

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年 9 月16日提出
【発行者名】	損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 山口 裕之
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋二丁目 2 番16号
【事務連絡者氏名】	生稲 博美
【電話番号】	03-5290-3429
【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】	好配当グローバルR E I T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 1 兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成28年3月17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】

原届出書の該当情報を以下の内容に訂正します。

下線部_____は訂正内容を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの特色>

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

ファンドの目的

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。

ファンドの特色



日本を含む世界各国の取引所に上場されている相対的に利回りが高いと判断されるREIT（リート、不動産投資信託証券）及び不動産関連の株式等を実質的な主要投資対象とし、相対的に高い配当収入等の確保と信託財産の成長を図ることを目指します。

● ファンド・オブ・ファンズ方式で運用します。

・ 当ファンドは、「UBP オポチュニティーズ TCW グローバル リート プレミアム エンハンスト ファンド^{※1}」および「損保ジャパン日本債券マザーファンド」を主要投資対象とします。

・ 原則として、「UBP オポチュニティーズ TCW グローバル リート プレミアム エンハンスト ファンド^{※1}」への投資比率を高位に保ちます。

※1 「UBP オポチュニティーズ TCW グローバル リート プレミアム」ということがあります。

※ 当ファンドが主要投資対象とする投資信託証券の正式名称及び概要については後掲「主要投資対象の投資信託証券の概要」をご覧ください。また、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。



「REITプレミアム(カバードコール)戦略」の活用により、オプションのプレミアム収入の獲得を目指しながら、ファンドのトータルリターンの上昇を目指します。

● 「REITプレミアム(カバードコール)戦略」とは、投資したリート等の個別銘柄毎に、保有口数(または保有株数)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により、トータルリターンの上昇を目指す戦略です。

・ 相対的に高いプレミアム収入の獲得が期待できる反面、リート等の価格が上昇し、権利行使された場合には、値上がり益を一部または全部放棄することになります。

・ カバードコールのカバー率(保有銘柄に対するコールオプションのポジション)はアクティブに変更を行い、高いプレミアム収入とともに保有銘柄の値上がり益の獲得も同時に目指します。なお、資産規模等で当該運用が困難な場合は、不動産投資信託指数に連動する上場投資信託(ETF)の投資信託証券を通じたカバードコール戦略を活用することがあります。

・ オプションのプレミアム収入とは、オプションを売却した対価として受け取る権利料のことを指します。



原則、相対的に流動性、金利水準が高い通貨^{※1}を選択し、当該通貨を通じた為替取引を行う「通貨セレクト戦略」を活用し、プレミアム収入(金利差相当分の収益)の獲得を目指します。

※1 セレクト通貨といいます。

● 「通貨セレクト戦略」とは、原資産通貨売り/セレクト通貨買いの為替取引を行う戦略です。

● 3〜6程度の通貨を選定します。相場状況によっては選択数が3〜6通貨以外になることがあります。

・ セレクト通貨及び通貨数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。また、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。

● 直物為替先渡取引(NDF)^{※2}を利用する場合があります。

NDFの取引価格は、需給や対象通貨に対する期待等により、金利差から理論上期待される水準とは大きく異なる場合があります。この結果、基準価額の値動きは、実際の当該セレクト通貨の為替市場の値動きから想定されるものと大きく乖離する場合があります。

※2 直物為替先渡取引(NDF)とは、規制等がある通貨の為替取引を行う場合等に利用され、決済時に元本部分の受け渡しを行わずに、米ドルまたはその他の主要な通貨によって差金決済する取引をいいます。



「通貨オプション・プレミアム(カバードコール)戦略」の活用により、オプションのプレミアム収入の獲得を目指します。

- 「通貨オプション・プレミアム(カバードコール)戦略」とは、セレクト通貨毎に、保有金額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戦略です。
- 当戦略ではセレクト通貨にかかる対米ドルのコールオプションを売却します。
・相対的に高いプレミアム収入の獲得が期待できる反面、セレクト通貨が米ドルに対して上昇し、権利行使された場合には、値上がり益を一部または全部放棄することになります。



原則、毎月18日(休業日の場合は翌営業日)の決算時に収益の分配を行います。

- 分配対象収益が少額の場合は分配を行わないことがあります。

「カバードコール戦略」の＜主なメリット＞

- コールオプション売却によるオプションのプレミアム収入が獲得できるため、オプションのプレミアム収入分が上乗せされます。
- 保有銘柄(リート等)の価格下落時、またはセレクト通貨(対米ドル)の下落時において、コールオプション売却によるオプションのプレミアム収入があるために、カバードコール戦略をとらない投資戦略に比べて、オプションのプレミアム収入分は損失がカバーされます。

「カバードコール戦略」の＜主なデメリット＞

- 保有銘柄(リート等)の価格またはセレクト通貨(対米ドル)の為替レートが、権利行使価格を超えて推移し、コールオプションの買い手が権利行使を行った場合、保有銘柄または通貨を権利行使価格にて受渡す等の決済を行うため、権利行使価格を超えるリート等またはセレクト通貨(対米ドル)の値上がり益は享受できません。

＜コールオプションとは＞

- コールオプションとは、ある特定の資産を将来のある期日(権利行使期間満了日*)に、あらかじめ決められた特定の価格(権利行使価格)で買う権利のことです。コールオプションの買い手は、オプション買い付けの対価として、コールオプションの売り手にプレミアム(権利料)を支払います。
- コールオプションの買い手は、権利行使価格を超えて当該資産の市場価格が上昇した場合、権利を行使すれば、当該資産を権利行使価格で手に入れることができ、権利行使価格と当該資産の市場価格の差が収益となります。一方コールオプションの売り手は、この場合、権利行使価格で買い手に当該資産を受渡す等の決済を行うために、権利行使価格と当該資産の市場価格との差が損失となります(コールオプション売却に伴うプレミアム収入を除く)。逆に、権利行使価格を超えて当該資産の市場価格が上昇しなかった場合は、コールオプションの権利は行使されず、決済も行われないため、コールオプションの売り手にとって、コールオプション売却に伴うプレミアム収入が収益となります。

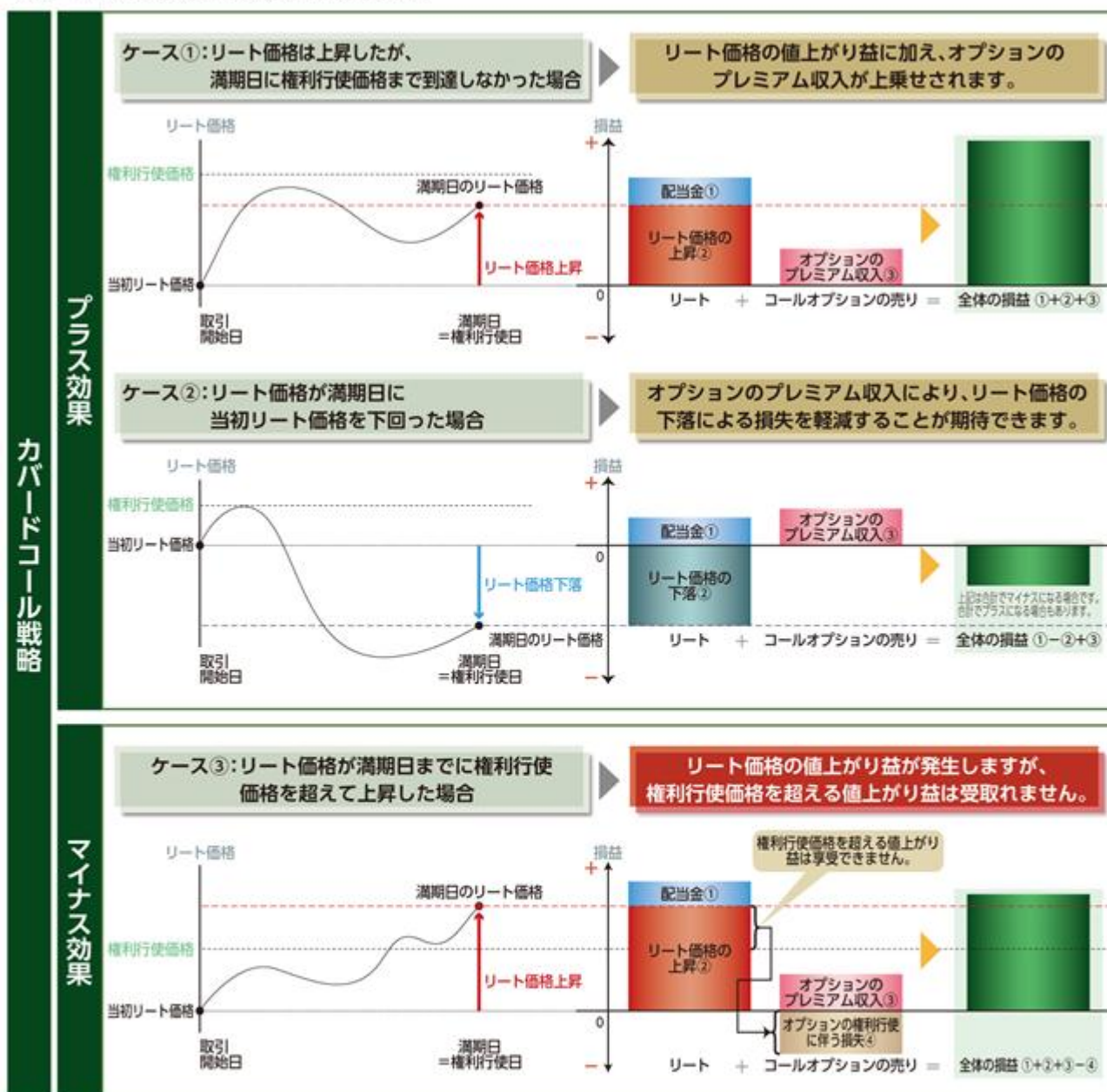
※ オプションには、満期日(権利行使日)に限り権利行使が可能なものと、満期日(権利行使日)までいつでも権利行使が可能なもの等があります。

ある特定の資産を保有し、当該資産のコールオプションを100%売却した場合の例です。当ファンドでは、保有資産の一部または全部にかかるコールオプションを売却します。また、各コールオプションの売却等は、市場環境等を考慮し、それぞれ異なるタイミングで行う場合があります。

上記はカバードコールに関する一般的な説明であり、全てを説明したものではありません。上記は当ファンドの損益を示したものではありません。また、将来の成果等をお約束するものではありません。

「リートポートフォリオ[®]」及び「REITプレミアム(カバードコール)戦略」の＜損益イメージ＞

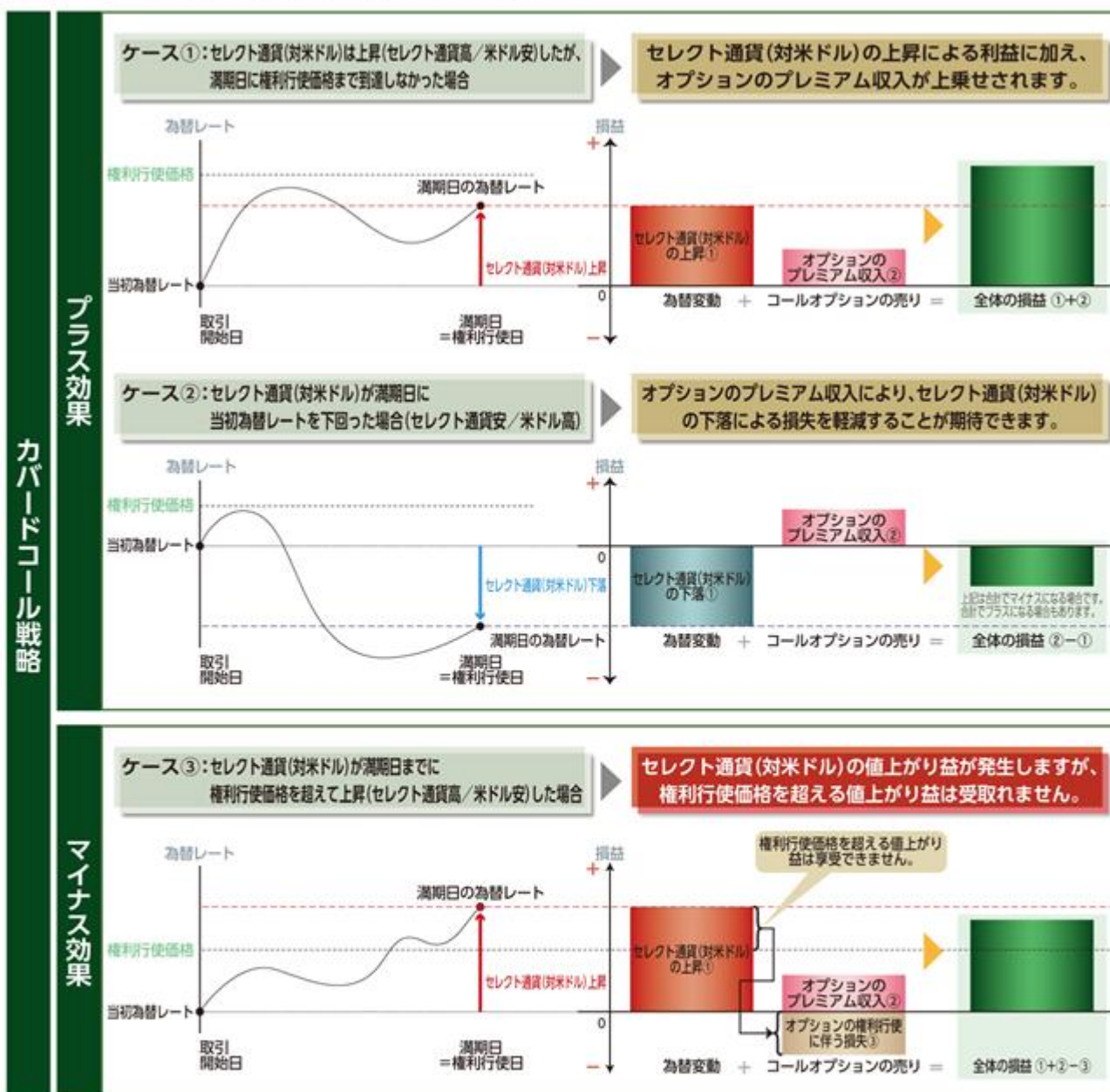
※リート等投資による価格変動、配当金を含みます。



- ・上記は為替変動、運用に係るコスト等は考慮していません。
- ・当ファンドにおける「リートポートフォリオ」及び「REITプレミアム(カバードコール)戦略」の損益は、対象となるリーツの銘柄毎に異なります。
- ・上記はリーツの配当金の支払いがあったことを前提として損益を表したものです。
- ・上記は、権利行使日に権利行使された場合のイメージ図を記載しておりますが、実際の運用においては権利行使日に必ず権利行使されるとは限りません。上記はコールオプションの全てを説明したものではありません。また、当てはまらない場合もあります。
- ・リート1銘柄を保有し、当該銘柄のコールオプションを100%売却した場合の例です。当ファンドでは、保有銘柄の一部または全部にかかるコールオプションを売却します。また、各コールオプションの売却等は、市場環境等を考慮し、それぞれ異なるタイミングで行う場合があります。
- ・オプションには、満期日(権利行使日)に限り権利行使が可能なものと、満期日(権利行使日)までいつでも権利行使が可能なもの等があります。上記では、満期日(権利行使日)に限り権利行使が可能なものを例に説明しています。
- ・上記は「リートポートフォリオ」及び「REITプレミアム(カバードコール)戦略」の損益について簡易的に説明するために用いたイメージ図であり、特定の資産、オプション等を示したものではありません。上記は当ファンドの損益を示したものではありません。また、将来の成果等をお約束するものではありません。

「通貨セレクト戦略※」及び「通貨オプション・プレミアム(カバードコール)戦略」の＜損益イメージ＞

※為替取引によるプレミアム(金利差相当分の収益)は考慮していません。



- ・上記は、運用に係るコスト等は考慮していません。
- ・当ファンドにおける「通貨セレクト戦略」及び「通貨オプション・プレミアム(カバードコール)戦略」の損益は、対象となる通貨毎に異なります。
- ・上記は、権利行使日に権利行使された場合のイメージ図を記載しておりますが、実際の運用においては権利行使日に必ず権利行使されるとは限りません。上記はコールオプションの全てを説明したものではありません。また、当てはまらない場合もあります。
- ・保有する通貨に対して、当該通貨のコールオプションを100%売却した場合の例です。当ファンドでは、保有通貨の一部または全部にかかるコールオプションを売却します。また、各コールオプションの売却等は、市場環境等を考慮し、それぞれ異なるタイミングで行う場合があります。
- ・オプションには、満期日(権利行使日)に限り権利行使が可能なものと、満期日(権利行使日)までいつでも権利行使が可能なもの等があります。上記では、満期日(権利行使日)に限り権利行使が可能なものを例に説明しています。
- ・上記は「通貨セレクト戦略」及び「通貨オプション・プレミアム(カバードコール)戦略」の損益について簡易的に説明するために用いたイメージ図であり、特定の資産、オプション等を示したものではありません。上記は当ファンドの損益を示したものではありません。また、将来の成果等をお約束するものではありません。
- ・当ファンドの「通貨オプション・プレミアム(カバードコール)戦略」は、米ドルに対して行います。

収益分配金に関する留意事項

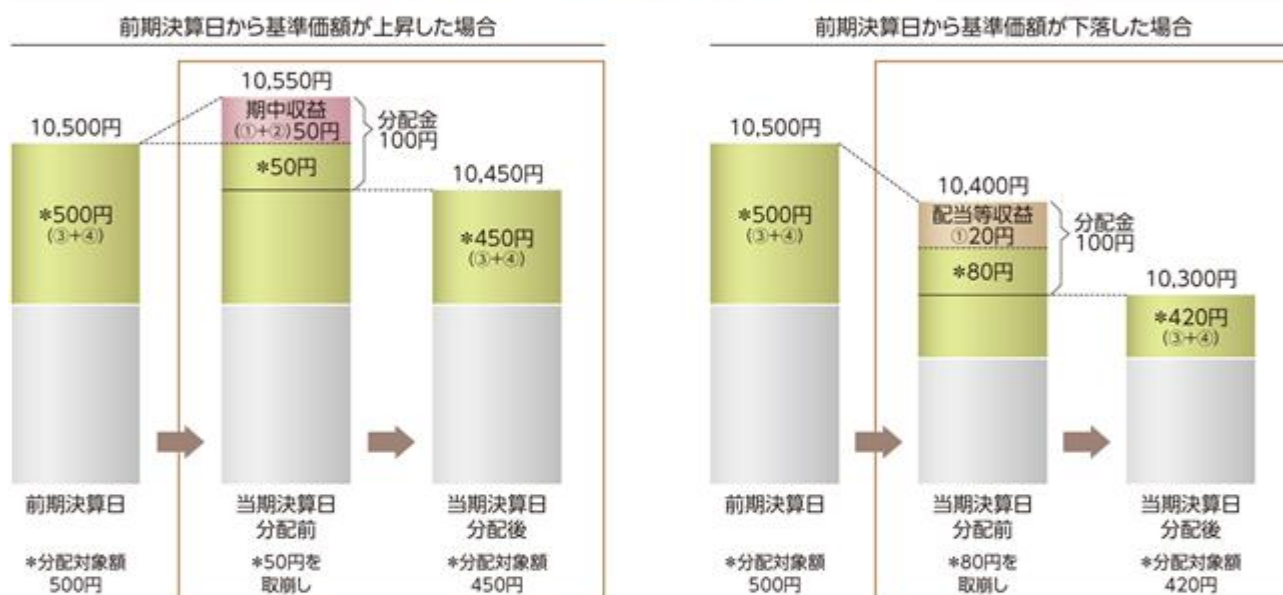
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が支払われるイメージ



- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

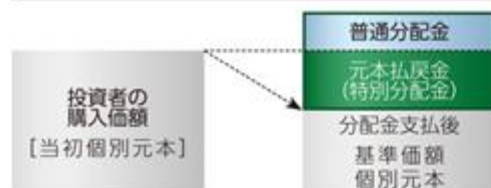


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



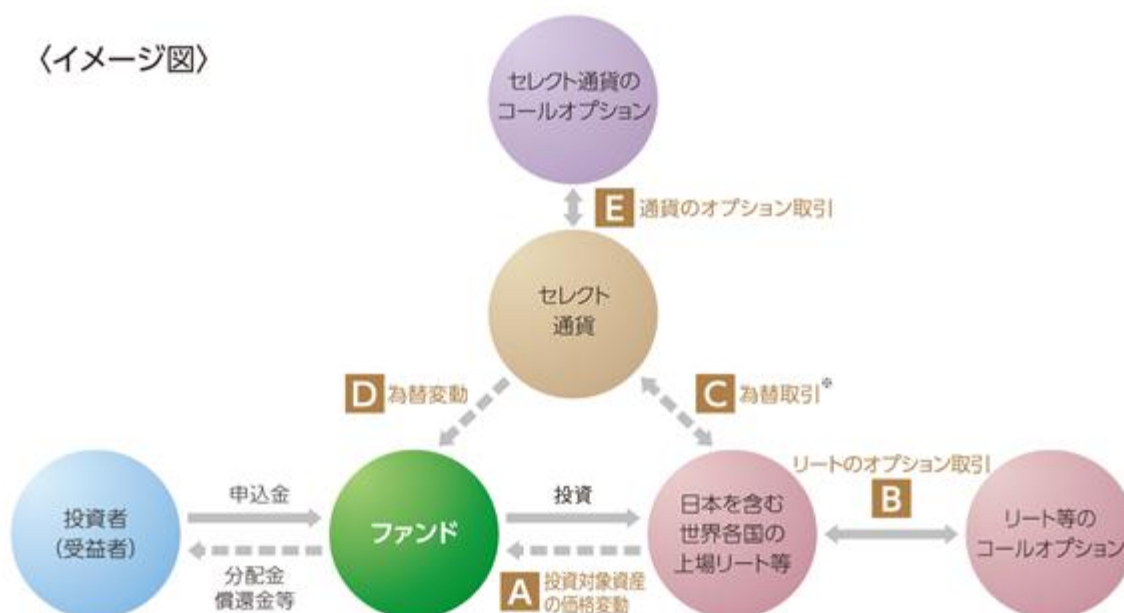
普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。(特別分配金)

当ファンド
の収益の
イメージ

●当ファンドは、リート等に投資するとともに、オプション取引および為替取引を活用します。

〈イメージ図〉



※取引対象通貨(セレクト通貨)が円以外の場合には、当該取引対象通貨の対円での為替リスクが発生することに留意が必要です。

●当ファンドの収益源としては、以下の5つの要素が挙げられます。
これらの収益源に相応してリスクが内在していることに注意が必要です。

		A	B	C	D	E
収益の源泉		リート等の配当等収入、 値上がり/値下がり	コールオプションの プレミアム/権利行使価格を 上回る部分の損失	為替取引による プレミアム/コスト	為替差益/差損	セレクト通貨(対米ドル)の コールオプションのプレミアム/ 権利行使価格を上回る部分の損失
収益を得られる ケース	インカム	配当の受取り	オプションプレミアムの受取り	プレミアム (金利差相当分の収益)の発生 〔セレクト通貨の > 発行通貨の 短期金利 短期金利〕		オプションプレミアムの受取り
	キャピタル	リート等の価格 の上昇 ・リート等の価格が権利行使価格 を超える場合、その超過分はオプション の損失と相殺されます。*	売却したオプション 価値の下落 ＜プレミアム収入が上限＞		為替差益の発生 円に対してセレクト通貨高 ・セレクト通貨が対米ドルで権利行 使価格を上回る場合、その超過分は オプションの損失と相殺されます。*	売却した通貨 オプション価値の下落 ＜プレミアム収入が上限＞
損失や コストが発生する ケース		リート等の価格 の下落	売却したオプション 価値の上昇 ・オプションにおける損失: リート等の価格が権利行使 価格を超える場合、その超 過分はリート等の価格の上 昇と相殺されます。*	コスト (金利差相当分の費用) の発生 〔セレクト通貨の < 発行通貨の 短期金利 短期金利〕	為替差損の発生 円に対してセレクト 通貨安	売却した通貨 オプション価値の上昇 ・オプションにおける損失: セレクト通貨が対米ドルで権 利行使価格を上回る場合、 その超過分はセレクト通貨 の上昇と相殺されます。*
			相殺効果		相殺効果	

※リート等の価格が権利行使価格を超えて上昇、またはセレクト通貨が権利行使価格を超えて通貨高(対米ドル)となった場合、その超過分は、オプションを売却している割合(カバー率)に応じて一部または全部が、オプションの権利行使によって、相殺されます。詳しくは前掲の＜コールオプションとは＞をご覧ください。

なお、通貨のコールオプションは米ドルに対する取引となります。必ずしも対円で差益が発生するとは限りません。

<投資対象とする外国投資信託に関して>

投資顧問会社

UBPインベストメンツ

- ・ユニオン パンケール プリヴェ ユービーピー エスエーの日本拠点

副投資顧問会社

TCW インベストメント マネジメント カンパニー (REIT等及びREIT等オプションの運用)

- ・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。
- ・同グループの運用資産額:約1,945億米ドル(約20兆159億円)。

(2016年6月末現在、同月末時点の為替レートで換算)

ユニオン パンケール プリヴェ ユービーピー エスエー (通貨及び通貨オプションの運用)

- ・スイスを代表する資産運用会社の一つ。
- ・世界の個人投資家・機関投資家に様々な運用戦略を提供。
- ・1969年スイスで設立。現在、グローバルに24拠点を展開。
- ・運用資産額:1,135億スイスフラン(約11兆9,254億円)。

(2016年6月末現在、同月末時点の為替レートで換算)

（３）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

（略）

委託会社等の概況

（ ）資本金の額 1,550百万円 （平成27年12月末現在）

（略）

（ ）大株主の状況（平成27年12月末現在）

（略）

<訂正後>

（略）

委託会社等の概況

（ ）資本金の額 1,550百万円 （平成28年6月末現在）

（略）

（ ）大株主の状況（平成28年6月末現在）

（略）

2【投資方針】

（３）【運用体制】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

（運用体制）

投信投資戦略会議は、ファンドの基本運用方針の分析と決定を行います。

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

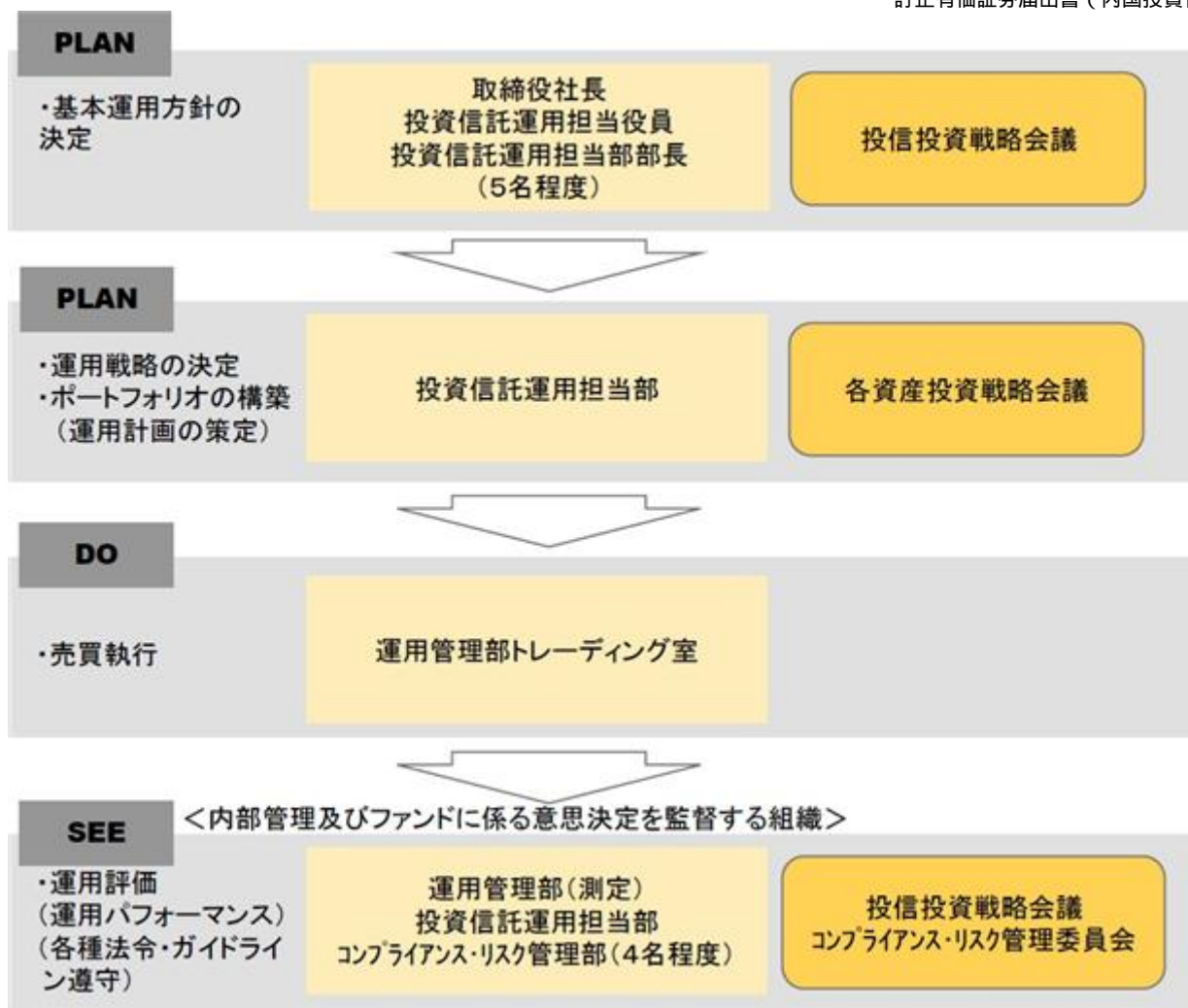
各運用担当部で策定された運用計画に基づき、運用管理部トレーディング室が最良執行の観点から売買を執行します。

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

（社内規程）

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

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



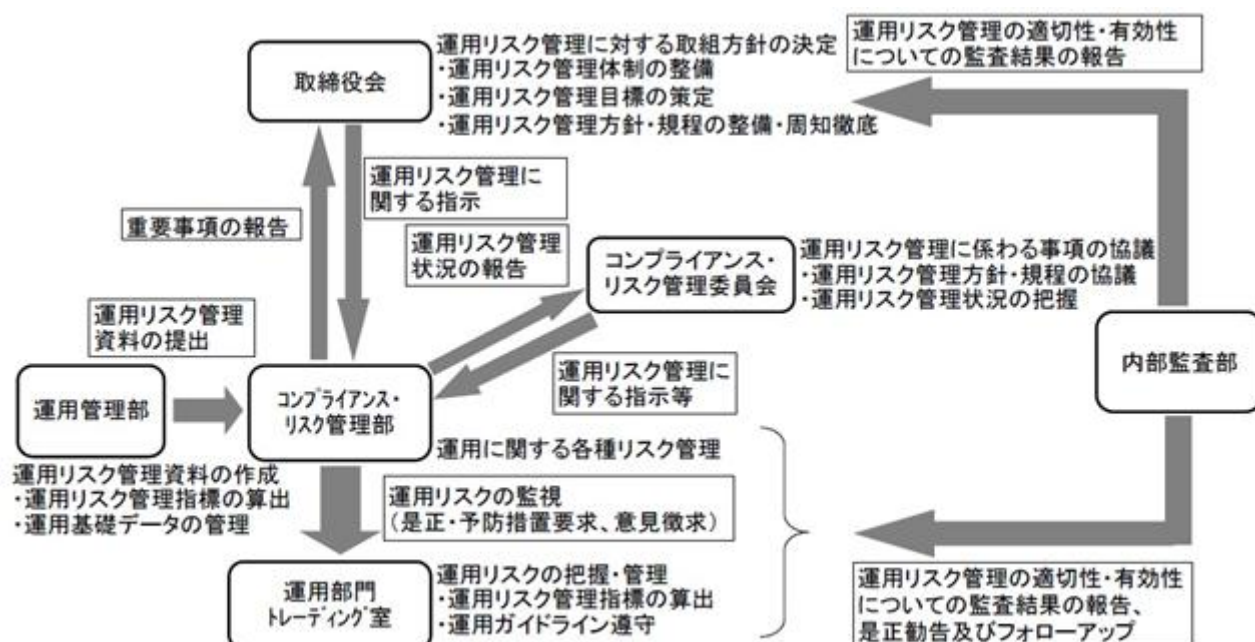
平成28年6月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

3【投資リスク】

＜訂正前＞

（略）

＜リスクの管理体制＞



※運用リスクには流動性リスクを含みます。

（注）上図は、平成27年12月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

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

※データは、設定日より掲載しています。



ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- 資料作成時において、ファンドの運用期間が1年末満のため、ファンドの年間騰落率を記載しておりません。
- 上記は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額および年間騰落率が記載されており、実際の基準価額および基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- 上記は、期間5年のグラフになります。
- 「ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較」は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

日 本 株…東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

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

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

日本国債…NOMURA-BPI 国債

先進国債…シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

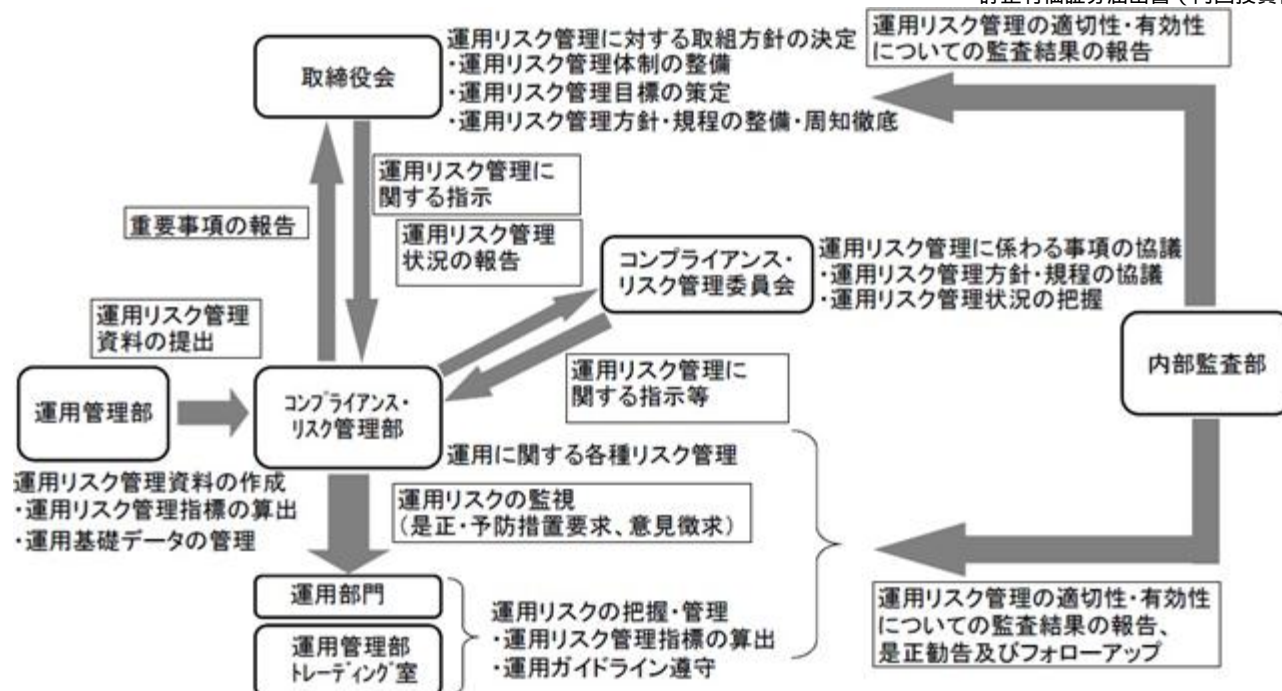
新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド (円ベース)

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

< 訂正後 >

(略)

< リスクの管理体制 >



※運用リスクには流動性リスクを含みます。

（注）上図は、平成28年6月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

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

※データは、設定日より掲載しています。



ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

※ファンドと代表的な資産クラスの対象期間が異なりますので、ご注意ください。



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

● 上記は、期間5年のグラフになります。

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

*各資産クラスの指数

日 本 株…東証株価指数(TOPIX) (配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

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

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

日本国債…NOMURA-BPI 国債

先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)

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

4【手数料等及び税金】

（５）【課税上の取扱い】

<訂正前>

（略）

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

- ・少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、平成28年4月1日より年間80万円の範囲で20歳未満の方を対象とした非課税制度（ジュニアNISA）が開始される予定です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

上記は平成28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。

<訂正後>

（略）

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

- ・少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

上記は平成28年6月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

平成28年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	219,868,395	95.16
内 ルクセンブルグ	219,868,395	95.16
親投資信託受益証券	2,175,738	0.94
内 日本	2,175,738	0.94
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,015,371	3.90
純資産総額	231,059,504	100.00

（参考）マザーファンドの投資状況

損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成28年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	8,902,465,190	67.16
内 日本	8,802,348,490	66.40
内 メキシコ	100,116,700	0.76
特殊債券	1,489,290,970	11.23
内 日本	1,489,290,970	11.23
社債券	2,766,041,800	20.87
内 日本	2,156,779,500	16.27
内 フランス	509,132,800	3.84
内 オランダ	100,129,500	0.76
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	98,684,027	0.74
純資産総額	13,256,481,987	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】

平成28年6月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	UBP OPPORTUNITIES - TCW GLOBAL REIT PREMIUM Enhanced Fund ルクセンブルグ	投資信託 受益証券	35,308	6,155.9999 217,361,465	6,227.0000 219,868,395	- -	95.16%
2	損保ジャパン日本債券マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,506,640	1.4296 2,154,043	1.4441 2,175,738	- -	0.94%

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年6月30日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	95.16%
親投資信託受益証券	0.94%
合計	96.10%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考) マザーファンドの投資資産

損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成28年6月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	3 6 5 2年国債 日本	国債 証券	1,560,000,000	100.70 1,571,013,600	100.79 1,572,450,360	0.100000 2018/6/15	11.86%
2	1 5 7 20年国債 日本	国債 証券	1,050,000,000	100.46 1,054,861,500	102.35 1,074,769,500	0.200000 2036/6/20	8.11%
3	3 6 3 2年国債 日本	国債 証券	820,000,000	100.69 825,706,300	100.73 826,042,580	0.100000 2018/4/15	6.23%
4	3 4 1 10年国債 日本	国債 証券	640,000,000	102.78 657,792,000	105.43 674,812,160	0.300000 2025/12/20	5.09%
5	1 5 2 20年国債 日本	国債 証券	510,000,000	100.00 510,000,000	121.78 621,081,570	1.200000 2035/3/20	4.69%
6	1 5 1 20年国債 日本	国債 証券	500,000,000	100.31 501,580,500	121.71 608,595,000	1.200000 2034/12/20	4.59%
7	1 5 6 20年国債 日本	国債 証券	530,000,000	101.97 540,483,200	106.62 565,120,450	0.400000 2036/3/20	4.26%
8	3 4 2 10年国債 日本	国債 証券	520,000,000	101.71 528,910,000	103.48 538,131,880	0.100000 2026/3/20	4.06%
9	1 0 0 20年国債 日本	国債 証券	310,000,000	126.13 391,012,300	128.49 398,337,600	2.200000 2028/3/20	3.00%
10	1 5 0 20年国債 日本	国債 証券	310,000,000	104.09 322,687,060	125.28 388,386,910	1.400000 2034/9/20	2.93%

11	1 4 9 2 0 年国債 日本	国債証券	290,000,000	106.10 307,693,190	126.95 368,180,810	1.500000 2034/6/20	2.78%
12	1 4 8 2 0 年国債 日本	国債証券	200,000,000	106.36 212,720,000	126.80 253,611,000	1.500000 2034/3/20	1.91%
13	1 3 0 2 0 年国債 日本	国債証券	170,000,000	126.46 214,987,100	128.97 219,257,840	1.800000 2031/9/20	1.65%
14	1 みずほ F G 劣後 日本	社債券	200,000,000	100.48 200,961,400	104.83 209,675,200	0.950000 2024/7/16	1.58%
15	1 2 5 5 年国債 日本	国債証券	200,000,000	101.53 203,060,000	101.78 203,571,000	0.100000 2020/9/20	1.54%
16	1 明治安田 2 0 1 4 基 日本	社債券	200,000,000	100.28 200,562,000	101.40 202,813,600	0.510000 2019/8/7	1.53%
17	9 2 住宅機構 R M B S 日本	特殊債券	186,096,000	99.50 185,165,520	104.12 193,781,764	0.740000 2050/1/10	1.46%
18	8 6 住宅機構 R M B S 日本	特殊債券	179,148,000	101.55 181,942,708	105.67 189,323,606	1.000000 2049/7/10	1.43%
19	7 9 住宅機構 R M B S 日本	特殊債券	164,464,000	102.17 168,049,314	105.80 174,002,912	1.070000 2048/12/10	1.31%
20	7 8 住宅機構 R M B S 日本	特殊債券	163,094,000	101.78 166,013,382	105.83 172,618,689	1.080000 2048/11/10	1.30%
21	1 2 3 5 年国債 日本	国債証券	150,000,000	101.36 152,044,500	101.55 152,331,900	0.100000 2020/3/20	1.15%
22	1 A 日本生命劣後 F R 日本	社債券	100,000,000	98.91 98,910,000	106.09 106,090,000	1.520000 2045/4/30	0.80%
23	4 9 6 関西電力 日本	社債券	100,000,000	99.88 99,888,600	105.87 105,879,200	0.908000 2025/2/25	0.80%
24	4 3 1 九州電力 日本	社債券	100,000,000	99.13 99,136,200	104.95 104,953,100	0.811000 2024/12/25	0.79%
25	6 9 アコム 日本	社債券	100,000,000	100.60 100,608,800	104.58 104,582,400	1.210000 2024/9/26	0.79%
26	1 三井住友 F G 劣後 日本	社債券	100,000,000	99.72 99,720,200	104.44 104,441,900	0.849000 2024/9/12	0.79%
27	1 クレディ・A 劣後 フランス	社債券	100,000,000	99.94 99,949,000	103.84 103,843,500	2.114000 2025/6/26	0.78%
28	1 B P C E S . A . 劣後 フランス	社債券	100,000,000	98.84 98,848,400	103.29 103,291,000	2.047000 2025/1/30	0.78%
29	4 9 5 関西電力 日本	社債券	100,000,000	101.13 101,133,700	103.14 103,143,500	0.746000 2021/9/17	0.78%
30	5 5 9 東京電力 日本	社債券	100,000,000	103.27 103,272,000	102.99 102,998,000	1.377000 2019/10/29	0.78%

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年6月30日現在

種類	投資比率
国債証券	67.16%
特殊債券	11.23%
社債券	20.87%
合計	99.26%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成28年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1 口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1 口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (平成27年6月18日)	441,851,537	441,851,537	0.9860	0.9860
第2特定期間末 (平成27年12月18日)	285,974,138	285,974,138	0.9101	0.9101
第3特定期間末 (平成28年6月20日)	228,869,971	228,869,971	0.8102	0.8102
平成27年6月末日	418,267,031	-	0.9626	-
7月末日	349,457,456	-	0.9846	-
8月末日	312,246,301	-	0.9064	-
9月末日	291,082,933	-	0.8547	-
10月末日	302,862,655	-	0.9271	-
11月末日	296,120,185	-	0.9317	-
12月末日	287,025,119	-	0.9134	-
平成28年1月末日	245,713,385	-	0.8103	-
2月末日	239,545,503	-	0.8040	-
3月末日	255,784,641	-	0.8616	-
4月末日	245,101,859	-	0.8641	-
5月末日	238,609,676	-	0.8378	-
6月末日	231,059,504	-	0.8190	-

【分配の推移】

	1 口当たりの分配金 (円)
第1特定期間	0.0000
第2特定期間	0.0000
第3特定期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	1.4
第2特定期間	7.7
第3特定期間	11.0

(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】

	設定口数	解約口数
第1特定期間	524,545,898	76,441,380
第2特定期間	22,377,687	156,257,323
第3特定期間	8,138,965	39,874,832

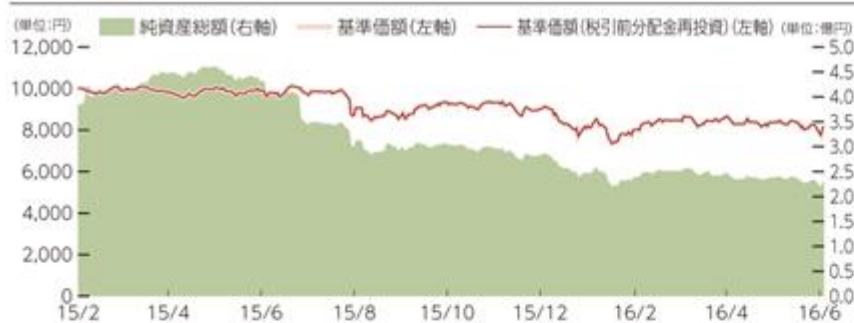
(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(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：2016年6月30日

基準価額・純資産の推移 2015/02/27～2016/06/30



基準価額	8,190円
純資産総額	2.31億円

分配の推移

2016年02月	0円
2016年03月	0円
2016年04月	0円
2016年05月	0円
2016年06月	0円
直近1年間累計	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

好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 通貨セレクト・プレミアムコース

資産の種類	純資産比
UBP OPPORTUNITIES - TCW GLOBAL REIT PREMIUM Enhanced Fund	95.16%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	0.94%
コール・ローン等	3.90%
合計	100.00%

《主要投資対象の投資信託証券の運用状況》

UBP オポチュニティーズ TCW グローバル リート プレミアム

UBPインベストメンツ、TCW インベストメント マネジメント カンパニー及びユニオン パンケール プリヴェ ユービーピー エスエーが作成したデータを掲載しております。

資産の種類	純資産比
投資証券	92.9%
現金等	7.1%
合計	100.0%

銘柄名	通貨	発行国/地域	業種	純資産比
1 SIMON PROPERTY GROUP INC	米ドル	アメリカ	店舗用REIT	6.1%
2 PUBLIC STORAGE	米ドル	アメリカ	専門REIT	4.5%
3 SCENTRE GROUP	オーストラリアドル	オーストラリア	店舗用REIT	4.1%
4 NIPPON PROLOGIS REIT INC	日本円	日本	工業用REIT	3.8%
5 UNIBAIL-RODAMCO SE	ユーロ	フランス	店舗用REIT	3.4%
6 MACERICH CO/THE	米ドル	アメリカ	店舗用REIT	3.3%
7 EQUINIX INC	米ドル	アメリカ	専門REIT	3.0%
8 WESTFIELD GROUP	オーストラリアドル	オーストラリア	店舗用REIT	2.9%
9 WEYERHAEUSER CO	米ドル	アメリカ	専門REIT	2.8%
10 LENNAR CORP	米ドル	アメリカ	住宅建設	2.8%
銘柄数				40銘柄

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

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	365 2年国債	国債証券	2018/06/15	11.9%
	2	157 20年国債	国債証券	2036/06/20	8.1%
	3	363 2年国債	国債証券	2018/04/15	6.2%
	4	341 10年国債	国債証券	2025/12/20	5.1%
	5	152 20年国債	国債証券	2035/03/20	4.7%
	6	151 20年国債	国債証券	2034/12/20	4.6%
	7	156 20年国債	国債証券	2036/03/20	4.3%
	8	342 10年国債	国債証券	2026/03/20	4.1%
	9	100 20年国債	国債証券	2028/03/20	3.0%
	10	150 20年国債	国債証券	2034/09/20	2.9%
銘 柄 数					62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。
- 2015年は設定日(2月27日)から年末、2016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。

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

第3【ファンドの経理状況】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

1. 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、平成27年12月19日から平成28年6月20日までの財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 通貨セレクト・プレミアムコース】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前 期 平成27年12月18日現在	当 期 平成28年 6 月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,645,719	10,478,764
投資信託受益証券	271,660,178	217,361,465
親投資信託受益証券	2,785,562	2,282,524
未収入金	16,000,000	-
流動資産合計	302,091,459	230,122,753
資産合計	302,091,459	230,122,753
負債の部		
流動負債		
未払金	15,730,000	1,050,000
未払解約金	160,287	-
未払受託者報酬	7,719	6,891
未払委託者報酬	218,810	195,441
その他未払費用	505	450
流動負債合計	16,117,321	1,252,782
負債合計	16,117,321	1,252,782
純資産の部		
元本等		
元本	314,224,882	282,489,015
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	28,250,744	53,619,044
純資産合計	285,974,138	228,869,971
負債純資産合計	302,091,459	230,122,753

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前 期 自 平成27年 6 月19日 至 平成27年12月18日	当 期 自 平成27年12月19日 至 平成28年 6 月20日
営業収益		
受取配当金	24,252,770	10,800,658
受取利息	700	138
有価証券売買等損益	49,497,963	40,451,751
営業収益合計	25,244,493	29,650,955
営業費用		
支払利息	-	1,248
受託者報酬	53,312	40,511
委託者報酬	1,511,911	1,149,005
その他費用	3,497	3,227
営業費用合計	1,568,720	1,193,991
営業利益又は営業損失（ ）	26,813,213	30,844,946
経常利益又は経常損失（ ）	26,813,213	30,844,946
当期純利益又は当期純損失（ ）	26,813,213	30,844,946
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（ ）	2,509,699	286,845
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,252,981	28,250,744
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,043,990	6,596,942
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,043,990	6,596,942
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,738,239	1,407,141
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,738,239	1,407,141
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	28,250,744	53,619,044

（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。
2．費用・収益の計上基準	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。 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。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年6月18日及び12月18日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当特定期間末日を平成28年6月20日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	前 期 平成27年12月18日現在	当 期 平成28年6月20日現在
1．受益権の総数	314,224,882口	282,489,015口
2．元本の欠損	28,250,744円	53,619,044円
3．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9101円 (9,101円)	0.8102円 (8,102円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	前 期	当 期
	自 平成27年6月19日	自 平成27年12月19日
	至 平成27年12月18日	至 平成28年6月20日

1. 分配金の計算過程	（自平成27年6月19日 至平成27年7月21日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（7,179,152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（7,674,750円）及び分配準備積立金（44,949,398円）より分配対象収益は59,803,300円（1万口当たり1,487.01円）ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。（以下、各期間において同じ。） （自平成27年7月22日 至平成27年8月18日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（5,701,545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（7,164,570円）及び分配準備積立金（45,383,255円）より分配対象収益は58,249,370円（1万口当たり1,654.42円）ですが、分配を行っておりません。 （自平成27年8月19日 至平成27年9月18日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（3,598,135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	（自平成27年12月19日 至平成28年1月18日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（1,623,366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（8,456,439円）及び分配準備積立金（51,899,997円）より分配対象収益は61,979,802円（1万口当たり2,002.58円）ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。（以下、各期間において同じ。） （自平成28年1月19日 至平成28年2月18日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（1,596,754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（8,433,908円）及び分配準備積立金（51,160,914円）より分配対象収益は61,191,576円（1万口当たり2,057.47円）ですが、分配を行っておりません。 （自平成28年2月19日 至平成28年3月18日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（1,785,309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（8,616,974円）及び分配準備
--------------------	--	---

	（8,711,328円）及び分配準備積立金（48,351,078円）より分配対象収益は60,660,541円（1万口当たり1,763.59円）ですが、分配を行っておりません。 （自平成27年9月19日 至平成27年10月19日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（2,620,251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（8,436,391円）及び分配準備積立金（49,709,769円）より分配対象収益は60,766,411円（1万口当たり1,844.28円）ですが、分配を行っておりません。 （自平成27年10月20日 至平成27年11月18日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（1,672,611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（8,351,774円）及び分配準備積立金（51,054,143円）より分配対象収益は61,078,528円（1万口当たり1,896.92円）ですが、分配を行っておりません。 （自平成27年11月19日 至平成27年12月18日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（1,627,798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	積立金（52,428,801円）より分配対象収益は62,831,084円（1万口当たり2,117.81円）ですが、分配を行っておりません。 （自平成28年3月19日 至平成28年4月18日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（1,544,459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（8,420,582円）及び分配準備積立金（52,095,675円）より分配対象収益は62,060,716円（1万口当たり2,172.92円）ですが、分配を行っておりません。 （自平成28年4月19日 至平成28年5月18日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（1,568,160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（8,475,144円）及び分配準備積立金（53,176,917円）より分配対象収益は63,220,221円（1万口当たり2,228.43円）ですが、分配を行っておりません。 （自平成28年5月19日 至平成28年6月20日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（1,545,035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（8,875,624円）及び分配準備
--	---	--

	（8,304,554円）及び分配準備 積立金（51,327,336円）より 分配対象収益は61,259,688円 （1万口当たり1,949.55円）で ありますが、分配を行って おりません。	積立金（54,084,547円）より 分配対象収益は64,505,206円 （1万口当たり2,283.46円）で ありますが、分配を行って おりません。
--	--	--

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	前 期	当 期
	自 平成27年6月19日 至 平成27年12月18日	自 平成27年12月19日 至 平成28年6月20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。	同左
	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。	
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

金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期 平成27年12月18日現在	当 期 平成28年6月20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）

前 期 平成27年12月18日現在	当 期 平成28年6月20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 平成27年6月19日 至 平成27年12月18日	当 期 自 平成27年12月19日 至 平成28年6月20日
期首元本額	448,104,518円	314,224,882円
期中追加設定元本額	22,377,687円	8,138,965円
期中一部解約元本額	156,257,323円	39,874,832円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前 期 平成27年12月18日現在	当 期 平成28年6月20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	3,295,829	7,753,931
親投資信託受益証券	18,756	13,090
合計	3,277,073	7,740,841

（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

平成28年6月20日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	UBP OPPORTUNITIES - TCW GLOBAL REIT PR EMIUM Enhanced Fun d	35,308	217,361,465	
投資信託受益証券 合計		35,308	217,361,465	
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	1,596,506	2,282,524	
親投資信託受益証券 合計		1,596,506	2,282,524	
合計		1,631,814	219,643,989	

（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 >

当ファンドは「損保ジャパン日本債券マザーファンド」受益証券及び「UBP OPPORTUNITIES SICAV-SIF - TCW GLOBAL REIT PREMIUM ENHANCED FUND」に係る投資信託の受益証券を主要投資対象としております。貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて「損保ジャパン日本債券マザーファンド」の受益証券であり、「投資信託受益証券」はすべて「UBP OPPORTUNITIES SICAV-SIF - TCW GLOBAL REIT PREMIUM ENHANCED FUND」に係る投資信託の受益証券であります。なお、同マザーファンドの状況及び「UBP OPPORTUNITIES SICAV-SIF - TCW GLOBAL REIT PREMIUM ENHANCED FUND」を含むルクセンブルグ籍会社型投資信託「UBP OPPORTUNITIES SICAV-SIF」の財務諸表のうち、投資対象に関連する部分を委託会社にて抜粋・翻訳したものは次のとおりです。

* なお、以下は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

損保ジャパン日本債券マザーファンドの状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	平成27年12月18日現在	平成28年6月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	55,554,916	50,094,863
国債証券	8,524,438,470	9,127,264,530
特殊債券	1,796,706,661	1,484,726,545
社債券	3,735,337,300	2,865,330,600
未収入金	904,293,000	1,677,291,800
未収利息	27,816,984	14,156,677
前払費用	2,424,833	1,220,533
流動資産合計	15,046,572,164	15,220,085,548
資産合計	15,046,572,164	15,220,085,548
負債の部		
流動負債		
未払金	900,645,000	1,571,013,600
流動負債合計	900,645,000	1,571,013,600
負債合計	900,645,000	1,571,013,600
純資産の部		
元本等		
元本	10,464,257,673	9,546,962,794
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,681,669,491	4,102,109,154
純資産合計	14,145,927,164	13,649,071,948
負債純資産合計	15,046,572,164	15,220,085,548

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）

項目	平成27年12月18日現在	平成28年6月20日現在
1．受益権の総数	10,464,257,673口	9,546,962,794口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3518円 (13,518円)	1.4297円 (14,297円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年6月19日 至 平成27年12月18日	自 平成27年12月19日 至 平成28年6月20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。	同左
	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。	
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

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年12月18日現在	平成28年6月20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）

平成27年12月18日現在	平成28年6月20日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	自 平成27年6月19日 至 平成27年12月18日	自 平成27年12月19日 至 平成28年6月20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	11,675,355,262円	10,464,257,673円
同期中追加設定元本額	675,294,416円	1,065,671,961円
同期中一部解約元本額	1,886,392,005円	1,982,966,840円
元本の内訳＊		
ファンド名		
損保ジャパン日本債券ファンド	1,035,288,090円	1,053,794,002円
ハッピーエイジング20	122,980,318円	100,789,174円
ハッピーエイジング30	615,904,523円	510,424,909円
ハッピーエイジング40	3,063,667,017円	2,721,142,327円
ハッピーエイジング50	2,384,934,244円	2,245,203,952円
ハッピーエイジング60	2,056,538,023円	2,112,050,294円
パン・アフリカ株式ファンド	1,491,284円	14,716,695円
人民元建て債券ファンド	4,015,090円	2,577,352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	10,229,153円	6,789,440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	79,717,742円	51,601,779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	1,033,849,456円	692,574,578円
好配当米国株式プレミアム・ファンド 円ヘッジありコース	33,589円	33,589円
好配当米国株式プレミアム・ファンド 円ヘッジなしコース	54,730円	27,358円
好配当米国株式プレミアム・ファンド 通貨セレクトコース	1,855,368円	1,057,830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	42,706,803円	26,268,421円
金利上昇対応型グローバル・ハイ・イールドファンド 円ヘッジありコース	810,501円	498,522円
金利上昇対応型グローバル・ハイ・イールドファンド 円ヘッジなしコース	677,119円	403,377円
金利上昇対応型グローバル・ハイ・イールドファンド 通貨セレクトコース	4,020,842円	2,325,268円
好配当グローバルＲＥＩＴプレミアム・ファンド 通貨セレクト・プレミアムコース	2,060,632円	1,596,506円
好配当グローバルＲＥＩＴプレミアム・ファンド 米ドルプレミアムコース	2,947,604円	1,504,410円
インド株式集中投資ファンド	475,545円	1,583,011円
計	10,464,257,673円	9,546,962,794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	平成27年12月18日現在	平成28年6月20日現在
	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	161,543,840	525,035,080
特殊債券	10,974,847	40,662,313
社債券	23,790,800	55,182,400
合計	196,309,487	620,879,793

（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

平成28年6月20日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 5 7 2 年国債	190,000,000	190,933,090	
	3 6 3 2 年国債	870,000,000	875,628,030	
	3 6 5 2 年国債	1,560,000,000	1,570,920,000	
	1 1 6 5 年国債	90,000,000	91,028,520	
	1 1 7 5 年国債	60,000,000	60,768,720	
	1 1 9 5 年国債	10,000,000	10,109,460	
	1 2 1 5 年国債	100,000,000	101,174,000	
	1 2 3 5 年国債	150,000,000	151,974,750	
	1 2 5 5 年国債	200,000,000	203,025,800	
	3 2 9 1 0 年国債	130,000,000	139,824,750	
	3 4 1 1 0 年国債	760,000,000	795,264,000	
	3 4 2 1 0 年国債	520,000,000	533,916,240	
	4 3 3 0 年国債	320,000,000	438,723,200	
	4 7 3 0 年国債	100,000,000	134,257,600	
	5 0 3 0 年国債	190,000,000	216,000,740	
	1 0 0 2 0 年国債	310,000,000	394,289,620	
	1 3 0 2 0 年国債	170,000,000	216,012,200	
	1 4 8 2 0 年国債	200,000,000	248,827,600	
	1 4 9 2 0 年国債	290,000,000	361,149,180	
	1 5 0 2 0 年国債	310,000,000	380,871,580	
	1 5 1 2 0 年国債	500,000,000	596,657,500	
	1 5 2 2 0 年国債	510,000,000	608,758,950	
	1 5 3 2 0 年国債	60,000,000	72,746,700	
	1 5 6 2 0 年国債	610,000,000	634,381,700	
	2 1 メキシコ国債	100,000,000	100,020,600	
国債証券 合計		8,310,000,000	9,127,264,530	
特殊債券	4 住宅金融 R M B S	40,698,000	42,122,430	
	6 住宅金融 R M B S	59,492,000	62,216,732	
	1 7 住宅金融 R M B S	18,091,000	19,049,823	
	3 1 住宅金融 R M B S	25,933,000	27,924,654	
	4 2 住宅金融 R M B S	50,484,000	55,340,560	
	4 9 住宅機構 R M B S	62,321,000	67,711,766	
	5 0 住宅機構 R M B S	62,199,000	67,286,878	
	5 2 住宅機構 R M B S	70,341,000	75,679,881	
	6 0 住宅機構 R M B S	76,260,000	81,491,436	
	6 5 住宅機構 R M B S	80,797,000	85,523,624	
	6 6 住宅機構 R M B S	80,327,000	84,881,540	
	7 3 住宅機構 R M B S	83,087,000	88,778,459	
	7 8 住宅機構 R M B S	163,094,000	172,031,551	
	7 9 住宅機構 R M B S	164,464,000	173,410,840	
	8 6 住宅機構 R M B S	179,148,000	188,499,525	
	9 2 住宅機構 R M B S	186,096,000	192,776,846	
特殊債券 合計		1,402,832,000	1,484,726,545	
社債券	7 B P C E S . A .	100,000,000	101,358,100	
	1 B P C E S . A . 劣後	100,000,000	103,713,700	
	1 クレディ・A 劣後	100,000,000	105,227,500	
	5 クレディ・A 劣後 F R	100,000,000	100,230,000	
	2 2 ラボバンク・ネダー	100,000,000	100,148,000	
	4 ソシエテ G 劣後	100,000,000	100,626,700	
	3 1 双日	100,000,000	102,009,600	

2 ユニゾHD	100,000,000	100,322,800	
2 荒川化学工業	100,000,000	100,137,300	
2 5 太平洋セメント	100,000,000	101,849,400	
3 6 富士通	100,000,000	101,966,600	
1 3 パナソニック	100,000,000	101,868,800	
1 明治安田 2 0 1 4 基	200,000,000	202,635,600	
1 日生 2 0 1 5 基金	100,000,000	101,048,000	
1 三井住友 F G 劣後	100,000,000	103,850,600	
1 みずほ F G 劣後	200,000,000	208,616,800	
6 9 アコム	100,000,000	104,587,800	
7 1 アコム	100,000,000	101,089,100	
1 6 7 オリックス	100,000,000	100,759,000	
5 5 9 東京電力	100,000,000	102,798,200	
5 6 8 東京電力	100,000,000	102,278,700	
4 9 5 関西電力	100,000,000	102,876,100	
4 9 6 関西電力	100,000,000	105,190,800	
4 3 1 九州電力	100,000,000	104,329,400	
1 A 日本生命劣後 F R	100,000,000	105,450,000	
2 A 日本生命劣後 F R	100,000,000	100,362,000	
社債券 合計	2,800,000,000	2,865,330,600	
合計	12,512,832,000	13,477,321,675	

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。

UBP OPPORTUNITIES SICAV-SIF - TCW GLOBAL REIT PREMIUM ENHANCED FUNDの状況

(1) 純資産計算書

(円)	
2015年12月31日現在	
資産	
有価証券ポートフォリオ（時価）	257,168,543
銀行預金	18,021,924
未収配当金	498,195
資産合計	275,688,662
負債	
売建オプション取引（時価）	1,290,705
未払解約金	3,530,001
先物為替未実現損失	5,707,509
未払費用	740,741
負債合計	11,268,956
純資産合計	264,419,706

(発行済み口数の状況)

2015年2月27日から2015年12月31日まで

(口)			
発行済み口数	追加設定口数	解約口数	発行済み口数
2015年2月27日現在			2015年12月31日現在
0.00	60,098.04	23,210.00	36,888.04

(1口当たりの純資産額)

2015年12月31日現在	
純資産合計（円）	264,419,706

発行済み口数（口）	36,888.04
1口当たりの純資産額（円）	7,168.0000
1口当たりの分配金（円）	1,940.0000

■組入資産の明細

○有価証券ポートフォリオ・その他純資産の明細表

(2015年12月31日現在)

数量	銘柄名	通貨	簿価(円)	時価(円)	純資産構成比 (%)
公認証券取引所譲渡可能上場有価証券またはその他規制市場で 取引される譲渡可能有価証券			273,675,529	257,168,543	97.26
	投資証券		273,675,529	257,168,543	97.26
780	AMERICAN CAPITAL AGENCY	USD	1,997,222	1,627,014	0.62
300	AVALONBAY COMMUN	USD	6,522,860	6,644,975	2.51
300	BOSTON PROPERTIES INC	USD	4,684,521	4,602,727	1.74
4,080	BRITISH LAND CO PLC REIT	GBP	6,117,119	5,685,689	2.15
2,144	CHIMERA INVT CORP	USD	4,083,497	3,517,926	1.33
2,070	COLONY CAPITAL	USD	6,261,426	4,850,727	1.83
400	CROWN CASTLE REIT	USD	4,111,386	4,160,282	1.57
1,710	DEUTSCHE WOHNEN AG	EUR	5,342,108	5,723,844	2.16
700	DIGITAL REALTY TRUST INC	USD	5,782,457	6,367,695	2.41
830	EQTY RESIDENTIAL PTYS TR SHS BEN.INT.	USD	7,811,934	8,146,341	3.08
139	EQUINIX	USD	4,978,160	5,056,432	1.91
1,560	GARMING AND LEISURE PROPERTIES	USD	5,777,555	5,216,953	1.97
2,660	GENERAL GROWTH PROPERTIES	USD	8,897,667	8,706,783	3.29
1,630	HCP	USD	8,070,001	7,498,131	2.84
1,500	HOSPITALITY PPTY TRUST SHS OF BENEF INT	USD	5,493,543	4,718,571	1.78
2,750	HOST HOTELS & RESORTS - SHS	USD	6,708,446	5,074,644	1.92
2,610	KB HOME	USD	4,447,425	3,871,249	1.46
820	KLEPIERRE SA	EUR	4,599,172	4,392,271	1.66
1,460	LENNAR CORP -A-	USD	8,972,978	8,590,097	3.25
830	MACERICH CO	USD	8,368,050	8,056,480	3.05
2,630	MDC HOLDINGS INC	USD	9,417,857	8,077,075	3.05
3,510	MFA MORTGAGE INVESTMENTS INC	USD	3,341,006	2,786,754	1.05
2,000	MITSUBISHI ESTATE	JPY	5,486,750	5,047,000	1.91
2,000	MITSUI FUDOSAN CO LTD	JPY	6,677,500	6,112,000	2.31
20	MORI HILLS REIT INVESTMENT CORP	JPY	3,209,160	3,100,000	1.17
1,070	PLUM CREEK TIMBER	USD	5,674,886	6,142,310	2.32
1,820	PROLOGIS	USD	9,213,152	9,396,771	3.55
34	PROLOGIS REIT	JPY	9,019,730	7,429,000	2.81
320	PUBLIC STORAGE INC	USD	9,230,838	9,535,062	3.62
23,990	SCENTRE GRP - STAPLED SECURITY	AUD	8,587,856	8,797,661	3.33
700	SIMON PROPERTY GROUP INC	USD	16,345,708	16,373,111	6.20
7,570	THE LINK REIT UNITS	HKD	5,503,065	5,451,967	2.06
1,680	TOLL BROTHERS INC	USD	7,782,913	6,729,783	2.55
210	UNIBAIL-RODAMCO SE	EUR	6,972,408	6,432,418	2.43
1,120	VENTAS INC	USD	8,172,050	7,602,836	2.88
570	VORNADO REALTY TRUST SHS OF BENEF.INT	USD	7,290,895	6,854,072	2.59
1,340	WELLTOWER INC	USD	10,978,325	10,966,115	4.16
7,930	WESTFIELD CORP - STAPLED	AUD	7,022,672	6,600,498	2.50
1,520	WEYERHAEUSER CO	USD	6,155,794	5,481,795	2.07
4,500	WP GLIMCHER INC	USD	8,565,437	5,743,484	2.17

数量	銘柄名	通貨	簿価（円）	時価（円）	純資産構成比 （％）
デリバティブ取引			-2,662,882	-1,290,705	-0.49
オプション取引			-2,662,882	-1,290,705	-0.49
-4	DIGITAL REALTY REIT FEB 80 19.02.16 CALL	USD	-32,456	-26,465	-0.01
-11	HCP REIT JAN 37.50 15.01.16 CALL	USD	-39,845	-185,254	-0.07
-14	HOST HOTELS REIT JAN 17.00 15.01.16 CALL	USD	-53,797	-8,421	0.00
-10	KB HOME JAN 15.00 15.01.16 CALL	USD	-44,200	-4,210	0.00
-4	MACERICH REIT MAR 86.00 18.03.16 CALL	USD	-55,708	-63,756	-0.02
-2	PUBLIC STORAGE JAN 260.00 15.01.16 CALL	USD	-32,940	-9,624	0.00
-4	SIMON PROP JAN 200 15.01.16 CALL	USD	-38,269	-31,277	-0.01
-352,000	USD(P)/BRL(C)OTC JAN 3.757 19.01.16 PUT	USD	-729,492	-128,994	-0.05
-352,000	USD(P)/CNH(C)OTC JAN 6.383 19.01.16 PUT	USD	-99,722	-14,418	-0.01
-352,000	USD(P)/IDR(C)OTC JAN 13731 19.01.16 PUT	USD	-415,149	-349,778	-0.14
-352,000	USD(P)/INR(C)OTC JAN 65.99 19.01.16 PUT	USD	-109,478	-112,626	-0.04
-352,000	USD(P)/TRY(C)OTC JAN 2.854 19.01.16 PUT	USD	-359,868	-72,887	-0.03
-352,000	USD(P)/ZAR(C)OTC JAN 14.20 19.01.16 PUT	USD	-559,313	-20,151	-0.01
-6	VENTAS REIT JAN 55.00 15.01.16 CALL	USD	-54,497	-140,745	-0.05
-7	WELLTOWER JAN 67.50 15.01.16 CALL	USD	-38,148	-122,099	-0.05
有価証券ポートフォリオ合計			271,012,647	255,877,838	96.77
銀行預金				18,021,924	6.82
その他純資産 / （負債）				-9,480,056	-3.59
合計				264,419,706	100.00

（注１）ＵＢＰインベストメンツ株式会社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】

平成28年6月30日現在

資産総額	231,540,806円
負債総額	481,302円
純資産総額（ - ）	231,059,504円
発行済数量	282,127,347口
1単位当りの純資産額（ / ）	0.8190円

（参考）マザーファンドの現況

損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成28年6月30日現在

資産総額	13,682,971,987円
負債総額	426,490,000円
純資産総額（ - ）	13,256,481,987円
発行済数量	9,179,803,763口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.4441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】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1) 資本金の額（平成28年6月末現在）

資本金の額	1,550百万円
会社が発行する株式の総数	50,000株
発行済株式総数	24,085株
最近5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。	

(2) 会社の機構（平成28年6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。また、その選任決議は、累積投票によらないものとしします。

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。増員により、または補欠として選任された取締役の任期は、他の在任取締役の任期終了と同時に終了します。

取締役会の決議によって、代表取締役を選定します。また、取締役会長、取締役社長各1名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役社長が招集し、議長となります。取締役社長に事故あるときは、あらかじめ取締役会で定めた順序により、他の取締役がその任にあたります。取締役会の招集通知は会日の3日前までに発します。ただし、緊急の必要のある場合には、この期間を短縮することができます。

取締役会は、法令または定款に別段の定めがある場合のほか、業務執行に関する重要事項を決定します。その決議は、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

投資運用の意思決定機構

- ・ 投信投資戦略会議は、ファンドの基本運用方針の分析と決定を行います。
- ・ 各資産投資戦略会議は、投信投資戦略会議の基本運用方針に基づき、ファンドの運用戦略を決定し、各運用担当部が運用計画を策定します。
銘柄の選定にあたっては「いかなる資産も本来の投資価値を有しており、市場価格は中長期的にはこの投資価値に収束する。したがって、市場価格と投資価値の乖離が超過収益の源泉となる。」という当社の投資哲学に基づき、各資産、市場、銘柄の割安・割高の度合いを算出するために、各々の「本来あるべき投資価値」を分析することに注力しています。
- ・ 各運用担当部で策定された運用計画に基づき、運用管理部トレーディング室が最良執行の観点から売買を執行します。
- ・ 運用状況の分析・評価等は運用担当部で行い、投信投資戦略会議に報告されます。また、売買チェック、リスク管理、各種法令、ガイドライン遵守の状況は、コンプライアンス・リスク管理部で確認を行い、コンプライアンス・リスク管理委員会に報告されます。



2【事業の内容及び営業の概況】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

「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。）は平成28年6月末現在、計131本（追加型株式投資信託108本、単位型株式投資信託18本、単位型公社債投資信託5本）であり、その純資産総額の合計は676,268百万円です。

3【委託会社等の経理状況】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

- 1．委託会社である損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

		前事業年度 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(千円)		金額(千円)	
(資産の部)					
流動資産					
1 現金・預金			3,896,094		4,375,837
2 前払費用			94,024		81,218
3 未収委託者報酬			814,705		754,788
4 未収運用受託報酬			319,881		521,498
5 未収収益			107		149
6 繰延税金資産			85,853		137,932
7 その他			84		421
流動資産合計			5,210,750		5,871,846
固定資産					
1 有形固定資産					
(1) 建物	* 1		45,249		37,899
(2) 器具備品	* 1		12,797		13,712
有形固定資産合計			58,046		51,612
2 無形固定資産					
(1) 電話加入権			4,535		4,535
無形固定資産合計			4,535		4,535
3 投資その他の資産					
(1) 投資有価証券			135,587		128,043
(2) 関係会社株式			122		-
(3) 長期差入保証金			161,636		161,598
(4) 繰延税金資産			132,485		133,008
(5) その他			29		29
投資その他の資産合計			429,859		422,678
固定資産合計			492,441		478,826
資産合計			5,703,191		6,350,672

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

（２）【損益計算書】

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

		前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
区分	注記 番号	金額（千円）		金額（千円）	
11 役員賞与引当金繰入		11,400		9,600	
12 固定資産減価償却費		14,237		13,042	
13 諸経費		183,804	1,964,036	205,813	2,045,605
営業利益			1,747,864		1,773,952
営業外収益					
1 受取配当金		2,211		90	
2 受取利息		464		657	
3 有価証券売却益		1,139		19	
4 有価証券償還益		18,285		-	
5 為替差益		2,259		-	
6 雑益		3,746	28,107	6,407	7,173
営業外費用					
1 為替差損		-		100	
2 雑損		221	221	0	100
経常利益			1,775,751		1,781,026
特別利益					
1 子会社清算益	* 1	124,873	124,873	-	-
特別損失					
1 固定資産除却損	* 2	31	31	663	663
税引前当期純利益			1,900,593		1,780,362
法人税、住民税及び事業税			702,469		659,040
法人税等調整額			43,579		52,602
当期純利益			1,241,702		1,173,924

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年４月１日 至 平成27年３月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	1,515,658	1,515,658	3,478,938
当期変動額						
剰余金の配当				1,007,036	1,007,036	1,007,036
当期純利益				1,241,702	1,241,702	1,241,702
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	234,666	234,666	234,666
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	1,750,324	1,750,324	3,713,604

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	11,764	11,764	3,490,702
当期変動額			
剰余金の配当			1,007,036
当期純利益			1,241,702
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	13,227	13,227	13,227
当期変動額合計	13,227	13,227	221,438
当期末残高	1,462	1,462	3,712,141

当事業年度（自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	1,750,324	1,750,324	3,713,604
当期変動額						
剰余金の配当				500,000	500,000	500,000
当期純利益				1,173,924	1,173,924	1,173,924
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	673,924	673,924	673,924
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	2,424,248	2,424,248	4,387,528

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,462	1,462	3,712,141
当期変動額			
剰余金の配当			500,000
当期純利益			1,173,924
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	6,342	6,342	6,342
当期変動額合計	6,342	6,342	667,582
当期末残高	7,804	7,804	4,379,723

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	15年
器具備品	3～20年

(2) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

4．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。

(2) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、当事業年度における支給見込額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における要支給額を計上しております。

退職給付債務の計算に当たっては、「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号）に定める簡便法によっております。

5．消費税等の会計処理方法

税抜方式を採用しております。

（未適用の会計基準等）

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

(1) 概要

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

（分類1）から（分類5）に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い

（分類2）及び（分類3）に係る分類の要件

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

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

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

（２）適用予定日

平成29年３月期の期首より適用予定であります。

（３）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当事業年度の財務諸表の作成時において評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

* 1．有形固定資産の減価償却累計額は、次のとおりであります。

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

* 2．関係会社項目

関係会社に対する負債は、次のとおりであります。

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

（損益計算書関係）

* 1．特別利益の子会社清算益の内容は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
米国の100%子会社であつた TACT ASSET MANAGEMENT INC.の清算終了によるものであります。		-

* 2．固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
器具備品	31千円	663千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成26年 4 月 1 日 至 平成27年 3 月31日）

１．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度 期首株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
普通株式	24,085株	- 株	- 株	24,085株

２．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

３．新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

４．剰余金の配当に関する事項

（１）配当金支払額

（決議）	株式の種類	配当金の 総額	１株当たり 配当額	基準日	効力発生日
平成26年 6 月25日 定時株主総会	普通株式	407,036千円	16,900円	平成26年 3 月31日	平成26年 6 月26日
平成27年 3 月27日 臨時株主総会	普通株式	600,000千円	24,911円	平成26年 3 月31日	平成27年 3 月31日

（２）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31日）

１．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度 期首株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
普通株式	24,085株	- 株	- 株	24,085株

２．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

３．新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4．剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

（決議）	株式の種類	配当金の総額	1株当たり配当額	基準日	効力発生日
平成28年3月29日 取締役会	普通株式	500,000千円	20,759円	平成27年3月31日	平成28年3月31日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの
該当事項はありません。

(金融商品関係)

1．金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社では、主として短期的な預金及び一部の有価証券によって運用しており、経営として許容できる範囲内にリスクを制御するよう、適切に資産運用を行っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は、主に投資信託を保有しており、今後の基準価額の下落によっては、売却損・評価損計上による利益減少や、評価差額金の減少により純資産が減少するなど、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、短期的な預金について、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

価格変動リスクについては、四半期ごとに時価の状況等を把握し、当該状況については資産運用管理規程に従い、経理担当部が取締役会等へ報告し、適切に管理を行っております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2．金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含めておりません（注2．参照）。

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	3,896,094	3,896,094	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	119,837	119,837	-
資産計	4,015,931	4,015,931	-
(1) 未払法人税等	583,342	583,342	-
負債計	583,342	583,342	-

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	4,375,837	4,375,837	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	112,293	112,293	-
資産計	4,488,131	4,488,131	-
(1) 未払法人税等	346,936	346,936	-
負債計	346,936	346,936	-

注1．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券取引に関する事項

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

注2．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
非上場株式	15,750	15,750
関係会社株式	122	-

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、

「(2) 投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

また、関係会社株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、時価開示の対象としておりません。

注３．金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成27年３月31日）

（単位：千円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 １０年以内	１０年超
(１) 預金	3,896,001	-	-	-
(２) 投資有価証券				
その他有価証券のうち 満期があるもの				
株式	-	-	-	-
債券	-	-	-	-
その他	-	1,316	118,520	-
合計	3,896,001	1,316	118,520	-

当事業年度（平成28年３月31日）

（単位：千円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 １０年以内	１０年超
(１) 預金	4,375,515	-	-	-
(２) 投資有価証券				
その他有価証券のうち 満期があるもの				
株式	-	-	-	-
債券	-	-	-	-
その他	-	96	112,197	-
合計	4,375,515	96	112,197	-

注４．社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

１．売買目的有価証券

該当事項はありません。

２．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

３．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式 122千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4．その他有価証券で時価のあるもの

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差 額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	1,217	1,200	17
	小 計	1,217	1,200	17
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	118,619	120,100	1,480
	小 計	118,619	120,100	1,480
合計		119,837	121,300	1,462

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差 額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	-	-	-
	小 計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	112,293	120,098	7,804
	小 計	112,293	120,098	7,804
合計		112,293	120,098	7,804

5．売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	42,174	1,171	31
合計	42,174	1,171	31

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要（出向受入者に対する出向元への退職金負担額を除く。）

当社は、従業員の退職給付に充てるため、非積立型の確定給付制度及び確定拠出制度を採用しております。

退職一時金制度（非積立型制度であります。）では、退職給付として、給与と勤務期間に基づいた一時金を支給しております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	59,903	千円
退職給付費用	13,437	
退職給付の支払額	9,032	
退職給付引当金の期末残高	64,308	

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

非積立型制度の退職給付債務	64,308	千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	64,308	
退職給付引当金	64,308	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	64,308	

(3) 退職給付に係る負債

簡便法で計算した退職給付費用	13,437	千円
----------------	--------	----

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、10,316千円でありました。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要（出向受入者に対する出向元への退職金負担額を除く。）

当社は、従業員の退職給付に充てるため、非積立型の確定給付制度及び確定拠出制度を採用しております。

退職一時金制度（非積立型制度であります。）では、退職給付として、給与と勤務期間に基づいた一時金を支給しております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	64,308	千円
退職給付費用	17,374	
退職給付の支払額	6,008	
退職給付引当金の期末残高	75,674	

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

非積立型制度の退職給付債務	75,674	千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	75,674	
退職給付引当金	75,674	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	75,674	

(3) 退職給付に係る負債

簡便法で計算した退職給付費用	17,374	千円
----------------	--------	----

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、10,921千円でありました。

（ストック・オプション等関係）

該当事項はありません。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

３．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引き下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の33.1%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.9%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、30.6%になります。

その税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は19,903千円減少し、法人税等調整額が同額増加しております。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

１．当該資産除去債務の概要

本社事務所の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

２．当該資産除去債務の金額の算定方法

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

３．当該資産除去債務の総額の増減

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

（セグメント情報等）

セグメント情報

当社は、投資運用事業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

（１）財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等
記載すべき重要な取引はありません。

（２）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
記載すべき重要な取引はありません。

（３）財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 平成26年４月１日 至 平成27年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 （千円）	事業の内容	議決権等 の所有 （被所有） 割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜ひまわり生命保険株式会社	東京都新宿区	17,250,000	生命保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用の一任（注１）	運用受託報酬の受取り	188,089	未収運用受託報酬	102,679
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜ＤＣ証券株式会社	東京都新宿区	3,000,000	確定拠出年金業	-	投資信託に係る事務代行の委託等（注２）	投資信託代行手数料の支払い	371,167	未払手数料	92,290

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

２．取引条件ないし取引条件の決定方針等

（注１） 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

（注２） 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

当事業年度（自 平成27年４月１日 至 平成28年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 （千円）	事業の内容	議決権等 の所有 （被所有） 割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜ひまわり生命保険株式会社	東京都新宿区	17,250,000	生命保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用の一任（注１）	運用受託報酬の受取り	189,203	未収運用受託報酬	101,258
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜ＤＣ証券株式会社	東京都新宿区	3,000,000	確定拠出年金業	-	投資信託に係る事務代行の委託等（注２）	投資信託代行手数料の支払い	407,134	未払手数料	86,317

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

２．取引条件ないし取引条件の決定方針等

（注１） 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

（注２） 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

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

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

（１）親会社情報

損保ジャパン日本興亜ホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）

（２）重要な関連会社の要約財務情報

関連会社はありません。

（１株当たり情報）

	前事業年度 (自 平成26年 4 月 1 日 至 平成27年 3 月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31日)
1株当たり純資産額	154,126.69円	181,844.45円
1株当たり当期純利益金額	51,555.01円	48,740.88円

（注）１．潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

２．１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成26年 4 月 1 日 至 平成27年 3 月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31日)
当期純利益（千円）	1,241,702	1,173,924
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益（千円）	1,241,702	1,173,924
期中平均株式数（株）	24,085	24,085

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1) 受託会社

名称

みずほ信託銀行株式会社（再信託受託会社：資産管理サービス信託銀行株式会社）

資本金の額

247,369百万円（平成28年3月末現在）

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

<再信託受託会社の概要>

名称：資産管理サービス信託銀行株式会社

資本金の額：50,000百万円（平成28年3月末現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約に係る信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（資産管理サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

（単位：百万円、平成28年3月末現在）

名 称	資本金の額	事業の内容
エイチ・エス証券株式会社	3,000	「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。
株式会社SBI証券	47,937	
岡三オンライン証券株式会社	1,000	
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	
マネックス証券株式会社	12,200	
楽天証券株式会社	7,495	
株式会社新生銀行	512,204	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

第3【その他】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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



ご投資家のみなさまへ

「好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 通貨セレクト・プレミアムコース（愛称:トリプルストラテジーNEO）」は、米国の大手運用会社（TCW）が厳選する世界のリート等に投資するファンドです。

以下の収入を高める戦略により、収益獲得を目指します。

1. 好配当のリート等から得られる配当収入
2. リート等を一定の値段で購入できる権利（コールオプション）を売却することによる収入
3. 高金利通貨との為替取引を行うことによる金利差収入
4. 高金利通貨を対米ドルで一定の値段で購入できる権利（コールオプション）を売却することによる収入

コールオプションの売却により収入を得ますが、リート等や高金利通貨の値上がり益の一部または全部を享受することはできません。なお、リート等や高金利通貨が値下がりする場合のリスクはご負担いただきます。

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント



独立監査人の監査報告書

平成28年8月10日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 小 澤 裕 治 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志 保 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 通貨セレクト・プレミアムコースの平成27年12月19日から平成28年6月20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、好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 通貨セレクト・プレミアムコースの平成28年6月20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

平成 28 年 6 月 3 日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 小 澤 裕 治 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 羽 柴 則 央 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の平成 27 年 4 月 1 日から平成 28 年 3 月 31 日までの第 31 期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の平成 28 年 3 月 31 日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

（注）１．上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

２．XBRL データは監査の対象には含まれていません。