

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年4月16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 小嶋 信弘
【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
【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】	ハッピーエイジング20 募集額 2,000億円を上限とします。 ハッピーエイジング30 募集額 2,000億円を上限とします。 ハッピーエイジング40 募集額 2,000億円を上限とします。 ハッピーエイジング50 募集額 2,000億円を上限とします。 ハッピーエイジング60 募集額 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】

2018年10月12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】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示し、<更新後>の記載事項は原届出書の更新後の内容を示します。

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」において「1 財務諸表」は「中間財務諸表」を追加し、「2 ファンドの現況」は更新後の内容を記載しています。

## 第一部【証券情報】

## (4)【発行（売出）価格】

&lt;訂正前&gt;

(略)

ホームページ <http://www.sjnk-am.co.jp/>

&lt;訂正後&gt;

(略)

ホームページ <https://www.sjnk-am.co.jp/>

## (5)【申込手数料】

&lt;訂正前&gt;

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.16%（税抜 2.0%）を上限として販売会社が定めた手数料率を乗じて得た額です。

(略)

&lt;訂正後&gt;

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.16%<sup>\*</sup>（税抜 2.0%）を上限として販売会社が定めた手数料率を乗じて得た額です。

\* 消費税率が10%になった場合は、2.2%となります。

(略)

## (8)【申込取扱場所】

&lt;訂正前&gt;

(略)

ホームページ <http://www.sjnk-am.co.jp/>

&lt;訂正後&gt;

(略)

ホームページ <https://www.sjnk-am.co.jp/>

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

(略)

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

#### <ファンドの特色>

(略)

##### 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。  
2018年6月末現在の同グループの運用資産は、約1,983億米ドル(約21兆9,200億円\*)です。  
※2018年6月末時点の為替レートで換算。

(略)

<訂正後>

(略)

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

#### <ファンドの特色>

(略)

##### 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。  
2018年12月末現在の同グループの運用資産は、約1,906億米ドル(約21兆1,566億円\*)です。  
※2018年12月末時点の為替レートで換算。

(略)

##### (3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

委託会社等の概況

( ) 資本金の額 1,550百万円 (平成30年7月末現在)

(略)

( ) 大株主の状況 (平成30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 (2019年1月末現在)

(略)

( )大株主の状況(2019年1月末現在)

(略)

## 2【投資方針】

### (3)【運用体制】

<更新後>

#### a. 委託会社の運用体制と社内規程

(運用体制)

総合投資会議は、ファンドの基本運用方針の分析と決定を行います。

各資産投資戦略会議は、総合投資会議の基本運用方針に基づき、ファンドの運用戦略を決定し、各運用担当部が運用計画を策定します。

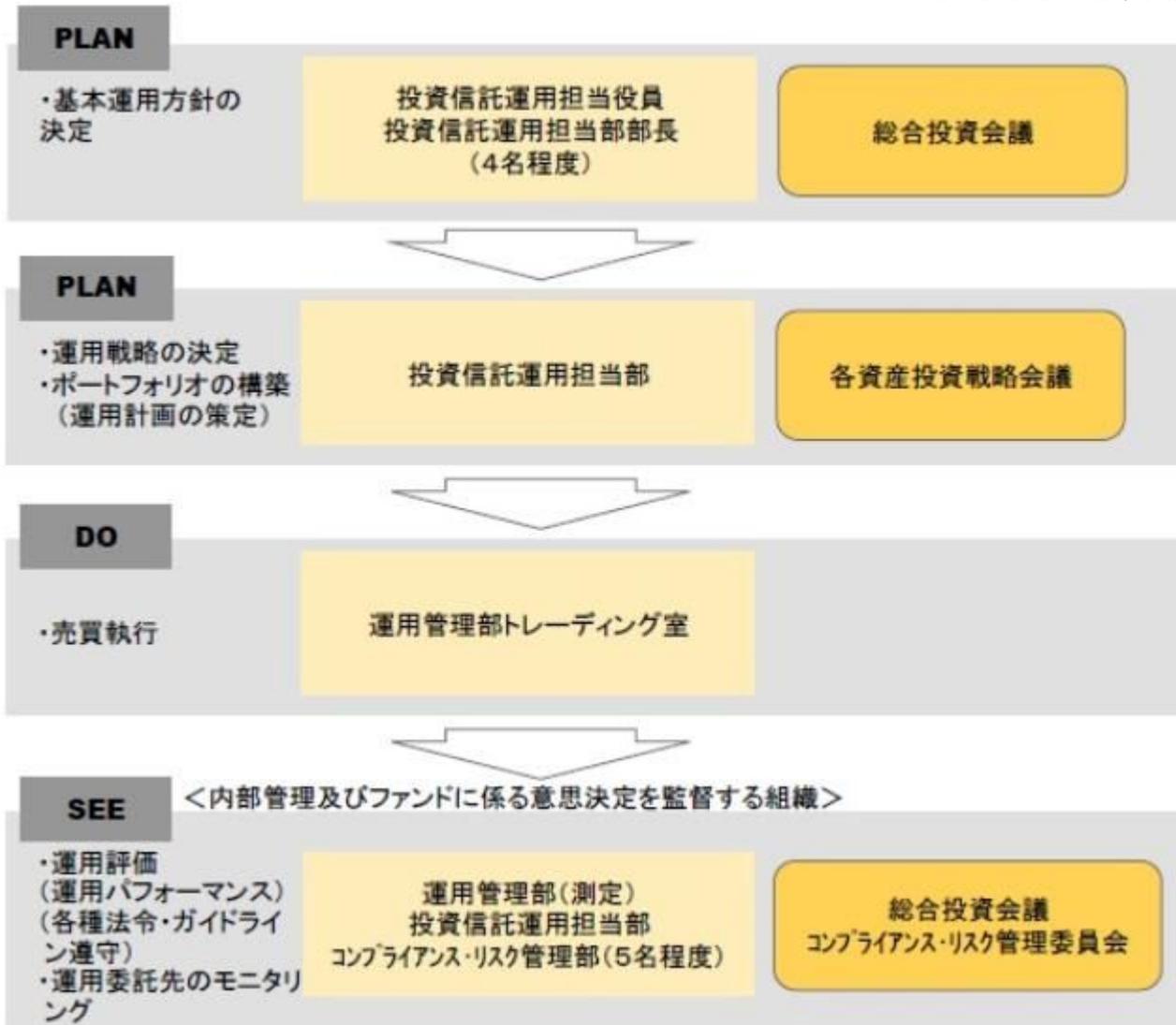
各運用担当部で策定された運用計画に基づき、運用管理部トレーディング室が最良執行の観点から売買を執行します。

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

(社内規程)

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

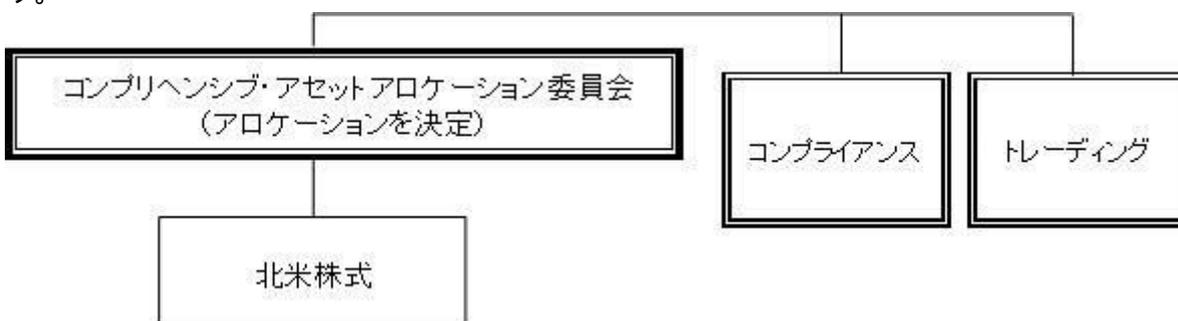
また、外部委託先の管理体制については、当社が当社以外の者に業務を委託するときの基本事項等を定めた「外部委託管理規程」に従い、定期モニタリング等を実施しています。



2019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

損保ジャパン-T C W外国株マザーファンドの運用委託先であるT C Wでは、主に資産配分を担当するコンプライアンス・アセットアロケーション委員会ならびに各プロダクト毎に編成されたチームが連携して運用を行っております。また、コンプライアンス部門によるチェック体制も保持しています。



(本組織図は、2019年1月末現在のものであり、今後変更されることもあります。)

### 3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

## <リスクの管理体制>

### a. 委託会社のリスク管理体制

(略)

(注) 上図は、平成30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

2013年8月～2018年7月

ファンドと他の代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

2013年8月～2018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	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。

<訂正後>

(略)

## &lt;リスクの管理体制&gt;

a. 委託会社のリスク管理体制

(略)

(注) 上図は、2019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

2014年2月～2019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

2014年2月～2019年1月

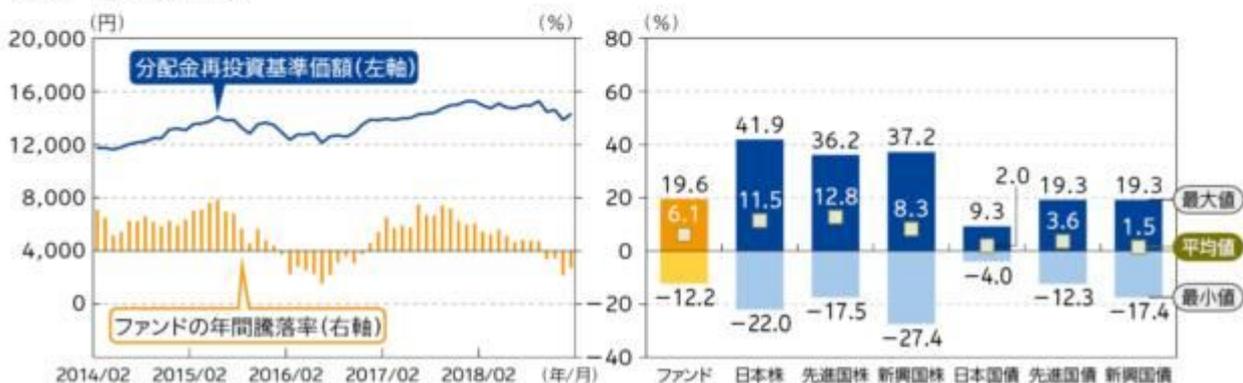
## ハッピーエイジング20



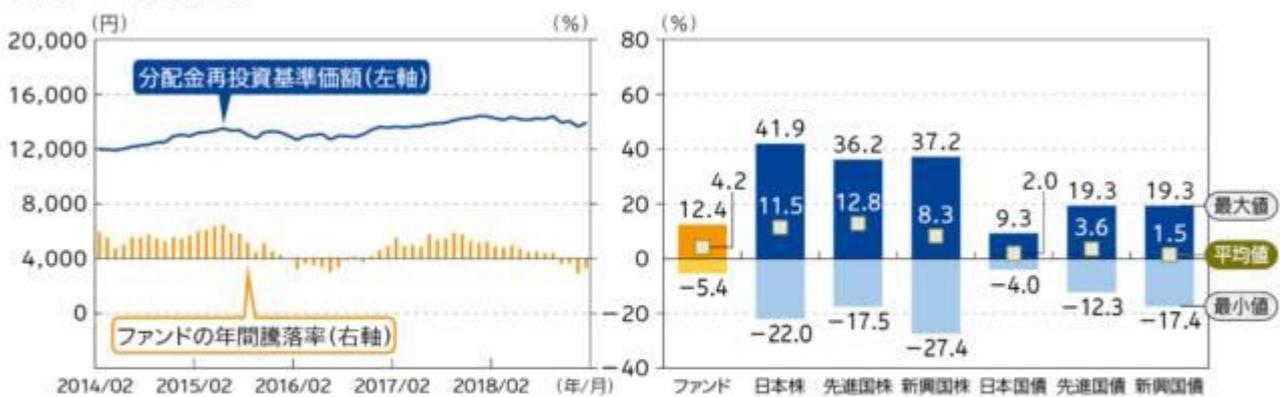
## ハッピーエイジング30



## 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年の各月末におけるグラフになります。

- 「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。

## 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。

## 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。

## 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。

## 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。

## 新興国債:J.P.モルガンG B I - E M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】

## (1)【申込手数料】

&lt;訂正前&gt;

&lt;申込み時に受益者が負担する費用・税金&gt;

時期	項目	費用・税金	
申込み時	申込手数料 及び 消費税等相 当額	申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準 価額に、2.16%（税抜 2.0%）を上限として販売 会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。 申込手数料率の詳細につきましては、販売会社 までお問い合わせください。	販売会社によるファ ンドの商品説明・投 資環境の説明・事務 処理等の対価

(略)

&lt;訂正後&gt;

&lt;申込み時に受益者が負担する費用・税金&gt;

時期	項目	費用・税金	
申込み時	申込手数料 及び 消費税等相 当額	申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準 価額に、2.16% <sup>*</sup> （税抜 2.0%）を上限として販 売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額で す。 <u>*消費税率が10%になった場合は、2.2%となり ます。</u> 申込手数料率の詳細につきましては、販売会社 までお問い合わせください。	販売会社によるファ ンドの商品説明・投 資環境の説明・事務 処理等の対価

(略)

## (3) 【信託報酬等】

&lt;訂正前&gt;

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。

(略)

<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対して以下の率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も下表のとおりです（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
		ファンドの運用の対価	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等の対価
ハッピー エイジング 20	1.5876% <sup>*1</sup> (税抜1.470%)	0.590%	0.830%	0.050%
ハッピー エイジング 30	1.4580% <sup>*2</sup> (税抜1.350%)	0.530%	0.770%	0.050%
ハッピー エイジング 40	1.2960% <sup>*3</sup> (税抜1.200%)	0.470%	0.680%	0.050%
ハッピー エイジング 50	1.1124% <sup>*4</sup> (税抜1.030%)	0.410%	0.570%	0.050%
ハッピー エイジング 60	0.9288% <sup>*5</sup> (税抜0.860%)	0.350%	0.460%	0.050%

\* 消費税率が10%になった場合は、\*1が1.617%、\*2が1.485%、\*3が1.320%、\*4が1.133%、\*5が0.946%となります。

信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末、または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

(略)

(4) 【その他の手数料等】

<訂正前>

(略)

委託会社は、前記 に定める信託事務の処理に要する諸費用のうち監査費用の支払いを信託財産のためにいき、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。この場合、信託財産にかかる監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、実際の費用額（年間27万円（税抜25万円））を上限として、純資産総額に定率（年0.004752%（税抜0.0044%））を乗じて日々計算し、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産からその支弁を受けることとします。なお、監査費用の上限金額については、変動する可能性があります。

(略)

<訂正後>

(略)

委託会社は、前記 に定める信託事務の処理に要する諸費用のうち監査費用の支払いを信託財産のためにいき、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。この場合、信託財産にかかる監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、実際の費用額（年間27万円<sup>\*1</sup>（税抜25万円））を上限として、純資産総額に定率（年0.004752%<sup>\*2</sup>（税抜0.0044%））を乗じて日々計算し、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産からその支弁を受けることとします。なお、監査費用の上限金額については、変動する可能性があります。

\*消費税率が10%になった場合は、\*1が年間27.5万円、\*2が年0.00484%となります。

(略)

## （５）【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

上記は平成30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2019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】

### （１）【投資状況】

ハッピーエイジング20

2019年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
-------	----	---------	---------

投資信託受益証券	アメリカ	484,005,426	4.80
親投資信託受益証券	日本	9,386,886,830	93.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		214,856,859	2.13
純資産総額		10,085,749,115	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。

### ハッピーエイジング30

2019年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	600,528,255	4.86
親投資信託受益証券	日本	11,492,222,807	92.97
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		269,035,629	2.17
純資産総額		12,361,786,691	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。

### ハッピーエイジング40

2019年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	737,051,354	4.79
親投資信託受益証券	日本	14,316,127,024	92.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		349,256,794	2.26
純資産総額		15,402,435,172	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。

### ハッピーエイジング50

2019年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	223,744,636	3.11
親投資信託受益証券	日本	6,837,669,648	94.96
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		139,512,691	1.93
純資産総額		7,200,926,975	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。

## ハッピーエイジング60

2019年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	4,347,733,196	98.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		88,632,312	2.00
純資産総額		4,436,365,508	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。

（参考）S J A M ラージキャップ・バリュース・マザーファンド

2019年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	28,189,734,040	99.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		278,694,647	0.98
純資産総額		28,468,428,687	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。

（参考）S J A M スモールキャップ・マザーファンド

2019年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	8,586,440,700	99.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		58,721,280	0.68
純資産総額		8,645,161,980	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。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2019年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	9,988,987,800	62.25
	メキシコ	100,107,000	0.62
		10,089,094,800	62.87
特殊債券	日本	494,102,778	3.08
社債券	日本	4,764,705,600	29.69

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		699,873,847	4.36
純資産総額		16,047,777,025	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。

(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

2019年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	2,626,093,343	35.75
	ドイツ	1,174,392,283	15.99
	フランス	1,007,286,844	13.71
	イギリス	458,957,490	6.25
	イタリア	434,986,365	5.92
	スペイン	222,059,641	3.02
	ベルギー	199,229,113	2.71
	カナダ	147,914,840	2.01
	オーストラリア	140,855,149	1.92
	オランダ	72,529,549	0.99
	メキシコ	60,452,319	0.82
	アイルランド	57,044,122	0.78
	ポーランド	44,533,254	0.61
	デンマーク	36,659,580	0.50
	マレーシア	30,693,931	0.42
	スウェーデン	29,026,124	0.40
ノルウェー	16,214,808	0.22	
		6,758,928,755	92.01
特殊債券	南アフリカ	29,100,064	0.40
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		557,776,354	7.59
純資産総額		7,345,805,173	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。

(参考) 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド

2019年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	8,827,506,962	73.34
	アイルランド	395,310,252	3.28
	イギリス	316,940,214	2.63
	スイス	295,796,626	2.46
	フランス	233,882,484	1.94

	ドイツ	218,711,108	1.82
	オランダ	206,943,901	1.72
	バミューダ	177,486,579	1.47
	カナダ	128,215,161	1.07
	オーストラリア	103,454,420	0.86
	シンガポール	74,228,459	0.62
	スウェーデン	56,046,196	0.47
	ジャージー	49,685,173	0.41
	ケイマン	44,624,052	0.37
	スペイン	35,510,016	0.30
	デンマーク	20,449,462	0.17
	プエルトリコ	18,470,981	0.15
	香港	15,267,888	0.13
		11,218,529,934	93.21
投資信託受益証券	アメリカ	46,124,027	0.38
投資証券	アメリカ	217,288,075	1.81
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		553,698,318	4.60
純資産総額		12,035,640,354	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

2019年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （%）
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - T C W外国株式マ ザーファンド	1,787,105,728	2.0498	3,663,209,322	1.8741	3,349,214,844	33.21
2	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド	1,122,353,283	2.5712	2,885,794,762	2.3333	2,618,786,915	25.97
3	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mラージキャップ・パ リユー・マザーファンド	1,447,957,958	1.9127	2,769,619,477	1.8060	2,615,012,072	25.93
4	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	397,779,043	1.5418	613,310,448	1.5165	603,231,918	5.98
5	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	86,539	5,535.16	479,007,903	5,592.91	484,005,426	4.80
6	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファ ンド	139,819,569	1.4233	199,005,548	1.4350	200,641,081	1.99

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2019年1月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	4.80
親投資信託受益証券	93.07
合計	97.87

（注1）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

2019年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド	1,164,168,214	2.5591	2,979,222,877	2.3333	2,716,353,693	21.97
2	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mラージキャップ・パ リビュー・マザーファンド	1,502,157,883	1.9071	2,864,859,869	1.8060	2,712,897,136	21.95
3	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - T C W外国株式マ ザーファンド	1,394,398,221	2.0364	2,839,552,538	1.8741	2,613,241,705	21.14
4	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	1,625,887,647	1.5425	2,508,064,804	1.5165	2,465,658,616	19.95
5	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファ ンド	685,764,221	1.4244	976,845,602	1.4350	984,071,657	7.96
6	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	107,373	5,521.00	592,806,676	5,592.91	600,528,255	4.86

（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

2019年1月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	4.86
親投資信託受益証券	92.97
合計	97.82

（注1）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

2019年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファン ド	3,528,996,867	1.4242	5,026,341,475	1.4350	5,064,110,504	32.88
2	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド	1,023,075,590	2.5403	2,598,918,922	2.3333	2,387,142,274	15.50
3	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mラージキャップ・パ リユー・マザーファンド	1,320,370,133	1.8942	2,501,142,130	1.8060	2,384,588,460	15.48
4	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	1,521,296,272	1.5436	2,348,357,550	1.5165	2,307,045,796	14.98
5	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - T C W外国株式マ ザーファンド	1,159,617,945	2.0172	2,339,189,673	1.8741	2,173,239,990	14.11
6	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	131,783	5,512.28	726,425,638	5,592.91	737,051,354	4.79

（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

2019年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	4.79
親投資信託受益証券	92.95
合計	97.73

（注1）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

2019年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファン ド	2,853,620,244	1.4241	4,063,988,845	1.4350	4,094,945,050	56.87
2	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	522,280,137	1.5441	806,454,885	1.5165	792,037,827	11.00
3	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド	293,630,814	2.5326	743,649,400	2.3333	685,128,778	9.51
4	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mラージキャップ・パ リユー・マザーファンド	378,811,539	1.8921	716,749,313	1.8060	684,133,639	9.50
5	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - T C W外国株式マ ザーファンド	310,241,905	2.0041	621,755,802	1.8741	581,424,354	8.07
6	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	40,005	5,504.68	220,215,077	5,592.91	223,744,636	3.11

（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

2019年1月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	3.11
親投資信託受益証券	94.96
合計	98.06

（注1）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

2019年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザー ファンド	2,224,020,615	1.4242	3,167,550,433	1.4350	3,191,469,582	71.94
2	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	468,732,458	1.5440	723,743,171	1.5165	710,832,772	16.02
3	日本	親投資信託 受益証券	S J A M スモールキャップ・マ ザーファンド	76,301,377	2.5274	192,848,038	2.3333	178,034,002	4.01
4	日本	親投資信託 受益証券	S J A M ラージキャップ・バ リュール・マザーファンド	98,401,001	1.8932	186,292,776	1.8060	177,712,207	4.01
5	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - T C W 外国株式マ ザーファンド	47,854,775	1.9975	95,589,914	1.8741	89,684,633	2.02

（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

2019年1月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.00
合計	98.00

（注1）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）S J A M ラージキャップ・バリュール・マザーファンド

2019年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	株式	本田技研工業	輸送用機 器	653,300	3,545.11	2,316,020,363	3,249.00	2,122,571,700	7.46

2	日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	1,004,900	2,503.46	2,515,731,258	2,010.00	2,019,849,000	7.10
3	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	3,275,700	712.41	2,333,643,782	583.60	1,911,698,520	6.72
4	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	454,000	4,700.24	2,133,913,361	4,045.00	1,836,430,000	6.45
5	日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	4,061,300	609.37	2,474,865,856	441.90	1,794,688,470	6.30
6	日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	1,074,100	1,639.28	1,760,756,539	1,546.50	1,661,095,650	5.83
7	日本	株式	三菱重工業	機械	387,100	4,326.01	1,674,598,471	4,203.00	1,626,981,300	5.72
8	日本	株式	デンソー	輸送用機器	258,700	5,778.28	1,494,841,339	4,988.00	1,290,395,600	4.53
9	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,240,500	1,105.26	1,371,078,022	926.80	1,149,695,400	4.04
10	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	232,900	5,094.42	1,186,491,926	4,671.00	1,087,875,900	3.82
11	日本	株式	KDDI	情報・通信業	378,600	2,642.27	1,000,363,422	2,723.00	1,030,927,800	3.62
12	日本	株式	日本郵船	海運業	563,000	2,265.24	1,275,330,120	1,818.00	1,023,534,000	3.60
13	日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	539,200	2,158.07	1,163,632,503	1,759.50	948,722,400	3.33
14	日本	株式	日本碍子	ガラス・土石製品	493,100	1,821.89	898,377,208	1,670.00	823,477,000	2.89
15	日本	株式	ヤマダ電機	小売業	1,507,300	550.35	829,551,278	536.00	807,912,800	2.84
16	日本	株式	大和証券グループ本社	証券・商品先物取引業	1,376,000	712.91	980,966,623	541.80	745,516,800	2.62
17	日本	株式	三井住友トラスト・ホールディングス	銀行業	178,400	4,415.28	787,687,712	4,127.00	736,256,800	2.59
18	日本	株式	ジェイ・エフ・イーホールディングス	鉄鋼	347,600	2,434.82	846,344,977	1,914.50	665,480,200	2.34
19	日本	株式	クレディセゾン	その他金融業	433,400	1,771.71	767,859,935	1,430.00	619,762,000	2.18
20	日本	株式	日立製作所	電気機器	172,200	3,293.87	567,205,406	3,413.00	587,718,600	2.06
21	日本	株式	マツダ	輸送用機器	461,200	1,473.43	679,547,201	1,199.00	552,978,800	1.94
22	日本	株式	セイコーエプソン	電気機器	314,700	1,533.74	482,671,026	1,728.00	543,801,600	1.91
23	日本	株式	アイシン精機	輸送用機器	119,700	4,403.81	527,136,367	4,290.00	513,513,000	1.80
24	日本	株式	日本テレビホールディングス	情報・通信業	269,400	1,744.32	469,922,333	1,709.00	460,404,600	1.62
25	日本	株式	MS&ADインシュアランスグループホール	保険業	106,500	3,392.17	361,267,142	3,234.00	344,421,000	1.21
26	日本	株式	大林組	建設業	309,500	1,102.68	341,279,460	1,033.00	319,713,500	1.12
27	日本	株式	ツムラ	医薬品	92,000	3,485.84	320,697,532	3,165.00	291,180,000	1.02
28	日本	株式	A G C	ガラス・土石製品	55,100	3,624.68	199,720,007	3,685.00	203,043,500	0.71
29	日本	株式	ヤマハ発動機	輸送用機器	75,400	2,323.59	175,199,361	2,326.00	175,380,400	0.62
30	日本	株式	野村不動産ホールディングス	不動産業	70,800	2,081.01	147,335,784	2,113.00	149,600,400	0.53

(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及び業種別投資比率

2019年1月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
----	-------	----	----------

株式	国内	建設業	1.12
		医薬品	1.02
		ガラス・土石製品	3.61
		鉄鋼	9.43
		非鉄金属	5.83
		機械	5.72
		電気機器	3.97
		輸送用機器	20.39
		海運業	3.60
		情報・通信業	9.06
		小売業	2.84
		銀行業	15.75
		証券、商品先物取引業	8.92
		保険業	4.54
		その他金融業	2.18
不動産業	1.04		
合計		99.02	

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類及び各業種の時価の比率です。

（参考）S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

2019年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （%）
1	日本	株式	N O K	輸送用機器	167,900	1,809.16	303,757,964	1,753.00	294,328,700	3.40
2	日本	株式	シチズン時計	精密機器	457,600	686.22	314,014,272	580.00	265,408,000	3.07
3	日本	株式	伊予銀行	銀行業	432,000	695.14	300,300,480	601.00	259,632,000	3.00
4	日本	株式	東邦ホールディングス	卸売業	89,700	2,840.24	254,769,528	2,663.00	238,871,100	2.76
5	日本	株式	E I Z O	電気機器	51,700	4,591.73	237,392,441	4,220.00	218,174,000	2.52
6	日本	株式	青山商事	小売業	79,700	3,265.89	260,291,433	2,717.00	216,544,900	2.50
7	日本	株式	豊田合成	輸送用機器	84,200	2,635.38	221,898,996	2,371.00	199,638,200	2.31
8	日本	株式	オプトラン	機械	104,600	2,012.45	210,503,049	1,893.00	198,007,800	2.29
9	日本	株式	日本ライフライン	卸売業	118,000	2,100.76	247,889,680	1,649.00	194,582,000	2.25
10	日本	株式	住友倉庫	倉庫・運輸関連業	138,000	1,354.41	186,908,580	1,399.00	193,062,000	2.23
11	日本	株式	北越コーポレーション	パルプ・紙	326,000	603.41	196,711,660	589.00	192,014,000	2.22
12	日本	株式	興銀リース	その他金融業	76,300	2,843.19	216,935,397	2,504.00	191,055,200	2.21
13	日本	株式	ダイビル	不動産業	171,500	1,124.33	192,822,595	1,084.00	185,906,000	2.15
14	日本	株式	ジーエス・ユアサコーポレーション	電気機器	82,000	2,570.36	210,769,520	2,266.00	185,812,000	2.15
15	日本	株式	みらかホールディングス	サービス業	69,000	2,592.31	178,869,390	2,689.00	185,541,000	2.15
16	日本	株式	ノーリツ鋼機	精密機器	105,500	2,362.71	249,266,520	1,730.00	182,515,000	2.11
17	日本	株式	広島銀行	銀行業	281,800	725.91	204,561,438	630.00	177,534,000	2.05

18	日本	株式	リコーリース	その他金融業	53,000	3,628.86	192,329,580	3,330.00	176,490,000	2.04
19	日本	株式	エクセディ	輸送用機器	63,500	3,300.61	209,588,735	2,740.00	173,990,000	2.01
20	日本	株式	日立キャピタル	その他金融業	69,900	2,925.12	204,465,888	2,475.00	173,002,500	2.00
21	日本	株式	A D E K A	化学	99,000	1,740.73	172,332,270	1,714.00	169,686,000	1.96
22	日本	株式	北洋銀行	銀行業	580,600	347.67	201,857,202	291.00	168,954,600	1.95
23	日本	株式	A O K I ホールディングス	小売業	131,000	1,450.33	189,993,230	1,280.00	167,680,000	1.94
24	日本	株式	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	証券、商品先物取引業	333,400	569.04	189,717,936	478.00	159,365,200	1.84
25	日本	株式	ほくほくフィナンシャルグループ	銀行業	125,500	1,466.63	184,062,065	1,248.00	156,624,000	1.81
26	日本	株式	日立造船	機械	399,400	427.55	170,763,470	361.00	144,183,400	1.67
27	日本	株式	第四北越フィナンシャルグループ	銀行業	44,500	4,332.63	192,802,035	3,130.00	139,285,000	1.61
28	日本	株式	七十七銀行	銀行業	65,600	2,449.84	160,709,504	1,919.00	125,886,400	1.46
29	日本	株式	ゼビオホールディングス	小売業	98,200	1,563.75	153,560,250	1,274.00	125,106,800	1.45
30	日本	株式	シップヘルスケアホールディングス	卸売業	29,000	4,125.12	119,628,480	4,105.00	119,045,000	1.38

（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及び業種別投資比率

2019年1月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	鉱業	0.67
		建設業	0.53
		繊維製品	1.61
		パルプ・紙	2.22
		化学	3.06
		鉄鋼	3.12
		非鉄金属	1.85
		金属製品	1.22
		機械	3.96
		電気機器	9.84
		輸送用機器	11.09
		精密機器	7.81
		その他製品	0.89
		電気・ガス業	0.58
		倉庫・運輸関連業	2.23
		卸売業	6.39
		小売業	9.85
銀行業	16.60		
証券、商品先物取引業	1.84		

	その他金融業	6.92
	不動産業	3.11
	サービス業	3.93
合計		99.32

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類及び各業種の時価の比率です。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2019年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率(%)	償還日	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	1,330,000,000	99.94	1,329,332,100	101.42	1,348,912,600	0.1000000	2028/3/20	8.41
2	日本	国債証券	第396回利付国債(2年)	1,120,000,000	100.52	1,125,847,200	100.51	1,125,801,600	0.1000000	2021/1/1	7.02
3	日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	860,000,000	113.07	972,484,000	114.34	983,392,800	1.2000000	2035/9/20	6.13
4	日本	国債証券	第150回利付国債(20年)	680,000,000	117.24	797,232,000	117.30	797,646,800	1.4000000	2034/9/20	4.97
5	日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	670,000,000	100.18	671,261,900	101.73	681,611,100	0.1000000	2027/6/20	4.25
6	日本	国債証券	第38回利付国債(30年)	510,000,000	122.44	624,451,200	128.26	654,156,600	1.8000000	2043/3/20	4.08
7	日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	550,000,000	101.36	557,507,000	101.83	560,070,500	0.1000000	2026/12/20	3.49
8	日本	国債証券	第158回利付国債(20年)	500,000,000	100.23	501,164,200	102.49	512,455,000	0.5000000	2036/9/20	3.19
9	日本	国債証券	第35回利付国債(30年)	210,000,000	131.15	275,415,000	131.70	276,576,300	2.0000000	2041/9/20	1.72
10	日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	250,000,000	100.52	251,315,000	101.85	254,627,500	0.1000000	2026/9/20	1.59
11	日本	国債証券	第146回利付国債(20年)	210,000,000	120.18	252,385,800	121.23	254,601,900	1.7000000	2033/9/20	1.59
12	日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	180,000,000	122.23	220,014,000	121.94	219,492,000	2.1000000	2029/9/20	1.37
13	日本	国債証券	第57回利付国債(30年)	210,000,000	103.57	217,497,000	104.40	219,258,900	0.8000000	2047/12/20	1.37
14	日本	国債証券	第162回利付国債(20年)	210,000,000	99.70	209,384,200	103.64	217,658,700	0.6000000	2037/9/20	1.36
15	日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	200,000,000	103.51	207,022,000	103.75	207,502,000	0.5000000	2024/9/20	1.29
16	日本	社債券	第3回A号明治安田生命劣後FR	200,000,000	101.37	202,750,000	101.73	203,474,000	1.1100000	2047/11/6	1.27
17	日本	社債券	第568回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	102.07	204,140,800	101.40	202,808,000	1.1550000	2020/9/8	1.26

18	日本	社債券	第30回東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	100.28	200,560,200	100.37	200,740,000	0.3750000	2027/7/16	1.25
19	日本	社債券	第1回東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	100.37	200,752,000	100.14	200,286,000	0.3800000	2020/3/9	1.25
20	日本	社債券	第3回A号富国生命劣後FR	200,000,000	99.55	199,100,000	99.99	199,980,000	1.0200000	9999/99/99	1.25
21	日本	社債券	第12回東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	100.30	200,611,200	99.84	199,694,000	0.4400000	2023/4/19	1.24
22	日本	国債証券	第130回利付国債(20年)	160,000,000	121.00	193,608,000	120.90	193,449,600	1.8000000	2031/9/20	1.21
23	日本	国債証券	第148回利付国債(20年)	160,000,000	118.58	189,731,200	118.65	189,846,400	1.5000000	2034/3/20	1.18
24	日本	国債証券	第58回利付国債(30年)	170,000,000	102.79	174,748,600	104.31	177,330,400	0.8000000	2048/3/20	1.11
25	日本	国債証券	第60回利付国債(30年)	160,000,000	100.22	160,352,000	106.87	171,000,000	0.9000000	2048/9/20	1.07
26	日本	国債証券	第144回利付国債(20年)	110,000,000	118.02	129,826,400	118.10	129,916,600	1.5000000	2033/3/20	0.81
27	日本	社債券	第547回東京電力株式会社社債(一般担保付)	120,000,000	103.56	124,275,840	102.46	122,961,600	1.9480000	2020/7/24	0.77
28	日本	国債証券	第11回利付国債(40年)	110,000,000	93.07	102,377,000	101.97	112,172,500	0.8000000	2058/3/20	0.70
29	日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	110,000,000	101.01	111,111,000	101.19	111,310,100	0.1000000	2023/6/20	0.69
30	日本	国債証券	第395回利付国債(2年)	110,000,000	100.49	110,545,000	100.49	110,544,500	0.1000000	2020/12/1	0.69

(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。

(注3) 償還年月日が「9999/99/99」の銘柄は償還日の定めのない銘柄です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2019年1月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	62.87
特殊債券	3.08
社債券	29.69
合計	95.64

(注1) 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）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

2019年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	利率(%)	償還日	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	Treasury 1.875 220228	6,880,000	10,582.39	728,068,608	10,694.20	735,761,378	1.8750000	2022/2/28	10.02
2	ドイツ	国債証券	GERMANY 0.0 220408	4,530,000	12,736.23	576,951,263	12,714.98	575,989,034	0.0000000	2022/4/8	7.84
3	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 280215	4,560,000	10,697.66	487,813,593	10,956.36	499,610,192	2.7500000	2028/2/15	6.80
4	アメリカ	国債証券	Treasury 2.125 240229	4,040,000	10,516.27	424,857,485	10,691.70	431,944,680	2.1250000	2024/2/29	5.88
5	ドイツ	国債証券	GERMANY 0.5 280215	2,960,000	12,866.45	380,846,980	12,997.70	384,732,025	0.5000000	2028/2/15	5.24
6	フランス	国債証券	FRANCE 2.75 271025	2,450,000	14,904.15	365,151,681	15,035.52	368,370,264	2.7500000	2027/10/25	5.01
7	フランス	国債証券	FRANCE 0.0 220525	2,430,000	12,642.52	307,213,351	12,652.03	307,444,554	0.0000000	2022/5/25	4.19
8	アメリカ	国債証券	Treasury 3.0 480215	2,020,000	10,634.78	214,822,601	10,769.06	217,535,045	3.0000000	2048/2/15	2.96
9	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 250228	1,640,000	10,978.82	180,052,703	11,011.71	180,592,134	2.7500000	2025/2/28	2.46
10	イタリア	国債証券	ITALY 2.2 270601	1,390,000	12,015.65	167,017,555	12,402.99	172,401,571	2.2000000	2027/6/1	2.35
11	フランス	国債証券	FRANCE 1.0 270525	1,220,000	13,103.83	159,866,735	13,139.87	160,306,462	1.0000000	2027/5/25	2.18
12	ドイツ	国債証券	GERMANY 2.5 460815	600,000	17,021.92	102,131,562	17,964.90	107,789,443	2.5000000	2046/8/15	1.47
13	ドイツ	国債証券	GERMANY 4.0 370104	530,000	19,220.49	101,868,608	19,977.69	105,881,781	4.0000000	2037/1/4	1.44
14	カナダ	国債証券	CANADA 1.5 230601	1,292,000	8,070.10	104,265,801	8,178.10	105,661,066	1.5000000	2023/6/1	1.44
15	ベルギー	国債証券	BELGIUM 2.25 230622	720,000	13,998.52	100,789,402	13,870.87	99,870,301	2.2500000	2023/6/22	1.36
16	スペイン	国債証券	SPAIN 1.5 270430	620,000	12,847.30	79,653,295	12,958.90	80,345,224	1.5000000	2027/4/30	1.09
17	アメリカ	国債証券	Treasury 1.625 230531	730,000	10,288.17	75,103,671	10,503.52	76,675,740	1.6250000	2023/5/31	1.04
18	アメリカ	国債証券	Treasury 2.125 210815	600,000	10,770.01	64,620,090	10,786.16	64,717,010	2.1250000	2021/8/15	0.88
19	オーストラ リア	国債証券	AUSTRALIA 3.25 250421	720,000	8,279.11	59,609,620	8,473.27	61,007,591	3.2500000	2025/4/21	0.83
20	イタリア	国債証券	ITALY 1.45 250515	500,000	11,640.20	58,201,007	12,136.92	60,684,609	1.4500000	2025/5/15	0.83
21	アメリカ	国債証券	Treasury 3.5 390215	495,000	11,858.73	58,700,746	11,878.27	58,797,458	3.5000000	2039/2/15	0.80
22	アメリカ	国債証券	Treasury 4.625 400215	420,000	13,837.04	58,115,603	13,768.94	57,829,583	4.6250000	2040/2/15	0.79
23	フランス	国債証券	FRANCE 5.75 321025	265,000	20,708.69	54,878,044	20,417.47	54,106,300	5.7500000	2032/10/25	0.74
24	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 421115	485,000	10,497.53	50,913,037	10,380.07	50,343,361	2.7500000	2042/11/15	0.69
25	アメリカ	国債証券	Treasury 1.625 200731	450,000	10,667.01	48,001,576	10,741.82	48,338,197	1.6250000	2020/7/31	0.66
26	アメリカ	国債証券	Treasury 2.875 430515	430,000	10,726.56	46,124,239	10,597.12	45,567,628	2.8750000	2043/5/15	0.62
27	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 470815	440,000	10,430.20	45,892,884	10,254.98	45,121,949	2.7500000	2047/8/15	0.61

28	イギリス	国債証券	UK GILT 4.25 271207	250,000	18,030.02	45,075,068	18,006.30	45,015,773	4.2500000	2027/12/7	0.61
29	ポーランド	国債証券	POLAND 2.5 260725	1,510,000	2,909.55	43,934,246	2,901.31	43,809,794	2.5000000	2026/7/25	0.60
30	イタリア	国債証券	ITALY 0.7 200501	340,000	12,431.14	42,265,908	12,593.34	42,817,369	0.7000000	2020/5/1	0.58

(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。

(注3) 償還年月日が「9999/99/99」の銘柄は償還日の定めのない銘柄です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2019年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	92.01
特殊債券	0.40
合計	92.41

(注1) 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) 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド

2019年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	BAXTER INTERNATIONAL INC	ヘルスケア機器・サービス	38,088	7,984.58	304,117,018	7,814.61	297,642,911	2.47
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	24,768	11,438.62	283,311,760	11,591.16	287,089,970	2.39
3	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	18,385	14,939.50	274,662,810	14,992.89	275,644,393	2.29
4	アメリカ	株式	TRANSUNION	商業・専門サービス	38,157	8,036.88	306,663,596	6,472.22	246,960,651	2.05
5	アメリカ	株式	ROPER INDUSTRIES INC	資本財	7,224	30,732.16	222,009,182	31,324.91	226,291,153	1.88
6	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1,005	197,275.34	198,261,725	182,010.05	182,920,103	1.52
7	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	保険	7,544	21,433.52	161,694,487	22,441.40	169,297,934	1.41
8	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	7,524	22,124.32	166,463,443	22,230.01	167,258,664	1.39
9	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	31,630	4,638.42	146,713,452	5,089.52	160,981,568	1.34
10	アメリカ	株式	JP MORGAN CHASE & CO	各種金融	14,075	11,991.04	168,774,001	11,376.51	160,124,429	1.33
11	アメリカ	株式	ALPHABET, INC	ソフトウェア・サービス	1,347	128,243.74	172,744,319	118,663.97	159,840,378	1.33

12	アメリカ	株式	AGILENT TECHNOLOGIES INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	18,856	6,898.25	130,073,545	8,219.94	154,995,234	1.29
13	バミューダ	株式	IHS MARKIT LTD	商業・専門サービス	27,614	5,661.56	156,338,362	5,603.81	154,743,687	1.29
14	アメリカ	株式	ADOBE SYSTEMS INC	ソフトウェア・サービス	5,730	27,614.82	158,232,932	26,441.32	151,508,782	1.26
15	アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	9,240	15,961.55	147,484,726	16,252.47	150,172,856	1.25
16	アメリカ	株式	TRADE DESK INC/THE - CLASS A	ソフトウェア・サービス	9,800	10,405.68	101,975,664	15,259.84	149,546,510	1.24
17	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	36,055	3,846.28	138,677,914	3,860.45	139,188,626	1.16
18	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	各種金融	19,770	7,561.82	149,497,260	6,997.41	138,338,819	1.15
19	アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORP		7,355	15,552.95	114,391,950	18,574.41	136,614,794	1.14
20	アメリカ	株式	IDEX CORP	資本財	8,917	14,914.44	132,992,104	14,938.41	133,205,855	1.11
21	アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	4,405	22,285.58	98,168,018	29,508.54	129,985,150	1.08
22	アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	16,225	6,865.56	111,393,867	7,994.39	129,709,062	1.08
23	アメリカ	株式	HEICO CORP	資本財	14,405	8,343.06	120,181,883	9,001.18	129,662,079	1.08
24	アメリカ	株式	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	各種金融	15,610	8,167.64	127,496,885	8,304.93	129,639,976	1.08
25	カナダ	株式	WASTE CONNECTIONS INC	商業・専門サービス	14,215	8,497.79	120,796,091	9,019.70	128,215,161	1.07
26	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	7,745	22,322.00	172,883,906	16,389.76	126,938,716	1.05
27	アメリカ	株式	AES CORP	公益事業	71,050	1,438.27	102,189,225	1,774.95	126,110,794	1.05
28	アメリカ	株式	DANAHER CORP	資本財	10,533	10,714.03	112,850,950	11,877.72	125,108,126	1.04
29	アメリカ	株式	TRANSDIGM GROUP INC	資本財	2,963	38,954.28	115,421,560	41,956.13	124,316,036	1.03
30	アメリカ	株式	CORNING INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	33,385	3,166.37	105,709,516	3,652.33	121,933,344	1.01

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別及び業種別投資比率

2019年1月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.01
		素材	4.24
		資本財	13.05
		商業・専門サービス	4.40
		運輸	1.04

	自動車・自動車部品	0.99
	耐久消費財・アパレル	1.87
	消費者サービス	0.40
	メディア・娯楽	1.79
	小売	3.64
	食品・生活必需品小売り	0.54
	食品・飲料・タバコ	3.20
	家庭用品・パーソナル用品	1.40
	ヘルスケア機器・サービス	5.74
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.29
	銀行	3.08
	各種金融	6.40
	保険	4.12
	不動産	0.89
	ソフトウェア・サービス	15.53
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.43
	電気通信サービス	1.02
	公益事業	2.28
	半導体・半導体製造装置	2.85
投資信託受益証券		0.38
投資証券		1.81
合計		95.40

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類及び各業種の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

ハッピーエイジング20

該当事項はありません。

ハッピーエイジング30

該当事項はありません。

ハッピーエイジング40

該当事項はありません。

ハッピーエイジング50

該当事項はありません。

ハッピーエイジング60

該当事項はありません。

（参考）S J A M ラージキャップ・バリュール・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）S J A M スモールキャップ・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

ハッピーエイジング20

該当事項はありません。

ハッピーエイジング30

該当事項はありません。

ハッピーエイジング40

該当事項はありません。

ハッピーエイジング50

該当事項はありません。

ハッピーエイジング60

該当事項はありません。

（参考）S J A Mラージキャップ・バリュアー・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

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（2019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（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第9計算期間末（2009年7月15日）	3,183,815,124	3,183,815,124	0.6639	0.6639
第10計算期間末（2010年7月15日）	3,719,447,117	3,719,447,117	0.6954	0.6954
第11計算期間末（2011年7月15日）	4,207,770,641	4,207,770,641	0.7237	0.7237
第12計算期間末（2012年7月17日）	4,034,512,435	4,034,512,435	0.6395	0.6395
第13計算期間末（2013年7月16日）	6,375,079,876	6,375,079,876	0.9828	0.9828
第14計算期間末（2014年7月15日）	7,212,476,370	7,212,476,370	1.0930	1.0930
第15計算期間末（2015年7月15日）	8,801,004,620	8,801,004,620	1.3543	1.3543
第16計算期間末（2016年7月15日）	7,416,738,892	7,416,738,892	1.1099	1.1099
第17計算期間末（2017年7月18日）	9,271,419,094	9,271,419,094	1.4045	1.4045
第18計算期間末（2018年7月17日）	10,439,689,943	10,439,689,943	1.5015	1.5015
2018年1月末日	10,646,418,736		1.5594	
2月末日	10,324,109,758		1.5053	
3月末日	10,061,226,990		1.4611	
4月末日	10,502,194,993		1.5253	
5月末日	10,293,170,278		1.4850	
6月末日	10,279,505,960		1.4725	
7月末日	10,561,525,220		1.5108	
8月末日	10,698,526,501		1.5220	
9月末日	11,174,945,124		1.5786	

10月末日	10,310,645,013		1.4339
11月末日	10,475,798,171		1.4503
12月末日	9,484,659,817		1.3089
2019年 1月末日	10,085,749,115		1.3815

### ハッピーエイジング 30

直近日（2019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（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第9計算期間末 (2009年 7月15日)	4,078,471,431	4,078,471,431	0.7546	0.7546
第10計算期間末 (2010年 7月15日)	4,610,678,881	4,610,678,881	0.7782	0.7782
第11計算期間末 (2011年 7月15日)	5,192,320,517	5,192,320,517	0.7985	0.7985
第12計算期間末 (2012年 7月17日)	5,099,609,632	5,099,609,632	0.7258	0.7258
第13計算期間末 (2013年 7月16日)	7,661,401,181	7,661,401,181	1.0552	1.0552
第14計算期間末 (2014年 7月15日)	8,543,771,190	8,543,771,190	1.1614	1.1614
第15計算期間末 (2015年 7月15日)	10,450,600,803	10,450,600,803	1.3944	1.3944
第16計算期間末 (2016年 7月15日)	9,226,785,122	9,226,785,122	1.1894	1.1894
第17計算期間末 (2017年 7月18日)	11,485,239,619	11,485,239,619	1.4397	1.4397
第18計算期間末 (2018年 7月17日)	12,738,786,784	12,738,786,784	1.5148	1.5148
2018年 1月末日	12,897,515,400		1.5662	
2月末日	12,573,864,591		1.5189	
3月末日	12,368,969,632		1.4859	
4月末日	12,787,659,596		1.5385	
5月末日	12,552,174,629		1.4976	
6月末日	12,573,204,822		1.4886	
7月末日	12,851,157,752		1.5198	
8月末日	12,975,469,729		1.5250	
9月末日	13,446,384,233		1.5742	
10月末日	12,549,772,992		1.4593	
11月末日	12,734,140,044		1.4734	
12月末日	11,768,028,799		1.3615	
2019年 1月末日	12,361,786,691		1.4185	

### ハッピーエイジング 40

直近日（2019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（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第9計算期間末 (2009年 7月15日)	5,927,975,456	5,927,975,456	0.8617	0.8617
第10計算期間末 (2010年 7月15日)	6,550,967,753	6,550,967,753	0.8909	0.8909

第11計算期間末	(2011年 7月15日)	7,355,736,675	7,355,736,675	0.9092	0.9092
第12計算期間末	(2012年 7月17日)	7,397,925,868	7,397,925,868	0.8565	0.8565
第13計算期間末	(2013年 7月16日)	9,756,993,303	9,756,993,303	1.1196	1.1196
第14計算期間末	(2014年 7月15日)	10,651,044,828	10,651,044,828	1.2075	1.2075
第15計算期間末	(2015年 7月15日)	12,378,839,543	12,378,839,543	1.3816	1.3816
第16計算期間末	(2016年 7月15日)	11,857,174,350	11,857,174,350	1.2636	1.2636
第17計算期間末	(2017年 7月18日)	13,906,785,392	13,906,785,392	1.4368	1.4368
第18計算期間末	(2018年 7月17日)	15,282,979,036	15,282,979,036	1.4924	1.4924
	2018年 1月末日	15,171,062,700		1.5266	
	2月末日	14,997,340,224		1.4950	
	3月末日	14,925,190,203		1.4729	
	4月末日	15,237,964,458		1.5089	
	5月末日	15,077,422,693		1.4801	
	6月末日	15,114,479,005		1.4729	
	7月末日	15,399,139,106		1.4942	
	8月末日	15,575,096,526		1.4942	
	9月末日	16,009,724,373		1.5274	
	10月末日	15,311,254,785		1.4478	
	11月末日	15,530,823,658		1.4607	
	12月末日	14,765,868,538		1.3863	
	2019年 1月末日	15,402,435,172		1.4294	

## ハッピーエイジング50

直近日（2019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（円）		1口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第9計算期間末	(2009年 7月15日)	3,057,510,606	3,057,510,606	0.9621	0.9621
第10計算期間末	(2010年 7月15日)	3,309,494,331	3,309,494,331	0.9927	0.9927
第11計算期間末	(2011年 7月15日)	3,702,379,934	3,702,379,934	1.0057	1.0057
第12計算期間末	(2012年 7月17日)	3,809,563,912	3,809,563,912	0.9795	0.9795
第13計算期間末	(2013年 7月16日)	4,480,882,597	4,480,882,597	1.1555	1.1555
第14計算期間末	(2014年 7月15日)	4,908,333,421	4,908,333,421	1.2215	1.2215
第15計算期間末	(2015年 7月15日)	5,534,439,620	5,534,439,620	1.3347	1.3347
第16計算期間末	(2016年 7月15日)	5,689,949,958	5,689,949,958	1.3007	1.3007
第17計算期間末	(2017年 7月18日)	6,297,794,959	6,297,794,959	1.3890	1.3890
第18計算期間末	(2018年 7月17日)	6,875,070,157	6,875,070,157	1.4262	1.4262
	2018年 1月末日	6,690,679,057		1.4408	
	2月末日	6,706,516,081		1.4246	
	3月末日	6,716,215,656		1.4136	
	4月末日	6,801,571,176		1.4340	
	5月末日	6,815,518,219		1.4176	

6月末日	6,831,553,917		1.4136
7月末日	6,938,832,168		1.4244
8月末日	6,976,878,014		1.4209
9月末日	7,191,834,566		1.4396
10月末日	7,075,133,985		1.3947
11月末日	7,180,437,734		1.4046
12月末日	7,003,476,693		1.3646
2019年 1月末日	7,200,926,975		1.3912

## ハッピーエイジング60

直近日（2019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（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第9計算期間末 (2009年 7月15日)	1,794,974,977	1,794,974,977	1.0407	1.0407
第10計算期間末 (2010年 7月15日)	1,977,963,799	1,977,963,799	1.0676	1.0676
第11計算期間末 (2011年 7月15日)	2,184,577,562	2,184,577,562	1.0737	1.0737
第12計算期間末 (2012年 7月17日)	2,434,101,752	2,434,101,752	1.0812	1.0812
第13計算期間末 (2013年 7月16日)	2,695,707,446	2,695,707,446	1.1485	1.1485
第14計算期間末 (2014年 7月15日)	3,031,298,200	3,031,298,200	1.1883	1.1883
第15計算期間末 (2015年 7月15日)	3,292,018,524	3,292,018,524	1.2399	1.2399
第16計算期間末 (2016年 7月15日)	3,737,464,193	3,737,464,193	1.2843	1.2843
第17計算期間末 (2017年 7月18日)	3,967,051,489	3,967,051,489	1.2846	1.2846
第18計算期間末 (2018年 7月17日)	4,186,192,577	4,186,192,577	1.3015	1.3015
2018年 1月末日	4,026,224,404		1.2988	
2月末日	4,087,445,500		1.2963	
3月末日	4,082,400,446		1.2941	
4月末日	4,098,005,194		1.3009	
5月末日	4,082,408,936		1.2925	
6月末日	4,128,266,026		1.2934	
7月末日	4,213,194,776		1.2952	
8月末日	4,227,705,948		1.2902	
9月末日	4,300,959,318		1.2973	
10月末日	4,356,256,708		1.2817	
11月末日	4,396,141,457		1.2883	
12月末日	4,357,071,514		1.2793	
2019年 1月末日	4,436,365,508		1.2882	

### 【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
第18計算期間	0.0000
第19中間計算期間末	

## ハッピーエイジング30

	1口当たりの分配金（円）
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
第18計算期間	0.0000
第19中間計算期間末	

## ハッピーエイジング40

	1口当たりの分配金（円）
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
第18計算期間	0.0000

第19中間計算期間末	
------------	--

## ハッピーエイジング50

	1口当たりの分配金（円）
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
第18計算期間	0.0000
第19中間計算期間末	

## ハッピーエイジング60

	1口当たりの分配金（円）
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
第18計算期間	0.0000
第19中間計算期間末	

## 【収益率の推移】

## ハッピーエイジング20

	収益率（％）
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
第18計算期間	6.9
第19中間計算期間末	9.8

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

### ハッピーエイジング30

	収益率（％）
第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
第18計算期間	5.2
第19中間計算期間末	7.9

（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
第18計算期間	3.9

第19中間計算期間末	5.4
------------	-----

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

#### ハッピーエイジング50

	収益率（％）
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
第18計算期間	2.7
第19中間計算期間末	3.2

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

#### ハッピーエイジング60

	収益率（％）
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
第18計算期間	1.3
第19中間計算期間末	1.5

（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
第18計算期間	1,489,193,062	1,137,446,811
第19中間計算期間末	822,601,533	524,731,295

（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
第18計算期間	1,190,076,724	757,714,913
第19中間計算期間末	616,505,034	368,108,401

（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
第18計算期間	1,676,258,878	1,115,070,892
第19中間計算期間末	963,053,299	510,337,669

（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
第18計算期間	971,431,975	684,746,630
第19中間計算期間末	583,433,814	256,216,348

（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

第18計算期間	671,022,511	542,867,692
第19中間計算期間末	449,615,420	244,847,877

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

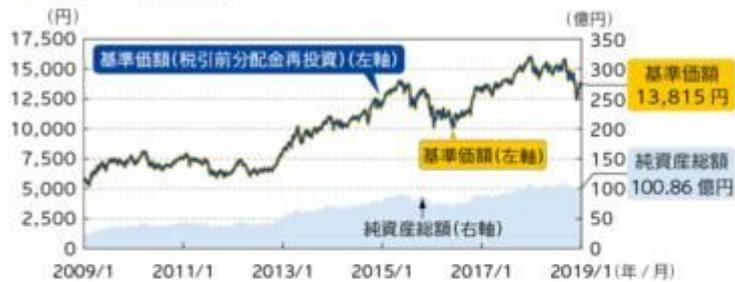
(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

## 参考情報

基準日:2019年1月31日

### 基準価額・純資産の推移 2009/01/30～2019/01/31

#### ●ハッピーエイジング20



### 分配の推移

#### ●ハッピーエイジング20

2014年07月	0円
2015年07月	0円
2016年07月	0円
2017年07月	0円
2018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

2014年07月	0円
2015年07月	0円
2016年07月	0円
2017年07月	0円
2018年07月	0円
設定来累計	0円

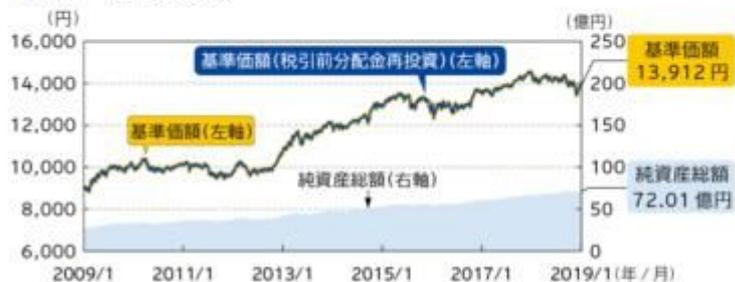
#### ●ハッピーエイジング40



#### ●ハッピーエイジング40

2014年07月	0円
2015年07月	0円
2016年07月	0円
2017年07月	0円
2018年07月	0円
設定来累計	0円

#### ●ハッピーエイジング50

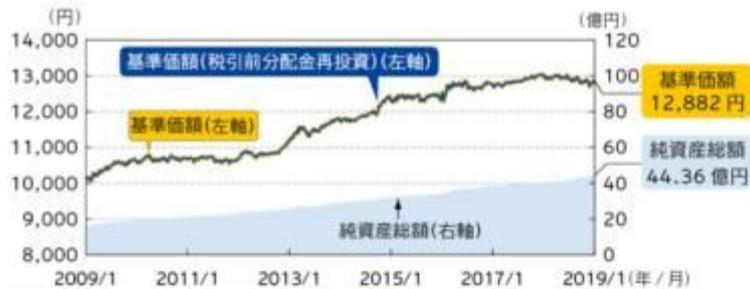


#### ●ハッピーエイジング50

2014年07月	0円
2015年07月	0円
2016年07月	0円
2017年07月	0円
2018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。
- 最新の運用状況は別途、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



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

## ●ハッピーエイジング60

2014年07月	0円
2015年07月	0円
2016年07月	0円
2017年07月	0円
2018年07月	0円
設定来累計	0円

- 1万口当たり、税引前

## ● 主要な資産の状況

	ハッピー エイジング 20	ハッピー エイジング 30	ハッピー エイジング 40
資産別構成			
資産の種類	純資産比	純資産比	純資産比
SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	25.93%	21.95%	15.48%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	25.97%	21.97%	15.50%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	1.99%	7.96%	32.88%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	5.98%	19.95%	14.98%
損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド	33.21%	21.14%	14.11%
ISHARES CORE MSCI EMERGING	4.80%	4.86%	4.79%
コール・ローン等	2.13%	2.17%	2.26%
合計	100.00%	100.00%	100.00%

	ハッピー エイジング 50	ハッピー エイジング 60
資産別構成		
資産の種類	純資産比	純資産比
SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	9.50%	4.01%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	9.51%	4.01%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	56.87%	71.94%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	11.00%	16.02%
損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド	8.07%	2.02%
ISHARES CORE MSCI EMERGING	3.11%	-
コール・ローン等	1.93%	2.00%
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。
- 最新の運用状況は別途、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 本田技研工業	輸送用機器	7.5%
2 新日鐵住金	鉄鋼	7.1%
3 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6.7%
4 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	6.5%
5 野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	6.3%
組入銘柄数		31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 NOK	輸送用機器	3.4%
2 シチズン時計	精密機器	3.1%
3 伊予銀行	銀行業	3.0%
4 東邦ホールディングス	卸売業	2.8%
5 EIZO	電気機器	2.5%
組入銘柄数		71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 第350回利付国債(10年)	国債証券	2028/03/20	8.4%	
2 第396回利付国債(2年)	国債証券	2021/01/01	7.0%	
3 第154回利付国債(20年)	国債証券	2035/09/20	6.1%	
4 第150回利付国債(20年)	国債証券	2034/09/20	5.0%	
5 第347回利付国債(10年)	国債証券	2027/06/20	4.3%	
組入銘柄数			82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 Treasury 1.875 220228	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2022/02/28	10.0%
2 GERMANY 0.0 220408	ドイツ	国債証券	ユーロ	2022/04/08	7.8%
3 Treasury 2.75 280215	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2028/02/15	6.8%
4 Treasury 2.125 240229	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2024/02/29	5.9%
5 GERMANY 0.5 280215	ドイツ	国債証券	ユーロ	2028/02/15	5.2%
組入銘柄数				117銘柄	

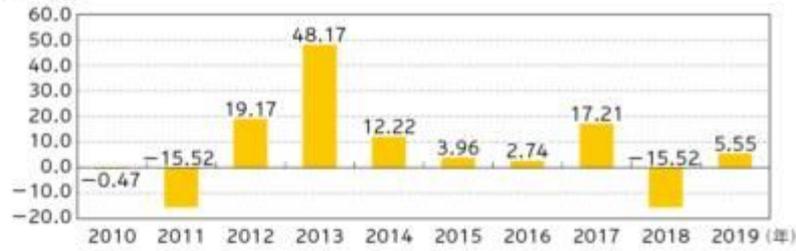
## ●損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド

組入上位5銘柄				
銘柄名	通貨	発行国/地域	業種	純資産比
1 BAXTER INTERNATIONAL INC	アメリカ・ドル	アメリカ	ヘルスケア	2.5%
2 MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	2.4%
3 VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	2.3%
4 TRANSUNION	アメリカ・ドル	アメリカ	資本財・サービス	2.1%
5 ROPER INDUSTRIES INC	アメリカ・ドル	アメリカ	資本財・サービス	1.9%
組入銘柄数			203銘柄	

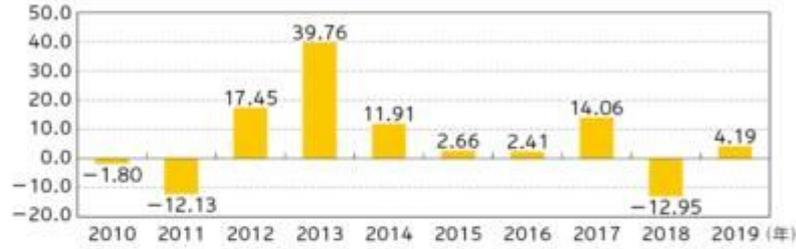
- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

## 年間収益率の推移（暦年ベース）

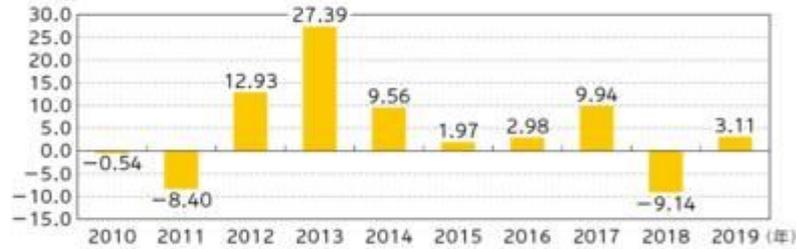
### ●ハッピーエイジング20 (%)



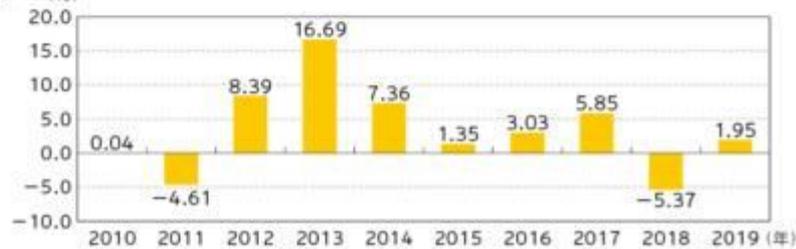
### ●ハッピーエイジング30 (%)



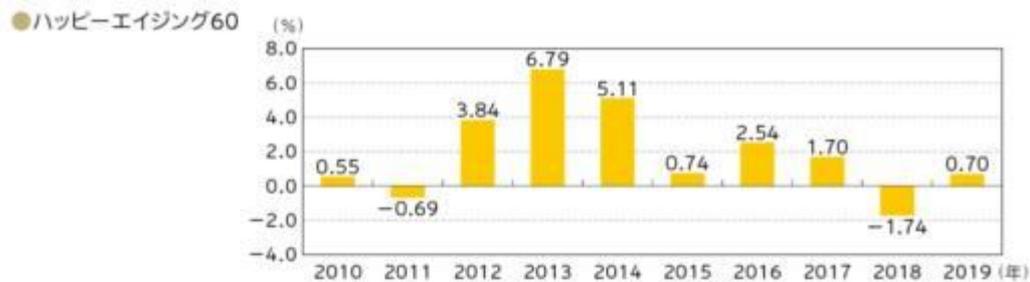
### ●ハッピーエイジング40 (%)



### ●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。
- 最新の運用状況は別途、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。

● 2019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。
- 最新の運用状況は別途、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】

### 1【申込（販売）手続等】

< 訂正前 >

(略)

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

(略)

ホームページ <http://www.sjnk-am.co.jp/>

(4) お申込みには申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額を要します。申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.16%（税抜2.0%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。

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

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

申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

(略)

<訂正後>

(略)

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

(略)

ホームページ <https://www.sjnk-am.co.jp/>

(4) お申込みには申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額を要します。申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.16%<sup>\*</sup>（税抜2.0%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。

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

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

\*消費税率が10%になった場合は、2.2%となります。

申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

(略)

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

<訂正前>

(略)

ホームページ <http://www.sjnk-am.co.jp/>

<訂正後>

(略)

ホームページ <https://www.sjnk-am.co.jp/>

#### (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、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/>

(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。

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

(略)

## 第3【ファンドの経理状況】

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、2018年7月18日から2019年1月17日までの中間財務諸表について、EY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。

## 【中間財務諸表】

## 【ハッピーエイジング20】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第18期 2018年7月17日現在	第19期中間計算期間末 2019年1月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	271,669,751
コール・ローン	296,573,260	-
投資信託受益証券	488,668,936	467,264,171
親投資信託受益証券	9,750,953,477	9,179,524,500
流動資産合計	10,536,195,673	9,918,458,422
資産合計	10,536,195,673	9,918,458,422
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	11,579,093	9,725,409
未払受託者報酬	3,518,812	2,821,603
未払委託者報酬	81,272,825	80,133,814
その他未払費用	135,000	135,801
流動負債合計	96,505,730	92,816,627
負債合計	96,505,730	92,816,627
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,952,858,168	7,250,728,406
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	3,486,831,775	2,574,913,389
元本等合計	10,439,689,943	9,825,641,795
純資産合計	10,439,689,943	9,825,641,795
負債純資産合計	10,536,195,673	9,918,458,422

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第18期中間計算期間 自 2017年7月19日 至 2018年1月18日	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	6,352,186	7,287,253
有価証券売買等損益	1,261,764,241	958,910,309
為替差損益	4,253,830	15,340,723
その他収益	-	1,705
営業収益合計	1,263,862,597	966,962,074

	第18期中間計算期間 自 2017年7月19日 至 2018年1月18日	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
<b>営業費用</b>		
支払利息	119,197	88,782
受託者報酬	4,259,447	2,821,603
委託者報酬	81,995,344	80,133,814
その他費用	191,484	255,794
営業費用合計	86,565,472	83,299,993
営業利益又は営業損失（ ）	1,177,297,125	1,050,262,067
経常利益又は経常損失（ ）	1,177,297,125	1,050,262,067
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,177,297,125	1,050,262,067
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（ ）	41,916,355	17,406,379
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,670,307,177	3,486,831,775
剰余金増加額又は欠損金減少額	363,795,225	383,985,755
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	363,795,225	383,985,755
剰余金減少額又は欠損金増加額	237,414,788	263,048,453
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	237,414,788	263,048,453
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,932,068,384	2,574,913,389

### （ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。 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2018年7月17日、当中間計算期間末日を2019年1月17日としております。

## （中間貸借対照表に関する注記）

期別	第18期 2018年7月17日現在	第19期中間計算期間末 2019年1月17日現在
1. 受益権の総数	6,952,858,168口	7,250,728,406口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.5015円 (1万口当たり純資産額) (15,015円)	1口当たり純資産額 1.3551円 (1万口当たり純資産額) (13,551円)

## （中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第18期中間計算期間 自 2017年7月19日 至 2018年1月18日	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	4,535,011円	損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

## （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18期 2018年7月17日現在	第19期中間計算期間末 2019年1月17日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	---	----

## (その他の注記)

項目	第18期 自 2017年7月19日 至 2018年7月17日	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
期首元本額	6,601,111,917円	6,952,858,168円
期中追加設定元本額	1,489,193,062円	822,601,533円
期中一部解約元本額	1,137,446,811円	524,731,295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18期 2018年7月17日現在	第19期中間計算期間末 2019年1月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	334,125,351
コール・ローン	350,716,848	-
投資信託受益証券	594,202,244	579,756,594
親投資信託受益証券	11,897,577,617	11,276,182,672
流動資産合計	12,842,496,709	12,190,064,617
資産合計	12,842,496,709	12,190,064,617
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	9,783,805	11,908,231
未払受託者報酬	4,292,203	3,437,944
未払委託者報酬	89,498,917	89,387,132
その他未払費用	135,000	135,987
流動負債合計	103,709,925	104,869,294
負債合計	103,709,925	104,869,294
<b>純資産の部</b>		
元本等		

	第18期 2018年7月17日現在	第19期中間計算期間末 2019年1月17日現在
元本	8,409,821,065	8,658,217,698
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	4,328,965,719	3,426,977,625
元本等合計	12,738,786,784	12,085,195,323
純資産合計	12,738,786,784	12,085,195,323
負債純資産合計	12,842,496,709	12,190,064,617

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第18期中間計算期間 自 2017年7月19日 至 2018年1月18日	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
営業収益		
受取配当金	7,808,846	9,041,638
有価証券売買等損益	1,286,429,951	919,273,359
為替差損益	5,229,302	19,250,058
営業収益合計	1,289,009,495	929,481,779
営業費用		
支払利息	143,661	107,091
受託者報酬	5,260,205	3,437,944
委託者報酬	90,082,819	89,387,132
その他費用	203,743	280,102
営業費用合計	95,690,428	93,212,269
営業利益又は営業損失( )	1,193,319,067	1,022,694,048
経常利益又は経常損失( )	1,193,319,067	1,022,694,048
中間純利益又は中間純損失( )	1,193,319,067	1,022,694,048
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( )	25,142,708	14,753,418
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,507,780,365	4,328,965,719
剰余金増加額又は欠損金減少額	295,419,549	295,333,780
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	295,419,549	295,333,780
剰余金減少額又は欠損金増加額	162,351,392	189,381,244
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	162,351,392	189,381,244
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	4,809,024,881	3,426,977,625

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<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> <p>計算期間末日の取扱い</p> <p>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2018年7月17日、当中間計算期間末日を2019年1月17日としております。</p>
------------------------------	--

## (中間貸借対照表に関する注記)

期別	第18期 2018年7月17日現在	第19期中間計算期間末 2019年1月17日現在
1. 受益権の総数	8,409,821,065口	8,658,217,698口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.5148円 (1万円当たり純資産額) (15,148円)	1.3958円 (1万円当たり純資産額) (13,958円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第18期中間計算期間 自 2017年7月19日 至 2018年1月18日	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17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	3,500,896円	損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

## (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18期 2018年7月17日現在	第19期中間計算期間末 2019年1月17日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (その他の注記)

項目	第18期 自 2017年7月19日 至 2018年7月17日	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
期首元本額	7,977,459,254円	8,409,821,065円
期中追加設定元本額	1,190,076,724円	616,505,034円
期中一部解約元本額	757,714,913円	368,108,401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18期 2018年7月17日現在	第19期中間計算期間末 2019年1月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	439,517,768
コール・ローン	431,342,868	-
投資信託受益証券	751,501,890	711,557,498
親投資信託受益証券	14,232,296,436	14,052,155,128

	第18期 2018年7月17日現在	第19期中間計算期間末 2019年1月17日現在
流動資産合計	15,415,141,194	15,203,230,394
資産合計	15,415,141,194	15,203,230,394
負債の部		
流動負債		
未払解約金	32,735,238	6,527,218
未払受託者報酬	4,755,793	4,174,955
未払委託者報酬	94,536,127	96,024,185
その他未払費用	135,000	136,294
流動負債合計	132,162,158	106,862,652
負債合計	132,162,158	106,862,652
純資産の部		
元本等		
元本	10,240,262,112	10,692,977,742
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,042,716,924	4,403,390,000
元本等合計	15,282,979,036	15,096,367,742
純資産合計	15,282,979,036	15,096,367,742
負債純資産合計	15,415,141,194	15,203,230,394

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第18期中間計算期間 自 2017年7月19日 至 2018年1月18日	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
営業収益		
受取配当金	9,029,343	11,097,147
有価証券売買等損益	1,120,624,497	736,375,105
為替差損益	6,402,386	23,919,382
その他収益	-	668
営業収益合計	1,123,251,454	749,196,672
営業費用		
支払利息	166,465	124,537
受託者報酬	5,512,502	4,174,955
委託者報酬	95,285,710	96,024,185
その他費用	221,071	302,461
営業費用合計	101,185,748	100,626,138
営業利益又は営業損失（ ）	1,022,065,706	849,822,810
経常利益又は経常損失（ ）	1,022,065,706	849,822,810
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,022,065,706	849,822,810
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（ ）	28,083,135	13,145,504
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,227,711,266	5,042,716,924
剰余金増加額又は欠損金減少額	375,427,974	448,448,781
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	375,427,974	448,448,781
剰余金減少額又は欠損金増加額	260,508,925	251,098,399
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	260,508,925	251,098,399
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,336,612,886	4,403,390,000

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。 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2018年7月17日、当中間計算期間末日を2019年1月17日としております。

## (中間貸借対照表に関する注記)

期別	第18期 2018年7月17日現在	第19期中間計算期間末 2019年1月17日現在
1. 受益権の総数	10,240,262,112口	10,692,977,742口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4924円 (14,924円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4118円 (14,118円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第18期中間計算期間 自 2017年7月19日 至 2018年1月18日	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17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	2,773,077円	損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

## （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18期 2018年7月17日現在	第19期中間計算期間末 2019年1月17日現在
1．中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	（1）有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 （2）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （その他の注記）

項目	第18期	第19期中間計算期間
	自 2017年7月19日 至 2018年7月17日	自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
期首元本額	9,679,074,126円	10,240,262,112円
期中追加設定元本額	1,676,258,878円	963,053,299円
期中一部解約元本額	1,115,070,892円	510,337,669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18期 2018年7月17日現在	第19期中間計算期間末 2019年1月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	183,139,174
コール・ローン	171,428,101	-
投資信託受益証券	203,873,168	216,005,537
親投資信託受益証券	6,544,940,819	6,749,403,532
流動資産合計	6,920,242,088	7,148,548,243
資産合計	6,920,242,088	7,148,548,243
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	6,689,276	5,359,479
未払受託者報酬	1,962,796	1,913,418
未払委託者報酬	36,384,859	37,503,057
その他未払費用	135,000	135,550
流動負債合計	45,171,931	44,911,504
負債合計	45,171,931	44,911,504
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,820,675,948	5,147,893,414
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,054,394,209	1,955,743,325
元本等合計	6,875,070,157	7,103,636,739
純資産合計	6,875,070,157	7,103,636,739
負債純資産合計	6,920,242,088	7,148,548,243

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)		
	第18期中間計算期間 自 2017年7月19日 至 2018年1月18日	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	2,609,394	2,951,313
有価証券売買等損益	315,253,840	189,868,830
為替差損益	1,747,417	6,307,340
その他収益	-	9
営業収益合計	316,115,817	193,224,848
<b>営業費用</b>		
支払利息	68,794	56,167
受託者報酬	2,122,969	1,913,418
委託者報酬	37,153,095	37,503,057
その他費用	159,911	199,229
営業費用合計	39,504,769	39,671,871
営業利益又は営業損失( )	276,611,048	232,896,719
経常利益又は経常損失( )	276,611,048	232,896,719
中間純利益又は中間純損失( )	276,611,048	232,896,719
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( )	11,511,149	5,454,158
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,763,804,356	2,054,394,209
剰余金増加額又は欠損金減少額	184,354,527	237,816,170
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	184,354,527	237,816,170

	第18期中間計算期間 自 2017年7月19日 至 2018年1月18日	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
剰余金減少額又は欠損金増加額	148,854,616	109,024,493
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	148,854,616	109,024,493
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,064,404,166	1,955,743,325

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。 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2018年7月17日、当中間計算期間末日を2019年1月17日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

期別	第18期 2018年7月17日現在	第19期中間計算期間末 2019年1月17日現在
1. 受益権の総数	4,820,675,948口	5,147,893,414口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4262円 (14,262円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3799円 (13,799円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第18期中間計算期間	第19期中間計算期間
	自 2017年7月19日 至 2018年1月18日	自 2018年7月18日 至 2019年1月17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	757,671円	損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

## (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18期	第19期中間計算期間末
	2018年7月17日現在	2019年1月17日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (その他の注記)

項目	第18期	第19期中間計算期間
	自 2017年7月19日 至 2018年7月17日	自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
期首元本額	4,533,990,603円	4,820,675,948円
期中追加設定元本額	971,431,975円	583,433,814円
期中一部解約元本額	684,746,630円	256,216,348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18期 2018年7月17日現在	第19期中間計算期間末 2019年1月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	108,981,268
コール・ローン	122,430,326	-
親投資信託受益証券	4,088,497,291	4,305,470,051
流動資産合計	4,210,927,617	4,414,451,319
資産合計	4,210,927,617	4,414,451,319
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,128,631	6,702,980
未払受託者報酬	1,087,405	1,170,441
未払委託者報酬	18,423,365	18,961,219
その他未払費用	95,639	103,278
流動負債合計	24,735,040	26,937,918
負債合計	24,735,040	26,937,918
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,216,425,068	3,421,192,611
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	969,767,509	966,320,790
元本等合計	4,186,192,577	4,387,513,401
純資産合計	4,186,192,577	4,387,513,401
負債純資産合計	4,210,927,617	4,414,451,319

### （2）【中間損益及び剰余金計算書】

	（単位：円）	
	第18期中間計算期間 自 2017年7月19日 至 2018年1月18日	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	72,955,466	42,617,240
営業収益合計	72,955,466	42,617,240
<b>営業費用</b>		
支払利息	45,057	33,923
受託者報酬	1,092,839	1,170,441
委託者報酬	19,454,485	18,961,219
その他費用	97,260	125,041
営業費用合計	20,689,641	20,290,624
営業利益又は営業損失（ ）	52,265,825	62,907,864

	第18期中間計算期間 自 2017年7月19日 至 2018年1月18日	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
経常利益又は経常損失( )	52,265,825	62,907,864
中間純利益又は中間純損失( )	52,265,825	62,907,864
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( )	2,884,409	3,398,017
期首剰余金又は期首欠損金( )	878,781,240	969,767,509
剰余金増加額又は欠損金減少額	91,152,279	129,690,161
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	91,152,279	129,690,161
剰余金減少額又は欠損金増加額	81,492,664	73,627,033
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	81,492,664	73,627,033
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	937,822,271	966,320,790

## (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、該日が休業日のため、前計算期間末日を2018年7月17日、当中間計算期間末日を2019年1月17日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

期別	第18期 2018年7月17日現在	第19期中間計算期間末 2019年1月17日現在
1. 受益権の総数	3,216,425,068口	3,421,192,611口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3015円 (13,015円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2825円 (12,825円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第18期中間計算期間 自 2017年7月19日 至 2018年1月18日	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17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	246,362円	損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。
---	----------	---

## (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18期 2018年7月17日現在	第19期中間計算期間末 2019年1月17日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (その他の注記)

項目	第18期 自 2017年7月19日 至 2018年7月17日	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
期首元本額	3,088,270,249円	3,216,425,068円
期中追加設定元本額	671,022,511円	449,615,420円
期中一部解約元本額	542,867,692円	244,847,877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・ファンド ハッピーエイジング20 / ハッピーエイジング30 / ハッピーエイジング40 / ハッピーエイジング50 / ハッピーエイジング60の主要投資対象の状況は以下のとおりです。

\*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

## 貸借対照表

科 目	2018年7月17日現在	2019年1月17日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	317,526,630
コール・ローン	358,782,059	-
株式	41,807,770,870	27,855,076,450
未収入金	749,935,067	-
未収配当金	35,533,200	18,818,800
流動資産合計	42,952,021,196	28,191,421,880
資産合計	42,952,021,196	28,191,421,880
負債の部		
流動負債		
未払金	748,615,714	-
その他未払費用	-	940
流動負債合計	748,615,714	940
負債合計	748,615,714	940
純資産の部		
元本等		
元本	21,998,050,748	15,795,820,460
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	20,205,354,734	12,395,600,480
元本等合計	42,203,405,482	28,191,420,940
純資産合計	42,203,405,482	28,191,420,940
負債純資産合計	42,952,021,196	28,191,421,880

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 原則として取引所における計算期間末日の最終相場で評価しております。計算期間末日に当該取引所の最終相場がない場合には当該取引所における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。
--------------------	---

2. 費用・収益の計上基準	<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)

期別	2018年7月17日現在	2019年1月17日現在
1. 受益権の総数	21,998,050,748口	15,795,820,460口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.9185円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (19,185円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.7847円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (17,847円)</p>

## (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	2018年7月17日現在	2019年1月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	同左
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 2017年7月19日 至 2018年7月17日	自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,304,460,772円	21,998,050,748円
同期中追加設定元本額	18,882,830,439円	1,234,306,950円
同期中一部解約元本額	1,189,240,463円	7,436,537,238円
元本の内訳*		
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）	487,501円	608,518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）	312,336円	413,324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）	96,425円	135,797円
損保ジャパン日本興亜ラージキャップ・バリュウ・ファンド（F o F s用）（適格機関投資家専用）	16,886,151,610円	10,312,776,315円
ラージキャップ・バリュウ・オープン（適格機関投資家専用）	569,697,437円	669,880,614円
ハッピーエイジング20	1,408,091,043円	1,432,474,519円
ハッピーエイジング30	1,455,703,503円	1,496,561,055円
ハッピーエイジング40	1,233,358,454円	1,370,652,249円
ハッピーエイジング50	341,812,097円	381,263,642円
ハッピーエイジング60	88,357,297円	100,646,435円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2035	3,455,020円	9,812,364円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2045	1,904,955円	5,933,637円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2055	1,830,305円	5,458,986円
S O M P O日本株バリュウ・プラスファンド	6,792,765円	9,203,005円
計	21,998,050,748円	15,795,820,460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

貸借対照表

科 目	2018年7月17日現在	2019年1月17日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	22,903,221
コール・ローン	79,254,858	-
株式	8,468,838,600	8,618,194,300
未収入金	511,513,016	-
未収配当金	1,560,000	6,109,200
流動資産合計	9,061,166,474	8,647,206,721
資産合計	9,061,166,474	8,647,206,721
負債の部		
流動負債		
未払金	495,685,391	-
その他未払費用	-	76
流動負債合計	495,685,391	76
負債合計	495,685,391	76
純資産の部		
元本等		
元本	3,308,847,650	3,779,459,704
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,256,633,433	4,867,746,941
元本等合計	8,565,481,083	8,647,206,645
純資産合計	8,565,481,083	8,647,206,645
負債純資産合計	9,061,166,474	8,647,206,721

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 原則として取引所における計算期間末日の最終相場で評価しております。計算期間末日に当該取引所の最終相場がない場合には当該取引所における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない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。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

期別	2018年7月17日現在	2019年1月17日現在
1. 受益権の総数	3,308,847,650口	3,779,459,704口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.5887円 (25,887円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.2879円 (22,879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	2018年7月17日現在	2019年1月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （その他の注記）

項目	自 2017年7月19日 至 2018年7月17日	自 2018年7月18日 至 2019年1月17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	3,330,488,283円	3,308,847,650円
同期中追加設定元本額	327,152,040円	536,577,551円
同期中一部解約元本額	348,792,673円	65,965,497円
元本の内訳*		
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）	360,935円	475,448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）	230,562円	317,139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）	71,379円	105,392円
ハッピーエイジング20	1,025,453,964円	1,124,862,852円
ハッピーエイジング30	1,061,791,512円	1,190,916,649円
ハッピーエイジング40	898,317,626円	1,062,302,278円
ハッピーエイジング50	248,944,292円	296,840,627円

項目	自 2017年7月19日 至 2018年7月17日	自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
ハッピーエイジング60	63,358,690円	79,924,443円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	2,534,178円	7,671,910円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	1,398,399円	4,598,510円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	1,359,373円	4,274,083円
SOMPO日本株バリュー・プラスファンド	5,026,740円	7,170,373円
計	3,308,847,650円	3,779,459,704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

#### 貸借対照表

科 目	2018年7月17日現在	2019年1月17日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	225,927,343
コール・ローン	214,348,067	-
国債証券	9,813,375,900	9,954,384,600
特殊債券	774,223,183	493,925,892
社債券	4,995,787,440	4,869,628,200
未収利息	28,086,373	31,073,577
前払費用	5,861,062	2,864,726
流動資産合計	15,831,682,025	15,577,804,338
資産合計	15,831,682,025	15,577,804,338
負債の部		
流動負債		
その他未払費用	-	664
流動負債合計	-	664
負債合計	-	664
純資産の部		
元本等		
元本	11,108,839,211	10,877,650,631
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	4,722,842,814	4,700,153,043
元本等合計	15,831,682,025	15,577,803,674
純資産合計	15,831,682,025	15,577,803,674
負債純資産合計	15,831,682,025	15,577,804,338

#### 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、以下のとおり、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>ただし、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2．費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

期別	2018年7月17日現在		2019年1月17日現在	
1．受益権の総数	11,108,839,211口		10,877,650,631口	
2．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4251円 (14,251円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4321円 (14,321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	2018年7月17日現在	2019年1月17日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	同左
2．時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	同左

項目	2018年7月17日現在	2019年1月17日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (その他の注記)

項目	自 2017年7月19日 至 2018年7月17日	自 2018年7月18日 至 2019年1月17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	10,507,344,028円	11,108,839,211円
同期中追加設定元本額	2,094,673,494円	1,104,588,569円
同期中一部解約元本額	1,493,178,311円	1,335,777,149円
元本の内訳*		
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）	93,822円	94,207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）	870,693円	811,779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）	1,646,459円	1,331,557円
S N A M絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用）	307,615,238円	231,917,079円
損保ジャパン日本債券ファンド	1,025,549,065円	1,029,094,351円
ハッピーエイジング20	144,480,272円	135,447,488円
ハッピーエイジング30	706,111,829円	639,337,300円
ハッピーエイジング40	3,502,922,872円	3,339,023,370円
ハッピーエイジング50	2,735,742,789円	2,817,444,245円
ハッピーエイジング60	2,103,510,357円	2,199,670,848円
パン・アフリカ株式ファンド	17,407,861円	14,641,815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	2,654,007円	1,688,418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	19,930,155円	14,992,193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	315,389,312円	235,024,773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	506,095円	- 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	13,222,313円	9,545,807円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2035	12,026,615円	34,494,991円

項目	自 2017年7月19日 至 2018年7月17日	自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	3,970,899円	12,368,561円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	996,980円	3,526,808円
ターゲット・リターン戦略ファンド	194,191,578円	157,195,041円
計	11,108,839,211円	10,877,650,631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

貸借対照表

科 目	2018年7月17日現在	2019年1月17日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	49,363,978	31,719,855
金銭信託	-	286,145,364
コール・ローン	242,412,086	-
国債証券	7,067,384,513	6,699,699,128
特殊債券	29,971,156	28,470,886
未収入金	-	255,113,252
未収利息	44,930,493	38,026,705
前払費用	9,883,376	9,108,949
流動資産合計	7,443,945,602	7,348,284,139
資産合計	7,443,945,602	7,348,284,139
負債の部		
流動負債		
未払金	-	255,471,222
その他未払費用	-	847
流動負債合計	-	255,472,069
負債合計	-	255,472,069
純資産の部		
元本等		
元本	4,812,486,387	4,721,611,563
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,631,459,215	2,371,200,507
元本等合計	7,443,945,602	7,092,812,070
純資産合計	7,443,945,602	7,092,812,070
負債純資産合計	7,443,945,602	7,348,284,139

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び特殊債券</p> <p>個別法に基づき、以下のとおり、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>ただし、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準</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)

期別	2018年7月17日現在	2019年1月17日現在
1. 受益権の総数	4,812,486,387口	4,721,611,563口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5468円 (15,468円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5022円 (15,022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	2018年7月17日現在	2019年1月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	同左

項目	2018年7月17日現在	2019年1月17日現在
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 2017年7月19日 至 2018年7月17日	自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,077,138,770円	4,812,486,387円
同期中追加設定元本額	994,426,098円	436,579,085円
同期中一部解約元本額	259,078,481円	527,453,909円
元本の内訳*		
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)	48,176円	48,285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)	68,843円	68,966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)	372,592円	372,997円
SNAM絶対収益ターゲットファンド(適格機関投資家専用)	27,413,710円	27,644,995円
ハッピーエイジング20	410,604,319円	379,599,621円
ハッピーエイジング30	1,672,230,543円	1,595,223,880円
ハッピーエイジング40	1,508,311,421円	1,453,536,698円
ハッピーエイジング50	500,116,598円	518,984,375円
ハッピーエイジング60	433,639,453円	468,099,671円
損保ジャパン外国債券ファンド(為替ヘッジなし)	256,894,834円	268,520,384円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	1,879,840円	6,743,975円

項目	自 2017年7月19日 至 2018年7月17日	自 2018年7月18日 至 2019年1月17日
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	516,503円	1,613,274円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	389,555円	1,154,442円
計	4,812,486,387円	4,721,611,563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

#### 貸借対照表

科 目	2018年7月17日現在	2019年1月17日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	130,181,334	155,577,299
金銭信託	-	256,043,714
コール・ローン	489,796,239	-
株式	11,939,376,592	11,231,237,902
投資信託受益証券	-	44,990,483
投資証券	199,337,601	213,757,802
未収入金	-	82,973,073
未収配当金	10,369,187	8,847,583
流動資産合計	12,769,060,953	11,993,427,856
資産合計	12,769,060,953	11,993,427,856
負債の部		
流動負債		
未払金	-	100,923,194
その他未払費用	-	757
流動負債合計	-	100,923,951
負債合計	-	100,923,951
純資産の部		
元本等		
元本	6,210,852,196	6,526,810,990
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	6,558,208,757	5,365,692,915
元本等合計	12,769,060,953	11,892,503,905
純資産合計	12,769,060,953	11,892,503,905
負債純資産合計	12,769,060,953	11,993,427,856

#### 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> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。</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)

期別	2018年7月17日現在	2019年1月17日現在
1. 受益権の総数	6,210,852,196口	6,526,810,990口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.0559円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (20,559円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.8221円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (18,221円)</p>

## (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	2018年7月17日現在	2019年1月17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 2017年7月19日 至 2018年7月17日	自 2018年7月18日 至 2019年1月17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	6,215,139,503円	6,210,852,196円
同期中追加設定元本額	653,204,601円	590,088,037円
同期中一部解約元本額	657,491,908円	274,129,243円
元本の内訳*		
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）	768,915,273円	749,439,276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）	971,058,508円	986,729,881円
ハッピーエイジング20	1,728,642,707円	1,802,977,120円
ハッピーエイジング30	1,344,065,660円	1,409,709,510円
ハッピーエイジング40	1,077,655,487円	1,212,991,869円
ハッピーエイジング50	278,440,013円	315,756,770円
ハッピーエイジング60	42,074,548円	49,206,564円
計	6,210,852,196円	6,526,810,990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】

### 【純資産額計算書】

#### ハッピーエイジング20

2019年1月31日現在

資産総額	10,112,328,250円
負債総額	26,579,135円
純資産総額（ - ）	10,085,749,115円
発行済数量	7,300,811,268口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.3815円

#### ハッピーエイジング30

2019年1月31日現在

資産総額	12,374,222,789円
負債総額	12,436,098円
純資産総額（ - ）	12,361,786,691円
発行済数量	8,714,860,103口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.4185円

#### ハッピーエイジング40

2019年1月31日現在

資産総額	15,417,780,473円
負債総額	15,345,301円
純資産総額（ - ）	15,402,435,172円
発行済数量	10,775,528,784口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.4294円

#### ハッピーエイジング50

2019年1月31日現在

資産総額	7,207,840,946円
負債総額	6,913,971円
純資産総額（ - ）	7,200,926,975円
発行済数量	5,176,233,236口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.3912円

## ハッピーエイジング60

2019年1月31日現在

資産総額	4,443,568,623円
負債総額	7,203,115円
純資産総額（ - ）	4,436,365,508円
発行済数量	3,443,811,522口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.2882円

## （参考）S J A M ラージキャップ・バリュール・マザーファンド

2019年1月31日現在

資産総額	28,468,442,159円
負債総額	13,472円
純資産総額（ - ）	28,468,428,687円
発行済数量	15,763,150,215口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.8060円

## （参考）S J A M スモールキャップ・マザーファンド

2019年1月31日現在

資産総額	8,696,665,515円
負債総額	51,503,535円
純資産総額（ - ）	8,645,161,980円
発行済数量	3,705,136,469口
1単位当りの純資産額（ / ）	2.3333円

## （参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2019年1月31日現在

資産総額	16,047,796,391円
負債総額	19,366円

純資産総額( - )	16,047,777,025円
発行済数量	11,183,152,574口
1単位当りの純資産額( / )	1.4350円

## (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

2019年1月31日現在

資産総額	7,345,819,155円
負債総額	13,982円
純資産総額( - )	7,345,805,173円
発行済数量	4,843,989,011口
1単位当りの純資産額( / )	1.5165円

## (参考) 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド

2019年1月31日現在

資産総額	12,063,302,663円
負債総額	27,662,309円
純資産総額( - )	12,035,640,354円
発行済数量	6,422,188,650口
1単位当りの純資産額( / )	1.8741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30年7月末現在）  
（略）
- (2) 会社の機構（平成30年7月末現在）  
（略）

<訂正後>

- (1) 資本金の額（2019年1月末現在）  
（略）
- (2) 会社の機構（2019年1月末現在）  
（略）

##### 2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

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

委託会社の運用する投資信託（親投資信託を除きます。）は2019年1月末現在、計166本（追加型株式投資信託127本、単位型株式投資信託12本、単位型公社債投資信託27本）であり、その純資産総額の合計は727,012百万円です。

##### 3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

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(2017年4月1日から2018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34期中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）の中間財務諸表について、EY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。

なお、新日本有限責任監査法人は、2018年7月1日をもって、EY新日本有限責任監査法人に名称を変更しております。

(1) 【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度 (2017年3月31日)		当事業年度 (2018年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
<b>(資産の部)</b>					
流動資産					
1		現金・預金		4,606,103	
2		前払費用		69,417	
3		未収委託者報酬		919,027	
4		未収運用受託報酬		1,371,086	
5		未収収益		57	
6		繰延税金資産		55,224	
7		その他		3,144	
流動資産合計		6,745,230		7,024,060	
固定資産					
1 有形固定資産					
	1	(1) 建物		27,525	
	1	(2) 器具備品		19,460	
有形固定資産合計		44,002		46,986	
2 無形固定資産					
		(1) 電話加入権		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		66,370	
		(2) 長期差入保証金		161,598	
		(3) 繰延税金資産		218,591	
		(4) その他		31	
投資その他の資産合計		370,490		446,591	
固定資産合計		419,028		498,113	
資産合計		7,164,258		7,522,173	

区分	注記 番号	前事業年度 (2017年3月31日)		当事業年度 (2018年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
<b>(負債の部)</b>					
流動負債					
1		預り金		15,053	
2 未払金					
	2	500,000		200,000	
		340,633		332,515	
		160,613	1,001,247	168,587	701,102

3	未払費用		691,223		1,106,809
4	未払消費税等		10,617		44,927
5	未払法人税等		143,251		71,550
6	前受収益		7,954		-
7	賞与引当金		120,025		104,908
8	役員賞与引当金		9,000		5,400
	流動負債合計		2,065,604		2,049,753
	固定負債				
1	退職給付引当金		90,737		112,624
2	資産除去債務		8,039		8,181
	固定負債合計		98,776		120,805
	負債合計		2,164,380		2,170,558
	(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		3,035,695		3,385,956
	利益剰余金合計		3,035,695		3,385,956
	株主資本合計		4,998,975		5,349,236
	評価・換算差額等				
1	その他有価証券評価差額金		902		2,378
	評価・換算差額等合計		902		2,378
	純資産合計		4,999,878		5,351,614
	負債・純資産合計		7,164,258		7,522,173

## (2) 【損益計算書】

区分	注記番号	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)		当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1	委託者報酬	5,363,843		5,004,466	
2	運用受託報酬	3,816,308	9,180,152	3,372,949	8,377,416
営業費用					
1	支払手数料	2,890,668		2,340,455	
2	広告宣伝費	15,637		40,406	
3	公告費	2,970		2,265	
4	調査費	2,245,765		2,634,404	
(1)	調査費	780,172		891,711	
(2)	委託調査費	1,461,574		1,738,613	
(3)	図書費	4,018		4,078	
5	営業雑経費	190,147		183,871	

(1) 通信費		16,450		6,147	
(2) 印刷費		160,333		162,442	
(3) 諸会費 一般管理費		13,363	5,345,189	15,281	5,201,402
1 給料		1,361,632		1,460,280	
(1) 役員報酬		75,948		74,540	
(2) 給料・手当		1,147,148		1,210,435	
(3) 賞与		138,535		175,304	
2 福利厚生費		134,150		161,706	
3 交際費		9,622		10,338	
4 寄付金		300		300	
5 旅費交通費		36,626		49,534	
6 法人事業税		41,868		34,078	
7 租税公課		13,856		15,243	
8 不動産賃借料		212,520		206,575	
9 退職給付費用		50,781		45,062	
10 賞与引当金繰入		120,025		104,908	
11 役員賞与引当金繰入		9,000		5,400	
12 固定資産減価償却費		10,429		7,609	
13 諸経費		260,939	2,261,753	297,581	2,398,617
営業利益			1,573,209		777,396
営業外収益					
1 受取配当金		90		93	
2 受取利息		280		309	
3 有価証券売却益		-		654	
4 有価証券償還益		745		-	
5 為替差益		9,721		1,906	
6 雑益		2,066	12,904	2,023	4,987
営業外費用					
1 有価証券売却損		6		-	
2 雑損		8	14	121	121
経常利益			1,586,098		782,261
特別損失					
1 固定資産除却損	1	0	0	0	0
税引前当期純利益			1,586,098		782,261
法人税・住民税及び事業税			428,835		281,742
法人税等調整額			45,816		49,741
当期純利益			1,111,446		550,260

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017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

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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	3,035,695	3,035,695	4,998,975
当期変動額						
剰余金の配当				200,000	200,000	200,000
当期純利益				550,260	550,260	550,260
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	350,260	350,260	350,260
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,385,956	3,385,956	5,349,236

	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
当期変動額			

剰余金の配当			200,000
当期純利益			550,260
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,475	1,475	1,475
当期変動額合計	1,475	1,475	351,736
当期末残高	2,378	2,378	5,351,614

## 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	2～20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、2016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）を採用していましたが、当事業年度より定額法に変更しております。

これは、当社の属するSOMPO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。

この変更による当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。

## 注記事項

### (貸借対照表関係)

- 1 有形固定資産の減価償却累計額は、次のとおりであります。

(単位：千円)

	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
建物	78,317	82,540
器具備品	44,893	47,055

- 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。

(単位：千円)

	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
未払金		
未払配当金	500,000	200,000

### (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。

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
器具備品	0	0

### (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017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 期末株式数
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
2017年3月28日 取締役会	普通 株式	500,000千円	20,759円	2016年3月31日	2017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 2017年4月1日 至 2018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 期末株式数
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
2018年3月27日 取締役会	普通 株式	200,000千円	8,303円	2017年3月31日	2018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（2017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 その他有価証券	31,812	31,812	-
資産計	6,613,532	6,613,532	-

当事業年度（2018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	4,606,103	4,606,103	-
(2) 未収委託者報酬	919,027	919,027	-
(3) 未収運用受託報酬	1,371,086	1,371,086	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	50,620	50,620	-
資産計	6,946,838	6,946,838	-
(1) 未払費用	1,106,809	1,106,809	-
負債計	1,106,809	1,106,809	-

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。

負 債

(1) 未払費用

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

注2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018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 その他有価証券」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（2017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
----	-----------	--------	---	--------

当事業年度(2018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	4,605,909	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	919,027	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	1,371,086	-	-	-
(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	-	37,688	1,126	11,806
合計	6,896,023	37,688	1,126	11,806

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(2017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

当事業年度(2018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	40,528	36,993	3,534
	小計	40,528	36,993	3,534
	(1) 株式	-	-	-

貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	10,092	10,199	106
	小計	10,092	10,199	106
合計		50,620	47,193	3,427

## 5. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017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

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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	6,160	668	14
合計	6,160	668	14

## （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

（単位：千円）

	前事業年度 （自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）	当事業年度 （自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）
退職給付引当金の期首残高	75,674	90,737
退職給付費用	21,913	24,091
退職給付の支払額	6,850	2,204
退職給付引当金の期末残高	90,737	112,624

## （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

（単位：千円）

	前事業年度 （2017年3月31日）	当事業年度 （2018年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	90,737	112,624
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	90,737	112,624
退職給付引当金	90,737	112,624
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	90,737	112,624

## (3) 退職給付費用

(単位:千円)

	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	21,913	24,091

## 3. 確定拠出制度

(単位:千円)

	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
当社の確定拠出制度への要拠出額	12,945	14,515

(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

(単位:千円)

	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018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	127,409	172,841
退職給付引当金	27,800	34,485
賞与引当金	37,039	32,123
未払費用否認	18,239	17,276
繰延資産損金算入限度超過額	7,090	6,561
未払事業税	6,351	6,393
その他	4,335	8,285
繰延税金資産 小計	228,266	277,965
評価性引当額	2,554	2,595
繰延税金資産 合計	225,712	275,370
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	402	1,049
固定資産除去価額	588	505
繰延税金負債 合計	990	1,554
繰延税金資産の純額	224,721	273,815

## 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

(単位:千円)

	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
期首残高	7,898	8,039
時の経過による調整額	140	142
期末残高	8,039	8,181

## (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 2016年4月1日 至 2017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。

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

(単位:千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益
B社(注)	972,353

(注) B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 2016年4月1日 至 2017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	運用受託報酬の受取り (注1)	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	投資信託代行手数料の支払 (注2)	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。

注2. 取引条件及び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 2017年4月1日 至 2018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	運用受託報酬の受取り (注1)	165,124	未収運用受託報酬	89,703
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	投資信託代行手数料の支払 (注2)	468,486	未払手数料	107,721

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。

注2. 取引条件及び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  
SOMPO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 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
1株当たり純資産額(円)	207,593.03	222,196.99
1株当たり当期純利益金額(円)	46,146.84	22,846.62

(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。

(注) 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 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
当期純利益(千円)	1,111,446	550,260
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)	1,111,446	550,260
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34期中間会計期間 (2018年9月30日)
区分	注記 番号	金額(千円)
<b>(資産の部)</b>		
流動資産		
1 現金・預金		4,473,545
2 前払費用		88,572
3 未収委託者報酬		1,057,891
4 未収運用受託報酬		1,254,463
5 未収収益		53
6 その他		3,511
流動資産合計		6,878,038
固定資産		
1 有形固定資産	1	50,170
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		59,373
(2) 長期差入保証金		161,598
(3) 繰延税金資産		296,100
(4) その他		32
投資その他の資産合計		517,103
固定資産合計		571,809
資産合計		7,449,848

		第34期中間会計期間 (2018年9月30日)	
区分	注記 番号	金額(千円)	
<b>(負債の部)</b>			
流動負債			
1	預り金		14,806
2	未払金		
	(1) 未払手数料		357,874
	(2) その他未払金		180,750
	未払金合計		538,625
3	未払費用		809,516
4	未払法人税等		170,820
5	賞与引当金		89,525
6	役員賞与引当金		2,700
7	その他	2	53,154
	流動負債合計		1,679,147
固定負債			
1	退職給付引当金		122,911
2	資産除去債務		8,254
	固定負債合計		131,166
<b>負債合計</b>			<b>1,810,313</b>
<b>(純資産の部)</b>			
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		3,675,331
	利益剰余金合計		3,675,331
株主資本合計			5,638,611
評価・換算差額等			
1	その他有価証券評価差額金		922
	評価・換算差額等合計		922
<b>純資産合計</b>			<b>5,639,534</b>
<b>負債・純資産合計</b>			<b>7,449,848</b>

## (2) 中間損益計算書

		第34期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018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	2,430,056	
2	運用受託報酬	1,834,500	4,264,557
営業費用			
1	支払手数料	1,087,830	
2	広告宣伝費	13,247	
3	公告費	200	
4	調査費	1,394,033	
	(1) 調査費	476,478	
	(2) 委託調査費	914,955	
	(3) 図書費	2,599	
5	営業雑経費	95,789	
	(1) 通信費	2,932	
	(2) 印刷費	80,533	
	(3) 諸会費	12,323	
			2,591,101

一般管理費				
1 給料			728,444	
(1) 役員報酬			40,840	
(2) 給料・手当			631,811	
(3) 賞与			55,792	
2 福利厚生費			95,862	
3 交際費			3,126	
4 旅費交通費			18,253	
5 法人事業税			20,304	
6 租税公課			3,566	
7 不動産賃借料			103,211	
8 退職給付費用			28,588	
9 賞与引当金繰入			89,525	
10 役員賞与引当金繰入			2,700	
11 固定資産減価償却費	1		5,729	
12 諸経費			162,828	1,262,140
営業利益				411,315
営業外収益				
1 受取配当金			98	
2 受取利息			144	
3 有価証券売却益			12,030	
4 為替差益			3,301	
5 雑益			1,266	16,840
営業外費用				
1 雑損			4,179	4,179
経常利益				423,976
特別損失				
1 固定資産除却損			0	0
税引前中間純利益				423,976
法人税、住民税及び事業税				156,243
法人税等調整額				21,643
中間純利益				289,375

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	3,385,956	3,385,956	5,349,236
当中間期変動額						
中間純利益				289,375	289,375	289,375
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	-	-	-	289,375	289,375	289,375
当中間期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,675,331	3,675,331	5,638,611

	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	2,378	2,378	5,351,614
当中間期変動額			

中間純利益			289,375
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	1,455	1,455	1,455
当中間期変動 額合計	1,455	1,455	287,920
当中間期末残高	922	922	5,639,534

## 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、売却原価は移動平均法により算定）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 2～20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。

## （表示方法の変更）

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

## 注記事項

### （中間貸借対照表関係）

	第34期中間会計期間 (2018年9月30日)
--	----------------------------

1 有形固定資産の減価償却累計額	133,835千円
2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

## (中間損益計算書関係)

	第34期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
1 減価償却実施額 有形固定資産	5,729千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第34期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018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34期中間会計期間 (2018年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

2018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	4,473,545	4,473,545	-
(2) 未収委託者報酬	1,057,891	1,057,891	-
(3) 未収運用受託報酬	1,254,463	1,254,463	-
(4) 投資有価証券			
その他有価証券	58,623	58,623	-
資産計	6,844,524	6,844,524	-
(1) 未払費用	809,516	809,516	-
負債計	809,516	809,516	-

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。

負債

(1) 未払費用

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

注2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額
非上場株式	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34期中間会計期間（2018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	27,747	26,193	1,553
	小計	27,747	26,193	1,553
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	30,876	31,099	222
	小計	30,876	31,099	222
合計		58,623	57,292	1,330

(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34期中間会計期間（2018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 8,181千円

時の経過による調整額 73千円

中間期末残高 8,254千円

## （セグメント情報等）

## セグメント情報

第34期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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34期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

## 1．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2．地域ごとの情報

## （1）営業収益

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

## （2）有形固定資産

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

## 3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益
C社（注）	552,513

（注）C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せん。

## （1株当たり情報）

	第34期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）
1株当たり純資産額	234,151.32 円
1株当たり中間純利益金額	12,014.75 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34期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）
中間純利益	289,375 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	289,375 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。

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年3月13日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY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  
業務執行社員 小 治指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志  
業務執行社員 保

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2018年7月18日から2019年1月17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2019年1月17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（2018年7月18日から2019年1月17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．XBRL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

2019年3月13日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY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  
業務執行社員 小 治指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志  
業務執行社員 保

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2018年7月18日から2019年1月17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2019年1月17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（2018年7月18日から2019年1月17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．XBRL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

2019年3月13日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY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  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志  
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、「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2018年7月18日から2019年1月17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2019年1月17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（2018年7月18日から2019年1月17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．XBRL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

2019年3月13日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY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  
業務執行社員 小 治指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志  
業務執行社員 保

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2018年7月18日から2019年1月17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2019年1月17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（2018年7月18日から2019年1月17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．XBRL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

2019年3月13日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY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  
業務執行社員 小 治指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志  
業務執行社員 保

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2018年7月18日から2019年1月17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2019年1月17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（2018年7月18日から2019年1月17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．XBRL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

2018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  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保  
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2017年4月1日から2018年3月31日までの第33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、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2018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。

## 独立監査人の中間監査報告書

2018年11月26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

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 蒲 谷 剛 史  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志 保  
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2018年4月1日から2019年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間(2018年4月1日から2018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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、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2018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(2018年4月1日から2018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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。