

【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28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】	生稲 博美
【電話番号】	03-5290-3429
【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】

平成27年10月14日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）につきまして、半期報告書の提出に伴い、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。

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>

（略）

<ファンドの特色>

（略）

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2015年7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。2015年6月末現在の同グループの運用資産は、約1,787億米ドル(約21兆8,818億円[※])です。

※2015年6月末時点の為替レートで換算。

（略）

<訂正後>

（略）

<ファンドの特色>

（略）

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2016年1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。2015年12月末現在の同グループの運用資産は、約1.807億米ドル(約21兆7,942億円[※])です。

※2015年12月末時点の為替レートで換算。

(略)

（ 3 ）【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

（ 略 ）

委託会社等の概況

（ ）資本金の額 1,550百万円（平成27年7月末現在）

（ 略 ）

（ ）大株主の状況（平成27年7月末現在）

（ 略 ）

< 訂正後 >

（ 略 ）

委託会社等の概況

（ ）資本金の額 1,550百万円（平成28年1月末現在）

（ 略 ）

（ ）大株主の状況（平成28年1月末現在）

（ 略 ）

2 【投資方針】

（ 3 ）【運用体制】

< 訂正前 >

a . 委託会社の運用体制と社内規程

（ 略 ）

平成27年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

b . 運用委託先の運用体制等

（ 略 ）

（本組織図は、平成27年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。）

< 訂正後 >

a . 委託会社の運用体制と社内規程

（ 略 ）

平成28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。

b . 運用委託先の運用体制等

（ 略 ）

（本組織図は、平成28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。）

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

(略)

(注) 上図は、平成27年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

(略)

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8月～2015年7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
2010年8月～2015年7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…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド (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。

・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。

・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、J.P. Morgan Securities LLCが算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。同指数の著作権はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

< 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

(略)

(注) 上図は、平成28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。

(略)

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
2011年2月～2016年1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
2011年2月～2016年1月

ハッピーエイジング20



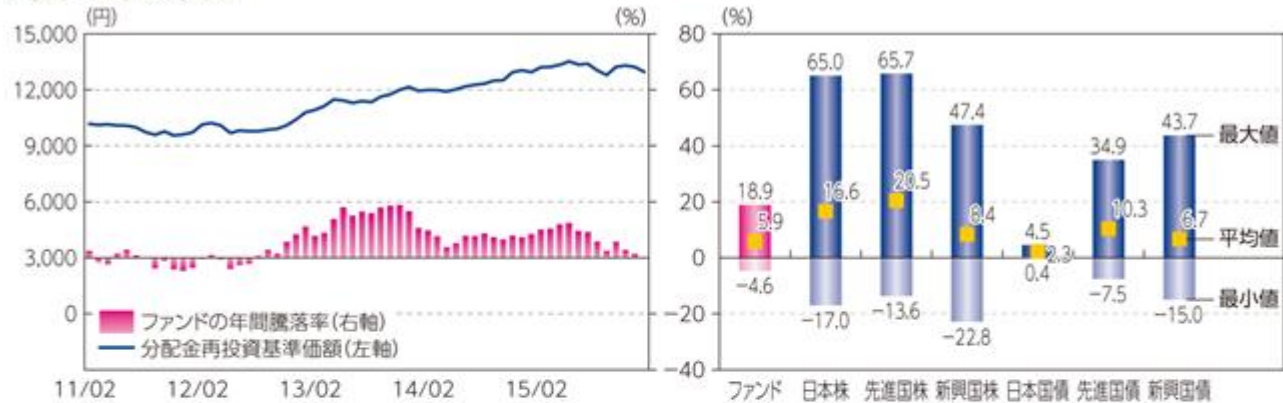
ハッピーエイジング30



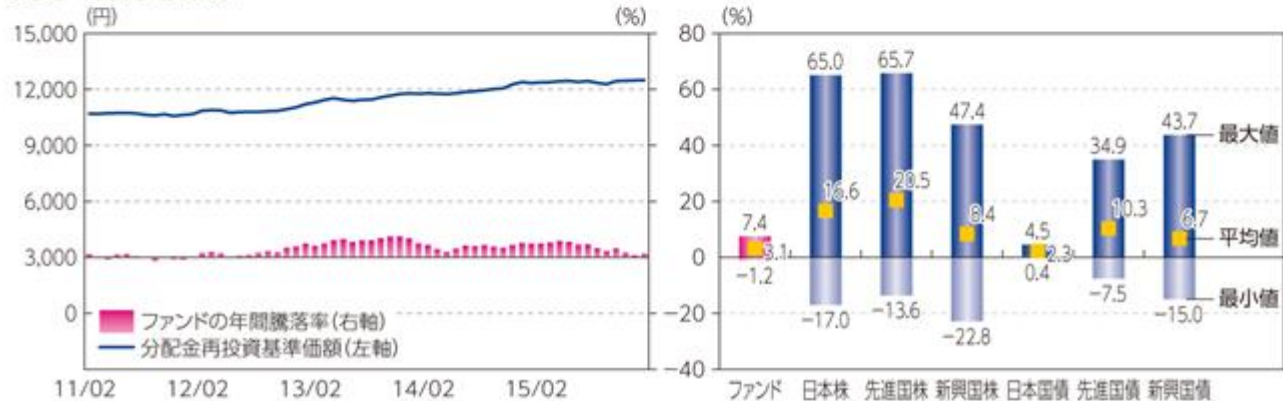
ハッピーエイジング40



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…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(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。

・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイドは、J.P. Morgan Securities LLCが算出公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。同指数の著作権はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

4【手数料等及び税金】

（5）【課税上の取扱い】

<訂正前>

（略）

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

- ・少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

毎年、年間100万円（平成28年以降は年間120万円）の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、平成28年4月1日より年間80万円の範囲で20歳未満の方を対象とした非課税制度（ジュニアNISA）が開始される予定です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

上記は平成27年7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）

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

- ・少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

上記は平成28年1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28年1月29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	385,099,750	4.97
内 アメリカ	385,099,750	4.97
親投資信託受益証券	7,199,918,514	92.87
内 日本	7,199,918,514	92.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	167,919,347	2.17
純資産総額	7,752,937,611	100.00

ハッピーエイジング30

平成28年1月29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	466,585,527	4.90
内 アメリカ	466,585,527	4.90
親投資信託受益証券	8,838,964,105	92.82
内 日本	8,838,964,105	92.82
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	217,439,421	2.28
純資産総額	9,522,989,053	100.00

ハッピーエイジング40

平成28年1月29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	573,940,032	4.85
内 アメリカ	573,940,032	4.85
親投資信託受益証券	10,985,381,803	92.91
内 日本	10,985,381,803	92.91
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	264,879,064	2.24
純資産総額	11,824,200,899	100.00

ハッピーエイジング50

平成28年1月29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	159,557,225	2.89
内 アメリカ	159,557,225	2.89
親投資信託受益証券	5,245,881,851	94.93
内 日本	5,245,881,851	94.93
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	120,347,561	2.18
純資産総額	5,525,786,637	100.00

ハッピーエイジング60

平成28年1月29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	3,400,872,584	97.92
内 日本	3,400,872,584	97.92
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	72,302,720	2.08
純資産総額	3,473,175,304	100.00

（参考）マザーファンドの投資状況

S J A M ラージキャップ・バリュース・マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	6,328,180,110	97.31
内 日本	6,328,180,110	97.31
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	174,867,756	2.69
純資産総額	6,503,047,866	100.00

S J A M スモールキャップ・マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	6,475,094,200	98.09
内 日本	6,475,094,200	98.09
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	126,114,239	1.91
純資産総額	6,601,208,439	100.00

損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	7,816,259,350	57.78
内 日本	7,816,259,350	57.78
特殊債券	1,800,356,276	13.31
内 日本	1,800,356,276	13.31
社債券	3,556,853,300	26.29
内 日本	2,747,666,600	20.31
内 フランス	408,801,500	3.02
内 オランダ	200,271,000	1.48
内 イギリス	200,114,200	1.48
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	355,245,373	2.63
純資産総額	13,528,714,299	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28年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	5,118,107,445	94.92
内 アメリカ	2,227,656,546	41.31
内 イタリア	1,391,594,728	25.81
内 イギリス	416,857,179	7.73
内 スペイン	277,887,124	5.15
内 ドイツ	170,020,344	3.15
内 フランス	135,822,713	2.52
内 カナダ	100,456,098	1.86
内 オーストラリア	78,951,399	1.46
内 オランダ	68,228,696	1.27
内 ベルギー	67,671,070	1.25
内 メキシコ	39,888,146	0.74
内 デンマーク	38,079,042	0.71
内 ポーランド	30,876,803	0.57
内 南アフリカ	26,624,210	0.49
内 スウェーデン	23,921,769	0.44
内 マレーシア	23,571,578	0.44
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	274,127,436	5.08
純資産総額	5,392,234,881	100.00

損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	8,281,285,487	88.76
内 アメリカ	5,863,078,212	62.84
内 イギリス	494,315,328	5.30
内 スイス	377,477,287	4.05
内 オランダ	289,694,790	3.10
内 フランス	253,463,879	2.72
内 ドイツ	248,021,257	2.66
内 アイルランド	191,104,802	2.05
内 オーストラリア	109,313,412	1.17
内 ジャージー	77,222,680	0.83
内 スウェーデン	68,923,642	0.74
内 シンガポール	68,312,683	0.73
内 パミュエダ	64,006,357	0.69
内 香港	43,606,751	0.47
内 ノルウェー	42,596,432	0.46
内 ケイマン諸島	33,648,866	0.36
内 デンマーク	30,381,859	0.33
内 プエルトリコ	14,324,545	0.15

	内 イタリア	8,290,654	0.09
	内 イスラエル	3,502,051	0.04
投資証券		214,453,676	2.30
	内 アメリカ	214,453,676	2.30
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		834,698,048	8.95
純資産総額		9,330,437,211	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28年1月29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 - TCW外国株式 マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,716,525,773	1.7702 3,038,703,615	1.4858 2,550,413,993	- -	32.90%
2	SJAMスモールキャップ・マ ザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,114,212,863	1.9344 2,155,428,997	1.8188 2,026,530,355	- -	26.14%
3	SJAMラージキャップ・バ リユー・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,347,568,832	1.7603 2,372,231,371	1.4818 1,996,827,495	- -	25.76%
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	298,540,119	1.5752 470,272,144	1.5804 471,812,804	- -	6.09%
5	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託受 益証券	107,601	4,463.28 480,254,107	3,578.96 385,099,750	- -	4.97%
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	112,627,795	1.3288 149,661,181	1.3703 154,333,867	- -	1.99%

(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28年1月29日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	4.97%
親投資信託受益証券	92.87%
合計	97.83%

（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28年1月29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	S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,154,604,476	1.9266 2,224,572,086	1.8188 2,099,994,620	- -	22.05%
2	S J A Mラージキャップ・バ リュウ・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,396,021,616	1.7513 2,444,866,353	1.4818 2,068,624,830	- -	21.72%
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	1,338,026,820	1.7652 2,361,966,989	1.4858 1,988,040,249	- -	20.88%
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	1,218,787,194	1.5749 1,919,488,817	1.5804 1,926,171,281	- -	20.23%
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	551,801,157	1.3288 733,258,383	1.3703 756,133,125	- -	7.94%
6	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託受 益証券	130,369	4,456.17 580,947,382	3,578.96 466,585,527	- -	4.90%

（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28年1月29日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	4.90%
親投資信託受益証券	92.82%
合計	97.72%

（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28年1月29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	2,833,129,124	1.3283 3,763,513,969	1.3703 3,882,236,838	- -	32.83%
2	SJAMスモールキャップ・マ ザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,012,485,778	1.9132 1,937,156,431	1.8188 1,841,509,133	- -	15.57%
3	SJAMラージキャップ・バ リユー・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,224,116,630	1.7283 2,115,742,247	1.4818 1,813,896,022	- -	15.34%
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	1,137,770,806	1.5751 1,792,186,697	1.5804 1,798,132,981	- -	15.21%
5	損保ジャパン - TCW外国株式 マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,110,248,236	1.7501 1,943,105,427	1.4858 1,649,606,829	- -	13.95%
6	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託受 益証券	160,365	4,443.23 712,539,223	3,578.96 573,940,032	- -	4.85%

（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28年1月29日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	4.85%
親投資信託受益証券	92.91%
合計	97.76%

（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28年1月29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	2,290,609,065	1.3277 3,041,408,843	1.3703 3,138,821,601	- -	56.80%
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	390,569,042	1.5752 615,231,782	1.5804 617,255,313	- -	11.17%
3	SJAMスモールキャップ・マ ザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	290,455,685	1.9003 551,975,362	1.8188 528,280,799	- -	9.56%
4	SJAMラージキャップ・バ リユー・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	351,139,195	1.7172 602,980,734	1.4818 520,318,059	- -	9.42%

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	296,948,499	1.7354 515,327,258	1.4858 441,206,079	- -	7.98%
6	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託受 益証券	44,582	4,427.09 197,368,747	3,578.96 159,557,225	- -	2.89%

（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28年1月29日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	2.89%
親投資信託受益証券	94.93%
合計	97.82%

（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28年1月29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	2,073,880,155	1.3274 2,752,953,493	1.3703 2,841,837,976	- -	81.82%
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	134,080,140	1.5742 211,076,786	1.5804 211,900,253	- -	6.10%
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	93,430,395	1.7261 161,276,793	1.4858 138,818,880	- -	4.00%
4	S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	57,711,840	1.9000 109,655,299	1.8188 104,966,294	- -	3.02%
5	S J A Mラージキャップ・バ リュール・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	69,745,702	1.7127 119,454,605	1.4818 103,349,181	- -	2.98%

（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28年1月29日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.92%
合計	97.92%

（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

S J A Mラージキャップ・バリュール・マザーファンド

平成28年1月29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	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	123,400	4,771.55 588,809,669	3,980.00 491,132,000	- -	7.55%
2	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,327,300	220.59 513,388,755	205.80 478,958,340	- -	7.37%
3	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	118,300	4,037.64 477,653,109	3,341.00 395,240,300	- -	6.08%
4	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	170,900	2,684.54 458,789,169	2,126.00 363,333,400	- -	5.59%
5	ヤマダ電機 日本	株式 小売業	623,500	508.31 316,933,688	581.00 362,253,500	- -	5.57%
6	JXホールディングス 日本	株式 石油・石炭製品	741,700	490.73 363,981,750	456.00 338,215,200	- -	5.20%
7	ジェイ エフ イー ホールディ ングス 日本	株式 鉄鋼	206,100	2,429.37 500,694,248	1,606.00 330,996,600	- -	5.09%
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	506,000	736.75 372,799,243	586.40 296,718,400	- -	4.56%
9	マツダ 日本	株式 輸送用機器	137,300	2,400.27 329,557,977	2,148.50 294,989,050	- -	4.54%
10	住友金属鉱山 日本	株式 非鉄金属	229,000	1,423.94 326,084,425	1,257.00 287,853,000	- -	4.43%
11	フジ・メディア・ホールディ ングス 日本	株式 情報・通信業	205,900	1,681.45 346,211,110	1,346.00 277,141,400	- -	4.26%
12	三菱商事 日本	株式 卸売業	140,800	2,329.98 328,062,348	1,905.50 268,294,400	- -	4.13%
13	ブラザー工業 日本	株式 電気機器	176,300	1,546.58 272,662,942	1,199.00 211,383,700	- -	3.25%
14	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	40,500	4,012.66 162,512,991	5,028.00 203,634,000	- -	3.13%
15	第一生命保険 日本	株式 保険業	122,300	1,877.56 229,626,265	1,633.50 199,777,050	- -	3.07%
16	商船三井 日本	株式 海運業	837,000	382.87 320,465,082	236.00 197,532,000	- -	3.04%
17	三井住友トラスト・ホールディ ングス 日本	株式 銀行業	469,000	416.68 195,424,329	379.80 178,126,200	- -	2.74%
18	三井物産 日本	株式 卸売業	112,400	1,577.50 177,311,894	1,355.50 152,358,200	- -	2.34%
19	三菱UFJフィナンシャル・グ ループ 日本	株式 銀行業	217,300	782.62 170,064,994	609.40 132,422,620	- -	2.04%
20	三菱重工業 日本	株式 機械	275,000	460.25 126,571,498	466.60 128,315,000	- -	1.97%
21	日立建機 日本	株式 機械	73,500	2,188.89 160,883,780	1,732.00 127,302,000	- -	1.96%
22	日本郵船 日本	株式 海運業	493,000	332.99 164,167,354	256.00 126,208,000	- -	1.94%
23	西日本シティ銀行 日本	株式 銀行業	438,000	308.48 135,115,078	267.00 116,946,000	- -	1.80%
24	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	89,200	1,235.69 110,223,563	1,180.00 105,256,000	- -	1.62%
25	パナソニック 日本	株式 電気機器	84,500	1,123.96 94,974,774	1,114.00 94,133,000	- -	1.45%

26	小松製作所	日本	株式 機械	51,500	2,056.71 105,920,701	1,770.50 91,180,750	- -	1.40%
27	クラレ	日本	株式 化学	54,500	1,585.86 86,429,480	1,440.00 78,480,000	- -	1.21%

(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28年1月29日現在

種類	投資比率
株式	97.31%
合計	97.31%

(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28年1月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行業	国内	21.49%
輸送用機器		12.23%
鉄鋼		10.68%
電気機器		9.26%
情報・通信業		7.39%
卸売業		6.47%
小売業		5.57%
機械		5.33%
石油・石炭製品		5.20%
海運業		4.98%
非鉄金属		4.43%
保険業		3.07%
化学		1.21%
合計		97.31%

(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。

S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

平成28年1月29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	大和工業 日本	株式 鉄鋼	76,000	2,677.33 203,477,802	2,823.00 214,548,000	- -	3.25%
2	ケースホールディングス 日本	株式 小売業	50,000	3,642.66 182,133,032	4,075.00 203,750,000	- -	3.09%
3	ツムラ 日本	株式 医薬品	62,000	3,359.01 208,258,939	3,255.00 201,810,000	- -	3.06%
4	エイチ・アイ・エス 日本	株式 サービス業	51,800	3,985.37 206,442,671	3,540.00 183,372,000	- -	2.78%
5	阪和興業 日本	株式 卸売業	300,000	470.43 141,129,112	499.00 149,700,000	- -	2.27%
6	大同特殊鋼 日本	株式 鉄鋼	300,000	425.00 127,500,000	497.00 149,100,000	- -	2.26%
7	ゼビオホールディングス 日本	株式 小売業	70,000	2,208.60 154,602,331	2,106.00 147,420,000	- -	2.23%
8	協和エクシオ 日本	株式 建設業	115,000	1,163.55 133,808,517	1,225.00 140,875,000	- -	2.13%
9	エクセディ 日本	株式 輸送用機器	49,000	2,600.00 127,400,000	2,785.00 136,465,000	- -	2.07%
10	住友倉庫 日本	株式 倉庫・運輸関連業	220,000	581.00 127,820,000	614.00 135,080,000	- -	2.05%
11	オンワードホールディングス 日本	株式 繊維製品	180,000	720.30 129,655,731	750.00 135,000,000	- -	2.05%
12	ダイビル 日本	株式 不動産業	140,000	970.54 135,875,932	959.00 134,260,000	- -	2.03%
13	日新製鋼 日本	株式 鉄鋼	118,000	1,055.00 124,490,000	1,127.00 132,986,000	- -	2.01%
14	ジーエス・ユアサ コーポレーション 日本	株式 電気機器	305,000	446.59 136,210,144	416.00 126,880,000	- -	1.92%
15	島忠 日本	株式 小売業	46,000	2,682.54 123,396,850	2,713.00 124,798,000	- -	1.89%
16	コメリ 日本	株式 小売業	52,000	2,400.37 124,819,319	2,378.00 123,656,000	- -	1.87%
17	エディオン 日本	株式 小売業	133,000	792.00 105,336,000	898.00 119,434,000	- -	1.81%
18	レンゴー 日本	株式 パルプ・紙	230,000	463.00 106,490,000	515.00 118,450,000	- -	1.79%
19	日立工機 日本	株式 機械	146,000	874.00 127,604,000	756.00 110,376,000	- -	1.67%
20	N I P P O 日本	株式 建設業	60,000	1,985.00 119,100,000	1,779.00 106,740,000	- -	1.62%
21	日立物流 日本	株式 陸運業	53,000	1,894.00 100,382,000	1,942.00 102,926,000	- -	1.56%
22	日本ゼオン 日本	株式 化学	125,000	896.15 112,018,965	804.00 100,500,000	- -	1.52%
23	東和薬品 日本	株式 医薬品	14,700	7,412.41 108,962,537	6,650.00 97,755,000	- -	1.48%
24	テレビ朝日ホールディングス 日本	株式 情報・通信業	45,000	1,744.00 78,480,000	2,170.00 97,650,000	- -	1.48%
25	ドトール・日レスホールディングス 日本	株式 小売業	49,000	1,810.34 88,706,814	1,829.00 89,621,000	- -	1.36%

26	エフ・シー・シー	株式	33,000	1,711.00	2,638.00	-	1.32%
	日本	輸送用機器		56,463,000	87,054,000	-	
27	小森コーポレーション	株式	64,000	1,315.73	1,340.00	-	1.30%
	日本	機械		84,207,183	85,760,000	-	
28	共英製鋼	株式	40,000	2,025.00	2,080.00	-	1.26%
	日本	鉄鋼		81,000,000	83,200,000	-	
29	E P Sホールディングス	株式	62,300	1,346.00	1,302.00	-	1.23%
	日本	サービス業		83,855,800	81,114,600	-	
30	タチエス	株式	43,200	1,386.00	1,828.00	-	1.20%
	日本	輸送用機器		59,875,200	78,969,600	-	

(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28年1月29日現在

種類	投資比率
株式	98.09%
合計	98.09%

(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28年1月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
小売業	国内	17.30%
輸送用機器		10.94%
鉄鋼		10.35%
電気機器		8.65%
サービス業		6.00%
機械		4.70%
医薬品		4.54%
その他金融業		3.97%
化学		3.78%
建設業		3.75%
繊維製品		3.57%
卸売業		3.35%
情報・通信業		2.75%
不動産業		2.26%
陸運業		2.18%
倉庫・運輸関連業		2.05%
パルプ・紙		1.79%
金属製品		1.53%
ガラス・土石製品		1.10%
電気・ガス業		1.05%
非鉄金属		0.98%
石油・石炭製品		0.46%
食料品		0.42%
銀行業		0.23%
水産・農林業		0.21%
ゴム製品		0.20%
合計		98.09%

（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28年1月29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	3 5 2 2年国債 日本	国債証券	670,000,000	100.18 671,215,380	100.16 671,122,920	0.100000 2017/5/15	4.96%
2	1 5 2 20年国債 日本	国債証券	510,000,000	100.00 510,000,000	107.71 549,326,100	1.200000 2035/3/20	4.06%
3	1 5 1 20年国債 日本	国債証券	500,000,000	100.31 501,580,500	107.98 539,908,500	1.200000 2034/12/20	3.99%
4	3 5 7 2年国債 日本	国債証券	530,000,000	100.24 531,272,000	100.22 531,183,490	0.100000 2017/10/15	3.93%
5	4 3 30年国債 日本	国債証券	440,000,000	105.53 464,341,680	114.84 505,328,120	1.700000 2044/6/20	3.74%
6	3 6 0 2年国債 日本	国債証券	500,000,000	100.27 501,373,900	100.27 501,358,000	0.100000 2018/1/15	3.71%
7	3 5 0 2年国債 日本	国債証券	450,000,000	100.15 450,675,000	100.15 450,677,250	0.100000 2017/3/15	3.33%
8	4 7 30年国債 日本	国債証券	390,000,000	103.94 405,386,800	112.01 436,852,650	1.600000 2045/6/20	3.23%
9	3 5 4 2年国債 日本	国債証券	420,000,000	100.16 420,688,800	100.18 420,791,700	0.100000 2017/7/15	3.11%
10	3 4 1 10年国債 日本	国債証券	410,000,000	101.01 414,143,800	101.95 418,030,670	0.300000 2025/12/20	3.09%
11	1 1 9 5年国債 日本	国債証券	360,000,000	100.18 360,648,000	100.64 362,312,640	0.100000 2019/6/20	2.68%
12	1 5 3 20年国債 日本	国債証券	320,000,000	101.89 326,069,300	109.31 349,792,320	1.300000 2035/6/20	2.59%
13	1 5 0 20年国債 日本	国債証券	310,000,000	104.09 322,687,060	111.72 346,353,080	1.400000 2034/9/20	2.56%
14	1 4 9 20年国債 日本	国債証券	290,000,000	106.10 307,693,190	113.77 329,947,210	1.500000 2034/6/20	2.44%
15	1 5 5 20年国債 日本	国債証券	280,000,000	101.15 283,245,200	103.25 289,113,160	1.000000 2035/12/20	2.14%
16	1 4 8 20年国債 日本	国債証券	230,000,000	106.36 244,628,000	113.97 262,143,650	1.500000 2034/3/20	1.94%
17	3 4 0 10年国債 日本	国債証券	200,000,000	100.96 201,920,000	103.06 206,123,000	0.400000 2025/9/20	1.52%
18	1 みずほFG劣後 日本	社債券	200,000,000	100.48 200,961,400	101.99 203,983,800	0.950000 2024/7/16	1.51%
19	1 明治安田2014基 日本	社債券	200,000,000	100.28 200,562,000	100.91 201,825,800	0.510000 2019/8/7	1.49%
20	6 バークレイズバンク イギリス	社債券	200,000,000	100.03 200,079,800	100.05 200,114,200	0.328000 2017/6/23	1.48%
21	9 2 住宅機構RMB S 日本	特殊債券	191,664,000	99.50 190,705,680	101.56 194,673,124	0.740000 2050/1/10	1.44%
22	1 5 4 20年国債 日本	国債証券	180,000,000	101.83 183,296,100	107.15 192,875,940	1.200000 2035/9/20	1.43%
23	8 6 住宅機構RMB S 日本	特殊債券	185,982,000	101.55 188,883,319	103.42 192,361,182	1.000000 2049/7/10	1.42%

24	7 9 住宅機構 R M B S 日本	特殊債券	174,654,000	102.17 178,461,456	103.86 181,413,108	1.070000 2048/12/10	1.34%
25	7 8 住宅機構 R M B S 日本	特殊債券	172,212,000	101.78 175,294,594	103.95 179,031,595	1.080000 2048/11/10	1.32%
26	1 1 7 5年国債 日本	国債証券	150,000,000	100.57 150,861,100	100.91 151,379,850	0.200000 2019/3/20	1.12%
27	3 5 3 2年国債 日本	国債証券	150,000,000	100.18 150,284,700	100.17 150,264,450	0.100000 2017/6/15	1.11%
28	3 1 7 北海道電力 日本	社債券	100,000,000	103.10 103,101,200	105.59 105,595,100	1.139000 2023/11/24	0.78%
29	4 2 7 九州電力 日本	社債券	100,000,000	101.44 101,441,600	104.41 104,411,500	1.024000 2024/5/24	0.77%
30	4 9 6 関西電力 日本	社債券	100,000,000	99.88 99,888,600	103.32 103,329,800	0.908000 2025/2/25	0.76%

(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28年1月29日現在

種類	投資比率
国債証券	57.78%
特殊債券	13.31%
社債券	26.29%
合計	97.37%

(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28年1月29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 2.0% 2025/08/15 アメリカ	国債証券	595,889,100	99.54 593,203,472	100.10 596,538,619	2.000000 2025/8/15	11.06%
2	BTPS 4.0 2020/09/01 イタリア	国債証券	391,223,200	115.78 452,959,436	116.16 454,464,430	4.000000 2020/9/1	8.43%
3	BTPS 4.25 2020/03/01 イタリア	国債証券	384,614,700	114.90 441,960,751	115.92 445,883,821	4.250000 2020/3/1	8.27%
4	US TREASURY N/B 1.0 2016/08/31 アメリカ	国債証券	423,045,000	100.69 425,985,162	100.26 424,166,069	1.000000 2016/8/31	7.87%
5	US TREASURY N/B 4.75 2017/08/15 アメリカ	国債証券	164,383,200	107.70 177,040,739	106.10 174,412,219	4.750000 2017/8/15	3.23%
6	BTPS 2.0% 2025/12/01 イタリア	国債証券	157,282,300	104.75 164,765,791	104.47 164,328,547	2.000000 2025/12/1	3.05%
7	US TREASURY N/B 0.875% 2017/05/15 アメリカ	国債証券	153,504,900	100.44 154,182,628	100.16 153,756,648	0.875000 2017/5/15	2.85%
8	US TREASURY N/B 2.125% 2025/05/15 アメリカ	国債証券	134,165,700	98.88 132,676,025	101.28 135,895,095	2.125000 2025/5/15	2.52%

9	US TREASURY N/B 2.0% 2022/07/31 アメリカ	国債証券	122,078,700	100.50 122,690,652	101.91 124,415,286	2.000000 2022/7/31	2.31%
10	US TREASURY N/B 0.75% 2017/12/31 アメリカ	国債証券	116,035,200	99.78 115,790,365	99.82 115,835,619	0.750000 2017/12/31	2.15%
11	SPANISH GOVT 4.85% 2020/10/31 スペイン	国債証券	72,032,650	118.81 85,585,593	119.94 86,399,562	4.850000 2020/10/31	1.60%
12	US TREASURY N/B 3.0% 2045/05/15 アメリカ	国債証券	81,587,250	100.47 81,972,341	104.08 84,920,089	3.000000 2045/5/15	1.57%
13	DEUTSCHLAND REP 2.5% 2046/08/15 ドイツ	国債証券	60,798,200	125.17 76,102,844	135.01 82,086,689	2.500000 2046/8/15	1.52%
14	US TREASURY N/B 0.25% 2016/04/15 アメリカ	国債証券	73,730,700	100.00 73,735,861	99.93 73,684,249	0.250000 2016/4/15	1.37%
15	SPANISH GOVT 5.5% 2021/04/30 スペイン	国債証券	56,172,250	123.16 69,187,234	124.71 70,058,030	5.500000 2021/4/30	1.30%
16	BTPS 3.25% 2046/09/01 イタリア	国債証券	55,511,400	108.60 60,290,799	112.89 62,669,595	3.250000 2046/9/1	1.16%
17	BTPS 0.65% 2020/11/01 イタリア	国債証券	58,154,800	100.81 58,629,343	100.72 58,579,330	0.650000 2020/11/1	1.09%
18	BTPS 0.7% 2020/05/01 イタリア	国債証券	56,833,100	101.50 57,688,438	101.35 57,606,030	0.700000 2020/5/1	1.07%
19	US TREASURY N/B 2.875% 2043/05/15 アメリカ	国債証券	51,974,100	93.81 48,762,100	101.96 52,996,950	2.875000 2043/5/15	0.98%
20	FRANCE O.A.T. 2.75% 2027/10/25 フランス	国債証券	43,616,100	113.69 49,591,505	119.55 52,147,409	2.750000 2027/10/25	0.97%
21	TREASURY 4.25 2027/12/07 イギリス	国債証券	36,449,700	121.37 44,239,591	125.96 45,915,687	4.250000 2027/12/7	0.85%
22	US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15 アメリカ	国債証券	32,634,900	126.00 41,119,974	135.45 44,207,235	4.625000 2040/2/15	0.82%
23	US TREASURY N/B 2.875% 2045/08/15 アメリカ	国債証券	43,513,200	100.41 43,695,638	101.51 44,172,424	2.875000 2045/8/15	0.82%
24	TREASURY 4.25 2039/09/07 イギリス	国債証券	31,242,600	125.36 39,168,847	133.42 41,685,439	4.250000 2039/9/7	0.77%
25	TREASURY 3.75 2020/09/07 イギリス	国債証券	34,714,000	110.81 38,470,054	112.58 39,082,756	3.750000 2020/9/7	0.72%
26	AUSTRALIAN GOVT. 3.25% 2025/04/21 オーストラリア	国債証券	33,407,400	101.88 34,038,799	104.97 35,069,752	3.250000 2025/4/21	0.65%
27	US TREASURY N/B 0.75% 2017/06/30 アメリカ	国債証券	35,052,300	100.20 35,125,909	99.98 35,046,691	0.750000 2017/6/30	0.65%
28	BTPS 5.0% 2022/03/01 イタリア	国債証券	27,755,700	122.30 33,947,375	124.76 34,630,786	5.000000 2022/3/1	0.64%
29	TREASURY 5% 2025/03/07 イギリス	国債証券	26,729,780	124.97 33,405,542	129.19 34,533,539	5.000000 2025/3/7	0.64%
30	US TREASURY N/B 2.75% 2042/11/15 アメリカ	国債証券	34,447,950	91.57 31,546,743	99.69 34,342,883	2.750000 2042/11/15	0.64%

(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28年1月29日現在

種類	投資比率
国債証券	94.92%
合計	94.92%

（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 - T C W外国株式マザーファンド

平成28年1月29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	ALPHABET, INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	2,772	68,349.55 189,464,957	88,351.13 244,909,346	- -	2.62%
2	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	24,730	8,676.18 214,562,165	7,939.95 196,354,970	- -	2.10%
3	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	14,250	10,906.64 155,419,727	13,188.12 187,930,791	- -	2.01%
4	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	21,100	8,484.19 179,016,516	8,379.91 176,816,250	- -	1.90%
5	STARBUCKS CORP アメリカ	株式 消費者サービス	20,455	6,745.49 137,979,008	7,165.77 146,575,987	- -	1.57%
6	CERNER CORP アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	21,529	8,564.50 184,385,305	6,763.88 145,619,684	- -	1.56%
7	GELGENE CORP アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー	11,825	14,556.30 172,128,328	11,749.77 138,941,062	- -	1.49%
8	CHUBB LTD スイス	株式 保険	10,350	12,395.53 128,293,823	13,237.68 137,010,012	- -	1.47%
9	ATHENAHEALTH INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	7,774	14,086.37 109,507,466	16,715.11 129,943,283	- -	1.39%
10	AMERICAN TOWER CORP アメリカ	投資証券 -	11,060	11,530.15 127,523,555	11,181.68 123,669,421	- -	1.33%
11	ALEXION PHARMACEUTICALS INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー	6,760	23,845.61 161,196,341	17,599.88 118,975,193	- -	1.28%
12	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売り	1,540	56,702.10 87,321,238	76,794.75 118,263,921	- -	1.27%
13	THE PRICELINE GROUP INC アメリカ	株式 小売り	915	141,215.61 129,212,284	126,083.12 115,366,057	- -	1.24%
14	ILLUMINA INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー	6,079	26,133.82 158,867,540	18,644.19 113,338,076	- -	1.21%
15	ALLERGAN PLC アイルランド	株式 医薬品・バイオテクノロジー	3,309	37,912.32 125,451,887	34,056.33 112,692,399	- -	1.21%
16	CVS HEALTH CORPORATION アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	9,843	11,969.96 117,820,371	11,300.13 111,227,241	- -	1.19%
17	LINKEDIN CORP - A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	4,675	25,704.81 120,170,017	23,103.09 108,006,954	- -	1.16%
18	SERVICENOW INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	13,586	9,345.23 126,964,374	7,683.70 104,390,828	- -	1.12%

19	SPLUNK INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	19,250	7,975.89 153,535,934	5,359.37 103,167,984	- -	1.11%
20	MONSTER BEVERAGE CORP アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	6,179	17,091.06 105,605,663	16,583.36 102,468,606	- -	1.10%
21	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	5,580	17,428.73 97,252,328	18,080.94 100,891,663	- -	1.08%
22	GENERAL ELECTRIC CO. アメリカ	株式 資本財	28,682	3,217.41 92,281,959	3,409.74 97,798,240	- -	1.05%
23	UNDER ARMOUR INC-CLASS A アメリカ	株式 耐久消費財・アパレル	9,231	10,712.10 98,883,409	10,161.54 93,801,184	- -	1.01%
24	NESTLE SA-REGISTERED-B スイス	株式 食品・飲料・タバコ	10,560	8,559.99 90,393,557	8,726.90 92,156,106	- -	0.99%
25	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	13,980	7,624.07 106,584,549	6,540.27 91,433,054	- -	0.98%
26	MOBILEYE NV オランダ	株式 自動車・自動車部品	28,030	6,036.45 169,201,822	3,215.14 90,120,430	- -	0.97%
27	ARM HOLDINGS PLC-SPONS ADR イギリス	株式 半導体・半導体製造装置	17,989	5,724.91 102,985,414	4,924.24 88,582,221	- -	0.95%
28	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	13,410	5,504.27 73,812,358	6,291.88 84,374,216	- -	0.90%
29	KONINKLIJKE PHILIPS N.V. オランダ	株式 資本財	26,551	3,180.08 84,434,561	3,159.54 83,888,994	- -	0.90%
30	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC アメリカ	株式 消費者サービス	1,487	75,310.84 111,987,232	54,763.77 81,433,740	- -	0.87%

（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28年1月29日現在

種類	投資比率
株式	88.76%
投資証券	2.30%
合計	91.05%

（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28年1月29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	14.10%
医薬品・バイオテクノロジー		10.27%
資本財		6.44%
小売り		5.75%
各種金融		5.41%
ヘルスケア機器・サービス		5.02%
食品・飲料・タバコ		4.82%
保険		4.55%
銀行		4.42%
食品・生活必需品小売り		3.44%
素材		3.34%
消費者サービス		3.19%
エネルギー		3.01%

半導体・半導体製造装置	2.67%
耐久消費財・アパレル	2.57%
テクノロジー・ハードウェア	2.14%
自動車・自動車部品	2.06%
公益事業	1.82%
メディア	1.55%
電気通信サービス	1.11%
不動産	0.45%
商業・専門サービス	0.39%
運輸	0.22%
合計	88.76%

(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28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
第15計算期間末 (平成27年7月15日)	8,801,004,620	8,801,004,620	1.3543	1.3543
平成27年1月末日	7,954,835,617	-	1.2150	-
2月末日	8,473,095,566	-	1.2986	-
3月末日	8,568,277,323	-	1.3074	-
4月末日	8,732,329,914	-	1.3297	-
5月末日	9,142,873,053	-	1.3933	-
6月末日	8,904,733,160	-	1.3504	-
7月末日	8,933,726,189	-	1.3597	-
8月末日	8,206,184,459	-	1.2580	-
9月末日	7,735,522,501	-	1.1808	-
10月末日	8,522,252,369	-	1.2952	-
11月末日	8,695,044,702	-	1.3190	-
12月末日	8,447,537,118	-	1.2865	-
平成28年1月末日	7,752,937,611	-	1.1716	-

ハッピーエイジング30

直近日（平成28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
第15計算期間末 （平成27年7月15日）	10,450,600,803	10,450,600,803	1.3944	1.3944
平成27年1月末日	9,558,711,732	-	1.2833	-
2月末日	10,089,922,049	-	1.3523	-
3月末日	10,264,804,207	-	1.3590	-
4月末日	10,462,908,320	-	1.3784	-
5月末日	10,853,656,651	-	1.4329	-
6月末日	10,558,813,047	-	1.3942	-
7月末日	10,554,540,563	-	1.4013	-
8月末日	9,887,225,715	-	1.3154	-
9月末日	9,440,863,742	-	1.2532	-
10月末日	10,199,349,610	-	1.3480	-
11月末日	10,306,795,375	-	1.3672	-
12月末日	10,109,881,381	-	1.3390	-
平成28年1月末日	9,522,989,053	-	1.2520	-

ハッピーエイジング４０

直近日（平成28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
第15計算期間末 (平成27年7月15日)	12,378,839,543	12,378,839,543	1.3816	1.3816
平成27年1月末日	11,619,864,068	-	1.3068	-
2月末日	12,108,266,517	-	1.3540	-
3月末日	12,214,242,291	-	1.3586	-
4月末日	12,459,606,930	-	1.3747	-
5月末日	12,794,496,864	-	1.4102	-
6月末日	12,514,274,717	-	1.3820	-
7月末日	12,490,741,637	-	1.3866	-
8月末日	11,944,697,286	-	1.3259	-
9月末日	11,621,732,592	-	1.2827	-
10月末日	12,285,779,637	-	1.3528	-
11月末日	12,408,140,772	-	1.3657	-
12月末日	12,267,552,601	-	1.3476	-
平成28年1月末日	11,824,200,899	-	1.2913	-

ハッピーエイジング50

直近日（平成28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
第15計算期間末 （平成27年7月15日）	5,534,439,620	5,534,439,620	1.3347	1.3347
平成27年1月末日	5,294,929,048	-	1.2951	-
2月末日	5,419,456,777	-	1.3204	-
3月末日	5,484,078,904	-	1.3231	-
4月末日	5,548,281,451	-	1.3340	-
5月末日	5,609,921,182	-	1.3523	-
6月末日	5,567,529,188	-	1.3352	-
7月末日	5,595,986,600	-	1.3395	-
8月末日	5,411,941,486	-	1.3043	-
9月末日	5,370,740,342	-	1.2797	-
10月末日	5,584,630,788	-	1.3228	-
11月末日	5,601,142,048	-	1.3302	-
12月末日	5,599,927,588	-	1.3223	-
平成28年1月末日	5,525,786,637	-	1.2960	-

ハッピーエイジング60

直近日（平成28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
第15計算期間末 (平成27年7月15日)	3,292,018,524	3,292,018,524	1.2399	1.2399
平成27年1月末日	3,220,916,304	-	1.2340	-
2月末日	3,261,755,417	-	1.2381	-
3月末日	3,309,096,837	-	1.2389	-
4月末日	3,313,061,118	-	1.2436	-
5月末日	3,312,991,879	-	1.2456	-
6月末日	3,314,494,679	-	1.2397	-
7月末日	3,344,056,719	-	1.2450	-
8月末日	3,294,699,590	-	1.2345	-
9月末日	3,325,636,153	-	1.2286	-
10月末日	3,383,709,384	-	1.2444	-
11月末日	3,364,392,571	-	1.2466	-
12月末日	3,414,458,507	-	1.2485	-
平成28年1月末日	3,473,175,304	-	1.2494	-

【分配の推移】

ハッピーエイジング20

	1口当たりの分配金(円)
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
第15計算期間	0.0000
平成27年7月16日～ 平成28年1月15日	-

ハッピーエイジング30

	1口当たりの分配金(円)
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
第15計算期間	0.0000
平成27年7月16日～ 平成28年1月15日	-

ハッピーエイジング40

	1口当たりの分配金(円)
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
第15計算期間	0.0000
平成27年7月16日～ 平成28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
第15計算期間	0.0000
平成27年7月16日～ 平成28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
第15計算期間	0.0000
平成27年7月16日～ 平成28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
第15計算期間	23.9
平成27年7月16日～ 平成28年1月15日	13.4

(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。

ハッピーエイジング30

	収益率(%)
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
第15計算期間	20.1
平成27年7月16日～ 平成28年1月15日	10.8

(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
第15計算期間	14.4
平成27年7月16日～ 平成28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
第15計算期間	9.3
平成27年7月16日～ 平成28年1月15日	3.8

(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
第15計算期間	4.3
平成27年7月16日～ 平成28年1月15日	0.2

(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
第15計算期間	1,446,470,764	1,546,505,235
平成27年7月16日～ 平成28年1月15日	624,856,746	554,163,445

(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
第15計算期間	1,083,572,839	945,383,122
平成27年7月16日～ 平成28年1月15日	470,364,771	392,769,636

(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
第15計算期間	1,360,175,410	1,220,689,774
平成27年7月16日～ 平成28年1月15日	614,730,260	466,452,133

(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
第15計算期間	849,878,441	721,397,173
平成27年7月16日～ 平成28年1月15日	357,814,239	252,238,967

(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
第15計算期間	649,247,886	545,147,386
平成27年7月16日～ 平成28年1月15日	315,350,782	218,178,780

(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。

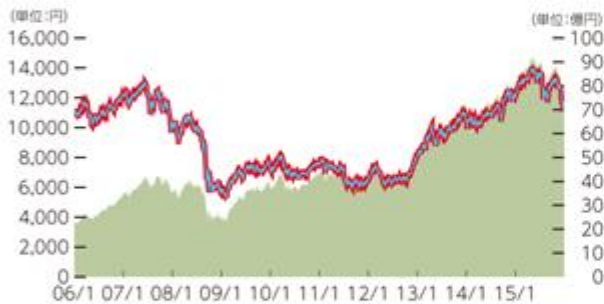
< 参考情報 >

基準日：2016年1月29日

基準価額・純資産の推移 2006/01/31～2016/01/29

ハッピーエイジング20

基準価額	11,716円
純資産総額	77.53億円



ハッピーエイジング30

基準価額	12,520円
純資産総額	95.23億円



ハッピーエイジング40

基準価額	12,913円
純資産総額	118.24億円



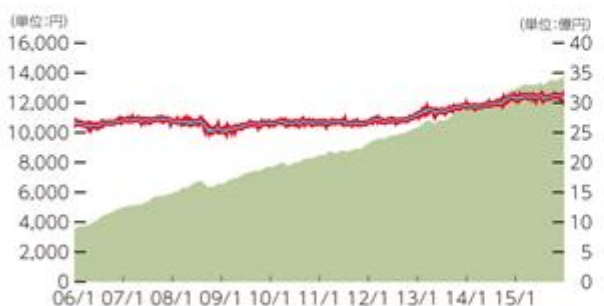
ハッピーエイジング50

基準価額	12,960円
純資産総額	55.26億円



ハッピーエイジング60

基準価額	12,494円
純資産総額	34.73億円



■ 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
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
2015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

●1万口当たり、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
	SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	25.76%	21.72%	15.34%	9.42%	2.98%
	SJAMスモールキャップ・マザーファンド	26.14%	22.05%	15.57%	9.56%	3.02%
	損保ジャパン日本債券マザーファンド	1.99%	7.94%	32.83%	56.80%	81.82%
	損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	6.09%	20.23%	15.21%	11.17%	6.10%
	損保ジャパン・TCW外国株式マザーファンド	32.90%	20.88%	13.95%	7.98%	4.00%
	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	4.97%	4.90%	4.85%	2.89%	—
	コール・ローン等	2.16%	2.28%	2.24%	2.18%	2.08%
	合計	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%

SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド

組入上位5銘柄	銘柄名	業種	純資産比
	1	三井住友フィナンシャルG	銀行業
2	みずほフィナンシャルG	銀行業	7.4%
3	本田技研	輸送用機器	6.1%
4	新日鐵住金	鉄鋼	5.6%
5	ヤマダ電機	小売業	5.6%
	組入銘柄数	27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。

SJAMスモールキャップ・マザーファンド

	銘柄名	業 種	純資産比
組入上位5銘柄	1 大和工業	鉄鋼	3.3%
	2 ケーズホールディングス	小売業	3.1%
	3 ツムラ	医薬品	3.1%
	4 エイチ・アイ・エス	サービス業	2.8%
	5 阪和興業	卸売業	2.3%
	組入銘柄数	82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	1 352 2年国債	国債証券	2017/05/15	5.0%
	2 152 20年国債	国債証券	2035/03/20	4.1%
	3 151 20年国債	国債証券	2034/12/20	4.0%
	4 357 2年国債	国債証券	2017/10/15	3.9%
	5 43 30年国債	国債証券	2044/06/20	3.7%
	組入銘柄数		74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

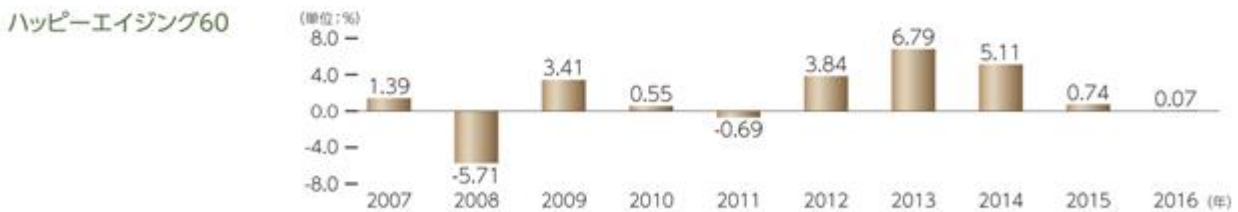
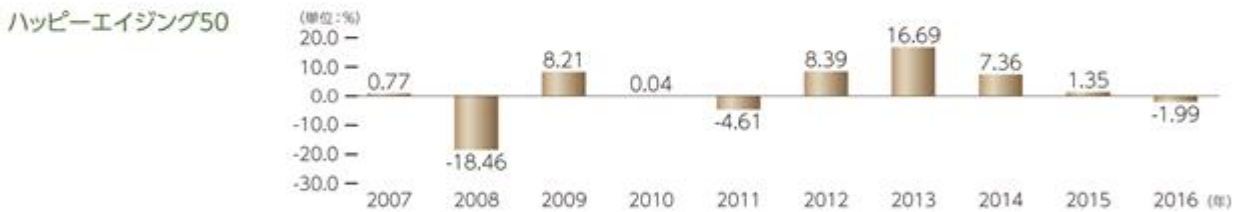
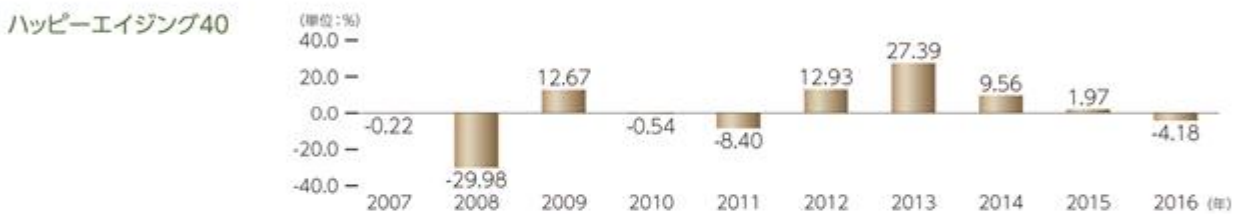
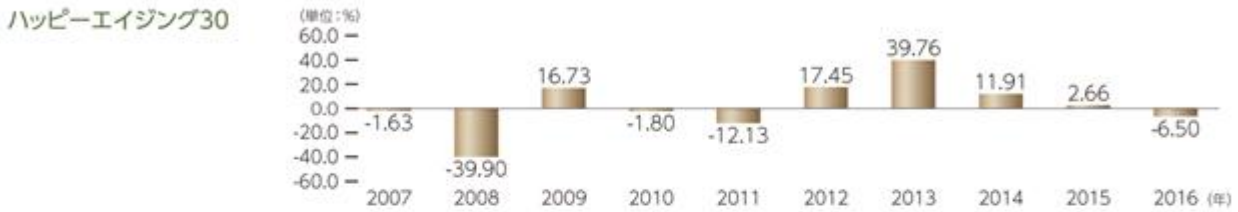
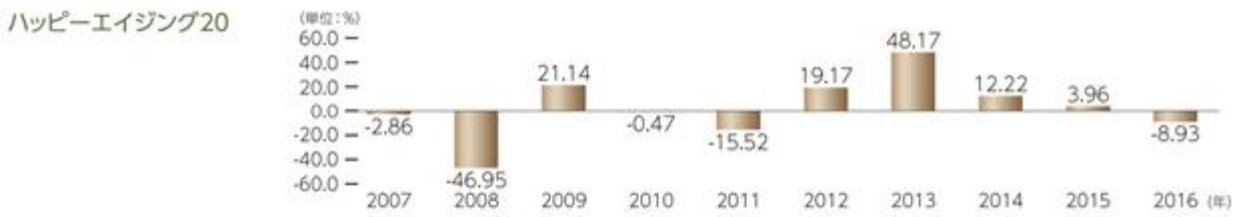
	銘柄名	発行国	種 類	通 貨	償還日	純資産比
組入上位5銘柄	1 US TREASURY N/B 2.0%	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2025/08/15	11.1%
	2 BTPS 4.0	イタリア	国債証券	ユーロ	2020/09/01	8.4%
	3 BTPS 4.25	イタリア	国債証券	ユーロ	2020/03/01	8.3%
	4 US TREASURY N/B 1.0	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2016/08/31	7.9%
	5 US TREASURY N/B 4.75	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2017/08/15	3.2%
	組入銘柄数				121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 ALPHABET, INC	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	2.6%
	2 SALESFORCE.COM INC	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	2.1%
	3 FACEBOOK INC-A	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	2.0%
	4 VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	1.9%
	5 STARBUCKS CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	一般消費財・サービス	1.6%
	組入銘柄数				269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)



- 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。
- 2016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27年7月16日から平成28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15期 平成27年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成28年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	8,061,023	-
コール・ローン	240,682,799	208,186,377
投資信託受益証券	425,765,681	376,719,795
親投資信託受益証券	8,260,771,515	7,203,684,145
流動資産合計	8,935,281,018	7,788,590,317
資産合計	8,935,281,018	7,788,590,317
負債の部		
流動負債		
未払金	8,061,024	-
未払解約金	51,538,942	12,437,308
未払受託者報酬	3,681,018	3,657,914
未払委託者報酬	70,860,414	70,410,410
その他未払費用	135,000	135,000
流動負債合計	134,276,398	86,640,632
負債合計	134,276,398	86,640,632
純資産の部		
元本等		
元本	6,498,541,162	6,569,234,463
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,302,463,458	1,132,715,222
純資産合計	8,801,004,620	7,701,949,685
負債純資産合計	8,935,281,018	7,788,590,317

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第15期中間計算期間		第16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	自	平成27年7月16日 至 平成28年1月15日
営業収益				
受取配当金		4,597,956		5,294,219
受取利息		21,923		10,227
有価証券売買等損益		646,309,984		1,103,211,709
為替差損益		54,138,094		19,171,627
その他収益		-		22,174
営業収益合計		705,067,957		1,117,056,716
営業費用				
受託者報酬		3,278,367		3,657,914
委託者報酬		63,109,352		70,410,410
その他費用		184,395		201,997
営業費用合計		66,572,114		74,270,321
営業利益又は営業損失（ ）		638,495,843		1,191,327,037
経常利益又は経常損失（ ）		638,495,843		1,191,327,037
中間純利益又は中間純損失（ ）		638,495,843		1,191,327,037
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（ ）		58,468,651		39,476,224
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		613,900,737		2,302,463,458
剰余金増加額又は欠損金減少額		107,733,700		176,799,772
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		107,733,700		176,799,772
剰余金減少額又は欠損金増加額		75,204,016		194,697,195
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		194,697,195
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,226,457,613		1,132,715,222

(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15期 平成27年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成28年1月15日現在
1. 受益権の総数	6,498,541,162口	6,569,234,463口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3543円 (13,543円)	1.1724円 (11,724円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	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	第16期中間計算期間 自 平成27年7月16日 至 平成28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	6,255,891円	3,954,199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15期 平成27年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成28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15期	第16期中間計算期間
	自 平成26年7月16日 至 平成27年7月15日	自 平成27年7月16日 至 平成28年1月15日
期首元本額	6,598,575,633円	6,498,541,162円
期中追加設定元本額	1,446,470,764円	624,856,746円
期中一部解約元本額	1,546,505,235円	554,163,445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15期 平成27年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成28年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	13,276,981	-
コール・ローン	283,392,035	284,464,262
投資信託受益証券	507,894,479	456,432,402
親投資信託受益証券	9,775,262,729	8,771,496,093
流動資産合計	10,579,826,224	9,512,392,757
資産合計	10,579,826,224	9,512,392,757
負債の部		
流動負債		
未払金	13,276,981	-
未払解約金	36,116,120	10,604,871
未払受託者報酬	4,396,991	4,379,724
未払委託者報酬	75,300,329	75,005,338
その他未払費用	135,000	135,000
流動負債合計	129,225,421	90,124,933
負債合計	129,225,421	90,124,933
純資産の部		
元本等		
元本	7,494,536,029	7,572,131,164
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,956,064,774	1,850,136,660
純資産合計	10,450,600,803	9,422,267,824
負債純資産合計	10,579,826,224	9,512,392,757

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第15期中間計算期間		第16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	自	平成27年7月16日 至 平成28年1月15日
営業収益				
受取配当金		5,571,290		6,368,392
受取利息		26,493		11,595
有価証券売買等損益		757,731,886		1,032,850,201
為替差損益		64,511,359		22,851,415
その他収益		-		22,488
営業収益合計		827,841,028		1,049,299,141
営業費用				
受託者報酬		3,927,425		4,379,724
委託者報酬		67,258,931		75,005,338
その他費用		192,649		213,293
営業費用合計		71,379,005		79,598,355
営業利益又は営業損失（ ）		756,462,023		1,128,897,496
経常利益又は経常損失（ ）		756,462,023		1,128,897,496
中間純利益又は中間純損失（ ）		756,462,023		1,128,897,496
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（ ）		33,861,442		21,360,329
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,187,424,878		2,956,064,774
剰余金増加額又は欠損金減少額		113,337,474		155,851,432
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		113,337,474		155,851,432
剰余金減少額又は欠損金増加額		74,700,028		154,242,379
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		74,700,028		154,242,379
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,948,662,905		1,850,136,660

(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15期 平成27年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成28年1月15日現在
1. 受益権の総数	7,494,536,029口	7,572,131,164口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3944円 (13,944円)	1.2443円 (12,443円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	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	第16期中間計算期間 自 平成27年7月16日 至 平成28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	5,329,399円	2,962,125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15期 平成27年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成28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15期		第16期中間計算期間	
	自	平成26年7月16日 至 平成27年7月15日	自	平成27年7月16日 至 平成28年1月15日
期首元本額		7,356,346,312円		7,494,536,029円
期中追加設定元本額		1,083,572,839円		470,364,771円
期中一部解約元本額		945,383,122円		392,769,636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15期 平成27年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成28年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	24,657,251	-
コール・ローン	237,725,626	280,288,047
投資信託受益証券	606,900,631	561,450,822
親投資信託受益証券	11,634,327,166	10,924,863,776
流動資産合計	12,503,610,674	11,766,602,645
資産合計	12,503,610,674	11,766,602,645
負債の部		
流動負債		
未払金	24,657,251	-
未払解約金	16,106,029	20,013,636
未払受託者報酬	4,586,899	4,624,693
未払委託者報酬	79,285,952	79,943,856
その他未払費用	135,000	135,000
流動負債合計	124,771,131	104,717,185
負債合計	124,771,131	104,717,185
純資産の部		
元本等		
元本	8,959,866,867	9,108,144,994
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,418,972,676	2,553,740,466
純資産合計	12,378,839,543	11,661,885,460
負債純資産合計	12,503,610,674	11,766,602,645

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第15期中間計算期間		第16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	自	平成27年7月16日 至 平成28年1月15日
営業収益				
受取配当金		6,784,370		7,753,029
受取利息		31,653		13,807
有価証券売買等損益		764,494,911		811,586,939
為替差損益		79,585,623		27,374,751
その他収益		-		18,878
営業収益合計		850,896,557		831,175,976
営業費用				
受託者報酬		4,221,982		4,624,693
委託者報酬		72,978,306		79,943,856
その他費用		204,802		226,937
営業費用合計		77,405,090		84,795,486
営業利益又は営業損失（ ）		773,491,467		915,971,462
経常利益又は経常損失（ ）		773,491,467		915,971,462
中間純利益又は中間純損失（ ）		773,491,467		915,971,462
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（ ）		30,896,510		19,552,773
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,830,663,597		3,418,972,676
剰余金増加額又は欠損金減少額		162,620,164		208,502,255
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		162,620,164		208,502,255
剰余金減少額又は欠損金増加額		124,689,876		177,315,776
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		124,689,876		177,315,776
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		2,611,188,842		2,553,740,466

（ 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15期 平成27年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成28年1月15日現在
1. 受益権の総数	8,959,866,867口	9,108,144,994口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3816円 (13,816円)	1.2804円 (12,804円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	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	第16期中間計算期間 自 平成27年7月16日 至 平成28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	4,415,908円	2,357,001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15期 平成27年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成28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15期		第16期中間計算期間	
	自	平成26年7月16日 至 平成27年7月15日	自	平成27年7月16日 至 平成28年1月15日
期首元本額		8,820,381,231円		8,959,866,867円
期中追加設定元本額		1,360,175,410円		614,730,260円
期中一部解約元本額		1,220,689,774円		466,452,133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15期 平成27年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成28年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	9,957,736	-
コール・ローン	123,597,795	117,523,187
投資信託受益証券	163,999,270	156,085,184
親投資信託受益証券	5,307,479,508	5,218,580,942
流動資産合計	5,605,034,309	5,492,189,313
資産合計	5,605,034,309	5,492,189,313
負債の部		
流動負債		
未払金	9,957,736	-
未払解約金	28,024,631	258,646
未払受託者報酬	1,755,807	1,802,111
未払委託者報酬	30,727,812	31,541,825
その他未払費用	128,703	132,115
流動負債合計	70,594,689	33,734,697
負債合計	70,594,689	33,734,697
純資産の部		
元本等		
元本	4,146,666,984	4,252,242,256
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,387,772,636	1,206,212,360
純資産合計	5,534,439,620	5,458,454,616
負債純資産合計	5,605,034,309	5,492,189,313

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第15期中間計算期間		第16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	自	平成27年7月16日 至 平成28年1月15日
営業収益				
受取配当金		1,847,241		2,129,530
受取利息		15,719		6,310
有価証券売買等損益		294,003,494		174,653,297
為替差損益		22,016,307		7,408,703
その他収益		-		5,196
営業収益合計		317,882,761		179,920,964
営業費用				
受託者報酬		1,658,560		1,802,111
委託者報酬		29,025,478		31,541,825
その他費用		145,647		164,948
営業費用合計		30,829,685		33,508,884
営業利益又は営業損失（ ）		287,053,076		213,429,848
経常利益又は経常損失（ ）		287,053,076		213,429,848
中間純利益又は中間純損失（ ）		287,053,076		213,429,848
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（ ）		13,557,990		4,355,919
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		890,147,705		1,387,772,636
剰余金増加額又は欠損金減少額		102,842,915		111,692,037
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		102,842,915		111,692,037
剰余金減少額又は欠損金増加額		76,958,814		84,178,384
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		76,958,814		84,178,384
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,189,526,892		1,206,212,360

(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15期 平成27年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成28年1月15日現在
1. 受益権の総数	4,146,666,984口	4,252,242,256口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3347円 (13,347円)	1.2837円 (12,837円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	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	第16期中間計算期間 自 平成27年7月16日 至 平成28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	1,318,756円	656,340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15期 平成27年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成28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15期	第16期中間計算期間
	自 平成26年7月16日 至 平成27年7月15日	自 平成27年7月16日 至 平成28年1月15日
期首元本額	4,018,185,716円	4,146,666,984円
期中追加設定元本額	849,878,441円	357,814,239円
期中一部解約元本額	721,397,173円	252,238,967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15期 平成27年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成28年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	66,830,296	72,421,274
親投資信託受益証券	3,250,020,243	3,354,280,683
流動資産合計	3,316,850,539	3,426,701,957
資産合計	3,316,850,539	3,426,701,957
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,254,559	2,852,226
未払受託者報酬	877,581	910,022
未払委託者報酬	15,622,702	16,200,068
その他未払費用	77,173	80,032
流動負債合計	24,832,015	20,042,348
負債合計	24,832,015	20,042,348
純資産の部		
元本等		
元本	2,655,013,590	2,752,185,592
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	637,004,934	654,474,017
純資産合計	3,292,018,524	3,406,659,609
負債純資産合計	3,316,850,539	3,426,701,957

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第15期中間計算期間		第16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	自	平成27年7月16日 至 平成28年1月15日
営業収益				
受取利息		8,998		3,706
有価証券売買等損益		149,636,104		11,560,440
その他収益		-		989
営業収益合計		149,645,102		11,565,135
営業費用				
受託者報酬		846,566		910,022
委託者報酬		15,070,608		16,200,068
その他費用		74,444		80,032
営業費用合計		15,991,618		17,190,122
営業利益又は営業損失()		133,653,484		5,624,987
経常利益又は経常損失()		133,653,484		5,624,987
中間純利益又は中間純損失()		133,653,484		5,624,987
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()		4,811,086		350,453
期首剰余金又は期首欠損金()		480,385,110		637,004,934
剰余金増加額又は欠損金減少額		58,721,956		75,772,454
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		58,721,956		75,772,454
剰余金減少額又は欠損金増加額		43,688,368		52,327,931
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		43,688,368		52,327,931
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金()		624,261,096		654,474,017

(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15期 平成27年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成28年1月15日現在
1. 受益権の総数	2,655,013,590口	2,752,185,592口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2399円 (12,399円)	1.2378円 (12,378円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	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	第16期中間計算期間 自 平成27年7月16日 至 平成28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	335,797円	208,964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15期 平成27年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成28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15期	第16期中間計算期間
	自 平成26年7月16日 至 平成27年7月15日	自 平成27年7月16日 至 平成28年1月15日
期首元本額	2,550,913,090円	2,655,013,590円
期中追加設定元本額	649,247,886円	315,350,782円
期中一部解約元本額	545,147,386円	218,178,780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。

<参考>

「ハッピーエイジング20」、「ハッピーエイジング30」、「ハッピーエイジング40」、「ハッピーエイジング50」及び「ハッピーエイジング60」は、「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」「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 - T C W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。

S J A Mラージキャップ・バリュース・マザーファンドの状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	平成27年7月15日現在	平成28年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	77,902,643	134,437,569
株式	7,025,785,410	6,257,162,440
未収配当金	4,442,200	3,696,000
流動資産合計	7,108,130,253	6,395,296,009
資産合計	7,108,130,253	6,395,296,009
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	4,004,083,371	4,222,041,884
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,104,046,882	2,173,254,125
純資産合計	7,108,130,253	6,395,296,009
負債純資産合計	7,108,130,253	6,395,296,009

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27年7月15日現在	平成28年1月15日現在
1．受益権の総数	4,004,083,371口	4,222,041,884口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7752円 (17,752円)	1.5147円 (15,147円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年7月15日現在	平成28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

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26年7月16日 至 平成27年7月15日	自 平成27年7月16日 至 平成28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	450,143,536円	4,004,083,371円
同期中追加設定元本額	4,186,070,371円	530,101,863円
同期中一部解約元本額	632,130,536円	312,143,350円
元本の内訳* ファンド名		
ハッピーエイジング20	1,291,934,635円	1,315,213,558円
ハッピーエイジング30	1,290,543,423円	1,371,008,809円
ハッピーエイジング40	1,070,573,539円	1,140,807,342円
ハッピーエイジング50	295,568,977円	327,604,779円
ハッピーエイジング60	55,462,797円	67,407,396円
計	4,004,083,371円	4,222,041,884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。

S J A Mスモールキャップ・マザーファンドの状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	平成27年7月15日現在	平成28年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	83,974,741	164,309,456
株式	6,963,408,100	6,281,268,000
未収入金	-	1,895,711
未収配当金	3,460,200	3,526,200
流動資産合計	7,050,843,041	6,450,999,367
資産合計	7,050,843,041	6,450,999,367
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	3,640,587,064	3,609,435,864
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,410,255,977	2,841,563,503
純資産合計	7,050,843,041	6,450,999,367
負債純資産合計	7,050,843,041	6,450,999,367

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27年7月15日現在	平成28年1月15日現在
1．受益権の総数	3,640,587,064口	3,609,435,864口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9367円 (19,367円)	1.7873円 (17,873円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年7月15日現在	平成28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

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26年7月16日 至 平成27年7月15日	自 平成27年7月16日 至 平成28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	407,548,673円	3,640,587,064円
同期中追加設定元本額	3,748,240,907円	291,101,397円
同期中一部解約元本額	515,202,516円	322,252,597円
元本の内訳* ファンド名		
ハッピーエイジング20	1,174,551,866円	1,135,048,886円
ハッピーエイジング30	1,173,273,093円	1,151,559,475円
ハッピーエイジング40	973,295,072円	986,099,777円
ハッピーエイジング50	268,961,173円	279,058,415円
ハッピーエイジング60	50,505,860円	57,669,311円
計	3,640,587,064円	3,609,435,864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27年7月15日現在	平成28年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	211,414,400	161,636,356
国債証券	8,970,722,970	8,049,292,790
特殊債券	1,861,511,441	1,791,127,434
社債券	4,112,394,900	3,739,573,800
未収入金	150,279,000	-
未収利息	16,478,213	16,046,672
前払費用	1,582,452	844,295
流動資産合計	15,324,383,376	13,758,521,347
資産合計	15,324,383,376	13,758,521,347
負債の部		
流動負債		
未払金	152,215,500	-
流動負債合計	152,215,500	-
負債合計	152,215,500	-
純資産の部		
元本等		
元本	11,437,411,824	10,139,474,647
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,734,756,052	3,619,046,700
純資産合計	15,172,167,876	13,758,521,347
負債純資産合計	15,324,383,376	13,758,521,347

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、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27年7月15日現在	平成28年1月15日現在
1．受益権の総数	11,437,411,824口	10,139,474,647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)	1.3569円 (13,569円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年7月15日現在	平成28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 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>	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	自 平成26年7月16日 至 平成27年7月15日	自 平成27年7月16日 至 平成28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	9,865,255,860円	11,437,411,824円
同期中追加設定元本額	3,236,316,011円	697,340,639円
同期中一部解約元本額	1,664,160,047円	1,995,277,816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	1,003,454,174円	1,038,184,670円
ハッピーエイジング20	129,053,289円	117,698,912円
ハッピーエイジング30	615,762,858円	570,493,784円
ハッピーエイジング40	3,157,981,056円	2,943,755,758円
ハッピーエイジング50	2,400,095,825円	2,350,325,911円
ハッピーエイジング60	2,048,641,457円	2,068,450,905円
パン・アフリカ株式ファンド	7,737,438円	5,246,712円
アジア転換社債ファンド（毎月分配型）	5,113,063円	- 円
人民元建て債券ファンド	5,038,931円	3,911,487円
オフショア人民元債フォーカス（ダイワSMA専用）	92,259円	- 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	16,178,224円	9,003,464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	123,045,537円	72,334,984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	1,844,517,910円	908,875,895円
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	213,905円	33,589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	218,284円	69,523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	3,157,884円	1,677,826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	61,612,428円	38,381,134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	1,527,058円	810,501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	1,156,379円	654,926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	8,392,020円	3,482,347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・プレミアムコース	2,913,905円	1,883,693円
好配当グローバルREITプレ ミアム・ファンド 米ドルプレ ミアムコース	1,507,940円	2,947,604円
インド株式集中投資ファンド	- 円	1,251,022円
計	11,437,411,824円	10,139,474,647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27年7月15日現在	平成28年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	19,060,037	47,220,717
コール・ローン	83,875,995	299,090,412
国債証券	5,570,886,126	4,949,737,061
未収入金	540,236,459	-
未収利息	32,163,626	38,903,979
前払費用	19,343,618	4,444,976
流動資産合計	6,265,565,861	5,339,397,145
資産合計	6,265,565,861	5,339,397,145
負債の部		
流動負債		
未払金	545,217,572	-
流動負債合計	545,217,572	-
負債合計	545,217,572	-
純資産の部		
元本等		
元本	3,630,703,658	3,492,026,117
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,089,644,631	1,847,371,028
純資産合計	5,720,348,289	5,339,397,145
負債純資産合計	6,265,565,861	5,339,397,145

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. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</p> <p>但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成27年7月15日現在	平成28年1月15日現在
1. 受益権の総数	3,630,703,658口	3,492,026,117口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5755円 (15,755円)	1.5290円 (15,290円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年7月15日現在	平成28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
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26年7月16日 至 平成27年7月15日	自 平成27年7月16日 至 平成28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	3,571,638,886円	3,630,703,658円
同期中追加設定元本額	615,191,075円	373,461,379円
同期中一部解約元本額	556,126,303円	512,138,920円
元本の内訳*		
ファンド名		
ハッピーエイジング20	328,746,890円	310,269,184円
ハッピーエイジング30	1,357,411,971円	1,234,861,404円
ハッピーエイジング40	1,198,676,166円	1,186,992,380円
ハッピーエイジング50	391,121,717円	394,304,602円
ハッピーエイジング60	126,430,326円	133,888,182円
損保ジャパン外国債券ファンド （為替ヘッジなし）	228,316,588円	231,710,365円
計	3,630,703,658円	3,492,026,117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 - 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27年7月15日現在	平成28年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	305,136,911	763,261,944
コール・ローン	79,904,685	146,805,870
株式	10,035,656,337	8,357,900,519
投資証券	234,344,664	209,788,904
未収入金	28,334,304	47,702,473
未収配当金	8,204,244	6,409,513
流動資産合計	10,691,581,145	9,531,869,223
資産合計	10,691,581,145	9,531,869,223
負債の部		
流動負債		
未払金	22,702,420	238,252,560
流動負債合計	22,702,420	238,252,560
負債合計	22,702,420	238,252,560
純資産の部		
元本等		
元本	5,967,202,524	6,214,360,958
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,701,676,201	3,079,255,705
純資産合計	10,668,878,725	9,293,616,663
負債純資産合計	10,691,581,145	9,531,869,223

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. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>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>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</p> <p>但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年7月15日現在	平成28年1月15日現在
1. 受益権の総数	5,967,202,524口	6,214,360,958口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7879円 (17,879円)	1.4955円 (14,955円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年7月15日現在	平成28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いません。 (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	自 平成26年7月16日 至 平成27年7月15日	自 平成27年7月16日 至 平成28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	6,391,759,222円	5,967,202,524円
同期中追加設定元本額	802,351,707円	569,303,349円
同期中一部解約元本額	1,226,908,405円	322,144,915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）	707,075,266円	734,882,842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）	992,373,981円	987,614,400円
ハッピーエイジング20	1,679,872,835円	1,704,279,546円
ハッピーエイジング30	1,262,151,158円	1,320,254,565円
ハッピーエイジング40	990,708,813円	1,086,682,199円
ハッピーエイジング50	258,375,179円	288,564,303円
ハッピーエイジング60	76,645,292円	92,083,103円
計	5,967,202,524円	6,214,360,958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。

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。

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

ハッピーエイジング20

平成28年1月29日現在

資産総額	7,761,518,032円
負債総額	8,580,421円
純資産総額（ - ）	7,752,937,611円
発行済数量	6,617,545,598口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.1716円

ハッピーエイジング30

平成28年1月29日現在

資産総額	9,532,167,381円
負債総額	9,178,328円
純資産総額（ - ）	9,522,989,053円
発行済数量	7,606,497,678口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.2520円

ハッピーエイジング40

平成28年1月29日現在

資産総額	11,835,217,140円
負債総額	11,016,241円
純資産総額（ - ）	11,824,200,899円
発行済数量	9,156,784,108口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.2913円

ハッピーエイジング50

平成28年1月29日現在

資産総額	5,537,031,652円
負債総額	11,245,015円
純資産総額（ - ）	5,525,786,637円
発行済数量	4,263,736,039口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.2960円

ハッピーエイジング60

平成28年1月29日現在

資産総額	3,476,043,191円
負債総額	2,867,887円
純資産総額（ - ）	3,473,175,304円
発行済数量	2,779,956,160口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.2494円

（参考）マザーファンドの現況

S J A M ラージキャップ・バリュース・マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産総額	6,503,047,866円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	6,503,047,866円
発行済数量	4,388,591,975口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.4818円

S J A M スモールキャップ・マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産総額	6,601,208,439円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	6,601,208,439円
発行済数量	3,629,470,642口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.8188円

損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産総額	13,791,280,499円
負債総額	262,566,200円
純資産総額（ - ）	13,528,714,299円
発行済数量	9,872,659,559口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.3703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28年1月29日現在

資産総額	5,615,630,016円
負債総額	223,395,135円
純資産総額（ - ）	5,392,234,881円
発行済数量	3,412,014,595口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.5804円

損保ジャパン - T C W 外国株式マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産総額	9,352,805,677円
負債総額	22,368,466円
純資産総額（ - ）	9,330,437,211円
発行済数量	6,279,907,874口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.4858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】

<訂正前>

(1) 資本金の額（平成27年7月末現在）

(略)

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7月末現在）

(略)

<訂正後>

(1) 資本金の額（平成28年1月末現在）

(略)

最近5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（平成28年1月末現在）

(略)

2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

(略)

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7月末現在、計118本（追加型株式投資信託103本、単位型株式投資信託15本）であり、その純資産総額の合計は810,561百万円です。

<訂正後>

(略)

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28年1月末現在、計119本（追加型株式投資信託102本、単位型株式投資信託17本）であり、その純資産総額の合計は647,860百万円です。

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26年4月1日から平成27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31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27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】

区分	注記 番号	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
		金額(千円)	金額(千円)
(資産の部)			
流動資産			
1 現金・預金		3,179,267	3,896,094
2 前払費用		133,019	94,024
3 未収委託者報酬		569,687	814,705
4 未収運用受託報酬		252,128	319,881
5 未収収益		73	107
6 繰延税金資産		57,628	85,853
7 その他		323	84
流動資産合計		4,192,127	5,210,750
固定資産			
1 有形固定資産			
(1) 建物	* 1	47,031	45,249
(2) 器具備品	* 1	10,600	12,797
有形固定資産合計		57,631	58,046
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		64,604	135,587
(2) 関係会社株式		41,085	122
(3) 長期差入保証金		193,917	161,636
(4) 繰延税金資産		110,616	132,485
(5) その他		29	29
投資その他の資産合計		410,253	429,859
固定資産合計		472,419	492,441
資産合計		4,664,547	5,703,191

区分	注記 番号	前事業年度 (平成26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
(負債の部)					
流動負債					
1			5,256		126,101
2					
		264,886		391,115	
		103,918	368,804	107,030	498,145
3			301,051		387,091
4			47,871		211,457
5			260,111		583,342
6			67,612		47,207
7			47,208		54,235
8			8,400		11,400
			1,106,316		1,918,981
流動負債合計					
固定負債					
1			59,903		64,308
2			7,625		7,760
			67,528		72,068
固定負債合計					
負債合計					
1,173,844					
1,991,050					
(純資産の部)					
株主資本					
1			1,550,000		1,550,000
2					
			413,280		413,280
			413,280		413,280
資本剰余金合計					
3					
			1,515,658		1,750,324
			1,515,658		1,750,324
利益剰余金合計					
株主資本合計					
3,478,938					
3,713,604					
評価・換算差額等					
1			11,764		1,462
			11,764		1,462
評価・換算差額等合計					
純資産合計					
3,490,702					
3,712,141					
負債・純資産合計					
4,664,547					
5,703,191					

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1 委託者報酬		4,255,278		6,931,318	
2 運用受託報酬		2,330,904	6,586,183	2,410,937	9,342,256
営業費用					
1 支払手数料		2,108,094		3,520,626	
2 広告宣伝費		6,708		23,637	
3 公告費		1,780		4,180	
4 調査費		1,432,804		1,890,482	
(1) 調査費		569,905		594,023	
(2) 委託調査費		860,367		1,292,599	
(3) 図書費		2,532		3,859	
5 営業雑経費		149,262		191,429	
(1) 通信費		18,408		21,613	
(2) 印刷費		120,430		158,297	
(3) 諸会費		10,423	3,698,650	11,518	5,630,355
一般管理費					
1 給料		1,201,183		1,260,113	
(1) 役員報酬		39,975		109,183	
(2) 給料・手当		1,063,436		1,045,995	
(3) 賞与		97,771		104,933	
2 福利厚生費		96,749		102,817	
3 交際費		8,762		10,360	
4 寄付金		200		200	
5 旅費交通費		33,717		37,768	
6 法人事業税		14,646		18,444	
7 租税公課		7,341		8,301	
8 不動産賃借料		238,291		227,534	
9 退職給付費用		33,185		34,819	
10 賞与引当金繰入		47,208		54,235	

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
11 役員賞与引当金繰入		8,400		11,400	
12 固定資産減価償却費		15,279		14,237	
13 諸経費		146,303	1,851,270	183,804	1,964,036
営業利益			1,036,262		1,747,864
営業外収益					
1 受取配当金		951		2,211	
2 受取利息		367		464	
3 有価証券売却益		-		1,139	
4 有価証券償還益		-		18,285	
5 為替差益		1,098		2,259	
6 雑益		1,893	4,310	3,746	28,107
営業外費用					
1 有価証券売却損		1		-	
2 雑損		2,709	2,711	221	221
経常利益			1,037,861		1,775,751
特別利益					
1 子会社清算益	* 1	-	-	124,873	124,873
特別損失					
1 固定資産除却損	* 2	325	325	31	31
税引前当期純利益			1,037,536		1,900,593
法人税、住民税及び事業税			273,769		702,469
法人税等調整額			50,302		43,579
当期純利益			814,068		1,241,702

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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	1,515,658	1,515,658	3,478,938
当期変動額						
剰余金の配当				1,007,036	1,007,036	1,007,036
当期純利益				1,241,702	1,241,702	1,241,702
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	234,666	234,666	234,666
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	1,750,324	1,750,324	3,713,604

	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
当期変動額			
剰余金の配当			1,007,036
当期純利益			1,241,702
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	13,227	13,227	13,227
当期変動額合計	13,227	13,227	221,438
当期末残高	1,462	1,462	3,712,141

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

（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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
建物	56,120千円	64,817千円
器具備品	42,124	46,725

（損益計算書関係）

* 1 . 特別利益の子会社清算益の内容は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	当事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
	-	米国の100%子会社であった TACT ASSET MANAGEMENT INC.の清算終了によるものであります。

* 2 . 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25年4月1日 至平成26年3月31日)	当事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
器具備品	325千円	31千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

当事業年度（自 平成26年 4月 1日 至 平成27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

（決議）	株式の種類	配当金の総額	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	16,900円	平成26年3月31日	平成26年6月26日
平成27年3月27日 臨時株主総会	普通株式	600,000千円	24,911円	平成26年3月31日	平成27年3月31日

(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。

(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。デリバティブは為替変動リスクを低減する目的で実需の範囲で為替予約取引を行っております。

(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 其他有価証券	48,854	48,854	-
資産計	3,228,121	3,228,121	-

当事業年度（平成27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	3,896,094	3,896,094	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	119,837	119,837	-
資産計	4,015,931	4,015,931	-
(1) 未払法人税等	583,342	583,342	-
負債計	583,342	583,342	-

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。

負 債

(1) 未払法人税等

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。

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26年3月31日）	当事業年度 （平成27年3月31日）
非上場株式	15,750	15,750
関係会社株式	41,085	122

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

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

注3．金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成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	-	-

当事業年度（平成27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	3,896,001	-	-	-
(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	-	119,837	-	-
合計	3,896,001	119,837	-	-

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 122千円、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

当事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差 額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	1,217	1,200	17
	小 計	1,217	1,200	17
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	118,619	120,100	1,480
	小 計	118,619	120,100	1,480
合計		119,837	121,300	1,462

5．売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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	42,174	1,171	31
合計	42,174	1,171	31

（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	

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
---------------------	--------

(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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要（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	59,903	千円
退職給付費用	13,437	
退職給付の支払額	9,032	
退職給付引当金の期末残高	64,308	

(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	64,308	千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	64,308	
退職給付引当金	64,308	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	64,308	

(3) 退職給付に係る負債

簡便法で計算した退職給付費用	13,437	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、10,316千円でありました。

（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26年3月31日)	当事業年度 (平成27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	96,962千円	112,543千円
未払事業税	19,448	41,100
未払費用否認	19,566	25,132
退職給付引当金	21,349	20,839
賞与引当金	16,824	17,930
その他	4,603	4,758
繰延税金資産小計	178,755	222,305
評価性引当額	2,815	3,071
繰延税金資産合計	175,940	219,234
繰延税金負債		
固定資産除去価額	1,181	896
その他有価証券差額金	6,514	-
繰延税金負債合計	7,695	896
繰延税金資産の純額	168,244	218,338

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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
法定実効税率 (調整)	38.0%	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.8	
住民税均等割	0.2	
税務上の繰越欠損金の利用	16.4	
評価性引当額の増減	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	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27年法律第9号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引き下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.6%から平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.1%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、32.3%になります。

その税率変更により、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19,550千円減少し、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 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
期首残高	7,492千円	7,625千円
時の経過による調整額	133	135
期末残高	7,625	7,760

（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	-

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

（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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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	損保ジャパン日本興亜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	188,089	未収運用受託報酬	102,679
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜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	371,167	未払手数料	92,290

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。

3．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。

4．損保ジャパンDC証券株式会社は、平成26年9月1日に商号を損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社に変更しております。

(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

損保ジャパン日本興亜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）

なお、NKSJホールディングス株式会社は、平成26年9月1日に商号を損保ジャパン日本興亜ホールディングス株式会社に変更しております。

(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25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	144,932.64円	154,126.69円
1株当たり当期純利益金額	33,799.80円	51,555.01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25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益(千円)	814,068	1,241,702
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)	814,068	1,241,702
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31期中間会計期間 (平成27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		3,937,172
2 前払費用		83,040
3 未収委託者報酬		907,995
4 未収運用受託報酬		383,249
5 未収収益		133
6 繰延税金資産		72,518
7 その他		1,120
流動資産合計		5,385,230
固定資産		
1 有形固定資産	1	57,722
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		161,598
(2) 繰延税金資産		140,082
(3) その他		123,753
投資その他の資産合計		425,433
固定資産合計		487,691
資産合計		5,872,921

		第31期中間会計期間 (平成27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		4,271
2 未払金		
(1) 未払手数料		374,794
(2) その他未払金		117,681
未払金合計		492,476
3 未払費用		400,034
4 未払法人税等		355,712
5 前受収益		36,977
6 賞与引当金		50,347
7 役員賞与引当金		4,500
8 その他	2	67,910
流動負債合計		1,412,229
固定負債		
1 退職給付引当金		67,586
2 資産除去債務		7,830
固定負債合計		75,416
負債合計		1,487,646

		第31期中間会計期間 (平成27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		2,434,243
利益剰余金合計		2,434,243
株主資本合計		
		4,397,523
評価・換算差額等		
1 その他有価証券評価差額金		12,248
評価・換算差額等合計		12,248
純資産合計		4,385,275
負債・純資産合計		5,872,921

(2) 中間損益計算書

		第31期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27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		3,846,111	
2 運用受託報酬		1,212,392	5,058,503
営業費用			
1 支払手数料		1,945,319	
2 広告宣伝費		11,471	
3 公告費		200	
4 調査費		959,198	
(1) 調査費		305,778	
(2) 委託調査費		651,541	
(3) 図書費		1,878	
5 営業雑経費		96,335	
(1) 通信費		9,014	
(2) 印刷費		76,182	
(3) 諸会費		11,139	3,012,525
一般管理費			
1 給料		627,226	
(1) 役員報酬		46,583	
(2) 給料・手当		550,163	
(3) 賞与		30,479	
2 福利厚生費		56,330	
3 交際費		3,113	
4 旅費交通費		20,283	
5 法人事業税		14,295	
6 租税公課		4,217	
7 不動産賃借料		108,061	
8 退職給付費用		24,071	
9 賞与引当金繰入		50,347	
10 役員賞与引当金繰入		4,500	
11 固定資産減価償却費	1	6,340	
12 諸経費		100,444	1,019,232
営業利益			1,026,744

		第31期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27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		90	
2 受取利息		288	
3 有価証券売却益		19	
4 為替差益		444	
5 雑益		5,301	6,143
営業外費用			
1 雑損		0	0
経常利益			1,032,888
特別損失		663	663
税引前中間純利益			1,032,224
法人税、住民税及び事業税			342,567
法人税等調整額			5,738
中間純利益			683,919

(3) 中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		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	1,750,324	1,750,324	3,713,604
当中間期変動額						
中間純利益				683,919	683,919	683,919
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	-	-	-	683,919	683,919	683,919
当中間期末残高	1,550,000	413,280	413,280	2,434,243	2,434,243	4,397,523

	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	1,462	1,462	3,712,141
当中間期変動額			
中間純利益			683,919
株主資本以外の項目の当 中間期変動額（純額）	10,785	10,785	10,785
当中間期変動額合計	10,785	10,785	673,134
当中間期末残高	12,248	12,248	4,385,275

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31期中間会計期間
（平成27年9月30日）

1 有形固定資産の減価償却累計額	110,305千円
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」に含めて表示していません。

（中間損益計算書関係）

第31期中間会計期間
（自 平成27年4月1日
至 平成27年9月30日）

1 減価償却実施額 有形固定資産	6,340千円
---------------------	---------

（中間株主資本等変動計算書関係）

第31期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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

該当事項はありません。

(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31期中間会計期間（平成27年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成27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	3,937,172	3,937,172	-
(2) 投資有価証券			
其他有価証券	107,851	107,851	-
資産計	4,045,024	4,045,024	-

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	中間貸借対照表計上額
非上場株式	15,750
関係会社株式	122

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31期中間会計期間（平成27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122千円）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	-	-	-
	小 計	-	-	-
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	107,851	120,100	12,248
	小 計	107,851	120,100	12,248
合計		107,851	120,100	12,248

（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31期中間会計期間(平成27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	7,760千円
時の経過による調整額	69
中間期末残高	7,830

(セグメント情報等)

セグメント情報

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日至平成27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31期中間会計期間(自平成27年4月1日至平成27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

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

（ 1株当たり情報）

	第31期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）
1株当たり純資産額	182,074.96円
1株当たり中間純利益金額	28,396.06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31期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）
中間純利益（千円）	683,919
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）	683,919
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27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27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27年9月末現在）

名称	資本金の額	事業の内容
エース証券株式会社	8,831	「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。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	
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	
高木証券株式会社	11,069	
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27年12月末現在）

（3,015千円、1ドル=120.61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。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年3月16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 小澤 裕治 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27年7月16日から平成28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20の平成28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27年7月16日から平成28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28年3月16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 小澤 裕治 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27年7月16日から平成28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30の平成28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27年7月16日から平成28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28年3月16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 小澤裕治 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27年7月16日から平成28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28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27年7月16日から平成28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28年3月16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 小澤 裕治 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27年7月16日から平成28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50の平成28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27年7月16日から平成28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28年3月16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 小澤 裕治 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27年7月16日から平成28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60の平成28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27年7月16日から平成28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27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 公認会計士 大村 真 敏 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 羽柴 則 央 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている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27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27年11月24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 小澤 裕治 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27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27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27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27年4月1日から平成27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。