 平成25年7月16日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 531,840円	1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 548,585円
2. 分配金の計算過程 第12期計算期間末(平成24年7月17日)に経費控除後の配当等収益(11,046円)、有価証券売買等損益(17,273,629円)、収益調整金(136,646,480円)及び分配準備積立金(28,916,333円)を対象収益(182,847,488円)として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、分配を行わないことに決定しました。	2. 分配金の計算過程 第13期計算期間末(平成25年7月16日)に経費控除後の配当等収益(21,267円)、有価証券売買等損益(139,038,200円)、収益調整金(170,166,929円)及び分配準備積立金(39,408,199円)を対象収益(348,634,595円)として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、分配を行わないことに決定しました。

(金融商品に関する注記)

	第12期 自 平成23年 7月16日 至 平成24年 7月17日	第13期 自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16日
1. 金融商品の状況に関する事項	<p>(1) 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。</p> <p>(2) 金融商品の内容およびその金融商品に係るリスク 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券関係）に記載しております。</p> <p>金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> <p>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p>	<p>(1) 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>(2) 金融商品の内容およびその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

<p>2. 金融商品の時価等に関する事項</p>	<p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> <p>(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。</p> <p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額</p> <p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>(2) 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p> <p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額</p> <p>同左</p> <p>(2) 時価の算定方法</p> <p>同左</p>
--------------------------	--	---

（関連当事者との取引に関する注記）

第12期 （平成24年7月17日現在）	第13期 （平成25年7月16日現在）
該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

	第12期	第13期
	自 平成23年7月16日 至 平成24年7月17日	自 平成24年7月18日 至 平成25年7月16日
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	2,034,587,585円	2,251,254,264円
期中追加設定元本額	406,833,203円	479,744,662円
期中解約元本額	190,166,524円	383,926,075円

（有価証券関係）

第12期（自平成23年7月16日 至平成24年7月17日）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	42,503,395
合計	42,503,395

第13期（自平成24年7月18日 至平成25年7月16日）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	136,559,981
合計	136,559,981

（デリバティブ取引等関係）

該当事項はございません。

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

（ ）株式

該当事項はございません。

() 株式以外の有価証券
次表の通りです。

平成25年7月16日現在

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	損保ジャパン日本株マザーファンド	64,217,108	84,895,016	-
	損保ジャパン-T C W外国株式マザーファンド	94,056,597	109,858,105	-
	損保ジャパン-D I A M日本株アクティブ・マザーファンド	68,453,528	82,041,553	-
	損保ジャパン日本債券マザーファンド	1,760,197,536	2,217,320,836	-
	損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	129,632,808	164,815,152	-
合計		-	2,658,930,662	-

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

< 参考 >

「ハッピーエイジング20」「ハッピーエイジング30」「ハッピーエイジング40」「ハッピーエイジング50」「ハッピーエイジング60」は「損保ジャパン日本株マザーファンド」「損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド」「損保ジャパン日本債券マザーファンド」「損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド」「損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券です。なお、同マザーファンドの状況は次のとおりです。

* なお、以下は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

損保ジャパン日本株マザーファンドの状況

(1) 貸借対照表

区分	(平成24年7月17日現在)	(平成25年7月16日現在)
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	392,956	348,942
コール・ローン	92,173,750	90,014,629
株式	6,089,474,600	9,469,921,100
未収入金	146,273,003	165,912,178
未収配当金	5,574,200	7,527,000
流動資産合計	6,333,888,509	9,733,723,849
資産合計	6,333,888,509	9,733,723,849
負債の部		
流動負債		
未払金	124,093,566	167,755,295
流動負債合計	124,093,566	167,755,295
負債合計	124,093,566	167,755,295
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	7,736,249,508	7,235,963,136
剰余金		
剰余金又は欠損金()	1,526,454,565	2,330,005,418
純資産合計	6,209,794,943	9,565,968,554
負債・純資産合計	6,333,888,509	9,733,723,849

「損保ジャパン日本株マザーファンド」は、平成10年7月31日に信託契約を締結し、平成25年7月5日に第15期決算を行いました。上の表は、平成24年7月17日及び平成25年7月16日現在における同マザーファンドの状況です。（同マザーファンドの計算期間は「ハッピーエイジング20」「ハッピーエイジング30」「ハッピーエイジング40」「ハッピーエイジング50」「ハッピーエイジング60」の計算期間とは異なります。）

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 原則として取引所における計算期間末日の最終相場で評価しております。計算期間末日に当該取引所の最終相場がない場合には当該取引所における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	(1) 受取配当金の計上基準 受取配当金は、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
3. その他	当計算期間は期末が休日のため平成24年 7月18日から平成25年 7月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	(平成24年 7月17日現在)	(平成25年 7月16日現在)
1. 計算期間末日における受益権の総数	7,736,249,508口	7,235,963,136口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 1,526,454,565円	
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.8027円 (1万口当たり純資産額 8,027円)	1口当たり純資産額 1.3220円 (1万口当たり純資産額 13,220円)

(金融商品に関する注記)

	自 平成23年 7月16日 至 平成24年 7月17日	自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16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 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	(1) 金融商品に対する取組方針 同左

(2) 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

金融商品の内容

当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券関係）に記載しております。

金融商品に係るリスク

当ファンドが実質的に保有している金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。

市場リスク

金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。

信用リスク

各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。

流動性リスク

必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。

また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。

(2) 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

同左

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

同左

<p>2. 金融商品の時価等に関する事項</p>	<p>(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。</p> <p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額</p> <p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>(2) 時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p> <p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額</p> <p>同左</p> <p>(2) 時価の算定方法</p> <p>同左</p>
--------------------------	---	---

(関連当事者との取引に関する注記)

(平成24年7月17日現在)	(平成25年7月16日現在)
該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

	自 平成23年 7月16日 至 平成24年 7月17日	自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16日
開示対象ファンドの期首における当該マ ザーファンドの元本額	6,969,686,276円	7,736,249,508円
同期中における追加設定元本額	1,607,450,981円	971,236,078円
同期中における解約元本額	840,887,749円	1,471,522,450円
同期末における元本の内訳*		
ファンド名		
損保ジャパン日本株オープン	606,304,072円	533,471,498円
損保ジャパン日本株ファンド	2,239,879,316円	2,351,315,335円
ハッピーエイジング20	1,304,399,597円	1,280,099,980円
ハッピーエイジング30	1,389,150,687円	1,316,803,475円
ハッピーエイジング40	1,419,895,900円	1,153,902,455円
ハッピーエイジング50	447,170,065円	331,559,770円
ハッピーエイジング60	89,816,104円	64,217,108円
損保ジャパン日本株オープン(D C年 金)	173,691,669円	161,753,229円
スター・マンスリープラス	65,942,098円	42,840,286円
(合計)	7,736,249,508円	7,235,963,136円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券関係）

（自平成23年 7月16日 至平成24年 7月17日）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
株式	329,787,566
合計	329,787,566

（自平成24年 7月18日 至平成25年 7月16日）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
株式	206,008,905
合計	206,008,905

（デリバティブ取引等関係）

該当事項はございません。

(3) 附属明細表

有価証券明細表

() 株式

次表の通りです。

平成25年7月16日現在

通貨種類	銘柄	株数	評価単価	評価金額	備考
日本・円	ホクト	11,700	1,789	20,931,300	-
	鹿島建設	141,000	391	55,131,000	-
	前田道路	22,000	1,736	38,192,000	-
	協和エクシオ	40,800	1,132	46,185,600	-
	新日鉄住金SOL	18,500	1,970	36,445,000	-
	サントリー食品インター	13,800	3,635	50,163,000	-
	日清オイリオグループ	45,000	364	16,380,000	-
	エディオン	42,700	629	26,858,300	-
	双日	224,700	179	40,221,300	-
	ナフコ	5,800	1,828	10,602,400	-
	グンゼ	121,000	250	30,250,000	-
	ドトール・日レスHD	16,900	1,617	27,327,300	-
	ココカラファイン	900	3,255	2,929,500	-
	王子ホールディングス	124,000	445	55,180,000	-
	日本製紙	48,200	1,505	72,541,000	-
	セントラル硝子	78,000	315	24,570,000	-
	東亜合成	140,000	426	59,640,000	-
	イビデン	15,800	1,648	26,038,400	-
	カネカ	83,000	696	57,768,000	-
	三井化学	211,000	243	51,273,000	-
	宇部興産	150,000	194	29,100,000	-
	三洋化成	29,000	635	18,415,000	-
	塩野義製薬	39,300	2,226	87,481,800	-
	ツムラ	32,500	2,886	93,795,000	-
	日医工	10,300	2,286	23,545,800	-
	テルモ	7,200	5,260	37,872,000	-
	みらかホールディングス	9,100	4,800	43,680,000	-
	東和薬品	5,500	4,200	23,100,000	-
	ビー・エム・エル	5,000	2,607	13,035,000	-
	もしもしホットライン	15,400	1,280	19,712,000	-
	コスモ石油	174,000	183	31,842,000	-
	出光興産	10,400	8,060	83,824,000	-
	JXホールディングス	234,600	503	118,003,800	-
	東海ゴム工業	29,600	933	27,616,800	-
	日本電気硝子	101,000	493	49,793,000	-
	新日鉄住金	500,000	300	150,000,000	-
	JFEホールディングス	152,200	2,542	386,892,400	-
	日新製鋼HD	75,200	851	63,995,200	-
	共英製鋼	17,500	1,601	28,017,500	-
	日本軽金属HD	275,100	132	36,313,200	-
	三井金属	219,000	229	50,151,000	-
	小松製作所	19,100	2,405	45,935,500	-
	住友重機械	210,000	463	97,230,000	-
	ミネベア	224,000	398	89,152,000	-
	日立	208,000	666	138,528,000	-
	三菱電機	242,000	1,092	264,264,000	-
	日本電産	31,100	7,260	225,786,000	-

	日本電気	102,000	231	23,562,000	-
	サンケン電気	71,000	460	32,660,000	-
	ミツミ電機	24,100	754	18,171,400	-
	ホシデン	27,300	571	15,588,300	-
	アルパイン	41,000	1,038	42,558,000	-
	デンソー	10,400	4,925	51,220,000	-
	コーセル	10,200	1,249	12,739,800	-
	日産自動車	74,100	1,115	82,621,500	-
	トヨタ自動車	52,200	6,460	337,212,000	-
	トピー工業	53,000	207	10,971,000	-
	ケーヒン	18,500	1,543	28,545,500	-
	アイシン精機	25,200	4,010	101,052,000	-
	本田技研	73,000	3,810	278,130,000	-
	エクセディ	16,700	2,696	45,023,200	-
	第一興商	14,100	2,890	40,749,000	-
	ネットワークシステムズ	18,300	819	14,987,700	-
	サイゼリヤ	28,900	1,351	39,043,900	-
	マクニカ	12,000	2,300	27,600,000	-
	キヤノン	81,000	3,460	280,260,000	-
	パラマウントベッドHD	11,700	3,200	37,440,000	-
	トッパン・フォームズ	33,300	828	27,572,400	-
	大日本印刷	95,000	949	90,155,000	-
	任天堂	7,500	12,720	95,400,000	-
	ニフコ	34,900	2,282	79,641,800	-
	長瀬産業	19,000	1,357	25,783,000	-
	三井物産	133,400	1,326	176,888,400	-
	東京エレクトロン	27,900	5,080	141,732,000	-
	日立ハイテクノロジーズ	20,800	2,320	48,256,000	-
	住友商事	221,500	1,314	291,051,000	-
	三菱商事	95,900	1,837	176,168,300	-
	阪和興業	63,000	408	25,704,000	-
	島忠	16,300	2,627	42,820,100	-
	ゼビオ	23,900	2,205	52,699,500	-
	ケーズホールディングス	29,100	3,625	105,487,500	-
	三菱UFJフィナンシャルG	496,100	662	328,418,200	-
	りそなホールディングス	171,900	508	87,325,200	-
	三井住友フィナンシャルG	51,700	4,800	248,160,000	-
	西日本シティ銀行	155,000	275	42,625,000	-
	千葉銀行	95,000	732	69,540,000	-
	横浜銀行	162,000	569	92,178,000	-
	群馬銀行	76,000	580	44,080,000	-
	八十二銀行	17,000	609	10,353,000	-
	みずほフィナンシャルG	1,398,900	219	306,359,100	-
	山口フィナンシャルG	54,000	980	52,920,000	-
	芙蓉総合リース	13,500	3,850	51,975,000	-
	北洋銀行	67,000	401	26,867,000	-
	野村ホールディングス	183,600	825	151,470,000	-
	MS&AD	82,300	2,863	235,624,900	-
	SONYFH	36,600	1,740	63,684,000	-
	第一生命	1,604	154,000	247,016,000	-
	東京海上HD	43,900	3,565	156,503,500	-
	T&Dホールディングス	34,500	1,430	49,335,000	-
	東日本旅客鉄道	27,900	8,410	234,639,000	-
	山九	118,000	390	46,020,000	-

	セイノーホールディングス	46,000	906	41,676,000	-
	日立物流	26,800	1,557	41,727,600	-
	日本電信電話	71,500	5,170	369,655,000	-
	KDDI	15,000	5,210	78,150,000	-
	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	405	156,300	63,301,500	-
	ゼンリン	19,000	1,190	22,610,000	-
	沖縄電力	7,100	3,920	27,832,000	-
	大阪瓦斯	125,000	429	53,625,000	-
	スクウェア・エニックス・HD	13,500	1,273	17,185,500	-
	ベネッセホールディングス	6,700	3,595	24,086,500	-
	ダイセキ	23,200	1,846	42,827,200	-
	ヤマダ電機	35,470	4,500	159,615,000	-
	ニトリ	6,850	8,370	57,334,500	-
	通貨計・円			9,469,921,100	-
	ファンド計			9,469,921,100	-

() 株式以外の有価証券

該当事項はございません。

損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンドの状況

(1) 貸借対照表

区分	(平成24年7月17日現在)	(平成25年7月16日現在)
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	63,265,278	31,727,975
株式	4,027,844,800	5,623,210,000
未収入金	-	24,764,438
未収配当金	3,676,500	3,503,750
流動資産合計	4,094,786,578	5,683,206,163
資産合計	4,094,786,578	5,683,206,163
負債の部		
流動負債		
未払金	-	24,647,754
流動負債合計	-	24,647,754
負債合計	-	24,647,754
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	5,551,814,412	4,721,505,160
剰余金		
剰余金又は欠損金()	1,457,027,834	937,053,249
純資産合計	4,094,786,578	5,658,558,409
負債・純資産合計	4,094,786,578	5,683,206,163

「損保ジャパン-D I A M日本株アクティブ・マザーファンド」は、平成12年7月31日に信託契約を締結し、平成25年7月16日に第13期決算を行いました。上の表は、平成24年7月17日及び平成25年7月16日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 原則として取引所における計算期間末日の最終相場で評価しております。計算期間末日に当該取引所の最終相場がない場合には当該取引所における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	(1) 受取配当金の計上基準 受取配当金は、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
3. その他	当計算期間は期末が休日のため平成24年 7月18日から平成25年 7月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	(平成24年 7月17日現在)	(平成25年 7月16日現在)
1. 計算期間末日における受益権の総数	5,551,814,412口	4,721,505,160口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 1,457,027,834円	
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.7376円 (1万口当たり純資産額 7,376円)	1口当たり純資産額 1.1985円 (1万口当たり純資産額 11,985円)

(金融商品に関する注記)

	自 平成23年 7月16日 至 平成24年 7月17日	自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16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 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	(1) 金融商品に対する取組方針 同左

(2) 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

金融商品の内容

当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券関係）に記載しております。

金融商品に係るリスク

当ファンドが実質的に保有している金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。

市場リスク

金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。

信用リスク

各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。

流動性リスク

必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。

また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。

(2) 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

同左

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

同左

<p>2. 金融商品の時価等に関する事項</p>	<p>(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。</p> <p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額</p> <p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>(2) 時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p> <p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額</p> <p>同左</p> <p>(2) 時価の算定方法</p> <p>同左</p>
--------------------------	---	---

(関連当事者との取引に関する注記)

(平成24年 7月17日現在)	(平成25年 7月16日現在)
該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

	自 平成23年 7月16日 至 平成24年 7月17日	自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16日
開示対象ファンドの期首における当該マ ザーファンドの元本額	4,942,415,197円	5,551,814,412円
同期中における追加設定元本額	1,033,792,427円	570,388,745円
同期中における解約元本額	424,393,212円	1,400,697,997円
同期末における元本の内訳*		
ファンド名		
損保ジャパン-D I A M日本株アクティ ブ・ファンド	451,131,150円	98,202,502円
ハッピーエイジング20	1,430,658,799円	1,431,909,389円
ハッピーエイジング30	1,523,653,769円	1,474,838,844円
ハッピーエイジング40	1,557,379,213円	1,289,874,561円
ハッピーエイジング50	490,481,160円	358,226,336円
ハッピーエイジング60	98,510,321円	68,453,528円
（合計）	5,551,814,412円	4,721,505,160円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券関係）

（自平成23年 7月16日 至平成24年 7月17日）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
株式	435,848,655
合計	435,848,655

（自平成24年 7月18日 至平成25年 7月16日）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
株式	1,534,327,921
合計	1,534,327,921

（デリバティブ取引等関係）

該当事項はございません。

(3) 附属明細表

有価証券明細表

() 株式

次表の通りです。

平成25年7月16日現在

通貨種類	銘柄	株数	評価単価	評価金額	備考
日本・円	石油資源開発	5,000	4,410	22,050,000	-
	明星工業	74,000	402	29,748,000	-
	大気社	5,600	2,517	14,095,200	-
	日本M&Aセンター	2,900	5,900	17,110,000	-
	日本ハム	10,000	1,636	16,360,000	-
	ぐるなび	20,900	1,173	24,515,700	-
	麒麟HD	29,000	1,639	47,531,000	-
	日本たばこ産業	26,900	3,675	98,857,500	-
	ウエルシアHD	11,800	5,390	63,602,000	-
	一建設	12,500	6,010	75,125,000	-
	シップヘルスケアHD	19,200	3,620	69,504,000	-
	信越化学	12,300	6,990	85,977,000	-
	三菱瓦斯化学	69,000	759	52,371,000	-
	ダイセル	63,000	896	56,448,000	-
	日本ゼオン	38,000	1,144	43,472,000	-
	アステラス製薬	10,600	5,740	60,844,000	-
	塩野義製薬	46,000	2,226	102,396,000	-
	科研製薬	14,000	1,543	21,602,000	-
	ロート製薬	20,000	1,413	28,260,000	-
	テルモ	7,900	5,260	41,554,000	-
	D I C	126,000	248	31,248,000	-
	パーク24	19,800	1,836	36,352,800	-
	ヤフー	1,144	53,000	60,632,000	-
	楽天	48,500	1,260	61,110,000	-
	住友ゴム	62,600	1,750	109,550,000	-
	新日鐵住金	157,000	300	47,100,000	-
	愛知製鋼	58,000	480	27,840,000	-
	D O W Aホールディングス	53,000	978	51,834,000	-
	古河スカイ	77,000	277	21,329,000	-
	住友電工	31,500	1,344	42,336,000	-
	三和ホールディングス	141,000	599	84,459,000	-
	日本発条	26,200	1,192	31,230,400	-
	瑞光	1,800	6,710	12,078,000	-
	クボタ	49,000	1,649	80,801,000	-
	荏原製作所	109,000	584	63,656,000	-
	タダノ	19,000	1,505	28,595,000	-
	セガサミーホールディングス	9,900	2,627	26,007,300	-
	T P R	8,100	1,707	13,826,700	-
	日立	159,000	666	105,894,000	-
	三菱電機	88,000	1,092	96,096,000	-
	日本電産	4,100	7,260	29,766,000	-
	オムロン	12,900	3,065	39,538,500	-
	サンケン電気	104,000	460	47,840,000	-
	日立国際電気	25,000	1,132	28,300,000	-
	ソニー	27,100	2,194	59,457,400	-
	堀場製作所	9,000	3,800	34,200,000	-
	デンソー	22,900	4,925	112,782,500	-

	イリソ電子工業	5,200	2,861	14,877,200	-
	ファナック	1,400	15,260	21,364,000	-
	エンプラス	11,600	7,910	91,756,000	-
	日東電工	10,800	5,990	64,692,000	-
	川崎重工業	97,000	345	33,465,000	-
	トヨタ自動車	61,100	6,460	394,706,000	-
	日野自動車	76,000	1,682	127,832,000	-
	マツダ	209,000	442	92,378,000	-
	本田技研	14,600	3,810	55,626,000	-
	富士重工業	26,000	2,741	71,266,000	-
	良品計画	1,600	8,770	14,032,000	-
	黒田電気	23,100	1,393	32,178,300	-
	ユナイテッドアローズ	13,600	4,560	62,016,000	-
	タムロン	12,600	2,155	27,153,000	-
	朝日インテック	11,500	5,310	61,065,000	-
	キヤノン	13,400	3,460	46,364,000	-
	丸紅	136,000	719	97,784,000	-
	三菱商事	25,000	1,837	45,925,000	-
	ワキタ	10,000	1,137	11,370,000	-
	コメリ	17,700	2,694	47,683,800	-
	エイチ・ツー・オーリテイリング	31,000	970	30,070,000	-
	イズミ	18,000	3,050	54,900,000	-
	三菱UFJフィナンシャルG	407,000	662	269,434,000	-
	三井住友フィナンシャルG	51,400	4,800	246,720,000	-
	セブン銀行	168,500	380	64,030,000	-
	日立キャピタル	11,700	2,427	28,395,900	-
	オリックス	60,700	1,492	90,564,400	-
	野村ホールディングス	82,800	825	68,310,000	-
	岡三証券グループ	25,000	956	23,900,000	-
	東海東京HD	18,900	843	15,932,700	-
	東京海上HD	41,500	3,565	147,947,500	-
	三井不動産	63,000	3,220	202,860,000	-
	東日本旅客鉄道	15,600	8,410	131,196,000	-
	日本テレビHLD S	17,800	1,824	32,467,200	-
	KDDI	20,900	5,210	108,889,000	-
	エイチ・アイ・エス	15,900	5,120	81,408,000	-
	SCSK	29,000	2,055	59,595,000	-
	ニトリ	5,200	8,370	43,524,000	-
	ソフトバンク	26,100	5,910	154,251,000	-
	通貨計・円			5,623,210,000	-
	ファンド計			5,623,210,000	-

株式以外の有価証券
該当事項はございません。

[次へ](#)

損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンドの状況

(1) 貸借対照表

区分	(平成24年7月17日現在)	(平成25年7月16日現在)
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	225,724,731	150,917,358
コール・ローン	114,538,787	63,393,775
株式	5,131,167,027	7,601,943,680
投資証券	167,258,504	159,566,362
未収配当金	4,271,631	7,484,720
流動資産合計	5,642,960,680	7,983,305,895
資産合計	5,642,960,680	7,983,305,895
負債の部		
流動負債		
該当事項なし	-	-
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	7,747,429,602	6,835,140,048
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,104,468,922	1,148,165,847
純資産合計	5,642,960,680	7,983,305,895
負債・純資産合計	5,642,960,680	7,983,305,895

「損保ジャパン-T C W外国株式マザーファンド」は、平成11年5月31日に信託契約を締結し、平成25年7月16日に第15期決算を行いました。上の表は、平成24年7月17日及び平成25年7月16日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式・投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>原則として取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券等の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。計算期間末日に当該取引所の最終相場がない場合には当該取引所における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>(1) 受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は、株式・投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</p> <p>但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>
5. その他	<p>当計算期間は期末が休日のため平成24年 7月18日から平成25年 7月16日までとなっております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	（平成24年7月17日現在）	（平成25年7月16日現在）
1．計算期間末日における受益権の総数	7,747,429,602口	6,835,140,048口
2．投資信託財産計算規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 2,104,468,922円	
3．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.7284円 (1万口当たり純資産額 7,284円)	1口当たり純資産額 1.1680円 (1万口当たり純資産額 11,680円)

（金融商品に関する注記）

	自 平成23年7月16日 至 平成24年7月17日	自 平成24年7月18日 至 平成25年7月16日
1．金融商品の状況に関する事項	<p>（1）金融商品に対する取組方針 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。</p> <p>（2）金融商品の内容およびその金融商品に係るリスク 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券関係）に記載しております。</p> <p>金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> <p>（3）金融商品に係るリスク管理体制 委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p>	<p>（1）金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>（2）金融商品の内容およびその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>（3）金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

<p>2. 金融商品の時価等に関する事項</p>	<p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> <p>(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。</p> <p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額</p> <p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>(2) 時価の算定方法</p> <p>株式・投資証券</p> <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p> <p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額</p> <p>同左</p> <p>(2) 時価の算定方法</p> <p>同左</p>
--------------------------	---	---

（関連当事者との取引に関する注記）

（平成24年7月17日現在）	（平成25年7月16日現在）
該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

	自 平成23年7月16日 至 平成24年7月17日	自 平成24年7月18日 至 平成25年7月16日
開示対象ファンドの期首における当該マ ザーファンドの元本額	7,118,752,224円	7,747,429,602円
同期中における追加設定元本額	1,825,534,647円	506,775,984円
同期中における解約元本額	1,196,857,269円	1,419,065,538円
同期末における元本の内訳*		
ファンド名		
損保ジャパン-T C W外国株式ファンドA コース(為替ヘッジあり)	1,219,631,021円	918,484,618円
損保ジャパン-T C W外国株式ファンドB コース(為替ヘッジなし)	1,211,565,962円	1,162,596,157円
ハッピーエイジング20	1,849,184,725円	1,772,052,512円
ハッピーエイジング30	1,480,844,485円	1,373,555,302円
ハッピーエイジング40	1,432,070,233円	1,194,477,213円
ハッピーエイジング50	420,432,076円	319,917,649円
ハッピーエイジング60	133,701,100円	94,056,597円
（合計）	7,747,429,602円	6,835,140,048円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券関係)

(自平成23年7月16日 至平成24年7月17日)

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)
株式	101,515,938
投資証券	43,840,877
合計	145,356,815

(自平成24年7月18日 至平成25年7月16日)

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)
株式	1,333,968,211
投資証券	8,279,539
合計	1,342,247,750

(デリバティブ取引等関係)

該当事項はございません。

(3) 附属明細表

有価証券明細表

() 株式

次表の通りです。

平成25年7月16日現在

種類	銘柄	株数	評価単価	評価金額	備考
アメリカ・ドル	AMERICAN ELECTRIC POWER	7,265	47.50	345,087.50	-
	APPLIED MATERIALS INC	13,190	16.47	217,239.30	-
	AMAZON.COM INC	5,210	306.57	1,597,229.70	-
	TIME WARNER INC	4,295	61.42	263,798.90	-
	BAKER HUGHES INC	8,760	48.91	428,451.60	-
	CITIGROUP INC	11,375	51.81	589,338.75	-
	CHEVRON CORP	4,485	124.68	559,189.80	-
	CISCO SYSTEMS INC	17,870	25.93	463,369.10	-
	GENERAL ELECTRIC CO.	24,400	23.63	576,572.00	-
	HOME DEPOT INC	6,785	80.40	545,514.00	-
	HONEYWELL INTERNATIONAL I	4,210	82.30	346,483.00	-
	INTEL CORP	13,245	23.94	317,085.30	-
	JOHNSON & JOHNSON	3,590	90.40	324,536.00	-
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2,910	29.28	85,204.80	-
	PEPSICO INC	4,230	84.72	358,365.60	-
	PFIZER INC	22,420	28.79	645,471.80	-
	SCHWAB(CHARLES)CORP	28,485	21.71	618,409.35	-
	SCHLUMBERGER LTD	13,170	77.02	1,014,353.40	-
	AMERICAN EXPRESS COMPANY	6,810	77.85	530,158.50	-
	COSTCO WHOLESALE CORP	6,980	115.89	808,912.20	-
JP MORGAN CHASE & CO	11,610	54.89	637,272.90	-	
COMERICA INC	1,455	41.56	60,469.80	-	
AT&T INC	8,825	35.55	313,728.75	-	

	CORNING INC	11,935	15.09	180,099.15	-
	GAP INC	12,285	44.87	551,227.95	-
	MEDTRONIC INC	5,910	53.69	317,307.90	-
	QUALCOMM INC	25,310	61.28	1,550,996.80	-
	BROADCOM CORP-CL A	2,080	34.45	71,656.00	-
	PRAXAIR INC	8,015	116.47	933,507.05	-
	TYCO INTERNATIONAL LTD	10,315	35.44	365,563.60	-
	TERADYNE INC	3,565	18.06	64,383.90	-
	NABORS INDUSTRIES INC	15,285	14.88	227,440.80	-
	HARTFORD FIN SVCS GRP	7,410	32.00	237,120.00	-
	WELLPOINT INC	2,225	85.68	190,638.00	-
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	9,355	30.18	282,333.90	-
	T ROWE PRICE GROUP INC	533	77.95	41,547.35	-
	SPX CORP	1,155	73.99	85,458.45	-
	ALLERGAN INC	9,915	92.37	915,848.55	-
	DOVER CORP	1,210	80.71	97,659.10	-
	THE TRAVELERS COMPANIES INC.	5,830	83.28	485,522.40	-
	GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	5,715	12.82	73,266.30	-
	STARBUCKS CORP	21,580	69.66	1,503,262.80	-
	GOOGLE INC-CL A	1,735	924.69	1,604,337.15	-
	LENNAR CORP-CL A	11,825	35.55	420,378.75	-
	ACE LTD	14,932	93.73	1,399,576.36	-
	VALERO ENERGY CORP	8,025	35.38	283,924.50	-
	COMCAST CORP-CL A	14,635	44.15	646,135.25	-
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC.	2,670	88.24	235,600.80	-
	SLM CORP	15,165	23.54	356,984.10	-
	CELGENE CORP	5,395	134.94	728,001.30	-
	TOLL BROTHERS INC	3,430	33.84	116,071.20	-
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,845	86.33	504,598.85	-
	ENSCO INTERNATIONAL INC	7,880	59.88	471,854.40	-
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	2,360	51.40	121,304.00	-
	PARTNERRE LTD	685	93.23	63,862.55	-
	EXPEDIA INC	810	64.34	52,115.40	-
	CERNER CORP	24,614	49.54	1,219,377.56	-
	CIGNA CORP	4,765	75.89	361,615.85	-
	MONSTER BEVERAGE CORP	654	60.80	39,763.20	-
	AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	3,005	19.17	57,605.85	-
	WESTERN DIGITAL CORP	7,880	68.24	537,731.20	-
	CARMAX INC	557	47.73	26,585.61	-
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	2,253	26.90	60,605.70	-
	TE CONNECTIVITY LTD	8,520	47.28	402,825.60	-
	OCEANEERING INTL INC	15,085	79.28	1,195,938.80	-
	CUMMINS INC	370	117.29	43,397.30	-
	VISA INC-CLASS A SHARES	7,060	190.25	1,343,165.00	-
	PRECISION CASTPARTS CORP	5,515	234.41	1,292,771.15	-
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	7,330	72.97	534,870.10	-
	INVESCO LTD	3,440	32.13	110,527.20	-
	STATE STREET CORP	9,080	69.25	628,790.00	-
	ACTIVISION BLIZZARD INC	2,085	15.13	31,546.05	-
	WYNN RESORTS LTD	195	131.99	25,738.05	-
	GAMESTOP CORP-CLASS A	2,145	43.48	93,264.60	-
	ROCKWELL AUTOMATION INC	245	91.35	22,380.75	-
	SEAGATE TECHNOLOGY	2,905	46.71	135,692.55	-
	BROCADE COMMUNICATIONS SYS	13,830	6.36	87,958.80	-

	DENBURY RESOURCES INC	3,580	17.74	63,509.20	-
	VULCAN MATERIALS CO	945	50.26	47,495.70	-
	ANSYS INC	543	79.13	42,967.59	-
	ARUBA NETWORKS INC	5,377	17.59	94,581.43	-
	CORE LABORATORIES N.V.	227	152.93	34,715.11	-
	KENNAMETAL INC	2,255	40.30	90,876.50	-
	WABTEC CORP	448	55.90	25,043.20	-
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	330	190.05	62,716.50	-
	INTUITIVE SURGICAL INC	859	426.78	366,604.02	-
	MYLAN INC	13,080	32.13	420,260.40	-
	SALESFORCE.COM INC	32,665	41.98	1,371,276.70	-
	VMWARE INC-CLASS A	9,390	71.01	666,783.90	-
	PRICELINE.COM INC	1,110	911.66	1,011,942.60	-
	ARM HOLDINGS PLC-SPONS ADR	23,141	41.40	958,037.40	-
	EQUINIX INC	5,520	200.64	1,107,532.80	-
	IRONWOOD PHARMACEUTICALS INC	3,055	11.33	34,613.15	-
	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	6,900	73.88	509,772.00	-
	ATHENAHEALTH INC	6,259	114.29	715,341.11	-
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	623	42.81	26,670.63	-
	HARMAN INTERNATIONAL	1,668	55.32	92,273.76	-
	SILVER WHEATON CORP	25,285	20.56	519,859.60	-
	ALERE INC	1,850	27.21	50,338.50	-
	BORGWARNER INC	298	88.81	26,465.38	-
	BJ'S RESTAURANTS INC	1,857	39.68	73,685.76	-
	CHART INDUSTRIES INC	244	101.71	24,817.24	-
	DEXCOM INC	1,021	23.57	24,064.97	-
	FLUIDIGM CORP	571	17.00	9,707.00	-
	FORTINET INC	1,594	20.00	31,880.00	-
	HEARTWARE INTERNATIONAL INC	79	96.01	7,584.79	-
	MICROSTRATEGY INC-CL A	401	96.59	38,732.59	-
	STEVEN MADDEN LTD	643	50.05	32,182.15	-
	ULTIMATE SOFTWARE GROUP INC	416	131.30	54,620.80	-
	FARO TECHNOLOGIES INC	854	38.57	32,938.78	-
	DICKS SPORTING GOODS INC	805	50.97	41,030.85	-
	ENDOLOGIX INC	1,743	15.35	26,755.05	-
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	605	79.95	48,369.75	-
	COGNEX CORP	656	52.00	34,112.00	-
	CORNERSTONE ONDEMAND INC	737	45.27	33,363.99	-
	ARCOS DORADOS HOLDINGS INC-A	4,935	11.89	58,677.15	-
	GREENHILL & CO INC	475	47.70	22,657.50	-
	PRICESMART INC	716	88.52	63,380.32	-
	LINKEDIN CORP - A	6,123	198.80	1,217,252.40	-
	IPG PHOTONICS CORP	601	58.34	35,062.34	-
	FASTENAL CO	21,180	46.98	995,036.40	-
	GUIDEWIRE SOFTWARE INC	186	45.47	8,457.42	-
	EXAR CORP	532	12.48	6,639.36	-
	MARKETAXESS HOLDINGS INC	503	50.70	25,502.10	-
	SANCHEZ ENERGY CORP	445	23.71	10,550.95	-
	THERAVANCE INC	400	41.54	16,616.00	-
	GEOSPACE TECHNOLOGIES CORP	415	77.44	32,137.60	-
	MSC INDUSTRIAL DIRECT CO-A	391	79.19	30,963.29	-
	FORUM ENERGY TECHNOLOGIES IN	819	30.04	24,602.76	-
	ILLUMINA INC	240	75.64	18,153.60	-
	MRC GLOBAL INC	732	28.54	20,891.28	-

	SPLUNK INC	14,722	50.45	742,724.90	-
	SERVICENOW INC	630	45.26	28,513.80	-
	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	15,630	62.88	982,814.40	-
	FIVE BELOW	795	39.36	31,291.20	-
	PALO ALTO NETWORKS INC	1,600	46.81	74,896.00	-
	AES CORP	24,600	12.87	316,602.00	-
	DANA HOLDING CORP	25,715	20.62	530,243.30	-
	ENERGIZER HOLDINGS INC	4,000	106.79	427,160.00	-
	HOLOGIC INC	18,550	19.91	369,330.50	-
	KONINKLIJKE PHILIPS N.V.	17,018	29.56	503,052.08	-
	LAM RESEARCH CORP	5,275	49.61	261,692.75	-
	MEADWESTVACO CORP	1,980	36.07	71,418.60	-
	TEREX CORP	14,480	28.05	406,164.00	-
	ROPER INDUSTRIES INC	197	130.45	25,698.65	-
	GULFPORT ENERGY CORP	301	48.82	14,694.82	-
	ADT Corp/THE-WHEN ISSUE	4,147	43.86	181,887.42	-
	PENTAIR	3,389	60.88	206,322.32	-
	QUALYS INC	1,290	16.17	20,859.30	-
	AMETEK INC	409	45.41	18,572.69	-
	CEPHEID INC	384	34.64	13,301.76	-
	DSW INC-CLASS A	490	78.47	38,450.30	-
	STAGE STORES INC	1,296	24.66	31,959.36	-
	UNDER ARMOUR INC-CLASS A	742	60.86	45,158.12	-
	ANNIES INC	376	45.52	17,115.52	-
	FRESH MARKET INC/THE	1,329	54.01	71,779.29	-
	HAIN CELESTIAL GROUP INC	1,140	71.77	81,817.80	-
	HMS HOLDINGS CORP	1,225	25.82	31,629.50	-
	RUCKUS WIRELESS INC	1,881	13.47	25,337.07	-
	WOODWARD INC	781	41.73	32,591.13	-
	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,934	64.02	828,034.68	-
	B/E AEROSPACE INC	719	68.48	49,237.12	-
	TIFFANY & CO	10,120	79.78	807,373.60	-
	ARIAD PHARMACEUTICALS INC	1,599	20.98	33,547.02	-
	SEALED AIR CORP	13,250	27.61	365,832.50	-
	WORKDAY INC-CLASS A	717	67.71	48,548.07	-
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	398	84.44	33,607.12	-
	ANN INC	1,255	33.89	42,531.95	-
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,605	54.53	87,520.65	-
	ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	1,050	44.15	46,357.50	-
	ATWOOD OCEANICS INC	675	56.05	37,833.75	-
	AVISTA CORP	1,515	28.60	43,329.00	-
	BEAZER HOMES USA INC	1,690	18.44	31,163.60	-
	CAMPBELL SOUP CO	2,020	46.22	93,364.40	-
	CELANESE CORP-SERIES A	1,020	47.53	48,480.60	-
	CHILDRENS PLACE	720	57.06	41,083.20	-
	COMMERCIAL METALS CO	5,160	14.96	77,193.60	-
	CYTEC INDUSTRIES INC	1,105	77.67	85,825.35	-
	FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	2,670	15.26	40,744.20	-
	HAWAIIAN ELECTRIC INDS	1,930	26.67	51,473.10	-
	INTL SPEEDWAY CORP-CL A	2,315	34.55	79,983.25	-
	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,545	57.85	89,378.25	-
	JARDEN CORP	860	45.85	39,431.00	-
	JONES LANG LASALLE INC	745	94.52	70,417.40	-
	KB HOME	3,170	18.97	60,134.90	-

	KEYCORP	10,410	11.76	122,421.60	-
	KKR FINANCIAL HOLDINGS LLC	4,237	10.97	46,479.89	-
	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	1,980	41.58	82,328.40	-
	MURPHY OIL CORP	1,235	64.88	80,126.80	-
	NEWPARK RESOURCES INC	4,745	12.14	57,604.30	-
	PACKAGING CORP OF AMERICA	520	52.31	27,201.20	-
	REINSURANCE GROUP OF AMERICA	795	72.59	57,709.05	-
	SYNOVUS FINANCIAL CORP	15,280	3.05	46,604.00	-
	TENNECO INC	1,195	49.76	59,463.20	-
	TESORO CORP	555	54.14	30,047.70	-
	US AIRWAYS GROUP INC	2,890	17.76	51,326.40	-
	WINDSTREAM CORP	5,105	8.02	40,942.10	-
	WORTHINGTON INDUSTRIES	2,335	35.10	81,958.50	-
	ZOETIS INC	962	31.58	30,379.96	-
	POPULAR INC	1,440	32.19	46,353.60	-
	CELLEX THERAPEUTICS INC	895	21.10	18,884.50	-
	ARTISAN PARTNERS ASSET MANAG	389	52.51	20,426.39	-
	HEICO CORP	511	55.65	28,437.15	-
	HYPERION THERAPEUTICS INC	344	26.16	8,999.04	-
	AEROPOSTALE INC	3,300	14.95	49,335.00	-
	ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	390	99.46	38,789.40	-
	DORMAN PRODUCTS INC	553	46.49	25,708.97	-
	DXP ENTERPRISES INC	392	69.03	27,059.76	-
	H&E EQUIPMENT SERVICES INC	1,038	23.53	24,424.14	-
	IDEX CORP	277	58.03	16,074.31	-
	INDEPENDENT BANK GROUP INC	758	31.66	23,998.28	-
	MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	735	50.45	37,080.75	-
	NVIDIA CORP	2,259	14.61	33,003.99	-
	TESLA MOTORS INC	275	127.28	35,002.00	-
	FIRST NIAGARA FINANCIAL GRP	2,765	9.97	27,567.05	-
	ARCTIC CAT INC	484	50.13	24,262.92	-
	BOSTON BEER COMPANY INC-A	154	180.72	27,830.88	-
	EPAM SYSTEMS INC	665	29.10	19,351.50	-
	NETSUITE INC	275	98.18	26,999.50	-
	SINCLAIR BROADCAST GROUP -A	796	31.30	24,914.80	-
	SPS COMMERCE INC	426	57.84	24,639.84	-
	WISDOMTREE INVESTMENTS INC	1,807	12.58	22,732.06	-
	LIFEWAY FOODS INC	545	17.79	9,695.55	-
	FEI COMPANY	334	76.57	25,574.38	-
	PLY GEM HOLDINGS INC	962	20.28	19,509.36	-
	ORIENT EXPRESS HOTELS LTD -A	1,276	12.52	15,975.52	-
	FIFTH & PACIFIC COS INC	1,429	23.90	34,153.10	-
	DRIL-QUIP INC	268	94.68	25,374.24	-
アメリカ・ドル 通貨計				56,930,336.42	-
				(5,694,172,249円)	-
イギリス・ポンド	KINGFISHER PLC	31,730	3.79	120,256.70	-
	VODAFONE GROUP PLC	201,890	1.96	394,694.95	-
	DIAGEO PLC	21,420	20.17	432,041.40	-
	GLAXOSMITHKLINE PLC	15,670	17.45	273,363.15	-
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	7,380	4.69	34,612.20	-
	TESCO PLC	99,810	3.53	352,429.11	-
	RIO TINTO PLC	12,340	28.07	346,322.10	-
	BARCLAYS PLC	64,830	3.10	200,778.51	-
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	22,190	22.17	491,952.30	-

	STANDARD CHARTERED PLC	25,710	15.47	397,605.15	-
	WM MORRISON SUPERMARKETS	44,970	2.84	127,894.68	-
	BURBERRY GROUP PLC	9,210	15.37	141,557.70	-
	GLENCORE XSTRATA PLC	48,290	2.62	126,423.22	-
イギリス・ポンド 通貨計				3,439,931.17	-
				(519,532,805円)	-
オーストラリア・ドル	NATIONAL AUSTRALIA BANK	6,790	30.03	203,903.70	-
	BHP BILLITON LTD	22,120	33.25	735,490.00	-
	WESFARMERS LIMITED	5,520	39.04	215,500.80	-
	AUST AND NZ BANKING GROUP	22,020	28.95	637,479.00	-
オーストラリア・ドル 通貨計				1,792,373.50	-
				(163,572,006円)	-
シンガポール・ドル	DBS GROUP HOLDINGS LTD	2,000	16.49	32,980.00	-
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	31,000	21.08	653,480.00	-
シンガポール・ドル 通貨計				686,460.00	-
				(54,415,684円)	-
スイス・フラン	NESTLE SA-REGISTERED-B	1,060	63.95	67,787.00	-
	NOVARTIS AG-REG SHS	7,470	69.60	519,912.00	-
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3,430	242.20	830,746.00	-
	ABB LTD	25,850	21.39	552,931.50	-
スイス・フラン 通貨計				1,971,376.50	-
				(207,881,651円)	-
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	18	43,480.00	782,640.00	-
デンマーク・クローネ 通貨計				782,640.00	-
				(13,704,026円)	-
ノルウェー・クローネ	TELENOR ASA	4,090	124.70	510,023.00	-
	STATOIL ASA	8,630	131.20	1,132,256.00	-
ノルウェー・クローネ 通貨計				1,642,279.00	-
				(27,048,335円)	-
ユーロ	ALSTOM	5,800	24.76	143,579.00	-
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE	1,360	70.86	96,369.60	-
	AXA	17,830	16.14	287,687.05	-
	DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	9,360	51.40	481,104.00	-
	ENI SPA	18,730	16.24	304,175.20	-
	ING GROEP N.V.	43,700	7.38	322,549.70	-
	SAP AG	7,700	57.80	445,060.00	-
	DEUTSCHE BANK AG	1,390	33.84	47,037.60	-
	TOTAL SA	13,890	39.00	541,640.55	-
	ALLIANZ AG-REG	2,860	117.10	334,906.00	-
	BAYER AG	2,240	84.67	189,660.80	-
	SIEMENS AG	6,010	79.86	479,958.60	-
	ORANGE S.A.	16,480	7.40	121,952.00	-
	MUENCHENER RUECKVER AG-RE	940	145.65	136,911.00	-
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFEN	3,520	41.84	147,276.80	-
	Sanofi	6,720	80.20	538,944.00	-
	Anheuser-Busch InBev	1,610	70.41	113,360.10	-
	BNP PARIBAS	9,880	44.43	438,968.40	-
	GDF SUEZ	15,890	15.40	244,626.55	-
	VOLKSWAGEN AG-PFD	1,130	167.90	189,727.00	-
	DANONE	1,400	57.36	80,304.00	-
	LINDE AG	1,740	146.70	255,258.00	-
	KONINKLIJKE DSM NV	1,850	54.18	100,233.00	-
	MICHELIN (CGDE)	1,160	72.49	84,088.40	-
	OSRAM LICHT AG	601	27.25	16,377.25	-

ユーロ 通貨計				6,141,754.60	-
				(802,051,733円)	-
香港・ドル	CHEUNG KONG	28,000	106.70	2,987,600.00	-
	HUTCHISON WHAMPOA	37,000	84.80	3,137,600.00	-
	HANG SENG BANK LTD	12,700	116.80	1,483,360.00	-
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	11,000	94.45	1,038,950.00	-
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	30,500	20.60	628,300.00	-
香港・ドル 通貨計				9,275,810.00	-
				(119,565,191円)	-
ファンド計				(7,601,943,680円)	-

() 株式以外の有価証券
次表の通りです。

平成25年7月16日現在

種類	通貨	銘柄	口数	評価単価	評価金額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN TOWER CORP	18,725	76.16	1,426,096.00	-
		GEO GROUP INC/THE	755	34.96	26,394.80	-
		HEALTH CARE REIT INC	500	67.57	33,785.00	-
		HOME PROPERTIES INC	625	65.61	41,006.25	-
		KIMCO REALTY CORP	3,025	22.50	68,062.50	-
	小計(アメリカ・ドル)	銘柄数	:		1,595,344.55	-
		5			(159,566,362円)	-
	ファンド計	銘柄数	:		(159,566,362円)	-
		5				-

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額です。

(注2) 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率(%)	合計額に対する比率(%)
アメリカ・ドル	株式 228銘柄	71.33	73.36
アメリカ・ドル	投資証券 5銘柄	2.00	2.06
イギリス・ポンド	株式 13銘柄	6.51	6.69
オーストラリア・ドル	株式 4銘柄	2.05	2.11
シンガポール・ドル	株式 2銘柄	0.68	0.70
スイス・フラン	株式 4銘柄	2.60	2.68
デンマーク・クローネ	株式 1銘柄	0.17	0.18
ノルウェー・クローネ	株式 2銘柄	0.34	0.35
ユーロ	株式 25銘柄	10.05	10.33
香港・ドル	株式 5銘柄	1.50	1.54
合計	289銘柄	97.22	100.00

組入時価比率は通貨種類毎の組入時価の純資産に対する比率、合計額に対する比率は外貨建有価証券の時価総額に対する外貨毎の種類別の有価証券の時価の比率です。

[次へ](#)

損保ジャパン日本債券マザーファンドの状況

(1) 貸借対照表

区分	(平成24年7月17日現在)	(平成25年7月16日現在)
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	32,046,103	449,638,608
国債証券	4,564,219,840	5,968,049,380
地方債証券	568,377,100	355,685,700
特殊債券	1,063,991,741	1,327,748,509
社債券	2,153,657,500	2,224,207,300
未収入金	212,877,400	-
未収利息	25,110,668	22,477,134
前払費用	3,373,335	3,263,089
流動資産合計	8,623,653,687	10,351,069,720
資産合計	8,623,653,687	10,351,069,720
負債の部		
流動負債		
未払金	203,211,800	-
流動負債合計	203,211,800	-
負債合計	203,211,800	-
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	6,703,057,903	8,216,981,694
剰余金		
剰余金	1,717,383,984	2,134,088,026
純資産合計	8,420,441,887	10,351,069,720
負債・純資産合計	8,623,653,687	10,351,069,720

「損保ジャパン日本債券マザーファンド」は、平成12年7月31日に信託契約を締結し、平成25年7月16日に第13期決算を行いました。上の表は、平成24年7月17日及び平成25年7月16日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券・地方債証券・特殊債券・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、原則として日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>ただし、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
3. その他	当計算期間は期末が休日のため平成24年 7月18日から平成25年 7月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	(平成24年 7月17日現在)	(平成25年 7月16日現在)
1. 計算期間末日における受益権の総数	6,703,057,903口	8,216,981,694口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2562円 (1万口当たり純資産額 12,562円)	1口当たり純資産額 1.2597円 (1万口当たり純資産額 12,597円)

(金融商品に関する注記)

	自 平成23年 7月16日 至 平成24年 7月17日	自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16日
1. 金融商品の状況に関する事項	<p>(1) 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。</p> <p>(2) 金融商品の内容およびその金融商品に係るリスク 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券関係）に記載しております。</p>	<p>(1) 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>(2) 金融商品の内容およびその金融商品に係るリスク 同左</p>

金融商品に係るリスク

当ファンドが実質的に保有している金融商品は、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。

市場リスク

金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。

信用リスク

各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。

流動性リスク

必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。

また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

同左

(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

同左

<p>2. 金融商品の時価等に関する事項</p>	<p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>(2) 時価の算定方法 国債証券・地方債証券・特殊債券・社債券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額 同左</p> <p>(2) 時価の算定方法 同左</p>
--------------------------	---	--

(関連当事者との取引に関する注記)

(平成24年 7月17日現在)	(平成25年 7月16日現在)
該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

	自 平成23年 7月16日 至 平成24年 7月17日	自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16日
開示対象ファンドの期首における当該マ ザーファンドの元本額	8,516,599,283円	6,703,057,903円
同期中における追加設定元本額	1,206,256,806円	2,212,216,852円
同期中における解約元本額	3,019,798,186円	698,293,061円
同期末における元本の内訳*		
ファンド名		
損保ジャパン日本債券ファンド	917,104,399円	935,006,741円
ハッピーエイジング20	65,113,733円	97,277,432円
ハッピーエイジング30	327,772,245円	477,191,773円
ハッピーエイジング40	1,961,372,904円	2,549,059,682円
ハッピーエイジング50	1,740,621,584円	2,018,949,261円
ハッピーエイジング60	1,592,722,838円	1,760,197,536円
損保ジャパン中国本土株ファンド(限定追 加型)2010-05	3,386,324円	1,367,228円
パン・アフリカ株式ファンド	28,130,597円	20,772,500円
アジア転換社債ファンド(毎月分配型)	19,947,763円	10,850,662円
人民元建て債券ファンド	14,067,343円	6,758,528円
オフショア人民元債フォーカス(ダイワS MA専用)	17,834,786円	3,798,695円
アジア転換社債ファンド(円ヘッジ型/限 定追加型/繰上償還条件付)2012-03	14,983,387円	5,339,349円
好配当グローバルREITプレミアム・ ファンド 円ヘッジありコース	- 円	19,651,154円
好配当グローバルREITプレミアム・ ファンド 円ヘッジなしコース	- 円	91,456,970円
好配当グローバルREITプレミアム・ ファンド 通貨セレクトコース	- 円	219,304,183円
(合計)	6,703,057,903円	8,216,981,694円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券関係）

（自平成23年7月16日 至平成24年7月17日）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	85,431,530
地方債証券	1,586,640
特殊債券	14,602,540
社債券	911,200
合計	102,531,910

（自平成24年7月18日 至平成25年7月16日）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	57,026,350
地方債証券	4,918,500
特殊債券	6,944,311
社債券	7,033,400
合計	75,922,561

（デリバティブ取引等関係）

該当事項はございません。

（3）附属明細表

有価証券明細表

（ ）株式

該当事項はございません。

（ ）株式以外の有価証券

次表の通りです。

平成25年7月16日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	1 40年国債	20,000,000	22,267,300	-
	5 40年国債	10,000,000	10,150,530	-
	6 40年国債	70,000,000	69,345,080	-
	18 30年国債	30,000,000	32,903,250	-
	19 30年国債	80,000,000	87,667,440	-
	79 20年国債	50,000,000	55,804,500	-
	80 20年国債	70,000,000	78,963,640	-
	82 20年国債	20,000,000	22,535,620	-
	90 20年国債	90,000,000	102,220,290	-
	97 5年国債	100,000,000	100,723,100	-
	98 20年国債	20,000,000	22,343,800	-
	99 20年国債	50,000,000	55,740,750	-
	100 20年国債	140,000,000	157,667,160	-
	105 20年国債	80,000,000	88,789,760	-
	110 20年国債	60,000,000	66,250,860	-

	113	20年国債	70,000,000	76,869,870	-
	114	20年国債	90,000,000	98,546,850	-
	117	20年国債	50,000,000	54,584,400	-
	121	20年国債	170,000,000	179,288,970	-
	126	20年国債	20,000,000	21,278,280	-
	131	20年国債	60,000,000	60,674,100	-
	132	20年国債	50,000,000	50,424,550	-
	137	20年国債	150,000,000	150,430,800	-
	143	20年国債	40,000,000	39,236,640	-
	144	20年国債	530,000,000	511,354,600	-
	145	20年国債	320,000,000	319,049,920	-
	287	10年国債	310,000,000	330,414,120	-
	299	10年国債	380,000,000	400,316,320	-
	310	10年国債	50,000,000	51,483,150	-
	311	10年国債	260,000,000	263,943,160	-
	314	10年国債	860,000,000	887,647,280	-
	316	10年国債	60,000,000	61,895,820	-
	318	10年国債	290,000,000	296,502,380	-
	319	2年国債	100,000,000	99,990,200	-
	322	10年国債	80,000,000	81,043,600	-
	326	2年国債	270,000,000	269,922,780	-
	327	2年国債	690,000,000	689,778,510	-
国債証券計	銘柄数：37		5,790,000,000	5,968,049,380	-
社債券	5	住友信託 劣後	100,000,000	105,313,800	-
	11	武田薬品	100,000,000	100,239,300	-
	12	武田薬品	100,000,000	100,349,100	-
	13	トヨタ自動車	100,000,000	100,095,900	-
	17	ダイキン工業	100,000,000	100,041,000	-
	28	相鉄HD	100,000,000	99,602,600	-
	33	大成建設	100,000,000	100,148,100	-
	38	IHI	100,000,000	100,216,000	-
	43	日本電気	100,000,000	100,546,900	-
	46	伊藤忠商事	100,000,000	106,104,400	-
	60	東日本旅客鉄道	100,000,000	105,709,600	-
	64	三菱商事	100,000,000	105,386,100	-
	167	オリックス	100,000,000	99,818,900	-
	316	北海道電力	100,000,000	100,370,700	-
	373	中国電力	100,000,000	99,840,500	-
	7	三井住友BK劣後	100,000,000	101,020,000	-
	1	クレディ・アグリコル	100,000,000	99,942,300	-
	20	ラボバンク・ネダー	200,000,000	199,766,400	-
	15	西日本高速道	100,000,000	99,961,800	-
	47	中日本高速道	100,000,000	99,348,600	-
	49	中日本高速道	100,000,000	100,385,300	-
社債券計	銘柄数：21		2,200,000,000	2,224,207,300	-
地方債証券	16-2	広島県公債	40,000,000	40,882,800	-
	17-4	静岡県公債	100,000,000	103,225,100	-
	21-15	愛知県公債	100,000,000	105,823,000	-
	24	公営企業	100,000,000	105,754,800	-
地方債証券計	銘柄数：4		340,000,000	355,685,700	-
特殊債券	11724	利付農林債	100,000,000	100,596,100	-
	11743	利付農林債	100,000,000	100,572,000	-
	56	道路機構	100,000,000	105,432,400	-
	42	政保道路機構	50,000,000	53,225,800	-

	87 政保道路機構	100,000,000	106,416,800	-
	4 住宅金融R M B S	62,649,000	65,618,562	-
	6 住宅金融R M B S	87,344,000	91,807,278	-
	17 住宅金融R M B S	29,826,000	30,971,318	-
	49 住宅機構R M B S	89,384,000	93,075,559	-
	50 住宅機構R M B S	89,617,000	92,744,633	-
	65 住宅機構R M B S	96,876,000	96,391,620	-
	66 住宅機構R M B S	194,494,000	192,976,946	-
	72 住宅機構R M B S	99,264,000	97,884,230	-
	73 住宅機構R M B S	99,746,000	100,035,263	-
特殊債券計	銘柄数：14	1,299,200,000	1,327,748,509	-
ファンド計	銘柄数：76	9,629,200,000	9,875,690,889	-

損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンドの状況

(1) 貸借対照表

区分	(平成24年7月17日現在)	(平成25年7月16日現在)
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	39,035,695	26,822,293
コール・ローン	73,754,040	136,482,286
国債証券	4,472,064,169	4,273,646,699
特殊債券	-	20,894,159
未収利息	35,255,675	31,919,211
前払費用	13,142,485	6,554,225
流動資産合計	4,633,252,064	4,496,318,873
資産合計	4,633,252,064	4,496,318,873
負債の部		
流動負債		
該当事項なし	-	-
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	4,744,900,449	3,536,537,379
剰余金		
剰余金又は欠損金()	111,648,385	959,781,494
純資産合計	4,633,252,064	4,496,318,873
負債・純資産合計	4,633,252,064	4,496,318,873

「損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド」は、平成17年9月26日に信託契約を締結し、平成25年7月16日に第8期決算を行いました。上の表は、平成24年7月17日及び平成25年7月16日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成24年 7月18日 至 平成25年 7月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券・特殊債券</p> <p>個別法に基づき、以下のとおり、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>ただし、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</p> <p>但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>
5. その他	<p>当計算期間は期末が休日のため平成24年 7月18日から平成25年 7月16日までとなっております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	（平成24年7月17日現在）	（平成25年7月16日現在）
1．計算期間末日における受益権の総数	4,744,900,449口	3,536,537,379口
2．投資信託財産計算規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 111,648,385円	
3．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9765円 (1万口当たり純資産額 9,765円)	1口当たり純資産額 1.2714円 (1万口当たり純資産額 12,714円)

（金融商品に関する注記）

	自 平成23年7月16日 至 平成24年7月17日	自 平成24年7月18日 至 平成25年7月16日
1．金融商品の状況に関する事項	<p>（1）金融商品に対する取組方針 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。</p> <p>（2）金融商品の内容およびその金融商品に係るリスク 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券関係）に記載しております。</p> <p>金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> <p>（3）金融商品に係るリスク管理体制 委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p>	<p>（1）金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>（2）金融商品の内容およびその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>（3）金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

<p>2. 金融商品の時価等に関する事項</p>	<p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> <p>(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。</p> <p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額</p> <p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>(2) 時価の算定方法</p> <p>国債証券</p> <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(4) 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p> <p>(1) 貸借対照表計上額、時価およびその差額</p> <p>同左</p> <p>(2) 時価の算定方法</p> <p>国債証券・特殊債券</p> <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>
--------------------------	--	--

（関連当事者との取引に関する注記）

（平成24年7月17日現在）	（平成25年7月16日現在）
該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

	自 平成23年7月16日 至 平成24年7月17日	自 平成24年7月18日 至 平成25年7月16日
開示対象ファンドの期首における当該マ ザーファンドの元本額	4,688,388,568円	4,744,900,449円
同期中における追加設定元本額	655,449,236円	406,522,338円
同期中における解約元本額	598,937,355円	1,614,885,408円
同期末における元本の内訳*		
ファンド名		
外国債券ファンド(為替ヘッジなし)(適 格機関投資家専用)	239,377,385円	228,915,957円
ハッピーエイジング20	251,027,958円	298,594,409円
ハッピーエイジング30	1,052,976,239円	1,151,941,801円
ハッピーエイジング40	1,145,631,144円	1,148,803,100円
ハッピーエイジング50	431,640,196円	384,683,937円
ハッピーエイジング60	149,748,021円	129,632,808円
損保ジャパン外国債券ファンド(為替 ヘッジなし)	1,474,499,506円	193,965,367円
(合計)	4,744,900,449円	3,536,537,379円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券関係)

(自平成23年7月16日 至平成24年7月17日)

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	145,931,289
合計	145,931,289

(自平成24年7月18日 至平成25年7月16日)

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	73,274,063
特殊債券	786,120
合計	74,060,183

(デリバティブ取引等関係)

該当事項はございません。

(3) 附属明細表

有価証券明細表

() 株式

該当事項はございません。

() 株式以外の有価証券

次表の通りです。

平成25年7月16日現在

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
アメリカ・ドル	国債証券	US TSY BOND 23/08/15	55,000	73,312.80	-
	国債証券	US TREASURY 29/02/15	25,000	31,445.25	-
	国債証券	US TREASURY 31/02/15	50,000	64,320.00	-
	国債証券	US TREASURY N/B 6.875% 08/15/25	20,000	28,403.00	-
	国債証券	US TREASURY N/B 4.75	190,000	217,800.80	-
	国債証券	US TREASURY N/B 3.5	195,000	214,392.75	-
	国債証券	US TREASURY N/B 3.75	95,000	106,058.00	-
	国債証券	US TREASURY N/B 3.25	275,000	295,559.00	-
	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	200,000	216,702.00	-
	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	70,000	75,293.40	-
	国債証券	US TREASURY N/B 3.375	170,000	186,641.30	-
	国債証券	US TREASURY N/B 6.25	30,000	42,011.70	-
	国債証券	US TREASURY N/B 3.25	260,000	281,244.60	-
	国債証券	US TREASURY N/B 5.25	60,000	75,421.80	-
	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	160,000	178,086.40	-
	国債証券	US TREASURY N/B 3.25	245,000	265,499.15	-
	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	562,000	578,747.60	-
国債証券	US TREASURY N/B 2.625	167,000	174,344.66	-	
国債証券	US TREASURY N/B 4.5	100,000	117,093.00	-	
国債証券	US TREASURY N/B 2.75	360,000	382,806.00	-	

	国債証券	US TREASURY N/B 6.0	110,000	146,411.10	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 6.375	11,000	15,248.75	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 1.25	825,000	839,949.00	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	960,000	998,246.40	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	795,000	817,291.80	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	220,000	230,758.00	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	240,000	256,929.60	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	50,000	52,023.00	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 1.0	770,000	776,614.30	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	310,000	307,650.20	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	500,000	497,535.00	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 1.375%	475,000	471,323.50	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 0.875%	800,000	801,368.00	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 0.875	800,000	799,432.00	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 0.125%	665,000	664,787.20	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 0.75%	795,000	785,555.40	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 0.25%	1,650,000	1,651,155.00	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 1.625%	545,000	506,037.95	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 2.75%	50,000	42,214.50	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 3.5%	265,000	264,295.10	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 0.75%	165,000	160,642.35	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 1.125%	200,000	189,812.00	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 0.375%	1,430,000	1,431,001.00	-	
	国債証券	US TREASURY N/B 2.875%	1,230,000	1,065,192.30	-	
	アメリカ・ドル 通貨計		17,150,000	17,376,656.66	-	
				(1,738,013,199円)	-	
	イギリス・ポンド	国債証券	TSY 5 2025	104,000	128,986.00	-
		国債証券	TSY 4.25%	33,000	37,951.65	-
		国債証券	UK TREASURY 6.0	55,000	75,971.50	-
		国債証券	TREASURY 4.0	17,000	18,770.55	-
		国債証券	TREASURY 4.25	51,000	58,491.90	-
		国債証券	TREASURY 5.0	82,000	96,345.90	-
		国債証券	TREASURY 4.25	109,000	125,017.55	-
		国債証券	TREASURY 4.25	105,000	121,626.75	-
		国債証券	TREASURY 4.25	145,000	166,068.50	-
		国債証券	TREASURY 4.0	305,000	348,416.75	-
		国債証券	TREASURY 2.75	325,000	336,700.00	-
		国債証券	TREASURY 4.5	53,000	62,826.20	-
		国債証券	TREASURY 4.25	70,000	81,707.50	-
		国債証券	TREASURY 3.75	60,000	67,692.00	-
		国債証券	TREASURY 4.5	95,000	110,741.50	-
		国債証券	TREASURY 4.0	45,000	50,343.75	-
		国債証券	TREASURY 4.25	10,000	11,431.50	-
		国債証券	TREASURY 4.25	70,000	80,734.50	-
		国債証券	TREASURY 1.75%	83,000	85,730.70	-
		国債証券	TREASURY 4.5%	25,000	29,833.75	-
		国債証券	TREASURY 1.0%	90,000	89,914.50	-
		国債証券	TREASURY 3.75%	100,000	112,415.00	-
	イギリス・ポンド 通貨計		2,032,000	2,297,717.95	-	
				(347,024,342円)	-	
	オーストラリア・ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	235,000	250,777.90	-
		国債証券	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	215,000	237,628.75	-
		国債証券	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	95,000	100,562.25	-
		国債証券	AUSTRALIAN GOVT. 5.5%	60,000	68,612.40	-

	国債証券	AUSTRALIAN GOVT. 3.25%	10,000	8,868.40	-
オーストラリア・ドル 通貨計			615,000	666,449.70	-
				(60,820,200円)	-
カナダ・ドル	国債証券	CANADA-GOV'T 29/6/1	100,000	138,553.00	-
	国債証券	CANADA-GOVT 4.0	125,000	134,516.25	-
	国債証券	CANADA-GOVT 5.0	100,000	135,695.00	-
	国債証券	CANADA-GOVT 3.75	70,000	77,045.50	-
	国債証券	CANADA-GOVT 4.25	120,000	134,001.60	-
	国債証券	CANADA-GOVT 4.0	192,000	209,765.76	-
	国債証券	CANADA-GOVT 3.5	170,000	185,349.30	-
	国債証券	CANADA-GOVT 1.5%	80,000	80,091.20	-
	国債証券	CANADA-GOVT 1.5%	90,000	82,800.00	-
カナダ・ドル 通貨計			1,047,000	1,177,817.61	-
				(112,917,374円)	-
シンガポール・ドル	国債証券	SINGAPORE GOVT 3.75	60,000	66,516.00	-
	国債証券	SINGAPORE GOVT 3.125	40,000	42,780.00	-
	国債証券	SINGAPORE GOVT 3.5	25,000	26,567.50	-
	国債証券	SINGAPORE GOVT 2.5	30,000	31,725.00	-
	国債証券	SINGAPORE GOVT 4.0	30,000	34,230.00	-
シンガポール・ドル 通貨計			185,000	201,818.50	-
				(15,998,152円)	-
ポーランド・ズロチ	国債証券	POLAND GOV'T BOND 6.25% 10/24/2015	300,000	321,210.00	-
	国債証券	POLAND GOVT BOND 5.75	153,000	174,228.75	-
	国債証券	POLAND GOVT BOND 5.25	535,000	576,917.25	-
ポーランド・ズロチ 通貨計			988,000	1,072,356.00	-
				(32,653,240円)	-
マレーシア・リングgit	国債証券	MALAYSIAN GOVT 3.814	250,000	252,890.00	-
	国債証券	MALAYSIAN GOVT 5.734	250,000	276,860.00	-
	国債証券	MALAYSIAN GOVT 5.094	25,000	25,390.75	-
	国債証券	MALAYSIAN GOVT 5.248%	60,000	68,608.80	-
	国債証券	MALAYSIAN GOVT 3.48%	100,000	98,041.00	-
マレーシア・リングgit 通貨計			685,000	721,790.55	-
				(22,693,095円)	-
メキシコ・ペソ	国債証券	MEXICAN BONOS 9.5	250,000	268,457.50	-
	国債証券	MEXICAN BONOS 8.5	900,000	1,037,646.00	-
	国債証券	MEXICAN BONOS 8.0	1,205,000	1,410,042.80	-
	国債証券	MEXICAN BONOS 8.5	790,000	958,941.50	-
	国債証券	MEXICAN BONOS 8.0	405,000	438,853.95	-
	国債証券	MEXICAN BONOS 6.5%	1,365,000	1,437,699.90	-
メキシコ・ペソ 通貨計			4,915,000	5,551,641.65	-
				(43,913,485円)	-
ユーロ	国債証券	BUNDESREPUB 28/07/04	190,000	254,780.50	-
	国債証券	BTPS 6%	145,000	163,639.75	-
	国債証券	FRANCE (GOVT OF) 5.5%	135,000	180,366.75	-
	国債証券	DBR 6.5%	75,000	116,426.25	-
	国債証券	FRTR 4.75 04/25/35	115,000	144,601.00	-
	国債証券	FRANCE(GOVT OF) 4.0% 04/25/55	60,000	68,286.00	-
	国債証券	SPANISH GOVT 5.5	160,000	173,272.00	-
	国債証券	BTPS 3.75	1,728,000	1,785,456.00	-
	国債証券	BELGIAN 0309 4.0	65,000	72,345.00	-
	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	137,000	157,022.55	-

	国債証券	DEUTSCHLAND REP 4.75	155,000	216,860.50	-
	国債証券	BELGIAN 0307 3.25	77,000	83,217.75	-
	国債証券	DEUTSCHLAND REP 4.75	145,000	213,041.25	-
	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.0	85,000	96,963.75	-
	国債証券	BTPS 4.0	250,000	222,675.00	-
	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	30,000	42,015.00	-
	国債証券	BTPS 3.75	95,000	98,429.50	-
	国債証券	BELGIAN 0308 4.0	115,000	130,898.75	-
	国債証券	BTPS 4.25	590,000	609,529.00	-
	国債証券	SPANISH GOVT 3.15	360,000	364,752.00	-
	国債証券	BELGIAN 0291 5.5	115,000	148,775.50	-
	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	195,000	240,864.00	-
	国債証券	FRANCE O.A.T. 8.5	88,000	136,897.20	-
	国債証券	BELGIAN 0315 4.0	107,000	121,637.60	-
	国債証券	BTPS 4.5	310,000	310,000.00	-
	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.0	40,000	45,624.00	-
	国債証券	SPANISH GOVT 4.1	100,000	102,655.00	-
	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	300,000	353,985.00	-
	国債証券	BTPS 3.0	2,450,000	2,499,367.50	-
	国債証券	NETHERLANDS GOVT 4.0	80,000	99,872.00	-
	国債証券	NETHERLANDS GOVT 4.0	155,000	180,203.00	-
	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.25%	69,000	76,369.20	-
	国債証券	BELGIAN 0318 3.75%	64,000	72,067.20	-
	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.5%	310,000	328,987.50	-
	国債証券	BELGIAN 0304 5.0%	75,000	94,582.50	-
	国債証券	BTPS 3.0%	615,000	627,084.75	-
	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.0%	200,000	216,140.00	-
	国債証券	BTPS 5.0%	120,000	118,764.00	-
	国債証券	DEUTSCHLAND REP 3.25%	355,000	411,054.50	-
	国債証券	DEUTSCHLAND REP 1.75%	40,000	41,138.00	-
	国債証券	BTPS 4.0%	140,000	145,516.00	-
	国債証券	NETHERLANDS GOVT 2.25%	95,000	98,510.25	-
	国債証券	NETHERLANDS GOVT 3.5%	165,000	188,091.75	-
	国債証券	BTPS 5.5%	830,000	897,520.50	-
	国債証券	BTPS 3.5%	160,000	162,264.00	-
	国債証券	DEUTSCHLAND REP 2.5%	35,000	35,722.75	-
	国債証券	NETHERLANDS GOVT 2.5%	40,000	39,586.00	-
	国債証券	SPANISH GOVT 5.4%	60,000	63,159.00	-
	国債証券	SPANISH GOVT 5.5%	250,000	269,137.50	-
	国債証券	SPANISH GOVT 5.75%	90,000	95,355.00	-
	国債証券	SPANISH GOVT 4.7%	60,000	54,513.00	-
	国債証券	NETHERLANDS GOVT 1.25%	100,000	101,735.00	-
	国債証券	DEUTSCHLAND REP 1.5%	250,000	249,275.00	-
	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.25%	690,000	698,245.50	-
ユーロ 通貨計			13,465,000	14,519,278.00	-
				(1,896,072,514円)	-
南アフリカ・ランド	国債証券	REP SOUTH AFRICA 8.75%	335,000	349,910.85	-
	特殊債券	EUROPEAN INVT BK 5.75%	1,530,000	1,471,003.20	-
	特殊債券	EUROPEAN INVT BK 9.0%	550,000	593,637.00	-
南アフリカ・ランド 通貨計			2,415,000	2,414,551.05	-
				(24,435,257円)	-
ファンド計				(4,294,540,858円)	-

（注1）通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額です。

（注2）外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率(%)	合計額に対する比率(%)
アメリカ・ドル	国債証券 44銘柄	38.65	40.47
イギリス・ポンド	国債証券 22銘柄	7.72	8.08
オーストラリア・ドル	国債証券 5銘柄	1.35	1.42
カナダ・ドル	国債証券 9銘柄	2.51	2.63
シンガポール・ドル	国債証券 5銘柄	0.36	0.37
ポーランド・ズロチ	国債証券 3銘柄	0.73	0.76
マレーシア・リングgit	国債証券 5銘柄	0.50	0.53
メキシコ・ペソ	国債証券 6銘柄	0.98	1.02
ユーロ	国債証券 54銘柄	42.17	44.15
南アフリカ・ランド	国債証券 1銘柄	0.08	0.08
南アフリカ・ランド	特殊債券 2銘柄	0.46	0.49
合計	156銘柄	95.51	100.00

組入時価比率は通貨種類毎の組入時価の純資産に対する比率、合計額に対する比率は外貨建有価証券の時価総額に対する外貨毎の種類別の有価証券の時価の比率です。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ハッピーエイジング20

平成25年7月31日現在

資産総額（円）	6,164,263,867
負債総額（円）	21,945,490
純資産総額(-)（円）	6,142,318,377
発行済数量（口）	6,496,036,881
1単位当り純資産額（ / ）（円）	0.9455

ハッピーエイジング30

平成25年7月31日現在

資産総額（円）	7,416,430,037
負債総額（円）	24,158,916
純資産総額(-)（円）	7,392,271,121
発行済数量（口）	7,246,526,112
1単位当り純資産額（ / ）（円）	1.0201

ハッピーエイジング40

平成25年7月31日現在

資産総額（円）	9,551,386,508
負債総額（円）	7,106,722
純資産総額(-)（円）	9,544,279,786
発行済数量（口）	8,726,926,986
1単位当り純資産額（ / ）（円）	1.0937

ハッピーエイジング50

平成25年7月31日現在

資産総額（円）	4,435,038,232
負債総額（円）	2,556,182
純資産総額(-)（円）	4,432,482,050
発行済数量（口）	3,889,335,281
1単位当り純資産額（ / ）（円）	1.1397

ハッピーエイジング60

平成25年7月31日現在

資産総額（円）	2,706,589,866
負債総額（円）	1,346,664
純資産総額(-)（円）	2,705,243,202
発行済数量（口）	2,363,935,036
1単位当り純資産額（ / ）（円）	1.1444

< 参 考 >

純資産額計算書

損保ジャパン日本株マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額（円）	9,053,986,443
負債総額（円）	0
純資産総額(-)（円）	9,053,986,443
発行済数量（口）	7,265,942,523
1単位当り純資産額（ / ）（円）	1.2461

損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額（円）	5,428,828,190
負債総額（円）	76,359,520
純資産総額(-)（円）	5,352,468,670
発行済数量（口）	4,750,718,512
1単位当り純資産額（ / ）（円）	1.1267

損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額（円）	7,834,350,938
負債総額（円）	0
純資産総額(-)（円）	7,834,350,938
発行済数量（口）	6,794,375,137
1単位当り純資産額（ / ）（円）	1.1531

損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額（円）	10,433,996,490
負債総額（円）	100,000,000
純資産総額(-)（円）	10,333,996,490
発行済数量（口）	8,188,133,521
1単位当り純資産額（ / ）（円）	1.2621

損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額（円）	4,461,585,819
負債総額（円）	0
純資産総額(-)（円）	4,461,585,819
発行済数量（口）	3,549,711,490
1単位当り純資産額（ / ）（円）	1.2569

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

1. 名義書換

該当事項はありません。

2. 受益者名簿

作成しません。

3. 受益者集会

開催しません。

4. 受益者に対する特典

ありません。

5. 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

6. 受益証券の再発行

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

7. 受益権の譲渡

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

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

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

8. 受益権の譲渡の対抗要件

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

9. 受益権の再分割

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

10. 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に支払います。

11. 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（平成25年8月末現在）

資本金の額	1,550百万円
会社が発行する株式の総数	50,000株
発行済株式総数	24,085株

最近5年間における主な資本金の額の増減

平成21年12月29日 資本金の額を1,200百万円から1,550百万円に増額しました。

(2) 会社の機構（平成25年8月末現在）

会社の意思決定機構

定款に基づき3名以上20名以内の取締役が株主総会において選任されます。取締役の選任は、発行済株式総数のうち議決権を行使することができる株式数の3分の1以上にあたる株式を有する株主が出席して、その過半数によって決し、累積投票によらないものとします。

取締役の任期は、就任後1年以内の最終の決算期に関する定時株主総会の終結のときまでとします。補欠により就任した取締役の任期は、前任取締役の残任期間までとし、増員により就任した取締役の任期は、他の取締役の残任期間と同一とします。

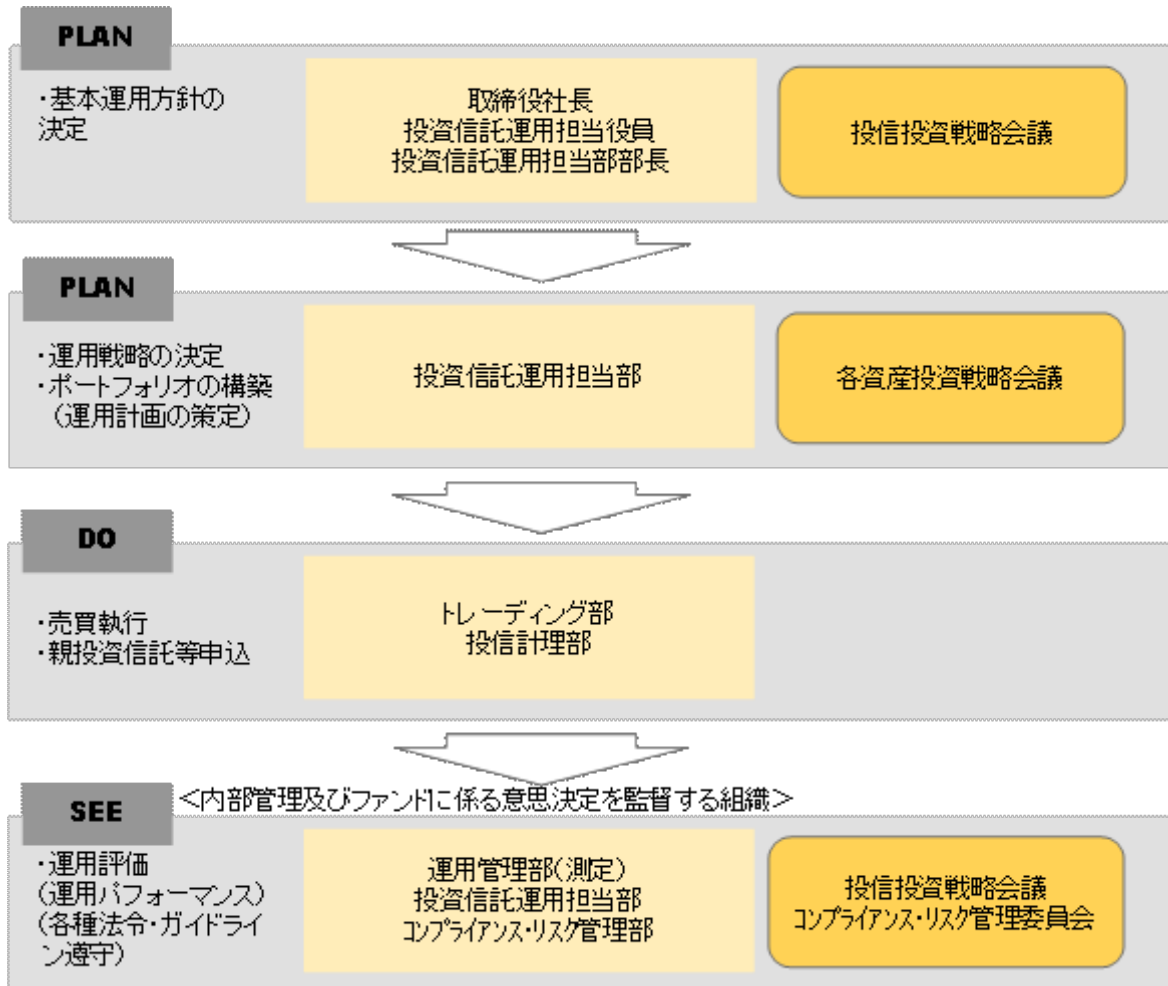
取締役会は、取締役中より代表取締役を選任します。また、取締役の中から会長、社長、専務取締役及び常務取締役を選任することができます。

取締役会は、取締役社長が召集し、議長となります。取締役社長に事故あるときはあらかじめ取締役会で定めた順序により、他の取締役がその任にあたります。取締役会の招集通知は開催日の少なくとも3日前にこれを発します。ただし、緊急の必要のあるときはこの限りではありません。

取締役会は、法令または定款に定める事項の他、業務執行に関する重要事項を決定します。その決議は、取締役の過半数が出席し、その出席取締役の過半数をもって行います。

投資運用の意思決定機構

- ・ 投信投資戦略会議は、ファンドの基本運用方針の分析と決定を行います。
 - ・ 各資産投資戦略会議は、投信投資戦略会議の基本運用方針に基づき、ファンドの運用戦略を決定し、運用計画を策定します。
- 銘柄の選定にあたっては「いかなる資産も本来の投資価値を有しており、市場価格は中長期的にはこの投資価値に収束する。したがって、市場価格と投資価値の乖離が超過収益の源泉となる。」という当社の投資哲学に基づき、各資産、市場、銘柄の割安・割高の度合いを算出するために、各々の「本来あるべき投資価値」を分析することに注力しています。
- ・ 各資産投資戦略会議で策定された運用計画に基づき、トレーディング部が最良執行の観点から売買を執行します。
 - ・ 運用状況の分析・評価等は運用担当部で行い、投信投資戦略会議に報告されます。また、売買チェック、リスク管理、各種法令、ガイドライン遵守の状況は、コンプライアンス・リスク管理部で確認を行い、コンプライアンス・リスク管理委員会に報告されます。



2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）ならびに証券投資信託の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資一任契約に基づく運用（投資運用業）および投資助言業務を行っています。

委託会社の運用する投資信託（親投資信託を除きます。）は平成25年8月末現在、計84本（追加型株式投資信託78本、単位型株式投資信託6本）であり、その純資産総額の合計は410,074百万円です。

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社である損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）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。以下「財務諸表等規則」という。）、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
2. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
		金額(千円)	金額(千円)
(資産の部)			
流動資産			
1 現金・預金		1,657,198	2,104,567
2 前払費用		61,869	70,097
3 未収委託者報酬		445,492	545,598
4 未収運用受託報酬		225,939	246,403
5 未収収益		26	45
6 繰延税金資産		-	97,142
7 その他		5,123	4,535
流動資産合計		2,395,650	3,068,389
固定資産			
1 有形固定資産			
(1) 建物	* 1	67,779	56,460
(2) 器具備品	* 1	24,189	14,422
有形固定資産合計		91,968	70,882
2 無形固定資産			
(1) 電話加入権		4,535	4,535
(2) 意匠権		1	-
無形固定資産合計		4,536	4,535
3 投資その他の資産			
(1) 投資有価証券		26,392	39,786
(2) 関係会社株式		41,085	41,085
(3) 長期差入保証金		193,917	193,917
(4) 繰延税金資産		-	22,609
(5) その他		29	29
投資その他の資産合計		261,424	297,428
固定資産合計		357,929	372,847
資産合計		2,753,579	3,441,236

区分	注記 番号	前事業年度 (平成24年3月31日)		当事業年度 (平成25年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
(負債の部)					
流動負債					
1 預り金			8,026		13,613
2 未払金					
(1) 未払手数料		193,715		257,132	
(2) その他未払金	* 2	90,111	283,826	85,958	343,090
3 未払費用	* 2		174,396		205,473
4 未払消費税等			51,506		37,990
5 未払法人税等			8,408		53,878
6 賞与引当金			46,161		45,837
7 役員賞与引当金			-		10,800
流動負債合計			572,327		710,684
固定負債					
1 退職給付引当金			36,984		49,692
2 資産除去債務			7,361		7,492
固定負債合計			44,345		57,184
負債合計			616,673		767,869
(純資産の部)					
株主資本					
1 資本金			1,550,000		1,550,000
2 資本剰余金					
(1) 資本準備金			413,280		413,280
資本剰余金合計			413,280		413,280
3 利益剰余金					
(1) その他利益剰余金					
繰越利益剰余金			174,819		701,589
利益剰余金合計			174,819		701,589
株主資本合計			2,138,099		2,664,870
評価・換算差額等					
1 その他有価証券評価差額金			1,192		8,496
評価・換算差額等合計			1,192		8,496
純資産合計			2,136,906		2,673,366
負債・純資産合計			2,753,579		3,441,236

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)		当事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1 委託者報酬		2,230,173		2,973,305	
2 運用受託報酬		2,102,922	4,333,096	2,136,259	5,109,564
営業費用					
1 支払手数料		1,036,217		1,413,637	
2 広告宣伝費		9,632		11,137	
3 公告費		2,605		200	
4 調査費		1,069,759		1,206,182	
(1) 調査費		514,165		553,301	
(2) 委託調査費	* 1	553,110		650,602	
(3) 図書費		2,483		2,278	
5 営業雑経費		146,308		143,886	
(1) 通信費		21,015		17,371	
(2) 印刷費		117,009		115,900	
(3) 諸会費		8,283	2,264,524	10,614	2,775,044
一般管理費					
1 給料		1,266,858		1,254,518	
(1) 役員報酬	*1,*2	48,673		47,888	
(2) 給料・手当		1,128,546		1,120,265	
(3) 賞与		89,637		86,364	
2 福利厚生費		85,435		92,228	
3 交際費		5,241		5,315	
4 寄付金		100		100	
5 旅費交通費		34,135		34,133	
6 法人事業税		10,345		11,992	
7 租税公課		6,466		6,373	
8 不動産賃借料		232,869		236,560	
9 退職給付費用		30,164		34,499	
10 賞与引当金繰入		46,161		45,837	

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)		当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
11 役員賞与引当金繰入	* 2	-		10,800	
12 固定資産減価償却費		39,575		23,523	
13 諸経費	* 1	134,414	1,891,767	133,243	1,889,126
営業利益			176,803		445,394
営業外収益					
1 受取配当金		415		130	
2 受取利息		186		235	
3 有価証券売却益		613		503	
4 為替差益		281		1,637	
5 雑益		817	2,314	1,682	4,188
営業外費用					
1 雑損		2,008	2,008	109	109
経常利益			177,110		449,473
特別損失					
1 固定資産除却損		1	1	-	-
税引前当期純利益			177,109		449,473
法人税、住民税及び事業 税			2,290		47,159
法人税等調整額			-		124,457
当期純利益			174,819		526,770

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）	当事業年度 （自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）
株主資本		
資本金		
当期首残高	1,550,000	1,550,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	1,550,000	1,550,000
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	504,824	413,280
当期変動額		
資本準備金からその他資本剰余金へ の振替	91,544	-
当期変動額合計	91,544	-
当期末残高	413,280	413,280
その他資本剰余金		
当期首残高	840,448	-
当期変動額		
資本準備金からその他資本剰余金へ の振替	91,544	-
欠損填補	931,993	-
当期変動額合計	840,448	-
当期末残高	-	-
資本剰余金合計		
当期首残高	1,345,273	413,280
当期変動額		
欠損填補	931,993	-
当期変動額合計	931,993	-
当期末残高	413,280	413,280
利益剰余金		
繰越利益剰余金		
当期首残高	931,993	174,819
当期変動額		
欠損填補	931,993	-
当期純利益	174,819	526,770
当期変動額合計	1,106,812	526,770
当期末残高	174,819	701,589

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
利益剰余金合計		
当期首残高	931,993	174,819
当期変動額		
欠損填補	931,993	-
当期純利益	174,819	526,770
当期変動額合計	1,106,812	526,770
当期末残高	174,819	701,589
株主資本合計		
当期首残高	1,963,280	2,138,099
当期変動額		
当期純利益	174,819	526,770
当期変動額合計	174,819	526,770
当期末残高	2,138,099	2,664,870
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	1,571	1,192
当期変動額		
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）	378	9,689
当期変動額合計	378	9,689
当期末残高	1,192	8,496
評価・換算差額等合計		
当期首残高	1,571	1,192
当期変動額		
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）	378	9,689
当期変動額合計	378	9,689
当期末残高	1,192	8,496
純資産合計		
当期首残高	1,961,708	2,136,906
当期変動額		
当期純利益	174,819	526,770
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）	378	9,689
当期変動額合計	175,197	536,460
当期末残高	2,136,906	2,673,366

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法より算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(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	15年
器具備品	3～20年

(2) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

なお、所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年3月31日以前のものについては、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。

3. 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、期末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。

4. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。

(2) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、当事業年度における支給見込額を計上しております。

(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要支給額を計上しております。

退職給付債務の計算に当たっては、「退職給付会計に関する実務指針」（日本公認会計士協会 会計制度委員会報告第13号）に定める簡便法によっております。

5. 消費税等の会計処理方法

税抜方式を採用しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

* 1 . 有形固定資産の減価償却累計額は、次のとおりであります。

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
建物	35,372千円	46,691千円
器具備品	57,527	60,361

* 2 . 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
その他未払金	10,000千円	- 千円
未払費用	4,336	3,728

（損益計算書関係）

* 1 . 関係会社との取引に係るものが、次のとおり含まれております。

	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
委託調査費	77,288千円	66,352千円
役員報酬	6,174	6,241
諸経費	4,504	5,203

* 2 . 役員報酬の限度額は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
取締役 年額	200,000千円以内	200,000千円以内
監査役 年額	50,000	50,000

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度 期首株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
普通株式	24,085株	- 株	- 株	24,085株

2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3．新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4．剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

該当事項はありません。

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度 期首株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
普通株式	24,085株	- 株	- 株	24,085株

2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3．新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4．剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

該当事項はありません。

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

該当事項はありません。

（リース取引関係）

1. ファイナンス・リース取引

所有権移転外ファイナンス・リース取引

(1) リース資産の内容

有形固定資産

器具備品であります。

(2) リース資産の減価償却の方法

重要な会計方針「2. 固定資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。

なお、所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年3月31日以前のものについては、通常の賃貸借処理に係る方法に準じた会計処理によっており、その内容は次のとおりであります。

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額

（単位：千円）

	前事業年度（平成24年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	14,131	13,324	806
合計	14,131	13,324	806

（単位：千円）

	当事業年度（平成25年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	-	-	-
合計	-	-	-

未経過リース料期末残高相当額等

（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
未経過リース料期末 残高相当額		
1年内	886	-
1年超	-	-
合計	886	-

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
支払リース料	4,386	893
減価償却費相当額	3,913	806
支払利息相当額	132	6

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。

（減損損失について）

リース資産に配分された減損損失はありません。

（金融商品関係）

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

当社では、主として短期的な預金及び一部の有価証券によって運用しており、経営として許容できる範囲内にリスクを制御するよう、適切に資産運用を行っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は、主に投資信託を保有しており、今後の基準価額の下落によっては、売却損・評価損計上による利益減少や、評価差額金の減少により純資産が減少するなど、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、短期的な預金について、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

価格変動リスクについては、四半期ごとに時価の状況等を把握し、当該状況については資産運用管理規程に従い、経理担当部が取締役会等へ報告し、適切に管理を行っております。

(4) 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額のほか、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変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2．金融商品の時価等に関する事項

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。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含めておりません（注2．参照）。

前事業年度（平成24年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	1,657,198	1,657,198	-
(2) 投資有価証券			
その他有価証券	10,642	10,642	-
資産計	1,667,840	1,667,840	-

当事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	2,104,567	2,104,567	-
(2) 投資有価証券			
其他有価証券	24,036	24,036	-
資産計	2,128,604	2,128,604	-

注1．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券取引に関する事項

資 産

(1) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 投資有価証券

時価については、公表されている基準価額または取引金融機関等から提示された基準価額によっております。

注2．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
非上場株式	15,750	15,750
関係会社株式	41,085	41,085

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、「(2) 投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

また、関係会社株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、時価開示の対象としておりません。

注3．金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成24年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
(1) 預金	1,657,075	-	-	-
(2) 投資有価証券				
其他有価証券のうち 満期があるもの				
株式	-	-	-	-
債券	-	-	-	-
その他	-	1,076	-	8,651
合計	1,657,075	1,076	-	8,651

当事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
(1) 預金	2,104,172	-	-	-
(2) 投資有価証券				
その他有価証券のうち 満期があるもの				
株式	-	-	-	-
債券	-	-	-	-
その他	-	-	-	20,972
合計	2,104,172	-	-	20,972

注4．社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額
該当事項はありません。

（有価証券関係）

1．売買目的有価証券

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式 41,085千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式 41,085千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4．その他有価証券で時価のあるもの

前事業年度（平成24年3月31日）

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	1,076	1,000	76
	小計	1,076	1,000	76
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	9,565	10,835	1,269
	小計	9,565	10,835	1,269
合計		10,642	11,835	1,192

当事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	24,036	10,835	13,201
	小計	24,036	10,835	13,201
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		24,036	10,835	13,201

5. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	19,564	613	-
合計	19,564	613	-

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	1,503	503	-
合計	1,503	503	-

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

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．退職給付債務に関する事項

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
退職給付債務(千円)	36,984	49,692
退職給付引当金(千円)	36,984	49,692

3．退職給付費用に関する事項

	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
勤務費用等(千円)	30,164	34,499
退職給付費用(千円)	30,164	34,499

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

該当事項はありません。

5．当社は、退職給付債務及び退職給付費用の算定方法として簡便法を採用しております。

（ストック・オプション等関係）

該当事項はありません。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
繰延税金資産		
繰越欠損金	313,704千円	163,192千円
ソフトウェア損金算入限度超過額	65,584	85,208
未払費用否認	17,652	19,883
退職給付引当金	13,277	17,721
賞与引当金	17,546	17,422
その他	9,776	10,388
繰延税金資産小計	437,541	313,975
評価性引当額	435,790	187,913
繰延税金資産合計	1,750	125,904
繰延税金負債		
その他有価証券差額金	-	4,705
固定資産除去価額	1,750	1,447
繰延税金負債合計	1,750	6,152
繰延税金資産の純額	-	119,751

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

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
法定実効税率	40.7%	38.0%
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.0	1.4
住民税均等割	1.3	0.5
税務上の繰越欠損金の利用	41.7	37.3
評価性引当額の増減	-	19.8
税効果会計適用後の法人税等の負担率	1.3	17.2

（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

本社事務所の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から15年と見積り、割引率は1.7%～1.8%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

	前事業年度		当事業年度	
	（自	平成23年4月1日	（自	平成24年4月1日
	至	平成24年3月31日）	至	平成25年3月31日）
期首残高		7,233千円		7,361千円
時の経過による調整額		128		130
期末残高		7,361		7,492

（セグメント情報等）

セグメント情報

当社は、投資運用事業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客へ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

本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えているため、記載を省略しております。

(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%を超えているため、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
株式会社損害保険ジャパン	592,950	-
日本興亜損害保険株式会社	483,987	-
NKSJひまわり生命保険株式会社	179,864	-

当事業年度（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

単一の製品・サービスの区分の外部顧客へ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

本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えているため、記載を省略しております。

(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%を超えているため、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
株式会社損害保険ジャパン	562,583	-
日本興亜損害保険株式会社	424,906	-
NKSJひまわり生命保険株式会社	198,960	-

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等記載すべき重要な取引はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等記載すべき重要な取引はありません。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 (千円)	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)
同一の親会社を持つ会社	株式会社損害保険ジャパン	東京都新宿区	70,000,000	損害保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用の一任及び助言（注1）	運用受託報酬の受取り	575,888	未収運用受託報酬	1,749
同一の親会社を持つ会社	株式会社日本興亜損害保険	東京都千代田区	91,249,175	損害保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用の一任及び助言（注1）	運用受託報酬の受取り	483,987	未収運用受託報酬	51,986
同一の親会社を持つ会社	NKSJひまわり生命保険株式会社	東京都新宿区	17,250,000	生命保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用の一任（注1）	運用受託報酬の受取り	179,864	未収運用受託報酬	99,060

注1．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。

2．取引条件ないし取引条件の決定方針等

（注1）運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 (千円)	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)
同一の親会社を持つ会社	株式会社損害保険ジャパン	東京都新宿区	70,000,000	損害保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用の一任及び助言（注1）	運用受託報酬の受取り	546,341	未収運用受託報酬	1,739
同一の親会社を持つ会社	日本興亜損害保険株式会社	東京都千代田区	91,249,175	損害保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用の一任及び助言（注1）	運用受託報酬の受取り	424,906	未収運用受託報酬	40,201
同一の親会社を持つ会社	NKSJひまわり生命保険株式会社	東京都新宿区	17,250,000	生命保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用の一任（注1）	運用受託報酬の受取り	198,960	未収運用受託報酬	107,248

注1．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。

2．取引条件ないし取引条件の決定方針等

（注1）運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

(4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等との取引はありません。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

NKSJホールディングス株式会社（東京証券取引所・大阪証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

関連会社はありません。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	88,723.53円	110,997.16円
1株当たり当期純利益金額	7,258.42円	21,871.32円

(注) 1．潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
当期純利益(千円)	174,819	526,770
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(千円)	174,819	526,770
期中平均株式数(株)	24,085	24,085

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更
定款の変更に関しては、株主総会の特別決議が必要です。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社及び当ファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称

みずほ信託銀行株式会社（再信託受託会社：資産管理サービス信託銀行株式会社）

資本金の額

247,369百万円（平成25年3月末現在）

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

<再信託受託会社の概要>

名称：資産管理サービス信託銀行株式会社

資本金の額：50,000百万円（平成25年3月末現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約に係る信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（資産管理サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2)販売会社

（単位：百万円、平成25年3月末現在）

名称	資本金の額	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社S B I証券	47,937	
カブドットコム証券株式会社	7,196	
損保ジャパンD C証券株式会社	3,000	
丸福証券株式会社 1	852	
みずほ証券株式会社	125,167	
楽天証券株式会社	7,495	
株式会社みずほ銀行	2 1,404,065	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社損害保険ジャパン	70,000	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
日本興亜損害保険株式会社	91,249	

1 平成25年10月11日より取扱いを開始します。

2 平成25年7月1日現在

(3)投資顧問会社

a . TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY

資本金の額 25千ドル（平成25年6月末現在）

（2,464千円、1ドル=98.59円換算）

事業の内容

米国において有価証券等に係る投資顧問業務及び投資信託委託業務を行っています。

b . D I A Mアセットマネジメント株式会社

資本金の額 2,000百万円（平成25年3月末現在）

事業の内容

「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り、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。

2【関係業務の概要】**(1) 受託会社**

受託会社として、信託財産の保管・管理業務などを行い、収益分配金、一部解約金及び償還金の交付等を行います。

(2) 販売会社

販売会社として、受益権の募集の取扱い、収益分配金等の支払い等を行います。

(3) 投資顧問会社**a . TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY**

委託会社との投資一任契約に基づき、「損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド」に関して、外国株式の運用の指図に関する権限の委託を受けて投資判断、発注等を行います。

b . D I A Mアセットマネジメント株式会社

委託会社との投資一任契約に基づき、「損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド」に関して、日本株式の運用の指図に関する権限の委託を受けて投資判断、発注等を行います。

3【資本関係】**(1) 受託会社**

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

(3) 投資顧問会社

該当事項はありません。

第3【その他】

- 1．目論見書の表紙に、委託会社及び販売会社の名称を記載し、当ファンド、委託会社及び販売会社のロゴマークや図案を表示し、イラスト、写真等を採用することがあります。また、目論見書の表紙に、当ファンドの概略的性格を表示する文言を記載することがあります。さらに、目論見書の裏表紙に当ファンド及び委託会社のロゴを記載することがあります。
- 2．金融商品取引法第13条第2項第1号に定める事項に関する内容を記載した目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」という名称を使用することがあります。また、金融商品取引法第13条第2項第2号に定める事項に関する内容を記載した目論見書の別称として「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用することがあります。
- 3．投資信託説明書（請求目論見書）の表紙あるいは裏表紙に、金融商品取引法に基づき、投資家の請求により交付される目論見書である旨を記載することがあります。
- 4．投資信託説明書（請求目論見書）の表紙に課税上の取扱いに関する記載をすることがあります。
- 5．目論見書に記載する運用状況に関する情報等は、適宜更新することがあります。
- 6．目論見書の表紙等に「金融商品取引業者登録番号」、「使用開始日」等を記載することがあります。
- 7．投資信託説明書（請求目論見書）の巻末に信託約款を掲載することがあります。
- 8．目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
- 9．投資評価機関、投資評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- 10．目論見書の表紙等に以下の内容を記載することがあります。
 - ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されています。

独立監査人の監査報告書

平成25年9月5日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 英 公一 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大村 真敏 印

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」に掲げられているハッピーエイジング20の平成24年7月18日から平成25年7月16日までの第13期計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、ハッピーエイジング20の平成25年7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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント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

- (注) 1. 上記は、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XBR Lデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年9月5日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 英 公一 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大村 真敏 印

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」に掲げられているハッピーエイジング30の平成24年7月18日から平成25年7月16日までの第13期計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、ハッピーエイジング30の平成25年7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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント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

(注) 1. 上記は、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XBR Lデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年9月5日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 英 公一 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大村 真敏 印

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」に掲げられているハッピーエイジング40の平成24年7月18日から平成25年7月16日までの第13期計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、ハッピーエイジング40の平成25年7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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント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

(注) 1. 上記は、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XBR Lデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年9月5日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 英 公一 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大村 真敏 印

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」に掲げられているハッピーエイジング50の平成24年7月18日から平成25年7月16日までの第13期計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、ハッピーエイジング50の平成25年7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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント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

(注) 1. 上記は、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XBR Lデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年9月5日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 英 公一 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大村 真敏 印

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」に掲げられているハッピーエイジング60の平成24年7月18日から平成25年7月16日までの第13期計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、ハッピーエイジング60の平成25年7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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント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

(注) 1. 上記は、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XBR Lデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年6月5日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大村 真 敏 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 羽柴 則 央 印

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」に掲げられている損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第28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、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の平成25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

（注）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。