

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年4月14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 山口 裕之
【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。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出し、平成26年10月14日付をもって提出した有価証券届出書（平成27年1月28日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。以下「原届出書」といいます。）につきまして訂正すべき事項がありましたので、これを訂正するものであります。

## 2【訂正の内容】

原届出書の該当情報を以下の内容に訂正します。

下線部\_\_\_\_\_は訂正内容を示します。

また、原届出書に添付しておりました「損保ジャパン日本株マザーファンド」および「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」の信託約款を削除し、「S J A Mラージキャップ・バリュー・マザーファンド」および「S J A Mスモールキャップ・マザーファンド」の信託約款を追加します。

## 第一部【証券情報】

### （４）【発行（売出）価格】

<訂正前>

（略）

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。

<訂正後>

（略）

各ファンドの基準価額については、委託会社または販売会社（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。

委託会社の照会先

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

電話番号 03-5290-3519（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ <http://www.sjnk-am.co.jp/>

### （８）【申込取扱場所】

<訂正前>

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。

<訂正後>

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、委託会社までお問い合わせください。

委託会社の照会先

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

電話番号 03-5290-3519（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ <http://www.sjnk-am.co.jp/>

### （１２）【その他】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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】

<訂正前>

「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-DIAM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-TCW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。

（略）

#### <ファンドの特色>

##### ファンドの目的

日本及び世界各国の株式や公社債を実質的な主要投資対象とし、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。

##### ファンドの特色



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。

投資対象資産	投資対象とするマザーファンド <sup>*1</sup> 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 <sup>*2</sup>
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 <sup>*3</sup>
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 <sup>*4</sup>

※1 マザーファンドについては、後掲「ファンドの仕組み」をご参照下さい。

※2 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に委託します。

※3 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に委託します。

※4 当ファンドは2014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(略称:DIAM)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・第一生命の高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 INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY(略称: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。2014年6月末現在の同グループの運用資産は、約1,416億ドル(約14兆3,525億円\*)です。

\*2014年6月末時点の為替レートで換算。

\*平成27年4月14日以降は、特色1を以下のとおりに変更する予定です。詳しくは、第一部 証券情報(12)その他をご参照ください。

## 変更後のファンドの特色



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。

投資対象資産	投資対象とするマザーファンド*1等
国内株式	SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド SJAMスモールキャップ・マザーファンド
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 マザーファンドについては、後掲「ファンドの仕組み」をご参照下さい。

\*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に委託します。

\*3 当ファンドは2014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、取引所等の上場されている投資信託をさします。

**TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY(略称: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。2014年6月末現在の同グループの運用資産は、約1,416億ドル(約14兆3,525億円\*)です。

\*2014年6月末時点の為替レートで換算。



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。

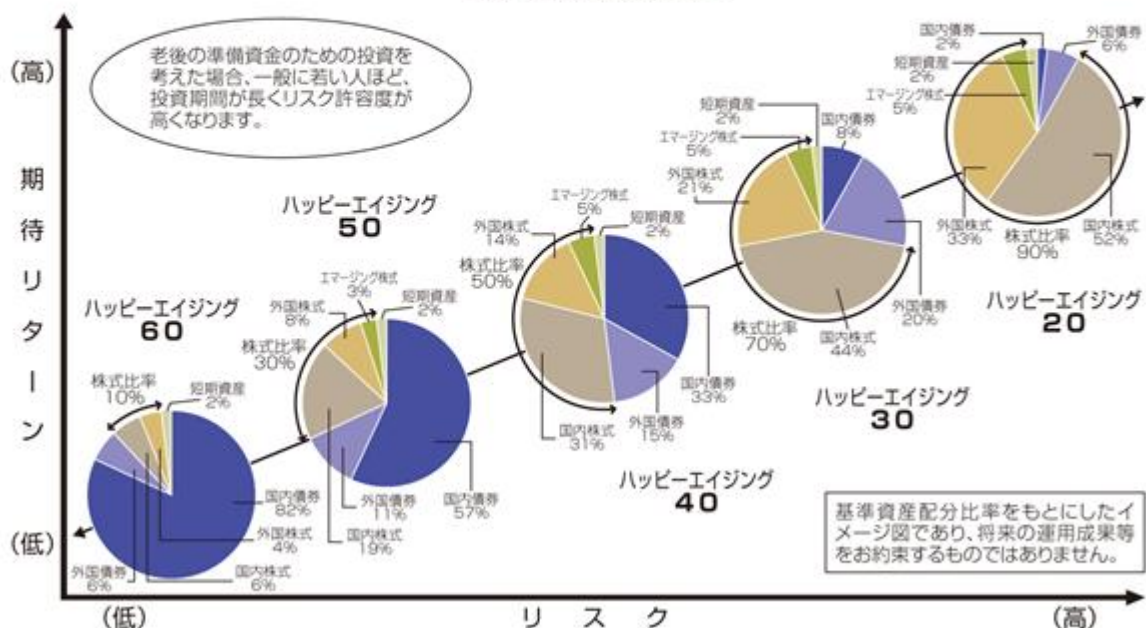
ハッピーエイジング20	国内外の株式の基準組入比率を90%とするファンドです。 リスクを積極的にとりながら資産の大きな成長を目指します。5つのファンドの中では最もリスクが高く、投資期間が長く積極的運用をお考えの方に適したファンドです。
ハッピーエイジング30	国内外の株式の基準組入比率を70%とするファンドです。 5つのファンドの中では比較的高いリスクをとり適度に高い収益を目指します。資産の成長性を重視した運用をお考えの方に適したファンドです。
ハッピーエイジング40	国内外の株式の基準組入比率を50%とするファンドです。 5つのファンドの中では、リスクのレベルは中位に位置し、リスク・リターン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目処に投資を行います。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)
エマージング株式	MSCIエマージング・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の指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。

※シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、世界主要国の国債の総合収益率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Citigroup Index LLCに帰属します。また、Citigroup Index LLC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エマージング・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エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)は、MSCIエマージング・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。

### <訂正後>

「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、「S J A M ラージキャップ・バリュール・マザーファンド」、「S J A M スモールキャップ・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。

（略）

### <ファンドの特色>

#### ファンドの目的

日本及び世界各国の株式や公社債を実質的な主要投資対象とし、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。



## ファンドの特色



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。

投資対象資産	投資対象とするマザーファンド <sup>*1</sup> 等
国内株式	SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド SJAMスモールキャップ・マザーファンド
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 <sup>*2</sup>
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 <sup>*3</sup>

<sup>\*1</sup> マザーファンドについては、後掲「ファンドの仕組み」をご参照下さい。

<sup>\*2</sup> 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に委託します。

<sup>\*3</sup> 当ファンドは2015年2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。

### TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY(略称: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。2014年12月末現在の同グループの運用資産は、約1,634億ドル(約19兆6,978億円<sup>\*</sup>)です。

<sup>\*</sup>2014年12月末時点の為替レートで換算。



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。



各ファンドの特徴は、以下のとおりです。

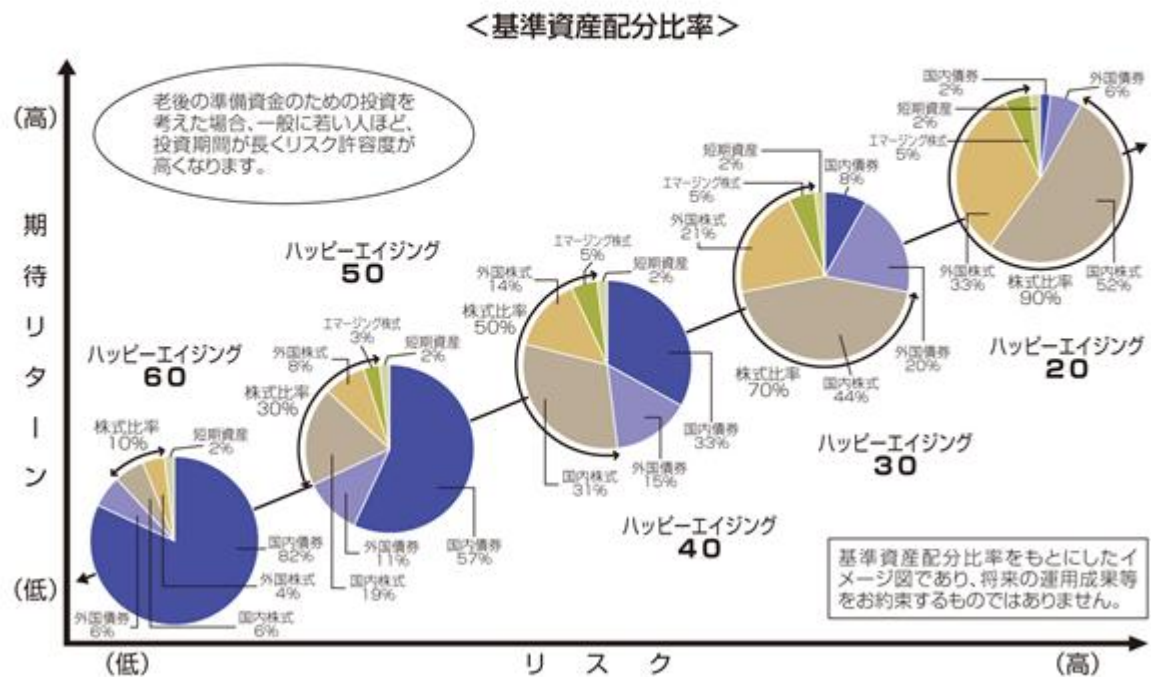
ハッピーエイジング20	国内外の株式の基準組入比率を90%とするファンドです。リスクを積極的にとりながら資産の大きな成長を目指します。5つのファンドの中では最もリスクが高く、投資期間が長く積極的運用をお考えの方に適したファンドです。
ハッピーエイジング30	国内外の株式の基準組入比率を70%とするファンドです。5つのファンドの中では比較的高いリスクをとり適度に高い収益を目指します。資産の成長性を重視した運用をお考えの方に適したファンドです。
ハッピーエイジング40	国内外の株式の基準組入比率を50%とするファンドです。5つのファンドの中では、リスクのレベルは中位に位置し、リスク・リターンのバラ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。





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。



※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目処に投資を行います。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。



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)
エマーヅィグ株式	MSCIエマーヅィグ・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、日本の公募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。
- ※シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、世界主要国の国債の総合収益率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Citigroup Index LLCに帰属します。また、Citigroup Index LLC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エマージング・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エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)は、MSCIエマージング・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】

<訂正前>

（略）

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。

<訂正後>

（略）

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。

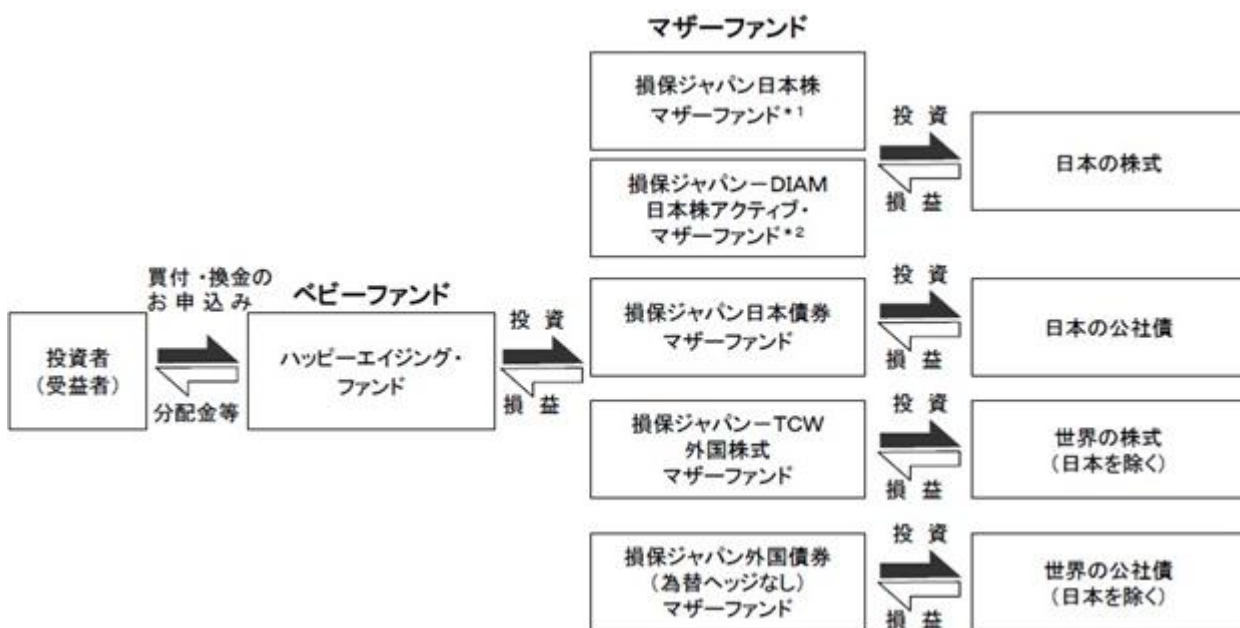
平成27年4月14日 主要投資対象とするマザーファンドのうち、「損保ジャパン日本株マザーファンド」、「損保ジャパン-DIAM日本株アクティブ・マザーファンド」を「S J A M ラージキャップ・バリュース・マザーファンド」、「S J A M スモールキャップ・マザーファンド」に変更

## （３）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

ファンドの仕組み

（略）



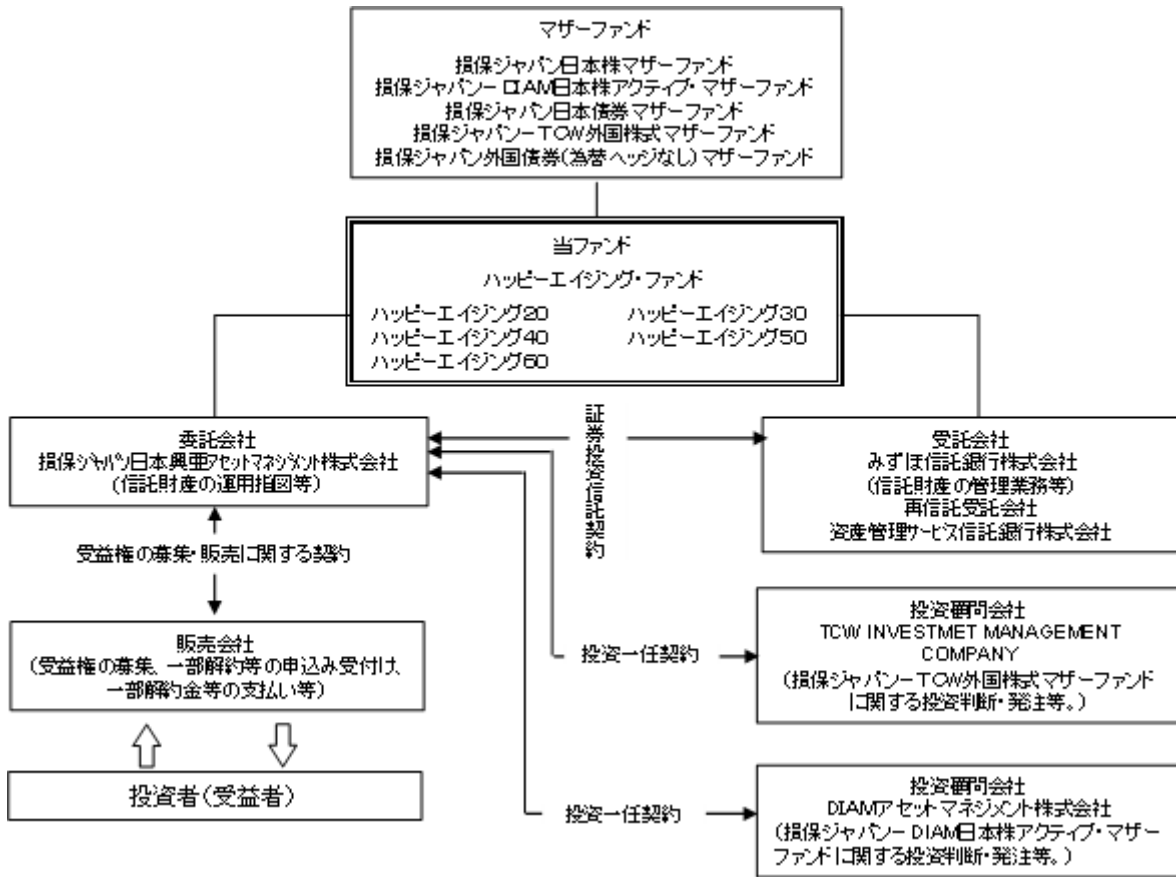
各マザーファンドには、「ハッピーエイジング・ファンド」以外にも当該マザーファンドに投資するファンド（ベビーファンド）があります。また、今後当該各マザーファンドに投資する他のファンドが設定される場合もあります。

\*平成27年4月14日以降は、マザーファンドをそれぞれ以下のとおりに変更する予定です。詳しくは、第一部 証券情報（12）その他をご参照ください。

\*1 S J A M ラージキャップ・バリュース・マザーファンド

\*2 S J A M スモールキャップ・マザーファンド

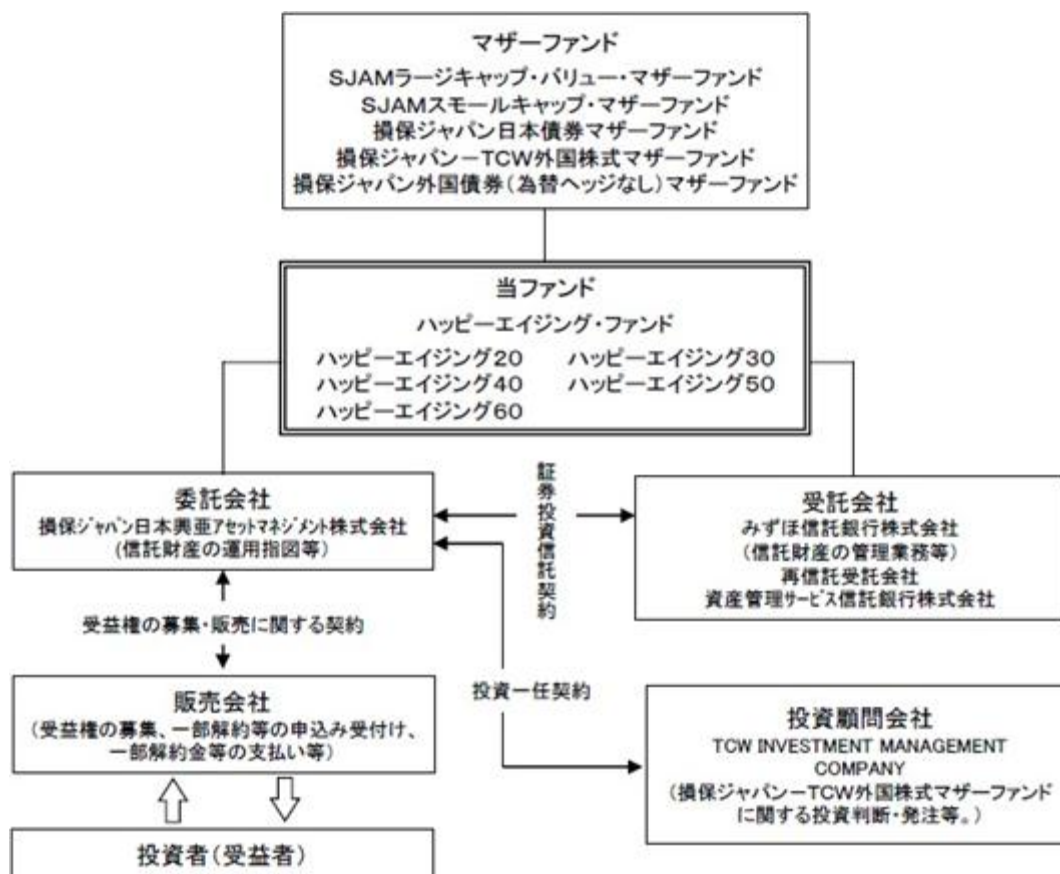
## ファンドの関係法人図\*



\*平成27年4月14日以降は、「ファンドの関係法人図」を以下のとおりに変更する予定です。詳しくは、第一部 証券情報(12)その他をご参照ください。



## ファンドの関係法人図



ファンドの関係法人

(略)

( )投資顧問会社<sup>\*</sup>：TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY〔略称：TCW〕

DIAMアセットマネジメント株式会社〔略称：DIAM〕

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。

DIAMは、委託会社との投資一任契約に基づき、「損保ジャパン - DIAM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。

\*平成27年4月14日以降は、「( )投資顧問会社」を以下のとおりに変更する予定です。詳しくは、第一部 証券情報(12)その他をご参照ください。

( )投資顧問会社：TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY〔略称：TCW〕

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。

## 委託会社等の概況

( ) 資本金の額 1,550百万円（平成26年11月末現在）

(略)

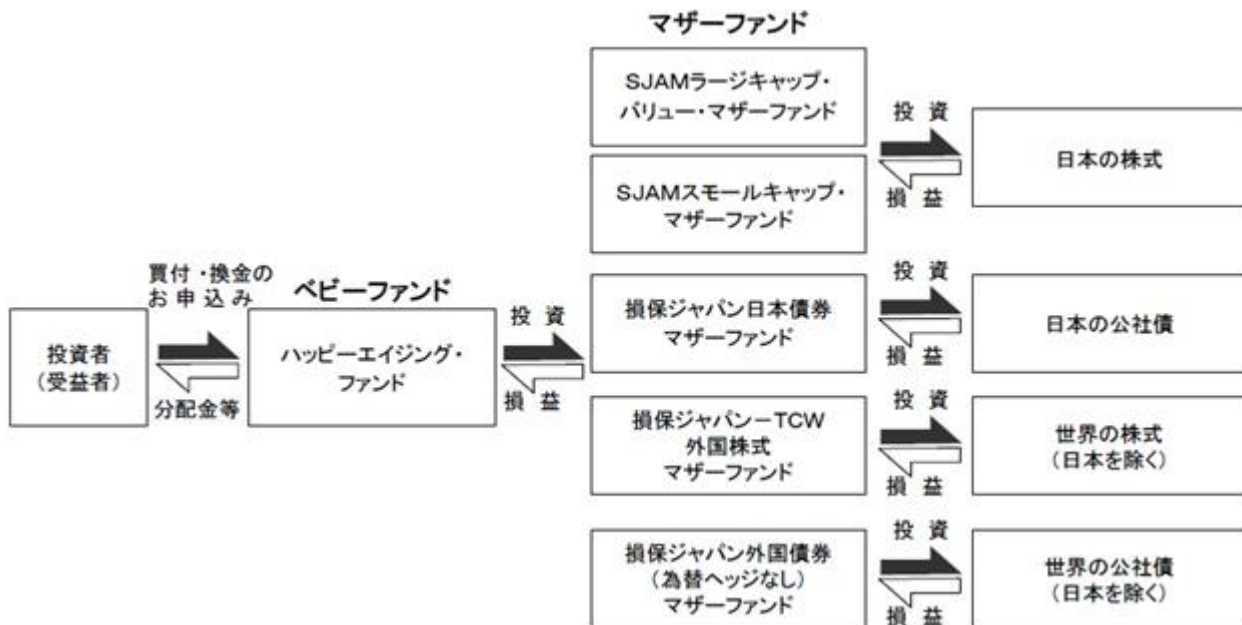
( ) 大株主の状況（平成26年11月末現在）

(略)

< 訂正後 >

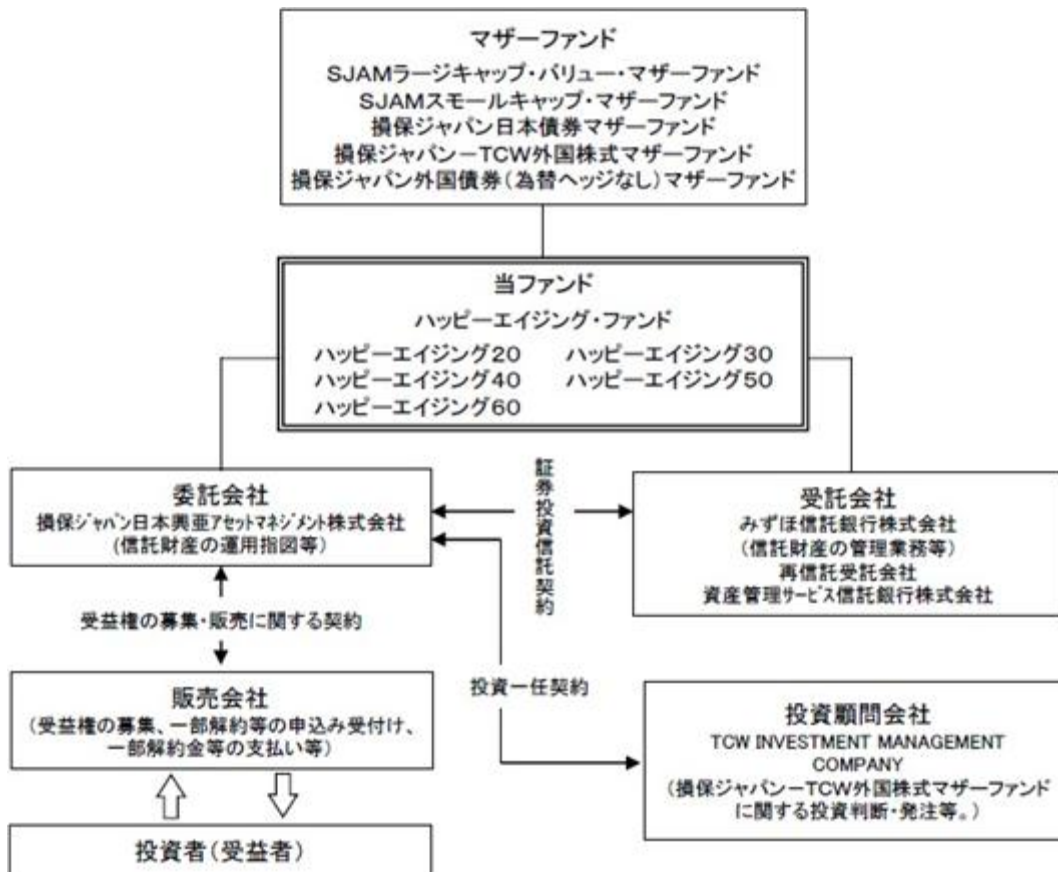
ファンドの仕組み

(略)



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

(略)

( ) 投資顧問会社：TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY〔略称：TCW〕

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。

### 委託会社等の概況

( ) 資本金の額 1,550百万円（平成27年2月末現在）

(略)

( ) 大株主の状況（平成27年2月末現在）

(略)

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

<訂正前>

（略）

#### 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<sup>\*1</sup>」、「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<sup>\*2</sup>」、「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

（略）

（ ） 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。

\*平成27年4月14日以降は、マザーファンドをそれぞれ以下のとおりに変更する予定です。詳しくは、第一部 証券情報（12）その他をご参照ください。

\*1 S J A Mラージキャップ・バリュール・マザーファンド

\*2 S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

<訂正後>

（略）

#### b. 運用方針

##### 投資対象

「S J A Mラージキャップ・バリュール・マザーファンド」、「S J A Mスモールキャップ・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

（略）

（ ） 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。

### （2）【投資対象】

<訂正前>

（略）

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<sup>\*1</sup>

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<sup>\*2</sup>

（略）



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。

\*平成27年4月14日以降は、マザーファンドをそれぞれ以下のとおりに変更する予定です。詳しくは、第一部 証券情報(12)その他をご参照ください。

\*1 S J A M ラージキャップ・バリュウ・マザーファンド

\*2 S J A M スモールキャップ・マザーファンド

<訂正後>

(略)

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. S J A M ラージキャップ・バリュウ・マザーファンド

2. S J A M スモールキャップ・マザーファンド

(略)

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】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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。

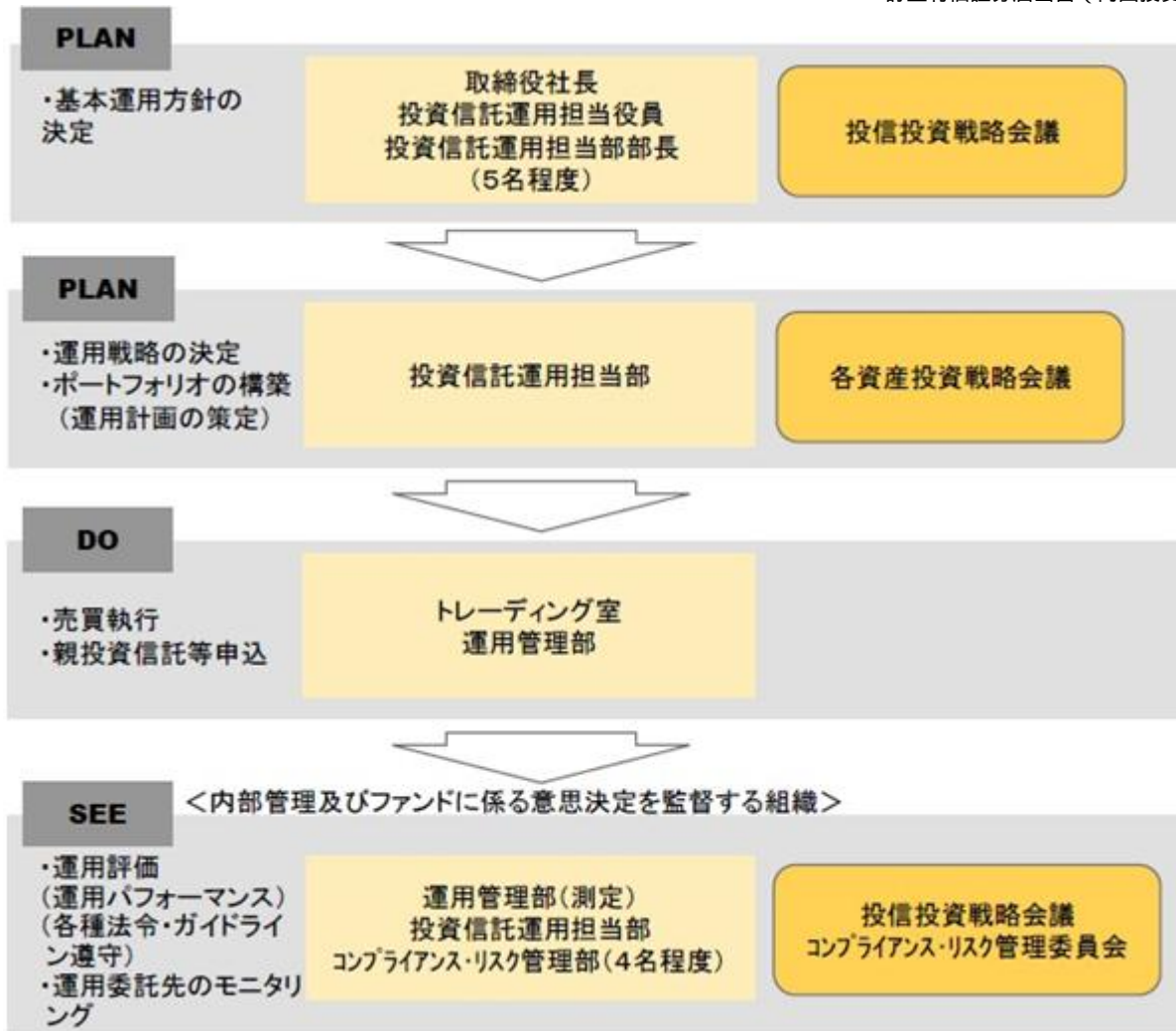
各資産投資戦略会議で策定された運用計画に基づき、トレーディング室が最良執行の観点から売買を執行します。

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。

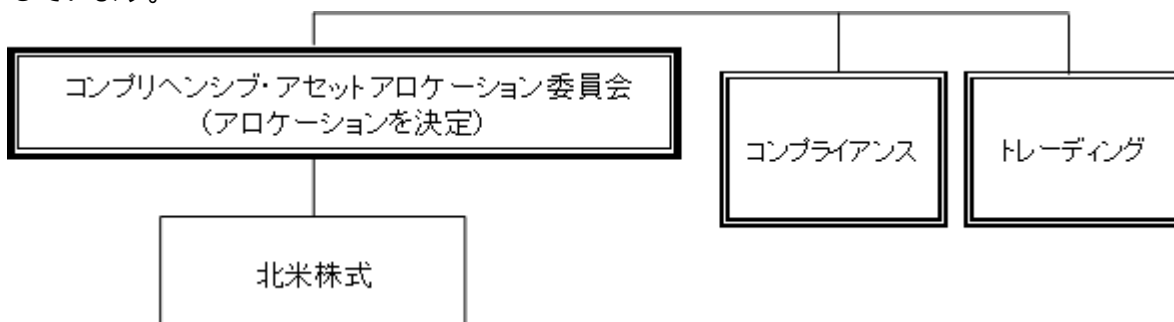
また、外部委託先の管理体制については、当社が当社以外の者に業務を委託するときの基本事項等を定めた「外部委託管理規程」に従い、定期モニタリング等を実施しています。



平成27年4月1日現在のものであり、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ライアンス・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27年1月末現在のものであり、今後変更されることもあります。)

(5) 【投資制限】

<訂正前>

a. 当ファンドの信託約款に基づく投資制限

(略)

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。<sup>\*</sup>

<sup>\*</sup> 平成27年4月14日以降は、以下のとおりに変更する予定です。詳しくは、第一部 証券情報(12)その他をご参照ください。

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券(親投資信託受益証券および上場投資信託証券(取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。))なものを含みます。以下同じ。)ならびに信託財産に既に組入っていた株式等が転換等により投資信託証券に該当することとなった投資信託証券を除きます。)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。

(略)

(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<sup>\*1</sup>

## 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。

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値を求めたものが、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。

金利先渡取引及び為替先渡取引は、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<sup>\*2</sup>

#### 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。

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。

(略)

\* 平成27年4月14日以降は、国内株式を投資対象とするマザーファンドを変更する予定です。各マザーファンドの運用の基本方針は以下のとおりです。詳しくは、第一部 証券情報(12)その他をご参照ください。

\* 1 (参考)「S J A M ラージキャップ・バリュー・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、信託財産の中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

原則としてRussell/Nomura Large Cap Value インデックス採用銘柄でかつ、当社の日本株式ユニバース構成銘柄より投資銘柄を選定します。

独自の調査分析に基づいて算出した理論株価と市場価格を比較し、割安となっている銘柄に投資することを基本にリスク管理を行いつつ最適なポートフォリオを構築し、「Russell/Nomura Large Cap Value インデックス(配当を含むトータルリターンインデックス)」を中長期的に上回る運用成果を目指します。

転換社債、ならびに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。

### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資割合は、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および新株予約権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

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21条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第22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23条の範囲で行います。

## \* 2 （参考）「S J A Mスモールキャップ・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、信託財産の中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

原則として、Russell/Nomura Small Cap インデックス採用銘柄でかつ、当社の日本株式ユニバース構成銘柄より投資銘柄を選定します。

独自の調査分析に基づいて算出した理論株価と市場価格を比較し、割安となっている銘柄に投資することを基本にリスクを軽減しつつ、「Russell/Nomura Small Cap インデックス（配当を含むトータルリターンインデックス）」を中長期的に上回る運用成果を目指します。

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。

投資環境によっては、防衛的な観点から運用者の判断で、主要投資対象への投資を大幅に縮小する場合があります。

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。

### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資割合は、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および新株予約権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

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21条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第22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23条の範囲で行います。

<訂正後>

a. 当ファンドの信託約款に基づく投資制限

(略)

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（親投資信託受益証券および上場投資信託証券（取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）なものをいいます。以下同じ。））ならびに信託財産に既に組入れていた株式等が転換等により投資信託証券に該当することとなった投資信託証券を除きます。）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。

(略)

(参考)「S」JAMラージキャップ・バリュー・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、信託財産の中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

原則としてRussell/Nomura Large Cap Value インデックス採用銘柄でかつ、当社の日本株式ユニバース構成銘柄より投資銘柄を選定します。

独自の調査分析に基づいて算出した理論株価と市場価格を比較し、割安となっている銘柄に投資することを基本にリスク管理を行いつつ最適なポートフォリオを構築し、「Russell/Nomura Large Cap Value インデックス（配当を含むトータルリターンインデックス）」を中長期的に上回る運用成果を目指します。

転換社債、ならびに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。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資割合は、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および新株予約権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

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21条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第22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23条の範囲で行います。

（参考）「S J A Mスモールキャップ・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、信託財産の中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

原則として、Russell/Nomura Small Cap インデックス採用銘柄でかつ、当社の日本株式ユニバース構成銘柄より投資銘柄を選定します。

独自の調査分析に基づいて算出した理論株価と市場価格を比較し、割安となっている銘柄に投資することを基本にリスクを軽減しつつ、「Russell/Nomura Small Cap インデックス（配当を含むトータルリターンインデックス）」を中長期的に上回る運用成果を目指します。

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。

投資環境によっては、防衛的な観点から運用者の判断で、主要投資対象への投資を大幅に縮小する場合があります。

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。

### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資割合は、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および新株予約権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。

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21条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第22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23条の範囲で行います。

（略）

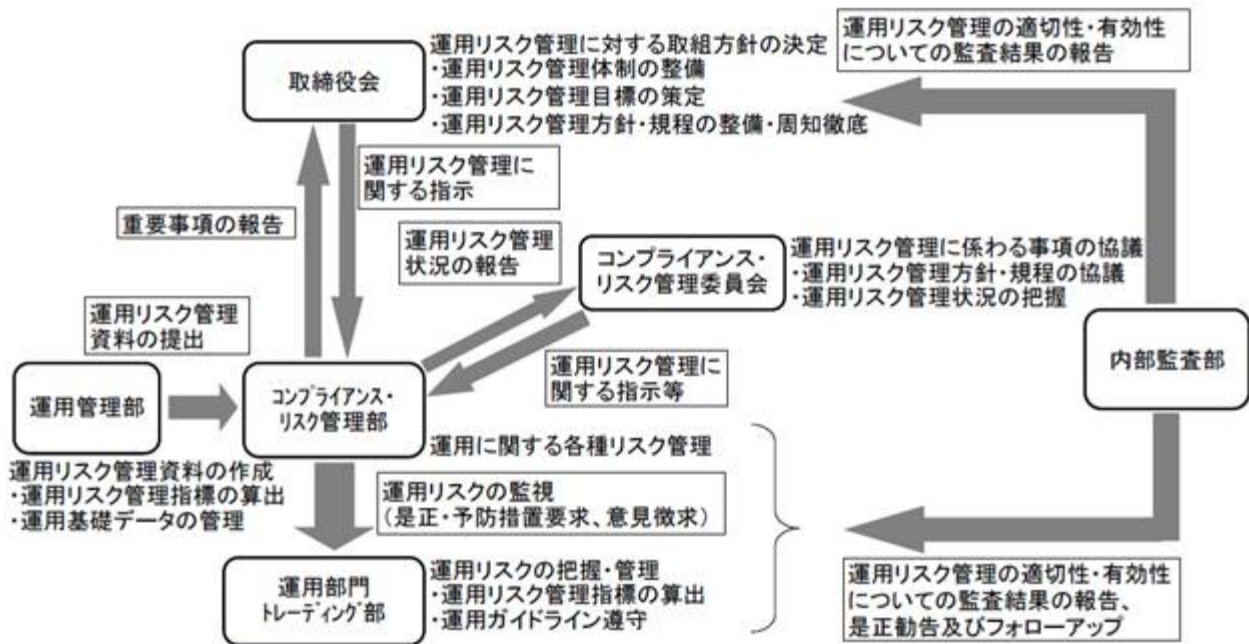
### 3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

#### <リスクの管理体制>

##### a. 委託会社のリスク管理体制



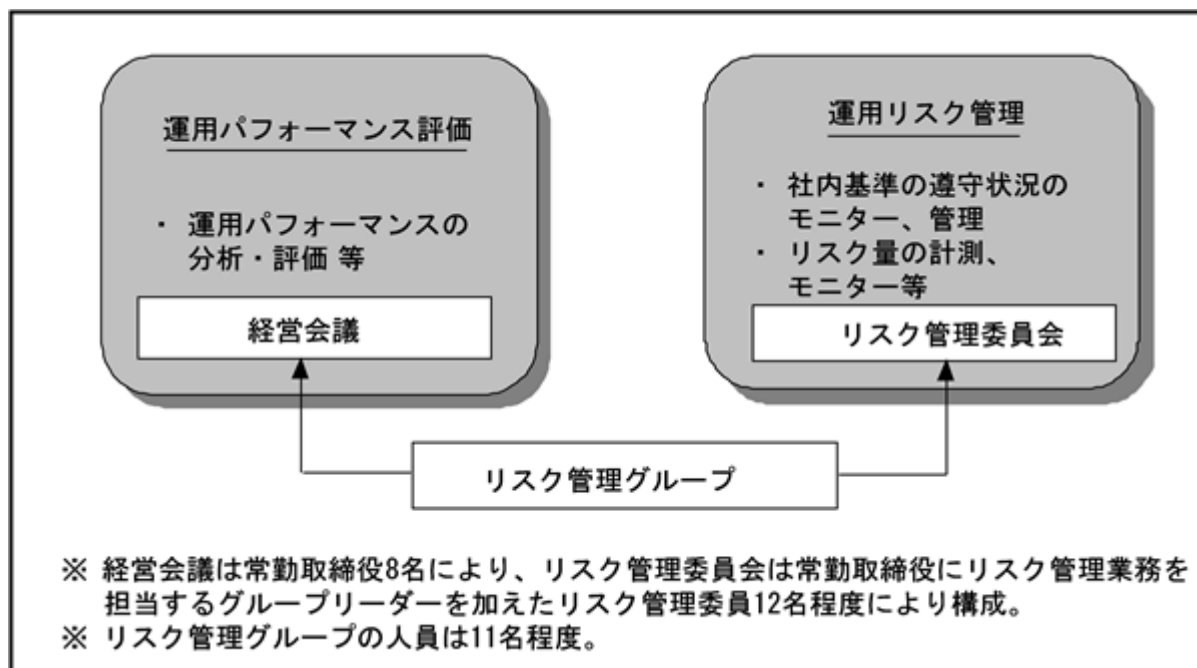
※運用リスクには流動性リスクを含みます。

(注) 上図は、平成26年11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-T C W外国株式マザーファンドの運用委託先であるT C W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、T C Wが行った取引については、T C W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-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26年10月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

\* 平成27年4月14日以降は、「b. 運用委託先のリスク管理体制等」を以下のとおりに変更する予定です。詳しくは、第一部 証券情報（12）その他をご参照ください。

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。

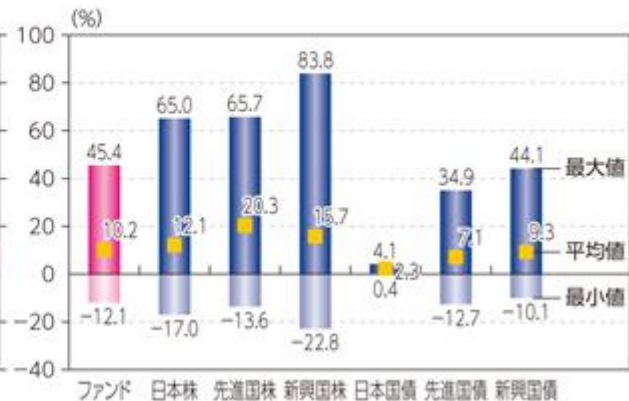
ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移  
2009年11月～2014年10月

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較  
2009年11月～2014年10月

#### ハッピーエイジング20



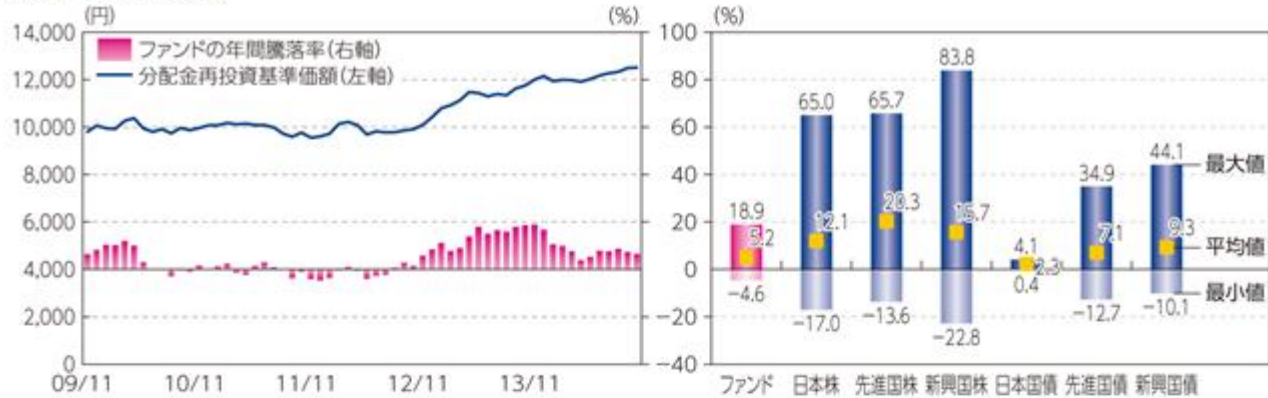
#### ハッピーエイジング30



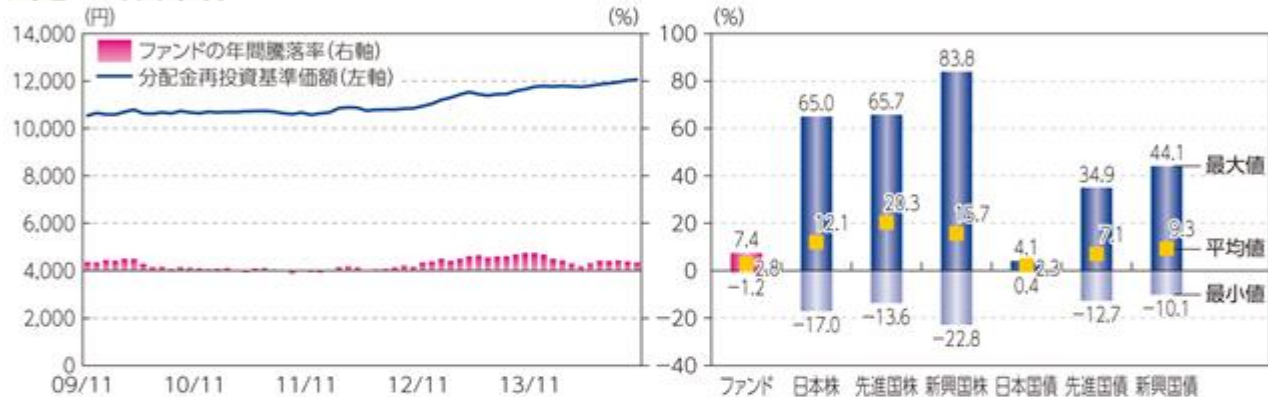
#### ハッピーエイジング40



## ハッピーエイジング50



## ハッピーエイジング60



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

●上記は、期間5年のグラフになります。

●「ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較」は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## \*各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数(TOPIX) (配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

日本国債…NOMURA-BPI 国債

先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債…シティ新興国市場国債インデックス(円ベース)

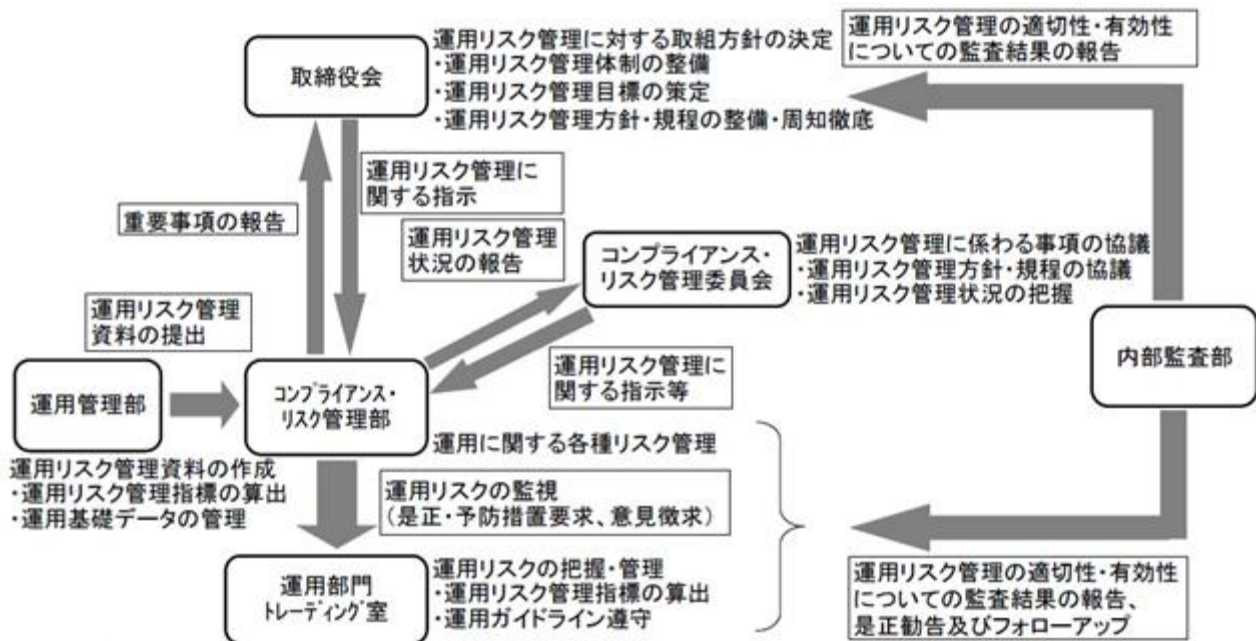
- 東証株価指数(TOPIX)とは、東京証券取引所第一部上場全銘柄の基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所の知的財産であり、東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの高標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
- MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI 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エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、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。
- NOMURA-BPI 国債とは、野村證券が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。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。
- シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、世界主要国の国債の総合収益率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Citigroup Index LLCに帰属します。また、Citigroup Index LLC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。
- シティ新興国市場国債インデックスは、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、主要新興国の国債の総合収益率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Citigroup Index LLCに帰属します。また、Citigroup Index LLC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。

< 訂正後 >

( 略 )

## < リスクの管理体制 >

### a . 委託会社のリスク管理体制



※運用リスクには流動性リスクを含みます。

( 注 ) 上図は、平成27年4月1日現在のものであり、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-T C W外国株式マザーファンドの運用委託先であるT C W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、T C Wが行った取引については、T C W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。



ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移  
2010年2月～2015年1月

ハッピーエイジング20



ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較  
2010年2月～2015年1月



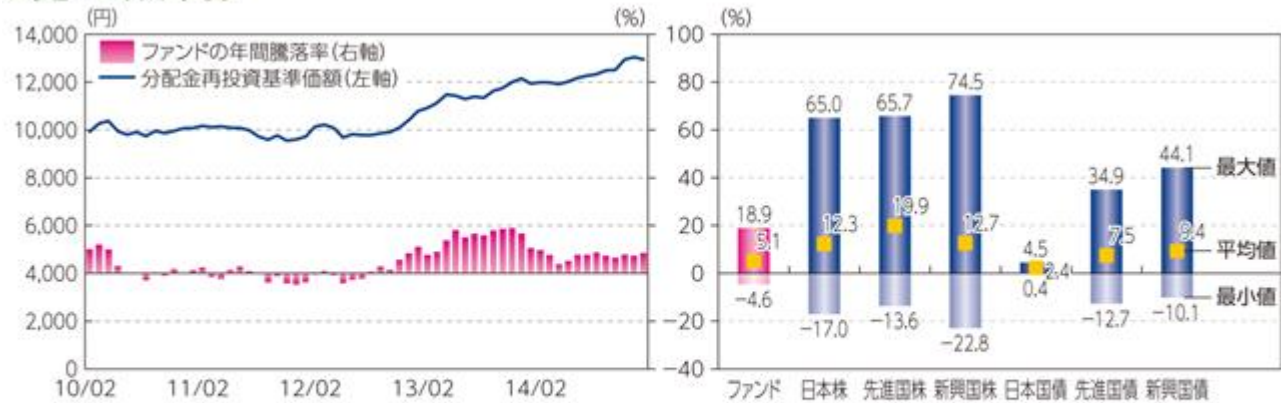
ハッピーエイジング30



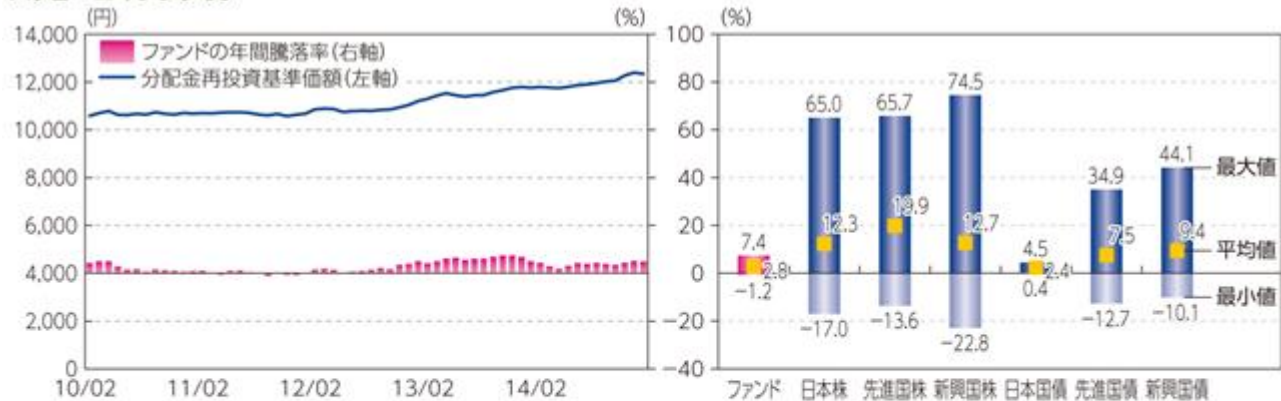
ハッピーエイジング40



## ハッピーエイジング50



## ハッピーエイジング60



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

●上記は、期間5年のグラフになります。

●「ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較」は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## \*各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

日本国債…NOMURA-BPI 国債

先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債…シティ新興国市場国債インデックス(円ベース)

- 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の高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。
- MSCIコクサイ・インデックスは、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。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エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、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。
- NOMURA-BPI 国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。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て一切責任を負いません。
- シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、世界主要国の国債の総合収益率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Citigroup Index LLCに帰属します。また、Citigroup Index LLC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。
- シティ新興国市場国債インデックスは、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、主要新興国の国債の総合収益率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Citigroup Index LLCに帰属します。また、Citigroup Index LLC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。

## 4【手数料等及び税金】

## (2)【換金(解約)手数料】

<訂正前>

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。<sup>\*</sup>

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%



\*平成27年4月14日以降は、以下のとおりに変更する予定です。詳しくは、第一部 証券情報(12)

その他をご参照ください。

換金(解約)手数料はかかりません。信託財産留保額はありませぬ。

<訂正後>

換金(解約)手数料はかかりません。信託財産留保額はありませぬ。

### (3)【信託報酬等】

<訂正前>

(略)

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及び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、各ファンドの純資産総額に当該計算期間を通じて毎日、D I A Mに対しては年0.08424%(税抜0.078%)以内、T C Wに対しては年

0.1056%以内の率を乗じて得た金額とします。〔ファンドの運用の対価〕<sup>\*</sup>

\*平成27年4月14日以降は、以下のとおりに変更する予定です。詳しくは、第一部 証券情報(12)

その他をご参照ください。

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、各ファンドの純資産総額に当該計算期間を通じて毎日、年0.1056%以内の率を乗じて得た金額とします。〔ファンドの運用の対価〕

(略)

<訂正後>

(略)

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、各ファンドの純資産総額に当該計算期間を通じて毎日、年0.1056%以内の率を乗じて得た金額とします。〔ファンドの運用の対価〕

(略)

### (5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

上記は平成26年11月末現在のものですので、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。

<訂正後>

(略)

上記は平成27年2月末現在のものですので、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】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## （１）【投資状況】

## ハッピーエイジング２０

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	364,832,955	4.59
内 アメリカ	364,832,955	4.59
親投資信託受益証券	7,431,217,698	93.42
内 日本	7,431,217,698	93.42
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	158,784,964	2.00
純資産総額	7,954,835,617	100.00

## ハッピーエイジング３０

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	439,639,343	4.60
内 アメリカ	439,639,343	4.60
親投資信託受益証券	8,928,783,664	93.41
内 日本	8,928,783,664	93.41
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	190,288,725	1.99
純資産総額	9,558,711,732	100.00

## ハッピーエイジング４０

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	536,401,842	4.62
内 アメリカ	536,401,842	4.62
親投資信託受益証券	10,851,507,667	93.39
内 日本	10,851,507,667	93.39
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	231,954,559	2.00
純資産総額	11,619,864,068	100.00

## ハッピーエイジング５０

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	146,510,075	2.77
内 アメリカ	146,510,075	2.77
親投資信託受益証券	5,038,830,910	95.16
内 日本	5,038,830,910	95.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	109,588,063	2.07
純資産総額	5,294,929,048	100.00

## ハッピーエイジング60

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	3,159,899,814	98.11
内 日本	3,159,899,814	98.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	61,016,490	1.89
純資産総額	3,220,916,304	100.00

（参考）マザーファンドの投資状況  
損保ジャパン日本株マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	10,875,883,370	99.25
内 日本	10,875,883,370	99.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	81,761,300	0.75
純資産総額	10,957,644,670	100.00

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27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	6,576,791,050	98.99
内 日本	6,576,791,050	98.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	66,842,737	1.01
純資産総額	6,643,633,787	100.00

損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	9,409,582,740	61.72
内 日本	9,409,582,740	61.72
地方債証券	40,081,920	0.26
内 日本	40,081,920	0.26
特殊債券	1,954,609,472	12.82
内 日本	1,954,609,472	12.82
社債券	3,736,669,700	24.51
内 日本	2,735,068,800	17.94
内 フランス	400,302,200	2.63
内 オランダ	301,034,800	1.97
内 イギリス	200,053,200	1.31
内 ドイツ	100,210,700	0.66
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	105,072,016	0.69
純資産総額	15,246,015,848	100.00

## 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27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	5,303,776,491	94.51
内 アメリカ	2,286,670,199	40.75
内 イタリア	687,402,939	12.25
内 ドイツ	641,385,272	11.43
内 イギリス	457,119,118	8.15
内 フランス	347,600,638	6.19
内 スペイン	279,944,614	4.99
内 メキシコ	151,776,544	2.70
内 カナダ	119,143,663	2.12
内 ベルギー	111,181,418	1.98
内 オランダ	106,547,455	1.90
内 ポーランド	34,246,883	0.61
内 南アフリカ	29,790,830	0.53
内 マレーシア	26,433,587	0.47
内 スウェーデン	24,533,331	0.44
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	308,289,842	5.49
純資産総額	5,612,066,333	100.00

## 損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	8,907,538,698	90.33
内 アメリカ	6,220,570,053	63.09
内 イギリス	555,787,202	5.64
内 ドイツ	427,346,255	4.33
内 スイス	346,281,812	3.51
内 フランス	274,361,633	2.78
内 オランダ	268,441,233	2.72
内 オーストラリア	133,041,888	1.35
内 シンガポール	99,801,437	1.01
内 香港	80,981,312	0.82
内 アイルランド	79,394,619	0.81
内 バミューダ	74,600,087	0.76
内 ジャージー	71,817,707	0.73
内 オランダ領アンチル	70,407,587	0.71
内 ノルウェー	54,182,737	0.55
内 カナダ	44,856,694	0.45

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
	内 ベルギー	44,052,852	0.45
	内 デンマーク	16,631,395	0.17
	内 スペイン	16,041,180	0.16
	内 プエルトリコ	11,162,208	0.11
	内 スウェーデン	6,789,922	0.07
	内 イスラエル	6,000,036	0.06
	内 ケイマン諸島	4,988,849	0.05
投資証券		293,782,853	2.98
	内 アメリカ	293,782,853	2.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		659,271,716	6.69
純資産総額		9,860,593,267	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）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

## （2）【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

ハッピーエイジング20

平成27年1月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率（％） 償還日	投資 比率
1	損保ジャパン - T C W外国株式 マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	1,671,437,380	1.3975 2,335,896,622	1.5976 2,670,288,358	- -	33.57%
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 日本	親投資信 託受益証 券	1,381,541,843	1.3279 1,834,592,795	1.4934 2,063,194,588	- -	25.94%
3	損保ジャパン日本株マザーファ ンド 日本	親投資信 託受益証 券	1,288,252,787	1.4498 1,867,761,787	1.5966 2,056,824,399	- -	25.86%
4	損保ジャパン外国債券（為替 ヘッジなし）マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	304,185,247	1.4233 432,965,191	1.5810 480,916,875	- -	6.05%
5	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託 受益証券	76,901	5,188.75 399,020,300	4,744.18 364,832,955	- -	4.59%
6	損保ジャパン日本債券マザー ファンド 日本	親投資信 託受益証 券	119,971,115	1.3017 156,171,787	1.3336 159,993,478	- -	2.01%

（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。



## 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年1月30日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	4.59%
親投資信託受益証券	93.42%
合計	98.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## ハッピーエイジング30

平成27年1月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	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 日本	親投資信 託受益証 券	1,404,963,323	1.3276 1,865,303,843	1.4934 2,098,172,226	- -	21.95%
2	損保ジャパン日本株マザーファ ンド 日本	親投資信 託受益証 券	1,310,028,516	1.4488 1,897,971,485	1.5966 2,091,591,528	- -	21.88%
3	損保ジャパン - T C W外国株式 マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	1,278,551,850	1.3959 1,784,780,999	1.5976 2,042,614,435	- -	21.37%
4	損保ジャパン外国債券（為替 ヘッジなし）マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	1,218,901,224	1.4196 1,730,440,972	1.5810 1,927,082,835	- -	20.16%
5	損保ジャパン日本債券マザー ファンド 日本	親投資信 託受益証 券	576,876,605	1.2998 749,827,954	1.3336 769,322,640	- -	8.05%
6	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託 受益証券	92,669	5,176.66 479,716,072	4,744.18 439,639,343	- -	4.60%

（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。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年1月30日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	4.60%
親投資信託受益証券	93.41%
合計	98.01%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## ハッピーエイジング40

平成27年1月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	損保ジャパン日本債券マザー ファンド 日本	親投資信 託受益証 券	2,890,975,290	1.2992 3,756,211,972	1.3336 3,855,404,646	- -	33.18%
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 日本	親投資信 託受益証 券	1,202,466,713	1.3276 1,596,401,561	1.4934 1,795,763,789	- -	15.45%
3	損保ジャパン日本株マザーファ ンド 日本	親投資信 託受益証 券	1,121,186,479	1.4478 1,623,280,935	1.5966 1,790,086,332	- -	15.41%
4	損保ジャパン外国債券（為替 ヘッジなし）マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	1,110,614,300	1.4181 1,574,989,036	1.5810 1,755,881,208	- -	15.11%
5	損保ジャパン - T C W外国株式 マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	1,035,535,611	1.3940 1,443,639,667	1.5976 1,654,371,692	- -	14.24%
6	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託 受益証券	113,065	5,181.52 585,849,280	4,744.18 536,401,842	- -	4.62%

（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。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年1月30日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	4.62%
親投資信託受益証券	93.39%
合計	98.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## ハッピーエイジング50

平成27年1月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	損保ジャパン日本債券マザー ファンド 日本	親投資信 託受益証 券	2,268,827,747	1.2984 2,946,064,280	1.3336 3,025,708,683	- -	57.14%
2	損保ジャパン外国債券（為替 ヘッジなし）マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	370,049,250	1.4170 524,362,418	1.5810 585,047,864	- -	11.05%
3	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 日本	親投資信 託受益証 券	334,850,347	1.3282 444,776,188	1.4934 500,065,508	- -	9.44%

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
4	損保ジャパン日本株マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	312,214,554	1.4486 452,295,864	1.5966 498,481,756	- -	9.41%
5	損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	268,857,724	1.3975 375,735,382	1.5976 429,527,099	- -	8.11%
6	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託受益証券	30,882	5,189.42 160,259,898	4,744.18 146,510,075	- -	2.77%

(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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年1月30日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	2.77%
親投資信託受益証券	95.16%
合計	97.93%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### ハッピーエイジング60

平成27年1月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	損保ジャパン日本債券マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,982,677,875	1.2979 2,573,327,396	1.3336 2,644,099,214	- -	82.09%
2	損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	122,604,044	1.4159 173,605,427	1.5810 193,836,993	- -	6.02%
3	損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	81,653,463	1.4046 114,698,443	1.5976 130,449,572	- -	4.05%
4	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 日本	親投資信託受益証券	64,222,157	1.3302 85,433,356	1.4934 95,909,369	- -	2.98%
5	損保ジャパン日本株マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	59,880,162	1.4510 86,886,269	1.5966 95,604,666	- -	2.97%

(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。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年1月30日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.11%
合計	98.11%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考) マザーファンドの投資資産

損保ジャパン日本株マザーファンド

平成27年1月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	66,600	6,170.00 410,922,000	7,645.00 509,157,000	- -	4.65%
2	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	55,600	6,408.00 356,285,169	7,020.00 390,312,000	- -	3.56%
3	ジェイ エフ イー ホールディングス 日本	株式 鉄鋼	128,700	2,128.00 273,873,600	2,611.50 336,100,050	- -	3.07%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	499,700	624.70 312,166,229	632.30 315,960,310	- -	2.88%
5	MS&ADインシュアランスグループホールディングス 日本	株式 保険業	101,000	2,411.87 243,599,255	2,889.50 291,839,500	- -	2.66%
6	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	66,000	4,246.34 280,259,034	3,990.50 263,373,000	- -	2.40%
7	三井物産 日本	株式 卸売業	172,400	1,633.16 281,557,567	1,507.00 259,806,800	- -	2.37%
8	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	72,500	3,577.57 259,373,909	3,581.00 259,622,500	- -	2.37%
9	ヤマダ電機 日本	株式 小売業	588,600	361.57 212,822,085	440.00 258,984,000	- -	2.36%
10	三菱商事 日本	株式 卸売業	124,100	2,148.22 266,595,197	2,068.00 256,638,800	- -	2.34%
11	住友商事 日本	株式 卸売業	215,000	1,378.33 296,342,775	1,168.00 251,120,000	- -	2.29%
12	第一生命保険 日本	株式 保険業	157,300	1,491.49 234,612,378	1,594.00 250,736,200	- -	2.29%
13	JXホールディングス 日本	株式 石油・石炭製品	556,200	521.86 290,263,093	435.80 242,391,960	- -	2.21%
14	マツダ 日本	株式 輸送用機器	98,700	2,480.95 244,870,388	2,447.50 241,568,250	- -	2.20%
15	旭硝子 日本	株式 ガラス・土石製品	370,000	591.41 218,822,577	630.00 233,100,000	- -	2.13%
16	クラレ 日本	株式 化学	154,900	1,327.88 205,689,643	1,488.00 230,491,200	- -	2.10%

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
17	大阪瓦斯 日本	株式 電気・ガス業	484,000	435.86 210,959,864	466.60 225,834,400	- -	2.06%
18	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	212,000	987.66 209,384,302	1,016.50 215,498,000	- -	1.97%
19	日立製作所 日本	株式 電気機器	238,000	769.20 183,070,249	897.30 213,557,400	- -	1.95%
20	フジ・メディア・ホールディングス 日本	株式 情報・通信業	130,200	1,635.43 212,934,133	1,487.00 193,607,400	- -	1.77%
21	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	20,100	8,150.22 163,819,520	9,130.00 183,513,000	- -	1.67%
22	長谷工コーポレーション 日本	株式 建設業	177,500	798.17 141,676,640	965.00 171,287,500	- -	1.56%
23	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	41,100	3,326.61 136,724,061	4,140.00 170,154,000	- -	1.55%
24	三菱ケミカルホールディングス 日本	株式 化学	268,000	448.50 120,200,053	614.10 164,578,800	- -	1.50%
25	富士通 日本	株式 電気機器	258,000	636.77 164,288,936	625.60 161,404,800	- -	1.47%
26	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	562,000	314.96 177,011,151	277.50 155,955,000	- -	1.42%
27	キャノン 日本	株式 電気機器	41,100	3,300.00 135,630,000	3,740.50 153,734,550	- -	1.40%
28	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	774,000	193.52 149,791,888	194.00 150,156,000	- -	1.37%
29	ツムラ 日本	株式 医薬品	51,000	2,446.81 124,787,723	2,691.00 137,241,000	- -	1.25%
30	ケーズホールディングス 日本	株式 小売業	37,600	2,889.20 108,634,196	3,470.00 130,472,000	- -	1.19%

(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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年1月30日現在

種類	投資比率
株式	99.25%
合計	99.25%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

平成27年1月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
輸送用機器	国内	13.74%
卸売業		9.40%
小売業		8.70%
銀行業		8.06%
情報・通信業		7.47%
電気機器		7.37%



業種	国内/外国	投資比率
保険業		6.88%
化学		6.46%
鉄鋼		6.17%
機械		3.27%
ガラス・土石製品		3.14%
石油・石炭製品		3.09%
陸運業		2.91%
電気・ガス業		2.39%
建設業		2.32%
医薬品		1.54%
その他製品		1.03%
食料品		1.02%
繊維製品		0.97%
不動産業		0.74%
海運業		0.61%
その他金融業		0.53%
パルプ・紙		0.53%
サービス業		0.36%
倉庫・運輸関連業		0.35%
水産・農林業		0.22%
合計		99.25%

（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。

#### 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27年1月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	50,900	6,039.42 307,406,953	7,645.00 389,130,500	- -	5.86%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	380,600	605.44 230,433,041	632.30 240,653,380	- -	3.62%
3	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	44,900	4,132.85 185,564,997	3,990.50 179,173,450	- -	2.70%
4	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	41,300	2,955.03 122,042,785	4,296.50 177,445,450	- -	2.67%
5	KDDI 日本	株式 情報・通信業	20,500	6,331.01 129,785,783	8,363.00 171,441,500	- -	2.58%
6	ミネベア 日本	株式 電気機器	80,000	1,223.26 97,860,992	1,837.00 146,960,000	- -	2.21%
7	朝日インテック 日本	株式 精密機器	22,300	4,212.84 93,946,366	6,280.00 140,044,000	- -	2.11%
8	カシオ計算機 日本	株式 電気機器	70,500	1,708.80 120,470,564	1,859.00 131,059,500	- -	1.97%

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
9	日立製作所 日本	株式 電気機器	146,000	769.07 112,285,262	897.30 131,005,800	- -	1.97%
10	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	31,000	3,313.05 102,704,789	4,140.00 128,340,000	- -	1.93%
11	日本電産 日本	株式 電気機器	15,800	6,527.07 103,127,813	8,074.00 127,569,200	- -	1.92%
12	三井不動産 日本	株式 不動産業	37,000	3,436.13 127,137,010	3,000.50 111,018,500	- -	1.67%
13	ウエルシアホールディングス 日本	株式 小売業	24,800	3,271.87 81,142,418	4,345.00 107,756,000	- -	1.62%
14	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	14,800	7,669.64 113,510,811	6,963.00 103,052,400	- -	1.55%
15	ヤマハ発動機 日本	株式 輸送用機器	38,400	1,772.35 68,058,514	2,612.00 100,300,800	- -	1.51%
16	熊谷組 日本	株式 建設業	259,000	271.23 70,249,271	375.00 97,125,000	- -	1.46%
17	アサヒグループホールディングス 日本	株式 食料品	24,700	3,462.80 85,531,289	3,889.00 96,058,300	- -	1.45%
18	イリソ電子工業 日本	株式 電気機器	13,900	6,341.53 88,147,317	6,880.00 95,632,000	- -	1.44%
19	三菱電機 日本	株式 電気機器	69,000	1,334.48 92,079,562	1,376.50 94,978,500	- -	1.43%
20	キーエンス 日本	株式 電気機器	1,700	52,290.37 88,893,630	55,490.00 94,333,000	- -	1.42%
21	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	339,000	311.36 105,554,338	277.50 94,072,500	- -	1.42%
22	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	20,600	4,381.36 90,256,165	4,337.50 89,352,500	- -	1.34%
23	塩野義製薬 日本	株式 医薬品	24,500	2,238.58 54,845,444	3,555.00 87,097,500	- -	1.31%
24	三菱重工業 日本	株式 機械	131,000	655.18 85,828,693	655.10 85,818,100	- -	1.29%
25	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	12,000	6,770.94 81,251,353	7,020.00 84,240,000	- -	1.27%
26	三和ホールディングス 日本	株式 金属製品	102,200	717.79 73,358,231	820.00 83,804,000	- -	1.26%
27	西日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	12,900	4,639.23 59,846,170	6,078.00 78,406,200	- -	1.18%
28	ダイセル 日本	株式 化学	53,000	1,006.92 53,367,214	1,475.00 78,175,000	- -	1.18%
29	イズミ 日本	株式 小売業	17,800	3,217.62 57,273,670	4,250.00 75,650,000	- -	1.14%
30	ニトリホールディングス 日本	株式 小売業	11,300	5,823.71 65,808,031	6,680.00 75,484,000	- -	1.14%

(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。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年1月30日現在

種類	投資比率
株式	98.99%
合計	98.99%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成27年1月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	17.45%
輸送用機器		11.41%
情報・通信業		8.46%
銀行業		6.32%
医薬品		5.62%
小売業		5.35%
化学		4.92%
陸運業		3.71%
精密機器		3.42%
建設業		3.18%
機械		3.15%
食料品		3.10%
不動産業		3.03%
卸売業		2.76%
鉄鋼		2.68%
ガラス・土石製品		2.43%
サービス業		1.94%
保険業		1.93%
その他金融業		1.47%
電気・ガス業		1.45%
金属製品		1.26%
証券、商品先物取引業	1.11%	
非鉄金属	1.04%	
その他製品	1.04%	
空運業	0.77%	
合計		98.99%

（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。

## 損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成27年1月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	1 2 1 5年国債 日本	国債証券	2,650,000,000	99.94 2,648,449,500	100.27 2,657,237,150	0.100000 2019/9/20	17.43%
2	1 4 8 20年国債 日本	国債証券	1,120,000,000	101.85 1,140,720,000	108.55 1,215,799,200	1.500000 2034/3/20	7.97%
3	3 2 0 10年国債 日本	国債証券	880,000,000	106.38 936,216,200	106.37 936,097,360	1.000000 2021/12/20	6.14%
4	4 3 30年国債 日本	国債証券	820,000,000	100.59 824,899,600	109.31 896,366,600	1.700000 2044/6/20	5.88%
5	1 2 2 5年国債 日本	国債証券	770,000,000	100.31 772,405,700	100.24 771,876,490	0.100000 2019/12/20	5.06%
6	1 2 0 5年国債 日本	国債証券	580,000,000	100.66 583,855,000	100.73 584,268,800	0.200000 2019/9/20	3.83%
7	3 1 8 10年国債 日本	国債証券	510,000,000	106.07 540,957,000	106.21 541,697,520	1.000000 2021/9/20	3.55%
8	4 5 30年国債 日本	国債証券	490,000,000	105.39 516,430,200	104.52 512,172,010	1.500000 2044/12/20	3.36%
9	1 5 0 20年国債 日本	国債証券	310,000,000	102.32 317,215,000	106.56 330,354,290	1.400000 2034/9/20	2.17%
10	4 4 30年国債 日本	国債証券	290,000,000	103.94 301,427,600	109.31 317,007,700	1.700000 2044/9/20	2.08%
11	1 4 9 20年国債 日本	国債証券	290,000,000	102.19 296,373,900	108.47 314,567,060	1.500000 2034/6/20	2.06%
12	1 1 9 5年国債 日本	国債証券	280,000,000	99.96 279,888,000	100.26 280,735,560	0.100000 2019/6/20	1.84%
13	4 2 8 東京電力 日本	社債券	200,000,000	102.18 204,372,000	100.98 201,962,000	4.100000 2015/5/29	1.32%
14	8 6 住宅機構R M B S 日本	特殊債券	195,992,000	101.85 199,617,852	102.78 201,460,176	1.000000 2049/7/10	1.32%
15	9 2 住宅機構R M B S 日本	特殊債券	200,000,000	100.00 200,000,000	100.40 200,800,000	0.740000 2050/1/10	1.32%
16	1 明治安田2014基 日本	社債券	200,000,000	100.00 200,000,000	100.31 200,625,400	0.510000 2019/8/7	1.32%
17	6 バークレイズバンク イギリス	社債券	200,000,000	100.10 200,203,400	100.02 200,053,200	0.328000 2017/6/23	1.31%
18	9 3 住宅機構R M B S 日本	特殊債券	200,000,000	100.00 200,000,000	99.39 198,780,000	0.600000 2050/2/10	1.30%
19	7 9 住宅機構R M B S 日本	特殊債券	190,248,000	102.48 194,985,175	103.31 196,564,232	1.070000 2048/12/10	1.29%
20	3 1 7 北海道電力 日本	社債券	100,000,000	100.82 100,827,300	103.99 103,999,500	1.139000 2023/11/24	0.68%
21	4 2 7 九州電力 日本	社債券	100,000,000	100.57 100,577,200	103.52 103,524,000	1.024000 2024/5/24	0.68%
22	2 8 相鉄HD 日本	社債券	100,000,000	102.18 102,182,900	102.65 102,659,200	0.800000 2020/4/24	0.67%
23	5 住友信託 劣後 日本	社債券	100,000,000	103.58 103,586,200	102.47 102,476,600	2.250000 2016/4/27	0.67%
24	1 みずほFG劣後 日本	社債券	100,000,000	100.02 100,024,600	102.40 102,407,400	0.950000 2024/7/16	0.67%

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
25	1 三井住友FG劣後 日本	社債券	100,000,000	100.00 100,000,000	102.00 102,003,200	0.849000 2024/9/12	0.67%
26	1 三井住友トラ 劣 日本	社債券	100,000,000	100.00 100,000,000	101.89 101,894,800	0.857000 2024/9/5	0.67%
27	3 3 大成建設 日本	社債券	100,000,000	101.50 101,509,200	101.69 101,694,300	0.660000 2018/6/20	0.67%
28	6 9 アコム 日本	社債券	100,000,000	100.00 100,000,000	101.69 101,691,400	1.210000 2024/9/26	0.67%
29	4 9 5 関西電力 日本	社債券	100,000,000	100.00 100,000,000	101.59 101,596,900	0.746000 2021/9/17	0.67%
30	4 3 1 九州電力 日本	社債券	100,000,000	100.00 100,000,000	101.30 101,306,400	0.811000 2024/12/25	0.66%

（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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年1月30日現在

種類	投資比率
国債証券	61.72%
地方債証券	0.26%
特殊債券	12.82%
社債券	24.51%
合計	99.31%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 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27年1月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US TREASURY N/B 0.25% 2016/04/15 アメリカ	国債証券	623,177,500	99.88 622,462,659	100.00 623,177,500	0.250000 2016/4/15	11.10%
2	US TREASURY N/B 1.0 2016/08/31 アメリカ	国債証券	313,362,500	100.92 316,261,220	100.96 316,370,780	1.000000 2016/8/31	5.64%
3	DEUTSCHLAND REP 4.75 2034/07/04 ドイツ	国債証券	139,235,200	159.91 222,659,790	171.25 238,440,280	4.750000 2034/7/4	4.25%
4	DEUTSCHLAND REP 1.0% 2024/08/15 ドイツ	国債証券	210,861,000	102.01 215,102,130	106.37 224,303,388	1.000000 2024/8/15	4.00%
5	BTPS 2.15% 2021/12/15 イタリア	国債証券	179,399,200	106.76 191,544,525	106.18 190,504,010	2.150000 2021/12/15	3.39%

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
6	US TREASURY N/B 2.125 2015/12/31 アメリカ	国債証券	185,652,500	102.66 190,607,545	101.77 188,944,118	2.125000 2015/12/31	3.37%
7	US TREASURY N/B 1.0% 2017/09/15 アメリカ	国債証券	165,550,000	99.67 165,018,584	100.63 166,596,276	1.000000 2017/9/15	2.97%
8	US TREASURY N/B 2.875% 2043/05/15 アメリカ	国債証券	137,170,000	90.83 124,598,369	111.32 152,697,644	2.875000 2043/5/15	2.72%
9	FRANCE O.A.T. 5.75 2032/10/25 フランス	国債証券	76,311,600	170.27 129,937,033	174.95 133,514,775	5.750000 2032/10/25	2.38%
10	US TREASURY N/B 0.625% 2016/10/15 アメリカ	国債証券	125,345,000	100.01 125,363,801	100.30 125,726,048	0.625000 2016/10/15	2.24%
11	BTPS 3.75% 2021/05/01 イタリア	国債証券	105,095,800	110.86 116,511,740	115.74 121,648,388	3.750000 2021/5/1	2.17%
12	SPANISH GOVT 4.85% 2020/10/31 スペイン	国債証券	90,369,000	120.86 109,226,834	121.72 110,001,665	4.850000 2020/10/31	1.96%
13	MEXICAN BONOS 6.5% 2021/06/10 メキシコ	国債証券	97,997,350	107.34 105,193,244	108.45 106,281,065	6.500000 2021/6/10	1.89%
14	US TREASURY N/B 2.25% 2024/11/15 アメリカ	国債証券	100,512,500	104.38 104,924,123	104.45 104,988,321	2.250000 2024/11/15	1.87%
15	US TREASURY N/B 0.875 2017/01/31 アメリカ	国債証券	94,600,000	100.32 94,910,288	100.69 95,257,470	0.875000 2017/1/31	1.70%
16	US TREASURY N/B 1.75% 2023/05/15 アメリカ	国債証券	94,600,000	97.07 91,836,734	100.52 95,094,758	1.750000 2023/5/15	1.69%
17	BTPS 4.0 2020/09/01 イタリア	国債証券	80,328,000	115.14 92,491,265	116.43 93,533,923	4.000000 2020/9/1	1.67%
18	US TREASURY N/B 3.0% 2044/11/15 アメリカ	国債証券	81,592,500	110.39 90,075,874	114.57 93,487,054	3.000000 2044/11/15	1.67%
19	BTPS 4.75 2023/08/01 イタリア	国債証券	68,278,800	120.47 82,256,153	126.11 86,113,222	4.750000 2023/8/1	1.53%
20	FRANCE O.A.T. 1.75% 2024/11/25 フランス	国債証券	74,972,800	109.84 82,353,872	110.95 83,186,070	1.750000 2024/11/25	1.48%
21	US TREASURY N/B 0.75% 2017/06/30 アメリカ	国債証券	57,942,500	99.59 57,706,094	100.22 58,073,450	0.750000 2017/6/30	1.03%
22	SPANISH GOVT 5.5% 2021/04/30 スペイン	国債証券	38,825,200	122.28 47,479,337	126.85 49,253,648	5.500000 2021/4/30	0.88%
23	BTPS 6% 2031/05/01 イタリア	国債証券	32,131,200	130.76 42,017,970	151.87 48,799,260	6.000000 2031/5/1	0.87%
24	DEUTSCHLAND REP 1.5% 2023/02/15 ドイツ	国債証券	43,511,000	104.20 45,338,462	110.66 48,153,623	1.500000 2023/2/15	0.86%
25	US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15 アメリカ	国債証券	31,927,500	125.57 40,092,071	145.06 46,317,224	4.625000 2040/2/15	0.83%

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
26	BTPS 4.5 2026/03/01 イタリア	国債証券	36,147,600	113.97 41,201,034	127.48 46,082,767	4.500000 2026/3/1	0.82%
27	TREASURY 4.0 2022/03/07 イギリス	国債証券	38,332,350	111.41 42,709,904	119.32 45,740,076	4.000000 2022/3/7	0.82%
28	US TREASURY N/B 0.875% 2016/11/30 アメリカ	国債証券	44,935,000	100.50 45,162,280	100.71 45,257,633	0.875000 2016/11/30	0.81%
29	FRANCE O.A.T. 2.75% 2027/10/25 フランス	国債証券	36,147,600	108.51 39,225,568	122.62 44,327,801	2.750000 2027/10/25	0.79%
30	TREASURY 3.75 2020/09/07 イギリス	国債証券	35,658,000	109.17 38,929,621	114.76 40,922,903	3.750000 2020/9/7	0.73%

(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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年1月30日現在

種類	投資比率
国債証券	94.51%
合計	94.51%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド

平成27年1月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	25,985	6,498.00 168,850,700	6,870.32 178,525,395	- -	1.81%
2	CERNER CORP アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	22,233	6,130.18 136,292,375	7,955.85 176,882,635	- -	1.79%
3	GOOGLE INC-CL C アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	2,685	68,365.14 183,560,424	60,385.54 162,135,188	- -	1.64%
4	AMERICAN TOWER CORP アメリカ	投資証券 -	13,695	10,903.34 149,321,271	11,638.16 159,384,669	- -	1.62%
5	STARBUCKS CORP アメリカ	株式 消費者サービス	14,465	9,274.51 134,155,879	10,530.16 152,318,800	- -	1.54%
6	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	5,095	26,142.27 133,194,889	29,326.00 149,415,970	- -	1.52%
7	CELGENE CORP アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー	9,990	10,524.66 105,141,429	14,292.87 142,785,846	- -	1.45%
8	SERVICENOW INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	15,809	6,962.35 110,067,833	8,736.30 138,112,324	- -	1.40%
9	ILLUMINA INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー	5,812	21,033.87 122,248,877	23,650.00 137,453,800	- -	1.39%
10	ATHENAHEALTH INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	7,784	15,138.44 117,837,624	16,940.49 131,864,813	- -	1.34%



順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
11	ACE LTD スイス	株式 保険	9,905	12,181.84 120,661,206	13,022.87 128,991,552	- -	1.31%
12	THE PRICELINE GROUP INC アメリカ	株式 小売り	1,030	141,511.09 145,756,430	119,993.00 123,592,795	- -	1.25%
13	LINKEDIN CORP - A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	4,503	19,179.04 86,363,232	26,374.47 118,764,283	- -	1.20%
14	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー	9,643	7,100.66 68,471,760	11,783.61 113,629,375	- -	1.15%
15	ARM HOLDINGS PLC-SPONS ADR イギリス	株式 半導体・半導体製造装置	19,444	5,101.98 99,202,917	5,645.25 109,766,338	- -	1.11%
16	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	11,690	9,010.55 105,333,408	9,223.50 107,822,715	- -	1.09%
17	EQUINIX INC アメリカ	投資証券 -	3,853	24,988.79 96,281,809	26,242.03 101,110,580	- -	1.03%
18	MEAD JOHNSON NUTRITION CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	8,370	11,039.95 92,404,455	12,033.11 100,717,214	- -	1.02%
19	NESTLE SA-REGISTERED-B スイス	株式 食品・飲料・タバコ	11,000	8,969.97 98,669,733	9,087.18 99,958,980	- -	1.01%
20	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC アメリカ	株式 消費者サービス	1,115	72,453.46 80,785,612	84,493.17 94,209,887	- -	0.96%
21	ALLERGAN INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー	3,515	19,819.88 69,666,897	26,297.61 92,436,125	- -	0.94%
22	SPLUNK INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	14,275	5,735.07 81,868,126	6,348.84 90,629,726	- -	0.92%
23	ALEXION PHARMACEUTICALS INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー	3,940	20,939.76 82,502,687	22,236.91 87,613,435	- -	0.89%
24	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	5,260	13,992.25 73,599,252	16,630.67 87,477,376	- -	0.89%
25	QUALCOMM INC アメリカ	株式 テクノロジー・ハードウェア	11,545	9,372.32 108,203,523	7,531.34 86,949,349	- -	0.88%
26	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品・バイオテクノロジー	2,530	34,153.93 86,409,455	32,434.04 82,058,133	- -	0.83%
27	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	12,660	6,500.88 82,301,180	6,370.12 80,645,814	- -	0.82%
28	KONINKLIJKE PHILIPS N.V. オランダ	株式 資本財	23,768	3,752.52 89,189,901	3,335.83 79,286,066	- -	0.80%
29	GENERAL ELECTRIC CO. アメリカ	株式 資本財	27,005	3,148.71 85,031,056	2,847.45 76,895,657	- -	0.78%
30	WESTERN DIGITAL CORP アメリカ	株式 テクノロジー・ハードウェア	6,030	11,639.34 70,185,265	11,950.34 72,060,580	- -	0.73%

(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。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年1月30日現在

種類	投資比率
株式	90.33%
投資証券	2.98%
合計	93.31%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成27年1月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
ソフトウェア・サービス	外国	12.62%
医薬品・バイオテクノロジー		9.96%
資本財		6.99%
ヘルスケア機器・サービス		5.89%
小売り		5.62%
食品・飲料・タバコ		5.34%
各種金融		5.23%
銀行		4.70%
エネルギー		4.61%
保険		4.07%
素材		4.05%
消費者サービス		3.65%
テクノロジー・ハードウェア		3.42%
半導体・半導体製造装置		2.86%
耐久消費財・アパレル		2.44%
自動車・自動車部品		1.92%
食品・生活必需品小売り		1.60%
公益事業		1.43%
メディア		1.39%
電気通信サービス		1.14%
運輸	0.55%	
不動産	0.42%	
商業サービス・用品	0.40%	
家庭用品・パーソナル用品	0.04%	
合計		90.33%

（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。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

## ハッピーエイジング20

直近日（平成27年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第5計算期間末 (平成17年7月15日)	831,748,653	831,748,653	0.8968	0.8968
第6計算期間末 (平成18年7月18日)	2,487,200,165	2,487,200,165	1.0307	1.0307
第7計算期間末 (平成19年7月17日)	4,128,875,931	4,128,875,931	1.2954	1.2954
第8計算期間末 (平成20年7月15日)	3,697,836,473	3,697,836,473	0.9762	0.9762
第9計算期間末 (平成21年7月15日)	3,183,815,124	3,183,815,124	0.6639	0.6639
第10計算期間末 (平成22年7月15日)	3,719,447,117	3,719,447,117	0.6954	0.6954
第11計算期間末 (平成23年7月15日)	4,207,770,641	4,207,770,641	0.7237	0.7237
第12計算期間末 (平成24年7月17日)	4,034,512,435	4,034,512,435	0.6395	0.6395
第13計算期間末 (平成25年7月16日)	6,375,079,876	6,375,079,876	0.9828	0.9828
第14計算期間末 (平成26年7月15日)	7,212,476,370	7,212,476,370	1.0930	1.0930
平成26年1月末日	6,892,970,512	-	1.0434	-
2月末日	6,986,512,755	-	1.0563	-
3月末日	6,929,401,201	-	1.0505	-
4月末日	6,776,019,843	-	1.0296	-
5月末日	6,903,400,018	-	1.0534	-
6月末日	7,186,539,487	-	1.0880	-
7月末日	7,301,556,410	-	1.1053	-
8月末日	7,350,233,544	-	1.1118	-
9月末日	7,572,503,165	-	1.1475	-
10月末日	7,589,746,389	-	1.1423	-
11月末日	8,000,087,446	-	1.2296	-
12月末日	7,950,284,402	-	1.2375	-
平成27年1月末日	7,954,835,617	-	1.2150	-

## ハッピーエイジング30

直近日（平成27年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第5計算期間末 （平成17年7月15日）	872,905,727	872,905,727	0.9400	0.9400
第6計算期間末 （平成18年7月18日）	2,543,516,633	2,543,516,633	1.0513	1.0513
第7計算期間末 （平成19年7月17日）	4,607,956,609	4,607,956,609	1.2794	1.2794
第8計算期間末 （平成20年7月15日）	4,587,555,192	4,587,555,192	1.0294	1.0294
第9計算期間末 （平成21年7月15日）	4,078,471,431	4,078,471,431	0.7546	0.7546
第10計算期間末 （平成22年7月15日）	4,610,678,881	4,610,678,881	0.7782	0.7782
第11計算期間末 （平成23年7月15日）	5,192,320,517	5,192,320,517	0.7985	0.7985
第12計算期間末 （平成24年7月17日）	5,099,609,632	5,099,609,632	0.7258	0.7258
第13計算期間末 （平成25年7月16日）	7,661,401,181	7,661,401,181	1.0552	1.0552
第14計算期間末 （平成26年7月15日）	8,543,771,190	8,543,771,190	1.1614	1.1614
平成26年1月末日	8,164,297,679	-	1.1128	-
2月末日	8,195,248,276	-	1.1228	-
3月末日	8,205,573,280	-	1.1215	-
4月末日	8,086,539,732	-	1.1051	-
5月末日	8,272,713,923	-	1.1254	-
6月末日	8,514,222,084	-	1.1562	-
7月末日	8,664,701,820	-	1.1733	-
8月末日	8,726,720,394	-	1.1806	-
9月末日	9,046,463,970	-	1.2148	-
10月末日	9,058,220,481	-	1.2121	-
11月末日	9,582,481,438	-	1.2964	-
12月末日	9,612,154,635	-	1.3043	-
平成27年1月末日	9,558,711,732	-	1.2833	-

## ハッピーエイジング４０

直近日（平成27年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第5計算期間末 （平成17年7月15日）	1,283,641,466	1,283,641,466	0.9870	0.9870
第6計算期間末 （平成18年7月18日）	3,872,160,919	3,872,160,919	1.0637	1.0637
第7計算期間末 （平成19年7月17日）	6,161,451,470	6,161,451,470	1.2301	1.2301
第8計算期間末 （平成20年7月15日）	6,505,406,524	6,505,406,524	1.0625	1.0625
第9計算期間末 （平成21年7月15日）	5,927,975,456	5,927,975,456	0.8617	0.8617
第10計算期間末 （平成22年7月15日）	6,550,967,753	6,550,967,753	0.8909	0.8909
第11計算期間末 （平成23年7月15日）	7,355,736,675	7,355,736,675	0.9092	0.9092
第12計算期間末 （平成24年7月17日）	7,397,925,868	7,397,925,868	0.8565	0.8565
第13計算期間末 （平成25年7月16日）	9,756,993,303	9,756,993,303	1.1196	1.1196
第14計算期間末 （平成26年7月15日）	10,651,044,828	10,651,044,828	1.2075	1.2075
平成26年1月末日	10,250,872,816	-	1.1680	-
2月末日	10,261,513,752	-	1.1758	-
3月末日	10,261,331,990	-	1.1750	-
4月末日	10,181,446,142	-	1.1635	-
5月末日	10,389,832,163	-	1.1795	-
6月末日	10,631,479,352	-	1.2030	-
7月末日	10,767,689,873	-	1.2166	-
8月末日	10,837,585,497	-	1.2235	-
9月末日	11,048,725,702	-	1.2482	-
10月末日	11,073,712,614	-	1.2487	-
11月末日	11,609,777,135	-	1.3134	-
12月末日	11,690,890,275	-	1.3216	-
平成27年1月末日	11,619,864,068	-	1.3068	-

## ハッピーエイジング50

直近日（平成27年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第5計算期間末 （平成17年7月15日）	710,074,576	710,074,576	1.0258	1.0258
第6計算期間末 （平成18年7月18日）	1,956,798,569	1,956,798,569	1.0637	1.0637
第7計算期間末 （平成19年7月17日）	2,866,331,796	2,866,331,796	1.1662	1.1662
第8計算期間末 （平成20年7月15日）	3,118,721,807	3,118,721,807	1.0787	1.0787
第9計算期間末 （平成21年7月15日）	3,057,510,606	3,057,510,606	0.9621	0.9621
第10計算期間末 （平成22年7月15日）	3,309,494,331	3,309,494,331	0.9927	0.9927
第11計算期間末 （平成23年7月15日）	3,702,379,934	3,702,379,934	1.0057	1.0057
第12計算期間末 （平成24年7月17日）	3,809,563,912	3,809,563,912	0.9795	0.9795
第13計算期間末 （平成25年7月16日）	4,480,882,597	4,480,882,597	1.1555	1.1555
第14計算期間末 （平成26年7月15日）	4,908,333,421	4,908,333,421	1.2215	1.2215
平成26年1月末日	4,739,816,481	-	1.1941	-
2月末日	4,785,652,848	-	1.1992	-
3月末日	4,790,004,112	-	1.1984	-
4月末日	4,742,265,641	-	1.1917	-
5月末日	4,776,963,372	-	1.2026	-
6月末日	4,890,225,965	-	1.2181	-
7月末日	4,967,252,745	-	1.2272	-
8月末日	4,990,761,621	-	1.2332	-
9月末日	5,057,982,414	-	1.2491	-
10月末日	5,093,573,768	-	1.2514	-
11月末日	5,264,795,454	-	1.2947	-
12月末日	5,286,389,587	-	1.3047	-
平成27年1月末日	5,294,929,048	-	1.2951	-

## ハッピーエイジング60

直近日（平成27年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第5計算期間末 (平成17年7月15日)	501,246,791	501,246,791	1.0504	1.0504
第6計算期間末 (平成18年7月18日)	1,033,316,911	1,033,316,911	1.0465	1.0465
第7計算期間末 (平成19年7月17日)	1,323,548,224	1,323,548,224	1.0836	1.0836
第8計算期間末 (平成20年7月15日)	1,650,255,654	1,650,255,654	1.0701	1.0701
第9計算期間末 (平成21年7月15日)	1,794,974,977	1,794,974,977	1.0407	1.0407
第10計算期間末 (平成22年7月15日)	1,977,963,799	1,977,963,799	1.0676	1.0676
第11計算期間末 (平成23年7月15日)	2,184,577,562	2,184,577,562	1.0737	1.0737
第12計算期間末 (平成24年7月17日)	2,434,101,752	2,434,101,752	1.0812	1.0812
第13計算期間末 (平成25年7月16日)	2,695,707,446	2,695,707,446	1.1485	1.1485
第14計算期間末 (平成26年7月15日)	3,031,298,200	3,031,298,200	1.1883	1.1883
平成26年1月末日	2,890,318,539	-	1.1766	-
2月末日	2,973,813,182	-	1.1793	-
3月末日	2,981,489,602	-	1.1771	-
4月末日	2,982,788,857	-	1.1751	-
5月末日	3,019,868,345	-	1.1798	-
6月末日	3,037,574,979	-	1.1866	-
7月末日	3,064,787,583	-	1.1902	-
8月末日	3,068,022,209	-	1.1955	-
9月末日	3,091,857,525	-	1.2023	-
10月末日	3,108,967,432	-	1.2058	-
11月末日	3,181,547,087	-	1.2270	-
12月末日	3,226,068,000	-	1.2393	-
平成27年1月末日	3,220,916,304	-	1.2340	-



## 【分配の推移】

## ハッピーエイジング 2 0

	1口当たりの分配金(円)
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
平成26年7月16日～ 平成27年1月15日	-

## ハッピーエイジング 3 0

	1口当たりの分配金(円)
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
平成26年7月16日～ 平成27年1月15日	-

## ハッピーエイジング 4 0

	1口当たりの分配金(円)
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000

	1口当たりの分配金(円)
第14計算期間	0.0000
平成26年7月16日～ 平成27年1月15日	-

## ハッピーエイジング50

	1口当たりの分配金(円)
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
平成26年7月16日～ 平成27年1月15日	-

## ハッピーエイジング60

	1口当たりの分配金(円)
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
平成26年7月16日～ 平成27年1月15日	-

## 【収益率の推移】

## ハッピーエイジング20

	収益率(%)
第5計算期間	9.1
第6計算期間	14.9
第7計算期間	25.7
第8計算期間	24.6
第9計算期間	32.0
第10計算期間	4.7
第11計算期間	4.1
第12計算期間	11.6
第13計算期間	53.7
第14計算期間	11.2
平成26年7月16日～ 平成27年1月15日	8.8

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。  
なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## ハッピーエイジング30

	収益率(%)
第5計算期間	8.0
第6計算期間	11.8
第7計算期間	21.7
第8計算期間	19.5
第9計算期間	26.7
第10計算期間	3.1
第11計算期間	2.6
第12計算期間	9.1
第13計算期間	45.4
第14計算期間	10.1
平成26年7月16日～ 平成27年1月15日	8.8

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。  
なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## ハッピーエイジング40

	収益率(%)
第5計算期間	6.8
第6計算期間	7.8
第7計算期間	15.6
第8計算期間	13.6
第9計算期間	18.9
第10計算期間	3.4
第11計算期間	2.1
第12計算期間	5.8
第13計算期間	30.7
第14計算期間	7.9
平成26年7月16日～ 平成27年1月15日	7.3

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## ハッピーエイジング50

	収益率(%)
第5計算期間	5.5
第6計算期間	3.7
第7計算期間	9.6
第8計算期間	7.5
第9計算期間	10.8
第10計算期間	3.2
第11計算期間	1.3
第12計算期間	2.6
第13計算期間	18.0
第14計算期間	5.7
平成26年7月16日～ 平成27年1月15日	5.8

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## ハッピーエイジング60

	収益率(%)
第5計算期間	3.9
第6計算期間	0.4
第7計算期間	3.5
第8計算期間	1.2
第9計算期間	2.7
第10計算期間	2.6
第11計算期間	0.6
第12計算期間	0.7
第13計算期間	6.2
第14計算期間	3.5
平成26年7月16日～ 平成27年1月15日	4.4

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## (4)【設定及び解約の実績】

## ハッピーエイジング20

	設定口数	解約口数
第5計算期間	580,661,199	61,329,680
第6計算期間	1,736,164,573	250,575,641
第7計算期間	1,080,299,931	306,068,974
第8計算期間	1,018,970,950	418,381,330
第9計算期間	1,479,340,785	471,208,841
第10計算期間	1,281,906,649	729,114,257
第11計算期間	1,165,350,197	699,705,959
第12計算期間	1,229,841,291	735,754,993
第13計算期間	1,412,715,175	1,234,496,719
第14計算期間	1,198,615,866	1,086,750,393
平成26年7月16日～ 平成27年1月15日	687,783,467	807,862,852

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

## ハッピーエイジング30

	設定口数	解約口数
第5計算期間	550,852,464	42,230,848
第6計算期間	1,744,825,572	253,983,053
第7計算期間	1,422,618,991	240,489,638
第8計算期間	1,227,027,693	372,033,781
第9計算期間	1,396,839,049	448,390,635
第10計算期間	1,119,556,593	599,737,003
第11計算期間	1,120,303,076	542,221,678
第12計算期間	1,095,836,730	572,539,792
第13計算期間	1,142,944,756	908,933,490
第14計算期間	925,289,956	829,222,130
平成26年7月16日～ 平成27年1月15日	506,388,479	464,441,525

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

## ハッピーエイジング40

	設定口数	解約口数
第5計算期間	846,725,729	71,732,594
第6計算期間	2,564,867,867	225,098,025
第7計算期間	1,716,655,629	348,192,196
第8計算期間	1,496,200,940	382,063,136
第9計算期間	1,464,605,050	708,112,174
第10計算期間	1,300,116,226	826,451,419
第11計算期間	1,345,880,036	608,198,860
第12計算期間	1,339,462,020	792,859,126
第13計算期間	1,210,013,963	1,132,548,340
第14計算期間	1,187,155,993	1,081,548,442
平成26年7月16日～ 平成27年1月15日	628,420,875	603,345,370

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

## ハッピーエイジング50

	設定口数	解約口数
第5計算期間	490,967,000	52,457,835
第6計算期間	1,270,937,045	123,495,310
第7計算期間	784,743,529	166,603,954
第8計算期間	668,475,571	235,028,492
第9計算期間	632,755,183	345,929,308
第10計算期間	600,002,968	444,226,284
第11計算期間	731,775,658	384,093,994
第12計算期間	686,143,489	478,493,200
第13計算期間	619,762,253	631,166,681
第14計算期間	718,206,328	577,818,984
平成26年7月16日～ 平成27年1月15日	397,477,750	348,955,408

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

## ハッピーエイジング60

	設定口数	解約口数
第5計算期間	294,966,175	37,865,518
第6計算期間	620,505,740	110,308,158
第7計算期間	413,005,730	178,957,589
第8計算期間	458,481,130	137,709,650
第9計算期間	400,300,646	217,665,541
第10計算期間	339,805,218	211,886,769
第11計算期間	411,859,598	230,027,943
第12計算期間	406,833,203	190,166,524
第13計算期間	479,744,662	383,926,075
第14計算期間	553,877,726	350,037,487
平成26年7月16日～ 平成27年1月15日	279,993,699	233,482,666

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。



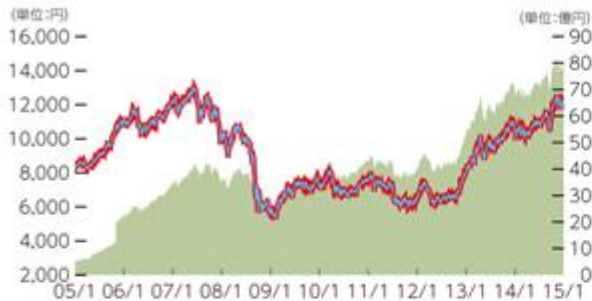
## &lt; 参考情報 &gt;

基準日：2015年1月30日

## 基準価額・純資産の推移 2005/01/31～2015/01/30

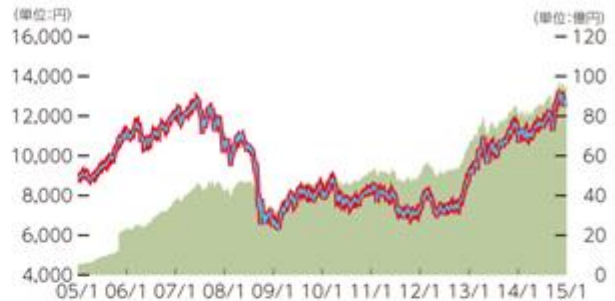
## ハッピーエイジング20

基準価額	12,150円
純資産総額	79.55億円



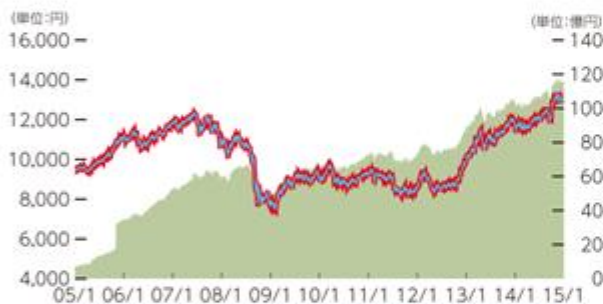
## ハッピーエイジング30

基準価額	12,833円
純資産総額	95.59億円



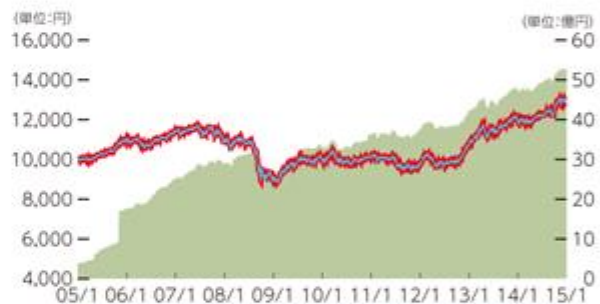
## ハッピーエイジング40

基準価額	13,068円
純資産総額	116.20億円



## ハッピーエイジング50

基準価額	12,951円
純資産総額	52.95億円



## ハッピーエイジング60

基準価額	12,340円
純資産総額	32.21億円



■ 純資産総額(右軸)  
 ■ 基準価額(左軸)  
 ■ 基準価額(税引前分配金再投資)(左軸)

- 基準価額(税引前分配金再投資)は、税引前の分配金を再投資したものと計算しています。
- 基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

- 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。
- 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。

## 分配の推移

	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
2010年07月	0円	0円	0円	0円	0円
2011年07月	0円	0円	0円	0円	0円
2012年07月	0円	0円	0円	0円	0円
2013年07月	0円	0円	0円	0円	0円
2014年07月	0円	0円	0円	0円	0円
設定来累計	0円	0円	0円	0円	0円

●1万円当たり、税引前

## 主要な資産の状況

資産別構成	資産の種類	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
		純資産比	純資産比	純資産比	純資産比	純資産比
	損保ジャパン日本株マザーファンド	25.86%	21.88%	15.41%	9.41%	2.97%
	損保ジャパン-DIAM日本株アクティブ・マザーファンド	25.94%	21.95%	15.45%	9.44%	2.98%
	損保ジャパン日本債券マザーファンド	2.01%	8.05%	33.18%	57.14%	82.09%
	損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	6.05%	20.16%	15.11%	11.05%	6.02%
	損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド	33.57%	21.37%	14.24%	8.11%	4.05%
	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	4.59%	4.60%	4.62%	2.77%	-
	コール・ローン等	1.99%	1.99%	1.99%	2.07%	1.89%
	合計	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%

## 損保ジャパン日本株マザーファンド

組入上位5銘柄	銘柄名	業種	純資産比
	1	トヨタ自動車	輸送用機器
2	日本電信電話	情報・通信業	3.6%
3	JFEホールディングス	鉄鋼	3.1%
4	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.9%
5	MS&AD	保険業	2.7%
	組入銘柄数	103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。
- 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。

## 損保ジャパン-DIAM日本株アクティブ・マザーファンド

	銘柄名	業 種	純資産比
組入上位5銘柄	1 トヨタ自動車	輸送用機器	5.9%
	2 三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	3.6%
	3 三井住友フィナンシャルG	銀行業	2.7%
	4 富士重工業	輸送用機器	2.7%
	5 KDDI	情報・通信業	2.6%
	組入銘柄数	100銘柄	

## 損保ジャパン日本債券マザーファンド

	銘柄名	種 類	償還日	純資産比
組入上位5銘柄	1 121 5年国債	国債証券	2019/09/20	17.4%
	2 148 20年国債	国債証券	2034/03/20	8.0%
	3 320 10年国債	国債証券	2021/12/20	6.1%
	4 43 30年国債	国債証券	2044/06/20	5.9%
	5 122 5年国債	国債証券	2019/12/20	5.1%
	組入銘柄数		67銘柄	

## 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

	銘柄名	発行国	種 類	通 貨	償還日	純資産比
組入上位5銘柄	1 US TREASURY N/B 0.25%	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2016/04/15	11.1%
	2 US TREASURY N/B 1.0	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2016/08/31	5.6%
	3 DEUTSCHLAND REP 4.75	ドイツ	国債証券	ユーロ	2034/07/04	4.3%
	4 DEUTSCHLAND REP 1.0%	ドイツ	国債証券	ユーロ	2024/08/15	4.0%
	5 BTPS 2.15%	イタリア	国債証券	ユーロ	2021/12/15	3.4%
	組入銘柄数				124銘柄	

## 損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド

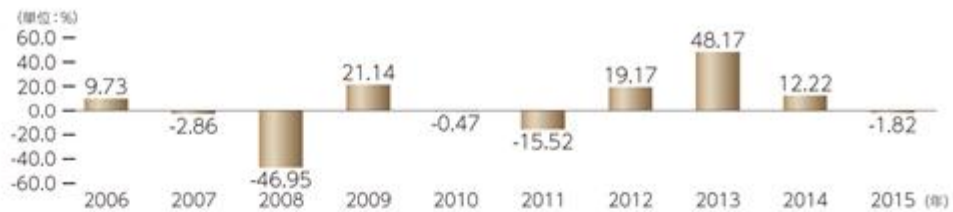
	銘柄名	通 貨	発行国/地域	業 種	純資産比
組入上位5銘柄	1 SALESFORCE.COM INC	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	1.8%
	2 CERNER CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	ヘルスケア	1.8%
	3 GOOGLE INC-CL C	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	1.6%
	4 AMERICAN TOWER CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	金融	1.6%
	5 STARBUCKS CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	一般消費財・サービス	1.5%
	組入銘柄数				295銘柄

- 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。
- 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。

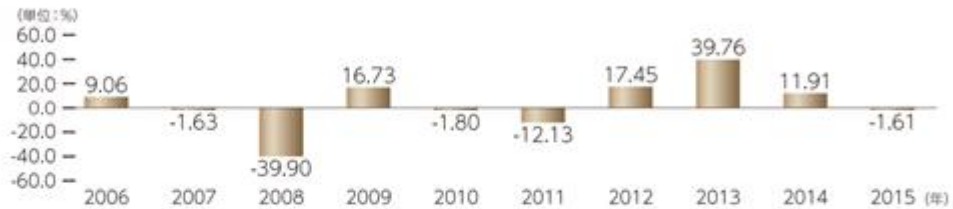


## 年間収益率の推移(暦年ベース)

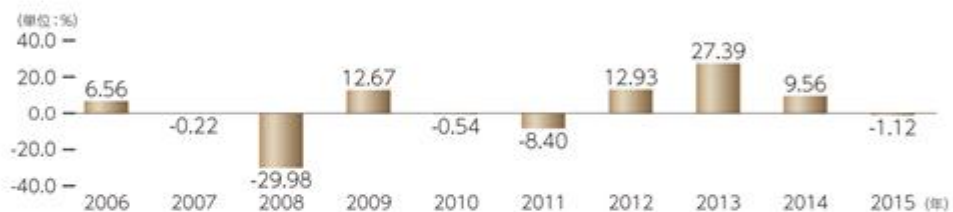
ハッピーエイジング20



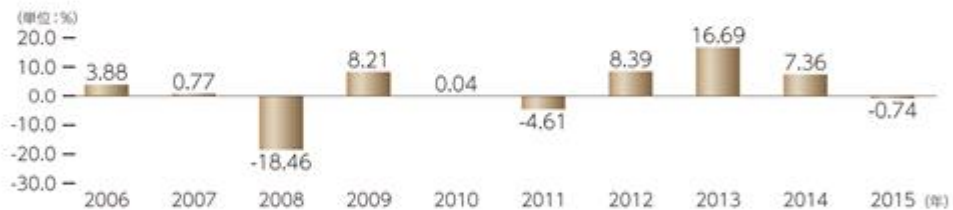
ハッピーエイジング30



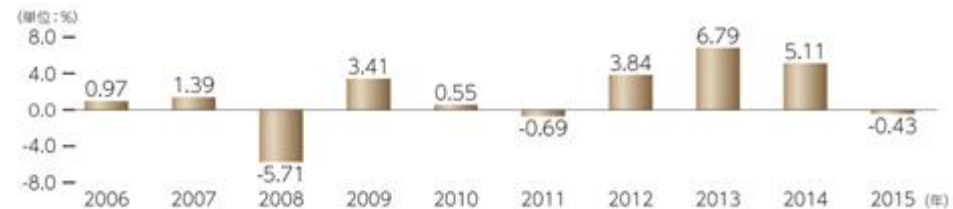
ハッピーエイジング40



ハッピーエイジング50



ハッピーエイジング60



- ファンドの年間収益率は基準価額(税引前分配金再投資)を使用して計算しています。
- 2015年は年初から基準日までの収益率です。

- 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。
- 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】

<訂正前>

（略）

(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。

（略）

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。

（略）

<訂正後>

（略）

(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。

（略）

当ファンドの基準価額については、委託会社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。

委託会社の照会先

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

電話番号 03-5290-3519（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ <http://www.sjnk-am.co.jp/>

（略）

### 2【換金（解約）手続等】

<訂正前>

（略）

(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一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。

\*平成27年4月14日以降は、以下のとおりに変更する予定です。詳しくは、第一部 証券情報（12）その他をご参照ください。

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。

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。

（略）

<訂正後>

（略）

(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。

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。

（略）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

<訂正前>

（略）

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/>

<訂正後>

（略）

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。

委託会社の照会先

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

電話番号 03-5290-3519（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ <http://www.sjnk-am.co.jp/>

### 第3【ファンドの経理状況】

#### 1【財務諸表】

以下の記載内容を追加いたします。

<追加>

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）（以下「中間財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、平成26年7月16日から平成27年1月15日までの中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【ハッピーエイジング20】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 平成26年7月15日現在	第15期中間計算期間末 平成27年1月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	207,458,288	271,371,733
投資信託受益証券	342,148,535	372,977,797
親投資信託受益証券	6,722,052,292	7,127,209,188
流動資産合計	7,271,659,115	7,771,558,718
資産合計		
	7,271,659,115	7,771,558,718
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	82,138
未払受託者報酬	2,915,857	3,278,367
未払委託者報酬	56,131,888	63,109,352
その他未払費用	135,000	135,000
流動負債合計	59,182,745	66,604,857
負債合計		
	59,182,745	66,604,857
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,598,575,633	6,478,496,248
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	613,900,737	1,226,457,613
純資産合計		
	7,212,476,370	7,704,953,861
負債純資産合計		
	7,271,659,115	7,771,558,718



## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第14期中間計算期間		第15期中間計算期間	
	自	平成25年7月17日 至 平成26年1月16日	自	平成26年7月16日 至 平成27年1月15日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		2,675,587		4,597,956
受取利息		29,021		21,923
有価証券売買等損益		799,920,928		646,309,984
為替差損益		14,956,132		54,138,094
営業収益合計		817,581,668		705,067,957
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		2,780,898		3,278,367
委託者報酬		53,535,023		63,109,352
その他費用		168,532		184,395
営業費用合計		56,484,453		66,572,114
営業利益又は営業損失( )		761,097,215		638,495,843
経常利益又は経常損失( )		761,097,215		638,495,843
中間純利益又は中間純損失( )		761,097,215		638,495,843
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )		12,903,762		58,468,651
期首剰余金又は期首欠損金( )		111,630,284		613,900,737
剰余金増加額又は欠損金減少額		18,405,389		107,733,700
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		10,744,361		-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		7,661,028		107,733,700
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		75,204,016
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		75,204,016
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金( )		654,968,558		1,226,457,613

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準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、わが国における中間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>受取配当金 原則として、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>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。</p>
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>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。</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>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第14期 平成26年7月15日現在	第15期中間計算期間末 平成27年1月15日現在
1. 受益権の総数	6,598,575,633口	6,478,496,248口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0930円 (10,930円)	1.1893円 (11,893円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第14期中間計算期間 自 平成25年7月17日 至 平成26年1月16日	第15期中間計算期間 自 平成26年7月16日 至 平成27年1月15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	5,481,665円	6,255,891円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 平成26年7月15日現在	第15期中間計算期間末 平成27年1月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。	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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 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せん。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は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。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。	同左

## （その他の注記）

項目	第14期		第15期中間計算期間	
	自	平成25年7月17日 至 平成26年7月15日	自	平成26年7月16日 至 平成27年1月15日
期首元本額		6,486,710,160円		6,598,575,633円
期中追加設定元本額		1,198,615,866円		687,783,467円
期中一部解約元本額		1,086,750,393円		807,862,852円

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## 【ハッピーエイジング30】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 平成26年7月15日現在	第15期中間計算期間末 平成27年1月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	248,425,649	261,789,018
投資信託受益証券	408,545,161	451,932,222
親投資信託受益証券	7,950,476,247	8,705,878,069
流動資産合計	8,607,447,057	9,419,599,309
資産合計	8,607,447,057	9,419,599,309
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	795,913	1,321,782
未払受託者報酬	3,461,632	3,927,425
未払委託者報酬	59,283,322	67,258,931
その他未払費用	135,000	135,000
流動負債合計	63,675,867	72,643,138
負債合計	63,675,867	72,643,138
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,356,346,312	7,398,293,266
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,187,424,878	1,948,662,905
純資産合計	8,543,771,190	9,346,956,171
負債純資産合計	8,607,447,057	9,419,599,309

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第14期中間計算期間		第15期中間計算期間	
	自	平成25年7月17日 至 平成26年1月16日	自	平成26年7月16日 至 平成27年1月15日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		3,185,427		5,571,290
受取利息		31,966		26,493
有価証券売買等損益		818,873,856		757,731,886
為替差損益		17,759,372		64,511,359
営業収益合計		839,850,621		827,841,028
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		3,321,416		3,927,425
委託者報酬		56,883,669		67,258,931
その他費用		175,183		192,649
営業費用合計		60,380,268		71,379,005
営業利益又は営業損失( )		779,470,353		756,462,023
経常利益又は経常損失( )		779,470,353		756,462,023
中間純利益又は中間純損失( )		779,470,353		756,462,023
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )		8,954,915		33,861,442
期首剰余金又は期首欠損金( )		401,122,695		1,187,424,878
剰余金増加額又は欠損金減少額		38,305,265		113,337,474
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		38,305,265		113,337,474
剰余金減少額又は欠損金増加額		23,433,596		74,700,028
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		23,433,596		74,700,028
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金( )		1,186,509,802		1,948,662,905

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間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、わが国における中間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	受取配当金 原則として、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。 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. その他中間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。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第14期 平成26年7月15日現在	第15期中間計算期間末 平成27年1月15日現在
1. 受益権の総数	7,356,346,312口	7,398,293,266口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1614円 (11,614円)	1.2634円 (12,634円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第14期中間計算期間 自 平成25年7月17日 至 平成26年1月16日	第15期中間計算期間 自 平成26年7月16日 至 平成27年1月15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	4,640,592円	5,329,399円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 平成26年7月15日現在	第15期中間計算期間末 平成27年1月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。	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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 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せん。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は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。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。	同左

## （その他の注記）

項目	第14期		第15期中間計算期間	
	自	至	自	至
期首元本額	平成25年7月17日	平成26年7月15日	平成26年7月16日	平成27年1月15日
期中追加設定元本額	7,260,278,486円		7,356,346,312円	
期中一部解約元本額	925,289,956円		506,388,479円	
	829,222,130円		464,441,525円	

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## 【ハッピーエイジング40】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 平成26年7月15日現在	第15期中間計算期間末 平成27年1月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	315,780,610	301,848,849
投資信託受益証券	511,485,107	550,330,922
親投資信託受益証券	9,893,693,919	10,681,999,429
流動資産合計	10,720,959,636	11,534,179,200
資産合計	10,720,959,636	11,534,179,200
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	345,321	198,334
未払受託者報酬	3,797,186	4,221,982
未払委託者報酬	65,637,301	72,978,306
その他未払費用	135,000	135,000
流動負債合計	69,914,808	77,533,622
負債合計	69,914,808	77,533,622
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	8,820,381,231	8,845,456,736
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,830,663,597	2,611,188,842
純資産合計	10,651,044,828	11,456,645,578
負債純資産合計	10,720,959,636	11,534,179,200



## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第14期中間計算期間		第15期中間計算期間	
	自	平成25年7月17日 至 平成26年1月16日	自	平成26年7月16日 至 平成27年1月15日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		4,024,205		6,784,370
受取利息		38,614		31,653
有価証券売買等損益		777,415,475		764,494,911
為替差損益		22,402,530		79,585,623
営業収益合計		803,880,824		850,896,557
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		3,680,550		4,221,982
委託者報酬		63,624,004		72,978,306
その他費用		186,343		204,802
営業費用合計		67,490,897		77,405,090
営業利益又は営業損失（ ）		736,389,927		773,491,467
経常利益又は経常損失（ ）		736,389,927		773,491,467
中間純利益又は中間純損失（ ）		736,389,927		773,491,467
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）		10,255,048		30,896,510
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,042,219,623		1,830,663,597
剰余金増加額又は欠損金減少額		78,987,235		162,620,164
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		78,987,235		162,620,164
剰余金減少額又は欠損金増加額		63,793,104		124,689,876
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		63,793,104		124,689,876
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,783,548,633		2,611,188,842

## （ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準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、わが国における中間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>受取配当金 原則として、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>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。</p>
4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>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。</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>

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第14期 平成26年7月15日現在	第15期中間計算期間末 平成27年1月15日現在
1．受益権の総数	8,820,381,231口	8,845,456,736口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2075円 (12,075円)	1.2952円 (12,952円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第14期中間計算期間 自 平成25年7月17日 至 平成26年1月16日	第15期中間計算期間 自 平成26年7月16日 至 平成27年1月15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	3,939,708円	4,415,908円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 平成26年7月15日現在	第15期中間計算期間末 平成27年1月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。	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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載してありません。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は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。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。	同左

## （その他の注記）

項目	第14期		第15期中間計算期間	
	自	平成25年7月17日 至 平成26年7月15日	自	平成26年7月16日 至 平成27年1月15日
期首元本額		8,714,773,680円		8,820,381,231円
期中追加設定元本額		1,187,155,993円		628,420,875円
期中一部解約元本額		1,081,548,442円		603,345,370円

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## 【ハッピーエイジング50】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 平成26年7月15日現在	第15期中間計算期間末 平成27年1月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	169,938,820	170,504,441
投資信託受益証券	143,340,818	149,842,327
親投資信託受益証券	4,623,241,229	4,966,696,322
流動資産合計	4,936,520,867	5,287,043,090
資産合計	4,936,520,867	5,287,043,090
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	187,850	2,530
未払受託者報酬	1,507,563	1,658,560
未払委託者報酬	26,381,549	29,025,478
その他未払費用	110,484	121,572
流動負債合計	28,187,446	30,808,140
負債合計	28,187,446	30,808,140
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,018,185,716	4,066,708,058
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	890,147,705	1,189,526,892
純資産合計	4,908,333,421	5,256,234,950
負債純資産合計	4,936,520,867	5,287,043,090

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第14期中間計算期間		第15期中間計算期間	
	自	平成25年7月17日 至 平成26年1月16日	自	平成26年7月16日 至 平成27年1月15日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		1,117,933		1,847,241
受取利息		20,319		15,719
有価証券売買等損益		253,030,808		294,003,494
為替差損益		6,243,469		22,016,307
営業収益合計		260,412,529		317,882,761
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		1,453,641		1,658,560
委託者報酬		25,437,156		29,025,478
その他費用		126,109		145,647
営業費用合計		27,016,906		30,829,685
営業利益又は営業損失（ ）		233,395,623		287,053,076
経常利益又は経常損失（ ）		233,395,623		287,053,076
中間純利益又は中間純損失（ ）		233,395,623		287,053,076
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）		5,598,732		13,557,990
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		603,084,225		890,147,705
剰余金増加額又は欠損金減少額		65,434,285		102,842,915
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		65,434,285		102,842,915
剰余金減少額又は欠損金増加額		48,519,221		76,958,814
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		48,519,221		76,958,814
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		847,796,180		1,189,526,892

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間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、わが国における中間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	受取配当金 原則として、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。 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. その他中間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。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第14期 平成26年7月15日現在	第15期中間計算期間末 平成27年1月15日現在
1. 受益権の総数	4,018,185,716口	4,066,708,058口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2215円 (12,215円)	1.2925円 (12,925円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第14期中間計算期間 自 平成25年7月17日 至 平成26年1月16日	第15期中間計算期間 自 平成26年7月16日 至 平成27年1月15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	1,181,240円	1,318,756円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 平成26年7月15日現在	第15期中間計算期間末 平成27年1月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。	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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 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せん。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は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。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。	同左

## （その他の注記）

項目	第14期		第15期中間計算期間	
	自	平成25年7月17日 至 平成26年7月15日	自	平成26年7月16日 至 平成27年1月15日
期首元本額		3,877,798,372円		4,018,185,716円
期中追加設定元本額		718,206,328円		397,477,750円
期中一部解約元本額		577,818,984円		348,955,408円

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## 【ハッピーエイジング60】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 平成26年7月15日現在	第15期中間計算期間末 平成27年1月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	75,758,233	85,961,406
親投資信託受益証券	2,970,315,498	3,151,761,602
流動資産合計	3,046,073,731	3,237,723,008
資産合計	3,046,073,731	3,237,723,008
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	46,171
未払受託者報酬	782,174	846,566
未払委託者報酬	13,924,581	15,070,608
その他未払費用	68,776	74,444
流動負債合計	14,775,531	16,037,789
負債合計	14,775,531	16,037,789
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,550,913,090	2,597,424,123
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	480,385,110	624,261,096
純資産合計	3,031,298,200	3,221,685,219
負債純資産合計	3,046,073,731	3,237,723,008



## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第14期中間計算期間		第15期中間計算期間	
	自	平成25年7月17日 至 平成26年1月16日	自	平成26年7月16日 至 平成27年1月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		13,178		8,998
有価証券売買等損益		92,379,910		149,636,104
営業収益合計		92,393,088		149,645,102
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		738,584		846,566
委託者報酬		13,149,809		15,070,608
その他費用		64,951		74,444
営業費用合計		13,953,344		15,991,618
営業利益又は営業損失( )		78,439,744		133,653,484
経常利益又は経常損失( )		78,439,744		133,653,484
中間純利益又は中間純損失( )		78,439,744		133,653,484
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )		2,791,950		4,811,086
期首剰余金又は期首欠損金( )		348,634,595		480,385,110
剰余金増加額又は欠損金減少額		46,218,379		58,721,956
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		46,218,379		58,721,956
剰余金減少額又は欠損金増加額		26,518,011		43,688,368
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		26,518,011		43,688,368
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金( )		443,982,757		624,261,096

## (3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間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。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第14期 平成26年7月15日現在	第15期中間計算期間末 平成27年1月15日現在
1. 受益権の総数	2,550,913,090口	2,597,424,123口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1883円 (11,883円)	1.2403円 (12,403円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第14期中間計算期間 自 平成25年7月17日 至 平成26年1月16日	第15期中間計算期間 自 平成26年7月16日 至 平成27年1月15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	299,726円	335,797円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 平成26年7月15日現在	第15期中間計算期間末 平成27年1月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。	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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 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。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。	同左

項目	第14期 平成26年7月15日現在	第15期中間計算期間末 平成27年1月15日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は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>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>	同左

## （その他の注記）

項目	第14期	第15期中間計算期間
	自 平成25年7月17日 至 平成26年7月15日	自 平成26年7月16日 至 平成27年1月15日
期首元本額	2,347,072,851円	2,550,913,090円
期中追加設定元本額	553,877,726円	279,993,699円
期中一部解約元本額	350,037,487円	233,482,666円

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## &lt;参考&gt;

「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」及び「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-DIAM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」「損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド」「損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同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

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	625,942	533,438
コール・ローン	84,348,237	168,815,054
株式	10,020,685,700	10,560,770,580
未収入金	109,027,248	293,109,360
未収配当金	7,515,200	12,269,600
流動資産合計	10,222,202,327	11,035,498,032
資産合計	10,222,202,327	11,035,498,032
負債の部		
流動負債		
未払金	154,668,553	352,776,945
流動負債合計	154,668,553	352,776,945
負債合計	154,668,553	352,776,945
純資産の部		
元本等		
元本	6,944,491,209	6,909,127,377
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,123,042,565	3,773,593,710
純資産合計	10,067,533,774	10,682,721,087
負債純資産合計	10,222,202,327	11,035,498,032

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、以下の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	受取配当金 原則として、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。 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。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
1．受益権の総数	6,944,491,209口	6,909,127,377口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4497円 (14,497円)	1.5462円 (15,462円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。	同左
2．時価の算定方法	(1)有価証券 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。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は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。	同左

項目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。	同左

## （その他の注記）

項目	自 平成25年7月17日 至 平成26年7月15日	自 平成26年7月16日 至 平成27年1月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	7,235,963,136円	6,944,491,209円
同期中追加設定元本額	605,191,000円	426,771,567円
同期中一部解約元本額	896,662,927円	462,135,399円
元本の内訳*		
ファンド名		
損保ジャパン日本株オープン	454,690,281円	427,872,070円
損保ジャパン日本株ファンド	2,188,263,946円	2,134,506,469円
ハッピーエイジング20	1,291,649,193円	1,288,121,109円
ハッピーエイジング30	1,292,376,163円	1,332,821,343円
ハッピーエイジング40	1,134,350,286円	1,151,453,598円
ハッピーエイジング50	318,638,238円	321,062,059円
ハッピーエイジング60	62,813,673円	62,338,151円
損保ジャパン日本株オープン （DC年金）	168,613,706円	159,494,360円
スター・マンスリープラス	33,095,723円	31,458,218円
計	6,944,491,209円	6,909,127,377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

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## 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

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	49,467,827	82,032,545
株式	6,087,250,900	6,485,679,560
未収入金	61,663,113	77,724,530
未収配当金	5,078,555	4,896,550
流動資産合計	6,203,460,395	6,650,333,185
資産合計	6,203,460,395	6,650,333,185
負債の部		
流動負債		
未払金	57,617,066	82,973,820
流動負債合計	57,617,066	82,973,820
負債合計	57,617,066	82,973,820
純資産の部		
元本等		
元本	4,633,286,322	4,510,668,547
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,512,557,007	2,056,690,818
純資産合計	6,145,843,329	6,567,359,365
負債純資産合計	6,203,460,395	6,650,333,185

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、以下の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	受取配当金 原則として、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。 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。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
1．受益権の総数	4,633,286,322口	4,510,668,547口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3265円 (13,265円)	1.4560円 (14,560円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。	同左
2．時価の算定方法	(1)有価証券 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。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は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。	同左



項目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。	同左

## （その他の注記）

項目	自 平成25年7月17日 至 平成26年7月15日	自 平成26年7月16日 至 平成27年1月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,721,505,160円	4,633,286,322円
同期中追加設定元本額	365,402,491円	166,339,379円
同期中一部解約元本額	453,621,329円	288,957,154円
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	71,595,788円	64,382,478円
ハッピーエイジング20	1,431,921,860円	1,378,121,778円
ハッピーエイジング30	1,438,140,305円	1,425,986,660円
ハッピーエイジング40	1,266,126,867円	1,231,966,445円
ハッピーエイジング50	356,206,047円	343,514,511円
ハッピーエイジング60	69,295,455円	66,696,675円
計	4,633,286,322円	4,510,668,547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

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## 損保ジャパン日本債券マザーファンドの状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	459,925,675	237,181,963
国債証券	7,561,768,440	9,199,156,640
地方債証券	40,389,200	40,106,520
特殊債券	770,353,472	1,761,254,048
社債券	4,335,114,000	3,843,617,200
未収入金	100,269,000	-
未収利息	18,560,564	20,922,892
前払費用	5,754,149	4,318,397
流動資産合計	13,292,134,500	15,106,557,660
資産合計	13,292,134,500	15,106,557,660
負債の部		
流動負債		
未払金	499,226,400	100,000,000
流動負債合計	499,226,400	100,000,000
負債合計	499,226,400	100,000,000
純資産の部		
元本等		
元本	9,865,255,860	11,158,578,001
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,927,652,240	3,847,979,659
純資産合計	12,792,908,100	15,006,557,660
負債純資産合計	13,292,134,500	15,106,557,660

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、以下のとおり、原則として時価で評価しております。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	<p>有価証券売買等損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
1．受益権の総数	9,865,255,860口	11,158,578,001口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2968円 (12,968円)	1.3448円 (13,448円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	<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>	同左
2．時価の算定方法	<p>(1)有価証券</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>(2)デリバティブ取引</p> <p>該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は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

項目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。	同左

## （その他の注記）

項目	自 平成25年7月17日 至 平成26年7月15日	自 平成26年7月16日 至 平成27年1月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	8,216,981,694円	9,865,255,860円
同期中追加設定元本額	2,305,462,790円	1,940,178,149円
同期中一部解約元本額	657,188,624円	646,856,008円
元本の内訳*		
ファンド名		
損保ジャパン日本債券ファンド	954,989,707円	981,072,761円
ハッピーエイジング20	110,855,307円	114,111,710円
ハッピーエイジング30	524,379,723円	558,165,523円
ハッピーエイジング40	2,694,965,278円	2,823,303,296円
ハッピーエイジング50	2,132,766,720円	2,218,568,912円
ハッピーエイジング60	1,915,510,834円	1,962,406,286円
パン・アフリカ株式ファンド	13,043,008円	9,356,921円
アジア転換社債ファンド（毎月分配型）	6,384,206円	5,643,785円
人民元建て債券ファンド	4,189,266円	3,805,376円
オフショア人民元債フォーカス（ダイワSMA専用）	311,338円	235,667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	13,756,258円	16,539,986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	84,298,659円	105,016,290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	1,367,403,354円	2,285,611,031円

項目	自 平成25年7月17日 至 平成26年7月15日	自 平成26年7月16日 至 平成27年1月15日
好配当米国株式プレミアム・ ファンド 円ヘッジありコース	69,964円	62,321円
好配当米国株式プレミアム・ ファンド 円ヘッジなしコース	77,732円	70,089円
好配当米国株式プレミアム・ ファンド 通貨セレクトコース	1,615,299円	3,301,716円
好配当米国株式プレミアム・ ファンド 通貨セレクト・プレ ミアムコース	21,544,111円	52,006,591円
金利上昇対応型グローバル・ハ イ・イールドファンド 円ヘッ ジありコース	2,727,735円	2,753,403円
金利上昇対応型グローバル・ハ イ・イールドファンド 円ヘッ ジなしコース	1,977,973円	2,141,572円
金利上昇対応型グローバル・ハ イ・イールドファンド 通貨セ レクトコース	14,389,388円	14,404,765円
計	9,865,255,860円	11,158,578,001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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## 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

## 貸借対照表

（単位：円）

科 目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	7,237,692	18,846,825
コール・ローン	54,796,420	52,937,021
国債証券	4,924,855,593	5,336,178,357
派生商品評価勘定	565,320	-
未収入金	518,069,899	-
未収利息	37,877,386	34,496,517
前払費用	11,654,224	9,494,198
流動資産合計	5,555,056,534	5,451,952,918
資産合計	5,555,056,534	5,451,952,918
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	509,404	-
未払金	519,293,382	-
流動負債合計	519,802,786	-
負債合計	519,802,786	-
純資産の部		
元本等		
元本	3,571,638,886	3,426,169,852
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,463,614,862	2,025,783,066
純資産合計	5,035,253,748	5,451,952,918
負債純資産合計	5,555,056,534	5,451,952,918

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</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られ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られた価額で評価しております。</p>
2．デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法による時価法によっております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3．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>
4．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>
5．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>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
1．受益権の総数	3,571,638,886口	3,426,169,852口
2．1口当たり純資産額	1.4098円	1.5913円
（1万口当たり純資産額）	（14,098円）	（15,913円）

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は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)有価証券 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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は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>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	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。



## （その他の注記）

項目	自 平成25年7月17日 至 平成26年7月15日	自 平成26年7月16日 至 平成27年1月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	3,536,537,379円	3,571,638,886円
同期中追加設定元本額	307,162,870円	168,578,537円
同期中一部解約元本額	272,061,363円	314,047,571円
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）	210,997,464円	196,879,913円
ハッピーエイジング20	306,296,604円	286,346,176円
ハッピーエイジング30	1,207,437,513円	1,167,203,350円
ハッピーエイジング40	1,128,269,054円	1,073,438,800円
ハッピーエイジング50	379,091,810円	358,122,877円
ハッピーエイジング60	129,093,728円	120,103,250円
損保ジャパン外国債券ファンド（為替ヘッジなし）	210,452,713円	224,075,486円
計	3,571,638,886円	3,426,169,852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

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成26年7月15日 現在				平成27年1月15日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	155,465,596	-	155,975,000	509,404	-	-	-	-
アメリカ・ドル	151,038,300	-	151,545,240	506,940	-	-	-	-
ユーロ	4,427,296	-	4,429,760	2,464	-	-	-	-
買 建	149,951,130	-	150,516,450	565,320	-	-	-	-
マレーシア・リン ギット	149,951,130	-	150,516,450	565,320	-	-	-	-
合計	305,416,726	-	306,491,450	55,916	-	-	-	-

## （注）時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
 計算期間末日において予約為替の受渡日（以下、「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該仲値で評価しております。  
 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。  
 （イ）計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。  
 （ロ）計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。
2. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。  
 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンドの状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	169,665,928	264,805,701
コール・ローン	118,081,003	168,518,583
株式	8,413,735,173	8,861,107,731
投資証券	164,265,688	188,963,194
未収入金	-	24,344,531
未収配当金	5,510,807	4,055,875
流動資産合計	8,871,258,599	9,511,795,615
資産合計	8,871,258,599	9,511,795,615
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	99,285	-
未払金	-	9,951,637
流動負債合計	99,285	9,951,637
負債合計	99,285	9,951,637
純資産の部		
元本等		
元本	6,391,759,222	6,057,017,963
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,479,400,092	3,444,826,015
純資産合計	8,871,159,314	9,501,843,978
負債純資産合計	8,871,258,599	9,511,795,615

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>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> <p>投資証券</p> <p>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. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法による時価法によっております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買取相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 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取相場の仲値によって計算しております。</p>
4. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、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>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>

5. 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>
----------------------------	--

## (貸借対照表に関する注記)

項目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
1. 受益権の総数	6,391,759,222口	6,057,017,963口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3879円 (13,879円)	1.5687円 (15,687円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<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>	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は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)有価証券 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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は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>

項目	平成26年7月15日現在	平成27年1月15日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	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。

## (その他の注記)

項目	自 平成25年7月17日 至 平成26年7月15日	自 平成26年7月16日 至 平成27年1月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	6,835,140,048円	6,391,759,222円
同期中追加設定元本額	399,395,278円	491,851,306円
同期中一部解約元本額	842,776,104円	826,592,565円
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)	874,568,966円	764,142,472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)	1,081,978,377円	1,067,446,773円
ハッピーエイジング20	1,710,879,744円	1,606,330,673円
ハッピーエイジング30	1,287,531,077円	1,249,978,612円
ハッピーエイジング40	1,069,417,348円	1,021,825,269円
ハッピーエイジング50	279,983,097円	265,634,368円
ハッピーエイジング60	87,400,613円	81,659,796円
計	6,391,759,222円	6,057,017,963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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成26年7月15日 現在				平成27年1月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	32,275,192	-	32,374,477	99,285	-	-	-	-
香港・ドル	1,128,063	-	1,130,737	2,674	-	-	-	-
イギリス・ポンド	6,019,152	-	6,025,363	6,211	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	2,111,738	-	2,116,284	4,546	-	-	-	-
シンガポール・ドル	2,163,884	-	2,169,820	5,936	-	-	-	-
スイス・フラン	1,924,319	-	1,931,029	6,710	-	-	-	-
ノルウェー・クローネ	1,141,129	-	1,143,774	2,645	-	-	-	-
ユーロ	17,786,907	-	17,857,470	70,563	-	-	-	-
合計	32,275,192	-	32,374,477	99,285	-	-	-	-

（注）時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
 計算期間末日において予約為替の受渡日（以下、「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該仲値で評価しております。  
 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。  
 （イ）計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。  
 （ロ）計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。
2. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。  
 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 2【ファンドの現況】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

&lt;更新・訂正後&gt;

## 【純資産額計算書】

## ハッピーエイジング20

平成27年1月30日現在

資産総額	7,967,594,483円
負債総額	12,758,866円
純資産総額（ - ）	7,954,835,617円
発行済数量	6,547,154,117口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.2150円

## ハッピーエイジング30

平成27年1月30日現在

資産総額	9,574,569,965円
負債総額	15,858,233円
純資産総額（ - ）	9,558,711,732円
発行済数量	7,448,423,423口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.2833円

## ハッピーエイジング40

平成27年1月30日現在

資産総額	11,632,117,287円
負債総額	12,253,219円
純資産総額（ - ）	11,619,864,068円
発行済数量	8,891,661,677口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.3068円

## ハッピーエイジング50

平成27年1月30日現在

資産総額	5,303,822,184円
負債総額	8,893,136円
純資産総額（ - ）	5,294,929,048円
発行済数量	4,088,379,294口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.2951円

## ハッピーエイジング60

平成27年1月30日現在

資産総額	3,225,936,471円
負債総額	5,020,167円
純資産総額（ - ）	3,220,916,304円
発行済数量	2,610,141,065口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.2340円



## （参考）マザーファンドの現況

## 損保ジャパン日本株マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産総額	11,007,639,161円
負債総額	49,994,491円
純資産総額（ - ）	10,957,644,670円
発行済数量	6,863,120,413口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.5966円

## 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27年1月30日現在

資産総額	6,714,252,292円
負債総額	70,618,505円
純資産総額（ - ）	6,643,633,787円
発行済数量	4,448,605,557口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.4934円

## 損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産総額	15,860,363,948円
負債総額	614,348,100円
純資産総額（ - ）	15,246,015,848円
発行済数量	11,432,181,285口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.3336円

## 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27年1月30日現在

資産総額	5,612,066,333円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	5,612,066,333円
発行済数量	3,549,588,224口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.5810円

## 損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産総額	9,979,596,424円
負債総額	119,003,157円
純資産総額（ - ）	9,860,593,267円
発行済数量	6,172,058,178口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.5976円

## 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】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

##### (1) 資本金の額（平成27年2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27年4月1日現在）

会社の意思決定機構

定款に基づき15名以内の取締役が株主総会において選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上にあたる株式を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行います。また、その選任決議は、累積投票によらないものとしします。

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。増員により、または補欠として選任された取締役の任期は、他の在任取締役の任期終了と同時に終了します。

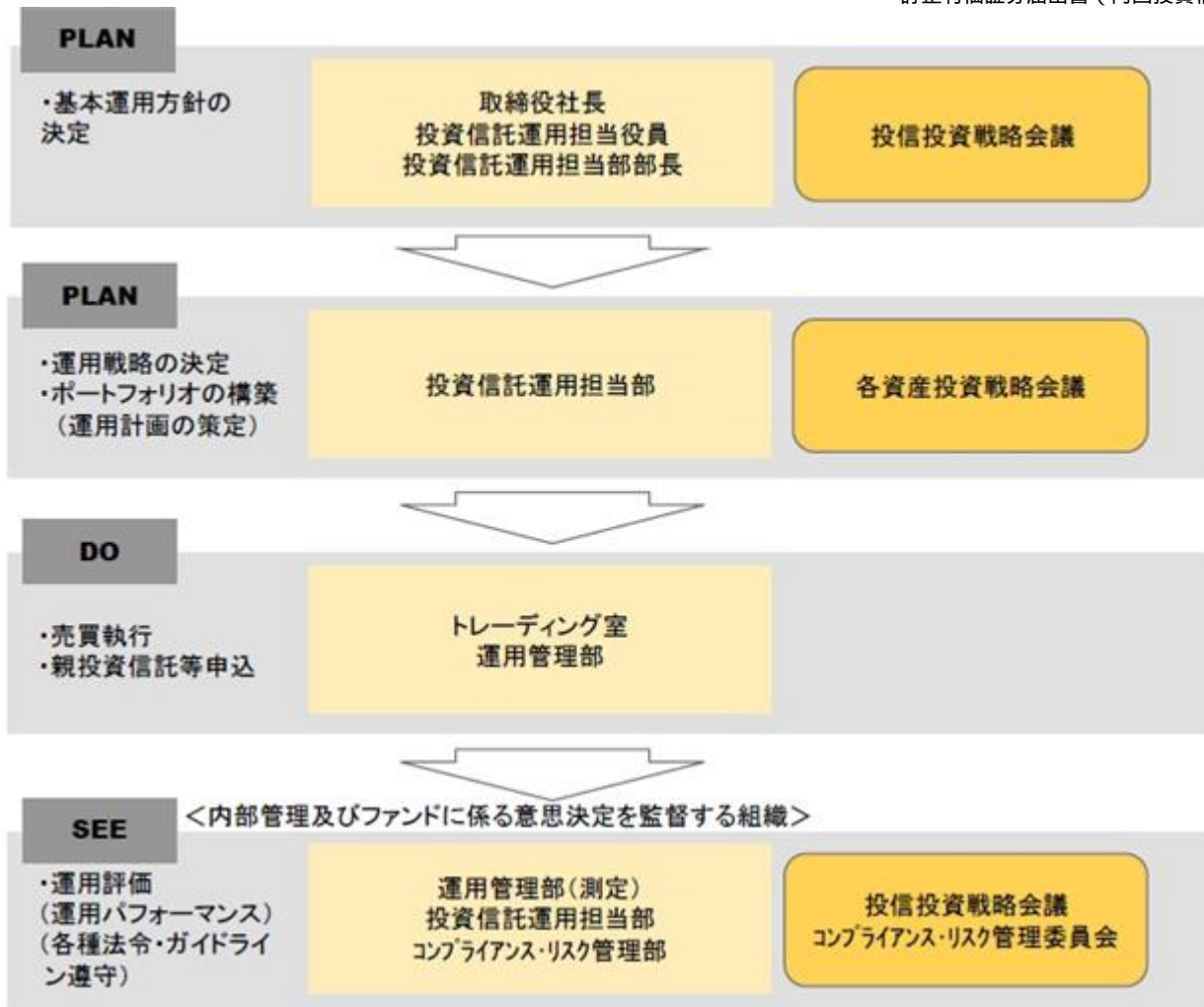
取締役会の決議によって、代表取締役を選定します。また、取締役会長、取締役社長各1名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役社長が招集し、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会日の3日前までに発します。ただし、緊急の必要のある場合には、この期間を短縮することができます。

取締役会は、法令または定款に別段の定めがある場合のほか、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、出席した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、トレーディング室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】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

「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27年2月末現在、計115本（追加型株式投資信託103本、単位型株式投資信託12本）であり、その純資産総額の合計は873,577百万円です。

### 3【委託会社等の経理状況】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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。

また、委託会社の中間財務諸表は「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)、ならびに、同規則第38条第1項及び第57条第1項の規定に基づき、「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25年4月1日から平成26年3月31日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

また、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、第30期中間会計期間(自平成26年4月1日至平成26年9月30日)の中間財務諸表について新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

		前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
区分	注記 番号	金額(千円)	金額(千円)
(資産の部)			
流動資産			
1 現金・預金		2,104,567	3,179,267
2 前払費用		70,097	133,019
3 未収委託者報酬		545,598	569,687
4 未収運用受託報酬		246,403	252,128
5 未収収益		45	73
6 繰延税金資産		97,142	57,628
7 その他		4,535	323
流動資産合計		3,068,389	4,192,127
固定資産			
1 有形固定資産			
(1) 建物	* 1	56,460	47,031
(2) 器具備品	* 1	14,422	10,600
有形固定資産合計		70,882	57,631
2 無形固定資産			
(1) 電話加入権		4,535	4,535
無形固定資産合計		4,535	4,535
3 投資その他の資産			
(1) 投資有価証券		39,786	64,604
(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	110,616
(5) その他		29	29
投資その他の資産合計		297,428	410,253
固定資産合計		372,847	472,419
資産合計		3,441,236	4,664,547

区分	注記 番号	前事業年度 (平成25年3月31日)		当事業年度 (平成26年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
<b>(負債の部)</b>					
流動負債					
1			13,613		5,256
2					
		257,132		264,886	
		85,958	343,090	103,918	368,804
3			205,473		301,051
4			37,990		47,871
5			53,878		260,111
6			-		67,612
7			45,837		47,208
8			10,800		8,400
			710,684		1,106,316
流動負債合計					
固定負債					
1			49,692		59,903
2			7,492		7,625
			57,184		67,528
固定負債合計					
負債合計					
767,869					
1,173,844					
<b>(純資産の部)</b>					
株主資本					
1			1,550,000		1,550,000
2					
			413,280		413,280
			413,280		413,280
3					
			701,589		1,515,658
			701,589		1,515,658
株主資本合計					
2,664,870					
3,478,938					
評価・換算差額等					
1			8,496		11,764
			8,496		11,764
評価・換算差額等合計					
純資産合計					
2,673,366					
3,490,702					
負債・純資産合計					
3,441,236					
4,664,547					

## ( 2 ) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1 委託者報酬		2,973,305		4,255,278	
2 運用受託報酬		2,136,259	5,109,564	2,330,904	6,586,183
営業費用					
1 支払手数料		1,413,637		2,108,094	
2 広告宣伝費		11,137		6,708	
3 公告費		200		1,780	
4 調査費		1,206,182		1,432,804	
(1) 調査費		553,301		569,905	
(2) 委託調査費		650,602		860,367	
(3) 図書費		2,278		2,532	
5 営業雑経費		143,886		149,262	
(1) 通信費		17,371		18,408	
(2) 印刷費		115,900		120,430	
(3) 諸会費		10,614	2,775,044	10,423	3,698,650
一般管理費					
1 給料		1,254,518		1,201,183	
(1) 役員報酬		47,888		39,975	
(2) 給料・手当		1,120,265		1,063,436	
(3) 賞与		86,364		97,771	
2 福利厚生費		92,228		96,749	
3 交際費		5,315		8,762	
4 寄付金		100		200	
5 旅費交通費		34,133		33,717	
6 法人事業税		11,992		14,646	
7 租税公課		6,373		7,341	
8 不動産賃借料		236,560		238,291	
9 退職給付費用		34,499		33,185	
10 賞与引当金繰入		45,837		47,208	

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
11 役員賞与引当金繰入		10,800		8,400	
12 固定資産減価償却費		23,523		15,279	
13 諸経費		133,243	1,889,126	146,303	1,851,270
営業利益			445,394		1,036,262
営業外収益					
1 受取配当金		130		951	
2 受取利息		235		367	
3 有価証券売却益		503		-	
4 為替差益		1,637		1,098	
5 雑益		1,682	4,188	1,893	4,310
営業外費用					
1 有価証券売却損		-		1	
2 雑損		109	109	2,709	2,711
経常利益			449,473		1,037,861
特別損失					
1 固定資産除却損	* 1	-	-	325	325
税引前当期純利益			449,473		1,037,536
法人税、住民税及び事業 税			47,159		273,769
法人税等調整額			124,457		50,302
当期純利益			526,770		814,068



## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	174,819	174,819	2,138,099
当期変動額						
当期純利益				526,770	526,770	526,770
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	526,770	526,770	526,770
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	701,589	701,589	2,664,870

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,192	1,192	2,136,906
当期変動額			
当期純利益			526,770
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	9,689	9,689	9,689
当期変動額合計	9,689	9,689	536,460
当期末残高	8,496	8,496	2,673,366

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	701,589	701,589	2,664,870
当期変動額						
当期純利益				814,068	814,068	814,068
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	814,068	814,068	814,068
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	1,515,658	1,515,658	3,478,938

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	8,496	8,496	2,673,366
当期変動額			
当期純利益			814,068
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	3,267	3,267	3,267
当期変動額合計	3,267	3,267	817,335
当期末残高	11,764	11,764	3,490,702

## 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。

### 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会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25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。

## 追加情報

### （子会社の解散及び清算）

当社は、平成26年2月25日開催の取締役会において、米国の100%子会社であるTACT ASSET MANAGEMENT INC.を解散することを決議し、翌事業年度中の清算手続完了を予定しております。当該解散により翌事業年度に特別利益として約1億円の計上を見込んでおります。なお、当該解散に伴う営業活動等への重要な影響はありません。

## 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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
建物	46,691千円	56,120千円
器具備品	60,361	42,124

## （損益計算書関係）

\* 1 . 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
器具備品	- 千円	325千円

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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。

当事業年度（自 平成25年 4月 1日 至 平成26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

（決議）	株式の 種類	配当金の 総額	配当の原資	1株当たり 配当額	基準日	効力発生日
平成26年 6月25日 定時株主総会	普通株式	407,036千円	利益剰余金	16,900円	平成26年 3月31日	平成26年 6月26日

## （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			
その他有価証券	24,036	24,036	-
資産計	2,128,604	2,128,604	-

当事業年度（平成26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	3,179,267	3,179,267	-
(2) 投資有価証券			
その他有価証券	48,854	48,854	-
資産計	3,228,121	3,228,121	-

## 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25年3月31日)	当事業年度 (平成26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 その他有価証券」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

当事業年度（平成26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	3,179,166	-	-	-
(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	29,028	19,825	-	-
合計	3,208,194	19,825	-	-

## 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



当事業年度（平成26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	39,282	20,985	18,297
	小計	39,282	20,985	18,297
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	9,572	9,590	18
	小計	9,572	9,590	18
合計		48,854	30,575	18,278

## 5. 売却したその他有価証券

前事業年度（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	-

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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	98	-	1
合計	98	-	1

## （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）

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

## 1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を採用しております。

## 2．退職給付債務に関する事項

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

## 3．退職給付費用に関する事項

	前事業年度 (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）	34,499
退職給付費用（千円）	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。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

## 1．採用している退職給付制度の概要（出向受入者に対する出向元への退職金負担額を除く。）

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

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

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

## 2．簡便法を適用した確定給付制度

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

退職給付引当金の期首残高	49,692	千円
退職給付費用	13,106	
退職給付の支払額	2,895	
退職給付引当金の期末残高	59,903	

## (2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

非積立型制度の退職給付債務	59,903	千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	59,903	
<hr/>		
退職給付引当金	59,903	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	59,903	
<hr/>		

## (3) 退職給付に係る負債

簡便法で計算した退職給付費用	13,106	千円
----------------	--------	----

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、9,867千円でありました。

## (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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
繰延税金資産		
ソフトウェア損金算入限度超過額	85,208千円	96,962千円
退職給付引当金	17,721	21,349
未払費用否認	19,883	19,566
未払事業税	5,674	19,448
賞与引当金	17,422	16,824
繰越欠損金	163,192	-
その他	4,713	4,603
繰延税金資産小計	313,818	178,755
評価性引当額	187,913	2,815
繰延税金資産合計	125,904	175,940
繰延税金負債		
その他有価証券差額金	4,705	6,514
固定資産除去価額	1,447	1,181
繰延税金負債合計	6,152	7,695
繰延税金資産の純額	119,751	168,244

## 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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
法定実効税率	38.0%	38.0%
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.4	0.8
住民税均等割	0.5	0.2
税務上の繰越欠損金の利用	37.3	16.4
評価性引当額の増減	19.8	1.8
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-	0.7
税効果会計適用後の法人税等の負担率	17.2	21.5

## 3．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないことになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については従来の38.0%から35.6%になります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は7,038千円減少し、法人税等調整額が同額増加しております。

## （資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## 1．当該資産除去債務の概要

本社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24年4月1日	（自	平成25年4月1日
	至	平成25年3月31日）	至	平成26年3月31日）
期首残高		7,361千円		7,492千円
時の経過による調整額		130		133
期末残高		7,492		7,625

## （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	-
NK S J ひまわり生命保険株式会社	198,960	-

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

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	453,804	-
日本興亜損害保険株式会社	253,819	-
NK S J ひまわり生命保険株式会社	179,208	-

## （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。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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	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	179,208	未収運用受託報酬	95,172
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパンDC証券株式会社	東京都新宿区	3,000,000	確定拠出年金業	-	投資信託に係る事務代行の委託等（注2）	投資信託代行手数料の支払い	331,709	未払手数料	75,919

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。

（注2）代行手数料の支払いについては、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

NKS J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24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	110,997.16円	144,932.64円
1株当たり当期純利益金額	21,871.32円	33,799.80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24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益(千円)	526,770	814,068
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)	526,770	814,068
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。



## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

		第30期中間会計期間 (平成26年9月30日)
区分	注記 番号	金額(千円)
(資産の部)		
流動資産		
1 現金・預金		2,914,231
2 前払費用		100,257
3 未収委託者報酬		829,535
4 未収運用受託報酬		612,847
5 未収収益		87
6 繰延税金資産		65,859
7 その他		1,674
流動資産合計		4,524,493
固定資産		
1 有形固定資産	1	64,055
2 無形固定資産		4,535
3 投資その他の資産		
(1) 長期差入保証金		193,955
(2) 繰延税金資産		121,079
(3) その他		76,692
投資その他の資産合計		391,728
固定資産合計		460,318
資産合計		4,984,812

		第30期中間会計期間 (平成26年9月30日)
区分	注記 番号	金額(千円)
(負債の部)		
流動負債		
1 預り金		5,609
2 未払金		
(1) 未払手数料		363,238
(2) その他未払金		103,980
未払金合計		467,219
3 未払費用		384,233
4 未払法人税等		293,597
5 前受収益		57,382
6 賞与引当金		45,917
7 役員賞与引当金		4,800
8 その他	2	108,368
流動負債合計		1,367,128
固定負債		
1 退職給付引当金		60,563
2 資産除去債務		7,693
固定負債合計		68,256
負債合計		1,435,384

		第30期中間会計期間 (平成26年9月30日)
区分	注記 番号	金額(千円)
(純資産の部)		
株主資本		
1 資本金		1,550,000
2 資本剰余金		
(1) 資本準備金		413,280
資本剰余金合計		413,280
3 利益剰余金		
(1) その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		1,586,002
利益剰余金合計		1,586,002
株主資本合計		3,549,282
評価・換算差額等		
1 その他有価証券評価差額金		144
評価・換算差額等合計		144
純資産合計		3,549,427
負債・純資産合計		4,984,812

## (2) 中間損益計算書

		第30期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
区分	注記 番号	金額(千円)	
営業収益			
1 委託者報酬		3,063,908	
2 運用受託報酬		1,198,344	4,262,252
営業費用			
1 支払手数料		1,530,387	
2 広告宣伝費		8,797	
3 公告費		200	
4 調査費		903,571	
(1) 調査費		278,716	
(2) 委託調査費		623,252	
(3) 図書費		1,602	
5 営業雑経費		104,686	
(1) 通信費		11,473	
(2) 印刷費		83,756	
(3) 諸会費		9,456	2,547,642
一般管理費			
1 給料		612,196	
(1) 役員報酬		57,478	
(2) 給料・手当		517,519	
(3) 賞与		37,198	
2 福利厚生費		54,256	
3 交際費		3,025	
4 旅費交通費		17,726	
5 法人事業税		8,414	
6 租税公課		5,728	
7 不動産賃借料		120,004	
8 退職給付費用		17,550	
9 賞与引当金繰入		45,917	
10 役員賞与引当金繰入		4,800	
11 固定資産減価償却費	1	6,761	
12 諸経費		91,178	987,560
営業利益			727,049

		第30期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
区分	注記 番号	金額(千円)	
営業外収益			
1 受取配当金		1,358	
2 受取利息		218	
3 有価証券償還益		18,193	
4 為替差益		1,055	
5 雑益		2,890	23,716
営業外費用			
1 有価証券売却損		30	
2 雑損		172	203
経常利益			750,562
税引前中間純利益			750,562
法人税、住民税及び事業税			285,442
法人税等調整額			12,260
中間純利益			477,380

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第30期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	1,515,658	1,515,658	3,478,938
当中間期変動額						
剰余金の配当				407,036	407,036	407,036
中間純利益				477,380	477,380	477,380
株主資本以外の項目の当 中間期変動額（純額）						
当中間期変動額合計	-	-	-	70,344	70,344	70,344
当中間期末残高	1,550,000	413,280	413,280	1,586,002	1,586,002	3,549,282

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	11,764	11,764	3,490,702
当中間期変動額			
剰余金の配当			407,036
中間純利益			477,380
株主資本以外の項目の当 中間期変動額（純額）	11,619	11,619	11,619
当中間期変動額合計	11,619	11,619	58,724
当中間期末残高	144	144	3,549,427

## 重要な会計方針

### 1．資産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によっております。

#### (2) その他有価証券

##### 時価のあるもの

中間会計期間末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により算定）によっております。

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 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。

### 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、中間会計期間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中間会計期間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の当中間会計期間負担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、当中間会計期間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会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25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

(中間貸借対照表関係)

第30期中間会計期間  
(平成26年9月30日)

1 有形固定資産の減価償却累計額	105,005千円
2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第30期中間会計期間  
(自 平成26年4月1日  
至 平成26年9月30日)

1 減価償却実施額 有形固定資産	6,761千円
---------------------	---------

(中間株主資本等変動計算書関係)

第30期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数並びに自己株式の種類及び株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
発行済株式				
普通株式	24,085	-	-	24,085
合計	24,085	-	-	24,085
自己株式				
普通株式	-	-	-	-
合計	-	-	-	-

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成26年6月25日 定時株主総会	普通株式	407,036	16,900	平成26年3月31日	平成26年6月26日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間の末日後となるもの

該当事項はありません。



## （金融商品関係）

第30期中間会計期間（平成26年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成26年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。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）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額	時 価	差 額
(1) 現金・預金	2,914,231	2,914,231	-
(2) 投資有価証券			
其他有価証券	19,828	19,828	-
資産計	2,934,059	2,934,059	-

注1．金融商品の時価の算定方法

## 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	中間貸借対照表計上額
非上場株式	15,750
関係会社株式	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。

## （有価証券関係）

第30期中間会計期間（平成26年9月30日）

## 1．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 2．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（中間貸借対照表計上額 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。

## 3．その他有価証券

（単位：千円）

	種 類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差 額
中間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	10,565	10,186	378
	小 計	10,565	10,186	378
中間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	9,263	9,417	154
	小 計	9,263	9,417	154
合計		19,828	19,603	224

## （デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

## （ストック・オプション等関係）

該当事項はありません。

## （資産除去債務関係）

第30期中間会計期間（平成26年9月30日）

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減

期首残高	7,625千円
時の経過による調整額	68
中間期末残高	7,693

## （セグメント情報等）

セグメント情報

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26年9月30日）

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

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26年9月30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中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が中間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中間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）

顧客の氏名又は名称	営業収益	関連するセグメント名
損害保険ジャパン日本興亜株式会社（注1）	317,691	-
損保ジャパン日本興亜ひまわり生命保険株式会社（注2）	93,015	-

注1．損害保険ジャパン日本興亜株式会社は、平成26年9月1日に株式会社損害保険ジャパンと日本興亜損害保険株式会社が合併し商号を損害保険ジャパン日本興亜株式会社に変更しております。

2．NKSJひまわり生命保険株式会社は、平成26年9月1日に商号を損保ジャパン日本興亜ひまわり生命保険株式会社に変更しております。

## （ 1株当たり情報）

	第30期中間会計期間 （自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）
1株当たり純資産額	147,370.86円
1株当たり中間純利益金額	19,820.65円
	なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第30期中間会計期間 （自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）
中間純利益（千円）	477,380
普通株主に帰属しない金額（千円）	-
普通株式に係る中間純利益（千円）	477,380
普通株式の期中平均株式数（株）	24,085

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

## 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】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## (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26年9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26年9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26年9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。
エース証券株式会社	8,831	
株式会社 S B I 証券	47,937	
岡三にいがた証券株式会社	852	
カブドットコム証券株式会社	7,196	
損保ジャパン日本興亜 D C 証券株式会社	3,000	
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	1,404,065	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
損害保険ジャパン日本興亜株式会社	70,000	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

## (3)投資顧問会社

TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY

資本金の額 25千ドル（平成26年12月末現在）

（3,013千円、1ドル=120.55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。

## 2【関係業務の概要】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

### (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

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。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成27年3月13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、「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26年7月16日から平成27年1月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング20の平成27年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成26年7月16日から平成27年1月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

[次へ](#)



# 独立監査人の中間監査報告書

平成27年3月13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、「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26年7月16日から平成27年1月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング30の平成27年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成26年7月16日から平成27年1月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成27年3月13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、「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26年7月16日から平成27年1月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング40の平成27年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成26年7月16日から平成27年1月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成27年3月13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、「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26年7月16日から平成27年1月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング50の平成27年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成26年7月16日から平成27年1月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成27年3月13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、「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26年7月16日から平成27年1月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング60の平成27年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成26年7月16日から平成27年1月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

[次へ](#)



# 独立監査人の監査報告書

平成26年6月4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25年4月1日から平成26年3月31日までの第29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26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

(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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成26年11月25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26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、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26年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 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）1．上記は、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。