

## 【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】	2020年4月15日提出
【発行者名】	SOMPO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】	津田 浩平
【電話番号】	03-5290-3432
【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】

2019年10月15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】

## (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

&lt;訂正前&gt;

(略)

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(2020年4月1日付でSOMPOアセットマネジメント株式会社に商号変更する予定です。以下同じ。)は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

(略)

&lt;訂正後&gt;

(略)

委託会社であるSOMPOアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

(略)

## (4)【発行(売出)価格】

&lt;訂正前&gt;

(略)

委託会社の照会先

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432 (受付時間: 営業日の午前9時~午後5時)

ホームページ <https://www.sjnk-am.co.jp/>(2020年4月1日付で<https://www.sompo-am.co.jp/>に変更する予定です。以下同じ。)

&lt;訂正後&gt;

(略)

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432 (受付時間: 営業日の午前9時~午後5時)

ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

## (8)【申込取扱場所】

&lt;訂正前&gt;

(略)

委託会社の照会先

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432 (受付時間: 営業日の午前9時~午後5時)

ホームページ <https://www.sjnk-am.co.jp/>

&lt;訂正後&gt;

(略)

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ <https://www.sompo-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)

##### <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。  
2019年6月末現在の同グループの運用資産は、約2,053億米ドル(約22兆1,292億円\*)です。  
※2019年6月末時点の為替レートで換算。

(略)

<訂正後>

(略)

##### <ファンドの特色>

(略)

##### 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。  
2019年12月末現在の同グループの運用資産は、約2,174億米ドル(約23兆8,183億円\*)です。  
※2019年12月末時点の為替レートで換算。

(略)

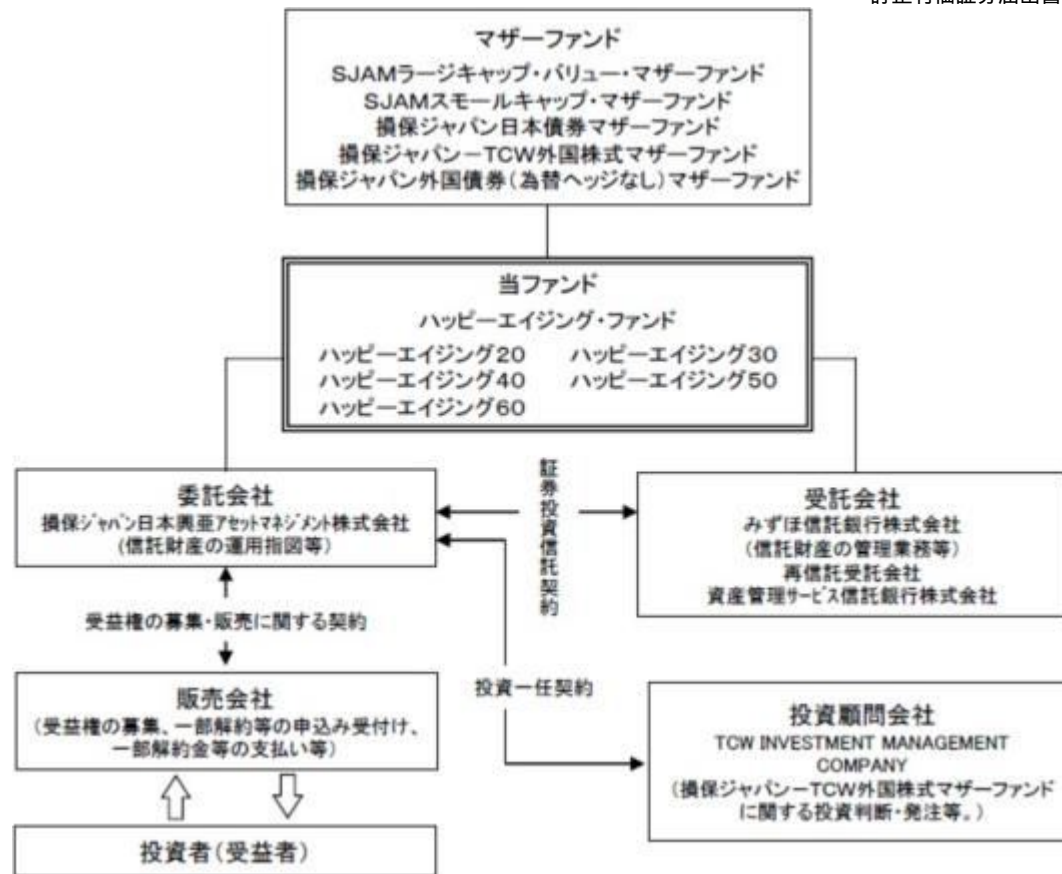
##### (3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

ファンドの仕組み

(略)

### ファンドの関係法人図



#### ファンドの関係法人

( )委託会社または委託者：損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

各ファンドの委託会社として、信託財産の運用指図、目論見書及び運用報告書の作成等を行います。

(略)

( )受託会社または受託者：みずほ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：資産管理サービス信託銀行株式会社)

委託会社との証券投資信託契約に基づき、各ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理業務などを行い、収益分配金、一部解約金及び償還金の交付、また信託財産に関する報告書を作成し委託会社への交付を行います。なお、信託事務の処理の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。

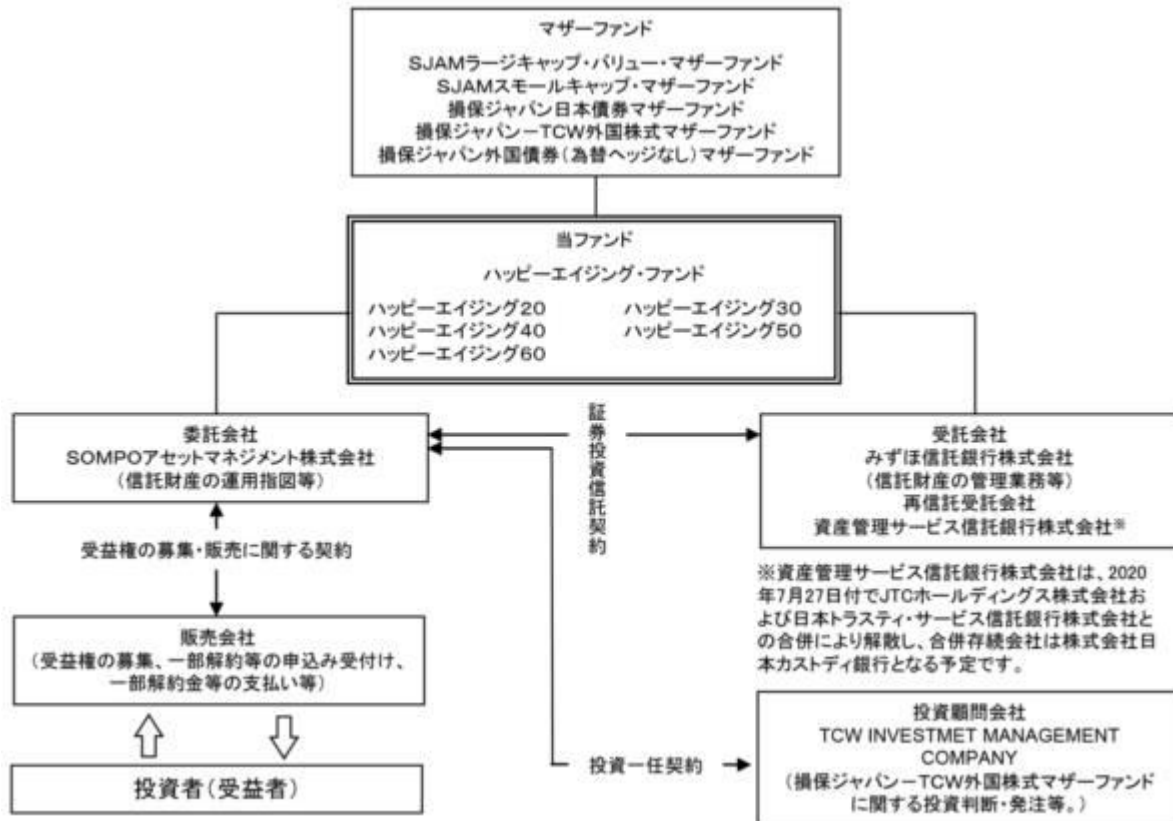
(略)

<訂正後>

#### ファンドの仕組み

(略)

### ファンドの関係法人図



#### ファンドの関係法人

##### ( )委託会社または委託者：SOMPOアセットマネジメント株式会社

各ファンドの委託会社として、信託財産の運用指図、目論見書及び運用報告書の作成等を行います。

(略)

##### ( )受託会社または受託者：みずほ信託銀行株式会社

##### (再信託受託会社：資産管理サービス信託銀行株式会社)

委託会社との証券投資信託契約に基づき、各ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理業務などを行い、収益分配金、一部解約金及び償還金の交付、また信託財産に関する報告書を作成し委託会社への交付を行います。なお、信託事務の処理の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。

資産管理サービス信託銀行株式会社は、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社との合併により解散し、合併存続会社は株式会社日本カストディ銀行となる予定です。以下同じ。

(略)

<訂正前>

#### 委託会社等の概況

( )資本金の額 1,550百万円 (2019年7月末現在)

#### ( )委託会社の沿革

1986年	2月25日	安田火災投資顧問株式会社設立
1987年	2月20日	投資顧問業の登録
1987年	9月9日	投資一任業務の認可取得
1991年	6月1日	プリンソン・パートナーズ投資顧問株式会社と合併し、安田火災プリンソン投資顧問株式会社に商号変更
1998年	1月1日	安田火災グローバル・アセット・マネジメント株式会社に商号変更

1998年	3月3日	安田火災グローバル投信投資顧問株式会社に商号変更
1998年	3月31日	証券投資信託委託業の免許取得
2002年	7月1日	損保ジャパン・アセットマネジメント株式会社に商号変更
2007年	9月30日	金融商品取引業者として登録
2010年	10月1日	ゼスト・アセットマネジメント株式会社と合併し、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社に商号変更
2020年	4月1日	SOMPOアセットマネジメント株式会社に商号変更(予定)

( )大株主の状況(2019年7月末現在)

(略)

<訂正後>

委託会社等の概況

( )資本金の額 1,550百万円 (2020年1月末現在)

( )委託会社の沿革

1986年	2月25日	安田火災投資顧問株式会社設立
1987年	2月20日	投資顧問業の登録
1987年	9月9日	投資一任業務の認可取得
1991年	6月1日	プリンソン・パートナーズ投資顧問株式会社と合併し、安田火災プリンソン投資顧問株式会社に商号変更
1998年	1月1日	安田火災グローバル・アセット・マネジメント株式会社に商号変更
1998年	3月3日	安田火災グローバル投信投資顧問株式会社に商号変更
1998年	3月31日	証券投資信託委託業の免許取得
2002年	7月1日	損保ジャパン・アセットマネジメント株式会社に商号変更
2007年	9月30日	金融商品取引業者として登録
2010年	10月1日	ゼスト・アセットマネジメント株式会社と合併し、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社に商号変更
2020年	4月1日	SOMPOアセットマネジメント株式会社に商号変更

( )大株主の状況(2020年1月末現在)

(略)

## 2【投資方針】

(2)【投資対象】

<訂正前>

(略)

委託会社は、信託金を、主として後記1.から5.までの損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託の受益証券および後記6.から25.までの有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

(略)

<訂正後>

(略)



委託会社は、信託金を、主として後記1．から5．までのSOMPOアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託の受益証券および後記6．から25．までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

（略）

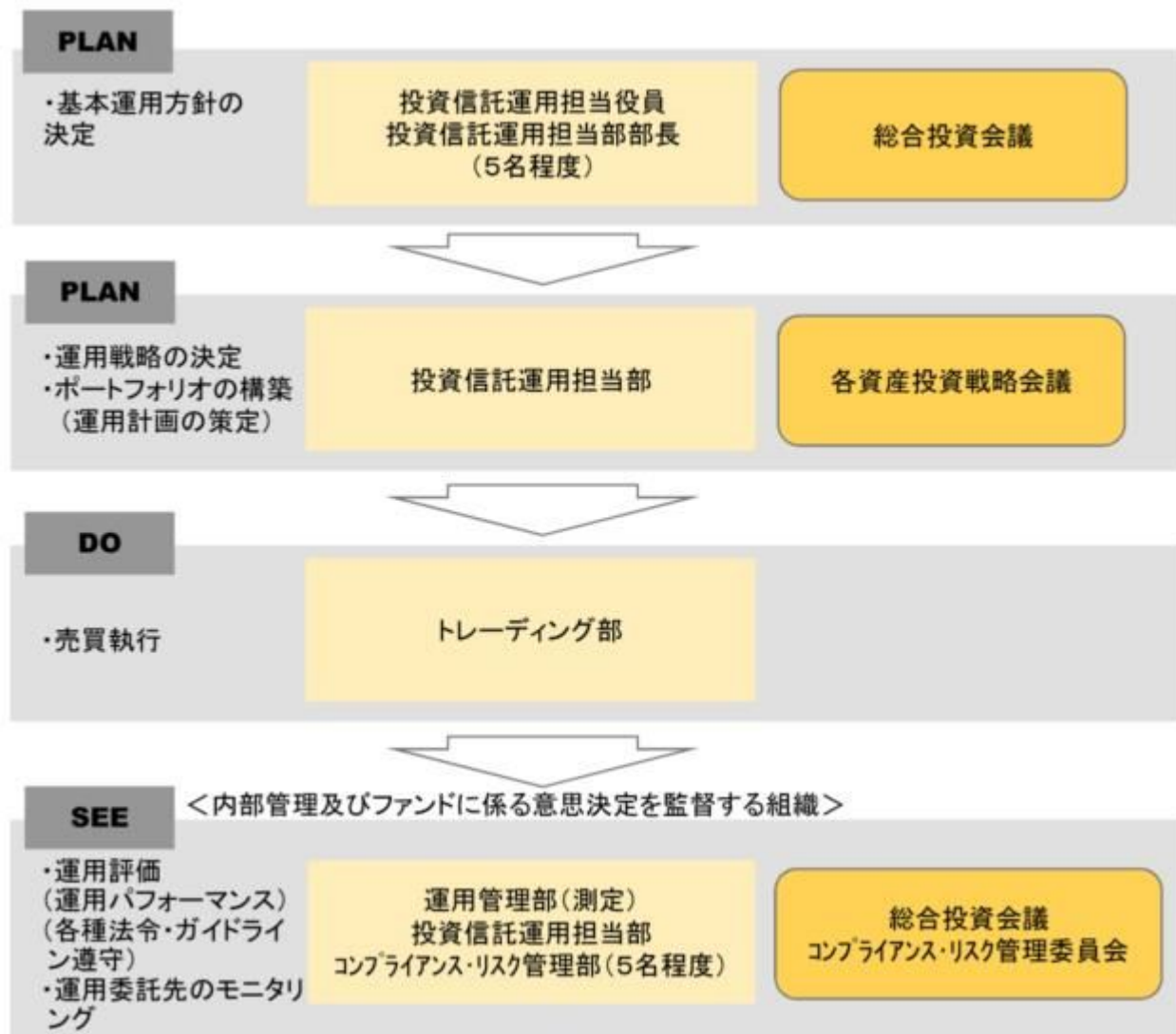
### （3）【運用体制】

<訂正前>

a．委託会社の運用体制と社内規程

（運用体制）

（略）



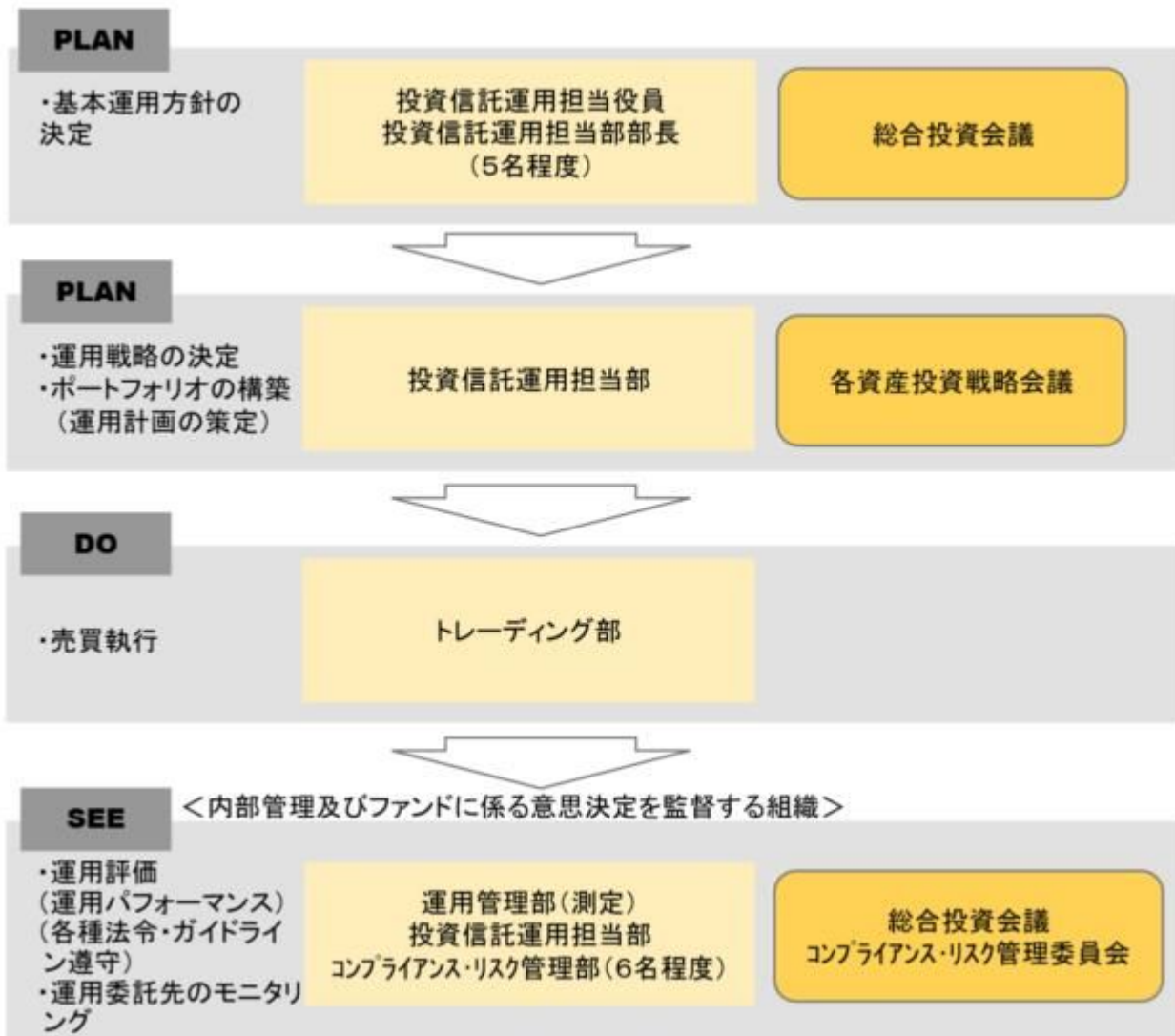
2019年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

<訂正後>

a．委託会社の運用体制と社内規程

（運用体制）

（略）



2020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。

<訂正前>

b. 運用委託先の運用体制等

(略)

(本組織図は、2019年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。)

<訂正後>

b. 運用委託先の運用体制等

(略)

(本組織図は、2020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、2019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

2014年8月～2019年7月

## ハッピーエイジング20



ファンドと他の代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

2014年8月～2019年7月



## ハッピーエイジング30



## ハッピーエイジング40



## ハッピーエイジング50



## ハッピーエイジング60



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

<p>日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)</p> <p>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。</p>	<p>先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)</p> <p>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。</p>
<p>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)</p> <p>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。</p>	<p>日本国債:NOMURA-BPI 国債</p> <p>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。</p>
<p>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)</p> <p>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。</p>	<p>新興国債:J.P.モルガンG B I - E Mグローバル・ディバースィファイド(円ベース)</p> <p>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。</p>

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

<訂正後>

(略)

<リスクの管理体制>

## a. 委託会社のリスク管理体制

(略)

(注) 上図は、2020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

2015年2月～2020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

2015年2月～2020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

<p>日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)</p> <p>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。</p>	<p>先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)</p> <p>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。</p>
<p>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)</p> <p>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。</p>	<p>日本国債:NOMURA-BPI 国債</p> <p>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。</p>
<p>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)</p> <p>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。</p>	<p>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)</p> <p>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。</p>

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

## 4【手数料等及び税金】

## (5) 【課税上の取扱い】

&lt; 訂正前 &gt;

(略)

2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2019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。

&lt; 訂正後 &gt;

(略)

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2020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

2020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	516,259,591	4.68
親投資信託受益証券	日本	10,262,914,419	93.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		243,211,289	2.21
純資産総額		11,022,385,299	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

2020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	643,403,734	4.74
親投資信託受益証券	日本	12,628,653,269	93.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		299,197,622	2.21
純資産総額		13,571,254,625	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

2020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	796,754,576	4.60
親投資信託受益証券	日本	16,125,652,621	93.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		405,536,198	2.34
純資産総額		17,327,943,395	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

2020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	232,516,912	2.87
親投資信託受益証券	日本	7,698,444,820	94.97
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		174,905,601	2.16
純資産総額		8,105,867,333	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

2020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	4,822,942,684	98.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		96,936,376	1.97
純資産総額		4,919,879,060	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・バリュール・マザーファンド

2020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	34,234,954,570	98.64
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		473,184,404	1.36
純資産総額		34,708,138,974	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

2020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	9,159,553,300	95.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		470,266,400	4.88
純資産総額		9,629,819,700	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

2020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	13,851,556,400	76.27
地方債証券	日本	114,330,000	0.63
特殊債券	日本	239,428,713	1.32
社債券	日本	3,655,822,000	20.13
	フランス	210,900,000	1.16
		3,866,722,000	21.29
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		88,794,618	0.49
純資産総額		18,160,831,731	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

2020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	3,445,476,354	40.52
	イタリア	960,051,902	11.29
	フランス	930,152,285	10.94
	ドイツ	839,406,797	9.87
	スペイン	675,999,251	7.95
	イギリス	551,138,518	6.48
	ベルギー	217,216,550	2.55
	カナダ	163,682,077	1.93
	オーストラリア	160,856,547	1.89

	オランダ	80,633,245	0.95
	メキシコ	66,559,038	0.78
	アイルランド	56,563,039	0.67
	ポーランド	44,139,270	0.52
	デンマーク	36,267,722	0.43
	マレーシア	32,318,862	0.38
	スウェーデン	26,861,929	0.32
	ノルウェー	19,674,839	0.23
		8,306,998,225	97.70
特殊債券	国際機関	27,068,867	0.32
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		168,294,971	1.98
純資産総額		8,502,362,063	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

2020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	9,679,921,769	71.06
	バミューダ	352,166,531	2.59
	イギリス	325,871,433	2.39
	スイス	313,852,436	2.30
	ドイツ	301,311,443	2.21
	カナダ	269,158,996	1.98
	アイルランド	263,232,680	1.93
	フランス	246,669,018	1.81
	オランダ	178,835,601	1.31
	シンガポール	139,927,260	1.03
	オーストラリア	93,485,247	0.69
	ジャージー	51,465,472	0.38
	スウェーデン	50,767,270	0.37
	ケイマン	40,362,854	0.30
	スペイン	36,207,816	0.27
	ベルギー	23,518,530	0.17
	香港	15,326,064	0.11
	プエルトリコ	10,170,396	0.07
			12,392,250,816
投資証券	アメリカ	955,773,758	7.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		274,879,599	2.01
純資産総額		13,622,904,173	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。

## (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

2020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	1,556,161,000	2.1529	3,350,259,017	2.3461	3,650,909,322	33.12
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	1,222,825,852	2.2685	2,774,075,791	2.3476	2,870,705,970	26.04
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	1,540,455,074	1.7454	2,688,827,635	1.8522	2,853,230,888	25.89
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	407,424,292	1.5696	639,493,169	1.6363	666,668,368	6.05
5	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	91,721	5,613.83	514,906,790	5,628.58	516,259,591	4.68
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	150,766,000	1.4653	220,917,420	1.4685	221,399,871	2.01

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2020年1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	4.68
親投資信託受益証券	93.11
合計	97.79

(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

2020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	1,271,782,215	2.2654	2,881,144,578	2.3476	2,985,635,927	22.00
2	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mラージキャップ・パ リユー・マザーファンド	1,602,170,323	1.7395	2,787,103,796	1.8522	2,967,539,872	21.87
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	1,217,176,141	2.1523	2,619,728,209	2.3461	2,855,616,944	21.04

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	1,669,220,692	1.5693	2,619,508,032	1.6363	2,731,345,818	20.13
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	741,242,566	1.4651	1,085,994,484	1.4685	1,088,514,708	8.02
6	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	114,310	5,612.09	641,518,840	5,628.58	643,403,734	4.74

(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

2020年1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	4.74
親投資信託受益証券	93.05
合計	97.80

(注1) 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

2020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	3,901,921,796	1.4648	5,715,535,047	1.4685	5,729,972,157	33.07
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	1,143,366,279	2.2606	2,584,798,143	2.3476	2,684,166,676	15.49
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	1,440,426,678	1.7366	2,501,448,160	1.8522	2,667,958,292	15.40
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	1,597,592,754	1.5681	2,505,185,198	1.6363	2,614,141,023	15.09
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	1,035,511,902	2.1508	2,227,178,999	2.3461	2,429,414,473	14.02
6	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	141,555	5,612.22	794,438,878	5,628.58	796,754,576	4.60

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2020年1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	4.60
親投資信託受益証券	93.06
合計	97.66

（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

2020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	3,147,697,130	1.4647	4,610,431,987	1.4685	4,622,393,235	57.03
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	547,164,908	1.5670	857,407,411	1.6363	895,325,938	11.05
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	327,395,882	2.2574	739,085,747	2.3476	768,594,572	9.48
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	412,360,838	1.7361	715,936,613	1.8522	763,774,744	9.42
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	276,354,943	2.1489	593,859,138	2.3461	648,356,331	8.00
6	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	41,310	5,580.72	230,539,953	5,628.58	232,516,912	2.87

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2020年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	2.87
親投資信託受益証券	94.97
合計	97.84

（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

2020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	2,412,675,984	1.4644	3,533,133,079	1.4685	3,543,014,682	72.01
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	482,934,311	1.5664	756,486,181	1.6363	790,225,413	16.06
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	83,612,533	2.2560	188,631,663	2.3476	196,288,782	3.99
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	105,310,650	1.7365	182,871,944	1.8522	195,056,385	3.96

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	41,923,798	2.1458	89,960,086	2.3461	98,357,422	2.00
---	----	---------------	--------------------------------	------------	--------	------------	--------	------------	------

(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

2020年1月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.03
合計	98.03

(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・バリュース・マザーファンド

2020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	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	3,989,800	565.31	2,255,479,708	568.50	2,268,201,300	6.54
2	日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品 先物取引 業	3,799,800	422.01	1,603,553,598	566.30	2,151,826,740	6.20
3	日本	株式	三井住友フィナン シャルグループ	銀行業	518,400	3,947.63	2,046,453,982	3,884.00	2,013,465,600	5.80
4	日本	株式	本田技研工業	輸送用機 器	576,400	2,982.57	1,719,155,412	2,831.00	1,631,788,400	4.70
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	565,200	2,386.86	1,349,054,030	2,786.50	1,574,929,800	4.54
6	日本	株式	日本製鉄	鉄鋼	995,900	1,949.63	1,941,645,318	1,535.50	1,529,204,450	4.41
7	日本	株式	鹿島建設	建設業	853,100	1,330.08	1,134,692,539	1,406.00	1,199,458,600	3.46
8	日本	株式	ヤマダ電機	小売業	2,097,600	515.16	1,080,610,893	551.00	1,155,777,600	3.33
9	日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	759,400	1,505.88	1,143,566,255	1,480.00	1,123,912,000	3.24
10	日本	株式	第一生命ホールディ ングス	保険業	661,600	1,649.84	1,091,538,082	1,656.00	1,095,609,600	3.16
11	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	454,500	2,492.58	1,132,878,299	2,316.00	1,052,622,000	3.03
12	日本	株式	日揮ホールディングス	建設業	653,700	1,505.28	984,004,449	1,597.00	1,043,958,900	3.01
13	日本	株式	三菱電機	電気機器	650,300	1,532.62	996,663,000	1,545.00	1,004,713,500	2.89
14	日本	株式	セイコーエプソン	電気機器	577,300	1,624.20	937,655,842	1,620.00	935,226,000	2.69
15	日本	株式	日本テレビホールディ ングス	情報・通 信業	598,400	1,604.23	959,973,396	1,488.00	890,419,200	2.57
16	日本	株式	クレディセゾン	その他金 融業	479,100	1,515.29	725,977,897	1,776.00	850,881,600	2.45
17	日本	株式	電源開発	電気・ガ ス業	335,600	2,460.30	825,679,406	2,479.00	831,952,400	2.40
18	日本	株式	クラレ	化学	615,400	1,249.95	769,225,230	1,335.00	821,559,000	2.37
19	日本	株式	大和証券グループ本 社	証券、商品 先物取引 業	1,414,900	550.99	779,607,966	559.10	791,070,590	2.28
20	日本	株式	三井不動産	不動産業	270,600	2,497.24	675,754,198	2,911.50	787,851,900	2.27

21	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,286,500	907.94	1,168,075,486	599.50	771,256,750	2.22
22	日本	株式	三井住友トラスト・ホールディングス	銀行業	185,200	4,076.39	754,947,870	4,083.00	756,171,600	2.18
23	日本	株式	ヤマトホールディングス	陸運業	419,400	1,850.72	776,195,412	1,775.00	744,435,000	2.14
24	日本	株式	東京瓦斯	電気・ガス業	279,700	2,625.02	734,219,415	2,408.00	673,517,600	1.94
25	日本	株式	KDDI	情報・通信業	197,600	2,688.01	531,150,776	3,271.00	646,349,600	1.86
26	日本	株式	小松製作所	機械	251,600	2,452.70	617,100,779	2,467.00	620,697,200	1.79
27	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	62,900	10,075.88	633,773,304	9,700.00	610,130,000	1.76
28	日本	株式	ジェイ・エフ・イーホールディングス	鉄鋼	423,400	1,837.42	777,964,115	1,315.00	556,771,000	1.60
29	日本	株式	ケースホールディングス	小売業	417,300	1,018.02	424,819,746	1,333.00	556,260,900	1.60
30	日本	株式	日本郵船	海運業	300,800	1,756.05	528,221,482	1,774.00	533,619,200	1.54

(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

2020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	7.26
		食料品	3.03
		化学	2.37
		石油・石炭製品	0.85
		ガラス・土石製品	0.95
		鉄鋼	6.01
		非鉄金属	3.24
		機械	2.91
		電気機器	5.59
		輸送用機器	9.20
		電気・ガス業	5.65
		陸運業	3.90
		海運業	1.54
		情報・通信業	8.97
		小売業	4.93
		銀行業	14.51
		証券、商品先物取引業	8.48
		保険業	3.16
その他金融業	2.45		
不動産業	3.65		
合計			98.64

(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

2020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	みらかホールディングス	サービス業	110,000	2,380.00	261,800,000	2,895.00	318,450,000	3.31
2	日本	株式	シチズン時計	精密機器	570,000	513.00	292,410,000	536.00	305,520,000	3.17
3	日本	株式	伊予銀行	銀行業	510,000	497.00	253,470,000	571.00	291,210,000	3.02
4	日本	株式	日立キャピタル	その他金融業	85,000	2,134.00	181,390,000	3,000.00	255,000,000	2.65
5	日本	株式	八十二銀行	銀行業	600,000	397.00	238,200,000	423.00	253,800,000	2.64
6	日本	株式	東邦ホールディングス	卸売業	110,000	2,533.20	278,652,220	2,266.00	249,260,000	2.59
7	日本	株式	ダイビル	不動産業	180,000	1,038.00	186,840,000	1,360.00	244,800,000	2.54
8	日本	株式	七十七銀行	銀行業	145,000	1,379.00	199,955,000	1,682.00	243,890,000	2.53
9	日本	株式	N O K	輸送用機器	164,300	1,552.00	254,993,600	1,484.00	243,821,200	2.53
10	日本	株式	E I Z O	電気機器	67,000	3,615.00	242,205,000	3,610.00	241,870,000	2.51
11	日本	株式	豊田合成	輸送用機器	90,000	2,058.00	185,220,000	2,521.00	226,890,000	2.36
12	日本	株式	島忠	小売業	70,000	2,557.00	178,990,000	3,140.00	219,800,000	2.28
13	日本	株式	キョーリン製薬ホールディングス	医薬品	104,800	1,787.70	187,351,135	1,981.00	207,608,800	2.16
14	日本	株式	リコーリース	その他金融業	50,000	3,315.00	165,750,000	4,105.00	205,250,000	2.13
15	日本	株式	日本ライフライン	卸売業	155,000	1,690.00	261,950,000	1,320.00	204,600,000	2.12
16	日本	株式	コメリ	小売業	81,500	2,169.42	176,808,427	2,368.00	192,992,000	2.00
17	日本	株式	ほくほくフィナンシャルグループ	銀行業	180,000	955.64	172,016,721	1,062.00	191,160,000	1.99
18	日本	株式	エクセディ	輸送用機器	80,800	2,007.00	162,165,600	2,301.00	185,920,800	1.93
19	日本	株式	ノーリツ鋼機	精密機器	115,000	1,828.15	210,238,252	1,606.00	184,690,000	1.92
20	日本	株式	A D E K A	化学	114,000	1,288.00	146,832,000	1,607.00	183,198,000	1.90
21	日本	株式	A O K Iホールディングス	小売業	169,000	1,051.18	177,649,724	1,074.00	181,506,000	1.88
22	日本	株式	広島銀行	銀行業	360,000	481.00	173,160,000	499.00	179,640,000	1.87
23	日本	株式	北洋銀行	銀行業	800,000	211.00	168,800,000	222.00	177,600,000	1.84
24	日本	株式	山口フィナンシャルグループ	銀行業	258,000	712.06	183,714,015	667.00	172,086,000	1.79
25	日本	株式	N I P P O	建設業	60,000	1,945.27	116,716,266	2,713.00	162,780,000	1.69
26	日本	株式	群馬銀行	銀行業	440,000	354.46	155,965,692	358.00	157,520,000	1.64
27	日本	株式	ツクイ	サービス業	270,000	445.32	120,236,668	576.00	155,520,000	1.61
28	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	440,000	290.00	127,600,000	331.00	145,640,000	1.51
29	日本	株式	第四北越フィナンシャルグループ	銀行業	50,000	2,470.00	123,500,000	2,738.00	136,900,000	1.42
30	日本	株式	大同特殊鋼	鉄鋼	32,000	4,085.00	130,720,000	4,245.00	135,840,000	1.41

(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



2020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	1.69
		繊維製品	1.00
		パルプ・紙	0.79
		化学	3.52
		医薬品	2.61
		鉄鋼	2.98
		非鉄金属	1.07
		金属製品	2.10
		機械	0.62
		電気機器	3.20
		輸送用機器	8.09
		精密機器	5.99
		その他製品	2.30
		電気・ガス業	0.59
		倉庫・運輸関連業	0.82
		情報・通信業	0.22
		卸売業	6.41
		小売業	10.34
		銀行業	22.94
		証券、商品先物取引業	1.51
その他金融業	5.16		
不動産業	4.29		
サービス業	6.90		
合計			95.12

（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

2020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140回利付 国債(5年)	920,000,000	102.16	939,915,300	101.21	931,150,400	0.1000000	2024/6/20	5.13
2	日本	国債証券	第355回利付 国債(10年)	800,000,000	102.58	820,699,100	101.74	813,984,000	0.1000000	2029/6/20	4.48
3	日本	国債証券	第38回利付国 債(30年)	560,000,000	134.23	751,701,500	134.02	750,556,800	1.8000000	2043/3/20	4.13
4	日本	国債証券	第138回利付 国債(5年)	720,000,000	101.13	728,150,400	101.09	727,869,600	0.1000000	2023/12/20	4.01
5	日本	国債証券	第406回利付 国債(2年)	720,000,000	100.45	723,247,200	100.45	723,268,800	0.1000000	2021/11/1	3.98
6	日本	国債証券	第139回利付 国債(5年)	620,000,000	100.87	625,394,000	101.16	627,210,600	0.1000000	2024/3/20	3.45

7	日本	国債証券	第407回利付 国債(2年)	610,000,000	100.48	612,933,900	100.47	612,897,500	0.1000000	2021/12/1	3.37
8	日本	国債証券	第162回利付 国債(20年)	560,000,000	107.32	601,014,000	107.35	601,210,400	0.6000000	2037/9/20	3.31
9	日本	国債証券	第166回利付 国債(20年)	530,000,000	109.34	579,511,600	109.07	578,108,100	0.7000000	2038/9/20	3.18
10	日本	国債証券	第151回利付 国債(20年)	470,000,000	116.45	547,328,800	116.29	546,581,800	1.2000000	2034/12/20	3.01
11	日本	国債証券	第354回利付 国債(10年)	520,000,000	103.45	537,953,400	101.79	529,328,800	0.1000000	2029/3/20	2.91
12	日本	国債証券	第43回利付 国債(30年)	390,000,000	132.46	516,626,000	133.00	518,731,200	1.7000000	2044/6/20	2.86
13	日本	国債証券	第405回利付 国債(2年)	510,000,000	100.60	513,093,800	100.43	512,203,200	0.1000000	2021/10/1	2.82
14	日本	国債証券	第154回利付 国債(20年)	420,000,000	117.13	491,958,600	116.74	490,329,000	1.2000000	2035/9/20	2.70
15	日本	国債証券	第158回利付 国債(20年)	390,000,000	105.68	412,154,800	105.76	412,475,700	0.5000000	2036/9/20	2.27
16	日本	国債証券	第353回利付 国債(10年)	390,000,000	102.28	398,897,500	101.83	397,160,400	0.1000000	2028/12/20	2.19
17	日本	国債証券	第356回利付 国債(10年)	290,000,000	101.25	293,651,500	101.69	294,921,300	0.1000000	2029/9/20	1.62
18	日本	国債証券	第35回利付 国債(30年)	210,000,000	136.77	287,221,200	136.60	286,874,700	2.0000000	2041/9/20	1.58
19	日本	国債証券	第11回利付 国債(40年)	240,000,000	115.12	276,294,200	114.55	274,936,800	0.8000000	2058/3/20	1.51
20	日本	国債証券	第150回利付 国債(20年)	230,000,000	119.82	275,586,000	119.08	273,893,200	1.4000000	2034/9/20	1.51
21	日本	国債証券	第146回利付 国債(20年)	210,000,000	123.31	258,961,500	122.33	256,899,300	1.7000000	2033/9/20	1.41
22	日本	国債証券	第57回利付 国債(30年)	210,000,000	111.77	234,735,900	112.14	235,496,100	0.8000000	2047/12/20	1.30
23	日本	国債証券	第130回利付 国債(20年)	190,000,000	122.36	232,497,300	121.07	230,033,000	1.8000000	2031/9/20	1.27
24	日本	国債証券	第113回利付 国債(20年)	180,000,000	122.68	220,833,000	121.09	217,963,800	2.1000000	2029/9/20	1.20
25	日本	国債証券	第63回利付 国債(30年)	210,000,000	99.80	209,580,000	101.06	212,230,200	0.4000000	2049/6/20	1.17
26	日本	社債券	第1回武田薬品 工業株式会社無 担保社債(劣後 特約付)FR	200,000,000	102.54	205,098,000	103.75	207,500,000	1.7200000	2079/6/6	1.14
27	日本	社債券	第3回A号明治 安田生命劣後FR	200,000,000	101.70	203,414,000	101.30	202,606,000	1.1100000	2047/11/6	1.12
28	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	100.26	200,524,000	100.79	201,588,000	0.4400000	2023/4/19	1.11
29	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	101.07	202,152,000	100.62	201,258,000	1.1550000	2020/9/8	1.11
30	日本	社債券	第3回A号富国 生命劣後FR	200,000,000	100.01	200,020,000	99.69	199,380,000	1.0200000	9999/99/99	1.10

(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

2020年1月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	76.27
地方債証券	0.63
特殊債券	1.32
社債券	21.29
合計	99.51

（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

2020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	7,180,000	10,955.03	786,571,663	11,010.69	790,568,088	1.8750000	2022/2/28	9.30
2	アメリカ	国債証券	Treasury 2.125 240229	4,880,000	11,050.64	539,271,278	11,231.43	548,094,029	2.1250000	2024/2/29	6.45
3	フランス	国債証券	FRANCE 0.0 220525	3,420,000	12,252.60	419,039,114	12,201.06	417,276,478	0.0000000	2022/5/25	4.91
4	ドイツ	国債証券	GERMANY 0.0 211008	3,100,000	12,211.85	378,567,619	12,162.08	377,024,772	0.0000000	2021/10/8	4.43
5	イタリア	国債証券	ITALY 1.75 240701	2,680,000	12,744.34	341,548,470	12,824.22	343,689,112	1.7500000	2024/7/1	4.04
6	アメリカ	国債証券	Treasury 2.125 250515	2,570,000	11,030.32	283,479,440	11,306.35	290,573,433	2.1250000	2025/5/15	3.42
7	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 280215	2,090,000	11,511.28	240,585,815	11,934.32	249,427,429	2.7500000	2028/2/15	2.93
8	アメリカ	国債証券	Treasury 1.875 260630	2,220,000	11,007.16	244,359,158	11,187.92	248,371,826	1.8750000	2026/6/30	2.92
9	スペイン	国債証券	SPAIN 1.5 270430	1,840,000	13,198.62	242,854,771	13,285.45	244,452,294	1.5000000	2027/4/30	2.88
10	スペイン	国債証券	SPAIN 0.25 240730	1,970,000	12,241.27	241,153,127	12,273.96	241,797,177	0.2500000	2024/7/30	2.84
11	アメリカ	国債証券	Treasury 3.0 480215	1,790,000	11,751.21	210,346,749	13,155.36	235,480,989	3.0000000	2048/2/15	2.77
12	アメリカ	国債証券	Treasury 2.375 290515	1,810,000	11,459.96	207,425,396	11,685.56	211,508,652	2.3750000	2029/5/15	2.49
13	イタリア	国債証券	ITALY 2.8 281201	1,430,000	14,061.82	201,084,048	14,089.29	201,476,924	2.8000000	2028/12/1	2.37
14	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 250228	1,540,000	11,395.02	175,483,386	11,632.77	179,144,748	2.7500000	2025/2/28	2.11
15	ドイツ	国債証券	GERMANY 0.25 290215	1,130,000	12,821.98	144,888,429	12,834.56	145,030,600	0.2500000	2029/2/15	1.71
16	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA 4.75 270421	1,530,000	9,179.06	140,439,660	9,324.02	142,657,614	4.7500000	2027/4/21	1.68
17	アメリカ	国債証券	Treasury 2.875 430515	1,120,000	11,499.28	128,792,007	12,656.84	141,756,711	2.8750000	2043/5/15	1.67
18	イタリア	国債証券	ITALY 1.35 220415	1,140,000	12,432.52	141,730,772	12,416.04	141,542,887	1.3500000	2022/4/15	1.66
19	アメリカ	国債証券	Treasury 2.875 490515	1,050,000	12,259.39	128,723,622	12,940.62	135,876,545	2.8750000	2049/5/15	1.60
20	ドイツ	国債証券	GERMANY 0.5 280215	800,000	13,060.85	104,486,806	13,044.97	104,359,769	0.5000000	2028/2/15	1.23

21	ドイツ	国債証券	GERMANY 4.0 370104	490,000	21,050.09	103,145,460	20,680.17	101,332,840	4.0000000	2037/1/4	1.19
22	カナダ	国債証券	CANADA 5.75 290601	860,000	11,307.64	97,245,724	11,416.20	98,179,374	5.7500000	2029/6/1	1.15
23	ベルギー	国債証券	BELGIUM 2.25 230622	720,000	13,378.08	96,322,189	13,194.62	95,001,295	2.2500000	2023/6/22	1.12
24	フランス	国債証券	FRANCE 2.75 271025	630,000	14,997.55	94,484,583	14,926.94	94,039,749	2.7500000	2027/10/25	1.11
25	フランス	国債証券	FRA 0.75 281125	700,000	13,026.39	91,184,778	13,083.70	91,585,954	0.7500000	2028/11/25	1.08
26	ドイツ	国債証券	GERMANY 2.5 460815	450,000	18,936.42	85,213,904	19,866.22	89,397,998	2.5000000	2046/8/15	1.05
27	フランス	国債証券	FRANCE 4.0 381025	440,000	19,967.39	87,856,533	20,193.55	88,851,655	4.0000000	2038/10/25	1.05
28	イギリス	国債証券	UK GILT 4.0 600122	300,000	26,588.01	79,764,035	28,712.44	86,137,323	4.0000000	2060/1/22	1.01
29	アメリカ	国債証券	Treasury 1.625 230531	760,000	10,819.84	82,230,804	10,997.06	83,577,695	1.6250000	2023/5/31	0.98
30	アメリカ	国債証券	Treasury 4.625 400215	420,000	14,786.13	62,101,774	15,929.52	66,903,991	4.6250000	2040/2/15	0.79

(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。

(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

2020年1月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.70
特殊債券	0.32
合計	98.02

(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

2020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	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェ ア・サービ ス	24,611	19,615.77	482,763,829	22,707.38	558,851,393	4.10
2	アメリカ	株式	FISERV INC	ソフトウェ ア・サービ ス	37,788	11,702.24	442,204,434	13,221.34	499,608,139	3.67
3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェ ア・サービ ス	21,186	15,139.40	320,743,464	18,843.38	399,215,993	2.93
4	アメリカ	株式	TRANSUNION	商業・専門 サービス	37,921	8,303.28	314,868,707	10,175.29	385,857,475	2.83
5	バミュー ダ	株式	IHS MARKIT LTD	商業・専門 サービス	38,058	7,135.79	271,574,116	8,719.34	331,840,908	2.44

6	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	7,653	30,448.96	233,025,896	35,385.60	270,806,055	1.99
7	カナダ	株式	WASTE CONNECTIONS INC	商業・専門サービス	25,199	10,533.24	265,427,167	10,681.33	269,158,996	1.98
8	アメリカ	株式	TRANSDIGM GROUP INC	資本財	3,537	54,985.04	194,482,097	71,312.15	252,231,084	1.85
9	アメリカ	株式	DANAHER CORP	ヘルスケア機器・サービス	12,470	15,394.89	191,974,400	18,436.59	229,904,315	1.69
10	アメリカ	株式	MOTOROLA SOLUTIONS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	11,625	19,178.27	222,947,449	19,638.43	228,296,798	1.68
11	アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORP		8,688	23,225.41	201,782,428	25,650.91	222,855,123	1.64
12	アメリカ	株式	ADOBE SYSTEMS INC	ソフトウェア・サービス	5,594	33,325.46	186,422,646	38,906.06	217,640,524	1.60
13	アメリカ	株式	ALPHABET, INC	メディア・娯楽	1,369	125,873.78	172,321,205	158,773.91	217,361,483	1.60
14	アメリカ	株式	S&P GLOBAL INC	各種金融	6,525	26,607.51	173,614,023	32,702.73	213,385,324	1.57
15	アメリカ	株式	ROPER TECHNOLOGIES INC	資本財	5,022	41,469.72	208,260,967	42,465.78	213,263,161	1.57
16	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1,019	216,768.74	220,887,353	204,016.36	207,892,672	1.53
17	アメリカ	株式	SERVICENOW INC	ソフトウェア・サービス	5,440	32,227.22	175,316,131	37,257.07	202,678,500	1.49
18	アメリカ	株式	IDEX CORP	資本財	10,080	18,339.31	184,860,305	18,095.23	182,399,971	1.34
19	アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	5,239	31,186.75	163,387,413	34,375.71	180,094,355	1.32
20	アメリカ	株式	TRADE DESK INC/THE - CLASS A	ソフトウェア・サービス	5,935	25,211.40	149,629,660	30,279.41	179,708,348	1.32
21	アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5,141	31,395.38	161,403,699	34,883.93	179,338,292	1.32
22	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	7,737	21,926.51	169,645,431	22,851.34	176,800,831	1.30
23	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC		2,610	56,843.68	148,362,007	65,763.18	171,641,900	1.26
24	アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	8,420	17,303.45	145,695,130	20,249.17	170,498,013	1.25
25	アメリカ	株式	ARAMARK	消費者サービス	31,724	4,597.64	145,855,615	4,940.41	156,729,821	1.15
26	アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	10,628	12,979.23	137,943,262	12,773.10	135,752,583	1.00
27	アメリカ	株式	HEICO CORP	資本財	9,427	14,206.04	133,920,381	13,426.37	126,570,452	0.93
28	アメリカ	株式	ASPEN TECHNOLOGY INC	ソフトウェア・サービス	9,188	13,485.15	123,901,619	13,342.40	122,589,975	0.90
29	アメリカ	株式	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	素材	4,621	24,798.33	114,593,119	26,328.17	121,662,495	0.89
30	アメリカ	株式	ZOETIS INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,700	12,559.34	96,706,992	15,053.55	115,912,349	0.85

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別及び業種別投資比率

2020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	2.04
		素材	3.28
		資本財	10.03
		商業・専門サービス	7.24
		運輸	0.77
		自動車・自動車部品	0.75
		耐久消費財・アパレル	1.08
		消費者サービス	1.91
		メディア・娯楽	4.72
		小売	3.45
		食品・生活必需品小売り	0.68
		食品・飲料・タバコ	2.57
		家庭用品・パーソナル用品	0.83
		ヘルスケア機器・サービス	5.15
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5.65
		銀行	3.86
		各種金融	3.47
		保険	2.54
		不動産	0.71
		ソフトウェア・サービス	21.92
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.15		
電気通信サービス	0.91		
公益事業	1.06		
半導体・半導体製造装置	3.19		
投資証券			7.02
合計			97.98

（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・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（2020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
第19計算期間末（2019年7月16日）	10,453,350,603	10,453,350,603	1.4179	1.4179
2019年1月末日	10,085,749,115		1.3815	
2月末日	10,510,291,234		1.4323	



3月末日	10,433,446,185		1.4190
4月末日	10,623,528,722		1.4477
5月末日	9,929,230,617		1.3515
6月末日	10,293,548,251		1.3960
7月末日	10,352,490,824		1.4028
8月末日	9,876,959,104		1.3368
9月末日	10,319,258,519		1.3948
10月末日	10,807,477,669		1.4563
11月末日	11,085,130,888		1.4973
12月末日	11,164,189,853		1.5197
2020年 1月末日	11,022,385,299		1.4910

### ハッピーエイジング30

直近日（2020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
第19計算期間末 (2019年 7月16日)	12,699,403,491	12,699,403,491	1.4446	1.4446
2019年 1月末日	12,361,786,691		1.4185	
2月末日	12,741,788,385		1.4586	
3月末日	12,708,125,253		1.4495	
4月末日	12,844,479,511		1.4693	
5月末日	12,230,447,817		1.3903	
6月末日	12,570,234,953		1.4292	
7月末日	12,655,638,712		1.4323	
8月末日	12,266,278,246		1.3829	
9月末日	12,740,073,243		1.4338	
10月末日	13,281,488,086		1.4857	
11月末日	13,559,352,340		1.5165	
12月末日	13,670,632,535		1.5351	
2020年 1月末日	13,571,254,625		1.5095	

## ハッピーエイジング40

直近日（2020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
第19計算期間末（2019年7月16日）	16,189,690,869	16,189,690,869	1.4537	1.4537
2019年1月末日	15,402,435,172		1.4294	
2月末日	15,848,590,418		1.4583	
3月末日	15,950,112,249		1.4547	
4月末日	16,084,034,298		1.4672	
5月末日	15,637,004,343		1.4129	
6月末日	16,033,224,338		1.4441	
7月末日	16,219,029,872		1.4461	
8月末日	15,933,277,984		1.4162	
9月末日	16,445,534,129		1.4493	
10月末日	16,987,935,036		1.4852	
11月末日	17,207,896,722		1.5053	
12月末日	17,391,233,652		1.5179	
2020年1月末日	17,327,943,395		1.5005	

## ハッピーエイジング50

直近日（2020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
第19計算期間末	(2019年 7月16日)	7,592,282,029	7,592,282,029	1.4137	1.4137
	2019年 1月末日	7,200,926,975		1.3912	
	2月末日	7,340,041,796		1.4089	
	3月末日	7,409,956,883		1.4107	
	4月末日	7,417,407,462		1.4156	
	5月末日	7,350,488,724		1.3873	
	6月末日	7,563,418,673		1.4095	
	7月末日	7,616,510,447		1.4111	
	8月末日	7,619,035,685		1.4014	
	9月末日	7,731,764,037		1.4156	
	10月末日	7,905,944,881		1.4342	
	11月末日	8,007,158,443		1.4437	
	12月末日	8,106,760,013		1.4494	
	2020年 1月末日	8,105,867,333		1.4413	

## ハッピーエイジング60

直近日（2020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
第19計算期間末	(2019年 7月16日)	4,551,251,809	4,551,251,809	1.3089	1.3089
	2019年 1月末日	4,436,365,508		1.2882	
	2月末日	4,429,491,501		1.2964	
	3月末日	4,502,232,493		1.3034	
	4月末日	4,498,400,423		1.3010	
	5月末日	4,531,403,522		1.2959	
	6月末日	4,593,961,204		1.3098	
	7月末日	4,572,753,476		1.3111	
	8月末日	4,646,013,402		1.3199	
	9月末日	4,690,078,369		1.3185	

10月末日	4,750,580,276		1.3221	
11月末日	4,775,081,103		1.3225	
12月末日	4,843,630,610		1.3220	
2020年 1月末日	4,919,879,060		1.3228	

## 【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計算期間	0.0000
第20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計算期間	0.0000
第20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計算期間	0.0000
第20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計算期間	0.0000
第20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計算期間	0.0000
第20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計算期間	5.6
第20中間計算期間末	7.1

（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計算期間	4.6
第20中間計算期間末	6.0

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## ハッピーエイジング40

	収益率（％）
--	--------

第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計算期間	2.6
第20中間計算期間末	4.1

（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計算期間	0.9
第20中間計算期間末	2.2

（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計算期間	0.6
第20中間計算期間末	0.7

(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計算期間	1,441,075,609	1,021,272,801
第20中間計算期間末	607,158,775	624,299,352

(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計算期間	1,151,257,690	770,237,275
第20中間計算期間末	591,318,661	446,266,289



（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計算期間	1,884,821,803	988,431,478
第20中間計算期間末	978,819,156	633,303,768

（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計算期間	1,121,171,260	571,339,838
第20中間計算期間末	573,118,524	353,723,149

（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計算期間	829,372,301	568,524,688
第20中間計算期間末	478,477,872	264,934,625

(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:2020年1月31日

## 基準価額・純資産の推移 2010/01/29～2020/01/31

## 分配の推移

## ●ハッピーエイジング20



## ●ハッピーエイジング20

2015年07月	0円
2016年07月	0円
2017年07月	0円
2018年07月	0円
2019年07月	0円
設定来累計	0円

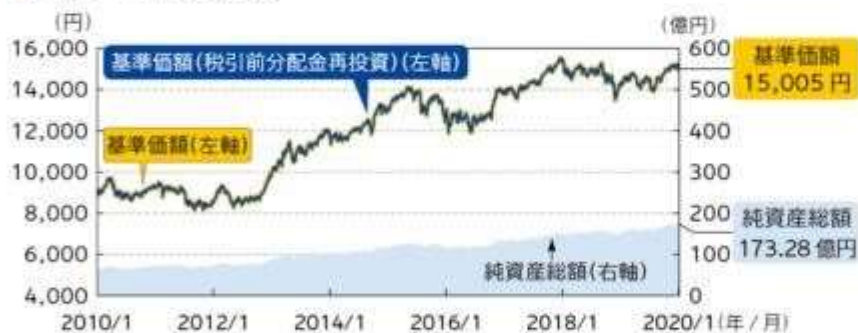
## ●ハッピーエイジング30



## ●ハッピーエイジング30

2015年07月	0円
2016年07月	0円
2017年07月	0円
2018年07月	0円
2019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

2015年07月	0円
2016年07月	0円
2017年07月	0円
2018年07月	0円
2019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

2015年07月	0円
2016年07月	0円
2017年07月	0円
2018年07月	0円
2019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

2015年07月	0円
2016年07月	0円
2017年07月	0円
2018年07月	0円
2019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

資産別構成	純資産比		
	ハッピーエイジング 20	ハッピーエイジング 30	ハッピーエイジング 40
資産の種類	純資産比	純資産比	純資産比
SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	25.89%	21.87%	15.40%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	26.04%	22.00%	15.49%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	2.01%	8.02%	33.07%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	6.05%	20.13%	15.09%
損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド	33.12%	21.04%	14.02%
ISHARES CORE MSCI EMERGING	4.68%	4.74%	4.60%
コール・ローン等	2.21%	2.21%	2.34%
合計	100.00%	100.00%	100.00%

資産別構成	純資産比	
	ハッピーエイジング 50	ハッピーエイジング 60
資産の種類	純資産比	純資産比
SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	9.42%	3.96%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	9.48%	3.99%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	57.03%	72.01%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	11.05%	16.06%
損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド	8.00%	2.00%
ISHARES CORE MSCI EMERGING	2.87%	-
コール・ローン等	2.16%	1.97%
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	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6.5%
2	野村ホールディングス	証券,商品先物取引業	6.2%
3	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	5.8%
4	本田技研工業	輸送用機器	4.7%
5	日本電信電話	情報・通信業	4.5%
組入銘柄数			38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	みらかホールディングス	サービス業	3.3%
2	シチズン時計	精密機器	3.2%
3	伊予銀行	銀行業	3.0%
4	日立キャピタル	その他金融業	2.7%
5	八十二銀行	銀行業	2.6%
組入銘柄数			72銘柄

## ● 損保ジャパン日本債券マザーファンド

組入上位5銘柄				
	銘柄名	種類	償還日	純資産比
1	第140回利付国債(5年)	国債証券	2024/06/20	5.1%
2	第355回利付国債(10年)	国債証券	2029/06/20	4.5%
3	第38回利付国債(30年)	国債証券	2043/03/20	4.1%
4	第138回利付国債(5年)	国債証券	2023/12/20	4.0%
5	第406回利付国債(2年)	国債証券	2021/11/01	4.0%
組入銘柄数			87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	9.3%
2	Treasury 2.125 240229	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2024/02/29	6.5%
3	FRANCE 0.0 220525	フランス	国債証券	ユーロ	2022/05/25	4.9%
4	GERMANY 0.0 211008	ドイツ	国債証券	ユーロ	2021/10/08	4.4%
5	ITALY 1.75 240701	イタリア	国債証券	ユーロ	2024/07/01	4.0%
組入銘柄数					121銘柄	

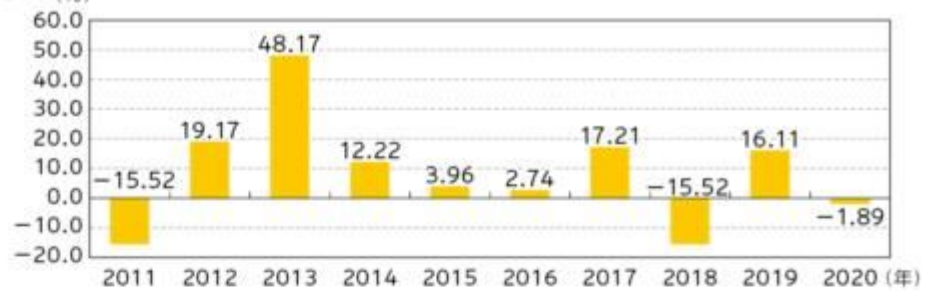
## ● 損保ジャパンTCW外国株式マザーファンド

組入上位5銘柄					
	銘柄名	通貨	発行国/地域	業種	純資産比
1	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	4.1%
2	FISERV INC	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	3.7%
3	MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	2.9%
4	TRANSUNION	アメリカ・ドル	アメリカ	資本財・サービス	2.8%
5	IHS MARKIT LTD	アメリカ・ドル	アメリカ	資本財・サービス	2.4%
組入銘柄数			221銘柄		

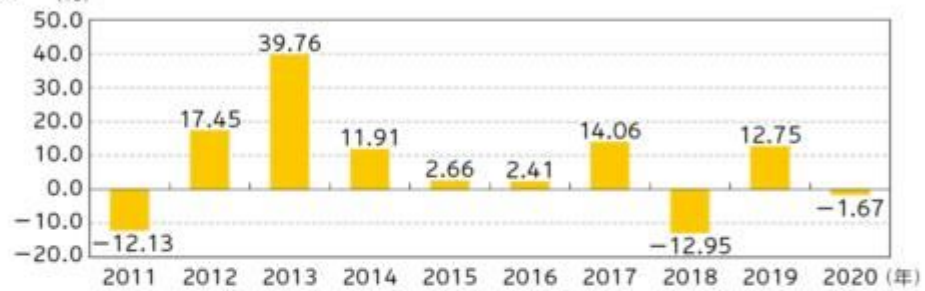
- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

## 年間収益率の推移（暦年ベース）

### ●ハッピーエイジング20 (%)



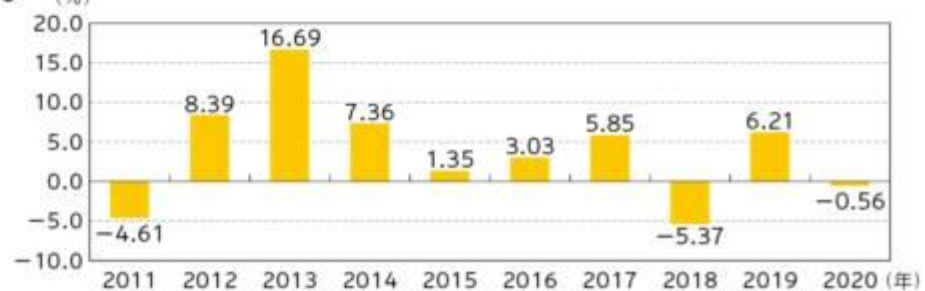
### ●ハッピーエイジング30 (%)



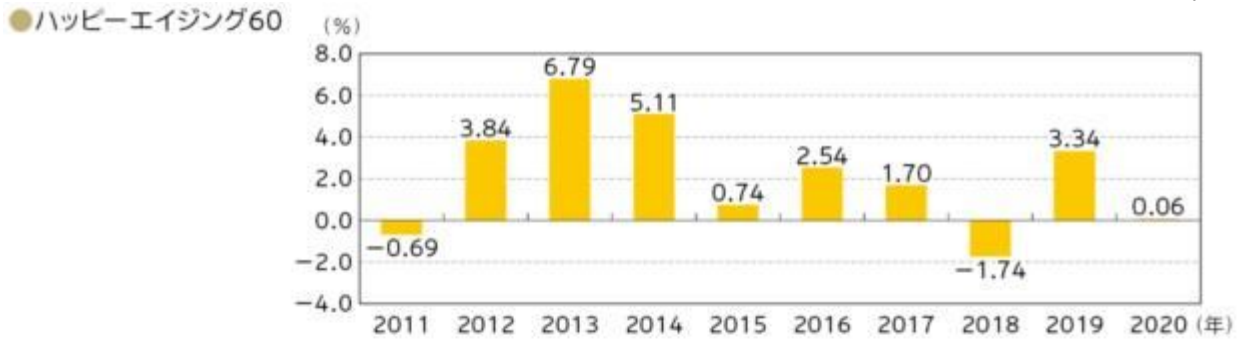
### ●ハッピーエイジング40 (%)



### ●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。
- 2020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)

委託会社の照会先

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432 (受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

ホームページ <https://www.sjnk-am.co.jp/>

(略)

<訂正後>

(略)

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432 (受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

(略)

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

<訂正前>

(略)

委託会社の照会先

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432 (受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

ホームページ <https://www.sjnk-am.co.jp/>

<訂正後>

(略)

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432 (受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

ホームページ <https://www.sompo-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。

<https://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.sompo-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、2019年7月17日から2020年1月16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19期 2019年7月16日現在	第20期中間計算期間末 2020年1月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	303,160,495	330,786,406
投資信託受益証券	482,971,502	551,836,094
親投資信託受益証券	9,754,607,095	10,370,765,467
流動資産合計	10,540,739,092	11,253,387,967
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	6,403,395	1,314,156
未払受託者報酬	2,749,977	2,894,830
未払委託者報酬	78,099,237	82,213,180
未払利息	880	797
その他未払費用	135,000	169,238
流動負債合計	87,388,489	86,592,201
負債合計	87,388,489	86,592,201
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,372,660,976	7,355,520,399
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	3,080,689,627	3,811,275,367
元本等合計	10,453,350,603	11,166,795,766
純資産合計	10,453,350,603	11,166,795,766
負債純資産合計	10,540,739,092	11,253,387,967

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日	第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	7,287,253	10,901,070
有価証券売買等損益	958,910,309	806,015,704
為替差損益	15,340,723	9,656,508
その他収益	1,705	-
営業収益合計	966,962,074	826,573,282

	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日	第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
営業費用		
支払利息	88,782	106,299
受託者報酬	2,821,603	2,894,830
委託者報酬	80,133,814	82,213,180
その他費用	255,794	224,225
営業費用合計	83,299,993	85,438,534
営業利益又は営業損失( )	1,050,262,067	741,134,748
経常利益又は経常損失( )	1,050,262,067	741,134,748
中間純利益又は中間純損失( )	1,050,262,067	741,134,748
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( )	17,406,379	13,779,839
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,486,831,775	3,080,689,627
剰余金増加額又は欠損金減少額	383,985,755	263,726,853
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	383,985,755	263,726,853
剰余金減少額又は欠損金増加額	263,048,453	260,496,022
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	263,048,453	260,496,022
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,574,913,389	3,811,275,367

## (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2019年7月16日、当中間計算期間末日を2020年1月16日としております。

## （中間貸借対照表に関する注記）

期別	第19期 2019年7月16日現在	第20期中間計算期間末 2020年1月16日現在
1. 受益権の総数	7,372,660,976口	7,355,520,399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 1.4179円 (1万円当たり純資産額) (14,179円)	1口当たり純資産額 1.5182円 (1万円当たり純資産額) (15,182円)

## （中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日	第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16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	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。	同左

## （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19期 2019年7月16日現在	第20期中間計算期間末 2020年1月16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

項目	第19期 2019年7月16日現在	第20期中間計算期間末 2020年1月16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	第19期 自 2018年7月18日 至 2019年7月16日	第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
期首元本額	6,952,858,168円	7,372,660,976円
期中追加設定元本額	1,441,075,609円	607,158,775円
期中一部解約元本額	1,021,272,801円	624,299,352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19期 2019年7月16日現在	第20期中間計算期間末 2020年1月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	362,412,553	416,941,680
投資信託受益証券	599,245,416	687,741,999
親投資信託受益証券	11,834,859,601	12,680,705,422
流動資産合計	12,796,517,570	13,785,389,101
資産合計	12,796,517,570	13,785,389,101
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	6,515,654	3,208,698
未払受託者報酬	3,350,457	3,561,867
未払委託者報酬	87,111,916	92,608,392
未払利息	1,052	1,005
その他未払費用	135,000	176,430
流動負債合計	97,114,079	99,556,392
負債合計	97,114,079	99,556,392
純資産の部		

	第19期 2019年7月16日現在	第20期中間計算期間末 2020年1月16日現在
元本等		
元本	8,790,841,480	8,935,893,852
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	3,908,562,011	4,749,938,857
元本等合計	12,699,403,491	13,685,832,709
純資産合計	12,699,403,491	13,685,832,709
負債純資産合計	12,796,517,570	13,785,389,101

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日	第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
営業収益		
受取配当金	9,041,638	13,585,778
有価証券売買等損益	919,273,359	848,223,773
為替差損益	19,250,058	12,064,565
営業収益合計	929,481,779	873,874,116
営業費用		
支払利息	107,091	128,870
受託者報酬	3,437,944	3,561,867
委託者報酬	89,387,132	92,608,392
その他費用	280,102	243,940
営業費用合計	93,212,269	96,543,069
営業利益又は営業損失( )	1,022,694,048	777,331,047
経常利益又は経常損失( )	1,022,694,048	777,331,047
中間純利益又は中間純損失( )	1,022,694,048	777,331,047
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( )	14,753,418	8,142,551
期首剰余金又は期首欠損金( )	4,328,965,719	3,908,562,011
剰余金増加額又は欠損金減少額	295,333,780	270,373,618
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	295,333,780	270,373,618
剰余金減少額又は欠損金増加額	189,381,244	198,185,268
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	189,381,244	198,185,268
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	3,426,977,625	4,749,938,857

## (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

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>約定日基準で計上しております。</p> <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2019年7月16日、当中間計算期間末日を2020年1月16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19期 2019年7月16日現在	第20期中間計算期間末 2020年1月16日現在
1. 受益権の総数	8,790,841,480口	8,935,893,852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 1.4446円 (1万口当たり純資産額) (14,446円)	1口当たり純資産額 1.5316円 (1万口当たり純資産額) (15,316円)

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日	第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16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	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。	同左

## ( 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19期 2019年7月16日現在	第20期中間計算期間末 2020年1月16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19期	第20期中間計算期間
	自 2018年7月18日 至 2019年7月16日	自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
期首元本額	8,409,821,065円	8,790,841,480円
期中追加設定元本額	1,151,257,690円	591,318,661円
期中一部解約元本額	770,237,275円	446,266,289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】



	第19期 2019年7月16日現在	第20期中間計算期間末 2020年1月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	500,969,422	498,384,494
投資信託受益証券	782,591,420	851,660,561
親投資信託受益証券	15,025,521,288	16,146,402,585
流動資産合計	16,309,082,130	17,496,447,640
資産合計		
	16,309,082,130	17,496,447,640
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	18,141,671	3,426,694
未払受託者報酬	4,213,050	4,563,690
未払委託者報酬	96,900,086	104,964,809
未払利息	1,454	1,201
その他未払費用	135,000	186,898
流動負債合計	119,391,261	113,143,292
負債合計		
	119,391,261	113,143,292
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	11,136,652,437	11,482,167,825
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	5,053,038,432	5,901,136,523
元本等合計	16,189,690,869	17,383,304,348
純資産合計		
	16,189,690,869	17,383,304,348
負債純資産合計		
	16,309,082,130	17,496,447,640

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日	第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	11,097,147	16,823,769
有価証券売買等損益	736,375,105	765,600,076
為替差損益	23,919,382	15,376,911
その他収益	668	-
営業収益合計	749,196,672	797,800,756
<b>営業費用</b>		
支払利息	124,537	164,727
受託者報酬	4,174,955	4,563,690
委託者報酬	96,024,185	104,964,809
その他費用	302,461	277,407
営業費用合計	100,626,138	109,970,633
営業利益又は営業損失( )	849,822,810	687,830,123
経常利益又は経常損失( )	849,822,810	687,830,123
中間純利益又は中間純損失( )	849,822,810	687,830,123
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	13,145,504	10,532,299
期首剰余金又は期首欠損金( )	5,042,716,924	5,053,038,432
剰余金増加額又は欠損金減少額	448,448,781	458,051,710
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	448,448,781	458,051,710
剰余金減少額又は欠損金増加額	251,098,399	287,251,443
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	251,098,399	287,251,443
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	4,403,390,000	5,901,136,523

## (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2019年7月16日、当中間計算期間末日を2020年1月16日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

期別	第19期 2019年7月16日現在	第20期中間計算期間末 2020年1月16日現在
1. 受益権の総数	11,136,652,437口	11,482,167,825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 1.4537円 (1万円当たり純資産額) (14,537円)	1口当たり純資産額 1.5139円 (1万円当たり純資産額) (15,139円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第19期中間計算期間	第20期中間計算期間
	自 2018年7月18日 至 2019年1月17日	自 2019年7月17日 至 2020年1月16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	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。	同左

## (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19期	第20期中間計算期間末
	2019年7月16日現在	2020年1月16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19期	第20期中間計算期間
	自 2018年7月18日 至 2019年7月16日	自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
期首元本額	10,240,262,112円	11,136,652,437円
期中追加設定元本額	1,884,821,803円	978,819,156円
期中一部解約元本額	988,431,478円	633,303,768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19期 2019年7月16日現在	第20期中間計算期間末 2020年1月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	224,909,772	198,426,536
投資信託受益証券	202,471,985	248,540,127
親投資信託受益証券	7,217,979,046	7,677,385,620
流動資産合計	7,645,360,803	8,124,352,283
資産合計		
	7,645,360,803	8,124,352,283
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	12,522,594	2,777,690
未払受託者報酬	1,962,166	2,141,255
未払委託者報酬	38,458,361	41,968,605
未払利息	653	478
その他未払費用	135,000	160,458
流動負債合計	53,078,774	47,048,486
負債合計		
	53,078,774	47,048,486
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,370,507,370	5,589,902,745
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,221,774,659	2,487,401,052
元本等合計	7,592,282,029	8,077,303,797
純資産合計		
	7,592,282,029	8,077,303,797
負債純資産合計		
	7,645,360,803	8,124,352,283

### （2）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日	第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	2,951,313	4,909,703
有価証券売買等損益	189,868,830	207,315,394
為替差損益	6,307,340	4,696,392
その他収益	9	-
営業収益合計	193,224,848	216,921,489
<b>営業費用</b>		
支払利息	56,167	77,258
受託者報酬	1,913,418	2,141,255
委託者報酬	37,503,057	41,968,605
その他費用	199,229	187,430

	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日	第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
営業費用合計	39,671,871	44,374,548
営業利益又は営業損失( )	232,896,719	172,546,941
経常利益又は経常損失( )	232,896,719	172,546,941
中間純利益又は中間純損失( )	232,896,719	172,546,941
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	5,454,158	4,727,062
期首剰余金又は期首欠損金( )	2,054,394,209	2,221,774,659
剰余金増加額又は欠損金減少額	237,816,170	244,206,345
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	237,816,170	244,206,345
剰余金減少額又は欠損金増加額	109,024,493	146,399,831
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	109,024,493	146,399,831
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,955,743,325	2,487,401,052

## ( 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、該日が休業日のため、前計算期間末日を2019年7月16日、当中間計算期間末日を2020年1月16日としております。

( 中間貸借対照表に関する注記 )

期別	第19期 2019年7月16日現在	第20期中間計算期間末 2020年1月16日現在
1. 受益権の総数	5,370,507,370口	5,589,902,745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) 1.4137円 (14,137円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4450円 (14,450円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日	第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16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	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。	同左

## (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19期 2019年7月16日現在	第20期中間計算期間末 2020年1月16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19期	第20期中間計算期間
	自 2018年7月18日 至 2019年7月16日	自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
期首元本額	4,820,675,948円	5,370,507,370円
期中追加設定元本額	1,121,171,260円	573,118,524円
期中一部解約元本額	571,339,838円	353,723,149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19期 2019年7月16日現在	第20期中間計算期間末 2020年1月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	112,432,884	126,585,031
親投資信託受益証券	4,467,070,880	4,762,252,929
流動資産合計	4,579,503,764	4,888,837,960
資産合計	4,579,503,764	4,888,837,960
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	7,593,555	3,053,058
未払受託者報酬	1,194,948	1,289,337
未払委託者報酬	19,358,032	20,887,145
未払利息	326	305
その他未払費用	105,094	122,712
流動負債合計	28,251,955	25,352,557
負債合計	28,251,955	25,352,557
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,477,272,681	3,690,815,928
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,073,979,128	1,172,669,475
元本等合計	4,551,251,809	4,863,485,403
純資産合計	4,551,251,809	4,863,485,403
負債純資産合計	4,579,503,764	4,888,837,960

### （2）【中間損益及び剰余金計算書】

	第19期中間計算期間 自 2018年7月18日 至 2019年1月17日	第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	42,617,240	53,012,049
<b>営業収益合計</b>	<b>42,617,240</b>	<b>53,012,049</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	33,923	46,179
受託者報酬	1,170,441	1,289,337
委託者報酬	18,961,219	20,887,145
その他費用	125,041	124,084
<b>営業費用合計</b>	<b>20,290,624</b>	<b>22,346,745</b>
営業利益又は営業損失( )	62,907,864	30,665,304
経常利益又は経常損失( )	62,907,864	30,665,304
中間純利益又は中間純損失( )	62,907,864	30,665,304
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( )	3,398,017	2,055,349
期首剰余金又は期首欠損金( )	969,767,509	1,073,979,128
剰余金増加額又は欠損金減少額	129,690,161	152,019,848
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	129,690,161	152,019,848
剰余金減少額又は欠損金増加額	73,627,033	81,939,456
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	73,627,033	81,939,456
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	966,320,790	1,172,669,475

## (3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
3. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年7月15日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2019年7月16日、当中間計算期間末日を2020年1月16日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

期別	第19期 2019年7月16日現在	第20期中間計算期間末 2020年1月16日現在
1. 受益権の総数	3,477,272,681口	3,690,815,928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) 1.3089円 (13,089円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3177円 (13,177円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)



項目	第19期中間計算期間	第20期中間計算期間
	自 2018年7月18日 至 2019年1月17日	自 2019年7月17日 至 2020年1月16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	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。	同左

## (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19期	第20期中間計算期間末
	2019年7月16日現在	2020年1月16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19期	第20期中間計算期間
	自 2018年7月18日 至 2019年7月16日	自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
期首元本額	3,216,425,068円	3,477,272,681円
期中追加設定元本額	829,372,301円	478,477,872円

項目	第19期	第20期中間計算期間
	自 2018年7月18日 至 2019年7月16日	自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
期中一部解約元本額	568,524,688円	264,934,625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。

SJAM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	2019年7月16日現在	2020年1月16日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	243,720,974	504,568,656
株式	42,660,766,130	34,657,295,390
未収配当金	65,858,400	68,649,900
流動資産合計	42,970,345,504	35,230,513,946
資産合計	42,970,345,504	35,230,513,946
負債の部		
流動負債		
未払利息	707	1,216
流動負債合計	707	1,216
負債合計	707	1,216
純資産の部		
元本等		
元本	24,665,295,599	18,457,664,354
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	18,305,049,198	16,772,848,376
元本等合計	42,970,344,797	35,230,512,730
純資産合計	42,970,344,797	35,230,512,730
負債純資産合計	42,970,345,504	35,230,513,946

#### 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
--------------------	----

2. 費用・収益の計上基準	<p>移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>原則として取引所における計算期間末日の最終相場で評価しております。計算期間末日に当該取引所の最終相場がない場合には当該取引所における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <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	2019年7月16日現在	2020年1月16日現在
1. 受益権の総数	24,665,295,599口	18,457,664,354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) 1.7421円 (17,421円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.9087円 (19,087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	2019年7月16日現在	2020年1月16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 2018年7月18日 至 2019年7月16日	自 2019年7月17日 至 2020年1月16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	21,998,050,748円	24,665,295,599円
同期中追加設定元本額	10,351,866,982円	1,556,477,934円
同期中一部解約元本額	7,684,622,131円	7,764,109,179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）	753,055円	- 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）	529,483円	- 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）	177,832円	- 円
損保ジャパン日本興亜ラージキャップ・バリュー・ファンド（F o F s 用）（適格機関投資家専用）	18,826,871,712円	13,206,506,126円
ラージキャップ・バリュー・オープン（適格機関投資家専用）	667,536,153円	256,927,297円
ハッピーエイジング20	1,550,615,493円	1,493,613,054円
ハッピーエイジング30	1,603,947,680円	1,546,663,476円
ハッピーエイジング40	1,444,637,955円	1,397,205,375円
ハッピーエイジング50	418,666,074円	396,059,490円
ハッピーエイジング60	104,678,249円	99,594,942円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド2035	17,370,795円	21,951,727円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド2045	10,503,323円	14,623,142円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド2055	9,316,856円	14,279,907円
S O M P O 日本株バリュー・プラスファンド	9,690,939円	10,239,818円
計	24,665,295,599円	18,457,664,354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	2019年7月16日現在	2020年1月16日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	44,112,001	76,126,270
株式	9,058,737,600	9,330,320,200
未収配当金	360,000	1,601,500
流動資産合計	9,103,209,601	9,408,047,970
資産合計	9,103,209,601	9,408,047,970
負債の部		
流動負債		
未払利息	128	183
流動負債合計	128	183
負債合計	128	183
純資産の部		
元本等		
元本	4,008,847,456	3,931,007,565
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,094,362,017	5,477,040,222
元本等合計	9,103,209,473	9,408,047,787
純資産合計	9,103,209,473	9,408,047,787
負債純資産合計	9,103,209,601	9,408,047,970

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

期別	2019年7月16日現在	2020年1月16日現在
1．受益権の総数	4,008,847,456口	3,931,007,565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) 2.2708円 (22,708円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.3933円 (23,933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	2019年7月16日現在	2020年1月16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ぬ。	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つた場合、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 2018年7月18日 至 2019年7月16日	自 2019年7月17日 至 2020年1月16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	3,308,847,650円	4,008,847,456円
同期中追加設定元本額	890,681,464円	257,106,527円
同期中一部解約元本額	190,681,658円	334,946,418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）	577,686円	- 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）	405,914円	- 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）	137,416円	- 円
ハッピーエイジング20	1,202,567,853円	1,178,133,454円
ハッピーエイジング30	1,243,947,531円	1,219,915,386円
ハッピーエイジング40	1,120,390,739円	1,093,459,233円
ハッピーエイジング50	324,640,565円	312,393,304円

項目	自 2018年7月18日 至 2019年7月16日	自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
ハッピーエイジング60	80,386,206円	78,552,026円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	13,226,249円	17,497,861円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	8,062,559円	11,651,189円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	7,161,103円	11,331,969円
SOMPO日本株バリュー・プラスファンド	7,343,635円	8,073,143円
計	4,008,847,456円	3,931,007,565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	2019年7月16日現在	2020年1月16日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	412,396,452	163,629,750
国債証券	11,598,657,100	13,628,475,600
地方債証券	-	113,151,000
特殊債券	346,497,724	237,605,340
社債券	4,471,462,400	3,858,125,200
未収利息	31,485,366	29,127,437
前払費用	371,773	1,907,751
流動資産合計	16,860,870,815	18,032,022,078
資産合計	16,860,870,815	18,032,022,078
負債の部		
流動負債		
未払利息	1,197	394
流動負債合計	1,197	394
負債合計	1,197	394
純資産の部		
元本等		
元本	11,515,341,036	12,378,739,060
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	5,345,528,582	5,653,282,624
元本等合計	16,860,869,618	18,032,021,684
純資産合計	16,860,869,618	18,032,021,684
負債純資産合計	16,860,870,815	18,032,022,078

注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

期別	2019年7月16日現在		2020年1月16日現在	
1．受益権の総数	11,515,341,036口		12,378,739,060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)	1.4642円 (14,642円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4567円 (14,567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	2019年7月16日現在	2020年1月16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	2019年7月16日現在	2020年1月16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 2018年7月18日 至 2019年7月16日	自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	11,108,839,211円	11,515,341,036円
同期中追加設定元本額	2,131,115,662円	1,393,564,547円
同期中一部解約元本額	1,724,613,837円	530,166,523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)	94,022円	- 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)	762,560円	- 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)	1,547,581円	- 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)	308,890,571円	346,805,220円
損保ジャパン日本債券ファンド	1,073,086,889円	1,107,459,821円
ハッピーエイジング20	138,410,414円	152,855,858円
ハッピーエイジング30	686,225,412円	748,199,680円
ハッピーエイジング40	3,609,450,542円	3,926,428,263円
ハッピーエイジング50	2,940,032,967円	3,161,400,330円
ハッピーエイジング60	2,244,136,359円	2,404,486,739円
パン・アフリカ株式ファンド	14,651,344円	14,705,334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	1,593,004円	1,423,183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	12,828,638円	10,922,607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	229,721,467円	216,363,333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	9,682,151円	9,217,515円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2035	58,904,604円	90,308,260円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2045	21,302,994円	34,749,202円

項目	自 2018年7月18日 至 2019年7月16日	自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	5,799,101円	11,926,605円
ターゲット・リターン戦略ファンド	158,220,416円	141,487,110円
計	11,515,341,036円	12,378,739,060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	2019年7月16日現在	2020年1月16日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	704,862,245	67,767,801
コール・ローン	27,673,934	289,722,669
国債証券	7,375,436,310	7,895,166,486
特殊債券	28,344,260	27,807,444
未収利息	45,480,240	42,125,868
前払費用	6,168,137	4,914,086
流動資産合計	8,187,965,126	8,327,504,354
資産合計	8,187,965,126	8,327,504,354
負債の部		
流動負債		
未払金	654,782,316	-
未払利息	80	698
流動負債合計	654,782,396	698
負債合計	654,782,396	698
純資産の部		
元本等		
元本	4,814,477,890	5,102,544,674
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,718,704,840	3,224,958,982
元本等合計	7,533,182,730	8,327,503,656
純資産合計	7,533,182,730	8,327,503,656
負債純資産合計	8,187,965,126	8,327,504,354

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	国債証券及び特殊債券
--------------------	------------

	<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	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。
3. 費用・収益の計上基準	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	2019年7月16日現在		2020年1月16日現在	
1. 受益権の総数	4,814,477,890口		5,102,544,674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 1.5647円	1口当たり純資産額 1.6320円	(1万口当たり純資産額) (15,647円)	(1万口当たり純資産額) (16,320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	2019年7月16日現在	2020年1月16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

項目	2019年7月16日現在	2020年1月16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 2018年7月18日 至 2019年7月16日	自 2019年7月17日 至 2020年1月16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	4,812,486,387円	4,814,477,890円
同期中追加設定元本額	700,112,430円	516,551,746円
同期中一部解約元本額	698,120,927円	228,484,962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)	48,195円	- 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)	68,966円	- 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)	360,056円	- 円
SNAM絶対収益ターゲットファンド(適格機関投資家専用)	26,955,325円	26,947,315円
ハッピーエイジング20	389,413,875円	414,430,115円
ハッピーエイジング30	1,586,684,702円	1,690,471,076円
ハッピーエイジング40	1,521,338,908円	1,612,952,853円
ハッピーエイジング50	527,509,135円	551,363,499円
ハッピーエイジング60	463,147,637円	478,980,893円
損保ジャパン外国債券ファンド(為替ヘッジなし)	283,244,053円	300,704,318円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	11,151,172円	19,455,733円

項目	自 2018年7月18日 至 2019年7月16日	自 2019年7月17日 至 2020年1月16日
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	2,722,342円	4,136,184円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	1,833,524円	3,102,688円
計	4,814,477,890円	5,102,544,674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	2019年7月16日現在 金額(円)	2020年1月16日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	169,268,587	230,063,194
コール・ローン	246,335,180	112,394,136
株式	11,494,116,065	12,677,779,042
投資信託受益証券	170,770,129	-
投資証券	801,762,856	951,429,187
未収入金	-	39,800,619
未収配当金	9,235,986	6,544,908
流動資産合計	12,891,488,803	14,018,011,086
資産合計	12,891,488,803	14,018,011,086
負債の部		
流動負債		
未払利息	715	270
流動負債合計	715	270
負債合計	715	270
純資産の部		
元本等		
元本	5,982,754,877	5,939,398,558
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	6,908,733,211	8,078,612,258
元本等合計	12,891,488,088	14,018,010,816
純資産合計	12,891,488,088	14,018,010,816
負債純資産合計	12,891,488,803	14,018,011,086

#### 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
--------------------	----

	<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	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。
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	2019年7月16日現在	2020年1月16日現在
1. 受益権の総数	5,982,754,877口	5,939,398,558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 2.1548円 (1万口当たり純資産額) (21,548円)	1口当たり純資産額 2.3602円 (1万口当たり純資産額) (23,602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	2019年7月16日現在	2020年1月16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 2018年7月18日 至 2019年7月16日	自 2019年7月17日 至 2020年1月16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	6,210,852,196円	5,982,754,877円
同期中追加設定元本額	759,691,885円	258,518,078円
同期中一部解約元本額	987,789,204円	301,874,397円
元本の内訳*		
損保ジャパン - TCW外国株式ファンド A コース(為替ヘッジあり)	749,434,668円	751,916,005円
損保ジャパン - TCW外国株式ファンド B コース(為替ヘッジなし)	940,107,287円	933,319,437円
ハッピーエイジング20	1,629,159,248円	1,610,568,749円
ハッピーエイジング30	1,266,200,805円	1,254,221,712円
ハッピーエイジング40	1,067,030,697円	1,063,729,175円
ハッピーエイジング50	288,303,913円	283,339,924円
ハッピーエイジング60	42,518,259円	42,303,556円
計	5,982,754,877円	5,939,398,558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

2020年1月31日現在

資産総額	11,058,150,859円
負債総額	35,765,560円
純資産総額（ - ）	11,022,385,299円
発行済数量	7,392,582,875口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.4910円

#### ハッピーエイジング30

2020年1月31日現在

資産総額	13,584,012,740円
負債総額	12,758,115円
純資産総額（ - ）	13,571,254,625円
発行済数量	8,990,284,728口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.5095円

#### ハッピーエイジング40

2020年1月31日現在

資産総額	17,345,255,590円
負債総額	17,312,195円
純資産総額（ - ）	17,327,943,395円
発行済数量	11,548,435,529口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.5005円

#### ハッピーエイジング50

2020年1月31日現在

資産総額	8,112,306,570円
------	----------------



負債総額	6,439,237円
純資産総額( - )	8,105,867,333円
発行済数量	5,623,929,745口
1単位当りの純資産額( / )	1.4413円

## ハッピーエイジング60

2020年1月31日現在

資産総額	4,929,211,085円
負債総額	9,332,025円
純資産総額( - )	4,919,879,060円
発行済数量	3,719,375,146口
1単位当りの純資産額( / )	1.3228円

## (参考) S J A M ラージキャップ・バリュー・マザーファンド

2020年1月31日現在

資産総額	34,927,260,045円
負債総額	219,121,071円
純資産総額( - )	34,708,138,974円
発行済数量	18,739,022,857口
1単位当りの純資産額( / )	1.8522円

## (参考) S J A M スモールキャップ・マザーファンド

2020年1月31日現在

資産総額	9,629,820,637円
負債総額	937円
純資産総額( - )	9,629,819,700円
発行済数量	4,102,027,634口
1単位当りの純資産額( / )	2.3476円

## (参考) 損保ジャパン日本債券マザーファンド

2020年1月31日現在

資産総額	18,160,831,846円
負債総額	115円
純資産総額( - )	18,160,831,731円
発行済数量	12,367,118,516口
1単位当りの純資産額( / )	1.4685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

2020年1月31日現在

資産総額	8,502,362,212円
負債総額	149円
純資産総額( - )	8,502,362,063円
発行済数量	5,196,090,004口
1単位当りの純資産額( / )	1.6363円

## (参考) 損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

2020年1月31日現在

資産総額	13,622,904,321円
負債総額	148円
純資産総額( - )	13,622,904,173円
発行済数量	5,806,735,423口
1単位当りの純資産額( / )	2.3461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（2019年7月末現在）

(略)

(2) 会社の機構（2019年7月末現在）

会社の意思決定機構

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

(略)

<訂正後>

(1) 資本金の額（2020年1月末現在）

(略)

(2) 会社の機構（2020年1月末現在）

会社の意思決定機構

定款に基づき10名以内の取締役が株主総会において選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上にあたる株式を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行います。

(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2020年1月末現在、計194本（追加型株式投資信託126本、単位型株式投資信託19本、単位型公社債投資信託49本）であり、その純資産総額の合計は879,572百万円です。

##### 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(2018年4月1日から2019年3月31日まで)の財務諸表について、EY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35期中間会計期間(2019年4月1日から2019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。

(1)【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019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		5,031,436
2	前払費用		69,417		77,905
3	未収委託者報酬		919,027		892,311
4	未収運用受託報酬		1,371,086		1,133,534
5	未収収益		57		52
6	その他		3,144		5,489
	流動資産合計		6,968,836		7,140,730
固定資産					
1	有形固定資産				
(1)	建物	1	27,525		23,660
(2)	器具備品	1	19,460		24,492
	有形固定資産合計		46,986		48,153
2	無形固定資産				
(1)	電話加入権		4,535		4,535
	無形固定資産合計		4,535		4,535
3	投資その他の資産				
(1)	投資有価証券		66,370		189,407
(2)	長期差入保証金		161,598		161,598
(3)	繰延税金資産		273,815		369,181
(4)	その他		31		31
	投資その他の資産合計		501,815		720,218
	固定資産合計		553,337		772,907
	資産合計		7,522,173		7,913,637

区分	注記 番号	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019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		12,372
2	未払金					
	(1) 未払配当金	2	200,000		240,000	
	(2) 未払手数料		332,515		320,577	
	(3) その他未払金		168,587	701,102	193,367	753,944
3	未払費用			1,106,809		985,047
4	未払消費税等			44,927		15,760
5	未払法人税等			71,550		225,326
6	賞与引当金			104,908		125,066
7	役員賞与引当金			5,400		7,200
	流動負債合計			2,049,753		2,124,718
	固定負債					
1	退職給付引当金			112,624		134,243
2	資産除去債務			8,181		8,327
	固定負債合計			120,805		142,570
	負債合計			2,170,558		2,267,288
	(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			3,385,956		3,675,113
	利益剰余金合計			3,385,956		3,675,113
	株主資本合計			5,349,236		5,638,393
	評価・換算差額等					
1	その他有価証券評価差額金			2,378		7,956
	評価・換算差額等合計			2,378		7,956
	純資産合計			5,351,614		5,646,349
	負債・純資産合計			7,522,173		7,913,637

## (2) 【損益計算書】

区分	注記番号	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1	委託者報酬	5,004,466		4,693,325	
2	運用受託報酬	3,372,949	8,377,416	3,479,650	8,172,976
営業費用					
1	支払手数料	2,340,455		2,096,873	
2	広告宣伝費	40,406		30,230	
3	公告費	2,265		200	
4	調査費	2,634,404		2,532,683	

(1) 調査費		891,711		1,070,321	
(2) 委託調査費		1,738,613		1,457,726	
(3) 図書費		4,078		4,635	
5 営業雑経費		183,871		165,973	
(1) 通信費		6,147		6,109	
(2) 印刷費		162,442		145,335	
(3) 諸会費		15,281	5,201,402	14,528	4,825,961
一般管理費					
1 給料		1,460,280		1,523,789	
(1) 役員報酬		74,540		75,540	
(2) 給料・手当		1,210,435		1,260,953	
(3) 賞与		175,304		187,295	
2 福利厚生費		161,706		183,912	
3 交際費		10,338		10,052	
4 寄付金		300		300	
5 旅費交通費		49,534		39,791	
6 法人事業税		34,078		41,849	
7 租税公課		15,243		15,555	
8 不動産賃借料		206,575		208,923	
9 退職給付費用		45,062		58,381	
10 賞与引当金繰入		104,908		125,066	
11 役員賞与引当金繰入		5,400		7,200	
12 固定資産減価償却費		7,609		11,976	
13 諸経費		297,581	2,398,617	353,873	2,580,671
営業利益			777,396		766,343
営業外収益					
1 受取配当金		93		98	
2 受取利息		309		281	
3 有価証券売却益		654		12,029	
4 為替差益		1,906		-	
5 雑益		2,023	4,987	2,826	15,236
営業外費用					
1 為替差損		-		3,184	
2 事務過誤費		5		4,341	
3 雑損		115	121	198	7,724
経常利益			782,261		773,855
特別損失					
1 固定資産除却損	1	0	0	7	7
税引前当期純利益			782,261		773,847
法人税・住民税及び事業税			281,742		342,518
法人税等調整額			49,741		97,828
当期純利益			550,260		529,156

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本剰余金		利益剰余金			
	資本	資本剰余金	その他利益 剰余金	利益剰余金		

	資本金	準備金	合計	繰越利益 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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本 準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	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
当期変動額						
剰余金の配当				240,000	240,000	240,000
当期純利益				529,156	529,156	529,156
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純 額)						
当期変動額合 計	-	-	-	289,156	289,156	289,156
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,675,113	3,675,113	5,638,393

	評価・換算差額等
--	----------

	その他有価 証券評価差 額金	評価・換 算差額等 合計	純資産合計
当期首残高	2,378	2,378	5,351,614
当期変動額			
剰余金の配当			240,000
当期純利益			529,156
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）	5,578	5,578	5,578
当期変動額合 計	5,578	5,578	294,735
当期末残高	7,956	7,956	5,646,349

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

##### 時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）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、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。

（表示方法の変更）

（損益計算書）



前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「事務過誤費」は、営業外費用の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「その他」に表示していた121千円は、「事務過誤費」5千円、「その他」115千円として組み替えております。

(「『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)を当事業年度より適用し、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。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」55,224千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」273,815千円に含めて表示しております。

また、税効果会計関係注記において、税効果会計基準一部改正第3項から第5項に定める「税効果会計に係る会計基準」注解(注8)(評価性引当額の合計額を除く。)及び同注解(注9)に記載された内容を追加しております。ただし、当該内容のうち前事業年度に係る内容については、税効果会計基準一部改正第7項に定める経過的な取扱いに従って記載しておりません。

## 注記事項

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額は、次のとおりであります。

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	82,540	86,787
器具備品	47,055	52,226

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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
未払金		
未払配当金	200,000	240,000

(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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
器具備品	0	7

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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
2019年3月27日 取締役会	普通株式	240,000千円	9,964円	2018年3月31日	2019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（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 其他有価証券	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	-

当事業年度（2019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	5,031,436	5,031,436	-
(2) 未収委託者報酬	892,311	892,311	-
(3) 未収運用受託報酬	1,133,534	1,133,534	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	188,657	188,657	-
資産計	7,245,941	7,245,941	-
(1) 未払費用	985,047	985,047	-
負債計	985,047	985,047	-

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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
非上場株式	15,750	750

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、「(4) 投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

## 注3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(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

当事業年度(2019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	5,031,283	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	892,311	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	1,133,534	-	-	-
(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	-	177,539	11,118	-
合計	7,057,129	177,539	11,118	-

## 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(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

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	10,092	10,199	106
	小計	10,092	10,199	106
合計		50,620	47,193	3,427

当事業年度(2019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	176,630	165,000	11,630
	小計	176,630	165,000	11,630
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	12,027	12,189	161
	小計	12,027	12,189	161
合計		188,657	177,189	11,468

## 5. 売却したその他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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	24,900	9,900	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	13,229	2,130	0
合計	38,129	12,030	0

(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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	90,737	112,624
退職給付費用	24,091	23,211
退職給付の支払額	2,204	1,592

退職給付引当金の期末残高	112,624	134,243
--------------	---------	---------

## (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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	112,624	134,243
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	112,624	134,243
退職給付引当金	112,624	134,243
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	112,624	134,243

## (3) 退職給付費用

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	24,091	23,211

## 3. 確定拠出制度

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当社の確定拠出制度への要拠出額	14,515	25,915

## (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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019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	172,841	259,327
退職給付引当金	34,485	41,105
賞与引当金	32,123	38,295
未払費用否認	17,276	14,684
未払事業税	6,393	14,487
繰延資産損金算入限度超過額	6,561	5,949
その他	8,285	4,944
繰延税金資産 小計	277,965	378,793
将来減算一時差異等の合計に係る評価性引当額	-	2,645
評価性引当額 小計	2,595	2,645
繰延税金資産 合計	275,370	376,148
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	1,049	3,512
株式譲渡損益	-	3,031
固定資産除去価額	505	424
繰延税金負債 合計	1,554	6,967
繰延税金資産の純額	273,815	369,181

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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）	当事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）
期首残高	8,039	8,181
時の経過による調整額	142	145
期末残高	8,181	8,327

（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 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。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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	中東	米国	アジア	合計
7,315,521	575,733	128,375	117,530	35,814	8,172,976

(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

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等に限る。)等

記載すべき重要な取引はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

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 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。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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1）	488,979	未払手数料	107,223
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2）	165,115	未収運用受託報酬	88,523

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）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。

（注2）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。

（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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）	当事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）
1株当たり純資産額（円）	222,196.99	234,434.27
1株当たり当期純利益金額（円）	22,846.62	21,970.39

（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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）	当事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）
当期純利益（千円）	550,260	529,156
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）	550,260	529,156
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35期中間会計期間 （2019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		4,462,716
2 前払費用		85,834
3 未収委託者報酬		1,064,536
4 未収運用受託報酬		1,051,386
5 未収収益		44
6 その他		3,500
流動資産合計		6,668,018
固定資産		
1 有形固定資産	1	108,449
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		198,354
(2) 長期差入保証金		161,598
(3) 繰延税金資産		377,510
(4) その他		33
投資その他の資産合計		737,495
固定資産合計		850,480
資産合計		7,518,498

		第35期中間会計期間 (2019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		7,118
2 未払金		
(1) 未払手数料		341,929
(2) その他未払金		274,113
未払金合計		616,043
3 未払費用		612,977
4 未払法人税等		143,352
5 賞与引当金		94,702
6 役員賞与引当金		2,400
7 その他	2	17,246
流動負債合計		1,493,840
固定負債		
1 退職給付引当金		145,393
2 資産除去債務		8,401
固定負債合計		153,794
負債合計		1,647,635
<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		3,899,384
利益剰余金合計		3,899,384
株主資本合計		5,862,664
評価・換算差額等		
1 その他有価証券評価差額金		8,198
評価・換算差額等合計		8,198
純資産合計		5,870,862
負債・純資産合計		7,518,498

## (2) 中間損益計算書

		第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019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		2,322,007	
2 運用受託報酬		1,597,031	3,919,039
営業費用			
1 支払手数料		995,486	
2 広告宣伝費		10,061	
3 公告費		200	
4 調査費		1,147,700	
(1) 調査費		546,899	
(2) 委託調査費		598,768	
(3) 図書費		2,032	
5 営業雑経費		99,614	
(1) 通信費		2,982	
(2) 印刷費		83,826	
(3) 諸会費		12,805	
一般管理費			2,253,063
1 給料		737,162	
(1) 役員報酬		43,456	
(2) 給料・手当		634,700	
(3) 賞与		59,005	
2 福利厚生費		94,456	
3 交際費		5,697	
4 旅費交通費		27,044	
5 法人事業税		27,501	
6 租税公課		3,807	
7 不動産賃借料		107,624	
8 退職給付費用		33,183	
9 賞与引当金繰入		94,702	
10 役員賞与引当金繰入		2,400	
11 固定資産減価償却費	1	5,810	
12 諸経費		184,843	1,324,235
営業利益			341,740
営業外収益			
1 受取配当金		90	
2 受取利息		132	
3 雑益		781	1,004
営業外費用			
1 有価証券売却損		2	
2 有価証券償還損		11	
3 為替差損		4,207	
4 雑損		128	4,349
経常利益			338,395
特別損失			
1 固定資産除却損		409	
2 商号変更費用		279	689
税引前中間純利益			337,706
法人税、住民税及び事業税			121,869
法人税等調整額			8,435
中間純利益			224,271

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

(単位:千円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計	
	資本	資本剰余金	その他利益 剰余金	利益剰余金		

	資本金	準備金	合計	繰越利益 剰余金	合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	3,675,113	3,675,113	5,638,393
当中間期変動額						
中間純利益				224,271	224,271	224,271
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	-	-	-	224,271	224,271	224,271
当中間期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,899,384	3,899,384	5,862,664

	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	7,956	7,956	5,646,349
当中間期変動額			
中間純利益			224,271
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	242	242	242
当中間期変動 額合計	242	242	224,513
当中間期末残高	8,198	8,198	5,870,862

## 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。

### 注記事項

#### （中間貸借対照表関係）

	第35期中間会計期間 (2019年9月30日)
1 有形固定資産の減価償却累計額	143,605千円
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35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
1 減価償却実施額 有形固定資産	5,810千円

#### （中間株主資本等変動計算書関係）

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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35期中間会計期間（2019年9月30日）

##### 金融商品の時価等に関する事項

2019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	4,462,716	4,462,716	-
(2) 未収委託者報酬	1,064,536	1,064,536	-
(3) 未収運用受託報酬	1,051,386	1,051,386	-
(4) 投資有価証券			
その他有価証券	197,604	197,604	-
資産計	6,776,242	6,776,242	-
(1) 未払費用	612,977	612,977	-
負債計	612,977	612,977	-

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35期中間会計期間 (2019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	186,669	174,700	11,969
	小計	186,669	174,700	11,969
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	10,935	11,087	152
	小計	10,935	11,087	152
合計		197,604	185,787	11,816

## (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35期中間会計期間 (2019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	8,327千円
時の経過による調整額	74千円
中間期末残高	8,401千円

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019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35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019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

(単位：千円)

日本	欧州	北米	中東	アジア	合計
3,430,451	246,607	120,521	94,487	26,971	3,919,039

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

## (1株当たり情報)

	第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
1株当たり純資産額	243,755.98 円
1株当たり中間純利益金額	9,311.65 円 なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(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35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
中間純利益	224,271 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	224,271 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。

## 5【その他】

## &lt;訂正前&gt;

## (1) 定款の変更

2019年6月27日付で取締役の数の上限を変更する定款の変更を行いました。

## (2) 訴訟事件その他の重要事項

2020年4月1日付で商号をS O M P Oアセットマネジメント株式会社に変更する予定です。

## &lt;訂正後&gt;

## (1) 定款の変更

2019年6月27日付で取締役の数の上限を変更する定款の変更を行いました。

2020年4月1日付で商号をS O M P Oアセットマネジメント株式会社に変更する定款変更を行いました。

## (2) 訴訟事件その他の重要事項

2020年4月1日付で商号をS O M P Oアセットマネジメント株式会社に変更しました。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## &lt;訂正前&gt;

(略)

## (2)販売会社

名 称	資本金の額 <sup>1</sup> (単位：百万円)	事業の内容
エース証券株式会社	8,831	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C日興証券株式会社	10,000	
株式会社S B I証券	48,323	
岡三にいがた証券株式会社	852	
カブドットコム証券株式会社	7,196	
静岡東海証券株式会社 <sup>2</sup>	600	
損保ジャパン日本興亜D C証券株式会社	3,000	
松井証券株式会社	11,945	
マネックス証券株式会社	12,200	
みずほ証券株式会社	125,167	
楽天証券株式会社	7,495	



株式会社イオン銀行 3	51,250	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社大東銀行 4	14,743	
株式会社みずほ銀行	1,404,065	
損害保険ジャパン日本興亜株式会社	70,000	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

1 資本金の額は、2019年3月末現在

2 ハッピーエイジング30、40のみの取扱いとなります。

3 ハッピーエイジング20、30、40のみの取扱いとなります。

4 ハッピーエイジング40のみの取扱いとなります。

(略)

<訂正後>

(略)

(2)販売会社

名称	資本金の額 <sup>1</sup> (単位：百万円)	事業の内容	
エース証券株式会社	8,831	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。	
SMB C日興証券株式会社	10,000		
株式会社SBI証券	48,323		
岡三にいがた証券株式会社	852		
auカブコム証券株式会社	7,196		
静岡東海証券株式会社 2	600		
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000		
松井証券株式会社	11,945		
マネックス証券株式会社	12,200		
みずほ証券株式会社	125,167		
楽天証券株式会社	7,495		
株式会社イオン銀行 3	51,250		銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社新生銀行	512,204		
株式会社大東銀行 4	14,743		
株式会社みずほ銀行	1,404,065	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。	
損害保険ジャパン株式会社	70,000		

1 資本金の額は、2019年3月末現在

2 ハッピーエイジング30、40のみの取扱いとなります。

3 ハッピーエイジング20、30、40のみの取扱いとなります。

4 ハッピーエイジング40のみの取扱いとなります。

(略)

第3【その他】

<訂正前>

(略)

## ご投資家のみなさまへ

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

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

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント

<訂正後>

(略)

## ご投資家のみなさまへ

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

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

SOMPOアセットマネジメント

## 独立監査人の中間監査報告書

2020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 蒲 谷 剛  
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20の2019年7月17日から2020年1月16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2020年1月16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（2019年7月17日から2020年1月16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

2020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 蒲 谷 剛  
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30の2019年7月17日から2020年1月16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2020年1月16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（2019年7月17日から2020年1月16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

2020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 蒲 谷 剛  
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2019年7月17日から2020年1月16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2020年1月16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（2019年7月17日から2020年1月16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

2020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 蒲 谷 剛  
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50の2019年7月17日から2020年1月16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2020年1月16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（2019年7月17日から2020年1月16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

2020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 蒲 谷 剛  
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60の2019年7月17日から2020年1月16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2020年1月16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（2019年7月17日から2020年1月16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

2019年6月3日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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、「委託会社等の経理の状況」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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の2019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の状況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

2019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2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間(2019年4月1日から2019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2019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(2019年4月1日から2019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。