

【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29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】	須田 静
【電話番号】	03-5290-3469
【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28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】

<ファンドの特色>

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

● ファンドの目的

日本及び世界各国の株式や公社債を実質的な主要投資対象とし、中長期的に信託財産の着実な成長を目標として運用を行います。

● ファンドの特色



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

投資対象資産	投資対象とするマザーファンド ^{※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2017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。

2016年12月末現在の同グループの運用資産は、約1,914億米ドル(約22兆3,020億円[※])です。

※2016年12月末時点の為替レートで換算。

2

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

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

3

各ファンドの特徴は、以下のとおりです。

ハッピーエイジング20	国内外の株式の基準組入比率を90%とするファンドです。リスクを積極的にとりながら資産の大きな成長を目指します。5つのファンドの中では最もリスクが高く、投資期間が長く積極的運用をお考えの方に適したファンドです。
ハッピーエイジング30	国内外の株式の基準組入比率を70%とするファンドです。5つのファンドの中では比較的高いリスクをとり適度に高い収益を目指します。資産の成長性を重視した運用をお考えの方に適したファンドです。
ハッピーエイジング40	国内外の株式の基準組入比率を50%とするファンドです。5つのファンドの中では、リスクのレベルは中位に位置し、リスク・リターンのバランスを重視した運用を目指します。積極性と安定性とのバランスのとれた運用をお考えの方に適したファンドです。
ハッピーエイジング50	国内外の株式の基準組入比率を30%とするファンドです。5つのファンドの中では比較的低位にリスクを設定し安定した運用を目指します。安定性に重点を置きつつ適度の収益性をも考慮した運用をお考えの方に適したファンドです。
ハッピーエイジング60	国内外の株式の基準組入比率を10%とするファンドです。5つのファンドの中では最もリスクを抑え、より安定した運用を目指します。投資期間が比較的短く安定性を重視した運用をお考えの方に適しています。

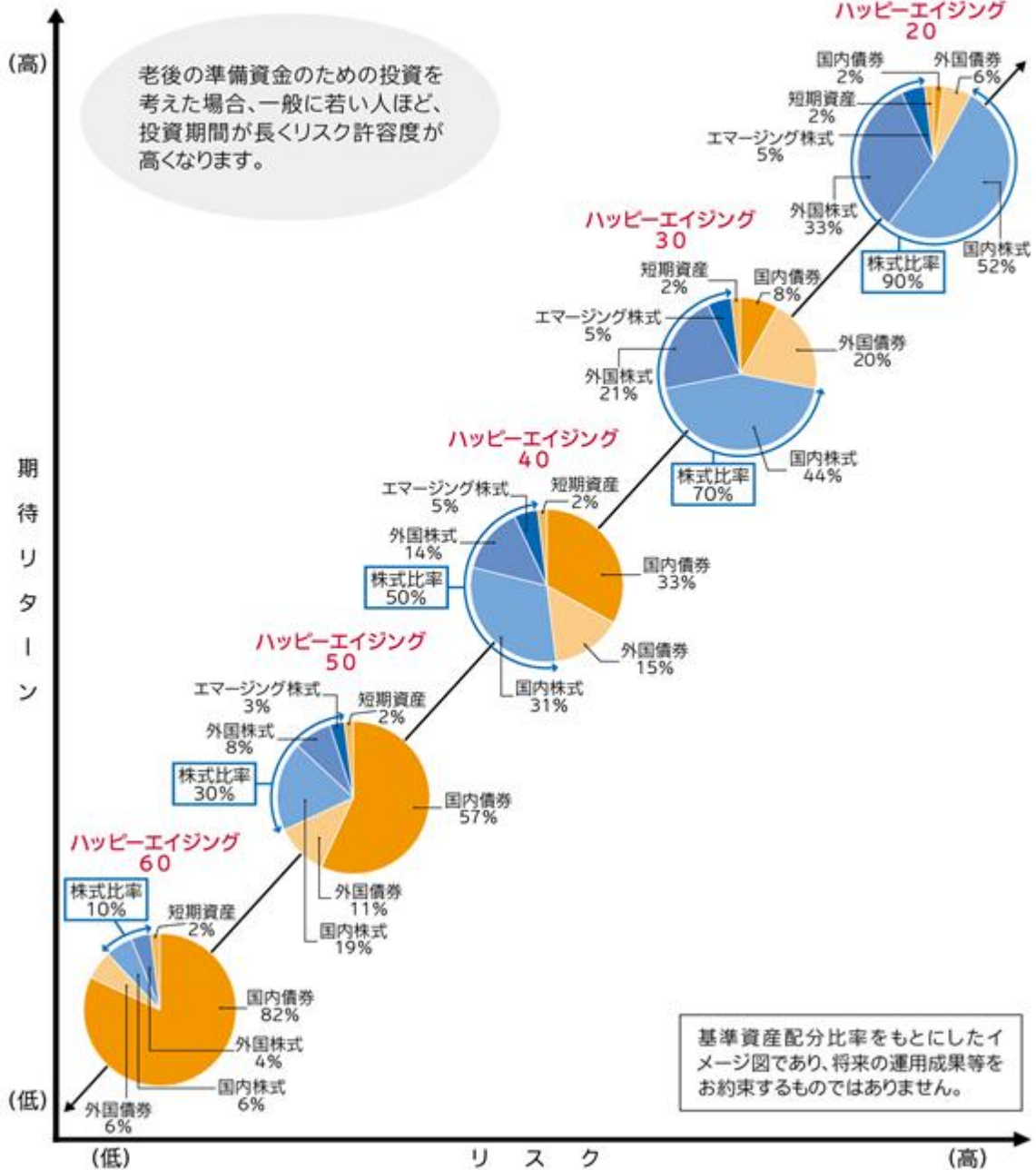
4

投資目的、投資期間、リスク許容度等に応じて、リスク水準の異なる

5種類のファンドからご選択いただけます。

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

<基準資産配分比率>



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

5

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

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

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

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

※「NOMURA-BPI総合指数」とは、野村證券が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づき構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

※シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はCitigroup Index LLCに帰属します。また、Citigroup

Index LLCは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

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

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

（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28年7月末現在）

（略）

（ ）大株主の状況（平成28年10月1日現在）

（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29年1月末現在）

（略）

（ ）大株主の状況（平成29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28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28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29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29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。）

（４）【分配方針】

<訂正前>

（略）

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

<訂正後>

（略）

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

中長期的な観点から、複利効果による資産の成長を目指すために分配を抑えるファンドです。

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28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
2011年8月～2016年7月

ハッピーエイジング20



ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較
2011年8月～2016年7月



ハッピーエイジング30



ハッピーエイジング40



ハッピーエイジング50



ハッピーエイジング60



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

● 上記は、期間5年のグラフになります。

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

*各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

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

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

日本国債…NOMURA-BPI 国債

先進国債…シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド (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・ディバーシファイドは、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29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

2012年2月～2017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

2012年2月～2017年1月

ハッピーエイジング20



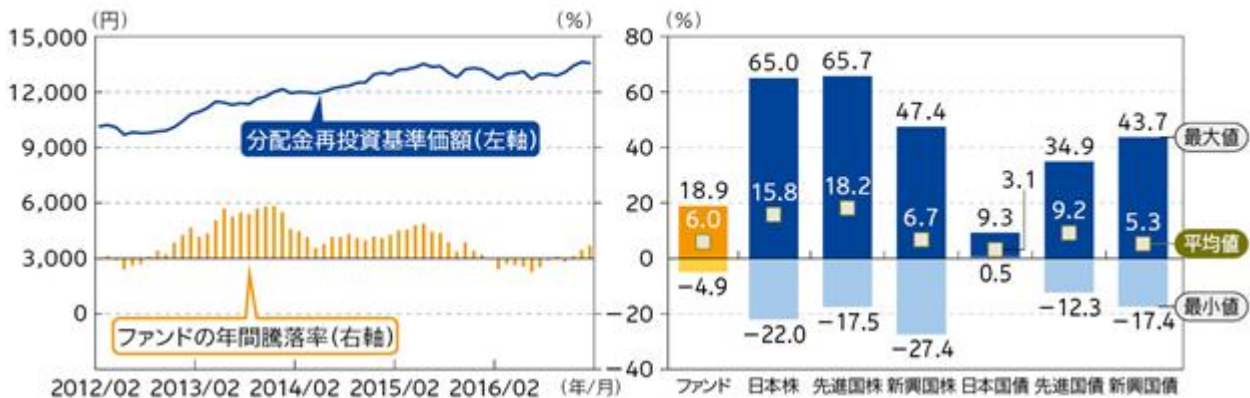
ハッピーエイジング30



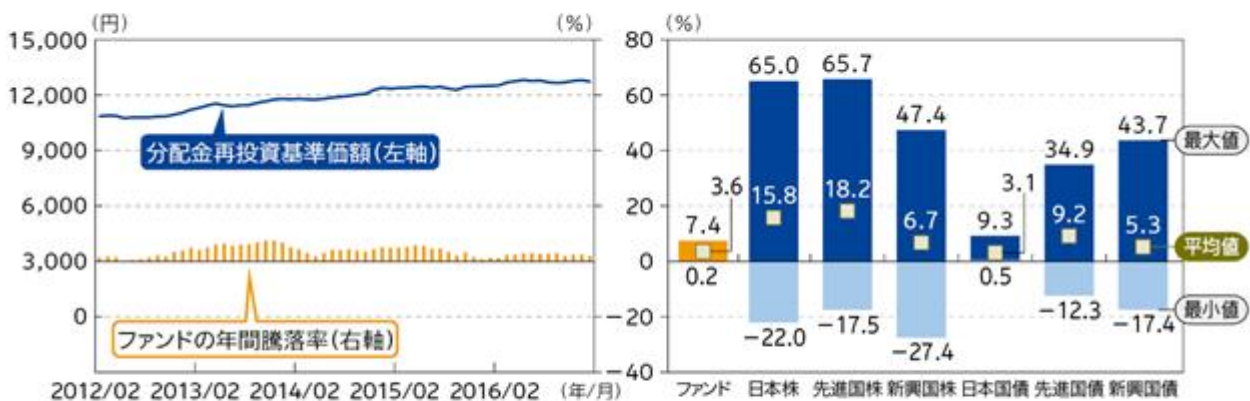
ハッピーエイジング40



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。

代表的な資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	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。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	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。
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)	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。
日本国債	NOMURA-BPI 国債	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。
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)	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。
新興国債	J.P.モルガンGBI-EM グローバル・ディバーシファイド (円ベース)	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。

(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。

4【手数料等及び税金】

（5）【課税上の取扱い】

<訂正前>

（略）

上記は平成28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）

上記は平成29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29年1月31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	427,567,470	4.89
内 アメリカ	427,567,470	4.89
親投資信託受益証券	8,145,808,583	93.18
内 日本	8,145,808,583	93.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	168,195,262	1.92
純資産総額	8,741,571,315	100.00

ハッピーエイジング30

平成29年1月31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	524,142,466	4.84
内 アメリカ	524,142,466	4.84
親投資信託受益証券	10,101,048,853	93.35
内 日本	10,101,048,853	93.35
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	194,994,671	1.80
純資産総額	10,820,185,990	100.00

ハッピーエイジング40

平成29年1月31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	639,923,874	4.83
内 アメリカ	639,923,874	4.83
親投資信託受益証券	12,354,706,183	93.27
内 日本	12,354,706,183	93.27
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	252,005,374	1.90
純資産総額	13,246,635,431	100.00

ハッピーエイジング50

平成29年1月31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	174,681,635	2.90
内 アメリカ	174,681,635	2.90
親投資信託受益証券	5,731,059,331	95.07
内 日本	5,731,059,331	95.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	122,482,994	2.03
純資産総額	6,028,223,960	100.00

ハッピーエイジング60

平成29年1月31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	3,775,580,412	97.94
内 日本	3,775,580,412	97.94
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	79,504,562	2.06
純資産総額	3,855,084,974	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29年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	7,396,710,360	99.76
内 日本	7,396,710,360	99.76
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	17,798,086	0.24
純資産総額	7,414,508,446	100.00

S J A M スモールキャップ・マザーファンド

平成29年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	7,300,220,800	98.81
内 日本	7,300,220,800	98.81
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	88,050,562	1.19
純資産総額	7,388,271,362	100.00

損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成29年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	9,366,635,600	64.35
内 日本	9,267,005,500	63.67
内 メキシコ	99,630,100	0.68
特殊債券	932,204,315	6.40
内 日本	932,204,315	6.40
社債券	4,035,543,000	27.73
内 日本	3,230,066,100	22.19
内 フランス	606,419,300	4.17
内 イギリス	199,057,600	1.37
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	220,967,315	1.52
純資産総額	14,555,350,230	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29年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	5,379,884,649	90.33
内 アメリカ	2,386,102,246	40.06
内 イタリア	1,050,442,104	17.64
内 ドイツ	392,589,020	6.59
内 イギリス	391,493,271	6.57
内 スペイン	296,997,761	4.99
内 フランス	151,891,198	2.55
内 ベルギー	148,968,872	2.50
内 カナダ	117,611,842	1.97
内 オーストラリア	112,731,968	1.89
内 アイルランド	86,130,333	1.45
内 オランダ	62,241,277	1.05
内 メキシコ	41,234,657	0.69
内 デンマーク	35,292,993	0.59
内 ポーランド	28,002,623	0.47
内 スウェーデン	21,410,386	0.36
内 マレーシア	20,614,789	0.35
内 スイス	19,905,183	0.33
内 ノルウェー	16,224,126	0.27
特殊債券	29,252,437	0.49
内 南アフリカ	29,252,437	0.49
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	546,495,050	9.18
純資産総額	5,955,632,136	100.00

損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

平成29年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	9,373,834,960	90.05
内 アメリカ	7,181,390,067	68.99
内 スイス	378,039,216	3.63
内 イギリス	315,459,387	3.03
内 オランダ	267,850,467	2.57
内 ドイツ	265,523,340	2.55
内 フランス	235,915,538	2.27
内 アイルランド	229,601,205	2.21
内 オーストラリア	113,897,959	1.09
内 バミューダ	67,871,955	0.65
内 シンガポール	66,065,434	0.63
内 ジャージー	55,139,971	0.53
内 スウェーデン	51,525,949	0.49
内 香港	35,102,742	0.34

	内 デンマーク	32,158,373	0.31
	内 ノルウェー	31,982,605	0.31
	内 ケイマン諸島	28,964,618	0.28
	内 プエルトリコ	7,101,914	0.07
	内 イタリア	7,077,936	0.07
	内 カナダ	3,166,284	0.03
投資証券		554,918,199	5.33
	内 アメリカ	554,918,199	5.33
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		480,774,898	4.62
純資産総額		10,409,528,057	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29年1月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	損保ジャパン - T C W外国株式 マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,751,787,275	1.4449 2,531,275,173	1.6463 2,883,967,390	- -	32.99%
2	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	1,042,892,868	1.7228 1,796,752,466	2.1841 2,277,782,312	- -	26.06%
3	S J A M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	1,275,051,966	1.3481 1,718,970,360	1.7854 2,276,477,780	- -	26.04%
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	363,230,837	1.4486 526,194,818	1.4590 529,953,791	- -	6.06%
5	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託受 益証券	100,801	4,060.52 409,305,174	4,241.69 427,567,470	- -	4.89%
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	127,194,637	1.4333 182,316,026	1.3965 177,627,310	- -	2.03%

（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29年1月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	4.89%
親投資信託受益証券	93.18%
合計	98.08%

（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29年1月31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 ラージキャップ・パ リユー・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,340,084,251	1.3501 1,809,263,728	1.7854 2,392,586,421	- -	22.11%
2	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	1,090,223,290	1.7267 1,882,594,975	2.1841 2,381,156,687	- -	22.01%
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	1,377,210,186	1.4469 1,992,769,477	1.6463 2,267,301,129	- -	20.95%
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	1,495,701,182	1.4486 2,166,679,763	1.4590 2,182,228,024	- -	20.17%
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	628,554,667	1.4335 901,080,203	1.3965 877,776,592	- -	8.11%
6	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託受 益証券	123,569	4,063.35 502,104,509	4,241.69 524,142,466	- -	4.84%

（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29年1月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	4.84%
親投資信託受益証券	93.35%
合計	98.20%

（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29年1月31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	3,159,960,781	1.4351 4,534,864,464	1.3965 4,412,885,230	- -	33.31%
2	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	1,154,020,559	1.3581 1,567,348,980	1.7854 2,060,388,306	- -	15.55%
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	936,129,385	1.7261 1,615,899,511	2.1841 2,044,600,189	- -	15.43%
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	1,367,163,397	1.4497 1,982,022,088	1.4590 1,994,691,396	- -	15.06%
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	1,118,958,308	1.4503 1,622,921,503	1.6463 1,842,141,062	- -	13.91%
6	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託受 益証券	150,865	4,067.70 613,673,736	4,241.69 639,923,874	- -	4.83%

（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29年1月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	4.83%
親投資信託受益証券	93.27%
合計	98.10%

（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29年1月31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	2,473,800,996	1.4365 3,553,801,202	1.3965 3,454,663,090	- -	57.31%
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	454,409,968	1.4505 659,157,938	1.4590 662,984,143	- -	11.00%
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	318,332,291	1.3457 428,407,135	1.7854 568,350,472	- -	9.43%
4	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	260,042,717	1.7244 448,431,321	2.1841 567,959,298	- -	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	289,802,787	1.4461 419,100,598	1.6463 477,102,328	- -	7.91%
6	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託受 益証券	41,182	4,070.98 167,651,250	4,241.69 174,681,635	- -	2.90%

(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29年1月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	2.90%
親投資信託受益証券	95.07%
合計	97.97%

(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29年1月31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	2,266,296,312	1.4376 3,258,208,205	1.3965 3,164,882,799	- -	82.10%
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	157,837,622	1.4509 229,006,668	1.4590 230,285,090	- -	5.97%
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	92,270,341	1.4463 133,457,299	1.6463 151,904,662	- -	3.94%
4	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	64,016,493	1.3585 86,972,297	1.7854 114,295,046	- -	2.96%
5	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	52,292,851	1.7245 90,183,717	2.1841 114,212,815	- -	2.96%

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.94%
合計	97.94%

(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・バリュウ・マザーファンド

平成29年1月31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	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,709,300	172.60 467,626,306	210.30 569,765,790	- -	7.68%
2	ジェイ エフ イー ホールディングス 日本	株式 鉄鋼	276,700	1,397.19 386,604,772	1,982.00 548,419,400	- -	7.40%
3	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	115,300	3,070.91 354,077,006	4,451.00 513,200,300	- -	6.92%
4	第一生命ホールディングス 日本	株式 保険業	239,800	1,438.81 345,028,277	2,062.00 494,467,600	- -	6.67%
5	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	166,200	1,892.83 314,588,512	2,736.50 454,806,300	- -	6.13%
6	三菱重工業 日本	株式 機械	838,000	445.62 373,437,413	508.90 426,458,200	- -	5.75%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	113,000	3,061.34 345,932,313	3,387.00 382,731,000	- -	5.16%
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	518,000	478.27 247,748,424	647.60 335,456,800	- -	4.52%
9	パナソニック 日本	株式 電気機器	280,500	1,007.60 282,633,857	1,178.50 330,569,250	- -	4.46%
10	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先物取引業	433,300	469.45 203,414,140	703.50 304,826,550	- -	4.11%
11	日本郵船 日本	株式 海運業	1,196,000	216.39 258,805,897	240.00 287,040,000	- -	3.87%
12	ツムラ 日本	株式 医薬品	80,000	3,246.20 259,696,114	3,270.00 261,600,000	- -	3.53%
13	ソニーフィナンシャルホールディングス 日本	株式 保険業	128,100	1,381.24 176,937,213	1,903.00 243,774,300	- -	3.29%
14	住友金属鉱山 日本	株式 非鉄金属	154,000	1,154.07 177,727,042	1,532.00 235,928,000	- -	3.18%
15	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	315,200	495.07 156,046,643	730.90 230,379,680	- -	3.11%
16	野村不動産ホールディングス 日本	株式 不動産業	114,500	1,903.57 217,959,212	1,945.00 222,702,500	- -	3.00%
17	三菱商事 日本	株式 卸売業	86,800	1,867.14 162,068,295	2,549.50 221,296,600	- -	2.98%
18	デンソー 日本	株式 輸送用機器	36,200	3,927.29 142,168,134	4,901.00 177,416,200	- -	2.39%
19	三菱UFJリース 日本	株式 その他金融業	289,300	534.69 154,688,628	603.00 174,447,900	- -	2.35%
20	スズケン 日本	株式 卸売業	45,000	2,927.91 131,756,065	3,730.00 167,850,000	- -	2.26%
21	マツダ 日本	株式 輸送用機器	100,400	1,651.76 165,837,349	1,668.00 167,467,200	- -	2.26%
22	JXホールディングス 日本	株式 石油・石炭製品	304,900	407.66 124,297,483	532.60 162,389,740	- -	2.19%
23	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	26,600	4,814.55 128,067,109	4,979.00 132,441,400	- -	1.79%
24	住友電気工業 日本	株式 非鉄金属	77,100	1,642.74 126,655,432	1,647.50 127,022,250	- -	1.71%

25	フジ・メディア・ホールディングス 日本	株式 情報・通信業	58,000	1,306.58 75,782,188	1,637.00 94,946,000	- -	1.28%
26	静岡銀行 日本	株式 銀行業	86,000	922.57 79,341,054	985.00 84,710,000	- -	1.14%
27	ヤマダ電機 日本	株式 小売業	71,700	519.90 37,277,167	622.00 44,597,400	- -	0.60%

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

種類	投資比率
株式	99.76%
合計	99.76%

（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

平成29年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行業	国内	18.86%
鉄鋼		13.53%
保険業		9.96%
輸送用機器		9.81%
電気機器		8.98%
機械		5.75%
卸売業		5.25%
非鉄金属		4.90%
証券、商品先物取引業		4.11%
海運業		3.87%
医薬品		3.53%
情報・通信業		3.07%
不動産業		3.00%
その他金融業		2.35%
石油・石炭製品		2.19%
小売業		0.60%
合計		99.76%

（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。

S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

平成29年1月31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	シチズン時計 日本	株式 精密機器	320,000	711.62 227,719,530	704.00 225,280,000	- -	3.05%
2	ケースホールディングス 日本	株式 小売業	110,000	1,675.00 184,250,000	2,037.00 224,070,000	- -	3.03%
3	ジーエス・ユアサ コーポレーション 日本	株式 電気機器	460,000	440.91 202,818,840	468.00 215,280,000	- -	2.91%
4	長瀬産業 日本	株式 卸売業	108,000	1,185.00 127,980,000	1,549.00 167,292,000	- -	2.26%
5	エクセディ 日本	株式 輸送用機器	54,000	2,616.00 141,264,000	3,060.00 165,240,000	- -	2.24%
6	東邦ホールディングス 日本	株式 卸売業	66,000	2,119.84 139,909,872	2,428.00 160,248,000	- -	2.17%
7	大和工業 日本	株式 鉄鋼	46,000	3,170.80 145,857,156	3,380.00 155,480,000	- -	2.10%
8	A O K Iホールディングス 日本	株式 小売業	107,000	1,170.00 125,190,000	1,423.00 152,261,000	- -	2.06%
9	住友倉庫 日本	株式 倉庫・運輸関連業	250,000	519.94 129,987,242	608.00 152,000,000	- -	2.06%
10	伊予銀行 日本	株式 銀行業	200,000	763.04 152,608,844	759.00 151,800,000	- -	2.05%
11	ダイビル 日本	株式 不動産業	147,000	934.19 137,325,996	1,025.00 150,675,000	- -	2.04%
12	A D E K A 日本	株式 化学	91,000	1,521.19 138,428,478	1,646.00 149,786,000	- -	2.03%
13	日立キャピタル 日本	株式 その他金融業	51,000	2,211.56 112,789,797	2,905.00 148,155,000	- -	2.01%
14	メイテック 日本	株式 サービス業	34,000	3,445.00 117,130,000	4,245.00 144,330,000	- -	1.95%
15	百五銀行 日本	株式 銀行業	310,000	399.00 123,690,000	465.00 144,150,000	- -	1.95%
16	コメリ 日本	株式 小売業	54,000	2,477.66 133,794,011	2,661.00 143,694,000	- -	1.94%
17	リコーリース 日本	株式 その他金融業	41,000	3,104.05 127,266,348	3,430.00 140,630,000	- -	1.90%
18	エディオン 日本	株式 小売業	128,000	844.00 108,032,000	1,083.00 138,624,000	- -	1.88%
19	ゼビオホールディングス 日本	株式 小売業	82,000	1,617.00 132,594,000	1,688.00 138,416,000	- -	1.87%
20	七十七銀行 日本	株式 銀行業	260,000	433.00 112,580,000	525.00 136,500,000	- -	1.85%
21	トッパン・フォームズ 日本	株式 その他製品	115,000	1,100.14 126,516,650	1,172.00 134,780,000	- -	1.82%
22	島忠 日本	株式 小売業	43,000	2,430.00 104,490,000	2,763.00 118,809,000	- -	1.61%
23	カブコン 日本	株式 情報・通信業	48,000	2,334.00 112,032,000	2,392.00 114,816,000	- -	1.55%
24	キャノンマーケティングジャパン 日本	株式 卸売業	53,000	1,814.71 96,180,034	2,156.00 114,268,000	- -	1.55%
25	U A C J 日本	株式 非鉄金属	310,000	319.11 98,924,576	355.00 110,050,000	- -	1.49%

26	セイノーホールディングス	日本	株式	陸運業	83,000	1,115.00 92,545,000	1,305.00 108,315,000	- -	1.47%
27	E P Sホールディングス	日本	株式	サービス業	70,000	1,322.00 92,540,000	1,432.00 100,240,000	- -	1.36%
28	東芝機械	日本	株式	機械	200,000	346.00 69,200,000	492.00 98,400,000	- -	1.33%
29	カワチ薬品	日本	株式	小売業	33,000	2,316.00 76,428,000	2,906.00 95,898,000	- -	1.30%
30	大同特殊鋼	日本	株式	鉄鋼	180,000	479.00 86,220,000	513.00 92,340,000	- -	1.25%

(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29年1月31日現在

種類	投資比率
株式	98.81%
合計	98.81%

(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29年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
小売業	国内	16.63%
電気機器	国内	10.10%
輸送用機器	国内	7.99%
銀行業	国内	7.50%
卸売業	国内	7.13%
その他金融業	国内	6.08%
鉄鋼	国内	5.43%
サービス業	国内	5.29%
化学	国内	4.33%
精密機器	国内	3.35%
繊維製品	国内	3.16%
情報・通信業	国内	2.81%
不動産業	国内	2.70%
陸運業	国内	2.53%
倉庫・運輸関連業	国内	2.06%
その他製品	国内	1.82%
非鉄金属	国内	1.49%
建設業	国内	1.36%
機械	国内	1.33%
電気・ガス業	国内	1.17%
金属製品	国内	1.12%
医薬品	国内	1.04%
水産・農林業	国内	1.00%
鉱業	国内	0.96%
証券、商品先物取引業	国内	0.43%
合計		98.81%

(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29年1月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	1 2 8 5年国債 日本	国債証券	1,260,000,000	101.28 1,276,128,000	100.92 1,271,629,800	0.100000 2021/6/20	8.74%
2	3 7 0 2年国債 日本	国債証券	860,000,000	100.55 864,799,200	100.59 865,074,000	0.100000 2018/11/15	5.94%
3	3 4 5 10年国債 日本	国債証券	770,000,000	100.34 772,628,500	100.19 771,509,200	0.100000 2026/12/20	5.30%
4	3 2 3 10年国債 日本	国債証券	570,000,000	105.58 601,829,500	105.26 600,004,800	0.900000 2022/6/20	4.12%
5	1 0 0 20年国債 日本	国債証券	450,000,000	127.21 572,445,000	122.63 551,857,500	2.200000 2028/3/20	3.79%
6	1 5 1 20年国債 日本	国債証券	450,000,000	120.56 542,520,000	111.30 500,872,500	1.200000 2034/12/20	3.44%
7	3 5 30年国債 日本	国債証券	380,000,000	129.76 493,109,800	128.25 487,361,400	2.000000 2041/9/20	3.35%
8	5 1 30年国債 日本	国債証券	510,000,000	99.02 505,002,000	86.96 443,536,800	0.300000 2046/6/20	3.05%
9	4 1 ソフトバンクグループ 日本	社債券	400,000,000	100.51 402,056,000	100.08 400,354,800	1.470000 2017/3/10	2.75%
10	1 5 2 20年国債 日本	国債証券	360,000,000	120.61 434,196,000	111.17 400,215,600	1.200000 2035/3/20	2.75%
11	3 2 8 10年国債 日本	国債証券	310,000,000	105.27 326,364,900	104.02 322,480,600	0.600000 2023/3/20	2.22%
12	1 1 3 20年国債 日本	国債証券	230,000,000	123.93 285,061,500	123.40 283,833,800	2.100000 2029/9/20	1.95%
13	1 4 8 20年国債 日本	国債証券	230,000,000	124.34 285,994,100	116.51 267,973,000	1.500000 2034/3/20	1.84%
14	3 7 2 2年国債 日本	国債証券	250,000,000	100.62 251,560,000	100.62 251,565,000	0.100000 2019/1/15	1.73%
15	1 2 5 5年国債 日本	国債証券	230,000,000	101.43 233,301,500	100.83 231,927,400	0.100000 2020/9/20	1.59%
16	5 3 30年国債 日本	国債証券	240,000,000	95.55 229,327,100	94.60 227,054,400	0.600000 2046/12/20	1.56%
17	1 みずほFG劣後 日本	社債券	200,000,000	104.89 209,790,600	103.18 206,371,800	0.950000 2024/7/16	1.42%
18	5 2 9 東京電力 日本	社債券	200,000,000	101.53 203,066,000	100.89 201,799,400	2.025000 2017/7/25	1.39%
19	1 明治安田2014基 日本	社債券	200,000,000	101.35 202,712,600	100.55 201,103,600	0.510000 2019/8/7	1.38%
20	1 エイチエスピーシーHD イギリス	社債券	200,000,000	100.00 200,000,000	99.52 199,057,600	0.450000 2021/9/24	1.37%
21	3 A 富国生命劣後FR 日本	社債券	200,000,000	98.90 197,800,000	98.03 196,060,000	1.020000 -	1.35%
22	3 4 0 10年国債 日本	国債証券	160,000,000	103.50 165,600,000	103.00 164,811,200	0.400000 2025/9/20	1.13%
23	9 40年国債 日本	国債証券	190,000,000	96.52 183,396,600	83.71 159,056,600	0.400000 2056/3/20	1.09%
24	1 4 6 20年国債 日本	国債証券	130,000,000	120.69 156,904,700	119.80 155,743,900	1.700000 2033/9/20	1.07%
25	1 0 9 20年国債 日本	国債証券	120,000,000	123.24 147,898,800	120.41 144,493,200	1.900000 2029/3/20	0.99%

26	131 20年国債 日本	国債証券	120,000,000	120.57 144,695,900	119.45 143,343,600	1.700000 2031/9/20	0.98%
27	79 住宅機構RMB S 日本	特殊債券	137,136,000	105.86 145,185,882	104.02 142,662,580	1.070000 2048/12/10	0.98%
28	78 住宅機構RMB S 日本	特殊債券	136,534,000	105.90 144,603,159	104.01 142,022,666	1.080000 2048/11/10	0.98%
29	124 5年国債 日本	国債証券	130,000,000	101.18 131,536,600	100.81 131,058,200	0.100000 2020/6/20	0.90%
30	119 5年国債 日本	国債証券	130,000,000	100.91 131,190,800	100.65 130,852,800	0.100000 2019/6/20	0.90%

(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29年1月31日現在

種類	投資比率
国債証券	64.35%
特殊債券	6.40%
社債券	27.73%
合計	98.48%

(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29年1月31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 1.0% 2018/11/30 アメリカ	国債証券	1,217,767,000	99.72 1,214,479,029	99.67 1,213,760,546	1.000000 2018/11/30	20.38%
2	BTPS 0.25% 2018/05/15 イタリア	国債証券	398,122,500	100.41 399,762,813	100.40 399,726,933	0.250000 2018/5/15	6.71%
3	US TREASURY N/B 2.0% 2021/12/31 アメリカ	国債証券	319,806,100	100.25 320,616,774	100.28 320,704,755	2.000000 2021/12/31	5.38%
4	US TREASURY N/B 1.25% 2018/12/31 アメリカ	国債証券	211,686,600	100.03 211,763,421	100.08 211,866,533	1.250000 2018/12/31	3.56%
5	BTPS 0.35% 2021/11/01 イタリア	国債証券	180,190,000	97.54 175,765,665	97.10 174,975,301	0.350000 2021/11/1	2.94%
6	DEUTSCHLAND REP 0.5% 2025/02/15 ドイツ	国債証券	146,100,000	102.83 150,247,779	103.03 150,534,135	0.500000 2025/2/15	2.53%
7	US TREASURY N/B 2.25% 2023/12/31 アメリカ	国債証券	135,433,900	100.08 135,555,578	99.83 135,210,434	2.250000 2023/12/31	2.27%
8	BTPS 2.0% 2025/12/01 イタリア	国債証券	117,854,000	107.33 126,498,710	98.58 116,185,187	2.000000 2025/12/1	1.95%
9	US TREASURY N/B 1.5% 2023/03/31 アメリカ	国債証券	120,638,600	100.51 121,262,744	96.00 115,821,500	1.500000 2023/3/31	1.94%

10	BELGIAN 0328 2.25% 2023/06/22 ベルギー	国債証券	93,747,500	116.04 108,789,055	113.13 106,064,984	2.250000 2023/6/22	1.78%
11	US TREASURY N/B 2.875% 2046/11/15 アメリカ	国債証券	105,843,300	96.66 102,309,424	96.06 101,675,190	2.875000 2046/11/15	1.71%
12	BTPS 0.65% 2020/11/01 イタリア	国債証券	99,835,000	102.04 101,881,617	100.32 100,163,457	0.650000 2020/11/1	1.68%
13	SPANISH GOVT 4.85% 2020/10/31 スペイン	国債証券	73,658,750	120.18 88,530,451	117.27 86,382,562	4.850000 2020/10/31	1.45%
14	IRISH GOVT 1.0% 2026/05/15 アイルランド	国債証券	87,660,000	100.91 88,462,965	98.25 86,130,333	1.000000 2026/5/15	1.45%
15	US TREASURY N/B 2.0% 2026/11/15 アメリカ	国債証券	84,219,400	96.37 81,163,156	95.81 80,692,291	2.000000 2026/11/15	1.35%
16	DEUTSCHLAND REP 1.0% 2024/08/15 ドイツ	国債証券	68,180,000	110.69 75,473,531	107.17 73,071,233	1.000000 2024/8/15	1.23%
17	US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15 アメリカ	国債証券	47,800,200	140.96 67,380,751	127.28 60,844,396	4.625000 2040/2/15	1.02%
18	DBR 6.5% 2027/07/04 ドイツ	国債証券	37,133,750	172.96 64,228,226	162.07 60,184,153	6.500000 2027/7/4	1.01%
19	TREASURY 4.25 2027/12/07 イギリス	国債証券	45,577,600	135.27 61,657,377	126.99 57,879,450	4.250000 2027/12/7	0.97%
20	AUSTRALIAN GOVT. 3.25% 2025/04/21 オーストラリア	国債証券	53,382,000	109.87 58,651,509	104.74 55,916,577	3.250000 2025/4/21	0.94%
21	SPANISH GOVT 5.5% 2021/04/30 スペイン	国債証券	44,438,750	125.30 55,686,197	121.89 54,167,281	5.500000 2021/4/30	0.91%
22	UK TSY GILT 1.25% 2018/07/22 イギリス	国債証券	51,274,800	101.61 52,100,837	101.62 52,108,528	1.250000 2018/7/22	0.87%
23	SPANISH GOVT 4.4% 2023/10/31 スペイン	国債証券	42,003,750	126.36 53,078,495	122.28 51,365,965	4.400000 2023/10/31	0.86%
24	US TREASURY N/B 2.875% 2043/05/15 アメリカ	国債証券	48,938,300	113.48 55,537,140	96.31 47,133,455	2.875000 2043/5/15	0.79%
25	AUSTRALIAN GOVT. 5.75% 2022/07/15 オーストラリア	国債証券	39,606,000	117.95 46,718,049	117.84 46,672,898	5.750000 2022/7/15	0.78%
26	CANADA-GOVT 1.5% 2023/06/01 カナダ	国債証券	45,130,800	104.79 47,294,231	100.44 45,333,888	1.500000 2023/6/1	0.76%
27	DEUTSCHLAND REP 4.0 2037/01/04 ドイツ	国債証券	25,567,500	174.27 44,558,819	155.73 39,818,824	4.000000 2037/1/4	0.67%
28	BTPS 5.75 2/1/2033 イタリア	国債証券	28,002,500	157.88 44,211,747	136.90 38,337,102	5.750000 2033/2/1	0.64%
29	FRANCE O.A.T. 2.75% 2027/10/25 フランス	国債証券	32,872,500	127.53 41,925,586	116.01 38,137,359	2.750000 2027/10/25	0.64%
30	FRANCE O.A.T. 5.75 2032/10/25 フランス	国債証券	23,741,250	181.89 43,183,264	159.62 37,896,258	5.750000 2032/10/25	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。

種類	投資比率
国債証券	90.33%
特殊債券	0.49%
合計	90.82%

（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。

損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

平成29年1月31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	2,452	82,067.50 201,229,527	91,312.03 223,897,120	- -	2.15%
2	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	12,960	13,350.63 173,024,173	14,906.83 193,192,566	- -	1.86%
3	CHUBB LTD スイス	株式 保険	11,958	14,581.79 174,369,106	14,989.91 179,249,404	- -	1.72%
4	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	18,520	8,893.68 164,711,044	9,525.89 176,419,612	- -	1.69%
5	EQUINIX INC アメリカ	投資証券 -	3,902	42,329.57 165,170,014	43,972.76 171,581,747	- -	1.65%
6	CVS HEALTH CORPORATION アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	18,699	10,427.50 194,983,999	8,954.57 167,441,519	- -	1.61%
7	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	18,210	9,145.85 166,546,057	8,957.98 163,124,908	- -	1.57%
8	CELGENE CORP アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー	11,860	11,548.92 136,970,204	12,881.01 152,768,847	- -	1.47%
9	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売り	1,605	84,980.69 136,394,022	94,505.54 151,681,404	- -	1.46%
10	AMERICAN TOWER CORP アメリカ	投資証券 -	12,840	13,283.86 170,564,861	11,723.56 150,530,614	- -	1.45%
11	THE PRICELINE GROUP INC アメリカ	株式 小売り	766	153,226.49 117,371,498	182,358.90 139,686,918	- -	1.34%
12	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	16,165	7,610.93 123,030,764	8,574.44 138,605,909	- -	1.33%
13	STARBUCKS CORP アメリカ	株式 消費者サービス	21,225	6,510.76 138,191,066	6,361.97 135,033,004	- -	1.30%
14	JP MORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 各種金融	13,485	7,306.09 98,522,626	9,791.07 132,032,636	- -	1.27%
15	ENPRO INDUSTRIES INC アメリカ	株式 資本財	17,083	6,228.84 106,407,320	7,578.60 129,465,358	- -	1.24%
16	ADOBE SYSTEMS INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	9,585	11,183.82 107,196,920	12,953.85 124,162,692	- -	1.19%
17	GENERAL ELECTRIC CO. アメリカ	株式 資本財	36,292	3,690.55 133,937,578	3,409.74 123,746,559	- -	1.19%
18	CITIGROUP INC アメリカ	株式 各種金融	18,550	5,125.44 95,077,067	6,442.78 119,513,645	- -	1.15%
19	CONAGRA BRANDS INC アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	26,888	4,128.23 110,999,875	4,440.86 119,406,010	- -	1.15%
20	CARDINAL HEALTH INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	13,770	8,778.40 120,878,649	8,329.75 114,700,711	- -	1.10%

21	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	15,425	6,116.14 94,341,604	7,412.44 114,336,968	- -	1.10%
22	SERVICENOW INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	11,085	8,032.21 89,037,107	10,256.55 113,693,936	- -	1.09%
23	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 テクノロジー・ハードウェア	31,350	3,412.64 106,986,553	3,508.76 109,999,698	- -	1.06%
24	WESTERN DIGITAL CORP アメリカ	株式 テクノロジー・ハードウェア	12,030	6,087.13 73,228,290	9,016.02 108,462,819	- -	1.04%
25	SPLUNK INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	15,589	6,644.17 103,576,004	6,532.69 101,838,166	- -	0.98%
26	MOBILEYE NV オランダ	株式 自動車・自動車部品	20,335	5,370.07 109,200,537	4,949.59 100,650,052	- -	0.97%
27	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	7,865	12,105.95 95,213,318	12,726.23 100,091,831	- -	0.96%
28	BAKER HUGHES INC アメリカ	株式 エネルギー	14,030	5,312.46 74,533,885	7,035.73 98,711,350	- -	0.95%
29	ARES CAPITAL CORP アメリカ	株式 各種金融	50,605	1,751.94 88,656,955	1,927.94 97,563,474	- -	0.94%
30	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	5,200	18,995.91 98,778,760	18,579.48 96,613,309	- -	0.93%

(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29年1月31日現在

種類	投資比率
株式	90.05%
投資証券	5.33%
合計	95.38%

(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29年1月31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	13.28%
資本財		7.91%
医薬品・バイオテクノロジー		7.91%
各種金融		6.92%
エネルギー		5.52%
銀行		4.97%
食品・飲料・タバコ		4.40%
テクノロジー・ハードウェア		4.22%
小売り		4.09%
素材		4.08%
保険		3.89%
耐久消費財・アパレル		3.63%
食品・生活必需品小売り		3.09%
ヘルスケア機器・サービス		3.06%
半導体・半導体製造装置		2.87%
メディア		2.19%
自動車・自動車部品		2.15%

消費者サービス	1.76%
電気通信サービス	1.59%
公益事業	1.44%
不動産	0.66%
運輸	0.23%
商業・専門サービス	0.10%
家庭用品・パーソナル用品	0.07%
合計	90.05%

(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29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
第16計算期間末 (平成28年7月15日)	7,416,738,892	7,416,738,892	1.1099	1.1099
平成28年1月末日	7,752,937,611	-	1.1716	-
2月末日	7,227,945,679	-	1.0871	-
3月末日	7,678,783,947	-	1.1382	-
4月末日	7,587,317,857	-	1.1348	-
5月末日	7,721,555,241	-	1.1537	-
6月末日	6,950,578,625	-	1.0372	-
7月末日	7,536,097,238	-	1.1135	-
8月末日	7,656,238,535	-	1.1321	-
9月末日	7,601,379,213	-	1.1158	-
10月末日	7,923,449,461	-	1.1659	-
11月末日	8,501,144,427	-	1.2608	-
12月末日	8,836,701,441	-	1.3218	-
平成29年1月末日	8,741,571,315	-	1.3243	-

ハッピーエイジング30

直近日（平成29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
第16計算期間末 (平成28年7月15日)	9,226,785,122	9,226,785,122	1.1894	1.1894
平成28年1月末日	9,522,989,053	-	1.2520	-
2月末日	8,914,993,303	-	1.1708	-
3月末日	9,390,568,561	-	1.2188	-
4月末日	9,381,011,586	-	1.2121	-
5月末日	9,546,371,950	-	1.2299	-
6月末日	8,719,433,477	-	1.1230	-
7月末日	9,292,143,455	-	1.1900	-
8月末日	9,448,568,369	-	1.2051	-
9月末日	9,355,520,684	-	1.1893	-
10月末日	9,716,809,748	-	1.2332	-
11月末日	10,374,559,708	-	1.3166	-
12月末日	10,807,113,249	-	1.3713	-
平成29年1月末日	10,820,185,990	-	1.3682	-

ハッピーエイジング４０

直近日（平成29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
第16計算期間末 （平成28年7月15日）	11,857,174,350	11,857,174,350	1.2636	1.2636
平成28年1月末日	11,824,200,899	-	1.2913	-
2月末日	11,318,274,384	-	1.2367	-
3月末日	11,828,718,106	-	1.2772	-
4月末日	11,970,168,512	-	1.2748	-
5月末日	12,119,918,215	-	1.2882	-
6月末日	11,392,755,968	-	1.2131	-
7月末日	11,921,507,345	-	1.2621	-
8月末日	12,029,576,322	-	1.2696	-
9月末日	11,989,598,208	-	1.2578	-
10月末日	12,319,972,909	-	1.2898	-
11月末日	12,915,510,867	-	1.3490	-
12月末日	13,242,040,249	-	1.3878	-
平成29年1月末日	13,246,635,431	-	1.3840	-

ハッピーエイジング50

直近日（平成29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
第16計算期間末 （平成28年7月15日）	5,689,949,958	5,689,949,958	1.3007	1.3007
平成28年1月末日	5,525,786,637	-	1.2960	-
2月末日	5,397,450,648	-	1.2686	-
3月末日	5,580,271,335	-	1.2979	-
4月末日	5,653,511,516	-	1.3009	-
5月末日	5,705,721,081	-	1.3110	-
6月末日	5,548,654,121	-	1.2698	-
7月末日	5,713,475,978	-	1.2969	-
8月末日	5,710,893,006	-	1.2964	-
9月末日	5,730,112,288	-	1.2887	-
10月末日	5,834,778,856	-	1.3072	-
11月末日	5,954,381,504	-	1.3412	-
12月末日	6,053,377,904	-	1.3623	-
平成29年1月末日	6,028,223,960	-	1.3568	-

ハッピーエイジング60

直近日（平成29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
第16計算期間末 （平成28年7月15日）	3,737,464,193	3,737,464,193	1.2843	1.2843
平成28年1月末日	3,473,175,304	-	1.2494	-
2月末日	3,472,958,388	-	1.2516	-
3月末日	3,524,381,656	-	1.2677	-
4月末日	3,647,302,392	-	1.2752	-
5月末日	3,702,081,200	-	1.2814	-
6月末日	3,698,775,952	-	1.2761	-
7月末日	3,708,731,050	-	1.2785	-
8月末日	3,726,024,640	-	1.2689	-
9月末日	3,734,285,788	-	1.2656	-
10月末日	3,775,443,606	-	1.2688	-
11月末日	3,847,056,153	-	1.2766	-
12月末日	3,863,080,544	-	1.2802	-
平成29年1月末日	3,855,084,974	-	1.2732	-

【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
第16計算期間	0.0000
平成28年7月16日～ 平成29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
第16計算期間	0.0000
平成28年7月16日～ 平成29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
第16計算期間	0.0000
平成28年7月16日～ 平成29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
第16計算期間	0.0000
平成28年7月16日～ 平成29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
第16計算期間	0.0000
平成28年7月16日～ 平成29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
第16計算期間	18.0
平成28年7月16日～ 平成29年1月15日	20.2

(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。

ハッピーエイジング30

	収益率(%)
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
第16計算期間	14.7
平成28年7月16日～ 平成29年1月15日	16.0

(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
第16計算期間	8.5
平成28年7月16日～ 平成29年1月15日	10.3

(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
第16計算期間	2.5
平成28年7月16日～ 平成29年1月15日	5.0

(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
第16計算期間	3.6
平成28年7月16日～ 平成29年1月15日	0.4

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

（4）【設定及び解約の実績】

ハッピーエイジング20

	設定口数	解約口数
第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
第16計算期間	1,316,566,721	1,133,015,060
平成28年7月16日～ 平成29年1月15日	578,200,270	653,175,040

(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
第16計算期間	963,924,983	701,088,669
平成28年7月16日～ 平成29年1月15日	465,859,697	367,806,315

(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
第16計算期間	1,288,216,954	864,776,270
平成28年7月16日～ 平成29年1月15日	657,529,641	526,122,880

(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
第16計算期間	730,303,162	502,519,916
平成28年7月16日～ 平成29年1月15日	381,539,223	334,177,194

(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
第16計算期間	720,837,714	465,830,338
平成28年7月16日～ 平成29年1月15日	383,275,333	266,204,314

(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:2017年1月31日

● 基準価額・純資産の推移 2007/01/31～2017/01/31

● ハッピーエイジング20



● ハッピーエイジング20

2012年07月	0円
2013年07月	0円
2014年07月	0円
2015年07月	0円
2016年07月	0円
設定来累計	0円

● ハッピーエイジング30



● ハッピーエイジング30

2012年07月	0円
2013年07月	0円
2014年07月	0円
2015年07月	0円
2016年07月	0円
設定来累計	0円

● ハッピーエイジング40



● ハッピーエイジング40

2012年07月	0円
2013年07月	0円
2014年07月	0円
2015年07月	0円
2016年07月	0円
設定来累計	0円

● ハッピーエイジング50



● ハッピーエイジング50

2012年07月	0円
2013年07月	0円
2014年07月	0円
2015年07月	0円
2016年07月	0円
設定来累計	0円

- 上記の運用実績は、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。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

●ハッピーエイジング60



●ハッピーエイジング60

2012年07月	0円
2013年07月	0円
2014年07月	0円
2015年07月	0円
2016年07月	0円
設定来累計	0円

- 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。

- 1万口当たり、税引前

● 主要な資産の状況

	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
資産別構成			
資産の種類	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	26.04%	22.11%	15.55%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	26.06%	22.01%	15.43%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	2.03%	8.11%	33.31%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	6.06%	20.17%	15.06%
損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド	32.99%	20.95%	13.91%
ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	4.89%	4.84%	4.83%
コール・ローン等	1.93%	1.81%	1.90%
合計	100.00%	100.00%	100.00%

	ハッピー エイジング 50	ハッピー エイジング 60
資産別構成		
資産の種類	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	9.43%	2.96%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	9.42%	2.96%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	57.31%	82.10%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	11.00%	5.97%
損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド	7.91%	3.94%
ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	2.90%	-
コール・ローン等	2.03%	2.06%
合計	100.00%	100.00%

- 上記の運用実績は、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。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

● 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 みずほフィナンシャルG	銀行業	7.7%
2 JFEホールディングス	鉄鋼	7.4%
3 三井住友フィナンシャルG	銀行業	6.9%
4 第一生命HLDGS	保険業	6.7%
5 新日鐵住金	鉄鋼	6.1%
組入銘柄数		27銘柄

● SJAMスモールキャップ・マザーファンド

組入上位5銘柄		
銘柄名	業種	純資産比
1 シチズン時計	精密機器	3.1%
2 ケーズホールディングス	小売業	3.0%
3 ジーエス・ユアサコーポ	電気機器	2.9%
4 長瀬産業	卸売業	2.3%
5 エクセディ	輸送用機器	2.2%
組入銘柄数		80銘柄

● 損保ジャパン日本債券マザーファンド

組入上位5銘柄			
銘柄名	種類	償還日	純資産比
1 128 5年国債	国債証券	2021/06/20	8.7%
2 370 2年国債	国債証券	2018/11/15	5.9%
3 345 10年国債	国債証券	2026/12/20	5.3%
4 323 10年国債	国債証券	2022/06/20	4.1%
5 100 20年国債	国債証券	2028/03/20	3.8%
組入銘柄数			78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

組入上位5銘柄					
銘柄名	発行国	種類	通貨	償還日	純資産比
1 US TREASURY N/B 1.0%	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2018/11/30	20.4%
2 BTPS 0.25%	イタリア	国債証券	ユーロ	2018/05/15	6.7%
3 US TREASURY N/B 2.0%	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2021/12/31	5.4%
4 US TREASURY N/B 1.25%	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2018/12/31	3.6%
5 BTPS 0.35%	イタリア	国債証券	ユーロ	2021/11/01	2.9%
組入銘柄数					115銘柄

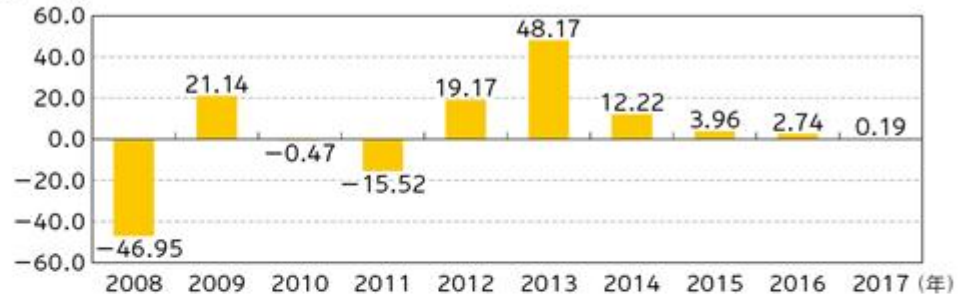
● 損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド

組入上位5銘柄				
銘柄名	通貨	発行国/地域	業種	純資産比
1 ALPHABET, INC	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	2.2%
2 FACEBOOK INC-A	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	1.9%
3 CHUBB LTD	アメリカ・ドル	アメリカ	金融	1.7%
4 VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	1.7%
5 EQUINIX INC	アメリカ・ドル	アメリカ	不動産	1.7%
組入銘柄数			246銘柄	

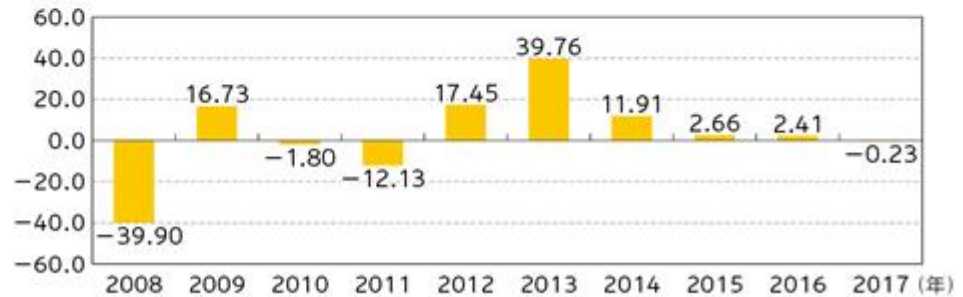
- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用実績は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

年間収益率の推移（暦年ベース）

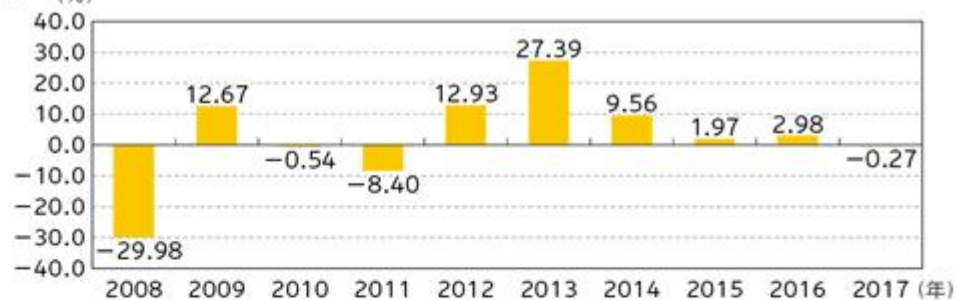
● ハッピーエイジング20 (%)



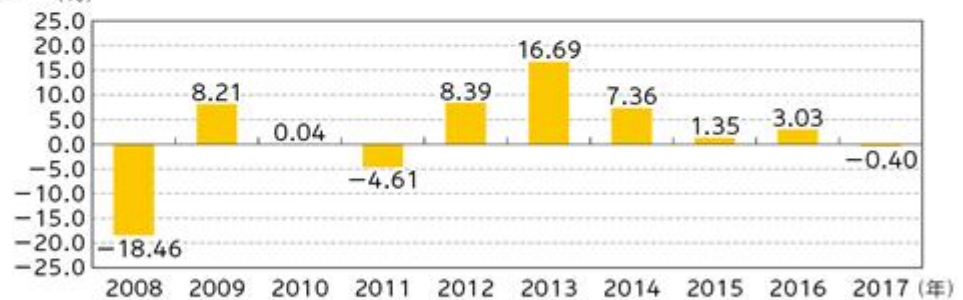
● ハッピーエイジング30 (%)



● ハッピーエイジング40 (%)

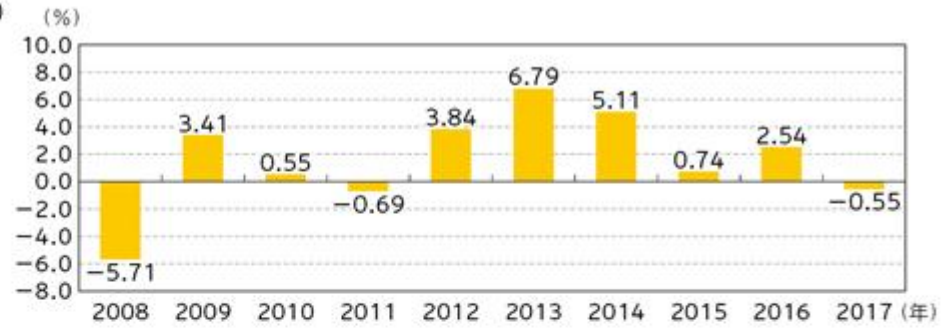


● ハッピーエイジング50 (%)



- 上記の運用実績は、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。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

●ハッピーエイジング60



- ファンドの年間収益率は基準価額(税引前分配金再投資)を使用して計算しています。
- 2017年は年初から基準日までの収益率です。

- 上記の運用実績は、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。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

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28年7月16日から平成29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16期 平成28年7月15日現在	第17期中間計算期間末 平成29年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	208,595,515	227,012,309
投資信託受益証券	350,671,110	425,657,554
親投資信託受益証券	6,947,311,897	8,263,169,407
未収入金	-	11,689,493
流動資産合計	7,506,578,522	8,927,528,763
資産合計	7,506,578,522	8,927,528,763
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	53,860
未払解約金	25,415,772	29,644,800
未払受託者報酬	3,174,978	3,487,723
未払委託者報酬	61,113,880	67,139,408
未払利息	-	1,180
その他未払費用	135,000	141,893
流動負債合計	89,839,630	100,468,864
負債合計	89,839,630	100,468,864
純資産の部		
元本等		
元本	6,682,092,823	6,615,435,318
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	734,646,069	2,211,624,581
純資産合計	7,416,738,892	8,827,059,899
負債純資産合計	7,506,578,522	8,927,528,763

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第16期中間計算期間		第17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	自	平成28年7月16日 至 平成29年1月15日
営業収益				
受取配当金		5,294,219		4,249,945
受取利息		10,227		-
有価証券売買等損益		1,103,211,709		1,553,120,475
為替差損益		19,171,627		33,497,774
その他収益		22,174		-
営業収益合計		1,117,056,716		1,590,868,194
営業費用				
支払利息		-		89,636
受託者報酬		3,657,914		3,487,723
委託者報酬		70,410,410		67,139,408
その他費用		201,997		191,218
営業費用合計		74,270,321		70,907,985
営業利益又は営業損失（ ）		1,191,327,037		1,519,960,209
経常利益又は経常損失（ ）		1,191,327,037		1,519,960,209
中間純利益又は中間純損失（ ）		1,191,327,037		1,519,960,209
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（ ）		39,476,224		84,052,942
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,302,463,458		734,646,069
剰余金増加額又は欠損金減少額		176,799,772		113,225,916
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		176,799,772		113,225,916
剰余金減少額又は欠損金増加額		194,697,195		72,154,671
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		194,697,195		72,154,671
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,132,715,222		2,211,624,581

(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. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法による時価法によっております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における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>
4. 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>
5. 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16期 平成28年7月15日現在	第17期中間計算期間末 平成29年1月15日現在
1．受益権の総数	6,682,092,823口	6,615,435,318口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1099円 (11,099円)	1.3343円 (13,343円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	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	第17期中間計算期間 自 平成28年7月16日 至 平成29年1月15日
1．信託財産の運用の指図に係る 権限の全部又は一部を委託す るために要する費用として委 託者報酬の中から支弁してい る額	3,954,199円	3,777,570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16期 平成28年7月15日現在	第17期中間計算期間末 平成29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	<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いません。</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>	<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いません。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載してあります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>
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。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（その他の注記）

項目	第16期	第17期中間計算期間
	自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15日	自 平成28年7月16日 至 平成29年1月15日
期首元本額	6,498,541,162円	6,682,092,823円
期中追加設定元本額	1,316,566,721円	574,407,494円
期中一部解約元本額	1,133,015,060円	641,064,999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）

通貨関連

種類	第16期 平成28年7月15日現在				第17期中間計算期間末 平成29年1月15日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	11,633,601	-	11,687,461	53,860
アメリカ・ドル	-	-	-	-	11,633,601	-	11,687,461	53,860
合計	-	-	-	-	11,633,601	-	11,687,461	53,860

（注） 時価の算定方法

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

【ハッピーエイジング30】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 平成28年7月15日現在	第17期中間計算期間末 平成29年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	209,638,981	304,610,864
投資信託受益証券	440,484,269	521,801,156
親投資信託受益証券	8,649,599,181	10,086,715,493
未収入金	-	10,854,529
流動資産合計	9,299,722,431	10,923,982,042
資産合計		
	9,299,722,431	10,923,982,042
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	50,012
未払解約金	1,642,788	6,547,200
未払受託者報酬	3,925,898	4,273,366
未払委託者報酬	67,233,623	73,183,328
未払利息	-	1,584
その他未払費用	135,000	142,882
流動負債合計	72,937,309	84,198,372
負債合計		
	72,937,309	84,198,372
純資産の部		
元本等		
元本	7,757,372,343	7,858,225,165
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,469,412,779	2,981,558,505
純資産合計	9,226,785,122	10,839,783,670
負債純資産合計	9,299,722,431	10,923,982,042

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第16期中間計算期間		第17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	自	平成28年7月16日 至 平成29年1月15日
営業収益				
受取配当金		6,368,392		5,175,735
受取利息		11,595		-
有価証券売買等損益		1,032,850,201		1,525,407,435
為替差損益		22,851,415		41,233,920
その他収益		22,488		-
営業収益合計		1,049,299,141		1,571,817,090
営業費用				
支払利息		-		105,594
受託者報酬		4,379,724		4,273,366
委託者報酬		75,005,338		73,183,328
その他費用		213,293		202,950
営業費用合計		79,598,355		77,765,238
営業利益又は営業損失（ ）		1,128,897,496		1,494,051,852
経常利益又は経常損失（ ）		1,128,897,496		1,494,051,852
中間純利益又は中間純損失（ ）		1,128,897,496		1,494,051,852
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（ ）		21,360,329		32,462,553
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,956,064,774		1,469,412,779
剰余金増加額又は欠損金減少額		155,851,432		119,247,593
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		155,851,432		119,247,593
剰余金減少額又は欠損金増加額		154,242,379		68,691,166
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		154,242,379		68,691,166
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,850,136,660		2,981,558,505

(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. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法による時価法によっております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客先物売買取相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客電信売買取相場の仲値によって計算しております。</p>
4. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 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>
5. 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16期 平成28年7月15日現在	第17期中間計算期間末 平成29年1月15日現在
1．受益権の総数	7,757,372,343口	7,858,225,165口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1894円 (11,894円)	1.3794円 (13,794円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	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	第17期中間計算期間 自 平成28年7月16日 至 平成29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	2,962,125円	2,888,696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16期 平成28年7月15日現在	第17期中間計算期間末 平成29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	<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いません。</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>	<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いません。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載してあります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>
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。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（その他の注記）

項目	第16期	第17期中間計算期間
	自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15日	自 平成28年7月16日 至 平成29年1月15日
期首元本額	7,494,536,029円	7,757,372,343円
期中追加設定元本額	963,924,983円	461,658,831円
期中一部解約元本額	701,088,669円	360,806,009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）

通貨関連

種類	第16期 平成28年7月15日現在				第17期中間計算期間末 平成29年1月15日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	10,802,630	-	10,852,642	50,012
アメリカ・ドル	-	-	-	-	10,802,630	-	10,852,642	50,012
合計	-	-	-	-	10,802,630	-	10,852,642	50,012

（注） 時価の算定方法

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

【ハッピーエイジング40】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 平成28年7月15日現在	第17期中間計算期間末 平成29年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	298,875,214	347,885,394
投資信託受益証券	580,660,512	637,065,375
親投資信託受益証券	11,073,073,732	12,327,585,401
未収入金	-	33,398,553
流動資産合計	11,952,609,458	13,345,934,723
資産合計		
	11,952,609,458	13,345,934,723
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	153,884
未払解約金	15,332,083	2,216,070
未払受託者報酬	4,373,091	4,712,792
未払委託者報酬	75,594,934	81,462,245
未払利息	-	1,810
その他未払費用	135,000	144,347
流動負債合計	95,435,108	88,691,148
負債合計		
	95,435,108	88,691,148
純資産の部		
元本等		
元本	9,383,307,551	9,512,805,554
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2,473,866,799	3,744,438,021
純資産合計	11,857,174,350	13,257,243,575
負債純資産合計	11,952,609,458	13,345,934,723

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第16期中間計算期間		第17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	自	平成28年7月16日 至 平成29年1月15日
営業収益				
受取配当金		7,753,029		6,516,997
受取利息		13,807		-
有価証券売買等損益		811,586,939		1,268,453,213
為替差損益		27,374,751		52,649,728
その他収益		18,878		-
営業収益合計		831,175,976		1,327,619,938
営業費用				
支払利息		-		127,774
受託者報酬		4,624,693		4,712,792
委託者報酬		79,943,856		81,462,245
その他費用		226,937		221,334
営業費用合計		84,795,486		86,524,145
営業利益又は営業損失（ ）		915,971,462		1,241,095,793
経常利益又は経常損失（ ）		915,971,462		1,241,095,793
中間純利益又は中間純損失（ ）		915,971,462		1,241,095,793
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（ ）		19,552,773		34,316,726
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,418,972,676		2,473,866,799
剰余金増加額又は欠損金減少額		208,502,255		201,904,153
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		208,502,255		201,904,153
剰余金減少額又は欠損金増加額		177,315,776		138,111,998
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		177,315,776		138,111,998
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		2,553,740,466		3,744,438,021

(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. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法による時価法によっております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客先物売買取相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客電信売買取相場の仲値によって計算しております。</p>
4. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 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>
5. 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16期 平成28年7月15日現在	第17期中間計算期間末 平成29年1月15日現在
1．受益権の総数	9,383,307,551口	9,512,805,554口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2636円 (12,636円)	1.3936円 (13,936円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	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	第17期中間計算期間 自 平成28年7月16日 至 平成29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	2,357,001円	2,392,810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16期 平成28年7月15日現在	第17期中間計算期間末 平成29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ぬ。	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ぬ。
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ありませぬ。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありませぬ。</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ありませぬ。</p>	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載してありませぬ。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載してありませぬ。</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ありませぬ。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてありませぬ。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもありませぬ。	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ありませぬ。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもありませぬ。 デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（その他の注記）

項目	第16期	第17期中間計算期間
	自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15日	自 平成28年7月16日 至 平成29年1月15日
期首元本額	8,959,866,867円	9,383,307,551円
期中追加設定元本額	1,288,216,954円	651,823,651円
期中一部解約元本額	864,776,270円	522,325,648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）

通貨関連

種類	第16期 平成28年7月15日現在				第17期中間計算期間末 平成29年1月15日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	33,238,862	-	33,392,746	153,884
アメリカ・ドル	-	-	-	-	33,238,862	-	33,392,746	153,884
合計	-	-	-	-	33,238,862	-	33,392,746	153,884

（注） 時価の算定方法

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

【ハッピーエイジング50】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 平成28年7月15日現在	第17期中間計算期間末 平成29年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	122,898,098	153,660,549
投資信託受益証券	170,731,157	173,901,344
親投資信託受益証券	5,430,659,626	5,735,384,601
未収入金	-	16,699,276
流動資産合計	5,724,288,881	6,079,645,770
資産合計	5,724,288,881	6,079,645,770
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	76,942
未払解約金	1,249,767	7,834,261
未払受託者報酬	1,781,277	1,897,745
未払委託者報酬	31,177,297	33,211,836
未払利息	-	798
その他未払費用	130,582	139,361
流動負債合計	34,338,923	43,160,943
負債合計	34,338,923	43,160,943
純資産の部		
元本等		
元本	4,374,450,230	4,422,116,417
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,315,499,728	1,614,368,410
純資産合計	5,689,949,958	6,036,484,827
負債純資産合計	5,724,288,881	6,079,645,770

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第16期中間計算期間		第17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	自	平成28年7月16日 至 平成29年1月15日
営業収益				
受取配当金		2,129,530		1,853,466
受取利息		6,310		-
有価証券売買等損益		174,653,297		303,868,694
為替差損益		7,408,703		15,116,988
その他収益		5,196		-
営業収益合計		179,920,964		320,839,148
営業費用				
支払利息		-		56,911
受託者報酬		1,802,111		1,897,745
委託者報酬		31,541,825		33,211,836
その他費用		164,948		166,726
営業費用合計		33,508,884		35,333,218
営業利益又は営業損失（ ）		213,429,848		285,505,930
経常利益又は経常損失（ ）		213,429,848		285,505,930
中間純利益又は中間純損失（ ）		213,429,848		285,505,930
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（ ）		4,355,919		9,061,844
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,387,772,636		1,315,499,728
剰余金増加額又は欠損金減少額		111,692,037		122,898,930
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		111,692,037		122,898,930
剰余金減少額又は欠損金増加額		84,178,384		100,474,334
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		84,178,384		100,474,334
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,206,212,360		1,614,368,410

(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. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法による時価法によっております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客先物売買取相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客電信売買取相場の仲値によって計算しております。</p>
4. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 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>
5. 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16期 平成28年7月15日現在	第17期中間計算期間末 平成29年1月15日現在
1．受益権の総数	4,374,450,230口	4,422,116,417口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3007円 (13,007円)	1.3651円 (13,651円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	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	第17期中間計算期間 自 平成28年7月16日 至 平成29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	656,340円	685,387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16期 平成28年7月15日現在	第17期中間計算期間末 平成29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	<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いません。</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>	<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いません。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載してあります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>
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。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（その他の注記）

項目	第16期	第17期中間計算期間
	自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15日	自 平成28年7月16日 至 平成29年1月15日
期首元本額	4,146,666,984円	4,374,450,230円
期中追加設定元本額	730,303,162円	381,479,674円
期中一部解約元本額	502,519,916円	333,813,487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）

通貨関連

種類	第16期 平成28年7月15日現在				第17期中間計算期間末 平成29年1月15日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	16,619,431	-	16,696,373	76,942
アメリカ・ドル	-	-	-	-	16,619,431	-	16,696,373	76,942
合計	-	-	-	-	16,619,431	-	16,696,373	76,942

（注） 時価の算定方法

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

【ハッピーエイジング60】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 平成28年7月15日現在	第17期中間計算期間末 平成29年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	96,457,546	119,683,720
親投資信託受益証券	3,659,877,769	3,777,283,700
流動資産合計	3,756,335,315	3,896,967,420
資産合計	3,756,335,315	3,896,967,420
負債の部		
流動負債		
未払解約金	764,294	10,077,742
未払受託者報酬	958,575	1,022,835
未払委託者報酬	17,063,953	18,208,487
未払利息	-	622
その他未払費用	84,300	91,560
流動負債合計	18,871,122	29,401,246
負債合計	18,871,122	29,401,246
純資産の部		
元本等		
元本	2,910,020,966	3,022,097,828
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	827,443,227	845,468,346
純資産合計	3,737,464,193	3,867,566,174
負債純資産合計	3,756,335,315	3,896,967,420

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第16期中間計算期間		第17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	自	平成28年7月16日 至 平成29年1月15日
営業収益				
受取利息		3,706		-
有価証券売買等損益		11,560,440		7,215,931
その他収益		989		-
営業収益合計		11,565,135		7,215,931
営業費用				
支払利息		-		39,808
受託者報酬		910,022		1,022,835
委託者報酬		16,200,068		18,208,487
その他費用		80,032		92,313
営業費用合計		17,190,122		19,363,443
営業利益又は営業損失()		5,624,987		12,147,512
経常利益又は経常損失()		5,624,987		12,147,512
中間純利益又は中間純損失()		5,624,987		12,147,512
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()		350,453		2,327,990
期首剰余金又は期首欠損金()		637,004,934		827,443,227
剰余金増加額又は欠損金減少額		75,772,454		103,081,974
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		75,772,454		103,081,974
剰余金減少額又は欠損金増加額		52,327,931		75,237,333
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		52,327,931		75,237,333
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金()		654,474,017		845,468,346

(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16期 平成28年7月15日現在	第17期中間計算期間末 平成29年1月15日現在
1. 受益権の総数	2,910,020,966口	3,022,097,828口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2843円 (12,843円)	1.2798円 (12,798円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	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	第17期中間計算期間 自 平成28年7月16日 至 平成29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	208,964円	231,849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16期 平成28年7月15日現在	第17期中間計算期間末 平成29年1月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (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16期 自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15日	第17期中間計算期間 自 平成28年7月16日 至 平成29年1月15日
	期首元本額	2,655,013,590円
期中追加設定元本額	720,837,714円	377,445,746円
期中一部解約元本額	465,830,338円	265,368,884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28年7月15日現在	平成29年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	99,151,629	149,172,036
株式	6,633,642,050	7,368,098,720
未収配当金	3,031,600	1,936,000
流動資産合計	6,735,825,279	7,519,206,756
資産合計	6,735,825,279	7,519,206,756
負債の部		
流動負債		
未払利息	-	776
その他未払費用	-	2,210
流動負債合計	-	2,986
負債合計	-	2,986
純資産の部		
元本等		
元本	5,007,141,390	4,206,697,795
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,728,683,889	3,312,505,975
純資産合計	6,735,825,279	7,519,203,770
負債純資産合計	6,735,825,279	7,519,206,756

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。</p>
2．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28年7月15日現在	平成29年1月15日現在
1．受益権の総数	5,007,141,390口	4,206,697,795口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3452円 (13,452円)	1.7874円 (17,874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28年7月15日現在	平成29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27年7月16日 至 平成28年7月15日	自 平成28年7月16日 至 平成29年1月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,004,083,371円	5,007,141,390円
同期中追加設定元本額	2,088,454,452円	91,815,455円
同期中一部解約元本額	1,085,396,433円	892,259,050円
元本の内訳*		
ファンド名		
ハッピーエイジング20	1,474,520,894円	1,301,670,729円
ハッピーエイジング30	1,572,053,587円	1,352,198,813円
ハッピーエイジング40	1,459,718,958円	1,166,656,355円
ハッピーエイジング50	412,622,455円	320,351,385円
ハッピーエイジング60	88,225,496円	64,422,507円
SOMPOターゲットイヤー・ ファンド2035	- 円	397,308円
SOMPOターゲットイヤー・ ファンド2045	- 円	422,630円
SOMPOターゲットイヤー・ ファンド2055	- 円	544,508円
SOMPO日本株バリュー・プ ラスファンド	- 円	33,560円
計	5,007,141,390円	4,206,697,795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28年7月15日現在	平成29年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	37,484,709	65,899,280
株式	6,403,326,400	7,387,741,700
未収配当金	2,046,000	3,749,000
流動資産合計	6,442,857,109	7,457,389,980
資産合計	6,442,857,109	7,457,389,980
負債の部		
流動負債		
未払利息	-	342
その他未払費用	-	975
流動負債合計	-	1,317
負債合計	-	1,317
純資産の部		
元本等		
元本	3,745,215,480	3,359,390,629
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,697,641,629	4,097,998,034
純資産合計	6,442,857,109	7,457,388,663
負債純資産合計	6,442,857,109	7,457,389,980

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。</p>
2．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28年7月15日現在	平成29年1月15日現在
1．受益権の総数	3,745,215,480口	3,359,390,629口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7203円 (17,203円)	2.2199円 (22,199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	平成28年7月15日現在	平成29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27年7月16日 至 平成28年7月15日	自 平成28年7月16日 至 平成29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	3,640,587,064円	3,745,215,480円
同期中追加設定元本額	719,184,864円	33,562,416円
同期中一部解約元本額	614,556,448円	419,387,267円
元本の内訳*		
ファンド名		
ハッピーエイジング20	1,096,169,329円	1,047,667,522円
ハッピーエイジング30	1,168,932,480円	1,076,116,365円
ハッピーエイジング40	1,085,418,169円	924,838,404円
ハッピーエイジング50	325,824,455円	257,816,262円
ハッピーエイジング60	68,871,047円	51,830,328円
SOMPOターゲットイヤー・ ファンド2035	- 円	320,526円
SOMPOターゲットイヤー・ ファンド2045	- 円	340,968円
SOMPOターゲットイヤー・ ファンド2055	- 円	434,435円
SOMPO日本株バリュー・プ ラスファンド	- 円	25,819円
計	3,745,215,480円	3,359,390,629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28年7月15日現在	平成29年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	414,810,954	380,223,308
国債証券	8,766,158,460	9,429,577,500
特殊債券	1,458,499,961	934,186,236
社債券	2,865,333,700	4,039,210,100
未収入金	101,772,000	-
未収利息	15,079,701	20,582,694
前払費用	1,107,107	5,020,194
流動資産合計	13,622,761,883	14,808,800,032
資産合計	13,622,761,883	14,808,800,032
負債の部		
流動負債		
未払金	100,000,000	251,560,000
未払利息	-	1,978
その他未払費用	-	3,150
流動負債合計	100,000,000	251,565,128
負債合計	100,000,000	251,565,128
純資産の部		
元本等		
元本	9,392,300,054	10,382,551,044
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,130,461,829	4,174,683,860
純資産合計	13,522,761,883	14,557,234,904
負債純資産合計	13,622,761,883	14,808,800,032

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<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28年7月15日現在	平成29年1月15日現在
1．受益権の総数	9,392,300,054口	10,382,551,044口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4398円 (14,398円)	1.4021円 (14,021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28年7月15日現在	平成29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あります。 (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27年7月16日 至 平成28年7月15日	自 平成28年7月16日 至 平成29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	11,437,411,824円	9,392,300,054円
同期中追加設定元本額	1,912,316,775円	1,252,754,970円
同期中一部解約元本額	3,957,428,545円	262,503,980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	1,070,483,754円	1,094,019,387円
ハッピーエイジング20	98,830,995円	128,046,829円
ハッピーエイジング30	501,729,548円	621,787,265円
ハッピーエイジング40	2,645,343,783円	3,128,465,507円
ハッピーエイジング50	2,230,565,421円	2,465,780,371円
ハッピーエイジング60	2,107,055,206円	2,259,269,384円

パン・アフリカ株式ファンド	14,243,358円	16,667,088円
人民元建て債券ファンド	2,369,564円	1,737,564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	6,565,475円	5,228,274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	49,679,602円	43,788,497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	631,066,826円	580,373,421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	33,589円	- 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	27,358円	- 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	995,184円	909,967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	25,983,714円	25,714,879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	463,945円	683,337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	396,444円	332,364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	2,012,342円	1,758,822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	1,596,463円	1,517,360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	1,336,859円	1,181,959円
インド株式集中投資ファンド	1,520,624円	3,014,942円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	- 円	1,263,708円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	- 円	805,271円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	- 円	204,848円
計	9,392,300,054円	10,382,551,044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28年7月15日現在	平成29年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	51,214,457	57,338,449
コール・ローン	72,868,395	311,676,927
国債証券	5,030,256,719	5,450,034,453
特殊債券	-	29,691,823
未収利息	30,875,787	25,502,909
前払費用	8,356,715	4,297,936
流動資産合計	5,193,572,073	5,878,542,497
資産合計	5,193,572,073	5,878,542,497
負債の部		
流動負債		
未払利息	-	1,622
その他未払費用	-	4,630
流動負債合計	-	6,252
負債合計	-	6,252
純資産の部		
元本等		
元本	3,577,031,312	3,978,755,650
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,616,540,761	1,899,780,595
純資産合計	5,193,572,073	5,878,536,245
負債純資産合計	5,193,572,073	5,878,542,497

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>国債証券及び特殊債券</p> <p>個別法に基づき、以下のとおり、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>ただし、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 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28年7月15日現在	平成29年1月15日現在
1. 受益権の総数	3,577,031,312口	3,978,755,650口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4519円 (14,519円)	1.4775円 (14,775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28年7月15日現在	平成29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27年7月16日 至 平成28年7月15日	自 平成28年7月16日 至 平成29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	3,630,703,658円	3,577,031,312円
同期中追加設定元本額	887,054,791円	447,973,894円
同期中一部解約元本額	940,727,137円	46,249,556円
元本の内訳*		
ファンド名		
ハッピーエイジング20	293,095,514円	358,858,807円
ハッピーエイジング30	1,232,102,599円	1,452,103,082円
ハッピーエイジング40	1,217,848,848円	1,328,263,193円
ハッピーエイジング50	437,068,927円	443,181,183円
ハッピーエイジング60	159,600,202円	153,832,190円
損保ジャパン外国債券ファンド （為替ヘッジなし）	237,315,222円	242,160,706円
SOMPOターゲットイヤー・ ファンド2035	- 円	142,583円
SOMPOターゲットイヤー・ ファンド2045	- 円	106,953円
SOMPOターゲットイヤー・ ファンド2055	- 円	106,953円
計	3,577,031,312円	3,978,755,650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28年7月15日現在	平成29年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	619,718,394	187,055,466
コール・ローン	51,248,784	96,884,477
株式	8,389,097,342	9,582,014,640
投資証券	396,286,101	550,989,184
派生商品評価勘定	261,500	-
未収入金	1,650,676	12,303,026
未収配当金	10,495,600	11,761,197
流動資産合計	9,468,758,397	10,441,007,990
資産合計	9,468,758,397	10,441,007,990
負債の部		
流動負債		
未払金	29,347,286	14,420,368
未払利息	-	504
その他未払費用	-	2,200
流動負債合計	29,347,286	14,423,072
負債合計	29,347,286	14,423,072
純資産の部		
元本等		
元本	6,523,191,242	6,302,080,612
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,916,219,869	4,124,504,306
純資産合計	9,439,411,111	10,426,584,918
負債純資産合計	9,468,758,397	10,441,007,990

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年7月15日現在	平成29年1月15日現在
1. 受益権の総数	6,523,191,242口	6,302,080,612口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4471円 (14,471円)	1.6545円 (16,545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28年7月15日現在	平成29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 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (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。	(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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（その他の注記）

項目	自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15日	自 平成28年7月16日 至 平成29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	5,967,202,524円	6,523,191,242円
同期中追加設定元本額	1,317,232,329円	420,860,247円
同期中一部解約元本額	761,243,611円	641,970,877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）	825,091,642円	730,633,999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）	989,144,857円	955,475,738円
ハッピーエイジング20	1,734,644,498円	1,753,509,970円
ハッピーエイジング30	1,390,835,592円	1,368,381,378円
ハッピーエイジング40	1,150,752,674円	1,112,664,373円
ハッピーエイジング50	324,051,982円	289,348,187円
ハッピーエイジング60	108,669,997円	92,066,967円
計	6,523,191,242円	6,302,080,612円

*当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成28年7月15日 現在				平成29年1月15日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	53,071,500	-	52,810,000	261,500	-	-	-	-
アメリカ・ドル	53,071,500	-	52,810,000	261,500	-	-	-	-
合計	53,071,500	-	52,810,000	261,500	-	-	-	-

（注） 時価の算定方法

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

計算期間末日において予約為替の受渡日（以下、「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該仲値で評価しております。

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

- （イ） 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
 - （ロ） 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。
2. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。
 3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

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29年1月31日現在

資産総額	8,757,002,993円
負債総額	15,431,678円
純資産総額（ - ）	8,741,571,315円
発行済数量	6,600,967,651口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.3243円

ハッピーエイジング30

平成29年1月31日現在

資産総額	10,846,724,707円
負債総額	26,538,717円
純資産総額（ - ）	10,820,185,990円
発行済数量	7,908,248,834口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.3682円

ハッピーエイジング40

平成29年1月31日現在

資産総額	13,275,887,576円
負債総額	29,252,145円
純資産総額（ - ）	13,246,635,431円
発行済数量	9,571,079,859口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.3840円

ハッピーエイジング50

平成29年1月31日現在

資産総額	6,031,966,471円
負債総額	3,742,511円
純資産総額（ - ）	6,028,223,960円
発行済数量	4,442,845,654口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.3568円

ハッピーエイジング60

平成29年1月31日現在

資産総額	3,859,428,584円
負債総額	4,343,610円
純資産総額（ - ）	3,855,084,974円
発行済数量	3,027,821,742口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.2732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29年1月31日現在

資産総額	7,432,350,110円
負債総額	17,841,664円
純資産総額 (-)	7,414,508,446円
発行済数量	4,152,881,618口
1単位当りの純資産額 (/)	1.7854円

S J A M スモールキャップ・マザーファンド

平成29年1月31日現在

資産総額	7,469,735,091円
負債総額	81,463,729円
純資産総額 (-)	7,388,271,362円
発行済数量	3,382,698,324口
1単位当りの純資産額 (/)	2.1841円

損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成29年1月31日現在

資産総額	14,555,352,120円
負債総額	1,890円
純資産総額 (-)	14,555,350,230円
発行済数量	10,422,642,582口
1単位当りの純資産額 (/)	1.3965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29年1月31日現在

資産総額	6,118,267,225円
負債総額	162,635,089円
純資産総額 (-)	5,955,632,136円
発行済数量	4,082,024,116口
1単位当りの純資産額 (/)	1.4590円

損保ジャパン - T C W 外国株式マザーファンド

平成29年1月31日現在

資産総額	10,449,750,940円
負債総額	40,222,883円
純資産総額 (-)	10,409,528,057円
発行済数量	6,323,064,007口
1単位当りの純資産額 (/)	1.6463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28年7月末現在）

（略）

(2) 会社の機構（平成28年7月末現在）

（略）

<訂正後>

(1) 資本金の額（平成29年1月末現在）

（略）

(2) 会社の機構（平成29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28年7月末現在、計133本（追加型株式投資信託109本、単位型株式投資信託19本、単位型公社債投資信託5本）であり、その純資産総額の合計は692,909百万円です。

<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29年1月末現在、計146本（追加型株式投資信託120本、単位型株式投資信託18本、単位型公社債投資信託8本）であり、その純資産総額の合計は692,838百万円です。

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27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、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32期中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30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。

(1) 【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成28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	3,896,094	4,375,837	
2		前払費用	94,024	81,218	
3		未収委託者報酬	814,705	754,788	
4		未収運用受託報酬	319,881	521,498	
5		未収収益	107	149	
6		繰延税金資産	85,853	137,932	
7		その他	84	421	
		流動資産合計	5,210,750	5,871,846	
固定資産					
1 有形固定資産					
	* 1	(1) 建物	45,249	37,899	
	* 1	(2) 器具備品	12,797	13,712	
		有形固定資産合計	58,046	51,612	
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	135,587	128,043	
		(2) 関係会社株式	122	-	
		(3) 長期差入保証金	161,636	161,598	
		(4) 繰延税金資産	132,485	133,008	
		(5) その他	29	29	
		投資その他の資産合計	429,859	422,678	
		固定資産合計	492,441	478,826	
		資産合計	5,703,191	6,350,672	

区分	注記 番号	前事業年度 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
(負債の部)					
流動負債					
1 預り金			126,101		3,485
2 未払金					
(1) 未払配当金	* 2		-	500,000	
(2) 未払手数料		391,115		333,031	
(3) その他未払金		107,030	498,145	107,732	940,764
3 未払費用			387,091		429,958
4 未払消費税等			211,457		71,725
5 未払法人税等			583,342		346,936
6 前受収益			47,207		26,746
7 賞与引当金			54,235		58,159
8 役員賞与引当金			11,400		9,600
流動負債合計			1,918,981		1,887,376
固定負債					
1 退職給付引当金			64,308		75,674
2 資産除去債務			7,760		7,898
固定負債合計			72,068		83,572
負債合計			1,991,050		1,970,949
(純資産の部)					
株主資本					
1 資本金			1,550,000		1,550,000
2 資本剰余金					
(1) 資本準備金			413,280		413,280
資本剰余金合計			413,280		413,280
3 利益剰余金					
(1) その他利益剰余金					
繰越利益剰余金			1,750,324		2,424,248
利益剰余金合計			1,750,324		2,424,248
株主資本合計			3,713,604		4,387,528
評価・換算差額等					
1 その他有価証券評価差額金			1,462		7,804
評価・換算差額等合計			1,462		7,804
純資産合計			3,712,141		4,379,723
負債・純資産合計			5,703,191		6,350,672

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1 委託者報酬		6,931,318		7,038,975	
2 運用受託報酬		2,410,937	9,342,256	2,535,301	9,574,276
営業費用					
1 支払手数料		3,520,626		3,508,448	
2 広告宣伝費		23,637		16,724	
3 公告費		4,180		610	
4 調査費		1,890,482		2,046,339	
(1) 調査費		594,023		622,284	
(2) 委託調査費		1,292,599		1,420,590	
(3) 図書費		3,859		3,465	
5 営業雑経費		191,429		182,596	
(1) 通信費		21,613		17,360	
(2) 印刷費		158,297		151,371	
(3) 諸会費		11,518	5,630,355	13,864	5,754,719
一般管理費					
1 給料		1,260,113		1,299,501	
(1) 役員報酬		109,183		83,689	
(2) 給料・手当		1,045,995		1,107,914	
(3) 賞与		104,933		107,897	
2 福利厚生費		102,817		109,923	
3 交際費		10,360		11,516	
4 寄付金		200		300	
5 旅費交通費		37,768		38,774	
6 法人事業税		18,444		29,306	
7 租税公課		8,301		7,391	
8 不動産賃借料		227,534		214,575	
9 退職給付費用		34,819		47,701	
10 賞与引当金繰入		54,235		58,159	

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
11 役員賞与引当金繰入		11,400		9,600	
12 固定資産減価償却費		14,237		13,042	
13 諸経費		183,804	1,964,036	205,813	2,045,605
営業利益			1,747,864		1,773,952
営業外収益					
1 受取配当金		2,211		90	
2 受取利息		464		657	
3 有価証券売却益		1,139		19	
4 有価証券償還益		18,285		-	
5 為替差益		2,259		-	
6 雑益		3,746	28,107	6,407	7,173
営業外費用					
1 為替差損		-		100	
2 雑損		221	221	0	100
経常利益			1,775,751		1,781,026
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	31	31	663	663
税引前当期純利益			1,900,593		1,780,362
法人税、住民税及び事業税			702,469		659,040
法人税等調整額			43,579		52,602
当期純利益			1,241,702		1,173,924

（ 3 ） 【 株主資本等変動計算書 】

前事業年度（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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31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
当期変動額						
剰余金の配当				500,000	500,000	500,000
当期純利益				1,173,924	1,173,924	1,173,924
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	673,924	673,924	673,924
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	2,424,248	2,424,248	4,387,528

	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
当期変動額			
剰余金の配当			500,000
当期純利益			1,173,924
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	6,342	6,342	6,342
当期変動額合計	6,342	6,342	667,582
当期末残高	7,804	7,804	4,379,723

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。

（未適用の会計基準等）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

(1) 概要

繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いについて、監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」の枠組み、すなわち企業を5つに分類し、当該分類に応じて繰延税金資産の計上額を見積る枠組みを基本的に踏襲した上で、以下の取扱いについて必要な見直しが行われております。

（分類1）から（分類5）に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い

（分類2）及び（分類3）に係る分類の要件

（分類2）に該当する企業におけるスケジューリング不能な将来減算一時差異に関する取扱い

(分類3)に該当する企業における将来の一時差異等加減算前課税所得の合理的な見積可能期間に関する取扱い

(分類4)に係る分類の要件を満たす企業が(分類2)又は(分類3)に該当する場合の取扱い

(2) 適用予定日

平成29年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当事業年度の財務諸表の作成時において評価中であります。

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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
建物	64,817千円	72,167千円
器具備品	46,725	44,838

* 2 . 関係会社項目

関係会社に対する負債は、次のとおりであります。

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
未払金		
未払配当金	- 千円	500,000千円

（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26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
米国の100%子会社であつた TACT ASSET MANAGEMENT INC.の清算結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26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
器具備品	31千円	663千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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。

当事業年度（自 平成27年 4月 1日 至 平成28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28年3月29日 取締役会	普通株式	500,000千円	20,759円	平成27年3月31日	平成28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。

(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	-

当事業年度（平成28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	4,375,837	4,375,837	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	112,293	112,293	-
資産計	4,488,131	4,488,131	-
(1) 未払法人税等	346,936	346,936	-
負債計	346,936	346,936	-

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27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
非上場株式	15,750	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。

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	-	1,316	118,520	-
合計	3,896,001	1,316	118,520	-

当事業年度（平成28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	4,375,515	-	-	-
(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	-	96	112,197	-
合計	4,375,515	96	112,197	-

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（前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式 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。

4．その他有価証券で時価のあるもの
前事業年度（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

当事業年度（平成28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	-	-	-
	小 計	-	-	-
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	112,293	120,098	7,804
	小 計	112,293	120,098	7,804
合計		112,293	120,098	7,804

5．売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	1,419	22	2
合計	1,419	22	2

（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。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要（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	64,308	千円
退職給付費用	17,374	
退職給付の支払額	6,008	
<u>退職給付引当金の期末残高</u>	<u>75,674</u>	

(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	75,674	千円
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>75,674</u>	
退職給付引当金	75,674	
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>75,674</u>	

(3) 退職給付に係る負債

簡便法で計算した退職給付費用	17,374	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、10,921千円でありました。

（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27年3月31日)	当事業年度 (平成28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	112,543千円	110,523千円
未払費用否認	25,132	88,021
退職給付引当金	20,839	23,200
未払事業税	41,100	22,641
賞与引当金	17,930	17,947
繰延資産損金算入限度超過額	-	7,634
その他	4,758	6,579
繰延税金資産小計	222,305	276,547
評価性引当額	3,071	4,900
繰延税金資産合計	219,234	271,647
繰延税金負債		
固定資産除去価額	896	707
繰延税金負債合計	896	707
繰延税金資産の純額	218,338	270,940

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

3．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引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33.1%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.9%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、30.6%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19,903千円減少し、法人税等調整額が同額増加しております。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

本社事務所の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から15年と見積り、割引率は1.7%～1.8%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3．当該資産除去債務の総額の増減

	前事業年度		当事業年度	
	（自	平成26年4月1日	（自	平成27年4月1日
	至	平成27年3月31日）	至	平成28年3月31日）
期首残高		7,625千円		7,760千円
時の経過による調整額		135		137
期末残高		7,760		7,898

（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。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

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。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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	189,203	未収運用受託報酬	101,258
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	407,134	未払手数料	86,317

注1．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2．取引条件ないし取引条件の決定方針等

（注1） 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

（注2） 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

損保ジャパン日本興亜ホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

関連会社はありません。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	154,126.69円	181,844.45円
1株当たり当期純利益金額	51,555.01円	48,740.88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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益(千円)	1,241,702	1,173,924
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)	1,241,702	1,173,924
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32期中間会計期間 (平成28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		3,658,005
2 前払費用		86,048
3 未収委託者報酬		816,739
4 未収運用受託報酬		721,313
5 未収収益		51
6 繰延税金資産		106,686
7 その他		294
流動資産合計		5,389,138
固定資産		
1 有形固定資産	1	46,485
2 無形固定資産		4,535
3 投資その他の資産		
(1) 投資有価証券		128,261
(2) 長期差入保証金		161,598
(3) 繰延税金資産		149,783
(4) その他		29
投資その他の資産合計		439,671
固定資産合計		490,692
資産合計		5,879,830

		第32期中間会計期間 (平成28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		3,833
2 未払金		
(1) 未払手数料		335,100
(2) その他未払金		129,088
未払金合計		464,188
3 未払費用		461,852
4 未払法人税等		121,542
5 前受収益		16,515
6 賞与引当金		62,781
7 役員賞与引当金		2,250
8 その他	2	21,212
流動負債合計		1,154,177
固定負債		
1 退職給付引当金		84,149
2 資産除去債務		7,969
固定負債合計		92,118
負債合計		1,246,295

		第32期中間会計期間 (平成28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		2,678,051
利益剰余金合計		2,678,051
株主資本合計		
		4,641,331
評価・換算差額等		
1 その他有価証券評価差額金		7,796
評価・換算差額等合計		7,796
純資産合計		4,633,535
負債・純資産合計		5,879,830

(2) 中間損益計算書

		第32期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28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		2,780,443	
2 運用受託報酬		1,244,524	4,024,967
営業費用			
1 支払手数料		1,365,286	
2 広告宣伝費		3,355	
3 公告費		2,970	
4 調査費		1,112,304	
(1) 調査費		381,749	
(2) 委託調査費		728,394	
(3) 図書費		2,160	
5 営業雑経費		98,321	
(1) 通信費		8,419	
(2) 印刷費		78,890	
(3) 諸会費		11,010	2,582,237
一般管理費			
1 給料		644,821	
(1) 役員報酬		39,778	
(2) 給料・手当		561,070	
(3) 賞与		43,973	
2 福利厚生費		65,595	
3 交際費		3,410	
4 旅費交通費		13,346	
5 法人事業税		17,277	
6 租税公課		3,604	
7 不動産賃借料		106,223	
8 退職給付費用		25,071	
9 賞与引当金繰入		62,781	
10 役員賞与引当金繰入		2,250	
11 固定資産減価償却費	1	5,126	
12 諸経費		114,298	1,063,807
営業利益			378,922

		第32期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28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		150	
3 雑益		474	715
営業外費用			
1 為替差損		4,057	
2 雑損		7	4,065
経常利益			375,572
税引前中間純利益			375,572
法人税、住民税及び事業税			107,298
法人税等調整額			14,471
中間純利益			253,802

(3) 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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	2,424,248	2,424,248	4,387,528
当中間期変動額						
中間純利益				253,802	253,802	253,802
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	-	-	-	253,802	253,802	253,802
当中間期末残高	1,550,000	413,280	413,280	2,678,051	2,678,051	4,641,331

	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	7,804	7,804	4,379,723
当中間期変動額			
中間純利益			253,802
株主資本以外の項目の当 中間期変動額（純額）	8	8	8
当中間期変動額合計	8	8	253,811
当中間期末残高	7,796	7,796	4,633,535

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。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しています。

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。

（会計方針の変更）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

これによる中間財務諸表に与える影響はありません。

（追加情報）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当中間会計期間から適用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

		第32期中間会計期間 (平成28年9月30日)
1	有形固定資産の減価償却累計額	121,305千円
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」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

		第32期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
1	減価償却実施額 有形固定資産	5,126千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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32期中間会計期間（平成28年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成28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	3,658,005	3,658,005	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	112,511	112,511	-
資産計	3,770,517	3,770,517	-

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

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。

（有価証券関係）

第32期中間会計期間（平成28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	112,511	120,308	7,796
	小 計	112,511	120,308	7,796
合計		112,511	120,308	7,796

（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32期中間会計期間（平成28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	7,898千円
時の経過による調整額	70
中間期末残高	7,969

（セグメント情報等）

セグメント情報

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28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32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28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中間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32期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）
1株当たり純資産額	192,382.60円
1株当たり中間純利益金額	10,537.80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32期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）
中間純利益（千円）	253,802
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）	253,802
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28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28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28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。
SMB C日興証券株式会社	10,000	
株式会社SBI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DC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28年12月末現在）

（2,912千円、1ドル=116.49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。

第3【その他】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

- 1．目論見書の表紙等に、ロゴマーク、キャッチコピー、図案、イラスト、写真、当ファンドの概略的性格を表示する文言、第三者機関から取得したユニバーサルデザインに関する認証マーク等を記載することがあります。
- 2．金融商品取引法第13条第2項第1号に定める事項に関する内容を記載した目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」という名称を使用することがあります。また、金融商品取引法第13条第2項第2号に定める事項に関する内容を記載した目論見書の別称として「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用することがあります。
- 3．投資信託説明書（請求目論見書）の表紙あるいは裏表紙に、金融商品取引法に基づき、投資家の請求により交付される目論見書である旨を記載することがあります。
- 4．投資信託説明書（請求目論見書）の表紙に課税上の取扱いに関する記載をすることがあります。
- 5．目論見書に記載する運用状況に関する情報等は、適宜更新することがあります。
- 6．目論見書の表紙等に「金融商品取引業者登録番号」、「使用開始日」等を記載することがあります。
- 7．投資信託説明書（請求目論見書）の巻末に信託約款を掲載することがあります。
- 8．目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
- 9．投資評価機関、投資評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- 10．目論見書の表紙等に以下の内容を記載することがあります。
 - ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されています。
- 11．目論見書の巻頭に、以下を記載することがあります。

ご投資家のみなさまへ

ファンドは、長期的な視点から国内外の株式・債券の最適な組み合わせを決定し、分散投資に基づく安定運用により、みなさまの資産形成を応援するファンドです。

投資目的、投資期間、リスク許容度等、投資家のみなさまのニーズに合わせ、株式・債券への資産配分比率が異なる5つのファンドをご用意しています。

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント

独立監査人の中間監査報告書

平成29年3月21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 伊藤 志保 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28年7月16日から平成29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29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28年7月16日から平成29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29年3月21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 伊藤 志保 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28年7月16日から平成29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29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28年7月16日から平成29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29年3月21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 伊藤志保 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28年7月16日から平成29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29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28年7月16日から平成29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29年3月21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 伊藤 志保 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28年7月16日から平成29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29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28年7月16日から平成29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29年3月21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 伊藤 志保 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28年7月16日から平成29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29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28年7月16日から平成29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28年6月3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 小澤 裕 治 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28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(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28年11月22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 伊藤 志保 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28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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28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28年4月1日から平成28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。