

【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30年4月13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29年10月13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>

<訂正前>

（略）

● ファンドの特色



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

投資対象資産	投資対象とするマザーファンド ^{※1} 等
国内株式	SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド SJAMスモールキャップ・マザーファンド
国内債券	損保ジャパン日本債券マザーファンド
外国債券	損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド
外国株式	損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド ^{※2}
エマージング株式	エマージング株式または エマージング株式を主要投資対象とする証券投資信託 ^{※3}

※1 マザーファンドについては、後掲「ファンドの仕組み」をご参照下さい。

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

※3 当ファンドは2017年7月末現在、パッシブ運用を行う

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

TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY〔略称:TCW〕について

1971年設立。ロサンゼルスを拠点とするTCWグループ傘下の運用会社です。

2017年6月末現在の同グループの運用資産は、約1,969億米ドル(約22兆528億円[※])です。

※2017年6月末時点の為替レートで換算。



長期的な視点から基準資産配分比率を決定し、当該比率をめ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。

(略)

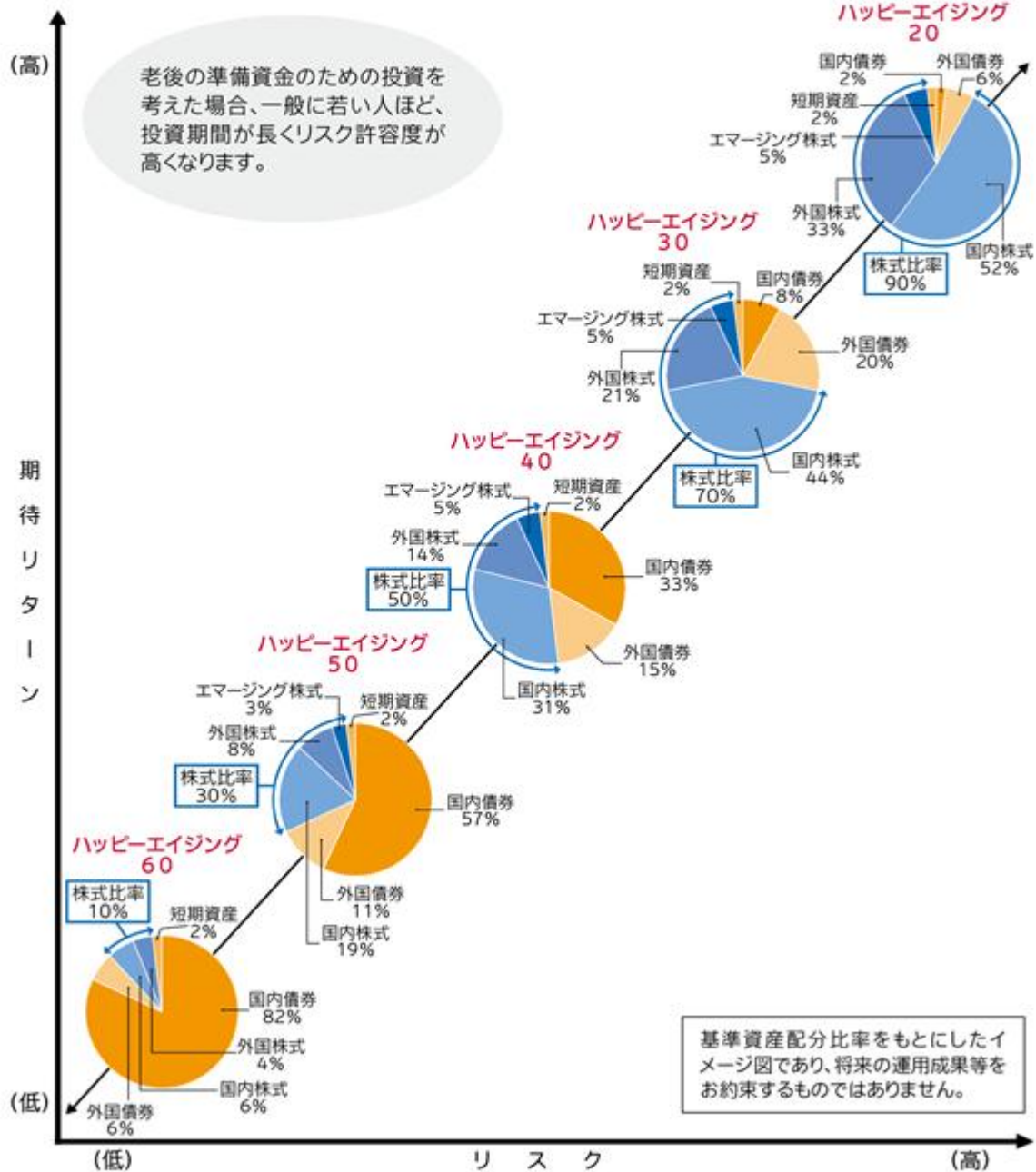
4

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。

<訂正後>
(略)

● ファンドの特色

1

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・バリュース・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2018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。

2017年12月末現在の同グループの運用資産は、約2,045億米ドル(約23兆1,085億円*)です。

※2017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に市場環境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。

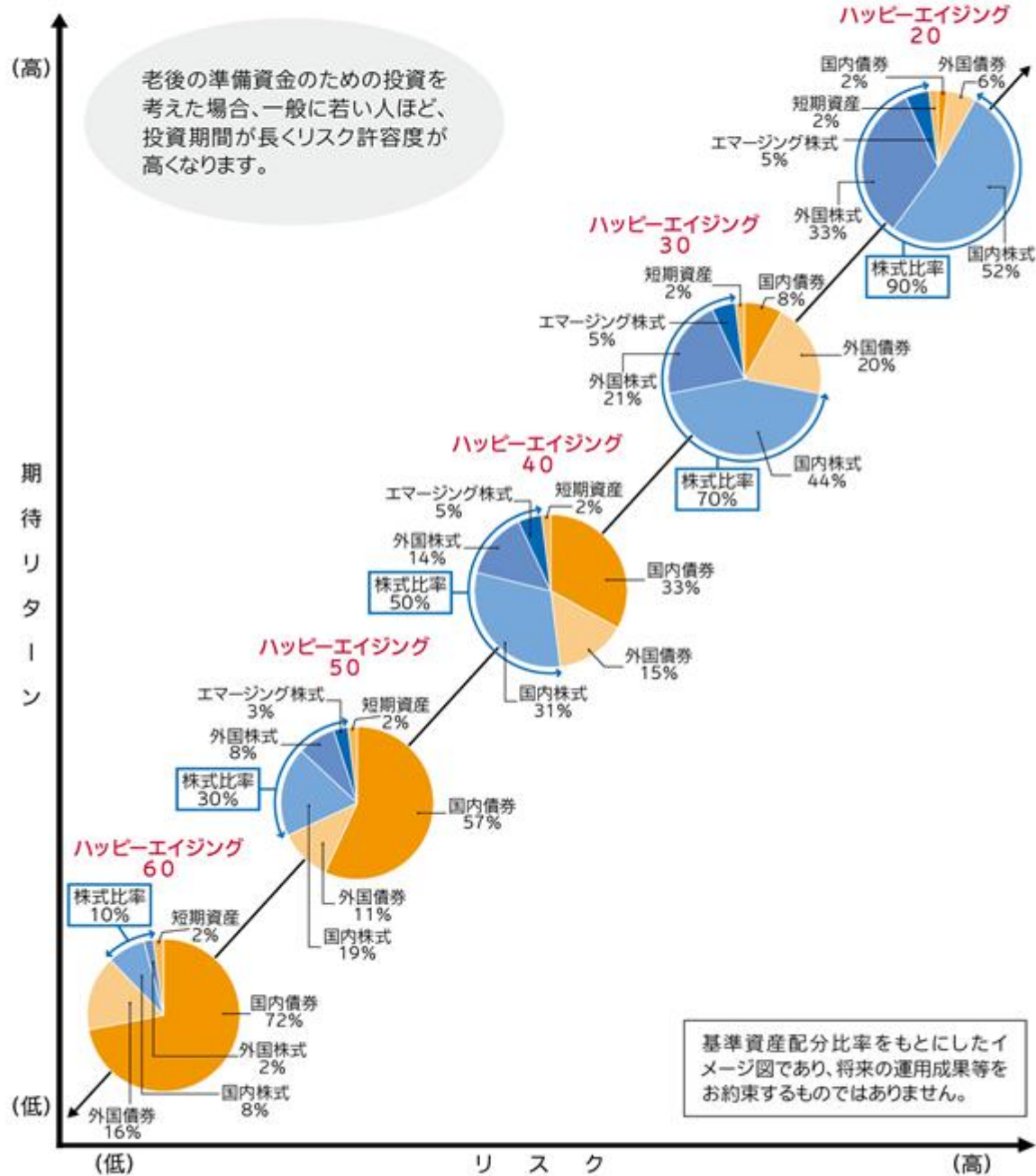
(略)

4

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

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

<基準資産配分比率>



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

5

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

資産	ベンチマーク
国内株式	東証株価指数(TOPIX)
国内債券	NOMURA-BPI総合指数
外国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・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。

※FTSE 世界国債インデックスとは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income

LLC が有しています。

※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29年7月末現在）

（ 略 ）

（ ）大株主の状況（平成29年7月末現在）

（ 略 ）

< 訂正後 >

（ 略 ）

委託会社等の概況

（ ）資本金の額 1,550百万円（平成30年1月末現在）

（ 略 ）

（ ）大株主の状況（平成30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29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29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30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30年1月末現在のものであり、今後変更されることもあります。）

（ 5 ）【投資制限】

< 訂正前 >

（ 略 ）

資金の借入れ

（ 略 ）

（ ） 一部解約に伴う支払資金の手当にかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

（ 略 ）

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

（略）

(2) 投資態度

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

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

（略）

<訂正後>

（略）

資金の借入れ

（略）

() 一部解約に伴う支払資金の手当にかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

（略）

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

（略）

(2) 投資態度

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

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

（略）

3【投資リスク】

<訂正前>

（略）

<リスクの管理体制>

a．委託会社のリスク管理体制

（略）

（注）上図は、平成29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

2012年8月～2017年7月

ハッピーエイジング20



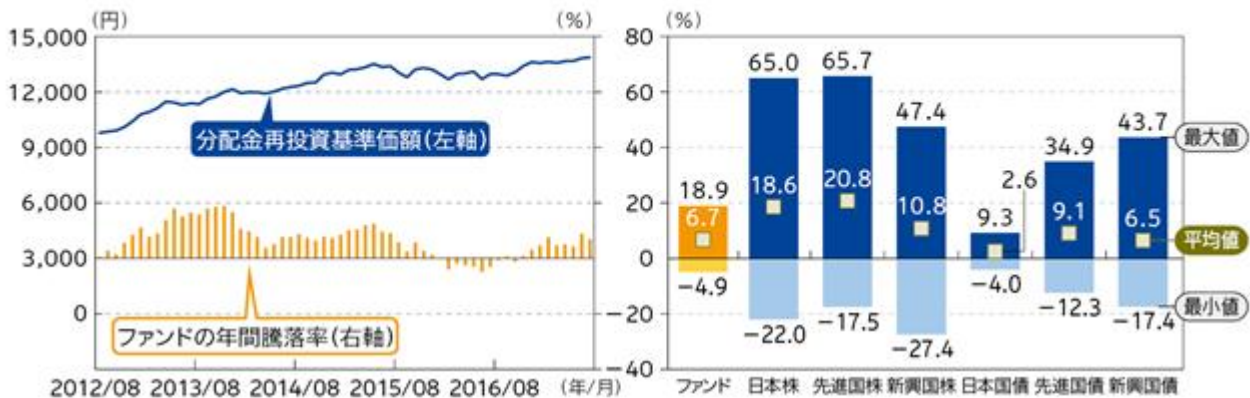
ハッピーエイジング30



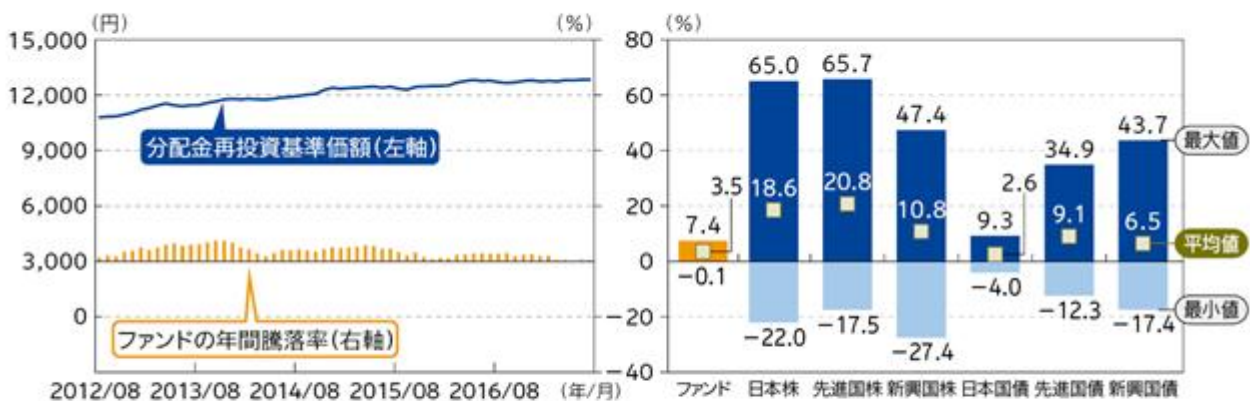
ハッピーエイジング40



ハッピーエイジング50



ハッピーエイジング60



- 上記は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額および年間騰落率が記載されており、実際の基準価額および基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- 上記は、期間5年のグラフになります。

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

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-EEM 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。

< 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30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

2013年2月～2018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

2013年2月～2018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	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
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】

(3)【信託報酬等】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

委託会社及び受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.9288%（税抜0.860%）～1.5876%（税抜1.470%）を乗じて得た金額とし、委託会社と受託会社との間の配分は以下のとおりです。（下記のとおり、委託会社は販売会社への配分を一旦収受します。）

・運用管理費用（信託報酬）＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

ファンド名	信託報酬率 （年率）	内訳（税抜 年率）		
		委託会社	販売会社	受託会社
ハッピー エイジング 20	1.5876% (税抜1.470%)	0.590%	0.830%	0.050%
ハッピー エイジング 30	1.4580% (税抜1.350%)	0.530%	0.770%	0.050%
ハッピー エイジング 40	1.2960% (税抜1.200%)	0.470%	0.680%	0.050%
ハッピー エイジング 50	1.1124% (税抜1.030%)	0.410%	0.570%	0.050%
ハッピー エイジング 60	0.9288% (税抜0.860%)	0.350%	0.460%	0.050%

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

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

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

委託会社の報酬には、損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託したTCWへの投資顧問報酬が含まれます。投資顧問報酬の額は、各ファンドの純資産総額に当該計算期間を通じて毎日、年0.082%以内の率を乗じて得た金額とします。〔ファンドの運用の対価〕

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料に対する消費税等相当額及び先物取引・オプション取引等及びコール取引等に要する費

用及び外国における資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担します。信託財産の証券取引等に伴う手数料や税金は信託財産が負担しますが、売買委託手数料や有価証券取引税等証券取引に伴う手数料や税金は国や市場によって異なります。また、売買金額によっても異なります。

売買委託手数料	有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
保管費用	有価証券等の保管等のために、海外の銀行等に支払う費用

(5) 【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

上記は平成29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30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30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	500,840,938	4.70
内 アメリカ	500,840,938	4.70
親投資信託受益証券	9,881,573,829	92.82
内 日本	9,881,573,829	92.82
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	264,003,969	2.48
純資産総額	10,646,418,736	100.00

ハッピーエイジング30

平成30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	615,691,860	4.77
内 アメリカ	615,691,860	4.77
親投資信託受益証券	11,984,162,303	92.92
内 日本	11,984,162,303	92.92
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	297,661,237	2.31
純資産総額	12,897,515,400	100.00

ハッピーエイジング40

平成30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	711,874,278	4.69
内 アメリカ	711,874,278	4.69
親投資信託受益証券	14,087,750,928	92.86
内 日本	14,087,750,928	92.86
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	371,437,494	2.45
純資産総額	15,171,062,700	100.00

ハッピーエイジング50

平成30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	186,723,558	2.79
内 アメリカ	186,723,558	2.79
親投資信託受益証券	6,356,182,100	95.00
内 日本	6,356,182,100	95.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	147,773,399	2.21
純資産総額	6,690,679,057	100.00

ハッピーエイジング60

平成30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	3,946,114,411	98.01
内 日本	3,946,114,411	98.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	80,109,993	1.99
純資産総額	4,026,224,404	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30年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	40,526,772,030	99.38
内 日本	40,526,772,030	99.38
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	254,860,349	0.62
純資産総額	40,781,632,379	100.00

S J A M スモールキャップ・マザーファンド

平成30年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	8,624,626,000	99.32
内 日本	8,624,626,000	99.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	59,029,435	0.68
純資産総額	8,683,655,435	100.00

損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成30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	9,842,480,100	61.46
内 日本	9,742,176,400	60.83
内 メキシコ	100,303,700	0.63
特殊債券	883,203,406	5.51
内 日本	883,203,406	5.51
社債券	5,063,090,200	31.61
内 日本	4,134,516,100	25.82
内 フランス	726,756,900	4.54
内 イギリス	201,817,200	1.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	226,733,877	1.42
純資産総額	16,015,507,583	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30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	6,548,600,380	94.37
内 アメリカ	2,686,578,517	38.72
内 フランス	694,832,454	10.01
内 イタリア	661,487,351	9.53
内 ドイツ	591,067,626	8.52
内 イギリス	478,011,946	6.89
内 スペイン	394,239,459	5.68
内 ベルギー	190,627,682	2.75
内 オーストラリア	153,077,876	2.21
内 カナダ	145,899,499	2.10
内 ポーランド	127,084,917	1.83
内 マレーシア	114,477,926	1.65
内 オランダ	67,256,398	0.97
内 ノルウェー	65,395,566	0.94
内 アイルランド	49,770,523	0.72
内 メキシコ	48,345,127	0.70
内 デンマーク	38,632,155	0.56
内 スウェーデン	22,356,268	0.32
内 スイス	19,459,090	0.28
特殊債券	32,295,789	0.47
内 南アフリカ	32,295,789	0.47
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	358,361,525	5.16
純資産総額	6,939,257,694	100.00

損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

平成30年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	11,660,772,061	93.95
内 アメリカ	9,188,608,261	74.03
内 イギリス	344,586,059	2.78
内 フランス	331,034,785	2.67
内 スイス	309,468,544	2.49
内 ドイツ	278,850,343	2.25
内 オランダ	247,379,797	1.99
内 アイルランド	230,213,514	1.85
内 バミューダ	162,967,373	1.31
内 オーストラリア	131,017,027	1.06
内 ジョージア	99,735,721	0.80
内 シンガポール	85,297,213	0.69
内 スウェーデン	47,050,312	0.38
内 カナダ	45,803,255	0.37

	内 ケイマン諸島	41,852,446	0.34
	内 デンマーク	40,322,403	0.32
	内 香港	30,081,766	0.24
	内 スペイン	25,542,506	0.21
	内 プエルトリコ	12,055,106	0.10
	内 ノルウェー	8,905,630	0.07
投資証券		204,203,358	1.65
	内 アメリカ	204,203,358	1.65
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		546,296,060	4.40
純資産総額		12,411,271,479	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30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	1,768,482,519	1.8089 3,199,144,939	1.9865 3,513,090,523	- -	33.00%
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	995,371,790	2.3738 2,362,816,730	2.7766 2,763,749,312	- -	25.96%
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	1,320,741,569	1.8347 2,423,238,486	2.0748 2,740,274,607	- -	25.74%
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	422,229,023	1.5284 645,348,601	1.5348 648,037,104	- -	6.09%
5	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託受 益証券	91,001	4,701.90 427,877,947	5,503.68 500,840,938	- -	4.70%
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	153,621,723	1.4037 215,648,331	1.4088 216,422,283	- -	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30年1月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	4.70%
親投資信託受益証券	92.82%
合計	97.52%

（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30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	1,017,681,823	2.3670 2,408,946,054	2.7766 2,825,695,349	- -	21.91%
2	S J A Mラージキャップ・バ リュウ・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,350,117,906	1.8330 2,474,895,066	2.0748 2,801,224,631	- -	21.72%
3	損保ジャパン - T C W外国株式 マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,359,774,260	1.8054 2,455,044,646	1.9865 2,701,191,567	- -	20.94%
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	1,700,583,401	1.5275 2,597,673,799	1.5348 2,610,055,403	- -	20.24%
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	742,472,568	1.4036 1,042,159,911	1.4088 1,045,995,353	- -	8.11%
6	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託受 益証券	111,869	4,701.90 525,997,276	5,503.68 615,691,860	- -	4.77%

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年1月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	4.77%
親投資信託受益証券	92.92%
合計	97.69%

（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30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	3,584,470,725	1.4035 5,030,972,189	1.4088 5,049,802,357	- -	33.29%
2	SJAMスモールキャップ・マ ザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	839,085,018	2.3688 1,987,679,590	2.7766 2,329,803,460	- -	15.36%
3	SJAMラージキャップ・バ リユー・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,113,154,735	1.8324 2,039,816,455	2.0748 2,309,573,444	- -	15.22%
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	1,492,758,120	1.5256 2,277,462,046	1.5348 2,291,085,162	- -	15.10%
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	1,060,904,357	1.8053 1,915,307,388	1.9865 2,107,486,505	- -	13.89%
6	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託受 益証券	129,345	4,701.90 608,167,747	5,503.68 711,874,278	- -	4.69%

（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30年1月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	4.69%
親投資信託受益証券	92.86%
合計	97.55%

（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30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	2,723,360,677	1.4033 3,821,927,706	1.4088 3,836,670,521	- -	57.34%
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	481,510,531	1.5246 734,119,879	1.5348 739,022,362	- -	11.05%
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	226,217,823	2.3664 535,337,199	2.7766 628,116,407	- -	9.39%
4	SJAMラージキャップ・バ リユー・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	300,109,998	1.8299 549,198,776	2.0748 622,668,223	- -	9.31%

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	266,652,196	1.8049 481,292,049	1.9865 529,704,587	- -	7.92%
6	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託受 益証券	33,927	4,701.90 159,521,490	5,503.68 186,723,558	- -	2.79%

（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30年1月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	2.79%
親投資信託受益証券	95.00%
合計	97.79%

（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30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	2,348,727,416	1.4033 3,295,989,652	1.4088 3,308,887,183	- -	82.18%
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	157,450,288	1.5244 240,023,382	1.5348 241,654,702	- -	6.00%
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	79,930,723	1.8053 144,300,364	1.9865 158,782,381	- -	3.94%
4	S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	42,819,267	2.3678 101,389,922	2.7766 118,891,976	- -	2.95%
5	S J A Mラージキャップ・バ リュール・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	56,823,872	1.8371 104,392,932	2.0748 117,898,169	- -	2.93%

（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30年1月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.01%
合計	98.01%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）マザーファンドの投資資産

S J A Mラージキャップ・バリュール・マザーファンド

平成30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	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	890,900	3,266.76 2,910,358,459	3,826.00 3,408,583,400	- -	8.36%
2	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	1,152,500	2,671.07 3,078,415,781	2,778.50 3,202,221,250	- -	7.85%
3	第一生命ホールディングス 日本	株式 保険業	1,349,000	1,878.20 2,533,695,017	2,285.50 3,083,139,500	- -	7.56%
4	三菱重工業 日本	株式 機械	666,500	4,345.05 2,895,976,995	4,102.00 2,733,983,000	- -	6.70%
5	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	559,000	4,251.27 2,376,464,949	4,878.00 2,726,802,000	- -	6.69%
6	ジェイ エフ イー ホールディ ングス 日本	株式 鉄鋼	970,200	2,226.80 2,160,448,346	2,588.50 2,511,362,700	- -	6.16%
7	三井住友トラスト・ホールディ ングス 日本	株式 銀行業	432,600	4,082.97 1,766,293,658	4,527.00 1,958,380,200	- -	4.80%
8	KDDI 日本	株式 情報・通信業	700,800	2,809.61 1,968,974,776	2,753.00 1,929,302,400	- -	4.73%
9	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	9,141,700	195.72 1,789,260,736	205.30 1,876,791,010	- -	4.60%
10	日本郵船 日本	株式 海運業	622,100	2,255.92 1,403,410,398	2,731.00 1,698,955,100	- -	4.17%
11	マツダ 日本	株式 輸送用機器	1,006,600	1,608.68 1,619,306,836	1,529.50 1,539,594,700	- -	3.78%
12	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	1,153,400	1,098.05 1,266,495,490	1,163.50 1,341,980,900	- -	3.29%
13	大和証券グループ本社 日本	株式 証券、商品先物取 引業	1,704,000	646.19 1,101,108,655	782.20 1,332,868,800	- -	3.27%
14	三菱UFJフィナンシャル・グ ループ 日本	株式 銀行業	1,510,900	703.07 1,062,276,285	820.80 1,240,146,720	- -	3.04%
15	ツムラ 日本	株式 医薬品	327,500	3,905.69 1,279,113,966	3,690.00 1,208,475,000	- -	2.96%
16	ヤマダ電機 日本	株式 小売業	1,831,100	592.04 1,084,098,760	647.00 1,184,721,700	- -	2.91%
17	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先物取 引業	1,616,300	630.13 1,018,479,447	707.50 1,143,532,250	- -	2.80%
18	MS&ADインシュアランスグ ループホールディングス 日本	株式 保険業	276,000	3,843.11 1,060,700,893	3,711.00 1,024,236,000	- -	2.51%
19	三菱UFJリース 日本	株式 その他金融業	1,398,400	566.73 792,518,041	704.00 984,473,600	- -	2.41%
20	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	469,100	1,806.17 847,276,690	1,994.00 935,385,400	- -	2.29%
21	三井物産 日本	株式 卸売業	455,100	1,661.76 756,267,604	1,914.00 871,061,400	- -	2.14%
22	静岡銀行 日本	株式 銀行業	578,000	967.65 559,303,308	1,161.00 671,058,000	- -	1.65%
23	日本テレビホールディングス 日本	株式 情報・通信業	348,500	1,913.65 666,908,349	1,916.00 667,726,000	- -	1.64%

24	SUBARU 日本	株式 輸送用機器	177,500	3,740.52 663,943,362	3,618.00 642,195,000	- -	1.57%
25	フジ・メディア・ホールディングス 日本	株式 情報・通信業	287,500	1,572.38 452,060,736	1,787.00 513,762,500	- -	1.26%
26	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	18,500	5,098.16 94,316,098	5,191.00 96,033,500	- -	0.24%

(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30年1月31日現在

種類	投資比率
株式	99.38%
合計	99.38%

(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30年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行業	国内	20.78%
輸送用機器		17.00%
鉄鋼		14.01%
保険業		12.37%
情報・通信業		7.86%
機械		6.70%
証券、商品先物取引業		6.07%
海運業		4.17%
医薬品		2.96%
小売業		2.91%
その他金融業		2.41%
卸売業		2.14%
合計		99.38%

(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30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	ケースホールディングス 日本	株式 小売業	107,700	2,418.00 260,418,600	3,045.00 327,946,500	- -	3.78%
2	ジーエス・ユアサ コーポレーション 日本	株式 電気機器	459,000	532.00 244,188,000	586.00 268,974,000	- -	3.10%
3	シチズン時計 日本	株式 精密機器	319,000	759.00 242,121,000	834.00 266,046,000	- -	3.06%
4	東邦ホールディングス 日本	株式 卸売業	103,000	2,229.40 229,628,984	2,537.00 261,311,000	- -	3.01%
5	青山商事 日本	株式 小売業	60,000	4,018.81 241,129,184	4,290.00 257,400,000	- -	2.96%
6	沢井製薬 日本	株式 医薬品	51,000	5,895.97 300,694,602	4,990.00 254,490,000	- -	2.93%
7	伊予銀行 日本	株式 銀行業	281,200	799.00 224,678,800	897.00 252,236,400	- -	2.90%
8	島忠 日本	株式 小売業	59,800	2,750.00 164,450,000	3,605.00 215,579,000	- -	2.48%
9	エクセディ 日本	株式 輸送用機器	53,800	3,210.00 172,698,000	3,815.00 205,247,000	- -	2.36%
10	ダイビル 日本	株式 不動産業	147,000	1,124.00 165,228,000	1,378.00 202,566,000	- -	2.33%
11	住友倉庫 日本	株式 倉庫・運輸関連業	249,000	717.00 178,533,000	811.00 201,939,000	- -	2.33%
12	大気社 日本	株式 建設業	50,000	2,845.40 142,270,325	3,800.00 190,000,000	- -	2.19%
13	ゼビオホールディングス 日本	株式 小売業	81,700	2,103.00 171,815,100	2,319.00 189,462,300	- -	2.18%
14	E P Sホールディングス 日本	株式 サービス業	68,000	2,071.63 140,871,126	2,645.00 179,860,000	- -	2.07%
15	東和薬品 日本	株式 医薬品	29,000	5,437.42 157,685,365	6,160.00 178,640,000	- -	2.06%
16	興銀リース 日本	株式 その他金融業	61,800	2,720.00 168,096,000	2,863.00 176,933,400	- -	2.04%
17	A O K Iホールディングス 日本	株式 小売業	106,700	1,419.00 151,407,300	1,652.00 176,268,400	- -	2.03%
18	アークス 日本	株式 小売業	68,900	2,429.08 167,364,124	2,535.00 174,661,500	- -	2.01%
19	日立造船 日本	株式 機械	290,000	573.80 166,404,285	591.00 171,390,000	- -	1.97%
20	大和工業 日本	株式 鉄鋼	54,800	3,070.00 168,236,000	3,125.00 171,250,000	- -	1.97%
21	シップヘルスケアホールディングス 日本	株式 卸売業	48,000	3,728.94 178,989,429	3,565.00 171,120,000	- -	1.97%
22	日医工 日本	株式 医薬品	100,000	1,687.50 168,750,869	1,707.00 170,700,000	- -	1.97%
23	北洋銀行 日本	株式 銀行業	439,100	333.21 146,315,687	379.00 166,418,900	- -	1.92%
24	A D E K A 日本	株式 化学	86,000	1,856.00 159,616,000	1,930.00 165,980,000	- -	1.91%
25	リコーリース 日本	株式 その他金融業	40,900	3,755.00 153,579,500	4,005.00 163,804,500	- -	1.89%

26	日立キャピタル	日本	株式 その他金融業	50,800	2,504.00 127,203,200	3,005.00 152,654,000	- -	1.76%
27	七十七銀行	日本	株式 銀行業	51,800	2,480.00 128,464,000	2,854.00 147,837,200	- -	1.70%
28	トッパン・フォームズ	日本	株式 その他製品	104,300	1,117.00 116,503,100	1,229.00 128,184,700	- -	1.48%
29	メイテック	日本	株式 サービス業	21,000	4,965.00 104,265,000	5,990.00 125,790,000	- -	1.45%
30	北越紀州製紙	日本	株式 パルプ・紙	170,000	641.00 108,970,194	715.00 121,550,000	- -	1.40%

（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30年1月31日現在

種類	投資比率
株式	99.32%
合計	99.32%

（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30年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
小売業	国内	19.28%
銀行業		9.75%
輸送用機器		8.61%
電気機器		7.69%
医薬品		6.95%
その他金融業		6.60%
鉄鋼		5.26%
卸売業		4.98%
サービス業		4.49%
不動産業		3.43%
精密機器		3.06%
化学		2.89%
倉庫・運輸関連業		2.33%
建設業		2.19%
繊維製品		1.98%
機械		1.97%
その他製品		1.48%
パルプ・紙		1.40%
非鉄金属		1.04%
水産・農林業		0.97%
鉱業	0.90%	
電気・ガス業	0.64%	
金属製品	0.50%	
証券、商品先物取引業	0.48%	
情報・通信業	0.44%	
合計		99.32%

（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30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	3 8 1 2年国債 日本	国債証券	1,640,000,000	100.49 1,648,170,500	100.40 1,646,691,200	0.100000 2019/10/15	10.28%
2	1 5 4 20年国債 日本	国債証券	890,000,000	112.40 1,000,367,200	112.25 999,025,000	1.200000 2035/9/20	6.24%
3	1 5 8 20年国債 日本	国債証券	840,000,000	99.46 835,480,200	99.57 836,430,000	0.500000 2036/9/20	5.22%
4	1 5 0 20年国債 日本	国債証券	680,000,000	116.01 788,892,300	115.77 787,256,400	1.400000 2034/9/20	4.92%
5	3 4 9 10年国債 日本	国債証券	590,000,000	100.48 592,867,300	100.19 591,156,400	0.100000 2027/12/20	3.69%
6	1 3 3 5年国債 日本	国債証券	540,000,000	100.98 545,317,200	100.88 544,768,200	0.100000 2022/9/20	3.40%
7	5 5 30年国債 日本	国債証券	540,000,000	99.23 535,845,400	100.00 540,000,000	0.800000 2047/6/20	3.37%
8	3 3 9 10年国債 日本	国債証券	520,000,000	103.25 536,947,400	102.95 535,345,200	0.400000 2025/6/20	3.34%
9	3 5 30年国債 日本	国債証券	370,000,000	128.33 474,832,100	128.70 476,215,900	2.000000 2041/9/20	2.97%
10	3 4 5 10年国債 日本	国債証券	330,000,000	100.44 331,484,000	100.44 331,458,600	0.100000 2026/12/20	2.07%
11	5 4 4 東京電力 日本	社債券	300,000,000	101.71 305,131,200	100.74 302,246,700	1.976000 2018/6/25	1.89%
12	5 4 0 東京電力 日本	社債券	300,000,000	101.15 303,469,800	100.34 301,044,900	1.640000 2018/4/25	1.88%
13	1 5 1 20年国債 日本	国債証券	260,000,000	112.47 292,422,000	112.47 292,424,600	1.200000 2034/12/20	1.83%
14	1 1 3 20年国債 日本	国債証券	230,000,000	123.23 283,433,600	122.35 281,425,700	2.100000 2029/9/20	1.76%
15	5 2 ソフトバンクグループ 日本	社債券	200,000,000	100.92 201,849,000	103.33 206,673,200	2.030000 2024/3/8	1.29%
16	1 みずほFG劣後 日本	社債券	200,000,000	103.41 206,837,000	103.04 206,089,000	0.950000 2024/7/16	1.29%
17	1 4 6 20年国債 日本	国債証券	170,000,000	120.62 205,067,200	120.18 204,312,800	1.700000 2033/9/20	1.28%
18	1 エイチエスピーシーHD イギリス	社債券	200,000,000	100.56 201,121,400	100.90 201,817,200	0.450000 2021/9/24	1.26%
19	5 4 2 東京電力 日本	社債券	200,000,000	101.12 202,242,000	100.33 200,676,800	1.602000 2018/4/25	1.25%
20	5 7 30年国債 日本	国債証券	200,000,000	99.73 199,474,800	99.75 199,518,000	0.800000 2047/12/20	1.25%
21	3 A 明治安田劣後FR 日本	社債券	200,000,000	100.00 200,000,000	99.57 199,156,000	1.110000 2047/11/6	1.24%
22	3 A 富国生命劣後FR 日本	社債券	200,000,000	98.27 196,540,000	99.05 198,100,000	1.020000 -	1.24%
23	3 0 東レ 日本	社債券	200,000,000	99.93 199,865,200	98.73 197,475,400	0.375000 2027/7/16	1.23%
24	3 8 4 2年国債 日本	国債証券	190,000,000	100.47 190,904,400	100.46 190,891,100	0.100000 2020/1/15	1.19%
25	1 4 8 20年国債 日本	国債証券	160,000,000	117.55 188,080,000	117.28 187,656,000	1.500000 2034/3/20	1.17%

26	9 4 0 年国債 日本	国債証券	150,000,000	80.35 120,532,500	82.86 124,299,000	0.400000 2056/3/20	0.78%
27	7 8 住宅機構 R M B S 日本	特殊債券	114,576,000	103.96 119,124,667	103.90 119,044,464	1.080000 2048/11/10	0.74%
28	7 9 住宅機構 R M B S 日本	特殊債券	114,452,000	103.97 119,007,188	103.83 118,846,956	1.070000 2048/12/10	0.74%
29	1 5 7 2 0 年国債 日本	国債証券	120,000,000	94.00 112,802,400	94.55 113,462,400	0.200000 2036/6/20	0.71%
30	1 クレディ・A 劣後 フランス	社債券	100,000,000	108.15 108,151,200	108.51 108,512,900	2.114000 2025/6/26	0.68%

(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30年1月31日現在

種類	投資比率
国債証券	61.46%
特殊債券	5.51%
社債券	31.61%
合計	98.58%

(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30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 1.25% 2019/06/30 アメリカ	国債証券	1,030,241,300	99.54 1,025,566,338	98.90 1,018,970,460	1.250000 2019/6/30	14.68%
2	US TREASURY N/B 1.875% 2022/02/28 アメリカ	国債証券	545,037,900	100.07 545,453,247	97.84 533,281,432	1.875000 2022/2/28	7.68%
3	FRANCE O.A.T. 0% 2019/02/25 フランス	国債証券	428,203,600	100.85 431,843,951	100.57 430,674,334	- 2019/2/25	6.21%
4	US TREASURY N/B 2.125% 2024/02/29 アメリカ	国債証券	419,929,400	100.52 422,138,947	97.26 408,444,330	2.125000 2024/2/29	5.89%
5	BTPS 0.7% 2020/05/01 イタリア	国債証券	271,510,800	101.47 275,514,003	101.59 275,830,536	0.700000 2020/5/1	3.97%
6	US TREASURY N/B 2.25% 2027/08/15 アメリカ	国債証券	143,602,800	99.93 143,509,250	96.00 137,868,740	2.250000 2027/8/15	1.99%
7	DEUTSCHLAND REP 1.0% 2024/08/15 ドイツ	国債証券	131,027,600	106.24 139,205,167	104.78 137,294,650	1.000000 2024/8/15	1.98%
8	BELGIAN 0328 2.25% 2023/06/22 ベルギー	国債証券	118,870,400	112.57 133,817,164	111.08 132,045,995	2.250000 2023/6/22	1.90%
9	BUNDESobl-175 0.0% 2022/04/08 ドイツ	国債証券	122,922,800	101.21 124,412,084	100.45 123,483,327	- 2022/4/8	1.78%

10	US TREASURY N/B 1.25% 2019/03/31 アメリカ	国債証券	122,932,700	99.60 122,444,236	99.13 121,875,478	1.250000 2019/3/31	1.76%
11	FRANCE O.A.T. 4.5 2041/04/25 フランス	国債証券	75,644,800	159.25 120,466,505	157.42 119,083,069	4.500000 2041/4/25	1.72%
12	DEUTSCHLAND REP 0.25% 2027/02/15 ドイツ	国債証券	121,572,000	99.62 121,112,646	97.26 118,250,652	0.250000 2027/2/15	1.70%
13	POLAND GOVT BOND 1.5% 2020/04/25 ポーランド	国債証券	115,375,000	99.01 114,233,275	99.48 114,784,280	1.500000 2020/4/25	1.65%
14	DEUTSCHLAND REP 4.0 2037/01/04 ドイツ	国債証券	72,943,200	155.01 113,072,982	149.92 109,363,010	4.000000 2037/1/4	1.58%
15	CANADA-GOVT 1.5% 2023/06/01 カナダ	国債証券	106,898,400	98.37 105,158,612	96.85 103,539,652	1.500000 2023/6/1	1.49%
16	MALAYSIA GOVT 3.759% 2019/03/15 マレーシア	国債証券	97,720,000	101.01 98,709,540	100.64 98,354,202	3.759000 2019/3/15	1.42%
17	FRANCE O.A.T. 0.0% 2022/05/25 フランス	国債証券	97,257,600	100.55 97,795,866	99.80 97,070,865	- 2022/5/25	1.40%
18	US TREASURY N/B 2.875% 2046/11/15 アメリカ	国債証券	88,119,900	99.50 87,685,468	97.95 86,322,254	2.875000 2046/11/15	1.24%
19	BTPS 0.65% 2020/11/01 イタリア	国債証券	71,592,400	100.95 72,275,391	101.38 72,587,534	0.650000 2020/11/1	1.05%
20	US TREASURY N/B 2.75% 2047/08/15 アメリカ	国債証券	71,801,400	99.01 71,093,446	95.42 68,513,613	2.750000 2047/8/15	0.99%
21	AUSTRALIAN GOVT. 3.25% 2025/04/21 オーストラリア	国債証券	63,208,800	104.80 66,244,718	103.48 65,414,155	3.250000 2025/4/21	0.94%
22	UK TSY GILT 1.5% 2026/07/22 イギリス	国債証券	61,588,000	102.68 63,244,717	101.09 62,263,620	1.500000 2026/7/22	0.90%
23	SPANISH GOVT 4.85% 2020/10/31 スペイン	国債証券	54,707,400	115.84 63,375,787	113.51 62,100,558	4.850000 2020/10/31	0.89%
24	TREASURY 4.25 2027/12/07 イギリス	国債証券	49,270,400	128.90 63,513,979	125.50 61,836,322	4.250000 2027/12/7	0.89%
25	SPANISH GOVT 1.5% 2027/04/30 スペイン	国債証券	58,084,400	101.56 58,993,677	101.55 58,987,612	1.500000 2027/4/30	0.85%
26	US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15 アメリカ	国債証券	45,691,800	130.92 59,820,161	127.92 58,449,407	4.625000 2040/2/15	0.84%
27	SPANISH GOVT 5.5% 2021/04/30 スペイン	国債証券	49,304,200	120.41 59,370,145	117.61 57,987,162	5.500000 2021/4/30	0.84%
28	SPANISH GOVT 4.4% 2023/10/31 スペイン	国債証券	46,602,600	122.43 57,058,825	121.36 56,557,847	4.400000 2023/10/31	0.82%
29	NORWEGIAN GOVT 4.5% 2019/05/22 ノルウェー	国債証券	47,799,000	105.83 50,586,637	105.06 50,222,409	4.500000 2019/5/22	0.72%
30	BTPS 2.0% 2025/12/01 イタリア	国債証券	45,657,040	100.30 45,797,207	102.10 46,616,294	2.000000 2025/12/1	0.67%

(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	94.37%
特殊債券	0.47%
合計	94.84%

（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30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	TRANSUNION アメリカ	株式 商業・専門サービス	61,927	5,050.33 312,752,382	6,377.26 394,925,186	- -	3.18%
2	ORACLE CORPORATION アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	54,869	5,498.86 301,717,273	5,543.93 304,190,356	- -	2.45%
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	29,026	7,980.45 231,640,611	10,089.18 292,848,672	- -	2.36%
4	AIR PRODUCTS & CHEMICALS アメリカ	株式 素材	11,867	15,821.27 187,751,060	18,309.35 217,277,139	- -	1.75%
5	IDEX CORP アメリカ	株式 資本財	11,830	12,478.22 147,617,355	15,714.71 185,905,084	- -	1.50%
6	BAXTER INTERNATIONAL INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	23,383	6,768.08 158,258,209	7,805.68 182,520,273	- -	1.47%
7	JP MORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 各種金融	14,550	9,930.86 144,494,112	12,522.81 182,206,985	- -	1.47%
8	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	13,147	10,609.82 139,487,432	13,441.00 176,708,886	- -	1.42%
9	CITIGROUP INC アメリカ	株式 各種金融	20,215	7,272.20 147,007,567	8,553.06 172,900,306	- -	1.39%
10	ALPHABET, INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	1,306	103,722.56 135,461,665	126,597.83 165,336,772	- -	1.33%
11	CONAGRA BRANDS INC アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	39,167	3,707.74 145,221,179	4,118.78 161,320,624	- -	1.30%
12	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 テクノロジー・ハードウェア	35,040	3,429.42 120,166,994	4,596.37 161,057,067	- -	1.30%
13	ROPER INDUSTRIES INC アメリカ	株式 資本財	5,212	25,620.47 133,533,891	30,420.94 158,553,979	- -	1.28%
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 保険	6,740	20,342.92 137,111,291	23,325.66 157,214,974	- -	1.27%
15	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	7,550	17,377.02 131,196,551	20,356.78 153,693,725	- -	1.24%
16	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売り	970	109,882.25 106,585,784	156,420.43 151,727,824	- -	1.22%
17	DANAHER CORP アメリカ	株式 資本財	13,563	9,259.81 125,590,932	11,053.06 149,912,707	- -	1.21%
18	CYPRESS SEMICONDUCTOR CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	74,385	1,558.66 115,941,328	1,876.62 139,592,936	- -	1.12%
19	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	30,135	4,273.00 128,766,947	4,606.16 138,806,890	- -	1.12%
20	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	10,830	9,713.85 105,201,094	12,209.50 132,228,903	- -	1.07%
21	GILEAD SCIENCES INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー	13,880	7,928.93 110,053,642	9,496.27 131,808,353	- -	1.06%
22	CELANESE CORP-SERIES A アメリカ	株式 素材	10,955	10,718.95 117,426,167	11,946.22 130,870,948	- -	1.05%
23	WESTERN DIGITAL CORP アメリカ	株式 テクノロジー・ハードウェア	13,695	10,075.19 137,979,793	9,473.43 129,738,667	- -	1.05%
24	ADOBE SYSTEMS INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	5,675	15,926.85 90,384,907	21,420.75 121,562,761	- -	0.98%
25	LENNAR CORP-CL A アメリカ	株式 耐久消費財・アパレル	17,390	5,725.33 99,563,590	6,948.41 120,832,976	- -	0.97%

26	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC アメリカ	株式 各種金融	14,845	7,161.15 106,307,415	8,001.50 118,782,334	- -	0.96%
27	AGILENT TECHNOLOGIES INC アメリカ	株式 テクノロジー・ハードウェア	14,877	6,746.04 100,360,974	7,940.58 118,132,039	- -	0.95%
28	AMERICAN TOWER CORP アメリカ	投資証券 -	7,460	14,730.16 109,887,038	15,790.86 117,799,879	- -	0.95%
29	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー	17,820	6,795.91 121,103,287	6,598.11 117,578,382	- -	0.95%
30	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	8,510	11,422.51 97,205,643	13,623.77 115,938,297	- -	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30年1月31日現在

種類	投資比率
株式	93.95%
投資証券	1.65%
合計	95.60%

(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30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	15.83%
資本財		13.20%
各種金融		7.20%
医薬品・バイオテクノロジー		6.44%
素材		5.84%
保険		4.42%
ヘルスケア機器・サービス		4.39%
食品・飲料・タバコ		4.38%
テクノロジー・ハードウェア		4.20%
商業・専門サービス		4.19%
エネルギー		3.59%
銀行		3.38%
半導体・半導体製造装置		2.62%
小売り		2.54%
耐久消費財・アパレル		2.29%
メディア		1.82%
自動車・自動車部品		1.28%
電気通信サービス		1.27%
消費者サービス		1.23%
公益事業		1.21%
不動産	0.96%	
家庭用品・パーソナル用品	0.80%	
食品・生活必需品小売り	0.56%	
運輸	0.33%	

合計	93.95%
----	--------

(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30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
第17計算期間末 (平成29年7月18日)	9,271,419,094	9,271,419,094	1.4045	1.4045
平成29年1月末日	8,741,571,315	-	1.3243	-
2月末日	8,812,364,507	-	1.3411	-
3月末日	8,815,848,069	-	1.3307	-
4月末日	8,923,010,357	-	1.3436	-
5月末日	8,904,865,890	-	1.3457	-
6月末日	9,179,575,212	-	1.3884	-
7月末日	9,255,161,245	-	1.3996	-
8月末日	9,298,920,836	-	1.3986	-
9月末日	9,690,426,692	-	1.4605	-
10月末日	9,944,674,762	-	1.5001	-
11月末日	10,054,893,456	-	1.5104	-
12月末日	10,403,582,042	-	1.5493	-
平成30年1月末日	10,646,418,736	-	1.5594	-

ハッピーエイジング30

直近日（平成30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
第17計算期間末 （平成29年7月18日）	11,485,239,619	11,485,239,619	1.4397	1.4397
平成29年1月末日	10,820,185,990	-	1.3682	-
2月末日	10,908,581,627	-	1.3804	-
3月末日	10,876,779,237	-	1.3703	-
4月末日	10,936,263,798	-	1.3828	-
5月末日	11,020,265,616	-	1.3873	-
6月末日	11,376,006,695	-	1.4261	-
7月末日	11,500,321,253	-	1.4359	-
8月末日	11,586,316,938	-	1.4387	-
9月末日	12,032,291,211	-	1.4901	-
10月末日	12,245,297,100	-	1.5219	-
11月末日	12,384,539,269	-	1.5307	-
12月末日	12,751,349,697	-	1.5641	-
平成30年1月末日	12,897,515,400	-	1.5662	-

ハッピーエイジング４０

直近日（平成30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
第17計算期間末 （平成29年7月18日）	13,906,785,392	13,906,785,392	1.4368	1.4368
平成29年1月末日	13,246,635,431	-	1.3840	-
2月末日	13,366,597,395	-	1.3937	-
3月末日	13,397,901,921	-	1.3862	-
4月末日	13,537,336,862	-	1.3966	-
5月末日	13,551,635,857	-	1.3999	-
6月末日	13,815,471,742	-	1.4264	-
7月末日	13,947,108,031	-	1.4340	-
8月末日	14,043,803,599	-	1.4385	-
9月末日	14,413,398,315	-	1.4729	-
10月末日	14,623,790,997	-	1.4952	-
11月末日	14,760,776,934	-	1.5019	-
12月末日	15,081,693,213	-	1.5258	-
平成30年1月末日	15,171,062,700	-	1.5266	-

ハッピーエイジング50

直近日（平成30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
第17計算期間末 （平成29年7月18日）	6,297,794,959	6,297,794,959	1.3890	1.3890
平成29年1月末日	6,028,223,960	-	1.3568	-
2月末日	6,114,358,611	-	1.3635	-
3月末日	6,143,329,369	-	1.3579	-
4月末日	6,167,181,690	-	1.3667	-
5月末日	6,200,847,764	-	1.3682	-
6月末日	6,274,216,091	-	1.3830	-
7月末日	6,345,482,532	-	1.3872	-
8月末日	6,444,895,933	-	1.3926	-
9月末日	6,512,133,172	-	1.4108	-
10月末日	6,555,976,739	-	1.4231	-
11月末日	6,574,995,830	-	1.4276	-
12月末日	6,672,956,406	-	1.4420	-
平成30年1月末日	6,690,679,057	-	1.4408	-

ハッピーエイジング60

直近日（平成30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
第17計算期間末 （平成29年7月18日）	3,967,051,489	3,967,051,489	1.2846	1.2846
平成29年1月末日	3,855,084,974	-	1.2732	-
2月末日	3,850,450,868	-	1.2770	-
3月末日	3,852,085,808	-	1.2738	-
4月末日	3,893,956,572	-	1.2808	-
5月末日	3,942,405,705	-	1.2801	-
6月末日	3,964,900,368	-	1.2830	-
7月末日	3,974,839,864	-	1.2835	-
8月末日	4,025,631,254	-	1.2889	-
9月末日	4,016,493,558	-	1.2919	-
10月末日	4,025,202,809	-	1.2944	-
11月末日	4,054,698,818	-	1.2967	-
12月末日	4,065,715,265	-	1.3019	-
平成30年1月末日	4,026,224,404	-	1.2988	-

【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
第17計算期間	0.0000
平成29年7月19日～ 平成30年1月18日	-

ハッピーエイジング30

	1口当たりの分配金(円)
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
第17計算期間	0.0000
平成29年7月19日～ 平成30年1月18日	-

ハッピーエイジング40

	1口当たりの分配金(円)
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
第17計算期間	0.0000
平成29年7月19日～ 平成30年1月18日	-

ハッピーエイジング50

	1口当たりの分配金(円)
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
第17計算期間	0.0000
平成29年7月19日～ 平成30年1月18日	-

ハッピーエイジング60

	1口当たりの分配金(円)
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
第17計算期間	0.0000
平成29年7月19日～ 平成30年1月18日	-

【収益率の推移】

ハッピーエイジング20

	収益率(%)
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
第17計算期間	26.5
平成29年7月19日～ 平成30年1月18日	12.6

(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
第17計算期間	21.0
平成29年7月19日～ 平成30年1月18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40

	収益率(%)
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
第17計算期間	13.7
平成29年7月19日～ 平成30年1月18日	7.3

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

ハッピーエイジング50

	収益率(%)
第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
第17計算期間	6.8
平成29年7月19日～ 平成30年1月18日	4.3

(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60

	収益率(%)
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
第17計算期間	0.0
平成29年7月19日～ 平成30年1月18日	1.3

(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。

（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
第17計算期間	1,187,415,933	1,268,396,839
平成29年7月19日～ 平成30年1月18日	746,722,338	584,088,327

(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
第17計算期間	1,000,840,370	780,753,459
平成29年7月19日～ 平成30年1月18日	579,703,386	368,316,438

(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
第17計算期間	1,431,202,031	1,135,435,456
平成29年7月19日～ 平成30年1月18日	781,063,472	595,135,360

(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
第17計算期間	828,831,999	669,291,626
平成29年7月19日～ 平成30年1月18日	445,881,733	381,915,628

(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
第17計算期間	748,382,900	570,133,617
平成29年7月19日～ 平成30年1月18日	310,358,876	286,088,324

(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:2018年1月31日

● 基準価額・純資産の推移 2008/01/31 ~ 2018/01/31

● ハッピーエイジング20



● ハッピーエイジング20

2013年07月	0円
2014年07月	0円
2015年07月	0円
2016年07月	0円
2017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

2013年07月	0円
2014年07月	0円
2015年07月	0円
2016年07月	0円
2017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

2013年07月	0円
2014年07月	0円
2015年07月	0円
2016年07月	0円
2017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

2013年07月	0円
2014年07月	0円
2015年07月	0円
2016年07月	0円
2017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

2013年07月	0円
2014年07月	0円
2015年07月	0円
2016年07月	0円
2017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として計算しています。
- 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

資産別構成	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	25.74%	21.72%	15.22%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	25.96%	21.91%	15.36%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	2.03%	8.11%	33.29%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	6.09%	20.24%	15.10%
損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド	33.00%	20.94%	13.89%
ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	4.70%	4.77%	4.69%
コール・ローン等	2.48%	2.31%	2.45%
合計	100.00%	100.00%	100.00%

資産別構成	主要な資産の状況	
	ハッピーエイジング 50	ハッピーエイジング 60
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	9.31%	2.93%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	9.39%	2.95%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	57.34%	82.18%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	11.05%	6.00%
損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド	7.92%	3.94%
ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	2.79%	-
コール・ローン等	2.21%	1.99%
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	本田技研	輸送用機器	8.4%
2	新日鐵住金	鉄鋼	7.9%
3	第一生命HLDGS	保険業	7.6%
4	三菱重工業	機械	6.7%
5	三井住友フィナンシャルG	銀行業	6.7%
組入銘柄数			26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	ケースホールディングス	小売業	3.8%
2	ジーエス・ユアサコーポ	電気機器	3.1%
3	シチズン時計	精密機器	3.1%
4	東邦ホールディングス	卸売業	3.0%
5	青山商事	小売業	3.0%
組入銘柄数			72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	381 2年国債	国債証券	2019/10/15	10.3%
2	154 20年国債	国債証券	2035/09/20	6.2%
3	158 20年国債	国債証券	2036/09/20	5.2%
4	150 20年国債	国債証券	2034/09/20	4.9%
5	349 10年国債	国債証券	2027/12/20	3.7%
組入銘柄数			86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 1.25%	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2019/06/30	14.7%
2	US TREASURY N/B 1.875%	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2022/02/28	7.7%
3	FRANCE O.A.T. 0%	フランス	国債証券	ユーロ	2019/02/25	6.2%
4	US TREASURY N/B 2.125%	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2024/02/29	5.9%
5	BTPS 0.7%	イタリア	国債証券	ユーロ	2020/05/01	4.0%
組入銘柄数					122銘柄	

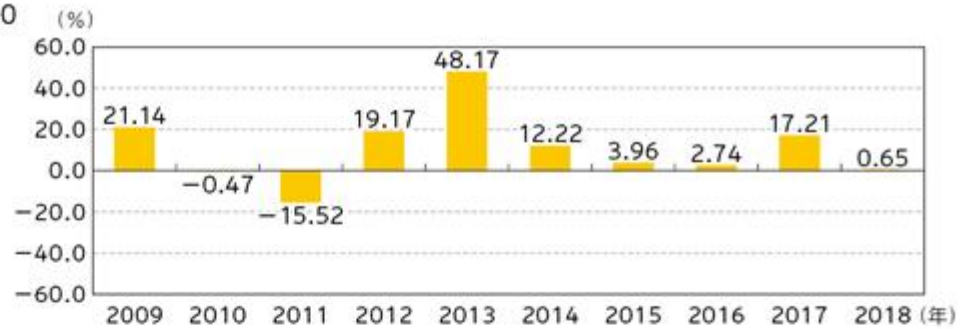
● 損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド

組入上位5銘柄					
	銘柄名	通貨	発行国/地域	業種	純資産比
1	TRANSUNION	アメリカ・ドル	アメリカ	資本財・サービス	3.2%
2	ORACLE CORPORATION	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	2.5%
3	MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	2.4%
4	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	アメリカ・ドル	アメリカ	素材	1.8%
5	IDEX CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	資本財・サービス	1.5%
組入銘柄数			213銘柄		

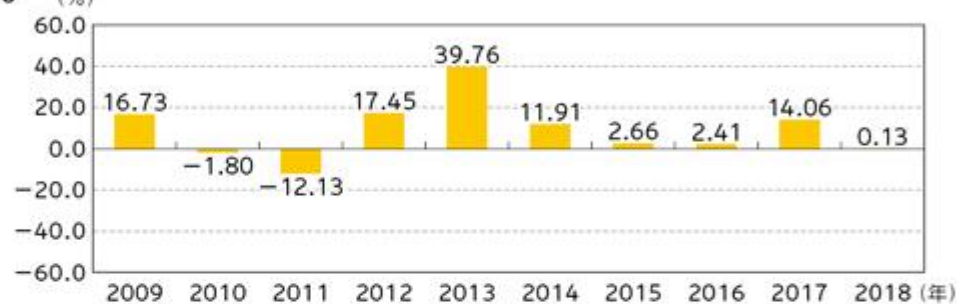
- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用実績は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

年間収益率の推移（暦年ベース）

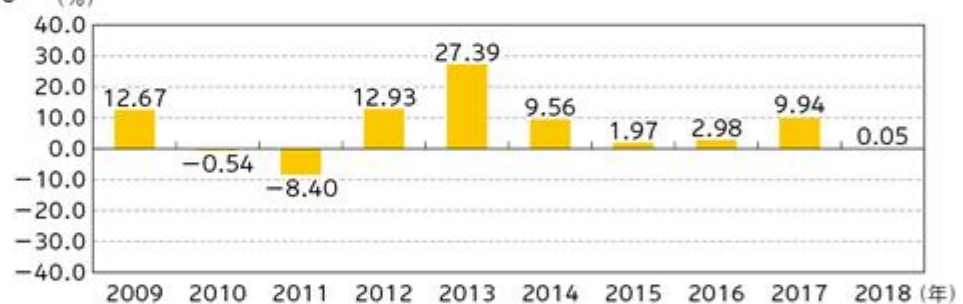
● ハッピーエイジング20 (%)



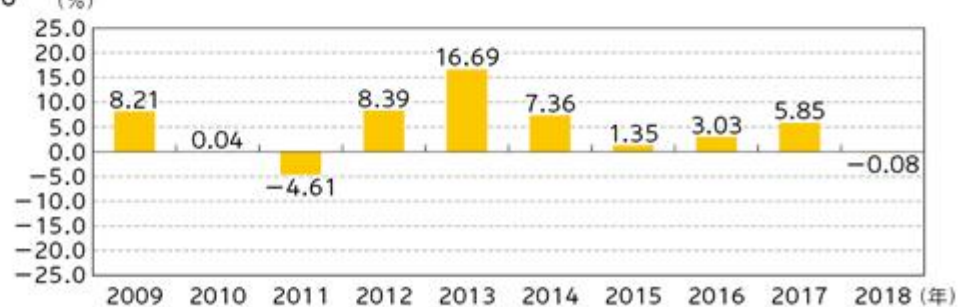
● ハッピーエイジング30 (%)



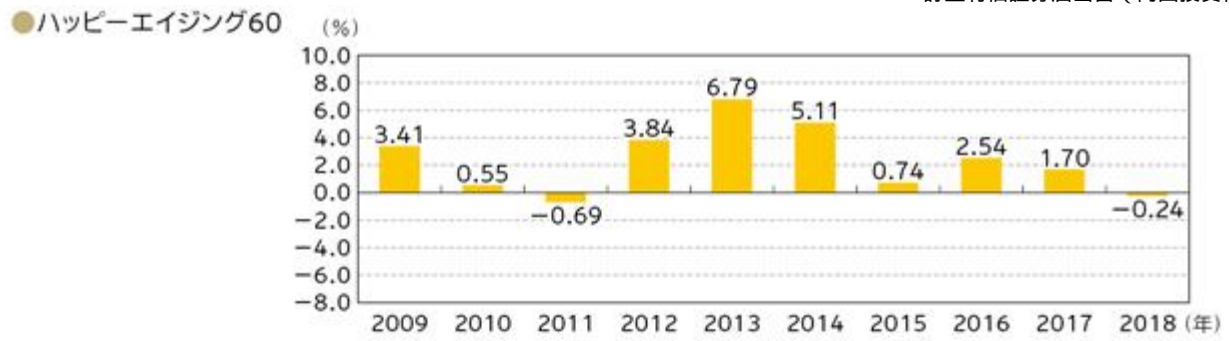
● ハッピーエイジング40 (%)



● 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。



- 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。
- 2018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2【管理及び運営】

3【資産管理等の概要】

(5)【その他】

<訂正前>

(略)

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

平成30年1月15日より、公告の方法は以下のとおり変更される予定です。

() 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.sjnk-am.co.jp/>

() 前記()の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

(略)

<訂正後>

(略)

公告

() 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.sjnk-am.co.jp/>

() 前記()の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

(略)

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29年7月19日から平成30年1月18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17期 平成29年7月18日現在	第18期中間計算期間末 平成30年1月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	277,231,002	356,664,779
投資信託受益証券	442,194,297	506,253,132
親投資信託受益証券	8,640,005,883	9,933,404,920
流動資産合計	9,359,431,182	10,796,322,831
資産合計	9,359,431,182	10,796,322,831
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,814,672	14,118,728
未払受託者報酬	3,854,806	4,259,447
未払委託者報酬	74,205,910	81,995,344
その他未払費用	136,700	135,000
流動負債合計	88,012,088	100,508,519
負債合計	88,012,088	100,508,519
純資産の部		
元本等		
元本	6,601,111,917	6,763,745,928
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,670,307,177	3,932,068,384
純資産合計	9,271,419,094	10,695,814,312
負債純資産合計	9,359,431,182	10,796,322,831

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期中間計算期間		第18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	自	平成29年7月19日 至 平成30年1月18日
営業収益				
受取配当金		4,249,945		6,352,186
有価証券売買等損益		1,553,120,475		1,261,764,241
為替差損益		33,497,774		4,253,830
営業収益合計		1,590,868,194		1,263,862,597
営業費用				
支払利息		89,636		119,197
受託者報酬		3,487,723		4,259,447
委託者報酬		67,139,408		81,995,344
その他費用		191,218		191,484
営業費用合計		70,907,985		86,565,472
営業利益又は営業損失（ ）		1,519,960,209		1,177,297,125
経常利益又は経常損失（ ）		1,519,960,209		1,177,297,125
中間純利益又は中間純損失（ ）		1,519,960,209		1,177,297,125
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（ ）		84,052,942		41,916,355
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		734,646,069		2,670,307,177
剰余金増加額又は欠損金減少額		113,225,916		363,795,225
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		113,225,916		363,795,225
剰余金減少額又は欠損金増加額		72,154,671		237,414,788
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		72,154,671		237,414,788
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		2,211,624,581		3,932,068,384

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</p> <p>但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> <p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年7月15日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成29年7月18日、当中間計算期間末日を平成30年1月18日としております。</p>

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第17期 平成29年7月18日現在	第18期中間計算期間末 平成30年1月18日現在
1．受益権の総数	6,601,111,917口	6,763,745,928口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4045円 (14,045円)	1.5813円 (15,813円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	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	第18期中間計算期間 自 平成29年7月19日 至 平成30年1月18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	3,777,570円	4,535,011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17期 平成29年7月18日現在	第18期中間計算期間末 平成30年1月18日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しておりません。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(その他の注記)

項目	第17期	第18期中間計算期間
	自 平成28年7月16日 至 平成29年7月18日	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月18日
期首元本額	6,682,092,823円	6,601,111,917円
期中追加設定元本額	1,187,415,933円	746,722,338円
期中一部解約元本額	1,268,396,839円	584,088,327円

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング30】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第17期 平成29年7月18日現在	第18期中間計算期間末 平成30年1月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	342,905,845	377,077,820
投資信託受益証券	543,596,596	622,345,157
親投資信託受益証券	10,686,031,787	12,103,114,701
流動資産合計	11,572,534,228	13,102,537,678
資産合計	11,572,534,228	13,102,537,678
負債の部		
流動負債		
未払解約金	887,196	9,188,571
未払受託者報酬	4,759,644	5,260,205
未払委託者報酬	81,510,719	90,082,819
その他未払費用	137,050	135,000
流動負債合計	87,294,609	104,666,595
負債合計	87,294,609	104,666,595
純資産の部		
元本等		
元本	7,977,459,254	8,188,846,202
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,507,780,365	4,809,024,881
純資産合計	11,485,239,619	12,997,871,083
負債純資産合計	11,572,534,228	13,102,537,678

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第17期中間計算期間		第18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	自	平成29年7月19日 至 平成30年1月18日
営業収益				
受取配当金		5,175,735		7,808,846
有価証券売買等損益		1,525,407,435		1,286,429,951
為替差損益		41,233,920		5,229,302
営業収益合計		1,571,817,090		1,289,009,495
営業費用				
支払利息		105,594		143,661
受託者報酬		4,273,366		5,260,205
委託者報酬		73,183,328		90,082,819
その他費用		202,950		203,743
営業費用合計		77,765,238		95,690,428
営業利益又は営業損失（ ）		1,494,051,852		1,193,319,067
経常利益又は経常損失（ ）		1,494,051,852		1,193,319,067
中間純利益又は中間純損失（ ）		1,494,051,852		1,193,319,067
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（ ）		32,462,553		25,142,708
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,469,412,779		3,507,780,365
剰余金増加額又は欠損金減少額		119,247,593		295,419,549
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		119,247,593		295,419,549
剰余金減少額又は欠損金増加額		68,691,166		162,351,392
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		68,691,166		162,351,392
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		2,981,558,505		4,809,024,881

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</p> <p>但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> <p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年7月15日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成29年7月18日、当中間計算期間末日を平成30年1月18日としております。</p>

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第17期 平成29年7月18日現在	第18期中間計算期間末 平成30年1月18日現在
1．受益権の総数	7,977,459,254口	8,188,846,202口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4397円 (14,397円)	1.5873円 (15,873円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	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	第18期中間計算期間 自 平成29年7月19日 至 平成30年1月18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	2,888,696円	3,500,896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17期 平成29年7月18日現在	第18期中間計算期間末 平成30年1月18日現在
1．中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しておりません。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	第17期	第18期中間計算期間
	自 平成28年7月16日 至 平成29年7月18日	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月18日
期首元本額	7,757,372,343円	7,977,459,254円
期中追加設定元本額	1,000,840,370円	579,703,386円
期中一部解約元本額	780,753,459円	368,316,438円

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング40】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第17期 平成29年7月18日現在	第18期中間計算期間末 平成30年1月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	416,192,278	440,060,769
投資信託受益証券	666,515,542	719,566,943
親投資信託受益証券	12,940,172,086	14,152,343,770
流動資産合計	14,022,879,906	15,311,971,482
資産合計	14,022,879,906	15,311,971,482
負債の部		
流動負債		
未払解約金	22,592,016	9,423,146
未払受託者報酬	5,105,998	5,512,502
未払委託者報酬	88,259,096	95,285,710
その他未払費用	137,404	135,000
流動負債合計	116,094,514	110,356,358
負債合計	116,094,514	110,356,358
純資産の部		
元本等		
元本	9,679,074,126	9,865,002,238
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	4,227,711,266	5,336,612,886
純資産合計	13,906,785,392	15,201,615,124
負債純資産合計	14,022,879,906	15,311,971,482

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第17期中間計算期間		第18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	自	平成29年7月19日 至 平成30年1月18日
営業収益				
受取配当金		6,516,997		9,029,343
有価証券売買等損益		1,268,453,213		1,120,624,497
為替差損益		52,649,728		6,402,386
営業収益合計		1,327,619,938		1,123,251,454
営業費用				
支払利息		127,774		166,465
受託者報酬		4,712,792		5,512,502
委託者報酬		81,462,245		95,285,710
その他費用		221,334		221,071
営業費用合計		86,524,145		101,185,748
営業利益又は営業損失（ ）		1,241,095,793		1,022,065,706
経常利益又は経常損失（ ）		1,241,095,793		1,022,065,706
中間純利益又は中間純損失（ ）		1,241,095,793		1,022,065,706
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（ ）		34,316,726		28,083,135
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,473,866,799		4,227,711,266
剰余金増加額又は欠損金減少額		201,904,153		375,427,974
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		201,904,153		375,427,974
剰余金減少額又は欠損金増加額		138,111,998		260,508,925
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		138,111,998		260,508,925
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		3,744,438,021		5,336,612,886

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</p> <p>但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> <p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年7月15日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成29年7月18日、当中間計算期間末日を平成30年1月18日としております。</p>

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第17期 平成29年7月18日現在	第18期中間計算期間末 平成30年1月18日現在
1．受益権の総数	9,679,074,126口	9,865,002,238口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4368円 (14,368円)	1.5410円 (15,410円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	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	第18期中間計算期間 自 平成29年7月19日 至 平成30年1月18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	2,392,810円	2,773,077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17期 平成29年7月18日現在	第18期中間計算期間末 平成30年1月18日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しておりません。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	第17期	第18期中間計算期間
	自 平成28年7月16日 至 平成29年7月18日	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月18日
期首元本額	9,383,307,551円	9,679,074,126円
期中追加設定元本額	1,431,202,031円	781,063,472円
期中一部解約元本額	1,135,435,456円	595,135,360円

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング50】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第17期 平成29年7月18日現在	第18期中間計算期間末 平成30年1月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	178,182,544	151,902,455
投資信託受益証券	181,647,533	207,962,050
親投資信託受益証券	5,979,856,701	6,344,968,809
流動資産合計	6,339,686,778	6,704,833,314
資産合計	6,339,686,778	6,704,833,314
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,855,516	3,061,376
未払受託者報酬	1,994,548	2,122,969
未払委託者報酬	34,905,625	37,153,095
その他未払費用	136,130	135,000
流動負債合計	41,891,819	42,472,440
負債合計	41,891,819	42,472,440
純資産の部		
元本等		
元本	4,533,990,603	4,597,956,708
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,763,804,356	2,064,404,166
純資産合計	6,297,794,959	6,662,360,874
負債純資産合計	6,339,686,778	6,704,833,314

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第17期中間計算期間		第18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	自	平成29年7月19日 至 平成30年1月18日
営業収益				
受取配当金		1,853,466		2,609,394
有価証券売買等損益		303,868,694		315,253,840
為替差損益		15,116,988		1,747,417
営業収益合計		320,839,148		316,115,817
営業費用				
支払利息		56,911		68,794
受託者報酬		1,897,745		2,122,969
委託者報酬		33,211,836		37,153,095
その他費用		166,726		159,911
営業費用合計		35,333,218		39,504,769
営業利益又は営業損失()		285,505,930		276,611,048
経常利益又は経常損失()		285,505,930		276,611,048
中間純利益又は中間純損失()		285,505,930		276,611,048
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()		9,061,844		11,511,149
期首剰余金又は期首欠損金()		1,315,499,728		1,763,804,356
剰余金増加額又は欠損金減少額		122,898,930		184,354,527
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		122,898,930		184,354,527
剰余金減少額又は欠損金増加額		100,474,334		148,854,616
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		100,474,334		148,854,616
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金()		1,614,368,410		2,064,404,166

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</p> <p>但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> <p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年7月15日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成29年7月18日、当中間計算期間末日を平成30年1月18日としております。</p>

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第17期 平成29年7月18日現在	第18期中間計算期間末 平成30年1月18日現在
1．受益権の総数	4,533,990,603口	4,597,956,708口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3890円 (13,890円)	1.4490円 (14,490円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	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	第18期中間計算期間 自 平成29年7月19日 至 平成30年1月18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	685,387円	757,671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17期 平成29年7月18日現在	第18期中間計算期間末 平成30年1月18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	(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ぬ。 (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17期	第18期中間計算期間
	自 平成28年7月16日 至 平成29年7月18日	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月18日
期首元本額	4,374,450,230円	4,533,990,603円
期中追加設定元本額	828,831,999円	445,881,733円
期中一部解約元本額	669,291,626円	381,915,628円

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング60】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第17期 平成29年7月18日現在	第18期中間計算期間末 平成30年1月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	102,536,951	122,491,504
親投資信託受益証券	3,887,132,411	3,953,397,877
流動資産合計	3,989,669,362	4,075,889,381
資産合計	3,989,669,362	4,075,889,381
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,749,997	4,882,872
未払受託者報酬	1,051,747	1,092,839
未払委託者報酬	18,723,030	19,454,485
その他未払費用	93,099	96,113
流動負債合計	22,617,873	25,526,309
負債合計	22,617,873	25,526,309
純資産の部		
元本等		
元本	3,088,270,249	3,112,540,801
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	878,781,240	937,822,271
純資産合計	3,967,051,489	4,050,363,072
負債純資産合計	3,989,669,362	4,075,889,381

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第17期中間計算期間		第18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	自	平成29年7月19日 至 平成30年1月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		7,215,931		72,955,466
営業収益合計		7,215,931		72,955,466
営業費用				
支払利息		39,808		45,057
受託者報酬		1,022,835		1,092,839
委託者報酬		18,208,487		19,454,485
その他費用		92,313		97,260
営業費用合計		19,363,443		20,689,641
営業利益又は営業損失()		12,147,512		52,265,825
経常利益又は経常損失()		12,147,512		52,265,825
中間純利益又は中間純損失()		12,147,512		52,265,825
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()		2,327,990		2,884,409
期首剰余金又は期首欠損金()		827,443,227		878,781,240
剰余金増加額又は欠損金減少額		103,081,974		91,152,279
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		103,081,974		91,152,279
剰余金減少額又は欠損金増加額		75,237,333		81,492,664
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		75,237,333		81,492,664
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金()		845,468,346		937,822,271

(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。
3. 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	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年7月15日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成29年7月18日、当中間計算期間末日を平成30年1月18日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第17期 平成29年7月18日現在	第18期中間計算期間末 平成30年1月18日現在
1. 受益権の総数	3,088,270,249口	3,112,540,801口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2846円 (12,846円)	1.3013円 (13,013円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	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	第18期中間計算期間 自 平成29年7月19日 至 平成30年1月18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	231,849円	246,362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17期 平成29年7月18日現在	第18期中間計算期間末 平成30年1月18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>	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17期 自 平成28年7月16日 至 平成29年7月18日	第18期中間計算期間 自 平成29年7月19日 至 平成30年1月18日
期首元本額	2,910,020,966円	3,088,270,249円
期中追加設定元本額	748,382,900円	310,358,876円
期中一部解約元本額	570,133,617円	286,088,324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29年7月18日現在	平成30年1月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	27,416,014	107,375,883
株式	7,842,646,260	41,656,381,910
未収配当金	4,454,400	21,381,600
流動資産合計	7,874,516,674	41,785,139,393
資産合計	7,874,516,674	41,785,139,393
負債の部		
流動負債		
その他未払費用	180	-
流動負債合計	180	-
負債合計	180	-
純資産の部		
元本等		
元本	4,304,460,772	19,594,626,601
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,570,055,722	22,190,512,792
純資産合計	7,874,516,494	41,785,139,393
負債純資産合計	7,874,516,674	41,785,139,393

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29年7月18日現在	平成30年1月18日現在
1．受益権の総数	4,304,460,772口	19,594,626,601口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8294円 (18,294円)	2.1325円 (21,325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29年7月18日現在	平成30年1月18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28年7月16日 至 平成29年7月18日	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月18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	5,007,141,390円	4,304,460,772円
同期中追加設定元本額	342,725,920円	16,239,981,042円
同期中一部解約元本額	1,045,406,538円	949,815,213円
元本の内訳*		
ファンド名		
マルチアセット 動的アロケーションファンド 成長型（適格機関投資家専用）	439,606円	338,968円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 標準型（適格機関投資家専用）	306,481円	240,392円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 安定型（適格機関投資家専用）	99,224円	75,906円
損保ジャパン日本興亜ラージキャップ・バリュース・ファンド（F o F s用）（適格機関投資家専用）	- 円	15,441,919,584円
ハッピーエイジング20	1,322,401,015円	1,304,568,934円
ハッピーエイジング30	1,388,779,073円	1,353,371,404円
ハッピーエイジング40	1,191,352,498円	1,127,577,311円
ハッピーエイジング50	331,954,664円	302,879,740円
ハッピーエイジング60	64,644,460円	56,235,776円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	447,710円	948,225円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	439,764円	512,023円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	583,990円	840,917円
SOMPO日本株バリュース・プラスファンド	3,012,287円	5,117,421円
計	4,304,460,772円	19,594,626,601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29年7月18日現在	平成30年1月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	113,892,663	88,207,450
株式	7,751,322,500	8,617,671,500
未収配当金	2,830,000	2,720,000
流動資産合計	7,868,045,163	8,708,598,950
資産合計	7,868,045,163	8,708,598,950
負債の部		
流動負債		
その他未払費用	668	-
流動負債合計	668	-
負債合計	668	-
純資産の部		
元本等		
元本	3,330,488,283	3,131,370,896
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,537,556,212	5,577,228,054
純資産合計	7,868,044,495	8,708,598,950
負債純資産合計	7,868,045,163	8,708,598,950

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29年7月18日現在	平成30年1月18日現在
1．受益権の総数	3,330,488,283口	3,131,370,896口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.3624円 (23,624円)	2.7811円 (27,811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29年7月18日現在	平成30年1月18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28年7月16日 至 平成29年7月18日	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月18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	3,745,215,480円	3,330,488,283円
同期中追加設定元本額	110,242,454円	49,475,450円
同期中一部解約元本額	524,969,651円	248,592,837円
元本の内訳*		
ファンド名		
マルチアセット 動的アロケーションファンド 成長型（適格機関投資家専用）	341,498円	260,443円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 標準型（適格機関投資家専用）	241,146円	183,342円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 安定型（適格機関投資家専用）	77,323円	55,781円
ハッピーエイジング20	1,022,866,895円	983,123,001円
ハッピーエイジング30	1,074,421,866円	1,019,900,479円
ハッピーエイジング40	921,015,811円	849,739,557円
ハッピーエイジング50	256,616,675円	228,518,519円
ハッピーエイジング60	51,422,003円	43,921,461円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	346,140円	717,272円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	341,149円	387,692円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	452,170円	634,248円
SOMPO日本株バリュー・プラスファンド	2,345,607円	3,929,101円
計	3,330,488,283円	3,131,370,896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29年7月18日現在	平成30年1月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	362,666,219	62,226,164
国債証券	8,844,161,600	9,830,283,500
特殊債券	845,383,061	884,724,497
社債券	4,861,820,500	5,063,020,400
未収利息	26,499,532	24,541,896
前払費用	2,341,309	4,905,566
流動資産合計	14,942,872,221	15,869,702,023
資産合計	14,942,872,221	15,869,702,023
負債の部		
流動負債		
未払金	200,000,000	-
その他未払費用	3,066	-
流動負債合計	200,003,066	-
負債合計	200,003,066	-
純資産の部		
元本等		
元本	10,507,344,028	11,275,777,123
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,235,525,127	4,593,924,900
純資産合計	14,742,869,155	15,869,702,023
負債純資産合計	14,942,872,221	15,869,702,023

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 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 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29年7月18日現在	平成30年1月18日現在
1．受益権の総数	10,507,344,028口	11,275,777,123口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4031円 (14,031円)	1.4074円 (14,074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29年7月18日現在	平成30年1月18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28年7月16日 至 平成29年7月18日	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	9,392,300,054円	10,507,344,028円
同期中追加設定元本額	1,716,140,836円	1,121,189,698円
同期中一部解約元本額	601,096,862円	352,756,603円
元本の内訳*		
ファンド名		
マルチアセット 動的アロケーションファンド 成長型（適格機関投資家専用）	142,929円	107,960円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 標準型（適格機関投資家専用）	893,249円	659,791円

マルチアセット 動的アロケーションファンド 安定型(適格機関投資家専用)	1,635,852円	1,161,253円
SNAM絶対収益ターゲットファンド(適格機関投資家専用)	- 円	120,791,605円
損保ジャパン日本債券ファンド	1,038,243,406円	1,024,672,954円
ハッピーエイジング20	129,771,038円	147,149,254円
ハッピーエイジング30	644,416,445円	721,641,306円
ハッピーエイジング40	3,234,668,548円	3,529,522,234円
ハッピーエイジング50	2,539,134,299円	2,689,612,897円
ハッピーエイジング60	2,316,004,234円	2,349,557,803円
パン・アフリカ株式ファンド	17,629,944円	18,596,746円
人民元建て債券ファンド	1,565,691円	1,203,351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	3,929,341円	3,290,602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	32,239,394円	24,060,253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	515,565,526円	418,628,166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	810,497円	711,068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	22,875,580円	17,537,005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	1,211,116円	- 円
インド株式集中投資ファンド	4,091,128円	3,116,258円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	1,455,898円	3,735,708円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	833,693円	1,204,646円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	226,220円	510,626円
ターゲット・リターン戦略ファンド	- 円	198,305,637円
計	10,507,344,028円	11,275,777,123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29年7月18日現在	平成30年1月18日現在
資産の部		
流動資産		
預金	50,122,340	65,725,880
コール・ローン	74,616,474	479,108,203
国債証券	6,014,433,507	6,261,319,054
特殊債券	31,100,858	32,557,974
未収利息	36,584,316	37,796,728
前払費用	5,320,207	4,889,253
流動資産合計	6,212,177,702	6,881,397,092
資産合計	6,212,177,702	6,881,397,092
負債の部		
流動負債		
その他未払費用	300	-
流動負債合計	300	-
負債合計	300	-
純資産の部		
元本等		
元本	4,077,138,770	4,411,277,148
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,135,038,632	2,470,119,944
純資産合計	6,212,177,402	6,881,397,092
負債純資産合計	6,212,177,702	6,881,397,092

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られた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 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29年7月18日現在	平成30年1月18日現在
1. 受益権の総数	4,077,138,770口	4,411,277,148口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5237円 (15,237円)	1.5600円 (15,600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29年7月18日現在	平成30年1月18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28年7月16日 至 平成29年7月18日	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月18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	3,577,031,312円	4,077,138,770円
同期中追加設定元本額	644,225,758円	393,966,612円
同期中一部解約元本額	144,118,300円	59,828,234円
元本の内訳*		
ファンド名		
マルチアセット 動的アロケーションファンド 成長型（適格機関投資家専用）	48,223円	54,673円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 標準型（適格機関投資家専用）	68,890円	75,340円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 安定型（適格機関投資家専用）	365,899円	365,899円
SNAM絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用）	- 円	13,639,617円
ハッピーエイジング20	360,970,197円	412,823,920円
ハッピーエイジング30	1,493,721,979円	1,673,097,069円
ハッピーエイジング40	1,363,288,079円	1,440,024,456円
ハッピーエイジング50	454,352,592円	467,419,148円
ハッピーエイジング60	157,266,527円	155,159,217円
損保ジャパン外国債券ファンド（為替ヘッジなし）	246,666,588円	247,706,972円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	162,529円	562,171円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	106,895円	151,194円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	120,372円	197,472円
計	4,077,138,770円	4,411,277,148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29年7月18日現在	平成30年1月18日現在
資産の部		
流動資産		
預金	351,958,256	282,586,472
コール・ローン	164,088,397	303,305,816
株式	10,404,710,632	11,822,858,729
投資証券	277,452,688	202,595,423
未収入金	9,270,920	387,317
未収配当金	14,982,382	9,470,449
流動資産合計	11,222,463,275	12,621,204,206
資産合計	11,222,463,275	12,621,204,206
負債の部		
流動負債		
その他未払費用	1,108	-
流動負債合計	1,108	-
負債合計	1,108	-
純資産の部		
元本等		
元本	6,215,139,503	6,270,842,292
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,007,322,664	6,350,361,914
純資産合計	11,222,462,167	12,621,204,206
負債純資産合計	11,222,463,275	12,621,204,206

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年7月18日現在	平成30年1月18日現在
1. 受益権の総数	6,215,139,503口	6,270,842,292口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8057円 (18,057円)	2.0127円 (20,127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29年7月18日現在	平成30年1月18日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載していません。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	自 平成28年7月16日 至 平成29年7月18日	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	6,523,191,242円	6,215,139,503円
同期中追加設定元本額	601,872,439円	274,218,276円
同期中一部解約元本額	909,924,178円	218,515,487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）	764,374,596円	762,767,952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）	943,935,036円	935,467,225円
ハッピーエイジング20	1,701,441,371円	1,771,821,492円
ハッピーエイジング30	1,344,088,300円	1,368,776,052円
ハッピーエイジング40	1,090,490,443円	1,078,494,923円
ハッピーエイジング50	283,209,408円	272,772,818円
ハッピーエイジング60	87,600,349円	80,741,830円
計	6,215,139,503円	6,270,842,292円

*当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

ハッピーエイジング20

平成30年1月31日現在

資産総額	10,662,644,035円
負債総額	16,225,299円
純資産総額（ - ）	10,646,418,736円
発行済数量	6,827,074,885口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.5594円

ハッピーエイジング30

平成30年1月31日現在

資産総額	12,914,140,668円
負債総額	16,625,268円
純資産総額（ - ）	12,897,515,400円
発行済数量	8,234,743,309口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.5662円

ハッピーエイジング40

平成30年1月31日現在

資産総額	15,187,279,263円
負債総額	16,216,563円
純資産総額（ - ）	15,171,062,700円
発行済数量	9,937,653,640口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.5266円

ハッピーエイジング50

平成30年1月31日現在

資産総額	6,702,902,840円
負債総額	12,223,783円
純資産総額（ - ）	6,690,679,057円
発行済数量	4,643,722,995口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.4408円

ハッピーエイジング60

平成30年1月31日現在

資産総額	4,031,599,973円
負債総額	5,375,569円
純資産総額（ - ）	4,026,224,404円
発行済数量	3,099,848,087口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.2988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30年1月31日現在

資産総額	40,781,632,379円
負債総額	0円
純資産総額 (-)	40,781,632,379円
発行済数量	19,655,739,277口
1単位当りの純資産額 (/)	2.0748円

S J A M スモールキャップ・マザーファンド

平成30年1月31日現在

資産総額	8,723,063,599円
負債総額	39,408,164円
純資産総額 (-)	8,683,655,435円
発行済数量	3,127,419,334口
1単位当りの純資産額 (/)	2.7766円

損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成30年1月31日現在

資産総額	16,015,507,583円
負債総額	0円
純資産総額 (-)	16,015,507,583円
発行済数量	11,368,530,075口
1単位当りの純資産額 (/)	1.4088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30年1月31日現在

資産総額	6,939,257,694円
負債総額	0円
純資産総額 (-)	6,939,257,694円
発行済数量	4,521,155,302口
1単位当りの純資産額 (/)	1.5348円

損保ジャパン - T C W 外国株式マザーファンド

平成30年1月31日現在

資産総額	12,411,271,479円
負債総額	0円
純資産総額 (-)	12,411,271,479円
発行済数量	6,247,902,022口
1単位当りの純資産額 (/)	1.9865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29年7月末現在）

（略）

(2) 会社の機構（平成29年7月末現在）

（略）

<訂正後>

(1) 資本金の額（平成30年1月末現在）

（略）

(2) 会社の機構（平成30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29年7月末現在、計144本（追加型株式投資信託120本、単位型株式投資信託13本、単位型公社債投資信託11本）であり、その純資産総額の合計は691,938百万円です。

<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30年1月末現在、計147本（追加型株式投資信託119本、単位型株式投資信託14本、単位型公社債投資信託14本）であり、その純資産総額の合計は740,519百万円です。

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28年4月1日から平成29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33期中間会計期間(平成29年4月1日から平成29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】

		前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
区分	注記 番号	金額(千円)	金額(千円)
(資産の部)			
流動資産			
1 現金・預金		4,375,837	5,032,858
2 前払費用		81,218	77,585
3 未収委託者報酬		754,788	760,025
4 未収運用受託報酬		521,498	788,836
5 未収収益		149	57
6 繰延税金資産		137,932	63,421
7 その他		421	22,446
流動資産合計		5,871,846	6,745,230
固定資産			
1 有形固定資産			
(1) 建物	* 1	37,899	31,748
(2) 器具備品	* 1	13,712	12,253
有形固定資産合計		51,612	44,002
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		128,043	47,562
(2) 長期差入保証金		161,598	161,598
(3) 繰延税金資産		133,008	161,300
(4) その他		29	30
投資その他の資産合計		422,678	370,490
固定資産合計		478,826	419,028
資産合計		6,350,672	7,164,258

区分	注記 番号	前事業年度 (平成28年3月31日)		当事業年度 (平成29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			3,485		82,284
2 未払金					
(1) 未払配当金	* 2	500,000		500,000	
(2) 未払手数料		333,031		340,633	
(3) その他未払金		107,732	940,764	160,613	1,001,247
3 未払費用			429,958		691,223
4 未払消費税等			71,725		10,617
5 未払法人税等			346,936		143,251
6 前受収益			26,746		7,954
7 賞与引当金			58,159		120,025
8 役員賞与引当金			9,600		9,000
流動負債合計			1,887,376		2,065,604
固定負債					
1 退職給付引当金			75,674		90,737
2 資産除去債務			7,898		8,039
固定負債合計			83,572		98,776
負債合計			1,970,949		2,164,380
(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			2,424,248		3,035,695
利益剰余金合計			2,424,248		3,035,695
株主資本合計			4,387,528		4,998,975
評価・換算差額等					
1 その他有価証券評価差額金			7,804		902
評価・換算差額等合計			7,804		902
純資産合計			4,379,723		4,999,878
負債・純資産合計			6,350,672		7,164,258

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1 委託者報酬		7,038,975		5,363,843	
2 運用受託報酬		2,535,301	9,574,276	3,816,308	9,180,152
営業費用					
1 支払手数料		3,508,448		2,890,668	
2 広告宣伝費		16,724		15,637	
3 公告費		610		2,970	
4 調査費		2,046,339		2,245,765	
(1) 調査費		622,284		780,172	
(2) 委託調査費		1,420,590		1,461,574	
(3) 図書費		3,465		4,018	
5 営業雑経費		182,596		190,147	
(1) 通信費		17,360		16,450	
(2) 印刷費		151,371		160,333	
(3) 諸会費		13,864	5,754,719	13,363	5,345,189
一般管理費					
1 給料		1,299,501		1,361,632	
(1) 役員報酬		83,689		75,948	
(2) 給料・手当		1,107,914		1,147,148	
(3) 賞与		107,897		138,535	
2 福利厚生費		109,923		134,150	
3 交際費		11,516		9,622	
4 寄付金		300		300	
5 旅費交通費		38,774		36,626	
6 法人事業税		29,306		41,868	
7 租税公課		7,391		13,856	
8 不動産賃借料		214,575		212,520	
9 退職給付費用		47,701		50,781	
10 賞与引当金繰入		58,159		120,025	

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
11 役員賞与引当金繰入		9,600		9,000	
12 固定資産減価償却費		13,042		10,429	
13 諸経費		205,813	2,045,605	260,939	2,261,753
営業利益			1,773,952		1,573,209
営業外収益					
1 受取配当金		90		90	
2 受取利息		657		280	
3 有価証券売却益		19		-	
4 有価証券償還益		-		745	
5 為替差益		-		9,721	
6 雑益		6,407	7,173	2,066	12,904
営業外費用					
1 有価証券売却損		-		6	
2 為替差損		100		-	
3 雑損		0	100	8	14
経常利益			1,781,026		1,586,098
特別損失					
1 固定資産除却損	* 1	663	663	0	0
税引前当期純利益			1,780,362		1,586,098
法人税、住民税及び事業 税			659,040		428,835
法人税等調整額			52,602		45,816
当期純利益			1,173,924		1,111,446

（ 3 ） 【 株主資本等変動計算書 】

前事業年度（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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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	2,424,248	2,424,248	4,387,528
当期変動額						
剰余金の配当				500,000	500,000	500,000
当期純利益				1,111,446	1,111,446	1,111,446
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	611,446	611,446	611,446
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,035,695	3,035,695	4,998,975

	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
当期変動額			
剰余金の配当			500,000
当期純利益			1,111,446
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	8,707	8,707	8,707
当期変動額合計	8,707	8,707	620,154
当期末残高	902	902	4,999,878

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

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

有形固定資産

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

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。

（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）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得する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。

これによる当事業年度の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）を当事業年度から適用しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

* 1 . 有形固定資産の減価償却累計額は、次のとおりであります。

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
建物	72,167千円	78,317千円
器具備品	44,838	44,893

* 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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
未払金		
未払配当金	500,000千円	500,000千円

（損益計算書関係）

* 1 . 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	当事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
器具備品	663千円	0千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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。

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

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、そのほとんどが信託財産から支払われるため、回収リスクは僅少であります。

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) 未収委託者報酬	754,788	754,788	-
(3) 未収運用受託報酬	521,498	521,498	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	112,293	112,293	-
資産計	5,764,418	5,764,418	-

当事業年度(平成29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	5,032,858	5,032,858	-
(2) 未収委託者報酬	760,025	760,025	-
(3) 未収運用受託報酬	788,836	788,836	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	31,812	31,812	-
資産計	6,613,532	6,613,532	-

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、(2) 未収委託者報酬、及び(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 投資有価証券

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

注2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

区分	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
非上場株式	15,750	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、「(4) 投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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) 未収委託者報酬	754,788	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	521,498	-	-	-
(4) 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	5,651,803	96	112,197	-

当事業年度（平成29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	5,032,643	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	760,025	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	788,836	-	-	-
(4) 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	-	15,266	-	16,545
合計	6,581,505	15,266	-	16,545

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

該当事項はありません。

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

当事業年度（平成29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	16,545	15,200	1,345
	小 計	16,545	15,200	1,345
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	15,266	15,306	40
	小 計	15,266	15,306	40
合計		31,812	30,506	1,305

5．売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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	3,993	-	6
合計	3,993	-	6

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要（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

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
	退職給付引当金の期首残高	64,308	千円	75,674
退職給付費用	17,374		21,913	
退職給付の支払額	6,008		6,850	
退職給付引当金の期末残高	75,674		90,737	

(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

	前事業年度 (平成28年3月31日)		当事業年度 (平成29年3月31日)	
	非積立型制度の退職給付債務	75,674	千円	90,737
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	75,674		90,737	
退職給付引当金	75,674		90,737	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	75,674		90,737	

(3) 退職給付費用

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	17,374 千円	21,913 千円

3. 確定拠出制度

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
当社の確定拠出制度への要拠出額	10,921 千円	12,945 千円

(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28年3月31日)	当事業年度 (平成29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	110,523千円	127,409千円
賞与引当金	17,947	37,039
退職給付引当金	23,200	27,800
未払費用否認	88,021	18,239
繰延資産損金算入限度超過額	7,634	7,090
未払事業税	22,641	6,351
その他	6,579	4,335
繰延税金資産小計	276,547	228,266
評価性引当額	4,900	2,554
繰延税金資産合計	271,647	225,712
繰延税金負債		
固定資産除去価額	707	588
その他有価証券評価差額金	-	402
繰延税金負債合計	707	990
繰延税金資産の純額	270,940	224,721

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。

（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27年4月1日 至 平成28年3月31日）	（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）
期首残高	7,760千円	7,898千円
時の経過による調整額	137	140
期末残高	7,898	8,039

（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。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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

(単位：千円)

日本	欧州	アジア	合計
7,945,745	1,208,415	25,991	9,180,152

(注) 営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えているため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益
A社(注)	1,038,124

(注) A社との間で守秘義務契約を負っているため、社名の公表は控えております。

（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
該当事項はありません。

（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。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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	157,531	未収運用受託報酬	86,309
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	400,493	未払手数料	97,637

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

SOMP O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27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	181,844.45円	207,593.03円
1株当たり当期純利益金額	48,740.88円	46,146.84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27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
当期純利益(千円)	1,173,924	1,111,446
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)	1,173,924	1,111,446
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33期中間会計期間 (平成29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		4,215,136
2 前払費用		91,698
3 未収委託者報酬		881,780
4 未収運用受託報酬		951,939
5 未収収益		63
6 繰延税金資産		52,329
7 その他		2,373
流動資産合計		6,195,319
固定資産		
1 有形固定資産	1	40,489
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		60,681
(2) 長期差入保証金		161,598
(3) 繰延税金資産		185,920
(4) その他		30
投資その他の資産合計		408,229
固定資産合計		453,254
資産合計		6,648,573

		第33期中間会計期間 (平成29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		13,359
2 未払金		
(1) 未払手数料		337,424
(2) その他未払金		174,571
未払金合計		511,996
3 未払費用		592,557
4 未払法人税等		121,912
5 前受収益		3,747
6 賞与引当金		80,017
7 役員賞与引当金		1,800
8 その他	2	27,057
流動負債合計		1,352,448
固定負債		
1 退職給付引当金		100,600
2 資産除去債務		8,110
固定負債合計		108,711
負債合計		1,461,159

		第33期中間会計期間 (平成29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		3,221,690
利益剰余金合計		3,221,690
株主資本合計		5,184,970
評価・換算差額等		
1 その他有価証券評価差額金		2,443
評価・換算差額等合計		2,443
純資産合計		5,187,414
負債・純資産合計		6,648,573

(2) 中間損益計算書

		第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29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		2,469,535	
2 運用受託報酬		1,462,281	3,931,816
営業費用			
1 支払手数料		1,187,891	
2 広告宣伝費		8,934	
3 公告費		1,770	
4 調査費		1,175,544	
(1) 調査費		442,104	
(2) 委託調査費		731,058	
(3) 図書費		2,381	
5 営業雑経費		99,171	
(1) 通信費		2,991	
(2) 印刷費		83,337	
(3) 諸会費		12,842	2,473,312
一般管理費			
1 給料		696,733	
(1) 役員報酬		40,340	
(2) 給料・手当		601,168	
(3) 賞与		55,224	
2 福利厚生費		82,614	
3 交際費		3,239	
4 旅費交通費		20,153	
5 法人事業税		18,186	
6 租税公課		3,619	
7 不動産賃借料		103,565	
8 退職給付費用		21,725	
9 賞与引当金繰入		80,017	
10 役員賞与引当金繰入		1,800	
11 固定資産減価償却費	1	3,512	
12 諸経費		149,357	1,184,525
営業利益			273,978

		第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29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		91	
2 受取利息		164	
3 有価証券売却益		15	
4 為替差益		3,183	
5 雑益		1,146	4,601
営業外費用			
1 雑損		71	71
経常利益			278,509
税引前中間純利益			278,509
法人税、住民税及び事業税			106,718
法人税等調整額			14,204
中間純利益			185,995

(3) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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	3,035,695	3,035,695	4,998,975
当中間期変動額						
中間純利益				185,995	185,995	185,995
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	-	-	-	185,995	185,995	185,995
当中間期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,221,690	3,221,690	5,184,970

	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	902	902	4,999,878
当中間期変動額			
中間純利益			185,995
株主資本以外の項目の当 中間期変動額（純額）	1,540	1,540	1,540
当中間期変動額合計	1,540	1,540	187,536
当中間期末残高	2,443	2,443	5,187,414

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

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

有形固定資産

定額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

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。

（会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

（減価償却方法の変更）

当社は、有形固定資産の減価償却方法について、従来、定率法（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）を採用しておりましたが、当中間会計期間より定額法に変更しております。

これは、当社の属するSOMP Oホールディングスグループの有形固定資産の減価償却方法に関する会計方針が変更されることを契機として、当社における有形固定資産の使用実態を改めて検討した結果、耐用年数にわたり安定的に使用されると見込まれ、耐用年数にわたって均等に費用配分することが実態をより適正に表すものと判断したことによるものであります。

この変更による当中間会計期間の経常利益及び税引前中間純利益に与える影響は軽微であります。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

		第33期中間会計期間 (平成29年9月30日)
1	有形固定資産の減価償却累計額	126,348千円
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」に含めて表示してあります。

（中間損益計算書関係）

		第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
1	減価償却実施額 有形固定資産	3,512千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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33期中間会計期間（平成29年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成29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	4,215,136	4,215,136	-
(2) 未収委託者報酬	881,780	881,780	-
(3) 未収運用受託報酬	951,939	951,939	-
(4) 投資有価証券			
その他有価証券	44,931	44,931	-
資産計	6,093,786	6,093,786	-

注1. 金融商品の時価の算定方法及び有価証券取引に関する事項

資産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 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）

	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、「(4) 投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第33期中間会計期間（平成29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

該当事項はありません。

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	43,657	40,100	3,557
	小 計	43,657	40,100	3,557
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	1,273	1,308	35
	小 計	1,273	1,306	35
合計		44,931	41,408	3,522

（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33期中間会計期間（平成29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	8,039千円
時の経過による調整額	71千円
中間期末残高	8,110千円

（セグメント情報等）

セグメント情報

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29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33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29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33期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）
1株当たり純資産額	215,379.46円
1株当たり中間純利益金額	7,722.45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33期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）
中間純利益	185,995千円
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	185,995千円
普通株式の期中平均株式数	24,085株

（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29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29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

名称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
エース証券株式会社	8,831	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	
株式会社 S B I 証券	48,323	
岡三にいがた証券株式会社	852	
カブドットコム証券株式会社	7,196	
損保ジャパン日本興亜 D C 証券株式会社	3,000	
高木証券株式会社	11,069	
マネックス証券株式会社	12,200	
みずほ証券株式会社	125,167	
楽天証券株式会社	7,495	
松井証券株式会社	11,945	
静岡東海証券株式会社	600	
株式会社みずほ銀行	1,404,065	
株式会社大東銀行	14,743	
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。

資本金の額は、平成29年9月末現在

(3)投資顧問会社

TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY

資本金の額 148,451千ドル（平成28年12月末現在）

（17,293百万円、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。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年3月19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29年7月19日から平成30年1月18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30年1月18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29年7月19日から平成30年1月18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30年3月19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29年7月19日から平成30年1月18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30年1月18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29年7月19日から平成30年1月18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30年3月19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29年7月19日から平成30年1月18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30年1月18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29年7月19日から平成30年1月18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30年3月19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29年7月19日から平成30年1月18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30年1月18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29年7月19日から平成30年1月18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30年3月19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29年7月19日から平成30年1月18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30年1月18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29年7月19日から平成30年1月18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29年6月1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 伊藤志保 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29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29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29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29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29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29年4月1日から平成29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。