

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年9月19日提出
【発行者名】	損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 山口 裕之
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋二丁目2番16号
【事務連絡者氏名】	須田 静
【電話番号】	03-5290-3469
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ターゲット・リターン戦略ファンド
【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29年12月4日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）につきまして、半期報告書の提出に伴い、訂正すべき事項がありましたので、これを訂正するものであります。

2【訂正の内容】

原届出書の該当情報を以下の内容に訂正します。

下線部_____は訂正内容を示します。

第一部【証券情報】

（３）【発行（売出）価額の総額】

<訂正前>

当初申込期間 1,000億円を上限とします。

継続申込期間 1兆円を上限とします。

（略）

<訂正後>

1兆円を上限とします。

（略）

（４）【発行（売出）価格】

<訂正前>

当初申込期間 1口当たり1円とします。

継続申込期間 取得申込受付日¹の翌営業日の基準価額²とします。

（略）

1日本における委託会社および販売会社（受益権の取得の申込みの取扱いを行う第一種金融商品取引業を行う者及び登録金融機関を総称して、以下「販売会社」といいます。）の営業日に限り、申込みの取扱いは行われます。ただし、継続申込期間中であっても下記の取得申込不可日にあたる日は取得のお申込みの受付はできません。

（略）

<訂正後>

取得申込受付日¹の翌営業日の基準価額²とします。

（略）

1日本における委託会社および販売会社（受益権の取得の申込みの取扱いを行う第一種金融商品取引業を行う者及び登録金融機関を総称して、以下「販売会社」といいます。）の営業日に限り、申込みの取扱いは行われます。ただし、下記の取得申込不可日にあたる日は取得のお申込みの受付はできません。

（略）

（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（当初申込期間中は1口当たり1円）に、2.16%（税抜2.0%）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。

（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、2.16%（税抜2.0%）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。

（略）

（７）【申込期間】

<訂正前>

当初申込期間 平成29年12月20日

継続申込期間 平成29年12月21日から平成31年3月22日までです。

（略）

<訂正後>

継続申込期間 平成29年12月21日から平成31年3月22日までです。

（略）

（ 9 ） 【 払込期日 】

< 訂正前 >

当初申込期間

ファンドの受益権の取得申込者は、当初申込期間中にお申込代金を販売会社に支払います。

当初申込期間中に、投資家から申込まれた募集に係る取得申込受付日の発行価額の総額は、設定日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

継続申込期間

ファンドの受益権の取得申込者は、お申込代金を販売会社に支払います。払込期日は販売会社によって異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

継続申込期間中に、投資家から申込まれた募集に係る各取得申込受付日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

< 訂正後 >

ファンドの受益権の取得申込者は、お申込代金を販売会社に支払います。払込期日は販売会社によって異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

投資家から申込まれた募集に係る各取得申込受付日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

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 】

< 訂正前 >

（略）

< ファンドの特色 >

（略）



基準配分比率は、日本株式および先進国株式部分をそれぞれ10%とし、日本債券および先進国債券部分をそれぞれ40%とします。

各資産への配分比率は、中期的な運用収益目標を目指し、当社開発のモデルに基づく一貫した投資判断(定量判断)により決定のうえ、機動的にリバランスします。

- 中期的な運用収益目標(年率4%程度・円ベース)を目指します。

※運用収益目標とは、必ずしも一定の収益を獲得できる運用を意味するものではなく、上記の数値は、その達成を示唆・保証するものではありません。したがって投資者の元本が保証されるものではなく、当ファンドの基準価額は下落する可能性があります。

※運用収益目標は、運用管理費用(信託報酬)等控除後のものです。

- 基準価額の下落リスクを抑制するため、純資産総額に対して日本株式および先進国株式部分の割合を0%まで引き下げ、短期金融資産を50%まで保有する場合があります。

＜＜基準配分比率＞＞



資産	基準配分比率	変動幅	組入範囲
日本株式	10%	±10%	0～20%
先進国株式	10%	±10%	0～20%
日本債券	40%	-22%～+15%	18～55%
先進国債券	40%	-22%～+15%	18～55%

※組入資産の価格変動や市況の動向等によっては、各資産の実際の組入比率は上記比率と異なる場合があります。必ずしも上記の通り運用することを示すものではありません。

(略)

<訂正後>

(略)

<ファンドの特色>

(略)



基準配分比率は、日本株式および先進国株式部分をそれぞれ10%とし、日本債券および先進国債券部分をそれぞれ40%とします。

各資産への配分比率は、中期的な運用収益目標を目指し、当社開発のモデルに基づく一貫した投資判断(定量判断)により決定のうえ、機動的にリバランスします。

●中期的な運用収益目標(年率4%程度・円ベース)を目指します。

※運用収益目標とは、必ずしも一定の収益を獲得できる運用を意味するものではなく、上記の数値は、その達成を示唆・保証するものではありません。したがって投資者の元本が保証されるものではなく、当ファンドの基準価額は下落する可能性があります。

※運用収益目標は、運用管理費用(信託報酬)等控除後のものです。

●基準価額の下落リスクを抑制するため、純資産総額に対して日本株式および先進国株式部分の割合を0%まで引き下げ、短期金融資産を50%まで保有する場合があります。

＜＜基準配分比率＞＞



資産	基準配分比率	変動幅	組入範囲
日本株式	10%	±10%	0～20%
先進国株式	10%	±10%	0～20%
日本債券	40%	-22%～+15%	18～55%
先進国債券	40%	-22%～+15%	18～55%

※組入資産の価格変動や市況の動向等によっては、各資産の実際の組入比率は上記比率と異なる場合があります。必ずしも上記の通り運用することを示すものではありません。

(略)

(2) 【ファンドの沿革】

< 訂正前 >

平成29年12月21日 信託契約締結、設定、運用開始(予定)

< 訂正後 >

平成29年12月21日 信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

(略)

委託会社等の概況

() 資本金の額 1,550百万円 (平成29年9月末現在)

(略)

() 大株主の状況 (平成29年9月末現在)

(略)

< 訂正後 >

(略)

委託会社等の概況

() 資本金の額 1,550百万円 (平成30年6月末現在)

(略)

() 大株主の状況 (平成30年6月末現在)

(略)

2【投資方針】

（2）【投資対象】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）とします。

- イ．有価証券
- ロ．金銭債権
- ハ．約束手形

委託会社は、信託金を、主として別に定める投資信託証券（投資信託および外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。））ならびに投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）をいいます。以下同じ。）のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前記1.の証券または証書の性質を有するもの
- 3．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）
- 4．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 5．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前記3.の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとしします。

別に定める投資信託証券とは次のものをいいます。

親投資信託 損保ジャパン日本債券マザーファンド

親投資信託 損保ジャパン外国債券マザーファンド

追加型投資信託証券 T O P I X 連動型上場投資信託

追加型投資信託証券 iシェアーズ TOPIX ETF

追加型投資信託証券 M A X I S トピックス上場投信

追加型投資信託証券 iシェアーズ MSCI コクサイ ETF

追加型投資信託証券 iシェアーズ・コア MSCI 先進国株（除く日本）ETF

追加型投資信託証券 M A X I S 海外株式（M S C I コクサイ）上場投信

追加型投資信託証券 SPDR S&P 500 ETF

追加型投資信託証券 iシェアーズ・コアS&P500 ETF

追加型投資信託証券 バンガード・トータル・ストック・マーケットETF

追加型投資信託証券 iシェアーズ・コア MSCI ヨーロッパETF

追加型投資信託証券 バンガード・FTSE・ヨーロッパETF

委託会社は、信託金を、前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形

前記の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前記に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（参考）指定投資信託証券の概要

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	<ul style="list-style-type: none"> ・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	平成12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。
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

名称	損保ジャパン外国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	主として日本を除く先進各国の政府、政府機関等の発行する外国債券を中心に分散投資を行い、国内債より相対的に高いインカムの確保を図るとともに金利低下や格付け上昇に伴うキャピタルゲインの獲得を狙い、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）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	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%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	平成12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。

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

名称	TOPIX連動型上場投資信託
形態	国内籍投資信託
運用の基本方針	東証株価指数(TOPIX)に連動する投資成果を目指します。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・委託者が投資することを指図する株式は、東京証券取引所第一部に上場(上場予定を含みます。)している銘柄のうち、TOPIXに採用されているまたは採用が決定された銘柄の株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
信託期間	無期限
決算日	7月10日
取引通貨	円
運用管理費用(信託報酬)	<p>信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、次のにより計算した額に、次のにより計算した額を加えて得た額とします。ただし、次のにより計算した額(税抜)に、次のにより計算した額(税抜)を加算して得た額は、信託財産の純資産総額に年10,000分の24を乗じて得た額から受益権の上場に係る費用および東証株価指数の商標(これに類する商標を含みます。)の使用料(以下、「商標使用料」といいます。)のうち受益者負担とした額を控除した額を超えないものとします。</p> <p>信託財産の純資産総額に年10,000分の25.92(税抜年10,000分の24)以内で委託者が定める率を乗じて得た額とします。</p> <p>株式の貸付を行なった場合は、その品貸料の54%(税抜50%)以内の額。委託会社と受託会社の配分については折半とします。</p>
その他の費用・手数料	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支払われます。
運用会社	野村アセットマネジメント株式会社

名称	iシェアーズ TOPIX ETF
形態	国内籍投資信託
運用の基本方針	東証株価指数(TOPIX)の動きと高位に連動することを目指します。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式以外の資産への投資は、原則として信託財産総額の、50%未満とします。 ・外貨建資産への投資は、原則、行ないません。
信託期間	無期限
決算日	2月9日、8月9日
取引通貨	円
運用管理費用(信託報酬)	計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.0648%(税抜0.06%)以内で委託会社が定める率を乗じて得た金額とします。
その他の費用・手数料	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息等、信託財産に係る監査費用等は、受益者の負担とし、信託財産中から支払われます。
運用会社	ブラックロック・ジャパン株式会社

名称	MAXIS トピックス上場投信
形態	国内籍投資信託
運用の基本方針	東証株価指数(TOPIX)の値動きに連動する投資成果を目指します。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合には制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・投資信託証券への投資は行いません。 ・同一銘柄の株式への投資割合に制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	1月16日、7月16日
取引通貨	円
運用管理費用 （信託報酬）	<p>委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、以下により計算されるとの合計額とします。</p> <p>ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.08424%以内（税抜年0.078%以内）の率を乗じて得た額</p> <p>信託約款に規定する有価証券の貸付の指図を行った場合は、その品貸料の54%以内（税抜50%以内）の額</p> <p>上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。</p>
その他の費用・手数料	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支払われます。
運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社

名称	iシェアーズ MSCI コクサイ ETF
形態	米国籍投資信託
運用の基本方針	M S C I コクサイ・インデックスの動きと高位に連動することを目指します。
主な投資制限	・ M S C I コクサイ・インデックス構成銘柄以外への投資は10%以内とします。
信託期間	無期限
決算日	7月末
取引通貨	USドル
管理報酬等	計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.25%
その他の費用・手数料	支払利息、信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、その他特別費用などは受益者の負担とし、信託財産中から支払われます。
運用会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ

名称	iシェアーズ・コア MSCI 先進国株（除く日本）ETF
形態	国内籍投資信託
運用の基本方針	M S C I コクサイ・インデックス（国内投信用 円建て）の動きと高位に連動することを目指します。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式の投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
信託期間	無期限
決算日	2月9日、8月9日
取引通貨	円

運用管理費用 （信託報酬）	<p>ファンドの実質的な信託報酬（ + ）は、信託財産の純資産総額に対し年0.2052%（税抜0.19%）以内となります。</p> <p>投資する上場投資信託証券の投資比率や報酬率が変更になる可能性があり、実質的な負担についても変動することがあります。</p> <p>当ファンドの信託報酬</p> <p>計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.2052%（税抜0.19%）以内で委託会社が定める率を乗じて得た金額とします。</p> <p>投資する上場投資信託証券に係る報酬等</p> <p>投資する上場投資信託証券において報酬等がかかりますが、投資銘柄や組入比率は固定されていないため、事前に料率、上限額などを表示することができません。また、報酬等は、上場投資信託証券の運用会社等に支払われます。</p>
その他の費用・手数料	<p>上場に係る費用、対象指数の商標の使用料について、ファンドの純資産総額の年0.0486%（税抜0.045%）を上限として、毎計算期末、または信託終了のときファンドから支払うことができます。</p> <p>信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支払われます。</p>
運用会社	ブラックロック・ジャパン株式会社

名称	MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信
形態	国内籍投資信託
運用の基本方針	日本円換算したMSCIコクサイ・インデックスの値動きに連動する投資成果を目指します。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・外貨建資産への直接投資は行いません。 ・投資信託証券への投資割合に制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	6月8日、12月8日
取引通貨	円
運用管理費用 （信託報酬）	<ul style="list-style-type: none"> ・委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、以下により計算されます。 <p>信託財産の純資産総額×年0.162%（税抜年0.15%）以内の率</p> <p>上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・受益者が負担する実質的な信託報酬率は、次の通りとなります。 <p>年0.27%（税込）程度</p> <p>（注）上記は、投資対象とする投資信託証券における信託報酬率を含めた実質的な信託報酬率を算出したものです。各投資信託証券への投資比率が変動する可能性や投資信託証券の変更の可能性があることから、実質的な信託報酬率は変動します。したがって事前に固定の料率、上限額等を表示することはできません。</p>
その他の費用・手数料	<p>信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支払われます。</p>
運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社

名称	SPDR S&P 500 ETF
形態	米国籍投資信託
運用の基本方針	S&P 500指数の値動きと利回りのパフォーマンスに、経費控除前で概ね連動する投資成果を上げることを目標とします。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ポートフォリオを構成する証券またはその他の資産の貸付けは行いません。 ・証券投資の目的のため優先証券を発行しまたは金銭を借入れることは行いません。 ・証券を空売りしまたはデリバティブ商品（先物取引、オプションまたはスワップを含みますがこれらに限りません。）への投資は行いません。
信託期間	(a) 2118年1月22日または(b) 信託契約で指名されている11名の者（うち最も年上の者は1990年生まれ、最も若い者は1993年生まれ）の最後の生存者が死亡してから20年が経過した日のうち、いずれか早い方の年月日
決算日	9月30日
取引通貨	USドル
管理報酬等	年率0.0945% 今後の費用発生額は、主として本信託の純資産および費用の水準によります。
その他の費用・手数料	本信託により発行される証券（ユニット）の流通市場における売買には、ブローカー手数料および税金が課される他、その他実費が信託財産中から支払われます。
運用会社	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・トラスト・カンパニー

名称	iシェアーズ・コアS&P500 ETF
形態	米国籍投資信託
運用の基本方針	米国の大型株で構成されるS&P 500指数に連動する投資成果を目指します。
主な投資制限	S&P 500指数の構成銘柄以外への投資は10%以内とします。
信託期間	無期限
決算日	3月末
取引通貨	USドル
管理報酬等	年率0.04%
その他の費用・手数料	支払利息、信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、その他特別費用などは受益者の負担とし、信託財産中から支払われます。
運用会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ

名称	バンガード・トータル・ストック・マーケットETF
形態	米国籍投資信託
運用の基本方針	CRSP USトータル・マーケット・インデックスのパフォーマンスへの連動を目指します。
主な投資制限	・総資産の75%について、ファンドは（1）単一発行体の発行済議決権付証券の10%以上を購入し、または（2）その結果、ファンドの総資産の5%以上が当該証券の発行体に投資されることとなるような場合に証券を購入することはできません。本制限は米国政府またはその機関、または下部機構の債務には適用されません。
信託期間	無期限
決算日	12月31日
取引通貨	USドル
管理報酬等	年率0.04%
運用会社	ザ・バンガード・グループ・インク

名称	iシェアーズ・コア MSCI ヨーロッパETF
----	-------------------------

形態	米国籍投資信託
運用の基本方針	欧州地域の先進国市場の大型株、中型株および小型株で構成されるMSCI Europe Investable Market指数に連動する投資成果を目指します。
主な投資制限	MSCI Europe Investable Marketの構成銘柄以外への投資は10%以内とします。
信託期間	無期限
決算日	7月末
取引通貨	USドル
管理報酬等	年率0.10%
その他の費用・手数料	支払利息、信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、その他特別費用などは受益者の負担とし、信託財産中から支払われます。
運用会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ

名称	バンガード・FTSE・ヨーロッパETF
形態	米国籍投資信託
運用の基本方針	FTSE欧州先進国オールキャップ・インデックスのパフォーマンスへの連動を目指します。
主な投資制限	・ファンドの総資産の75%について、ファンドは、いずれか単一発行体の発行済議決権付証券の10%以上を購入すること、結果的にファンドの総資産の5%以上が当該発行体の証券に投資されることとなるような場合に、当該発行体の証券を購入することはできません。本制限は、米国政府またはその機関もしくは下部組織の債務には適用されません。さらに、ファンドは、（1986年米国内国歳入法（改訂済）で定義される米国政府証券以外の）単一発行体の証券の保有総額が、課税年度の各四半期末時点でファンドの総資産の25%までに制限されます。
信託期間	無期限
決算日	10月31日
取引通貨	USドル
管理報酬等	年率0.10%
運用会社	ザ・バンガード・グループ・インク

上記指定投資信託証券は、平成30年6月末現在における投資対象とする投資信託証券であり、今後変更となる場合があります。

上記すべての投資信託証券に投資するとは限りません。

上記の内容（親投資信託を除く）は、作成時点に各ETFの直近の目論見書等で開示されているものです。運用管理費用（信託報酬）等は、今後変更される場合があります。上記のほか、対象株価指数に係る商標使用料や監査費用等の諸費用が発生する場合があります。

・東証株価指数（TOPIX）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。また、MSCI Europe Investable Market指数は、欧州地域の先進国市場の大型株、中型株および小型株で構成される指数です。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。

- ・ S&P 500指数は、米国の証券取引所に上場している銘柄のうち、25の産業グループにわたる代表的な500銘柄で構成される指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はStandard & Poor's Financial Services LLCに帰属します。
- ・ CRSP USトータル・マーケット・インデックスは、ニューヨーク証券取引所およびナスダックにおいて通常取引される大型株、中型株、小型株、超小型株を含む投資可能な米国市場で取引される株式のほぼ100%から構成される指数です。
- ・ FTSE欧州先進国オールキャップ・インデックスは、ヨーロッパの16ヵ国、大半が英国、フランス、スイスおよびドイツに所在する大、中、小規模の企業の普通株式により構成される時価総額加重型の指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はLondon Stock Exchange Group companiesに帰属します。

（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）

総合投資会議は、ファンドの基本運用方針の分析と決定を行います。

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

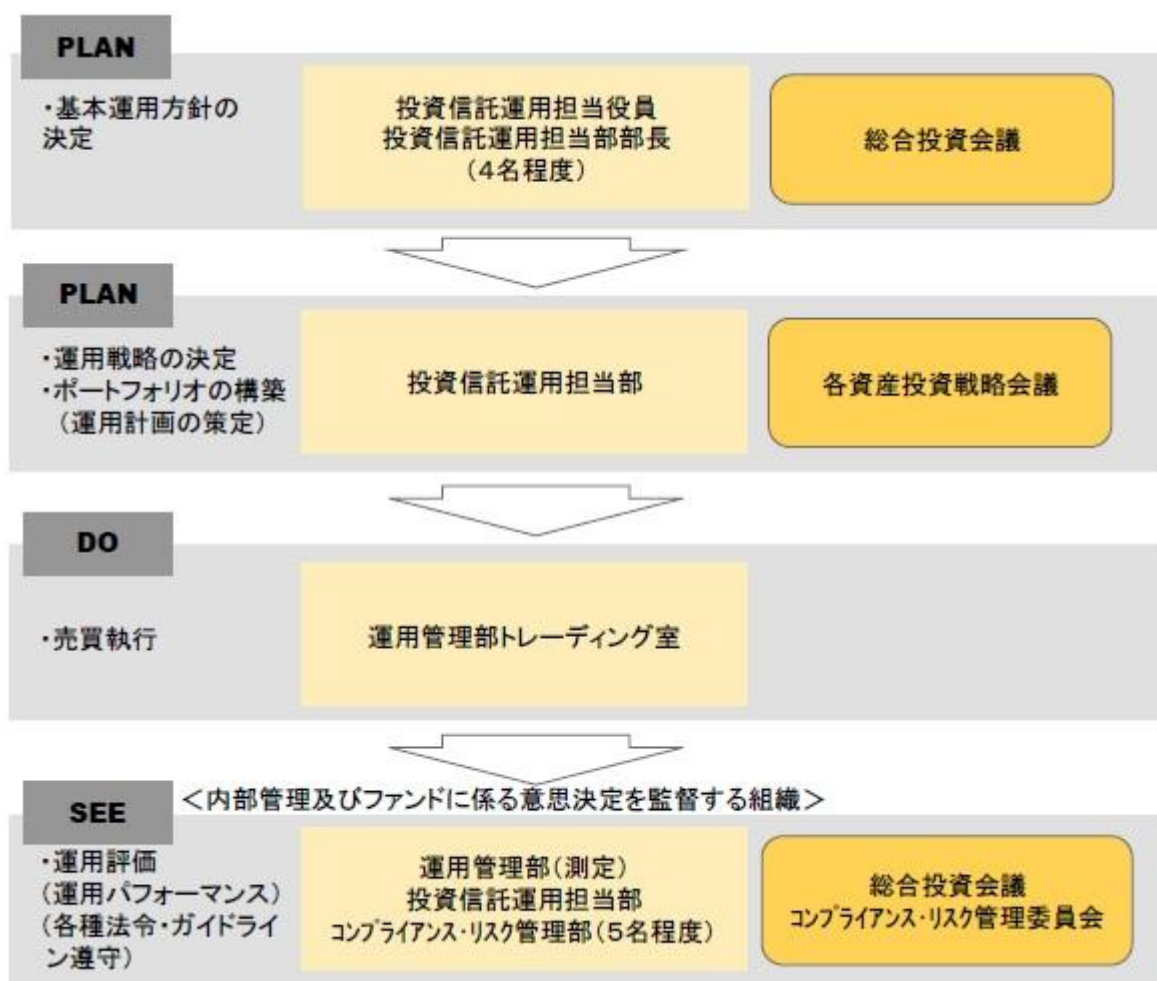
各運用担当部で策定された運用計画に基づき、運用管理部トレーディング室が最良執行の観点から売買を執行します。

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

（社内規程）

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

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



平成30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】

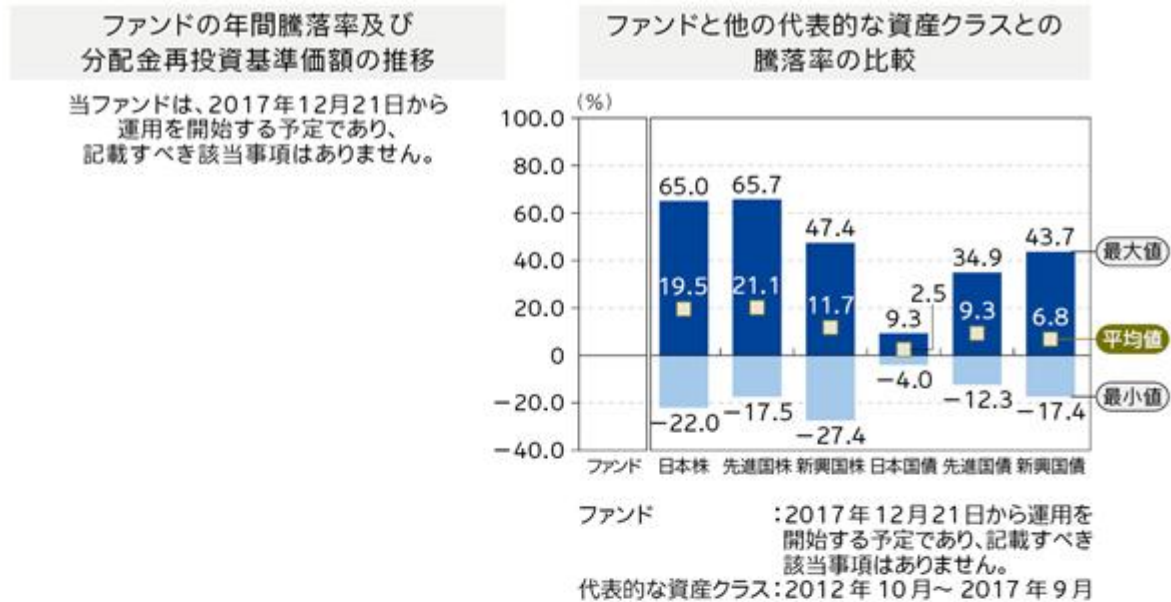
<訂正前>

(略)

<リスクの管理体制>

(略)

(注)上図は、平成29年9月末現在のものであり、今後変更されることもあります。



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

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

代表的な資産クラスの指数

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

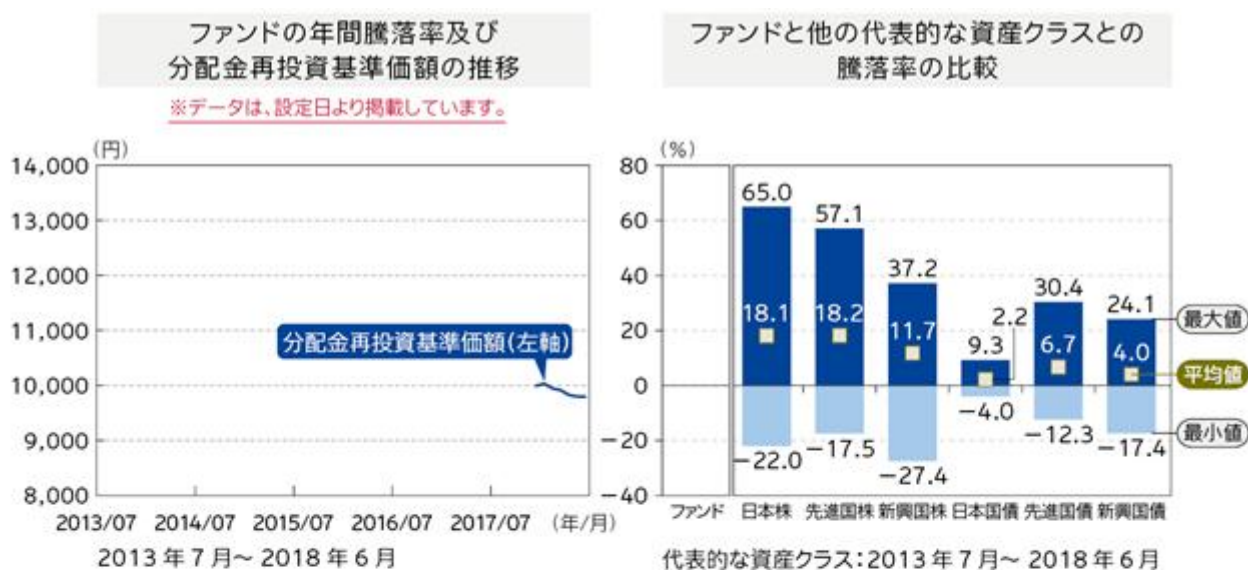
<訂正後>

(略)

<リスクの管理体制>

(略)

(注) 上図は、平成30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。



- 資料作成時において、ファンドの運用期間が1年未満のため、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。

代表的な資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

(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（当初申込期間中は1口当たり1円）に2.16%（税抜2.0%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。 申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。	販売会社によるファンドの商品説明・投資環境の説明・事務処理等の対価

(略)

<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2.16%（税抜2.0%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。 申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。	販売会社によるファンドの商品説明・投資環境の説明・事務処理等の対価

(略)

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

(略)

当ファンドが投資対象とする投資信託証券の運用管理費用（信託報酬）等を加えた当ファンドの実質的な信託報酬率は、当ファンドの純資産総額に対して年率1.00332%（税抜0.929%）程度となります。

各投資信託証券への投資比率が変動する可能性や投資信託証券の変更の可能性があることなどから、実質的な信託報酬率は変動することがあり、あらかじめ上限額等を記載することができません。そのため、実質的な信託報酬率は概算で表示しています。

当ファンドが投資対象とする投資信託証券の運用管理費用（信託報酬）等の詳細については、（参考）指定投資信託証券の概要をご参照ください。

上記の信託報酬等は、平成29年9月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(略)

<訂正後>

(略)

当ファンドが投資対象とする投資信託証券の運用管理費用（信託報酬）等を加えた当ファンドの実質的な信託報酬率は、当ファンドの純資産総額に対して年率1.00332%（税抜0.929%）程度となります。

各投資信託証券への投資比率が変動する可能性や投資信託証券の変更の可能性があることなどから、実質的な信託報酬率は変動することがあり、あらかじめ上限額等を記載することができません。そのため、実質的な信託報酬率は概算で表示しています。

当ファンドが投資対象とする投資信託証券の運用管理費用（信託報酬）等の詳細については、（参考）指定投資信託証券の概要をご参照ください。

上記の信託報酬等は、平成30年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(略)

（５）【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

（略）

上記は平成29年9月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

< 訂正後 >

（略）

上記は平成30年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30年6月29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	50,244,840	10.01
内 アメリカ	50,244,840	10.01
親投資信託受益証券	402,884,218	80.28
内 日本	402,884,218	80.28
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	48,744,850	9.71
純資産総額	501,873,908	100.00

その他資産の投資状況

平成30年6月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	51,930,300	10.35
内 日本	51,930,300	10.35

(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30年6月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	9,784,822,900	61.83
内 日本	9,684,618,100	61.19
内 メキシコ	100,204,800	0.63
特殊債券	780,451,998	4.93
内 日本	780,451,998	4.93
社債券	4,996,181,200	31.57
内 日本	4,276,500,800	27.02
内 フランス	619,771,900	3.92
内 イギリス	99,908,500	0.63
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	265,001,794	1.67
純資産総額	15,826,457,892	100.00

損保ジャパン外国債券マザーファンド

平成30年6月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	3,286,729,134	98.33
内 アメリカ	1,454,017,661	43.50
内 イタリア	441,966,302	13.22
内 フランス	339,327,591	10.15
内 ドイツ	274,782,375	8.22
内 イギリス	229,555,037	6.87
内 スペイン	198,979,182	5.95
内 ベルギー	92,446,922	2.77
内 カナダ	64,005,462	1.91
内 オランダ	41,312,869	1.24
内 メキシコ	40,324,384	1.21
内 アイルランド	26,521,882	0.79
内 デンマーク	21,684,096	0.65
内 シンガポール	21,404,904	0.64
内 スウェーデン	18,018,312	0.54
内 スイス	12,404,810	0.37
内 ノルウェー	9,977,345	0.30
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	55,954,413	1.67
純資産総額	3,342,683,547	100.00

その他資産の投資状況

平成30年6月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	3,258,723,940	97.49
内 日本	3,258,723,940	97.49

（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。

（注3）為替予約取引の時価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成30年6月29日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	損保ジャパン日本債券マザー ファンド 日本	親投資信託 受益証券	194,479,722	1.4126 274,741,149	1.4221 276,569,612	- -	55.11%
2	損保ジャパン外国債券マザー ファンド 日本	親投資信託 受益証券	79,423,168	1.6004 127,113,822	1.5904 126,314,606	- -	25.17%
3	ISHARES MSCI KOKUSAI ETF アメリカ	投資信託受 益証券	7,090	7,322.08 51,913,555	7,086.71 50,244,840	- -	10.01%

(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

平成30年6月29日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	10.01%
親投資信託受益証券	80.28%
合計	90.29%

(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30年6月29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 4 5 10年国債 日本	国債証券	1,140,000,000	100.75 1,148,600,800	101.01 1,151,593,800	0.100000 2026/12/20	7.28%
2	1 5 4 20年国債 日本	国債証券	930,000,000	112.42 1,045,568,000	113.71 1,057,521,600	1.200000 2035/9/20	6.68%
3	3 8 8 2年国債 日本	国債証券	880,000,000	100.44 883,920,800	100.44 883,872,000	0.100000 2020/5/15	5.58%
4	1 5 0 20年国債 日本	国債証券	710,000,000	116.03 823,839,900	116.92 830,146,200	1.400000 2034/9/20	5.25%
5	3 3 5 10年国債 日本	国債証券	750,000,000	103.60 777,063,600	103.62 777,187,500	0.500000 2024/9/20	4.91%
6	3 5 30年国債 日本	国債証券	550,000,000	128.84 708,628,700	130.39 717,156,000	2.000000 2041/9/20	4.53%
7	1 4 6 20年国債 日本	国債証券	440,000,000	120.88 531,905,600	121.17 533,148,000	1.700000 2033/9/20	3.37%
8	3 4 9 10年国債 日本	国債証券	430,000,000	100.62 432,666,000	100.80 433,452,900	0.100000 2027/12/20	2.74%
9	3 8 6 2年国債 日本	国債証券	410,000,000	100.44 411,816,200	100.40 411,640,000	0.100000 2020/3/15	2.60%
10	3 8 30年国債 日本	国債証券	280,000,000	126.71 354,810,400	126.92 355,376,000	1.800000 2043/3/20	2.25%

11	1 5 8 20年国債	日本	国債証券	280,000,000	99.49 278,572,000	101.35 283,788,400	0.500000 2036/9/20	1.79%
12	1 1 3 20年国債	日本	国債証券	230,000,000	123.23 283,433,600	122.32 281,347,500	2.100000 2029/9/20	1.78%
13	5 7 30年国債	日本	国債証券	270,000,000	100.39 271,065,600	102.44 276,593,400	0.800000 2047/12/20	1.75%
14	5 8 30年国債	日本	国債証券	220,000,000	102.07 224,565,000	102.33 225,132,600	0.800000 2048/3/20	1.42%
15	1 みずほFG劣後	日本	社債券	200,000,000	103.41 206,837,000	103.29 206,585,600	0.950000 2024/7/16	1.31%
16	5 6 8 東京電力	日本	社債券	200,000,000	102.37 204,743,500	102.11 204,232,400	1.155000 2020/9/8	1.29%
17	3 A 明治安田劣後FR	日本	社債券	200,000,000	100.00 200,000,000	101.34 202,684,000	1.110000 2047/11/6	1.28%
18	1 東京電力パワー	日本	社債券	200,000,000	100.30 200,615,300	100.37 200,759,800	0.380000 2020/3/9	1.27%
19	1 2 東京電力パワー	日本	社債券	200,000,000	100.00 200,000,000	100.30 200,619,200	0.440000 2023/4/19	1.27%
20	3 0 東レ	日本	社債券	200,000,000	99.93 199,865,200	100.22 200,448,800	0.375000 2027/7/16	1.27%
21	3 A 富国生命劣後FR	日本	社債券	200,000,000	98.27 196,540,000	99.51 199,020,000	1.020000 -	1.26%
22	1 3 0 20年国債	日本	国債証券	160,000,000	121.26 194,026,700	121.07 193,716,800	1.800000 2031/9/20	1.22%
23	1 4 8 20年国債	日本	国債証券	160,000,000	117.55 188,080,000	118.36 189,382,400	1.500000 2034/3/20	1.20%
24	1 0 40年国債	日本	国債証券	170,000,000	99.61 169,349,500	102.05 173,485,000	0.900000 2057/3/20	1.10%
25	1 4 4 20年国債	日本	国債証券	110,000,000	117.83 129,613,000	117.90 129,698,800	1.500000 2033/3/20	0.82%
26	5 4 7 東京電力	日本	社債券	120,000,000	104.00 124,808,400	103.64 124,375,200	1.948000 2020/7/24	0.79%
27	7 8 住宅機構RMB S	日本	特殊債券	108,794,000	103.96 113,113,121	104.10 113,254,554	1.080000 2048/11/10	0.72%
28	7 9 住宅機構RMB S	日本	特殊債券	108,704,000	103.97 113,030,418	104.05 113,106,512	1.070000 2048/12/10	0.71%
29	1 クレディ・A 劣後 フランス	フランス	社債券	100,000,000	108.15 108,151,200	107.27 107,270,000	2.114000 2025/6/26	0.68%
30	1 B P C E S . A . 劣後 フランス	フランス	社債券	100,000,000	107.10 107,100,900	106.68 106,681,300	2.047000 2025/1/30	0.67%

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年6月29日現在

種類	投資比率
国債証券	61.83%
特殊債券	4.93%
社債券	31.57%
合計	98.33%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

損保ジャパン外国債券マザーファンド

平成30年6月29日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US TREASURY N/B 1.875% 2022/02/28 アメリカ	国債証券	309,512,000	100.01 309,568,617	97.20 300,876,615	1.875000 2022/2/28	9.00%
2	US TREASURY N/B 2.25% 2020/02/29 アメリカ	国債証券	278,560,800	99.91 278,312,214	99.58 277,404,772	2.250000 2020/2/29	8.30%
3	BUNDESUBL-175 0.0% 2022/04/08 ドイツ	国債証券	254,540,900	101.48 258,317,954	101.78 259,074,273	- 2022/4/8	7.75%
4	US TREASURY N/B 2.125% 2024/02/29 アメリカ	国債証券	218,869,200	100.55 220,076,386	96.59 211,412,326	2.125000 2024/2/29	6.32%
5	US TREASURY N/B 1.25% 2019/06/30 アメリカ	国債証券	202,288,200	99.15 200,572,211	98.88 200,042,800	1.250000 2019/6/30	5.98%
6	US TREASURY N/B 2.75% 2028/02/15 アメリカ	国債証券	130,437,200	99.53 129,832,505	99.11 129,285,439	2.750000 2028/2/15	3.87%
7	BTPS 1.35% 2022/04/15 イタリア	国債証券	125,351,800	103.25 129,431,975	99.10 124,229,901	1.350000 2022/4/15	3.72%
8	FRANCE O.A.T. 0.0% 2022/05/25 フランス	国債証券	102,328,000	100.57 102,915,567	101.14 103,498,632	- 2022/5/25	3.10%
9	BTPS 2.2% 2027/06/01 イタリア	国債証券	104,886,200	103.85 108,929,435	96.26 100,966,602	2.200000 2027/6/1	3.02%
10	US TREASURY N/B 2.75% 2025/02/28 アメリカ	国債証券	84,010,400	100.40 84,351,692	99.63 83,707,962	2.750000 2025/2/28	2.50%
11	FRANCE O.A.T. 1.0% 2027/05/25 フランス	国債証券	76,746,000	101.53 77,927,300	104.25 80,007,705	1.000000 2027/5/25	2.39%
12	US TREASURY N/B 3.0% 2048/02/15 アメリカ	国債証券	75,167,200	96.48 72,527,597	100.38 75,454,338	3.000000 2048/2/15	2.26%
13	FRANCE O.A.T. 0.25% 2020/11/25 フランス	国債証券	70,094,680	101.58 71,204,688	101.78 71,347,972	0.250000 2020/11/25	2.13%
14	BTPS 4.0 2020/09/01 イタリア	国債証券	57,559,500	111.46 64,161,574	106.47 61,285,902	4.000000 2020/9/1	1.83%

15	BELGIAN 0328 2.25% 2023/06/22 ベルギー	国債証券	53,082,650	112.57 59,757,262	111.87 59,388,868	2.250000 2023/6/22	1.78%
16	FRANCE O.A.T. 4.5 2041/04/25 フランス	国債証券	30,698,400	159.18 48,867,452	161.09 49,452,973	4.500000 2041/4/25	1.48%
17	US TREASURY N/B 2.75% 2047/08/15 アメリカ	国債証券	40,899,800	99.17 40,562,892	95.47 39,049,493	2.750000 2047/8/15	1.17%
18	SPANISH GOVT 4.4% 2023/10/31 スペイン	国債証券	31,977,500	122.43 39,152,291	120.45 38,520,096	4.400000 2023/10/31	1.15%
19	BTPS 0.35% 2021/11/01 イタリア	国債証券	33,256,600	98.84 32,871,360	96.87 32,216,998	0.350000 2021/11/1	0.96%
20	US TREASURY N/B 2.75% 2042/11/15 アメリカ	国債証券	33,162,000	97.17 32,225,987	96.22 31,910,466	2.750000 2042/11/15	0.95%
21	BTPS 2.0% 2025/12/01 イタリア	国債証券	31,721,680	100.30 31,819,065	97.04 30,783,669	2.000000 2025/12/1	0.92%
22	BTPS 2.7% 2047/03/01 イタリア	国債証券	34,535,700	97.87 33,802,379	88.02 30,399,704	2.700000 2047/3/1	0.91%
23	UK TSY GILT 1.5% 2026/07/22 イギリス	国債証券	29,640,950	102.68 30,438,291	102.22 30,300,461	1.500000 2026/7/22	0.91%
24	SPANISH GOVT 0.45% 2022/10/31 スペイン	国債証券	29,419,300	100.40 29,537,117	100.87 29,677,307	0.450000 2022/10/31	0.89%
25	US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15 アメリカ	国債証券	18,791,800	130.92 24,602,412	126.91 23,849,425	4.625000 2040/2/15	0.71%
26	TREASURY 5% 2025/03/07 イギリス	国債証券	18,796,700	129.76 24,390,785	125.20 23,533,844	5.000000 2025/3/7	0.70%
27	BTPS 5.75 2/1/2033 イタリア	国債証券	17,907,400	137.99 24,711,853	130.59 23,385,631	5.750000 2033/2/1	0.70%
28	TREASURY 4.25 2036/03/07 イギリス	国債証券	16,627,850	138.61 23,048,860	139.65 23,220,958	4.250000 2036/3/7	0.69%
29	SPANISH GOVT 4.85% 2020/10/31 スペイン	国債証券	20,465,600	115.84 23,708,374	111.64 22,848,000	4.850000 2020/10/31	0.68%
30	SPANISH GOVT 4.7% 2041/07/30 スペイン	国債証券	15,349,200	140.48 21,562,658	142.69 21,902,540	4.700000 2041/7/30	0.66%

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年6月29日現在

種類	投資比率
国債証券	98.33%
合計	98.33%

（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】

平成30年6月29日現在

種類	地域	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約 取引	日本	アメリカ・ドル売/円買20 18年07月	売建	470,000	51,409,258	51,930,300	10.35%

(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) 為替予約取引の時価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(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

該当事項はありません。

損保ジャパン外国債券マザーファンド

平成30年6月29日現在

種類	地域	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約 取引	日本	アメリカ・ドル売/円買20 18年09月	売建	13,068,000	1,422,817,704	1,436,695,920	42.98%
		ユーロ売/円買2018年0 9月	売建	10,972,000	1,419,129,452	1,403,647,960	41.99%
		イギリス・ポンド売/円買2 018年09月	売建	1,568,000	230,127,520	226,246,720	6.77%
		カナダ・ドル売/円買201 8年09月	売建	764,000	64,131,688	63,450,200	1.90%
		メキシコ・ペソ売/円買20 18年09月	売建	7,413,000	38,866,359	40,771,500	1.22%
		シンガポール・ドル売/円買 2018年09月	売建	295,000	24,123,920	23,741,600	0.71%
		デンマーク・クローネ売/円 買2018年09月	売建	1,319,000	22,917,625	22,647,230	0.68%
		スウェーデン・クローナ売/ 円買2018年09月	売建	1,478,000	18,610,680	18,090,720	0.54%
		スイス・フラン売/円買20 18年09月	売建	115,000	12,861,485	12,763,850	0.38%
		ノルウェー・クローネ売/円 買2018年09月	売建	792,000	10,720,987	10,668,240	0.32%

(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) 為替予約取引の時価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成30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)
平成29年12月末日	509,579,210	-	0.9992	-
平成30年1月末日	511,890,664	-	1.0033	-
2月末日	508,055,734	-	0.9945	-
3月末日	509,408,140	-	0.9913	-
4月末日	505,120,725	-	0.9825	-
5月末日	502,271,824	-	0.9800	-
6月末日	501,873,908	-	0.9793	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
平成29年12月21日～ 平成30年6月20日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
平成29年12月21日～ 平成30年6月20日	1.9

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。
なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
平成29年12月21日～ 平成30年6月20日	514,675,263	2,234,696

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

< 参考情報 >

基準日:2018年6月29日

● 基準価額・純資産の推移 2017/12/21～2018/06/29



● 分配の推移

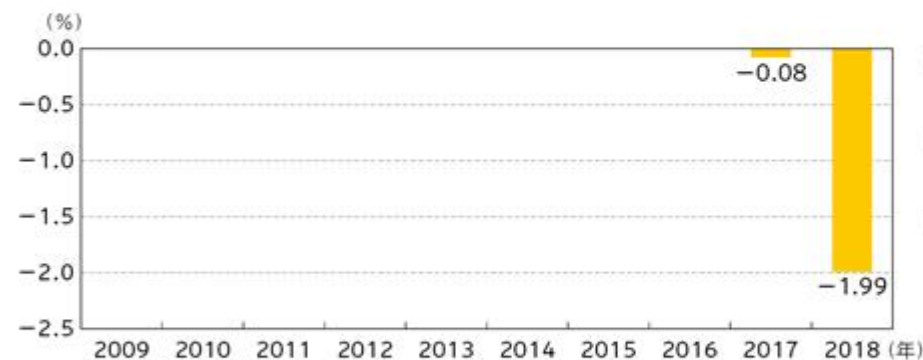
当ファンドの初回決算日は2018年12月25日のため、記載すべき該当事項はありません。

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

● 主要な資産の状況

組入上位10銘柄		
	銘柄名	純資産比
1	損保ジャパン日本債券マザーファンド	55.1%
2	損保ジャパン外国債券マザーファンド	25.2%
3	ISHARES MSCI KOKUSAI ETF	10.0%
4	—	—
5	—	—
6	—	—
7	—	—
8	—	—
9	—	—
10	—	—
組入銘柄数		3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。
- 2017年は設定日(12月21日)から年末、2018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。
- 最新の運用実績は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

(1) ファンドの受益権の取得申込みは、当初申込期間は販売会社の営業時間内にお申込みいただくことができます。

継続申込期間は、申込期間内における毎営業日において、いつでも申込みいただくことができます。ただし、継続申込期間中であっても下記の取得申込不可日にあたる日は取得のお申込みの受付はできません。

(略)

(3) 当該受益権の申込価額は、当初申込期間は1口当たり1円です。継続申込期間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)

(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（当初申込期間中は1口当たり1円）に、2.16%（税抜2.0%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。

(略)

<訂正後>

(1) 申込期間内における毎営業日において、いつでも申込みいただくことができます。

ただし、下記の取得申込不可日にあたる日は取得のお申込みの受付はできません。

(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)

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

(略)

3【資産管理等の概要】

(5)【その他】

<訂正前>

(略)

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

平成30年1月15日より、公告の方法は以下のとおり変更される予定です。

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

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

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

(略)

<訂正後>

(略)

公告

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

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

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

(略)

第3【ファンドの経理状況】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)(以下「中間財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、平成29年12月21日から平成30年6月20日までの中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

1【財務諸表】

【ターゲット・リターン戦略ファンド】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

		第1期中間計算期間末 平成30年6月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金		1,192,168
コール・ローン		49,882,145
投資信託受益証券		50,883,280
親投資信託受益証券		402,775,472
未収配当金		673,025
流動資産合計		505,406,090
資産合計		505,406,090
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		271,942
未払解約金		15,961
未払受託者報酬		81,470
未払委託者報酬		2,309,542
その他未払費用		12,500
流動負債合計		2,691,415
負債合計		2,691,415
純資産の部		
元本等		
元本		512,440,567
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()		9,725,892
純資産合計		502,714,675
負債純資産合計		505,406,090

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第 1 期中間計算期間 自 平成29年12月21日 至 平成30年 6 月20日
営業収益	
受取配当金	673,025
有価証券売買等損益	7,159,168
為替差損益	812,313
営業収益合計	7,298,456
営業費用	
支払利息	10,816
受託者報酬	81,470
委託者報酬	2,309,542
その他費用	31,434
営業費用合計	2,433,262
営業利益又は営業損失（ ）	9,731,718
経常利益又は経常損失（ ）	9,731,718
中間純利益又は中間純損失（ ）	9,731,718
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	39,921
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	119
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	119
剰余金減少額又は欠損金増加額	34,214
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	34,214
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	9,725,892

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期中間計算期間末 平成30年6月20日現在
1. 受益権の総数	512,440,567口
2. 元本の欠損	9,725,892円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9810円 (9,810円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期中間計算期間末 平成30年6月20日現在	
	1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (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。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

（その他の注記）

項目	第1期中間計算期間 自 平成29年12月21日 至 平成30年6月20日	
	期首元本額	510,000,000円
期中追加設定元本額	4,675,263円	
期中一部解約元本額	2,234,696円	

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第1期中間計算期間末 平成30年6月20日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	51,409,258	-	51,681,200	271,942
アメリカ・ドル	51,409,258	-	51,681,200	271,942

合計	51,409,258	-	51,681,200	271,942
----	------------	---	------------	---------

(注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日または中間計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のよう
に評価しております。

計算期間末日または中間計算期間末日において予約為替の受渡日（以下、「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該仲値で評価しております。

計算期間末日または中間計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

（イ）計算期間末日または中間計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。

（ロ）計算期間末日または中間計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。

2. 計算期間末日または中間計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日または中間計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

< 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」、「損保ジャパン外国債券マザーファンド」受益証券及び複数の投資信託受益証券を主要投資対象としております。中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は上記マザーファンドの受益証券です。なお、各マザーファンドの状況は次のとおりです。

*なお、以下は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

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30年6月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	221,823,428
国債証券	9,781,311,500
特殊債券	780,374,267
社債券	4,987,346,320
未収利息	25,793,215
前払費用	5,022,716
流動資産合計	15,801,671,446
資産合計	15,801,671,446
負債の部	
流動負債	
その他未払費用	1,709
流動負債合計	1,709
負債合計	1,709
純資産の部	
元本等	
元本	11,116,446,392
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,685,223,345
純資産合計	15,801,669,737
負債純資産合計	15,801,671,446

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年6月20日現在
1．受益権の総数	11,116,446,392口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4215円 (14,215円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30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。
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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（その他の注記）

項目	自 平成29年12月21日 至 平成30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	10,944,287,207円
同期中追加設定元本額	1,325,068,020円
同期中一部解約元本額	1,152,908,835円
元本の内訳*	
ファンド名	
マルチアセット 動的アロケーションファンド 成長型（適格機関投資家専用）	93,822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）	877,712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）	1,653,478円
SNAM絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用）	337,977,395円
損保ジャパン日本債券ファンド	1,026,069,317円
ハッピーエイジング20	145,738,974円
ハッピーエイジング30	708,840,189円
ハッピーエイジング40	3,502,662,693円
ハッピーエイジング50	2,728,169,481円

ハッピーエイジング60	2,084,665,189円
パン・アフリカ株式ファンド	17,407,861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	2,794,645円
好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 円ヘッジなしコース	19,930,155円
好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 通貨セレクトコース	315,389,312円
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	534,235円
好配当米国株式プレミアム・ファンド 通貨セレクト・プレミアムコース	13,222,313円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	12,096,934円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	2,902,245円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	940,720円
ターゲット・リターン戦略ファンド	194,479,722円
計	11,116,446,392円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

損保ジャパン外国債券マザーファンドの状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	平成30年6月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,482,515
コール・ローン	12,241,161
国債証券	3,275,776,818
派生商品評価勘定	25,959,037
未収入金	188,069,018
未収利息	19,696,250
前払費用	3,059,986
流動資産合計	3,526,284,785
資産合計	3,526,284,785
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,265,427
未払金	181,343,762
その他未払費用	756
流動負債合計	188,609,945
負債合計	188,609,945
純資産の部	
元本等	
元本	2,098,453,369
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,239,221,471
純資産合計	3,337,674,840
負債純資産合計	3,526,284,785

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、以下のとおり、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>ただし、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法による時価法によっております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
4. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</p> <p>但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年6月20日現在
1. 受益権の総数	2,098,453,369口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5905円 (15,905円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30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。
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 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（その他の注記）

項目	自 平成29年12月21日 至 平成30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	2,044,024,654円
同期中追加設定元本額	149,308,792円
同期中一部解約元本額	94,880,077円
元本の内訳*	
ファンド名	
損保ジャパン外国債券ファンド	2,019,030,201円
ターゲット・リターン戦略ファンド	79,423,168円
計	2,098,453,369円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成30年6月20日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	3,264,307,420	-	3,245,613,810	18,693,610
アメリカ・ドル	1,422,817,704	-	1,430,031,240	7,213,536
イギリス・ポンド	230,127,520	-	226,779,840	3,347,680
カナダ・ドル	64,131,688	-	63,030,000	1,101,688
シンガポール・ドル	24,123,920	-	23,833,050	290,870
スイス・フラン	12,861,485	-	12,737,400	124,085
スウェーデン・クローナ	18,610,680	-	18,282,860	327,820
デンマーク・クローネ	22,917,625	-	22,568,090	349,535
ノルウェー・クローネ	10,720,987	-	10,612,800	108,187
メキシコ・ペソ	38,866,359	-	38,918,250	51,891
ユーロ	1,419,129,452	-	1,398,820,280	20,309,172
合計	3,264,307,420	-	3,245,613,810	18,693,610

（注）時価の算定方法

1. 計算期間末日または中間計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のよう
に評価しております。
計算期間末日または中間計算期間末日において予約為替の受渡日（以下、「当該日」といいます。）の対顧
客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該仲値で評価しております。
計算期間末日または中間計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の
方法によっております。
（イ）計算期間末日または中間計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、
発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算した
レートを用いています。
（ロ）計算期間末日または中間計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合
には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。
2. 計算期間末日または中間計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間
末日または中間計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

2【ファンドの現況】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

平成30年6月29日現在

資産総額	502,514,121円
負債総額	640,213円
純資産総額（ - ）	501,873,908円
発行済数量	512,491,581口
1単位当りの純資産額（ / ）	0.9793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30年6月29日現在

資産総額	15,826,461,890円
負債総額	3,998円
純資産総額（ - ）	15,826,457,892円
発行済数量	11,128,768,146口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.4221円

損保ジャパン外国債券マザーファンド

平成30年6月29日現在

資産総額	3,358,467,749円
負債総額	15,784,202円
純資産総額（ - ）	3,342,683,547円
発行済数量	2,101,773,498口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.5904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30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30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、

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。

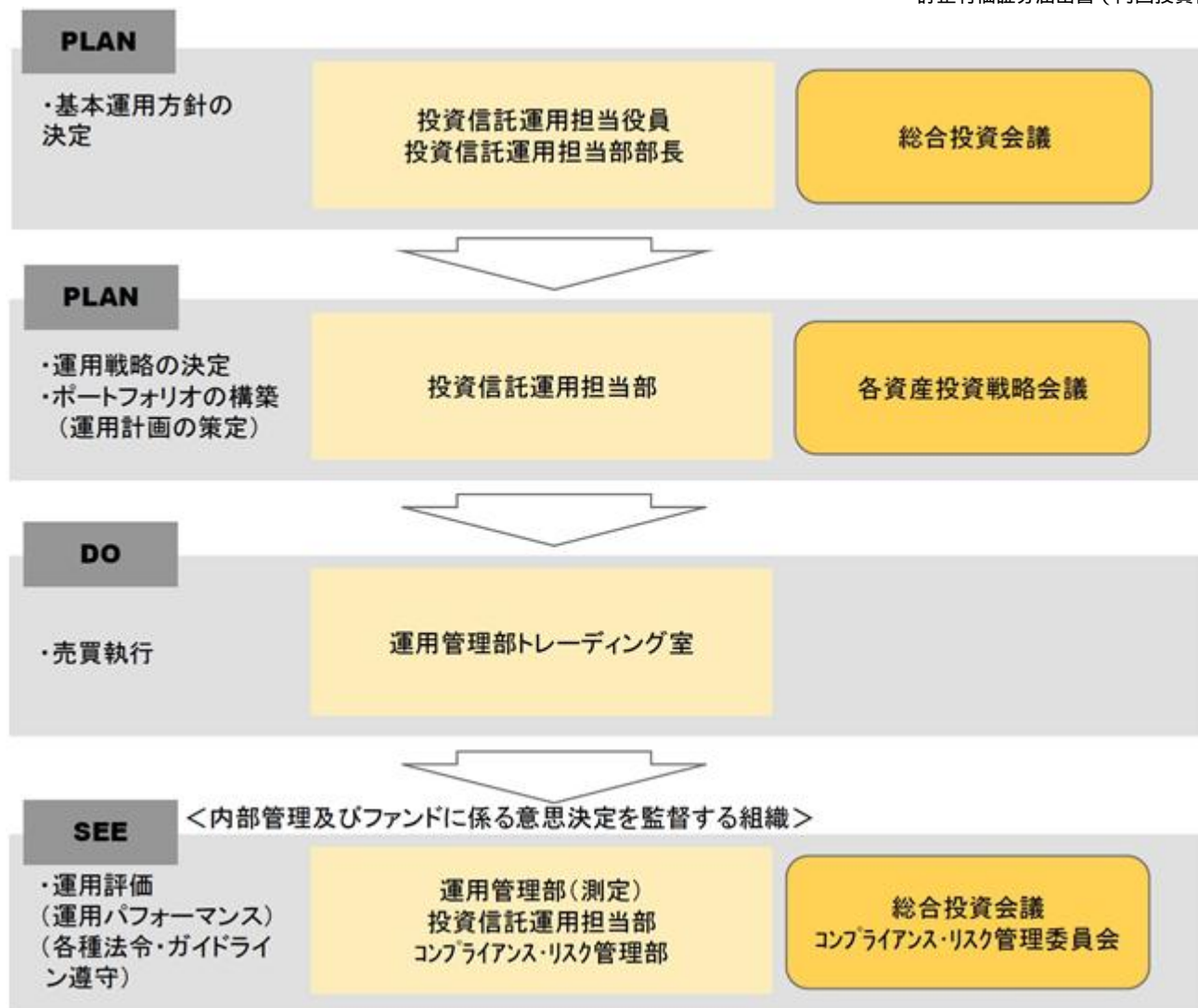
取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役社長が招集し、議長となります。取締役社長に事故あるときは、あらかじめ取締役会で定めた順序により、他の取締役がその任にあたります。取締役会の招集通知は会日の3日前までに発します。ただし、緊急の必要のある場合には、この期間を短縮することができます。

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

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

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



2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

(略)

委託会社の運用する投資信託（親投資信託を除きます。）は平成29年9月末現在、計147本（追加型株式投資信託122本、単位型株式投資信託13本、単位型公社債投資信託12本）であり、その純資産総額の合計は736,652百万円です。

<訂正後>

(略)

委託会社の運用する投資信託（親投資信託を除きます。）は平成30年6月末現在、計152本（追加型株式投資信託124本、単位型株式投資信託12本、単位型公社債投資信託16本）であり、その純資産総額の合計は750,690百万円です。

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」（1963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」（2007年内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2017年4月1日から2018年3月31日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

		前事業年度 (2017年3月31日)		当事業年度 (2018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			5,032,858		4,606,103
2 前払費用			77,585		69,417
3 未収委託者報酬			760,025		919,027
4 未収運用受託報酬			788,836		1,371,086
5 未収収益			57		57
6 繰延税金資産			63,421		55,224
7 その他			22,446		3,144
流動資産合計			6,745,230		7,024,060
固定資産					
1 有形固定資産					
(1) 建物	1		31,748		27,525
(2) 器具備品	1		12,253		19,460
有形固定資産合計			44,002		46,986
2 無形固定資産					
(1) 電話加入権			4,535		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			47,562		66,370
(2) 長期差入保証金			161,598		161,598
(3) 繰延税金資産			161,300		218,591
(4) その他			30		31
投資その他の資産合計			370,490		446,591
固定資産合計			419,028		498,113
資産合計			7,164,258		7,522,173

区分	注記 番号	前事業年度 (2017年3月31日)		当事業年度 (2018年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
(負債の部)					
流動負債					
1 預り金			82,284		15,053
2 未払金					
(1) 未払配当金	2	500,000		200,000	
(2) 未払手数料		340,633		332,515	
(3) その他未払金		160,613	1,001,247	168,587	701,102
3 未払費用			691,223		1,106,809
4 未払消費税等			10,617		44,927
5 未払法人税等			143,251		71,550
6 前受収益			7,954		-
7 賞与引当金			120,025		104,908
8 役員賞与引当金			9,000		5,400
流動負債合計			2,065,604		2,049,753
固定負債					
1 退職給付引当金			90,737		112,624
2 資産除去債務			8,039		8,181
固定負債合計			98,776		120,805
負債合計			2,164,380		2,170,558
(純資産の部)					
株主資本					
1 資本金			1,550,000		1,550,000
2 資本剰余金					
(1) 資本準備金			413,280		413,280
資本剰余金合計			413,280		413,280
3 利益剰余金					
(1) その他利益剰余金					
繰越利益剰余金			3,035,695		3,385,956
利益剰余金合計			3,035,695		3,385,956
株主資本合計			4,998,975		5,349,236
評価・換算差額等					
1 その他有価証券評価差額金			902		2,378
評価・換算差額等合計			902		2,378
純資産合計			4,999,878		5,351,614
負債・純資産合計			7,164,258		7,522,173

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)		当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1 委託者報酬		5,363,843		5,004,466	
2 運用受託報酬		3,816,308	9,180,152	3,372,949	8,377,416
営業費用					
1 支払手数料		2,890,668		2,340,455	
2 広告宣伝費		15,637		40,406	
3 公告費		2,970		2,265	
4 調査費		2,245,765		2,634,404	
(1) 調査費		780,172		891,711	
(2) 委託調査費		1,461,574		1,738,613	
(3) 図書費		4,018		4,078	
5 営業雑経費		190,147		183,871	
(1) 通信費		16,450		6,147	
(2) 印刷費		160,333		162,442	
(3) 諸会費		13,363	5,345,189	15,281	5,201,402
一般管理費					
1 給料		1,361,632		1,460,280	
(1) 役員報酬		75,948		74,540	
(2) 給料・手当		1,147,148		1,210,435	
(3) 賞与		138,535		175,304	
2 福利厚生費		134,150		161,706	
3 交際費		9,622		10,338	
4 寄付金		300		300	
5 旅費交通費		36,626		49,534	
6 法人事業税		41,868		34,078	
7 租税公課		13,856		15,243	
8 不動産賃借料		212,520		206,575	
9 退職給付費用		50,781		45,062	
10 賞与引当金繰入		120,025		104,908	

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)		当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
11 役員賞与引当金繰入		9,000		5,400	
12 固定資産減価償却費		10,429		7,609	
13 諸経費		260,939	2,261,753	297,581	2,398,617
営業利益			1,573,209		777,396
営業外収益					
1 受取配当金		90		93	
2 受取利息		280		309	
3 有価証券売却益		-		654	
4 有価証券償還益		745		-	
5 為替差益		9,721		1,906	
6 雑益		2,066	12,904	2,023	4,987
営業外費用					
1 有価証券売却損		6		-	
2 雑損		8	14	121	121
経常利益			1,586,098		782,261
特別損失					
1 固定資産除却損	1	0	0	0	0
税引前当期純利益			1,586,098		782,261
法人税・住民税及び事業税			428,835		281,742
法人税等調整額			45,816		49,741
当期純利益			1,111,446		550,260

（ 3 ） 【 株主資本等変動計算書 】

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	2,424,248	2,424,248	4,387,528
当期変動額						
剰余金の配当				500,000	500,000	500,000
当期純利益				1,111,446	1,111,446	1,111,446
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	611,446	611,446	611,446
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,035,695	3,035,695	4,998,975

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	7,804	7,804	4,379,723
当期変動額			
剰余金の配当			500,000
当期純利益			1,111,446
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	8,707	8,707	8,707
当期変動額合計	8,707	8,707	620,154
当期末残高	902	902	4,999,878

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	3,035,695	3,035,695	4,998,975
当期変動額						
剰余金の配当				200,000	200,000	200,000
当期純利益				550,260	550,260	550,260
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	350,260	350,260	350,260
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,385,956	3,385,956	5,349,236

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	902	902	4,999,878
当期変動額			
剰余金の配当			200,000
当期純利益			550,260
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,475	1,475	1,475
当期変動額合計	1,475	1,475	351,736
当期末残高	2,378	2,378	5,351,614

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	15年
器具備品	2～20年

3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

4. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 役員賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

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

5. 消費税等の会計処理方法

税抜方式を採用しております。

（会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

（減価償却方法の変更）

当社は、有形固定資産の減価償却方法について、従来、定率法（ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については定額法）を採用していましたが、当事業年度より定額法に変更しております。

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

* 1 . 有形固定資産の減価償却累計額は、次のとおりであります。

	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
建物	78,317千円	82,540千円
器具備品	44,893	47,055

* 2 . 関係会社項目

関係会社に対する負債は、次のとおりであります。

	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
未払金		
未払配当金	500,000千円	200,000千円

（損益計算書関係）

* 1 . 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
器具備品	0千円	0千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

1．発行済株式に関する事項

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

2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3．新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4．剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

（決議）	株式の種類	配当金の総額	1株当たり 配当額	基準日	効力発生日
2017年3月28日 取締役会	普通株式	500,000千円	20,759円	2016年3月31日	2017年3月31日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

該当事項はありません。

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1．発行済株式に関する事項

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

2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3．新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4．剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

（決議）	株式の種類	配当金の総額	1株当たり 配当額	基準日	効力発生日
2018年3月27日 取締役会	普通株式	200,000千円	8,303円	2017年3月31日	2018年3月31日

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

(金融商品関係)

1．金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2017年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	5,032,858	5,032,858	-
(2) 未収委託者報酬	760,025	760,025	-
(3) 未収運用受託報酬	788,836	788,836	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	31,812	31,812	-
資産計	6,613,532	6,613,532	-

当事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	4,606,103	4,606,103	-
(2) 未収委託者報酬	919,027	919,027	-
(3) 未収運用受託報酬	1,371,086	1,371,086	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	50,620	50,620	-
資産計	6,946,838	6,946,838	-
(1) 未払費用	1,106,809	1,106,809	-
負債計	1,106,809	1,106,809	-

注1．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券取引に関する事項

資 産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、及び(3) 未収運用受託報酬

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

(4) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払費用

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

注2．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
非上場株式	15,750	15,750

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

注3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2017年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
(1) 預金	5,032,643	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	760,025	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	788,836	-	-	-
(4) 投資有価証券				
その他有価証券のうち 満期があるもの				
株式	-	-	-	-
債券	-	-	-	-
その他	-	15,266	-	16,545
合計	6,581,505	15,266	-	16,545

当事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
(1) 預金	4,605,909	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	919,027	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	1,371,086	-	-	-
(4) 投資有価証券				
その他有価証券のうち 満期があるもの				
株式	-	-	-	-
債券	-	-	-	-
その他	-	37,688	1,126	11,806
合計	6,896,023	37,688	1,126	11,806

注4. 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

該当事項はありません。

4．その他有価証券で時価のあるもの

前事業年度（2017年3月31日）

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差 額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	16,545	15,200	1,345
	小 計	16,545	15,200	1,345
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	15,266	15,306	40
	小 計	15,266	15,306	40
合計		31,812	30,506	1,305

当事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差 額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	40,528	36,993	3,534
	小 計	40,528	36,993	3,534
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

5．売却したその他有価証券

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	3,993	-	6
合計	3,993	-	6

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	6,160	668	14
合計	6,160	668	14

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

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

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

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

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

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	75,674 千円	90,737 千円
退職給付費用	21,913	24,091
退職給付の支払額	6,850	2,204
退職給付引当金の期末残高	90,737	112,624

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

	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	90,737 千円	112,624 千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	90,737	112,624
退職給付引当金	90,737	112,624
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	90,737	112,624

(3) 退職給付費用

	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	21,913 千円	24,091 千円

3. 確定拠出制度

	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
当社の確定拠出制度への要拠出額	12,945 千円	14,515 千円

(ストック・オプション等関係)

該当事項はありません。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
繰延税金資産		
ソフトウェア損金算入限度超過額	127,409千円	172,841千円
退職給付引当金	27,800	34,485
賞与引当金	37,039	32,123
未払費用否認	18,239	17,276
繰延資産損金算入限度超過額	7,090	6,561
未払事業税	6,351	6,393
その他	4,335	8,285
繰延税金資産小計	228,266	277,965
評価性引当額	2,554	2,595
繰延税金資産合計	225,712	275,370
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	402	1,049
固定資産除去価額	588	505
繰延税金負債合計	990	1,554
繰延税金資産の純額	224,721	273,815

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

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

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

本社事務所の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3．当該資産除去債務の総額の増減

	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
期首残高	7,898千円	8,039千円
時の経過による調整額	140	142
期末残高	8,039	8,181

（セグメント情報等）

セグメント情報

当社は、投資運用事業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

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

（注）営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益
A社（注）	1,038,124

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

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益
B社（注）	972,353

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

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

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
該当事項はありません。

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

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 (千円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜ひまわり生命保険株式会社	東京都新宿区	17,250,000	生命保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用	運用受託報酬の受取り（注1）	157,531	未収運用受託報酬	86,309
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	東京都新宿区	3,000,000	確定拠出年金業	-	投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託代行手数料の支払（注2）	400,493	未払手数料	97,637

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1） 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

（注2） 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 (千円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜ひまわり生命保険株式会社	東京都新宿区	17,250,000	生命保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用	運用受託報酬の受取り（注1）	165,124	未収運用受託報酬	89,703
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	東京都新宿区	3,000,000	確定拠出年金業	-	投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託代行手数料の支払（注2）	468,486	未払手数料	107,721

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1） 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

（注2） 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

S O M P Oホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

関連会社はありません。

(1株当たり情報)

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

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

(注) 2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
当期純利益(千円)	1,111,446	550,260
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	1,111,446	550,260
期中平均株式数(株)	24,085	24,085

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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30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30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

名称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
高木証券株式会社	11,069	「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	48,323	
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、平成30年3月末現在

独立監査人の中間監査報告書

平成30年8月23日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 小澤裕治 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」に掲げられているターゲット・リターン戦略ファンドの平成29年12月21日から平成30年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ターゲット・リターン戦略ファンドの平成30年6月20日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年12月21日から平成30年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- （注）1．上記は、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- 2．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2018年6月1日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 小澤裕治 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の2017年4月1日から2018年3月31日までの第33期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針、その他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の2018年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。