【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年7月23日提出
【発行者名】	損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 小嶋　信弘
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋二丁目２番１６号
【事務連絡者氏名】	須田　静
【電話番号】	03-5290-3469
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	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
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	募集額　5,000億円を上限とします。
【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1月23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、有価証券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」および「第二部　ファンド情報　第３　ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。

第一部【証券情報】

（４）【発行（売出）価格】

＜訂正前＞

(略)

ホームページ http://www.sjnk-am.co.jp/

＜訂正後＞

(略)

ホームページ https://www.sjnk-am.co.jp/

（５）【申込手数料】

＜訂正前＞

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.78%（税抜3.5%）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額です。

※申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

(略)

＜訂正後＞

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.78%＊（税抜3.5%）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額です。

＊消費税率が10%になった場合は、3.85%となります。

(略)

（８）【申込取扱場所】

＜訂正前＞

(略)

ホームページ http://www.sjnk-am.co.jp/

＜訂正後＞

(略)

ホームページ https://www.sjnk-am.co.jp/

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

＜ファンドの特色＞

(略)

投資対象とする外国投資信託に関して

「TCW ファンズ - TCW ハイ インカム US エクイティ プレミアム ファンド」の運用は、
TCW アセット マネジメント カンパニーが行います。

ＴＣＷ アセット マネジメント カンパニーについて

ロサンゼルスを拠点とする TCW グループ(1971 年設立)傘下の運用会社です。
2018 年 6 月末現在の同グループの運用資産は、約 1,983 億米ドル(約 21 兆 9,200 億円※)です。
※2018 年 6 月末時点の為替レートで換算。

(略)

＜訂正後＞

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

＜ファンドの特色＞

(略)

投資対象とする外国投資信託に関して

「TCW ファンズ - TCW ハイ インカム US エクイティ プレミアム ファンド」の運用は、
TCW アセット マネジメント カンパニーが行います。

ＴＣＷ アセット マネジメント カンパニーについて

ロサンゼルスを拠点とする TCW グループ(1971 年設立)傘下の運用会社です。
2018 年 12 月末現在の同グループの運用資産は、約 1,906 億米ドル(約 21 兆 1,566 億円※)です。
※2018 年 12 月末時点の為替レートで換算。

(略)

（３）【ファンドの仕組み】

＜訂正前＞
(略)

③　委託会社等の概況
（ｉ)資本金の額　1,550百万円　（2018年10月末現在）
(略)
(iii)大株主の状況（2018年10月末現在）
(略)

＜訂正後＞
(略)

③　委託会社等の概況
（ｉ)資本金の額　1,550百万円　（2019年4月末現在）
(略)
(iii)大株主の状況（2019年4月末現在）
(略)

２【投資方針】

（２）【投資対象】

＜訂正前＞
(略)

主要投資対象の投資信託証券の概要

名　　称	ＴＣＷ ファンズ －ＴＣＷ ハイ インカム ＵＳ エクイティ プレミアム ファンド 通貨セレクト プレミアム シェア クラス (The TCW Funds - TCW High Income US Equity Premium Fund Currency Select Premium Share Class)
形　　態	ケイマン籍外国投資信託(円建て)
運用の基本方針	・米国の取引所に上場されている株式等（不動産投資信託(REIT)等を含みます。)を実質的な主要投資対象とし、インカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。 また、インカムゲインの確保に加え、「株式オプション・プレミアム戦略」※の活用により、オプションプレミアムの獲得を目指します。 ※個別銘柄毎に、保有株数の一部または全部にかかるコールオプションを売却することで「株式オプション・プレミアム戦略」を構築します。 ・原則として、相対的に利回りが高いと判断される銘柄に投資を行います。 ※なお、資産規模等で当該運用が困難な場合は、上場投資信託(ＥＴＦ)を通じて「株式オプション・プレミアム戦略」を行うことがあります。 ・セレクト通貨※1を通じた為替取引を活用し、為替取引によるプレミアムの獲得を目指します。 ・同時に、セレクト通貨※1(対米ドル)のコールオプションを売却する「通貨オプション・プレミアム戦略」を活用し、通貨のオプションプレミアム収入の獲得をめざします。 ※１ 相対的に金利が高い４から６つの通貨※2を選定し為替取引を行います。 ※２ セレクト通貨候補：原則として、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよび JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ・ブロード構成国の通貨とします。 ■原則としてセレクト通貨候補の流動性（オプションを含みます。)・金利状況・ファンダメンタルズ等を総合的に勘案して、通貨選定を行います。なお、セレクト通貨は必ずしも相対的に金利の高い上位通貨から選定されるとは限りません。 ■上記のセレクト通貨候補及びセレクト通貨は定期的に見直しを行い、今後変更となる可能性があります。
主な投資制限	・有価証券の空売りは行いません。 ・純資産総額の 10%を超える借入れを行いません。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、ファンドの純資産総額の５%以下とします。 ・流動性に欠ける資産への投資は行いません。 <有価証券の発行者等に関するエクスポージャー>　１発行体 10%以内 <取引の相手方に対するエクスポージャー>　評価益ベースで 10%以内
決　算　日	毎年３月31日
信託報酬等	純資産総額に対して年率 0.88% ※年間最低報酬額等がかかる場合は、純資産総額等により年率換算で上記の信託報酬率を上回ることがあります。 ※上記のほか、投資信託証券の設立・開示に関する費用等(監査費用、弁護士費用等)、管理報酬、売買委託手数料、外国における資産の保管等に要する費用、信託財産に関する租税等がかかります。
申込・解約手数料	ありません。
投資顧問会社	TCW Asset Management Company

※ファンドが主要投資対象とする投資信託証券の名称及びその運用会社の名称等は今後変更となる場合があります。

名　　称	損保ジャパン日本債券マザーファンド
形　　態	国内籍親投資信託(円建て)
運用の基本方針	主として、日本の公社債を中心に分散投資を行い、インカムの確保を図るとともに金利低下や格付け上昇に伴うキャピタルゲインの獲得を狙い、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数を中長期的に上回る投資成果を目指します。
主な投資制限	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以内とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
設　定　日	2000 年 7 月 31 日
信託期間	無期限
決　算　日	原則として、毎年 7 月 15 日
信託報酬等	ありません。
申込・解約手数料	ありません。
委託会社	損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

＜訂正後＞

(略)

主要投資対象の投資信託証券の概要

名　称	ＴＣＷ ファンズ －ＴＣＷ ハイ インカム ＵＳ エクイティ プレミアム ファンド 通貨セレクト プレミアム シェア クラス (The TCW Funds – TCW High Income US Equity Premium Fund Currency Select Premium Share Class)
形　態	ケイマン籍外国投資信託(円建て)
運用の基本方針	・米国の取引所に上場されている株式等（不動産投資信託(REIT)等を含みます。)を実質的な主要投資対象とし、インカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。また、インカムゲインの確保に加え、「株式オプション・プレミアム戦略」※の活用により、オプションプレミアムの獲得を目指します。 ※個別銘柄毎に、保有株数の一部または全部にかかるコールオプションを売却することで「株式オプション・プレミアム戦略」を構築します。 ・原則として、相対的に利回りが高いと判断される銘柄に投資を行います。 ※なお、資産規模等で当該運用が困難な場合は、上場投資信託(ＥＴＦ)を通じて「株式オプション・プレミアム戦略」を行うことがあります。 ・セレクト通貨※1を通じた為替取引を活用し、為替取引によるプレミアムの獲得を目指します。 ・同時に、セレクト通貨※1(対米ドル)のコールオプションを売却する「通貨オプション・プレミアム戦略」を活用し、通貨のオプションプレミアム収入の獲得をめざします。 ※1 相対的に金利が高い４から６つの通貨※2を選定し為替取引を行います。 ※2 セレクト通貨候補：原則として、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよび JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ・ブロード構成国の通貨とします。 ■原則としてセレクト通貨候補の流動性（オプションを含みます。)・金利状況・ファンダメンタルズ等を総合的に勘案して、通貨選定を行います。なお、セレクト通貨は必ずしも相対的に金利の高い上位通貨から選定されるとは限りません。 ■上記のセレクト通貨候補及びセレクト通貨は定期的に見直しを行い、今後変更となる可能性があります。
主な投資制限	・有価証券の空売りは行いません。 ・純資産総額の 10%を超える借入れを行いません。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、ファンドの純資産総額の５%以下とします。 ・流動性に欠ける資産への投資は行いません。 ＜有価証券の発行者等に関するエクスポージャー＞　１発行体 10%以内 ＜取引の相手方に対するエクスポージャー＞　評価益ベースで 10%以内
決　算　日	毎年３月31日
信託報酬等	純資産総額に対して年率 0.88% ※年間最低報酬額等がかかる場合は、純資産総額等により年率換算で上記の信託報酬率を上回ることがあります。 ※上記のほか、投資信託証券の設立・開示に関する費用等(監査費用、弁護士費用等)、管理報酬、売買委託手数料、外国における資産の保管等に要する費用、信託財産に関する租税等がかかります。
申込・解約手数料	ありません。
投資顧問会社	TCW Asset Management Company

※ファンドが主要投資対象とする投資信託証券の名称及びその運用会社の名称等は今後変更となる場合があります。

名　称	損保ジャパン日本債券マザーファンド
形　態	国内籍親投資信託(円建て)
運用の基本方針	主として、日本の公社債を中心に分散投資を行い、インカムの確保を図るとともに金利低下や格付け上昇に伴うキャピタルゲインの獲得を狙い、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数を中長期的に上回る投資成果を目指します。
主な投資制限	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以内とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
設　定　日	2000 年 7 月 31 日
信託期間	無期限
決　算　日	原則として、毎年 7 月 15 日
信託報酬等	ありません。
申込・解約手数料	ありません。
委託会社	損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

（３）【運用体制】

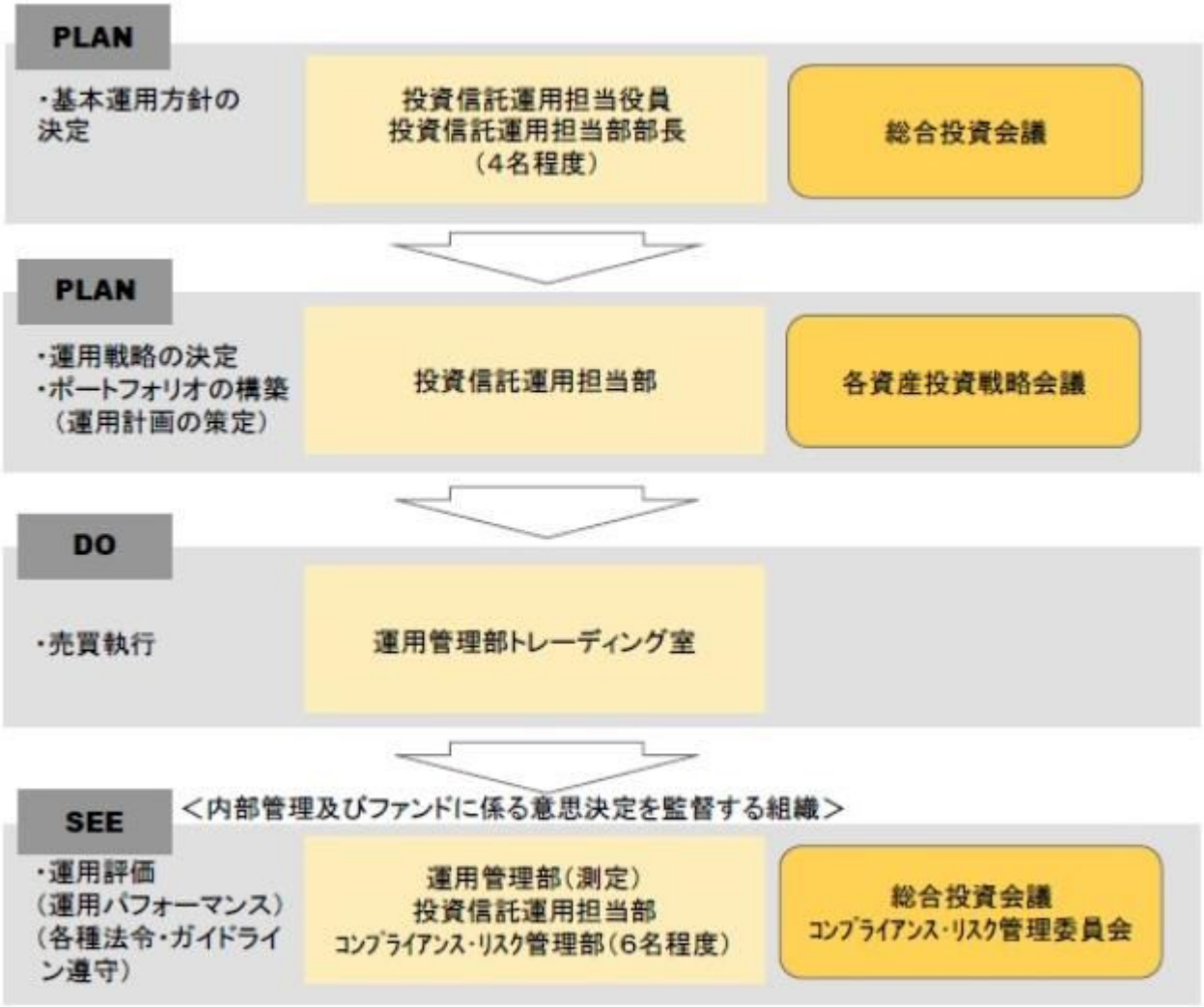
＜訂正前＞

（運用体制）

(略)

③各運用担当部で策定された運用計画に基づき、<u>運用管理部トレーディング室</u>が最良執行の観点から売買を執行します。

(略)



※2018年10月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

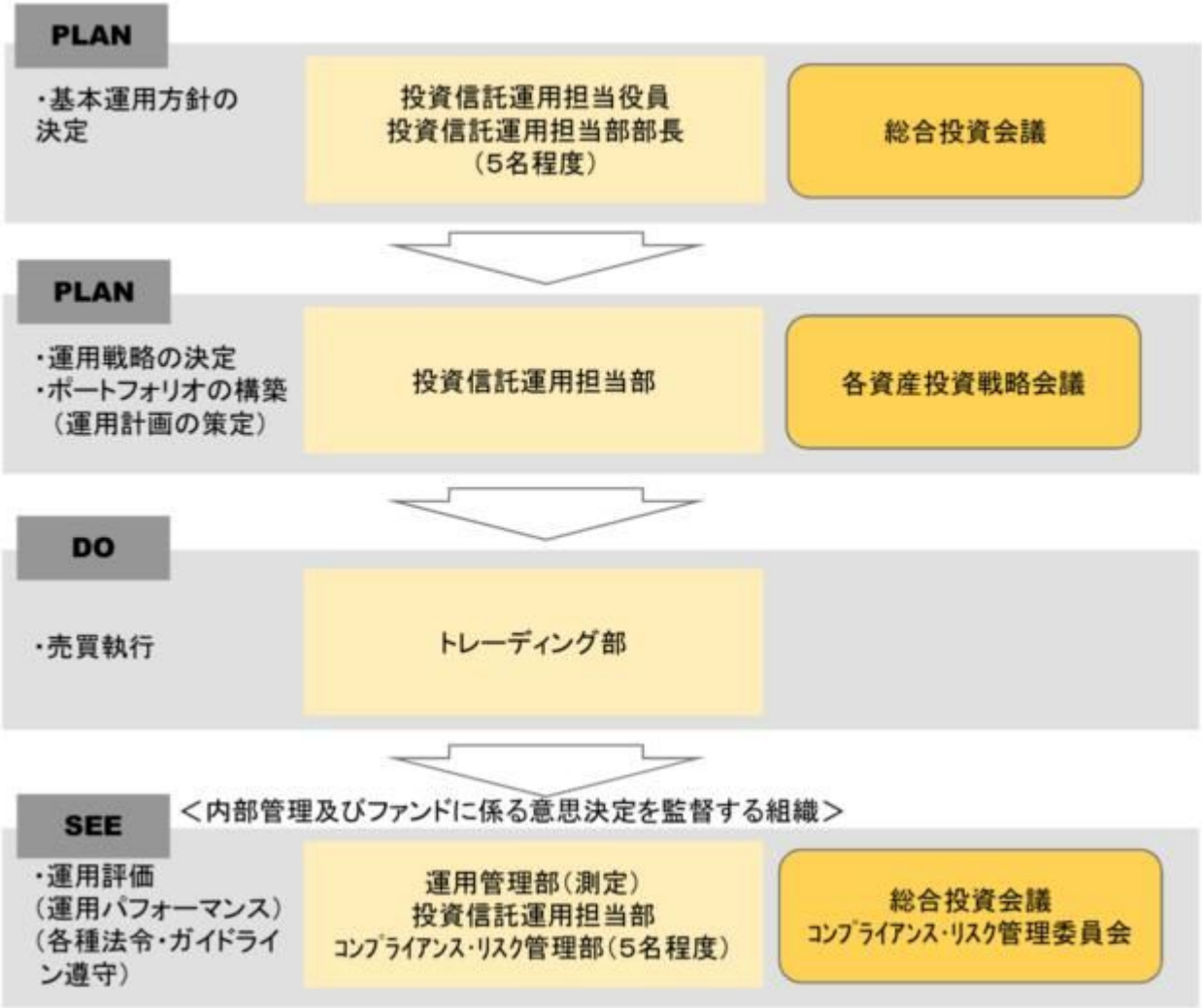
＜訂正後＞

（運用体制）

（略）

③各運用担当部で策定された運用計画に基づき、トレーディング部が最良執行の観点から売買を執行します。

（略）



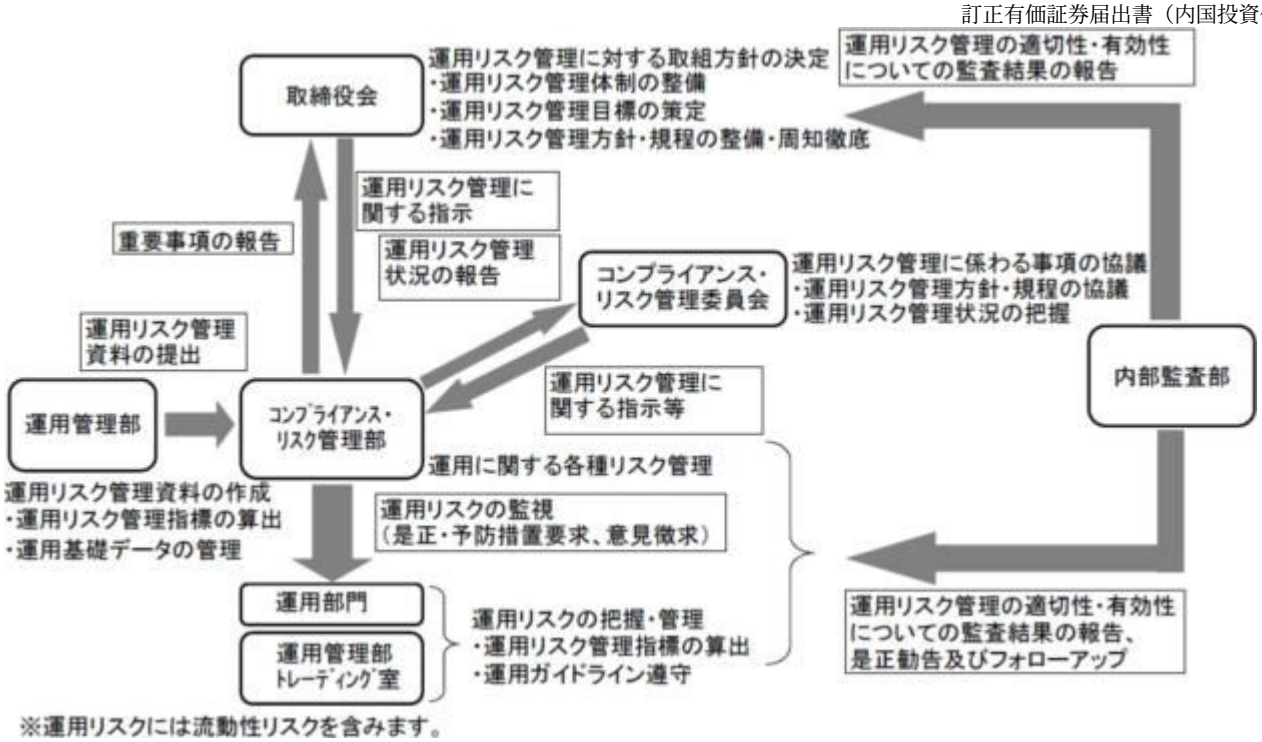
※2019年4月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

3【投資リスク】

＜訂正前＞

(略)

＜リスクの管理体制＞



（注）上図は、2018年10月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

2013年11月～2018年10月

ファンド　:2014年10月～2018年10月
代表的な資産クラス:2013年11月～2018年10月

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

●上記は、期間5年のグラフになります。

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

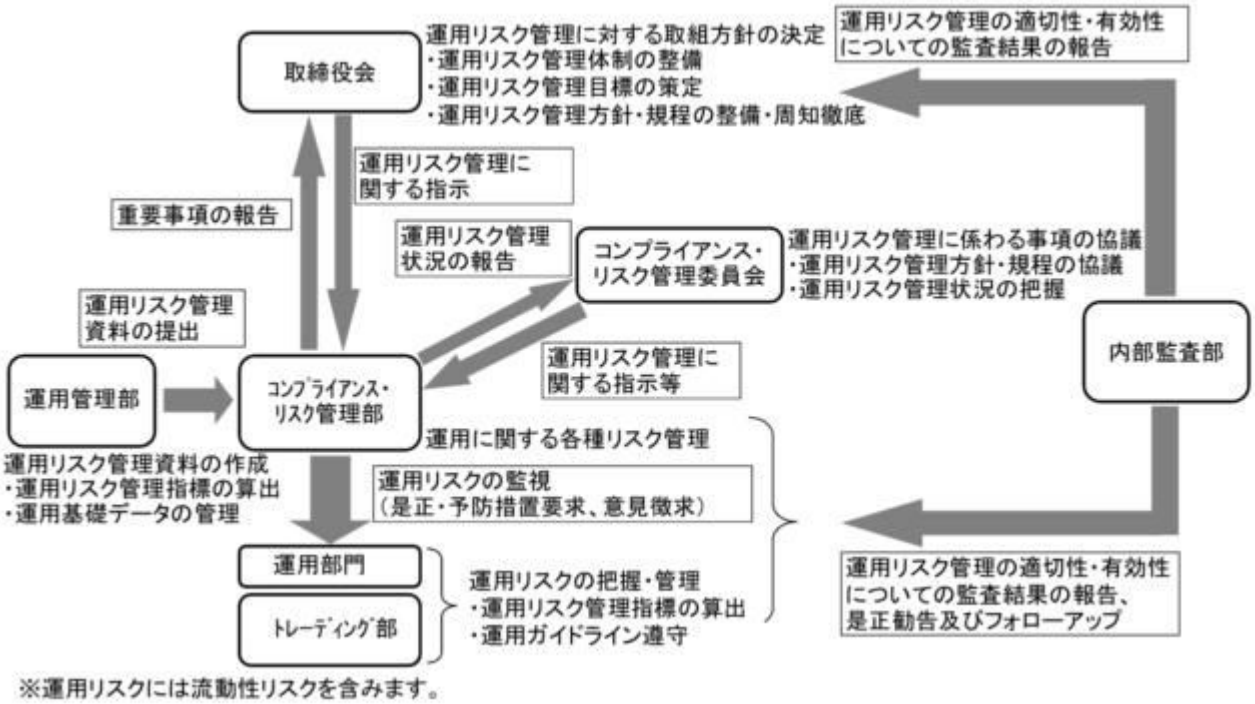
代表的な資産クラスの指数		
日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	東京証券取引所第一部上場全銘柄の基準時（1968年1月4日終値）の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。東証株価指数（TOPIX）は、東京証券取引所の知的財産であり、東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース)	MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、米ドルベース）をもとに委託会社が独自に計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭ グローバル・ディバーシファイド (円ベース)	J.P. Morgan Securities LLCが算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。 同指数の著作権はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

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

＜訂正後＞

(略)

＜リスクの管理体制＞



（注）上図は、2019年4月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

–

2014年5月～2019年4月

ファンド　:2014年10月～2019年4月
代表的な資産クラス:2014年　5月～2019年4月

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

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

代表的な資産クラスの指数	
日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み) 東京証券取引所第一部上場全銘柄の基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所の知的財産であり、東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。	先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース) MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。	日本国債:NOMURA-BPI 国債 野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。	新興国債:ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ディバーシファイド(円ベース) J.P. Morgan Securities LLC が算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。 同指数の著作権はJ.P. Morgan Securities LLC に帰属します。

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

＜訂正前＞

＜申込み時に受益者が負担する費用・税金＞

時期	項目	費用・税金	
申込み時	申込手数料及び消費税等相当額	申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.78%（税抜 3.5%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。 ※申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。	販売会社によるファンドの商品説明・投資環境の説明・事務処理等の対価

（略）

＜訂正後＞

＜申込み時に受益者が負担する費用・税金＞

時期	項目	費用・税金	
申込み時	申込手数料及び消費税等相当額	申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.78%＊（税抜 3.5%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。 ＊消費税率が10%になった場合は、3.85%となります。 ※申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。	販売会社によるファンドの商品説明・投資環境の説明・事務処理等の対価

（略）

（３）【信託報酬等】

＜訂正前＞

① 委託会社及び受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、ファンドの信託財産の純資産総額に年率1.0044%（税抜0.93%）を乗じて得た金額とし、委託会社と受託会社との間の配分は以下のとおりです（下記④のとおり、委託会社は販売会社への配分を一旦収受します。）。

・運用管理費用（信託報酬） ＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

委託会社	年率0.40%（税抜）	ファンドの運用の対価
販売会社	年率0.50%（税抜）	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%（税抜）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等の対価

（略）

⑤ ファンドの主要投資対象の１つである以下の外国投資信託証券に関しても別途信託報酬等がかかります。当該投資信託証券の信託報酬等を加えた実質的な信託報酬率は概ね1.8844%（税込・年率）程度となります。実質的に負担する信託報酬率は、ファンドの運用方針に基づいて投資信託証券を組み入れた場合の概算です。投資信託証券の組入状況等によって、実質的に負担する信託報酬率は変動します。

（略）

⑥ 組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料に対する消費税等相当額及びコール取引等に要する費用及び外国における資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担します。信託財産の証券取引等に伴う手数料や税金は信託財産が負担しますが、売買委託手数料や有価証券取引税等証券取引に伴う手数料や税金は国や市場によって異なります。また、売買金額によっても異なります。

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

＜訂正後＞

① 委託会社及び受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、ファンドの信託財産の純資

産総額に年率1.0044%＊（税抜0.93%）を乗じて得た金額とし、委託会社と受託会社との間の配分は以下のとおりです（下記④のとおり、委託会社は販売会社への配分を一旦収受します。）。
＊消費税率が10%になった場合は、1.023%となります。
・運用管理費用（信託報酬）　＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

委託会社	年率0.40%（税抜）	ファンドの運用の対価
販売会社	年率0.50%（税抜）	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%（税抜）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等の対価

(略)

⑤　ファンドの主要投資対象の１つである以下の外国投資信託証券に関しても別途信託報酬等がかかります。当該投資信託証券の信託報酬等を加えた実質的な信託報酬率は概ね1.8844%＊（税込・年率）程度となります。実質的に負担する信託報酬率は、ファンドの運用方針に基づいて投資信託証券を組み入れた場合の概算です。投資信託証券の組入状況等によって、実質的に負担する信託報酬率は変動します。
＊消費税率が10%になった場合は、概ね1.903%となります。

(略)

（４）【その他の手数料等】

＜訂正前＞

(略)

②　委託会社は、前記①に定める信託事務の処理に要する諸費用のうち監査費用の支払いを信託財産のために行い、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。この場合、信託財産にかかる監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、実際の費用額（年間27万円（税抜25万円））を上限として、純資産総額に定率（年0.00216%（税抜0.0020%））を乗じて日々計算し、毎計算期末または信託終了のとき信託財産からその支弁を受けることとします。なお、監査費用の上限金額については、変動する可能性があります。

監査費用	監査法人に支払うファンド監査にかかる費用

＜訂正後＞

(略)

②　信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて日々計算し、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁することができます。支弁時期は信託報酬と同様です。

監査費用	監査法人に支払うファンド監査にかかる費用

※上記の費用等については、運用状況等により変動するものがあり、事前に料率、上限額等を表示することができないものがあります。

③　組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料に対する消費税等相当額及びコール取引等に要する費用及び外国における資産の保管等

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

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

（５）【課税上の取扱い】

＜訂正前＞
(略)

※　上記は2018年10月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

＜訂正後＞
(略)

※　上記は2019年4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】

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

2019年4月26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	ケイマン	1,376,201,332	94.72
親投資信託受益証券	日本	14,709,242	1.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	―	61,962,423	4.27
純資産総額		1,452,872,997	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2019年4月26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	11,198,057,400	66.75
	メキシコ	100,045,000	0.60
		11,298,102,400	67.34

特殊債券	日本	484,553,602	2.89
社債券	日本	4,051,334,000	24.15
	フランス	409,540,000	2.44
		4,460,874,000	26.59
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	―	533,715,379	3.18
純資産総額		16,777,245,381	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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

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

2019年4月26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	ケイマン	投資信託受益証券	ＴＣＷ　ＨｉｇｈＩｎｃｏｍｅ　ＵＳ　ＥＱ　Ｐｒｅ　ＣｕＳｅＰ	838,125.05	1,664	1,394,640,083	1,642	1,376,201,332	94.72
2	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	10,180,111	1.4445	14,705,170	1.4449	14,709,242	1.01

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。
（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2019年4月26日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	94.72
親投資信託受益証券	1.01
合計	95.74

（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）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2019年4月26日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率(%)	償還日	投資比率（%）
1	日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	1,020,000,000	99.97	1,019,766,100	101.78	1,038,247,800	0.1000000	2028/3/20	6.19

2	日本	国債証券	第３４７回利付国債（１０年）	920,000,000	100.64	925,901,900	101.88	937,360,400	0.1000000	2027/6/20	5.59
3	日本	国債証券	第１５０回利付国債（２０年）	710,000,000	117.28	832,752,300	118.33	840,199,800	1.4000000	2034/9/20	5.01
4	日本	国債証券	第３８回利付国債（３０年）	580,000,000	123.26	714,945,100	130.50	756,917,400	1.8000000	2043/3/20	4.51
5	日本	国債証券	第１５８回利付国債（２０年）	600,000,000	100.77	604,630,500	103.81	622,896,000	0.5000000	2036/9/20	3.71
6	日本	国債証券	第１５４回利付国債（２０年）	520,000,000	113.40	589,707,800	115.57	601,005,600	1.2000000	2035/9/20	3.58
7	日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	510,000,000	101.63	518,327,100	101.59	518,144,700	0.1000000	2028/12/20	3.09
8	日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	460,000,000	102.02	469,294,500	101.82	468,404,200	0.1000000	2027/12/20	2.79
9	日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	440,000,000	101.90	448,363,500	101.88	448,307,200	0.1000000	2026/12/20	2.67
10	日本	国債証券	第１６６回利付国債（２０年）	420,000,000	105.47	442,982,400	106.44	447,073,200	0.7000000	2038/9/20	2.66
11	日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	380,000,000	101.21	384,629,200	101.25	384,776,600	0.1000000	2023/12/20	2.29
12	日本	国債証券	第３３５回利付国債（１０年）	300,000,000	103.60	310,828,000	103.63	310,896,000	0.5000000	2024/9/20	1.85
13	日本	国債証券	第１４８回利付国債（２０年）	250,000,000	118.63	296,583,700	119.54	298,867,500	1.5000000	2034/3/20	1.78
14	日本	国債証券	第３５回利付国債（３０年）	210,000,000	131.15	275,415,000	133.54	280,436,100	2.0000000	2041/9/20	1.67
15	日本	国債証券	第１６２回利付国債（２０年）	250,000,000	100.42	251,074,700	105.04	262,600,000	0.6000000	2037/9/20	1.57
16	日本	国債証券	第１４６回利付国債（２０年）	210,000,000	120.18	252,385,800	122.06	256,334,400	1.7000000	2033/9/20	1.53
17	日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	250,000,000	100.52	251,315,000	101.86	254,657,500	0.1000000	2026/9/20	1.52
18	日本	国債証券	第１３０回利付国債（２０年）	190,000,000	120.99	229,888,800	121.44	230,743,600	1.8000000	2031/9/20	1.38
19	日本	国債証券	第５７回利付国債（３０年）	210,000,000	103.57	217,497,000	107.10	224,928,900	0.8000000	2047/12/20	1.34
20	日本	国債証券	第１１３回利付国債（２０年）	180,000,000	122.23	220,014,000	122.09	219,778,200	2.1000000	2029/9/20	1.31
21	日本	国債証券	第６１回利付国債（３０年）	210,000,000	102.29	214,810,800	104.08	218,578,500	0.7000000	2048/12/20	1.30
22	日本	社債券	第５６８回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	102.07	204,140,800	101.22	202,442,000	1.1550000	2020/9/8	1.21
23	日本	社債券	第３回Ａ号明治安田生命劣後ＦＲ	200,000,000	101.37	202,750,000	101.01	202,026,000	1.1100000	2047/11/6	1.20
24	日本	社債券	第３０回東レ株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	200,000,000	100.28	200,560,200	100.40	200,812,000	0.3750000	2027/7/16	1.20

25	日本	社債券	第１回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	100.37	200,752,000	100.15	200,308,000	0.3800000	2020/3/9	1.19
26	日本	社債券	第１２回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	100.30	200,611,200	99.96	199,920,000	0.4400000	2023/4/19	1.19
27	日本	社債券	第３回Ａ号富国生命劣後ＦＲ	200,000,000	99.55	199,100,000	99.57	199,140,000	1.0200000	9999/99/99	1.19
28	日本	国債証券	第１１回利付国債（４０年）	180,000,000	102.80	185,041,200	106.30	191,345,400	0.8000000	2058/3/20	1.14
29	日本	国債証券	第５８回利付国債（３０年）	170,000,000	102.79	174,748,600	107.02	181,947,600	0.8000000	2048/3/20	1.08
30	日本	国債証券	第６０回利付国債（３０年）	160,000,000	100.22	160,352,000	109.54	175,268,800	0.9000000	2048/9/20	1.04

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

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

投資有価証券の種類別投資比率

2019年4月26日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	67.34
特殊債券	2.89
社債券	26.59
合計	96.82

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

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

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。

③【その他投資資産の主要なもの】

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

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。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

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

直近日（2019年4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1特定期間末　(2014年 4月24日)	1,500,240,455	1,537,593,396	0.9238	0.9468
第2特定期間末　(2014年10月24日)	4,780,372,117	4,909,756,538	0.8498	0.8728
第3特定期間末　(2015年 4月24日)	8,672,928,621	8,916,458,604	0.8191	0.8421
第4特定期間末　(2015年10月26日)	6,390,914,918	6,574,726,926	0.5911	0.6081
第5特定期間末　(2016年 4月25日)	4,224,556,491	4,296,811,748	0.4677	0.4757
第6特定期間末　(2016年10月24日)	3,445,432,415	3,511,938,582	0.4144	0.4224
第7特定期間末　(2017年 4月24日)	3,204,687,069	3,266,865,184	0.4123	0.4203
第8特定期間末　(2017年10月24日)	2,728,458,350	2,784,804,749	0.3874	0.3954
第9特定期間末　(2018年 4月24日)	1,965,993,556	2,002,995,166	0.3188	0.3248
第10特定期間末　(2018年10月24日)	1,610,523,794	1,629,748,680	0.2932	0.2967
第11特定期間末　(2019年 4月24日)	1,472,789,805	1,491,141,904	0.2809	0.2844
2018年 4月末日	1,994,324,736	—	0.3218	—
5月末日	1,893,229,355	—	0.3109	—
6月末日	1,826,573,894	—	0.3050	—
7月末日	1,840,739,431	—	0.3142	—
8月末日	1,786,395,053	—	0.3125	—
9月末日	1,748,539,748	—	0.3131	—
10月末日	1,608,790,783	—	0.2929	—
11月末日	1,613,244,060	—	0.2953	—
12月末日	1,413,380,937	—	0.2624	—
2019年 1月末日	1,437,224,232	—	0.2688	—
2月末日	1,470,628,603	—	0.2763	—
3月末日	1,446,561,807	—	0.2735	—
4月末日	1,452,872,997	—	0.2774	—

②【分配の推移】

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

	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.1380
第2特定期間	0.1380
第3特定期間	0.1380
第4特定期間	0.1200
第5特定期間	0.0660
第6特定期間	0.0480
第7特定期間	0.0480
第8特定期間	0.0480
第9特定期間	0.0360
第10特定期間	0.0235
第11特定期間	0.0210

③【収益率の推移】

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

	収益率（%）
第1特定期間	6.2
第2特定期間	6.9
第3特定期間	12.6
第4特定期間	△13.2
第5特定期間	△9.7
第6特定期間	△1.1
第7特定期間	11.1
第8特定期間	5.6
第9特定期間	△8.4
第10特定期間	△0.7
第11特定期間	3.0

（注）各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（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】

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

	設定口数	解約口数
第1特定期間	1,965,007,425	340,966,488
第2特定期間	5,609,625,685	1,608,256,971
第3特定期間	8,115,222,345	3,152,371,860

第4特定期間	4,203,508,273	3,979,297,349
第5特定期間	1,037,170,047	2,817,733,928
第6特定期間	433,026,446	1,151,662,691
第7特定期間	817,372,385	1,358,378,910
第8特定期間	724,065,752	1,453,030,229
第9特定期間	464,802,587	1,341,167,426
第10特定期間	229,168,286	903,278,589
第11特定期間	212,121,214	461,489,040

（注1）本邦外における設定及び解約はございません。

（注2）設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

≪参考情報≫

基準日：2019年4月26日

基準価額・純資産の推移 2013/10/25～2019/04/26

● 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して計算しています。
● 基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

分配の推移

2018年12月	35円
2019年01月	35円
2019年02月	35円
2019年03月	35円
2019年04月	35円
直近1年間累計	445円
設定来累計	8,245円

● 1万口当たり、税引前

主要な資産の状況

●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

資産別構成

資産の種類	純資産比
TCW HighIncome US EQ Pre CuSeP	94.72%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	1.01%
コール・ローン等	4.27%
合　計	100.00%

≪主要投資対象の投資信託証券の運用状況≫

●ＴＣＷ ファンズ－ＴＣＷ ハイ インカム ＵＳ エクイティ プレミアム ファンド

TCW アセット マネジメント カンパニーが作成したデータを掲載しております。

資産別構成

資産の種類	純資産比
株式	94.6%
現金等	5.4%
合　計	100.0%

組入上位10銘柄

	銘　柄　名	通　貨	発行国／地域	業　種	純資産比
1	MICROSOFT CORP	米ドル	アメリカ	情報技術	6.3%
2	EQUINIX INC	米ドル	アメリカ	不動産	5.7%
3	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC	米ドル	アメリカ	金融	5.1%
4	NEXTERA ENERGY INC	米ドル	アメリカ	公益事業	4.8%
5	WELLS FARGO & CO	米ドル	アメリカ	金融	4.6%
6	WAL-MART STORES INC	米ドル	アメリカ	生活必需品	4.6%
7	CONOCOPHILLIPS	米ドル	アメリカ	エネルギー	4.6%
8	ARES CAPITAL CORP	米ドル	アメリカ	金融	4.6%
9	KAR AUCTION SERVICES INC	米ドル	アメリカ	資本財・サービス	4.3%
10	PFIZER INC COM STK	米ドル	アメリカ	ヘルスケア	4.0%
	銘　柄　数			25銘柄	

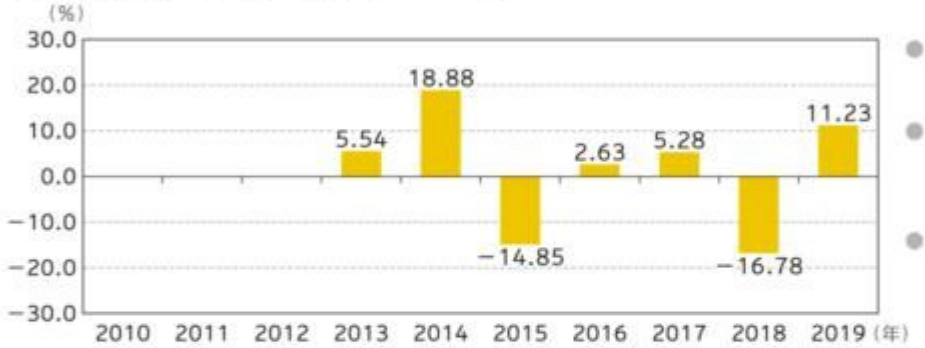
● 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
● 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
● 表中の各数値は四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

●損保ジャパン日本債券マザーファンド

組入上位10銘柄

	銘柄名	種類	償還日	純資産比
1	第350回利付国債(10年)	国債証券	2028/03/20	6.2%
2	第347回利付国債(10年)	国債証券	2027/06/20	5.6%
3	第150回利付国債(20年)	国債証券	2034/09/20	5.0%
4	第38回利付国債(30年)	国債証券	2043/03/20	4.5%
5	第158回利付国債(20年)	国債証券	2036/09/20	3.7%
6	第154回利付国債(20年)	国債証券	2035/09/20	3.6%
7	第353回利付国債(10年)	国債証券	2028/12/20	3.1%
8	第349回利付国債(10年)	国債証券	2027/12/20	2.8%
9	第345回利付国債(10年)	国債証券	2026/12/20	2.7%
10	第166回利付国債(20年)	国債証券	2038/09/20	2.7%
	銘柄数			84銘柄

年間収益率の推移(暦年ベース)



● ファンドの年間収益率は基準価額（税引前分配金再投資）を使用して計算しています。
● 2013年は設定日（10月25日）から年末、2019年は年初から基準日までの収益率です。
● 当ファンドはベンチマークを設定していません。

● 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。
● 表中の各数値は四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜訂正前＞
(略)

（３）　当該受益権の申込価額は、取得申込受付日の翌営業日における基準価額※とします。
(略)
ホームページ http://www.sjnk-am.co.jp/

（４）　お申込みには申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額を要します。申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.78%（税抜3.5%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。
自動けいぞく投資契約に基づき収益分配金を再投資する場合は、手数料はかかりません。
※申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。
(略)

＜訂正後＞
(略)

（３）　当該受益権の申込価額は、取得申込受付日の翌営業日における基準価額※とします。
(略)
ホームページ https://www.sjnk-am.co.jp/

（４）　お申込みには申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額を要します。申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.78%＊（税抜3.5%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。
自動けいぞく投資契約に基づき収益分配金を再投資する場合は、手数料はかかりません。
＊消費税率が10%になった場合は、3.85%となります。
※申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。
(略)

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

＜訂正前＞
(略)
ホームページ http://www.sjnk-am.co.jp/

＜訂正後＞
(略)
ホームページ https://www.sjnk-am.co.jp/

（５）【その他】

＜訂正前＞
(略)
⑧　公告
（ｉ）委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。
http://www.sjnk-am.co.jp/

(略)

＜訂正後＞
(略)

⑧　公告

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

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

(略)

第３【ファンドの経理状況】

１．当ファンドの財務諸表は、「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、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．当ファンドの計算期間は６ヶ月未満であるため、財務諸表は６ヶ月ごとに作成しております。
３．当ファンドは、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、2018年10月25日から2019年4月24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。

１【財務諸表】

【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】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前　期 2018年10月24日現在	当　期 2019年4月24日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	87,613,687	-
コール・ローン	-	93,357,434
投資信託受益証券	1,529,217,903	1,394,640,083
親投資信託受益証券	16,493,768	14,705,170
未収入金	1,000,000	-
流動資産合計	1,634,325,358	1,502,702,687
資産合計	1,634,325,358	1,502,702,687
負債の部		
流動負債		
未払金	-	8,620,000
未払収益分配金	19,224,886	18,352,099
未払解約金	3,210,539	1,723,071
未払受託者報酬	43,944	39,184
未払委託者報酬	1,318,285	1,175,494
未払利息	-	266
その他未払費用	3,910	2,768
流動負債合計	23,801,564	29,912,882
負債合計	23,801,564	29,912,882
純資産の部		
元本等		
元本	5,492,824,790	5,243,456,964
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△3,882,300,996	△3,770,667,159
元本等合計	1,610,523,794	1,472,789,805
純資産合計	1,610,523,794	1,472,789,805
負債純資産合計	1,634,325,358	1,502,702,687

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前　期 自　2018年4月25日 至　2018年10月24日	当　期 自　2018年10月25日 至　2019年4月24日
営業収益		

	前　期 自　2018年4月25日 至　2018年10月24日	当　期 自　2018年10月25日 至　2019年4月24日
受取配当金	246,468,181	244,737,405
有価証券売買等損益	△244,482,386	△192,676,418
営業収益合計	1,985,795	52,060,987
営業費用		
支払利息	32,425	20,251
受託者報酬	299,674	242,312
委託者報酬	8,991,333	7,269,221
その他費用	29,527	32,787
営業費用合計	9,352,959	7,564,571
営業利益又は営業損失（△）	△7,367,164	44,496,416
経常利益又は経常損失（△）	△7,367,164	44,496,416
当期純利益又は当期純損失（△）	△7,367,164	44,496,416
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	1,200,501	1,893,603
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△4,200,941,537	△3,882,300,996
剰余金増加額又は欠損金減少額	621,471,146	334,725,053
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	621,471,146	334,725,053
剰余金減少額又は欠損金増加額	157,193,964	153,588,077
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	157,193,964	153,588,077
分配金	137,068,976	112,105,952
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△3,882,300,996	△3,770,667,159

（３）【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	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	前期 2018年10月24日現在	当期 2019年4月24日現在
１．　受益権の総数	5,492,824,790口	5,243,456,964口
２．　元本の欠損	3,882,300,996円	3,770,667,159円
３．　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　0.2932円 （1万口当たり純資産額）　(2,932円)	1口当たり純資産額　0.2809円 （1万口当たり純資産額）　(2,809円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	前　期 自　2018年4月25日 至　2018年10月24日	当　期 自　2018年10月25日 至　2019年4月24日
1．分配金の計算過程	（自2018年4月25日　至2018年5月24日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（40,165,554円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,571,494,343円）及び分配準備積立金（96,233,912円）より分配対象収益は1,707,893,809円（1万口当たり2,800.41円）であり、うち36,592,389円（1万口当たり60円）を分配金額としております。 （自2018年5月25日　至2018年6月25日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（39,959,998円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,549,830,870円）及び分配準備積立金（97,585,446円）より分配対象収益は1,687,376,314円（1万口当たり2,807.21円）であり、うち21,038,041円（1万口当たり35円）を分配金額としております。 （自2018年6月26日　至2018年7月24日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（39,706,246円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,509,608,043円）及び分配準備積立金（113,004,671円）より分配対象収益は1,662,318,960円（1万口当たり2,840.34円）であり、うち20,483,907円（1万口当たり35円）を分配金額としております。 （自2018年7月25日　至2018年8月24日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（38,836,122円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,480,012,705円）及び分配準備積立金（128,904,772円）より分配対象収益は1,647,753,599円（1万口当たり2,873.34円）であり、うち20,071,194円（1万口当たり35円）を分配金額としております。	（自2018年10月25日　至2018年11月26日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（38,501,294円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,411,344,024円）及び分配準備積立金（175,771,642円）より分配対象収益は1,625,616,960円（1万口当たり2,977.98円）であり、うち19,105,703円（1万口当たり35円）を分配金額としております。 （自2018年11月27日　至2018年12月25日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（38,677,330円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,392,425,124円）及び分配準備積立金（191,349,431円）より分配対象収益は1,622,451,885円（1万口当たり3,015.06円）であり、うち18,833,955円（1万口当たり35円）を分配金額としております。 （自2018年12月26日　至2019年1月24日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（40,005,302円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,389,194,710円）及び分配準備積立金（209,183,784円）より分配対象収益は1,638,383,796円（1万口当たり3,054.77円）であり、うち18,771,705円（1万口当たり35円）を分配金額としております。 （自2019年1月25日　至2019年2月25日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（40,362,809円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,376,957,073円）及び分配準備積立金（226,882,412円）より分配対象収益は1,644,202,294円（1万口当たり3,095.92円）であり、うち18,587,998円（1万口当たり35円）を分配金額としております。

項目	前　期 自　2018年4月25日 至　2018年10月24日	当　期 自　2018年10月25日 至　2019年4月24日
	（自2018年8月25日　至2018年9月25日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（38,470,420円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,450,320,265円）及び分配準備積立金（144,036,706円）より分配対象収益は1,632,827,391円（1万口当たり2,907.08円）であり、うち19,658,559円（1万口当たり35円）を分配金額としております。 （自2018年9月26日　至2018年10月24日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（38,444,712円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,419,121,962円）及び分配準備積立金（158,597,172円）より分配対象収益は1,616,163,846円（1万口当たり2,942.31円）であり、うち19,224,886円（1万口当たり35円）を分配金額としております。	（自2019年2月26日　至2019年3月25日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（39,943,088円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,368,483,617円）及び分配準備積立金（245,522,674円）より分配対象収益は1,653,949,379円（1万口当たり3,136.79円）であり、うち18,454,492円（1万口当たり35円）を分配金額としております。 （自2019年3月26日　至2019年4月24日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（40,820,385円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,363,698,013円）及び分配準備積立金（262,935,428円）より分配対象収益は1,667,453,826円（1万口当たり3,180.06円）であり、うち18,352,099円（1万口当たり35円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	前　期 自　2018年4月25日 至　2018年10月24日	当　期 自　2018年10月25日 至　2019年4月24日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	（1）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。 （2）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左

項目	前　期 自　2018年4月25日 至　2018年10月24日	当　期 自　2018年10月25日 至　2019年4月24日
3．金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
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

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

項目	前　期 2018年10月24日現在	当　期 2019年4月24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	前　期 2018年10月24日現在	当　期 2019年4月24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

（関連当事者との取引に関する注記）

前　期 2018年10月24日現在	当　期 2019年4月24日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	前　期 自　2018年4月25日 至　2018年10月24日	当　期 自　2018年10月25日 至　2019年4月24日
期首元本額	6,166,935,093円	5,492,824,790円
期中追加設定元本額	229,168,286円	212,121,214円
期中一部解約元本額	903,278,589円	461,489,040円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	前　期 2018年10月24日現在	当　期 2019年4月24日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）
投資信託受益証券	△124,574,725	29,163,218
親投資信託受益証券	11,709	△44,013
合計	△124,563,016	29,119,205

（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。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2019年4月24日現在

種　類	銘　柄	券面総額	評価額（円）	備考
投資信託受益証券	ＴＣＷ　ＨｉｇｈＩｎｃｏｍｅ　ＵＳ　ＥＱ　Ｐｒｅ　ＣｕＳｅＰ	838,125	1,394,640,083	
投資信託受益証券　合計		838,125	1,394,640,083	
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	10,180,111	14,705,170	
親投資信託受益証券　合計		10,180,111	14,705,170	
合計			1,409,345,253	

（注）投資信託受益証券及び親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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。

損保ジャパン日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2018年10月24日現在	2019年4月24日現在
科　　目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	80,481,641	-
コール・ローン	-	437,819,037
国債証券	10,294,215,900	11,295,301,300
特殊債券	503,210,490	484,396,428
社債券	5,277,873,600	4,459,639,800
未収入金	100,546,500	-

	2018年10月24日現在	2019年4月24日現在
科　　目	金額（円）	金額（円）
未収利息	18,477,148	19,478,496
前払費用	1,150,776	1,748,312
流動資産合計	16,275,956,055	16,698,383,373
資産合計	16,275,956,055	16,698,383,373
負債の部		
流動負債		
未払金	100,000,000	-
未払利息	-	1,247
その他未払費用	1,354	1,201
流動負債合計	100,001,354	2,448
負債合計	100,001,354	2,448
純資産の部		
元本等		
元本	11,484,664,512	11,559,953,243
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	4,691,290,189	5,138,427,682
元本等合計	16,175,954,701	16,698,380,925
純資産合計	16,175,954,701	16,698,380,925
負債純資産合計	16,275,956,055	16,698,383,373

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、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、以下のとおり、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 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。
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。

（貸借対照表に関する注記）

期別	2018年10月24日現在		2019年4月24日現在	
1．　受益権の総数		11,484,664,512口		11,559,953,243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	1.4085円	1口当たり純資産額	1.4445円
	（1万口当たり純資産額）	(14,085円)	（1万口当たり純資産額）	(14,445円)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	自　2018年4月25日 至　2018年10月24日	自　2018年10月25日 至　2019年4月24日
１．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
２．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	（１）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。 （２）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左
３．金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
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

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

項目	2018年10月24日現在	2019年4月24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

（関連当事者との取引に関する注記）

2018年10月24日現在	2019年4月24日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	自　2018年4月25日 至　2018年10月24日	自　2018年10月25日 至　2019年4月24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	11,072,105,428円	11,484,664,512円
同期中追加設定元本額	1,095,849,349円	1,104,549,737円
同期中一部解約元本額	683,290,265円	1,029,261,006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）	250,182円	101,083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）	842,819円	686,855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）	1,235,089円	1,608,976円
ＳＮＡＭ絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用）	238,295,682円	313,583,584円
損保ジャパン日本債券ファンド	1,025,675,831円	1,056,151,495円
ハッピーエイジング２０	149,869,916円	145,149,246円

項目	自　2018年4月25日 至　2018年10月24日	自　2018年10月25日 至　2019年4月24日
ハッピーエイジング３０	724,673,415円	706,402,676円
ハッピーエイジング４０	3,739,902,841円	3,648,686,356円
ハッピーエイジング５０	2,900,348,747円	2,921,879,492円
ハッピーエイジング６０	2,216,075,972円	2,243,414,163円
パン・アフリカ株式ファンド	15,650,501円	15,438,094円
好配当グローバルＲＥＩＴプレミアム・ファンド　円ヘッジありコース	2,242,413円	1,688,418円
好配当グローバルＲＥＩＴプレミアム・ファンド　円ヘッジなしコース	16,670,581円	14,992,193円
好配当グローバルＲＥＩＴプレミアム・ファンド　通貨セレクトコース	264,579,757円	244,681,008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	11,710,166円	10,180,111円
ＳＯＭＰＯターゲットイヤー・ファンド２０３５	21,578,510円	52,915,706円
ＳＯＭＰＯターゲットイヤー・ファンド２０４５	9,453,521円	18,402,792円
ＳＯＭＰＯターゲットイヤー・ファンド２０５５	2,153,106円	4,956,936円
ターゲット・リターン戦略ファンド	143,455,463円	159,034,059円
計	11,484,664,512円	11,559,953,243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）

売買目的有価証券

種類	2018年10月24日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	2019年4月24日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△131,055,600	189,060,700
特殊債券	△2,657,220	147,254
社債券	△18,222,140	△16,666,640
合計	△151,934,960	172,541,314

（注）「当計算期間」とは、当該親投資信託の計算期間の開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間を指しております。

（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。

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2019年4月24日現在

種　類	銘　柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	第３９８回利付国債（２年）	60,000,000	60,283,200	
	第１３８回利付国債（５年）	380,000,000	384,632,200	
	第１０回利付国債（４０年）	70,000,000	76,959,400	
	第１１回利付国債（４０年）	180,000,000	191,655,000	
	第３３５回利付国債（１０年）	300,000,000	310,794,000	
	第３４２回利付国債（１０年）	160,000,000	162,844,800	
	第３４４回利付国債（１０年）	250,000,000	254,680,000	
	第３４５回利付国債（１０年）	440,000,000	448,342,400	
	第３４７回利付国債（１０年）	920,000,000	937,047,600	
	第３４９回利付国債（１０年）	460,000,000	468,234,000	
	第３５０回利付国債（１０年）	1,020,000,000	1,037,850,000	
	第３５３回利付国債（１０年）	510,000,000	517,670,400	
	第３５回利付国債（３０年）	210,000,000	280,242,900	
	第３８回利付国債（３０年）	580,000,000	756,314,200	
	第４３回利付国債（３０年）	130,000,000	167,856,000	
	第５３回利付国債（３０年）	100,000,000	102,181,000	
	第５７回利付国債（３０年）	210,000,000	224,943,600	
	第５８回利付国債（３０年）	170,000,000	181,959,500	
	第６０回利付国債（３０年）	160,000,000	175,283,200	
	第６１回利付国債（３０年）	210,000,000	218,586,900	
	第１１３回利付国債（２０年）	180,000,000	219,789,000	
	第１３０回利付国債（２０年）	190,000,000	230,709,400	
	第１３１回利付国債（２０年）	80,000,000	96,155,200	
	第１４４回利付国債（２０年）	110,000,000	130,755,900	
	第１４６回利付国債（２０年）	210,000,000	256,258,800	
	第１４８回利付国債（２０年）	250,000,000	298,755,000	
	第１４９回利付国債（２０年）	110,000,000	131,611,700	
	第１５０回利付国債（２０年）	710,000,000	839,837,700	
	第１５４回利付国債（２０年）	520,000,000	600,688,400	
	第１５７回利付国債（２０年）	80,000,000	79,146,400	
	第１５８回利付国債（２０年）	600,000,000	622,938,000	
	第１６２回利付国債（２０年）	250,000,000	262,622,500	
	第１６６回利付国債（２０年）	420,000,000	447,115,200	
	第１６７回利付国債（２０年）	20,000,000	20,513,800	

	第２１回メキシコ合衆国円貨債券（２０１６）	100,000,000	100,044,000	
国債証券　合計		10,350,000,000	11,295,301,300	
特殊債券	第６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,416,000	41,695,558	
	第１７回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,760,000	13,075,682	
	第３１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,084,000	15,645,124	
	第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,768,000	31,357,313	
	第４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,874,000	36,130,685	
	第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,386,000	36,577,075	
	第５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,290,000	42,750,913	
	第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,289,000	52,180,292	
	第６５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,917,000	56,619,320	
	第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,127,000	57,300,466	
	第１０９回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,064,000	
特殊債券　合計		464,911,000	484,396,428	
社債券	第１回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債（劣後特約付	100,000,000	104,420,000	
	第７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債（２０１４）	100,000,000	100,100,000	
	第１回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（劣後特約付）	100,000,000	105,086,000	
	第１８回ルノー円貨社債（２０１６）	100,000,000	99,874,000	
	第２３回前田建設工業株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	99,749,000	
	第１回積水ハウス株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保	100,000,000	101,545,000	
	第１回パーソルホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定	100,000,000	99,985,000	
	第２回ユニゾホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定同	100,000,000	99,718,000	
	第３０回東レ株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	200,000,000	200,720,000	
	第２１回大王製紙株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,012,000	
	第１回大陽日酸株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	100,000,000	101,704,000	
	第２９回富士電機株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約	100,000,000	100,282,000	
	第１回日本生命第１回劣後ローン流動化株式会社利払繰延条項・期	100,000,000	100,580,000	
	第１回日本生命第２回劣後ローン流動化株式会社利払繰延条項・期	100,000,000	100,555,000	
	第１回ドンキホーテホールディングス無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	100,360,000	
	第２８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,476,000	
	第６回三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,544,000	
	第７回三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,675,000	

	第６９回アコム株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,729,000	
	第７１回アコム株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,402,000	
	第８回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債（社債間限	100,000,000	99,918,000	
	第１１回京阪神ビルディング株式会社無担保社債（社債間限定同順	100,000,000	101,180,000	
	第３回日本航空株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,147,000	
	第５４７回東京電力株式会社社債（一般担保付）	120,000,000	122,536,800	
	第５５９回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,610,000	
	第５６３回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,264,000	
	第５６５回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,248,000	
	第５６６回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,223,000	
	第５６８回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	202,452,000	
	第１回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	200,274,000	
	第２回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,353,000	
	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	199,492,000	
	第１４回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,585,000	
	第１回Ａ号日本生命劣後ＦＲ	100,000,000	103,840,000	
	第３回Ａ号富国生命劣後ＦＲ	200,000,000	199,040,000	
	第３回Ａ号明治安田生命劣後ＦＲ	200,000,000	201,968,000	
	第２回Ａ号住友生命劣後ＦＲ	100,000,000	100,279,000	
	第５回株式会社ファーストリテイリング無担保社債（特定社債間限	100,000,000	99,714,000	
社債券　合計		4,420,000,000	4,459,639,800	
合計			16,239,337,528	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

The TCW Funds － TCW High Income US Equity Premium Fund

貸借対照表

	2018年3月31日現在 アメリカドル
資産	
現金	1,121,617
売買目的の金融資産	17,623,921
先物為替予約取引に係る未実現利益	69,642
未収配当金	10,923
資産合計	18,826,103
負債	
オプション取引（公正価値）	253,348
先物為替予約取引に係る未実現損失	94,604
未払管理報酬	48,723
未払助言報酬	39,987
未払専門家報酬	15,090
未払保管報酬	11,322
その他未払費用	13,829
負債合計	476,903
償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産	18,349,200
クラス当たりの純資産額（アメリカドル）：	
通貨 セレクト シェア クラス	739,946
通貨セレクト プレミアム シェア クラス	17,609,254
発行済み口数（口）：	
通貨セレクト シェア クラス	24,389
通貨セレクト プレミアム シェア クラス	844,992
1口当たりの純資産額（アメリカドル）：	
通貨セレクト シェア クラス	30.34
通貨セレクト プレミアム シェア クラス	20.84

■組入資産の明細

数量	普通株式	2018年3月31日現在 評価金額 （アメリカドル）
	アメリカ	
	Applicaitions Software (純資産比率 5.1%)	
10,300	Microsoft Corp	
		940,081
	Banks (7.2%)	
13,200	US Bancorp	666,600
12,500	Wells Fargo & Co	655,125
	Total Banks	1,321,725

	Computers (11.7%)	
4,600	Apple Inc	771,788
4,750	International Business Machines Corp	728,793
10,400	NetApp Inc	641,576
	Total Computers	2,142,157
	Electric (4.5%)	
5,050	NextEra Energy Inc	824,817
	Healthcare-Services (2.8%)	
2,400	UnitedHealth Group Inc	513,600
	Home Builders (11.3%)	
18,200	DR Horton Inc	797,888
200	NVR Inc	560,000
16,700	Toll Brothers Inc	722,275
	Total Home Builders	2,080,163
	Insurance (4.9%)	
6,600	Chubb Ltd	902,682
	Investment Companies (4.1%)	
47,300	Ares Capital Corp	750,651
	Machinery-Construction & Mining (3.0%)	
3,700	Caterpillar Inc	545,306
	Machinery-Diversified (2.7%)	
6,400	Xylem Inc/NY	492,288
	Media (3.8%)	
10,500	Nexstar Media Group Inc	698,250

数量	普通株式	評価金額 （アメリカドル）
	アメリカ（続き）	
	Miscellaneous Manufacturing (3.0%)	
7,000	EnPro Industries Inc	
		541,660
	Oil&Gas (5.6%)	
17,300	ConocoPhillips	1,025,717
	Pharmaceuticals (6.1%)	
3,800	AbbVie Inc	359,670
21,400	Pfizer Inc	759,486
	Total Pharmaceuticals	1,119,156
	Semiconductors (7.8%)	
3,200	Broadcom Ltd	754,080
13,000	Intel Corp	677,040
	Total Semiconductors	1,431,120
	Telecommunications (3.8%)	
14,700	Verizon Communications Inc	702,954
	アメリカ合計	16,032,327

	普通株式合計	16,032,327
	Real Estate Investment Trusts (8.7%)	
	アメリカ	
5,600	American Tower Corp	813,904
45,000	Colony NorthStar Inc	252,900
3,400	Simon Property Group Inc	524,790
	アメリカ合計	1,591,594
	Total Real Estate Investment Trusts	1,591,594
	売買目的の金融資産合計（取得金額：17,771,127アメリカドル）（96.1%）	17,623,921

数量	オプション	公正価値（アメリカドル）
	株式オプション（-1.0%）	
3,800	Abbvie Inc.	(456)
3,900	American Tower Corp.	(5,753)
3,300	Apple Inc.	(941)
3,000	Caterpillar Inc.	(1,485)
5,600	Chubb Ltd.	(3,500)
12,100	Conocophillips	(56,265)
12,700	Dr Horton Inc.	(15,177)
9,100	Intel Corp.	(13,514)
6,600	International Business Machines Corp.	(4,317)
8,000	Microsoft Corp.	(3,880)
7,300	Netapp Inc.	(7,337)
7,400	Nexstar Media Group Inc.	(6,105)
4,500	Nextera Energy Inc.	(24,075)
15,000	Pfizer Inc.	(2,175)
2,700	Simon Property Group Inc.	(2,822)
11,700	Toll Brothers Inc.	(6,143)
1,700	Unitedhealth Group Inc.	(9,775)
9,900	Us Bancorp	(2,228)
11,000	Verizon Communications Inc.	(3,300)
10,000	Wells Fargo & Co.	(2,900)
	株式オプション合計（-1.0%）	(172,148)
	通貨オプション（-0.4%）	
3,454,019	USD Put IDR Call @ 13,616 OTC Opt	(6,217)
3,455,612	USD Put MXN Call @ 18.41 OTC Opt	(58,054)
3,466,676	USD Put BRL Call @ 3.23 OTC Opt	(9,360)
3,429,820	USD Put INR Call @ 64.61 OTC Opt	(4,802)
3,458,647	USD Put PHP Call @ 51.44 OTC Opt	(2,767)
	通貨オプション合計（-0.4%）	(81,200)

オプション取引合計（取得金額：-235,326アメリカドル）（-1.4%）	(253,348)
投資合計（取得金額：17,535,801アメリカドル）（94.7%）	17,370,573
その他負債超過資産（5.3%）	978,627
純資産（100.0%）	18,349,200

（注１）ＴＣＷ アセット マネジメント カンパニーからのデータ提供を受けて作成しております。
（注２）作成時点において、入手可能な直近計算期間の財務諸表を用いております。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

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

2019年4月26日現在

Ⅰ　資産総額	1,461,846,240円
Ⅱ　負債総額	8,973,243円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,452,872,997円
Ⅳ　発行済数量	5,238,248,072口
Ⅴ　1単位当りの純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.2774円

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2019年4月26日現在

Ⅰ　資産総額	16,777,246,582円
Ⅱ　負債総額	1,201円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	16,777,245,381円
Ⅳ　発行済数量	11,611,173,095口
Ⅴ　1単位当りの純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4449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（2018年10月末現在）

(略)

（２）会社の機構（2018年10月末現在）

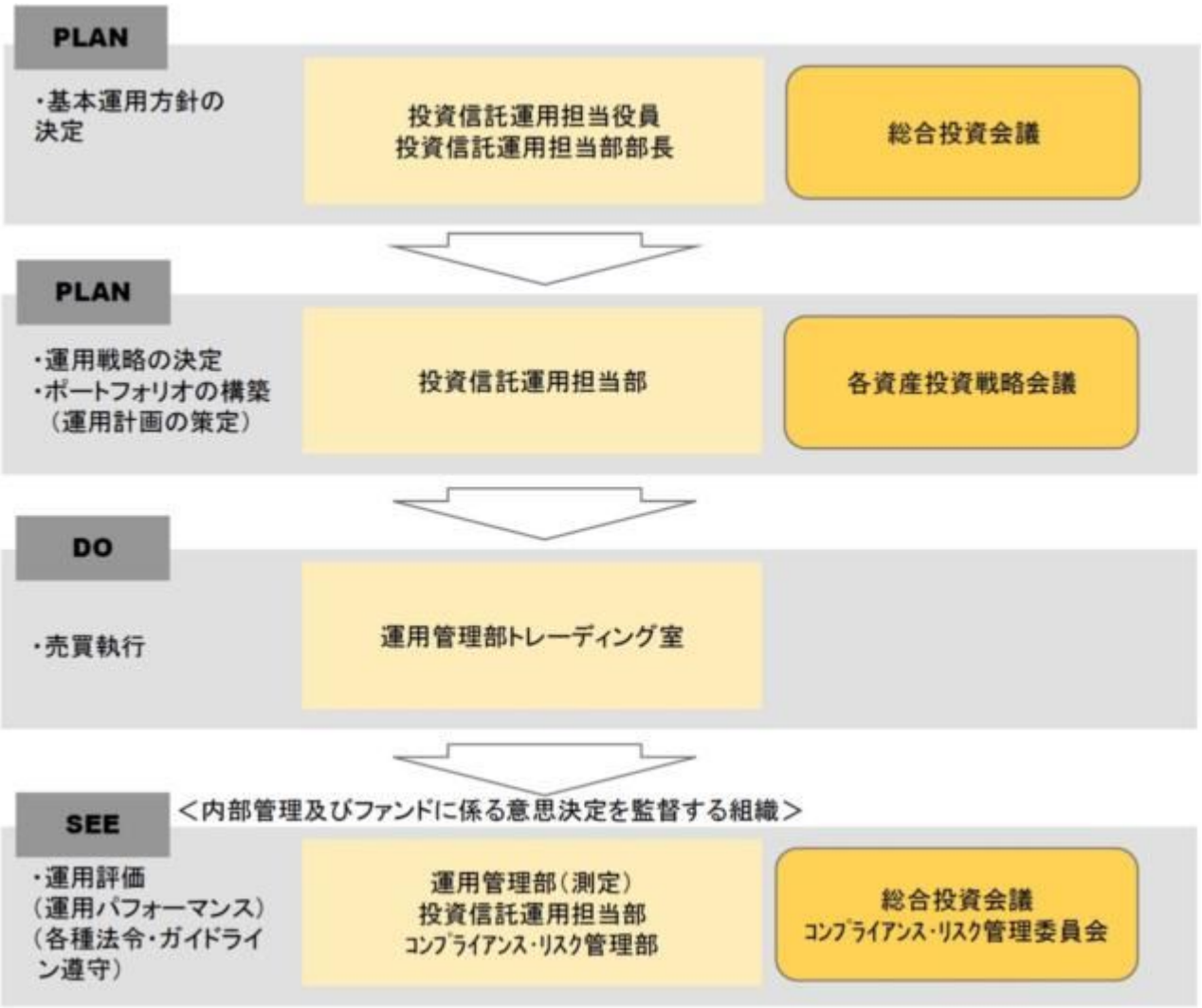
(略)

② 投資運用の意思決定機構

(略)

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

(略)



＜訂正後＞

（１）資本金の額（2019年4月末現在）

(略)

（２）会社の機構（2019年4月末現在）

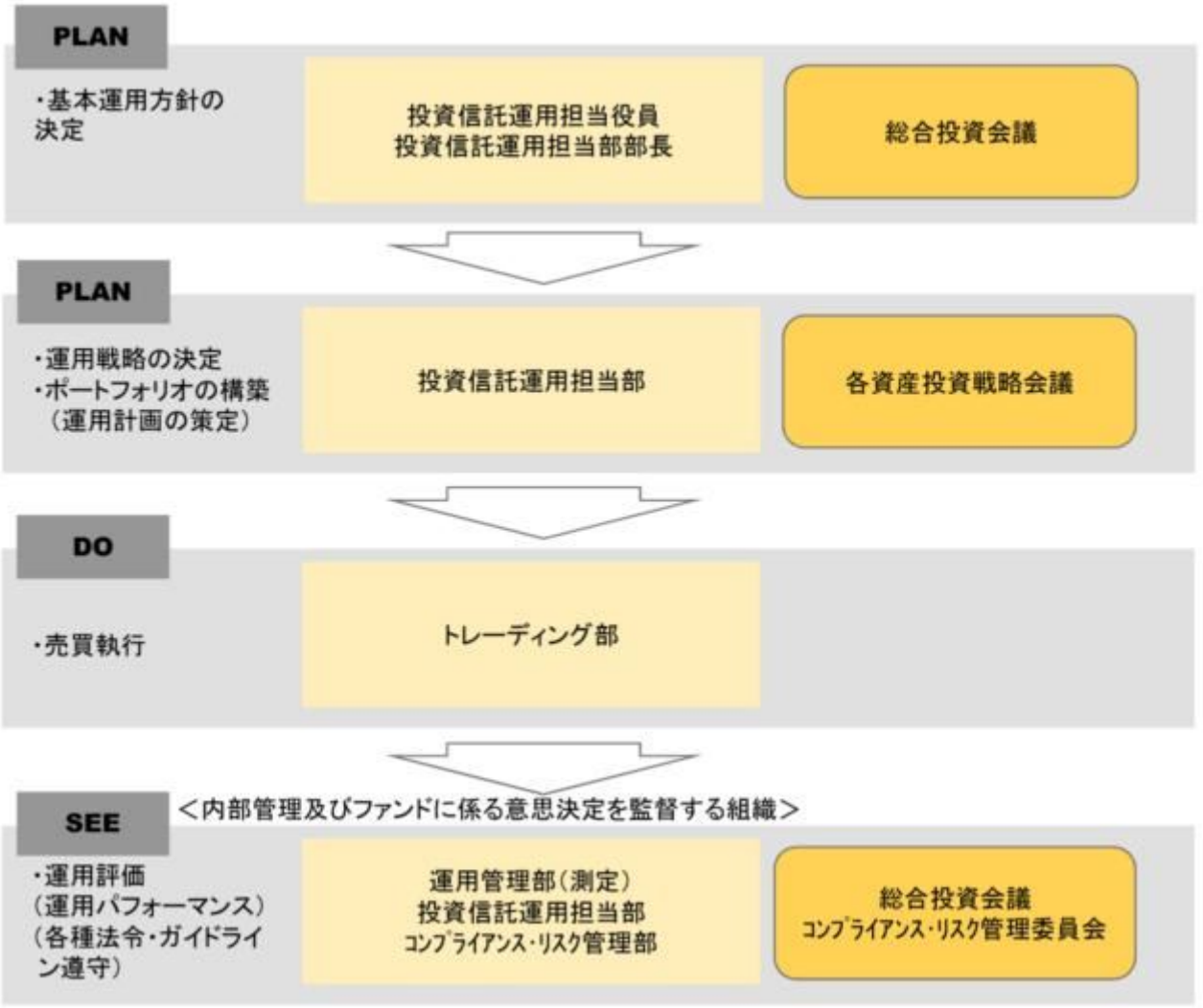
(略)

② 投資運用の意思決定機構

(略)

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

(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2019年4月末現在、計173本（追加型株式投資信託128本、単位型株式投資信託11本、単位型公社債投資信託34本）であり、その純資産総額の合計は763,726百万円です。

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。

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。

（１）【貸借対照表】

		前事業年度 （2018年3月31日）		当事業年度 （2019年3月31日）	
区分	注記番号	金額（千円）		金額（千円）	
（資産の部）					
Ⅰ　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
Ⅱ　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

		前事業年度 （2018年3月31日）		当事業年度 （2019年3月31日）	
区分	注記番号	金額（千円）		金額（千円）	
（負債の部）					
Ⅰ　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
Ⅱ　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）					
Ⅰ　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
Ⅱ　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】

		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）	
区分	注記番号	金額（千円）		金額（千円）	
Ⅰ　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
Ⅱ　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
Ⅲ　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
Ⅳ　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
Ⅴ　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
Ⅵ　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					
		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	3,035,695	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					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
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 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			
その他有価証券	50,620	50,620	－
資産計	6,946,838	6,946,838	－
（1）未払費用	1,106,809	1,106,809	－
負債計	1,106,809	1,106,809	－

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			
その他有価証券	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 その他有価 証券」には含めておりません。

注３．金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（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。

５【その他】

＜訂正前＞

（１） 定款の変更
定款の変更に関しては、株主総会の特別決議が必要です。

（２） 訴訟事件その他の重要事項
委託会社及び当ファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

＜訂正後＞

（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ＳＯＭＰＯアセットマネジメント株式会社に変更する予定です。

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】

＜訂正前＞

（１）受託会社
(略)
② 資本金の額
247,369百万円（2018年3月末現在）

(略)
＜再信託受託会社の概要＞
名称　　：資産管理サービス信託銀行株式会社
資本金の額　　：50,000百万円（2018年3月末現在）
(略)

（２）販売会社

名　称	資本金の額※ （単位：百万円）	事業の内容
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	「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。
カブドットコム証券株式会社	7,196	
立花証券株式会社	6,695	
フィデリティ証券株式会社	8,557	
マネックス証券株式会社	12,200	
楽天証券株式会社	7,495	

※資本金の額は、2018年3月末現在

＜訂正後＞

（１）受託会社
(略)

② 資本金の額

247,369百万円（2019年3月末現在）

(略)

＜再信託受託会社の概要＞

名称　　：資産管理サービス信託銀行株式会社

資本金の額　　：50,000百万円（2019年3月末現在）

(略)

（２）販売会社

名　称	資本金の額※1（単位：百万円）	事業の内容
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	「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。
カブドットコム証券株式会社	7,196	
立花証券株式会社	6,695	
フィデリティ証券株式会社	9,257※2	
マネックス証券株式会社	12,200	
楽天証券株式会社	7,495	

※1資本金の額は、2019年3月末現在

※2フィデリティ証券株式会社の資本金の額は、2019年1月23日現在

独立監査人の監査報告書

２０１９年６月２０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

指定有限責任社員業務執行社員　公認会計士　蒲谷　剛史

指定有限責任社員業務執行社員　公認会計士　伊藤　志保

　当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている好配当米国株式プレミアム・ファンド　通貨セレクト・プレミアムコースの２０１８年１０月２５日から２０１９年４月２４日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表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、好配当米国株式プレミアム・ファンド　通貨セレクト・プレミアムコースの２０１９年４月２４日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益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
　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、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
業務執行社員　公認会計士 蒲　谷　剛　史

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士 伊　藤　志　保

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社の経理の状況」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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。