

【表紙】

| | |
|--|--|
| 【提出書類】 | 訂正有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 2021年4月14日提出 |
| 【発行者名】 | SOMPOアセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 代表取締役社長 小嶋 信弘 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都中央区日本橋二丁目2番16号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 津田 浩平 |
| 【電話番号】 | 03-5290-3432 |
| 【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】 | ハッピーエイジング20 ハッピーエイジング30 ハッピーエイジング40 ハッピーエイジング50 ハッピーエイジング60 |
| 【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券の金額】 | ハッピーエイジング20 募集額 2,000億円を上限とします。 ハッピーエイジング30 募集額 2,000億円を上限とします。 ハッピーエイジング40 募集額 2,000億円を上限とします。 ハッピーエイジング50 募集額 2,000億円を上限とします。 ハッピーエイジング60 募集額 2,000億円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2020年10月14日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）につきまして、半期報告書の提出に伴い、訂正すべき事項がありましたので、これを訂正するものであります。

2【訂正の内容】

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

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

(略)

<ファンドの特色>

(略)

TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY[略称:TCW]について

1971年設立。ロサンゼルスを拠点とするTCWグループ傘下の運用会社です。
2020年6月末現在の同グループの運用資産は、約2,251億米ドル(約24兆2,522億円*)です。
※2020年6月末時点の為替レートで換算。

(略)

<訂正後>

(略)

<ファンドの特色>

(略)

TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY[略称:TCW]について

1971年設立。ロサンゼルスを拠点とするTCWグループ傘下の運用会社です。
2020年12月末現在の同グループの運用資産は、約2,476億米ドル(約25兆6,282億円*)です。
※2020年12月末時点の為替レートで換算。

(略)

(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

委託会社等の概況

()資本金の額 1,550百万円 (2020年7月末現在)

(略)

()大株主の状況 (2020年7月末現在)

(略)

<訂正後>

(略)

委託会社等の概況

()資本金の額 1,550百万円 (2021年1月末現在)

(略)

()大株主の状況 (2021年1月末現在)

(略)

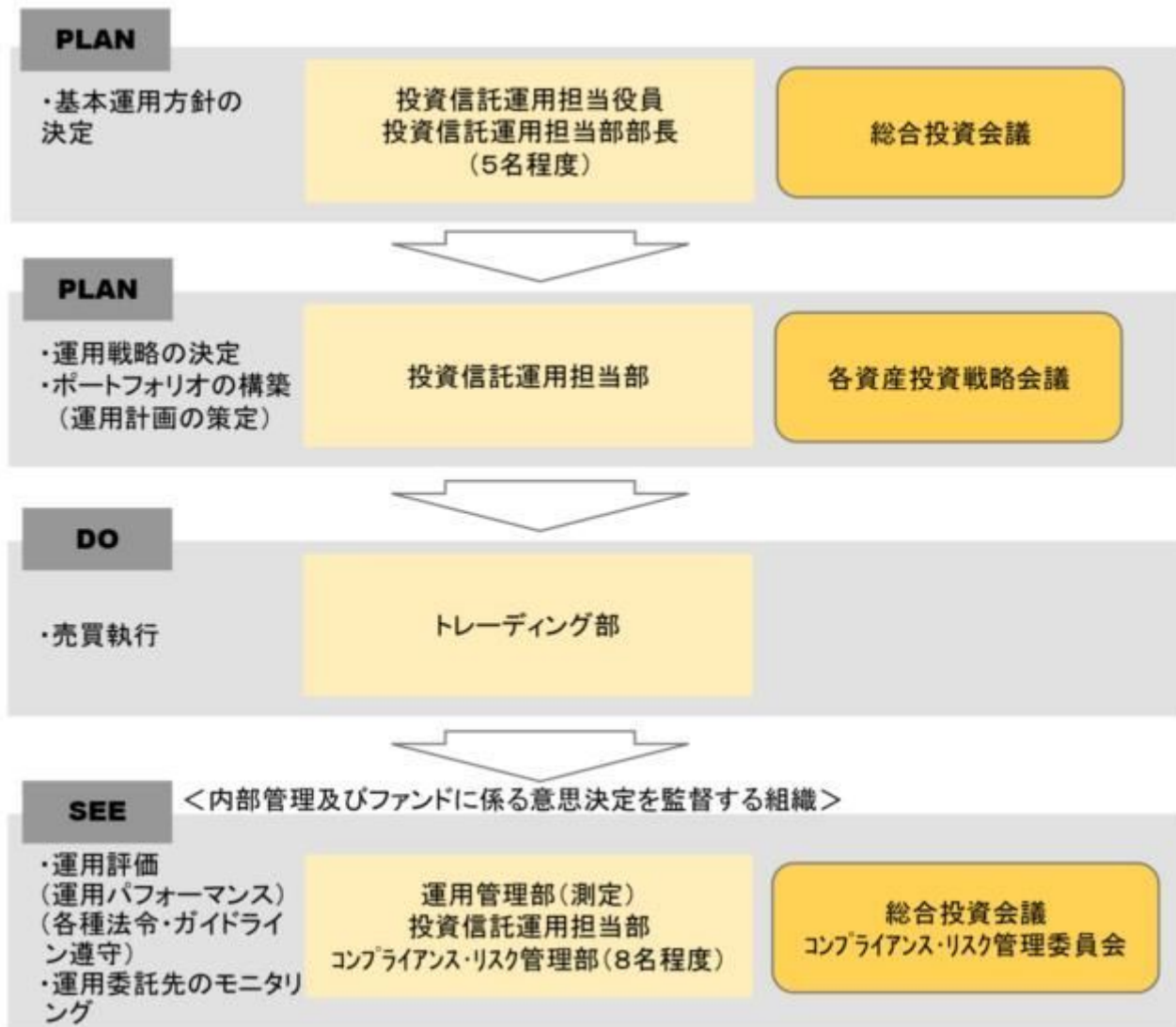
2【投資方針】

(3)【運用体制】

<訂正前>

a. 委託会社の運用体制と社内規程

(略)

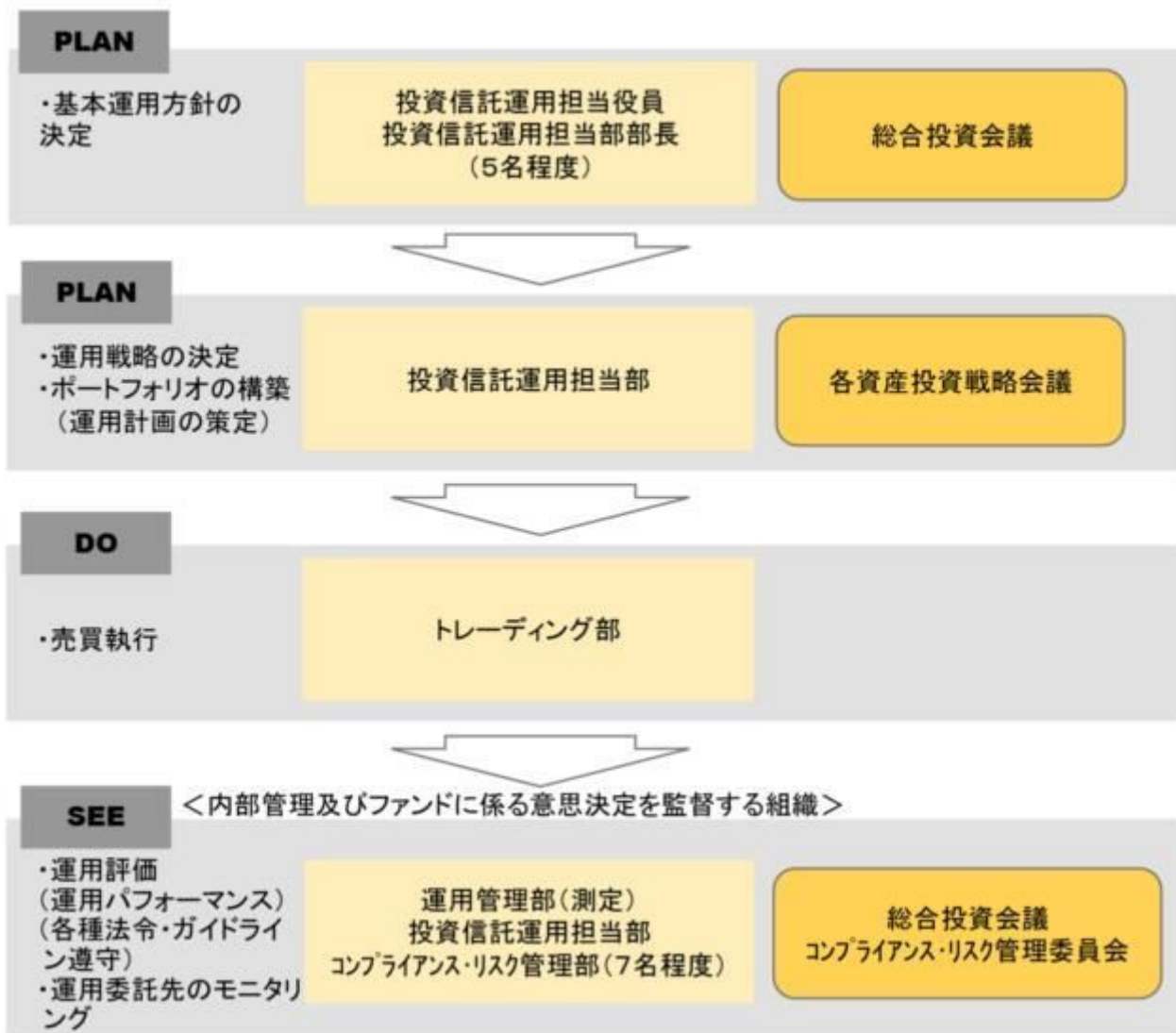


2020年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

<訂正後>

a. 委託会社の運用体制と社内規程

(略)



2021年1月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

<訂正前>

b. 運用委託先の運用体制等

(略)

(本組織図は、2020年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。)

<訂正後>

b. 運用委託先の運用体制等

(略)

(本組織図は、2021年1月末現在のものであり、今後変更されることもあります。)

3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

<リスクの管理体制>

a. 委託会社のリスク管理体制

(略)

（注）上図は、2020年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

（略）

ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

2015年8月～2020年7月

ファンドと他の代表的な資産クラスとの
騰落率の比較

2015年8月～2020年7月

ハッピーエイジング20



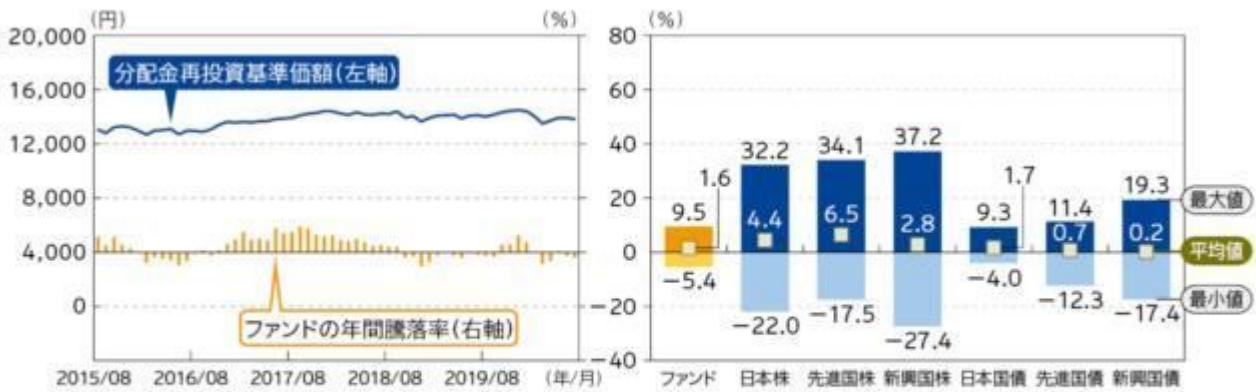
ハッピーエイジング30



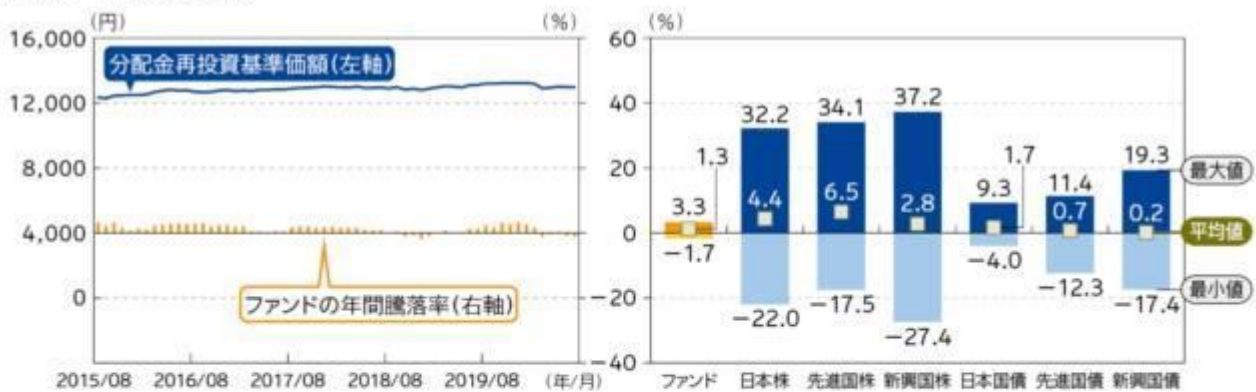
ハッピーエイジング40



ハッピーエイジング50



ハッピーエイジング60



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

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

代表的な資産クラスの指数

日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東京証券取引所第一部上場全銘柄の基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所の知的財産であり、東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

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

MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変更す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

野村証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、すべて野村証券株式会社に帰属します。野村証券株式会社は、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

新興国債:J.P.Morgan Global Emerging Markets Diversified(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とした指数です。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>

a. 委託会社のリスク管理体制

(略)

(注) 上図は、2021年1月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

(略)

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移

2016年2月～2021年1月

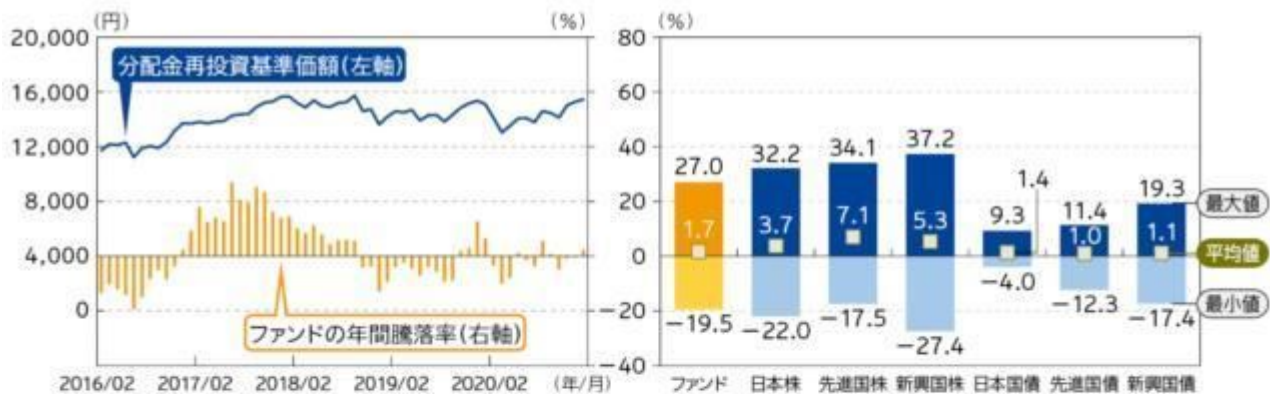
ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

2016年2月～2021年1月

ハッピーエイジング20



ハッピーエイジング30



ハッピーエイジング40



ハッピーエイジング50



ハッピーエイジング60



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

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

代表的な資産クラスの指数

日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東京証券取引所第一部上場全銘柄の基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所の知的財産であり、東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの高標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

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

MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし、円ベース)

FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

日本国債:NOMURA-BPI 国債

野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

新興国債:J PモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(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】

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

上記は2020年7月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

<訂正後>

(略)

上記は2021年1月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

ハッピーエイジング20

2021年1月29日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 621,504,637 | 5.52 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 10,457,657,036 | 92.84 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | | 185,383,744 | 1.64 |
| 純資産総額 | | 11,264,545,417 | 100.00 |

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

ハッピーエイジング30

2021年1月29日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 708,408,206 | 5.08 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 12,946,403,049 | 92.86 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | | 286,295,287 | 2.06 |
| 純資産総額 | | 13,941,106,542 | 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。

その他資産の投資状況

2021年1月29日現在

| 資産の種類 | 建別 | 地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|--------|----|----|------------|---------|
| 為替予約取引 | 売建 | | 74,833,417 | 0.54 |

(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。

ハッピーエイジング40

2021年1月29日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 925,855,409 | 5.08 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 16,950,661,008 | 92.92 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | | 365,360,662 | 2.00 |
| 純資産総額 | | 18,241,877,079 | 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。

その他資産の投資状況

2021年1月29日現在

| 資産の種類 | 建別 | 地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|--------|----|----|-------------|---------|
| 為替予約取引 | 売建 | | 108,782,835 | 0.60 |

(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。

ハッピーエイジング50

2021年1月29日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|------|---------------|---------|
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 289,247,228 | 3.47 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 7,912,376,350 | 94.95 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | | 131,675,057 | 1.58 |
| 純資産総額 | | 8,333,298,635 | 100.00 |

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

ハッピーエイジング60

2021年1月29日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|----|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 5,093,285,203 | 97.97 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 105,359,620 | 2.03 |
| 純資産総額 | | 5,198,644,823 | 100.00 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

（参考）S J A M ラージキャップ・バリュール・マザーファンド

2021年1月29日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|----|----------------|---------|
| 株式 | 日本 | 30,088,467,350 | 99.22 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 235,192,733 | 0.78 |
| 純資産総額 | | 30,323,660,083 | 100.00 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

（参考）S J A M スモールキャップ・マザーファンド

2021年1月29日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|----|----------------|---------|
| 株式 | 日本 | 9,905,612,000 | 98.66 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 134,065,013 | 1.34 |
| 純資産総額 | | 10,039,677,013 | 100.00 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2021年1月29日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|------|----------------|---------|
| 国債証券 | 日本 | 13,060,652,000 | 68.00 |
| 地方債証券 | 日本 | 1,318,708,000 | 6.87 |
| 特殊債券 | 日本 | 620,729,045 | 3.23 |
| 社債券 | 日本 | 3,526,218,000 | 18.36 |
| | フランス | 205,748,000 | 1.07 |
| | | 3,731,966,000 | 19.43 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 473,868,606 | 2.47 |
| 純資産総額 | | 19,205,923,651 | 100.00 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

2021年1月29日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|------------|---------------|---------|
| 国債証券 | アメリカ | 2,828,184,744 | 31.37 |
| | フランス | 1,152,794,523 | 12.79 |
| | ドイツ | 921,309,702 | 10.22 |
| | イタリア | 813,025,820 | 9.02 |
| | イギリス | 594,856,859 | 6.60 |
| | スペイン | 523,389,582 | 5.81 |
| | オーストラリア | 226,388,594 | 2.51 |
| | ベルギー | 219,706,176 | 2.44 |
| | ポーランド | 194,260,686 | 2.15 |
| | マレーシア | 181,194,784 | 2.01 |
| | カナダ | 164,347,422 | 1.82 |
| | オランダ | 158,757,866 | 1.76 |
| | ノルウェー | 158,393,902 | 1.76 |
| | オーストリア | 131,582,089 | 1.46 |
| | メキシコ | 76,351,992 | 0.85 |
| | アイルランド | 73,405,058 | 0.81 |
| | フィンランド | 50,747,216 | 0.56 |
| | デンマーク | 37,457,554 | 0.42 |
| | シンガポール | 36,361,192 | 0.40 |
| スウェーデン | 30,135,936 | 0.33 | |
| | | 8,572,651,697 | 95.10 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 441,811,009 | 4.90 |
| 純資産総額 | | 9,014,462,706 | 100.00 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

（参考）損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド

2021年1月29日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-------|--------|----------------|---------|
| 株式 | アメリカ | 10,460,899,898 | 72.88 |
| | ドイツ | 361,198,216 | 2.52 |
| | バミューダ | 339,562,562 | 2.37 |
| | アイルランド | 316,155,854 | 2.20 |
| | カナダ | 313,235,497 | 2.18 |
| | フランス | 284,118,589 | 1.98 |

| | | | |
|-----------------------|---------|----------------|--------|
| | イギリス | 256,603,470 | 1.79 |
| | スイス | 209,533,618 | 1.46 |
| | シンガポール | 175,852,209 | 1.23 |
| | オランダ | 122,619,047 | 0.85 |
| | オーストラリア | 117,439,112 | 0.82 |
| | スウェーデン | 44,455,337 | 0.31 |
| | ジャージー | 44,154,577 | 0.31 |
| | デンマーク | 38,992,432 | 0.27 |
| | スペイン | 32,929,253 | 0.23 |
| | ベルギー | 20,374,324 | 0.14 |
| | プエルトリコ | 17,859,419 | 0.12 |
| | ケイマン | 13,476,754 | 0.09 |
| | 香港 | 12,294,434 | 0.09 |
| | | 13,181,754,602 | 91.83 |
| 投資証券 | アメリカ | 737,463,690 | 5.14 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 435,005,352 | 3.03 |
| 純資産総額 | | 14,354,223,644 | 100.00 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

ハッピーエイジング20

2021年1月29日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 （円） | 簿価金額 （円） | 評価単価 （円） | 評価金額 （円） | 投資 比率 （%） |
|----|------|---------------|---------------------------------|---------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン - T C W外国株式マ ザーファンド | 1,426,072,710 | 2.2692 | 3,236,113,036 | 2.6190 | 3,734,884,427 | 33.16 |
| 2 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド | 1,275,587,469 | 2.1414 | 2,731,543,007 | 2.2894 | 2,920,329,951 | 25.92 |
| 3 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | S J A Mラージキャップ・パ リユー・マザーファンド | 1,622,340,105 | 1.5879 | 2,576,113,853 | 1.7829 | 2,892,470,173 | 25.68 |
| 4 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド | 400,285,540 | 1.6969 | 679,269,569 | 1.7070 | 683,287,416 | 6.07 |
| 5 | アメリカ | 投資信託受 益証券 | ISHARES CORE MSCI EMERGING | 90,776 | 5,355.64 | 486,164,012 | 6,846.57 | 621,504,637 | 5.52 |
| 6 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン日本債券マザーファ ンド | 156,442,422 | 1.4475 | 226,462,849 | 1.4490 | 226,685,069 | 2.01 |

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年1月29日現在

| 種類 | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 5.52 |
| 親投資信託受益証券 | 92.84 |
| 合計 | 98.35 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

ハッピーエイジング30

2021年1月29日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 （円） | 簿価金額 （円） | 評価単価 （円） | 評価金額 （円） | 投資 比率 （％） |
|----|------|---------------|----------------------------------|---------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド | 1,333,424,801 | 2.1401 | 2,853,662,417 | 2.2894 | 3,052,742,739 | 21.90 |
| 2 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | S J A Mラージキャップ・バ リュール・マザーファンド | 1,695,841,891 | 1.5876 | 2,692,318,587 | 1.7829 | 3,023,516,507 | 21.69 |
| 3 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン - T C W外国株式マ ザーファンド | 1,121,091,566 | 2.2684 | 2,543,141,859 | 2.6190 | 2,936,138,811 | 21.06 |
| 4 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド | 1,648,380,609 | 1.6968 | 2,797,062,265 | 1.7070 | 2,813,785,699 | 20.18 |
| 5 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン日本債券マザーファ ンド | 773,098,201 | 1.4476 | 1,119,192,657 | 1.4490 | 1,120,219,293 | 8.04 |
| 6 | アメリカ | 投資信託受 益証券 | ISHARES CORE MSCI EMERGING | 103,469 | 5,355.64 | 554,143,211 | 6,846.57 | 708,408,206 | 5.08 |

（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

2021年1月29日現在

| 種類 | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 5.08 |
| 親投資信託受益証券 | 92.86 |
| 合計 | 97.95 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

ハッピーエイジング40

2021年1月29日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 （円） | 簿価金額 （円） | 評価単価 （円） | 評価金額 （円） | 投資 比率 （％） |
|----|----|----|-----|----|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------|
|----|----|----|-----|----|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------|

| | | | | | | | | | |
|---|------|---------------|---------------------------------|---------------|----------|---------------|----------|---------------|-------|
| 1 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン日本債券マザーファン ド | 4,167,937,989 | 1.4476 | 6,033,864,992 | 1.4490 | 6,039,342,146 | 33.11 |
| 2 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド | 1,227,830,148 | 2.1392 | 2,626,574,253 | 2.2894 | 2,810,994,340 | 15.41 |
| 3 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | S J A Mラージキャップ・パ リユー・マザーファンド | 1,561,446,997 | 1.5883 | 2,480,046,266 | 1.7829 | 2,783,903,850 | 15.26 |
| 4 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン外国債券(為替ヘッ ジなし)マザーファンド | 1,615,769,487 | 1.6967 | 2,741,489,895 | 1.7070 | 2,758,118,514 | 15.12 |
| 5 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン - T C W外国株式マ ザーファンド | 976,824,039 | 2.2690 | 2,216,473,785 | 2.6190 | 2,558,302,158 | 14.02 |
| 6 | アメリカ | 投資信託受 益証券 | ISHARES CORE MSCI EMERGING | 135,229 | 5,355.64 | 724,238,490 | 6,846.57 | 925,855,409 | 5.08 |

(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

2021年1月29日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 5.08 |
| 親投資信託受益証券 | 92.92 |
| 合計 | 98.00 |

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

ハッピーエイジング50

2021年1月29日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 (円) | 簿価金額 (円) | 評価単価 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|------|---------------|---------------------------------|---------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン日本債券マザーファン ド | 3,284,096,648 | 1.4475 | 4,753,934,087 | 1.4490 | 4,758,656,042 | 57.10 |
| 2 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン外国債券(為替ヘッ ジなし)マザーファンド | 540,528,996 | 1.6965 | 917,014,638 | 1.7070 | 922,682,996 | 11.07 |
| 3 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド | 343,294,335 | 2.1392 | 734,375,242 | 2.2894 | 785,938,050 | 9.43 |
| 4 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | S J A Mラージキャップ・パ リユー・マザーファンド | 436,548,974 | 1.5873 | 692,934,187 | 1.7829 | 778,323,165 | 9.34 |
| 5 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン - T C W外国株式マ ザーファンド | 254,591,866 | 2.2672 | 577,212,756 | 2.6190 | 666,776,097 | 8.00 |
| 6 | アメリカ | 投資信託受 益証券 | ISHARES CORE MSCI EMERGING | 42,247 | 5,355.64 | 226,259,925 | 6,846.57 | 289,247,228 | 3.47 |

(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

2021年1月29日現在

| 種類 | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 3.47 |
| 親投資信託受益証券 | 94.95 |
| 合計 | 98.42 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

ハッピーエイジング60

2021年1月29日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 （円） | 簿価金額 （円） | 評価単価 （円） | 評価金額 （円） | 投資 比率 （％） |
|----|----|---------------|----------------------------------|---------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン日本債券マザーファン ド | 2,583,470,533 | 1.4476 | 3,739,914,939 | 1.4490 | 3,743,448,802 | 72.01 |
| 2 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド | 489,639,584 | 1.6965 | 830,678,300 | 1.7070 | 835,814,769 | 16.08 |
| 3 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド | 90,016,535 | 2.1400 | 192,635,385 | 2.2894 | 206,083,855 | 3.96 |
| 4 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | S J A Mラージキャップ・バ リュール・マザーファンド | 114,500,235 | 1.5927 | 182,370,610 | 1.7829 | 204,142,468 | 3.93 |
| 5 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン - T C W外国株式マ ザーファンド | 39,631,657 | 2.2660 | 89,805,335 | 2.6190 | 103,795,309 | 2.00 |

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年1月29日現在

| 種類 | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 97.97 |
| 合計 | 97.97 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

（参考）S J A Mラージキャップ・バリュール・マザーファンド

2021年1月29日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価単価 （円） | 簿価金額 （円） | 評価単価 （円） | 評価金額 （円） | 投資 比率 （％） |
|----|----|----|-----------------------|------------|-----------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通 信業 | 700,000 | 2,611.29 | 1,827,908,717 | 2,618.00 | 1,832,600,000 | 6.04 |
| 2 | 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナン シャル・グループ | 銀行業 | 3,744,300 | 533.97 | 1,999,357,898 | 469.30 | 1,757,199,990 | 5.79 |

| | | | | | | | | | | |
|----|----|----|-------------------|------------|-----------|----------|---------------|----------|---------------|------|
| 3 | 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 486,600 | 3,586.83 | 1,745,352,260 | 3,245.00 | 1,579,017,000 | 5.21 |
| 4 | 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 328,200 | 3,725.50 | 1,222,710,448 | 3,698.00 | 1,213,683,600 | 4.00 |
| 5 | 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 436,700 | 2,969.47 | 1,296,771,029 | 2,764.50 | 1,207,257,150 | 3.98 |
| 6 | 日本 | 株式 | 日本製鉄 | 鉄鋼 | 935,500 | 1,304.98 | 1,220,811,749 | 1,207.00 | 1,129,148,500 | 3.72 |
| 7 | 日本 | 株式 | 鹿島建設 | 建設業 | 800,200 | 1,257.41 | 1,006,179,963 | 1,401.00 | 1,121,080,200 | 3.70 |
| 8 | 日本 | 株式 | 三菱電機 | 電気機器 | 689,300 | 1,522.95 | 1,049,775,825 | 1,594.50 | 1,099,088,850 | 3.62 |
| 9 | 日本 | 株式 | 日揮ホールディングス | 建設業 | 844,500 | 1,403.85 | 1,185,552,321 | 1,180.00 | 996,510,000 | 3.29 |
| 10 | 日本 | 株式 | 東レ | 繊維製品 | 1,452,000 | 485.95 | 705,599,400 | 681.20 | 989,102,400 | 3.26 |
| 11 | 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業 | 237,200 | 3,584.69 | 850,288,468 | 3,961.00 | 939,549,200 | 3.10 |
| 12 | 日本 | 株式 | 小松製作所 | 機械 | 325,300 | 2,193.33 | 713,490,249 | 2,862.50 | 931,171,250 | 3.07 |
| 13 | 日本 | 株式 | 第一生命ホールディングス | 保険業 | 575,400 | 1,574.94 | 906,224,910 | 1,586.00 | 912,584,400 | 3.01 |
| 14 | 日本 | 株式 | 住友電気工業 | 非鉄金属 | 654,400 | 1,400.32 | 916,370,759 | 1,392.50 | 911,252,000 | 3.01 |
| 15 | 日本 | 株式 | 東日本旅客鉄道 | 陸運業 | 129,200 | 7,807.83 | 1,008,772,458 | 6,890.00 | 890,188,000 | 2.94 |
| 16 | 日本 | 株式 | 日本たばこ産業 | 食料品 | 426,200 | 2,213.93 | 943,580,448 | 2,077.50 | 885,430,500 | 2.92 |
| 17 | 日本 | 株式 | セイコーエプソン | 電気機器 | 478,300 | 1,586.28 | 758,717,724 | 1,773.00 | 848,025,900 | 2.80 |
| 18 | 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 169,800 | 3,603.81 | 611,928,059 | 4,306.00 | 731,158,800 | 2.41 |
| 19 | 日本 | 株式 | 東京瓦斯 | 電気・ガス業 | 312,100 | 2,384.34 | 744,153,337 | 2,289.50 | 714,552,950 | 2.36 |
| 20 | 日本 | 株式 | 日本テレビホールディングス | 情報・通信業 | 561,900 | 1,397.79 | 785,419,968 | 1,202.00 | 675,403,800 | 2.23 |
| 21 | 日本 | 株式 | 三井不動産 | 不動産業 | 294,100 | 2,581.00 | 759,072,323 | 2,118.50 | 623,050,850 | 2.05 |
| 22 | 日本 | 株式 | 大和ハウス工業 | 建設業 | 189,000 | 2,597.22 | 490,875,706 | 2,964.50 | 560,290,500 | 1.85 |
| 23 | 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 209,900 | 2,545.32 | 534,264,726 | 2,647.50 | 555,710,250 | 1.83 |
| 24 | 日本 | 株式 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 銀行業 | 173,900 | 3,783.78 | 658,000,881 | 3,132.00 | 544,654,800 | 1.80 |
| 25 | 日本 | 株式 | クレディセゾン | その他金融業 | 450,200 | 1,693.96 | 762,621,319 | 1,189.00 | 535,287,800 | 1.77 |
| 26 | 日本 | 株式 | 三菱地所 | 不動産業 | 308,500 | 1,906.40 | 588,127,061 | 1,652.00 | 509,642,000 | 1.68 |
| 27 | 日本 | 株式 | 日産自動車 | 輸送用機器 | 924,600 | 486.12 | 449,475,037 | 532.10 | 491,979,660 | 1.62 |
| 28 | 日本 | 株式 | 野村ホールディングス | 証券、商品先物取引業 | 859,000 | 542.36 | 465,894,501 | 551.70 | 473,910,300 | 1.56 |
| 29 | 日本 | 株式 | キリンホールディングス | 食料品 | 210,200 | 2,281.50 | 479,572,705 | 2,246.00 | 472,109,200 | 1.56 |
| 30 | 日本 | 株式 | 日本精工 | 機械 | 458,600 | 861.74 | 395,196,613 | 947.00 | 434,294,200 | 1.43 |

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別及び業種別投資比率

2021年1月29日現在

| 種類 | 国内/外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|-------|------|----------|
| 株式 | 国内 | 建設業 | 8.83 |
| | | 食料品 | 5.06 |
| | | 繊維製品 | 3.26 |
| | | 医薬品 | 5.32 |
| | | ゴム製品 | 1.42 |

| | | |
|----|------------|-------|
| | ガラス・土石製品 | 1.22 |
| | 鉄鋼 | 4.92 |
| | 非鉄金属 | 3.01 |
| | 機械 | 6.78 |
| | 電気機器 | 8.83 |
| | 輸送用機器 | 6.95 |
| | 電気・ガス業 | 3.19 |
| | 陸運業 | 2.94 |
| | 情報・通信業 | 8.27 |
| | 卸売業 | 1.83 |
| | 小売業 | 3.10 |
| | 銀行業 | 12.80 |
| | 証券、商品先物取引業 | 1.56 |
| | 保険業 | 4.44 |
| | その他金融業 | 1.77 |
| | 不動産業 | 3.74 |
| 合計 | | 99.22 |

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

（参考）S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

2021年1月29日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価単価 （円） | 簿価金額 （円） | 評価単価 （円） | 評価金額 （円） | 投資 比率 （%） |
|----|----|----|------------------|--------|---------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 株式 | H・U・グループホールディングス | サービス業 | 104,000 | 2,709.80 | 281,819,203 | 3,110.00 | 323,440,000 | 3.22 |
| 2 | 日本 | 株式 | E I Z O | 電気機器 | 85,000 | 3,830.61 | 325,602,299 | 3,750.00 | 318,750,000 | 3.17 |
| 3 | 日本 | 株式 | シチズン時計 | 精密機器 | 985,800 | 318.87 | 314,343,881 | 317.00 | 312,498,600 | 3.11 |
| 4 | 日本 | 株式 | 日鉄ソリューションズ | 情報・通信業 | 90,000 | 3,025.12 | 272,260,800 | 3,355.00 | 301,950,000 | 3.01 |
| 5 | 日本 | 株式 | 東邦ホールディングス | 卸売業 | 145,000 | 2,109.14 | 305,825,882 | 1,970.00 | 285,650,000 | 2.85 |
| 6 | 日本 | 株式 | 日本ライフライン | 卸売業 | 180,000 | 1,413.34 | 254,402,661 | 1,509.00 | 271,620,000 | 2.71 |
| 7 | 日本 | 株式 | 森永乳業 | 食料品 | 51,000 | 5,092.70 | 259,728,089 | 5,220.00 | 266,220,000 | 2.65 |
| 8 | 日本 | 株式 | ひろぎんホールディングス | 銀行業 | 420,000 | 560.56 | 235,437,801 | 608.00 | 255,360,000 | 2.54 |
| 9 | 日本 | 株式 | 伊予銀行 | 銀行業 | 420,000 | 680.12 | 285,651,759 | 601.00 | 252,420,000 | 2.51 |
| 10 | 日本 | 株式 | ツクイホールディングス | サービス業 | 428,000 | 609.92 | 261,047,335 | 561.00 | 240,108,000 | 2.39 |
| 11 | 日本 | 株式 | 八十二銀行 | 銀行業 | 705,000 | 414.12 | 291,959,576 | 335.00 | 236,175,000 | 2.35 |
| 12 | 日本 | 株式 | A O K Iホールディングス | 小売業 | 413,000 | 550.82 | 227,489,528 | 534.00 | 220,542,000 | 2.20 |
| 13 | 日本 | 株式 | メイテック | サービス業 | 40,000 | 5,204.00 | 208,160,293 | 5,490.00 | 219,600,000 | 2.19 |
| 14 | 日本 | 株式 | 第四北越フィナンシャルグループ | 銀行業 | 98,000 | 2,134.43 | 209,174,370 | 2,184.00 | 214,032,000 | 2.13 |
| 15 | 日本 | 株式 | キョーリン製薬ホールディングス | 医薬品 | 100,000 | 2,046.02 | 204,602,598 | 1,963.00 | 196,300,000 | 1.96 |
| 16 | 日本 | 株式 | コメリ | 小売業 | 70,000 | 3,123.37 | 218,636,326 | 2,785.00 | 194,950,000 | 1.94 |
| 17 | 日本 | 株式 | 北洋銀行 | 銀行業 | 915,000 | 231.24 | 211,586,535 | 212.00 | 193,980,000 | 1.93 |

| | | | | | | | | | | |
|----|----|----|--------------------|--------|---------|----------|-------------|----------|-------------|------|
| 18 | 日本 | 株式 | 群馬銀行 | 銀行業 | 554,000 | 356.23 | 197,353,811 | 323.00 | 178,942,000 | 1.78 |
| 19 | 日本 | 株式 | 西日本フィナンシャルホールディングス | 銀行業 | 267,000 | 732.13 | 195,480,517 | 630.00 | 168,210,000 | 1.68 |
| 20 | 日本 | 株式 | ほくほくフィナンシャルグループ | 銀行業 | 180,000 | 992.00 | 178,560,000 | 925.00 | 166,500,000 | 1.66 |
| 21 | 日本 | 株式 | 日本テレビホールディングス | 情報・通信業 | 130,000 | 1,168.88 | 151,955,303 | 1,202.00 | 156,260,000 | 1.56 |
| 22 | 日本 | 株式 | 山口フィナンシャルグループ | 銀行業 | 260,000 | 713.00 | 185,380,000 | 595.00 | 154,700,000 | 1.54 |
| 23 | 日本 | 株式 | 七十七銀行 | 銀行業 | 115,000 | 1,594.00 | 183,310,000 | 1,317.00 | 151,455,000 | 1.51 |
| 24 | 日本 | 株式 | ダイビル | 不動産業 | 125,000 | 1,130.00 | 141,250,000 | 1,189.00 | 148,625,000 | 1.48 |
| 25 | 日本 | 株式 | めぶきフィナンシャルグループ | 銀行業 | 680,000 | 223.79 | 152,183,189 | 203.00 | 138,040,000 | 1.37 |
| 26 | 日本 | 株式 | トラスコ中山 | 卸売業 | 50,000 | 2,583.77 | 129,188,500 | 2,710.00 | 135,500,000 | 1.35 |
| 27 | 日本 | 株式 | 日立キャピタル | その他金融業 | 50,000 | 2,490.62 | 124,531,224 | 2,578.00 | 128,900,000 | 1.28 |
| 28 | 日本 | 株式 | コーセル | 電気機器 | 111,000 | 904.20 | 100,366,872 | 1,131.00 | 125,541,000 | 1.25 |
| 29 | 日本 | 株式 | ゴールドクレスト | 不動産業 | 68,000 | 1,393.56 | 94,762,637 | 1,802.00 | 122,536,000 | 1.22 |
| 30 | 日本 | 株式 | ゼビオホールディングス | 小売業 | 140,000 | 758.53 | 106,195,006 | 873.00 | 122,220,000 | 1.22 |

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別及び業種別投資比率

2021年1月29日現在

| 種類 | 国内/外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|------|-------|--------|----------|
| 株式 | 国内 | 建設業 | 3.11 |
| | | 食料品 | 2.65 |
| | | 繊維製品 | 1.18 |
| | | パルプ・紙 | 1.70 |
| | | 化学 | 4.53 |
| | | 医薬品 | 3.46 |
| | | ゴム製品 | 0.51 |
| | | 鉄鋼 | 0.67 |
| | | 金属製品 | 2.40 |
| | | 機械 | 0.94 |
| | | 電気機器 | 4.69 |
| | | 輸送用機器 | 2.52 |
| | | 精密機器 | 6.02 |
| | | その他製品 | 2.01 |
| | | 電気・ガス業 | 1.19 |
| | | 情報・通信業 | 4.87 |
| | | 卸売業 | 6.90 |
| | | 小売業 | 8.53 |
| | | 銀行業 | 23.65 |
| | | その他金融業 | 3.70 |
| 不動産業 | 3.49 | | |

| | | |
|----|-------|-------|
| | サービス業 | 9.93 |
| 合計 | | 98.66 |

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

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2021年1月29日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 （円） | 簿価金額 （円） | 評価単価 （円） | 評価金額 （円） | 利率（%） | 償還日 | 投資 比率 （%） |
|----|----|-------|--------------------------------|---------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------|------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 国債証券 | 第138回利付国債（5年） | 1,090,000,000 | 100.72 | 1,097,914,000 | 100.66 | 1,097,248,500 | 0.1000000 | 2023/12/20 | 5.71 |
| 2 | 日本 | 国債証券 | 第151回利付国債（20年） | 740,000,000 | 113.87 | 842,704,400 | 113.20 | 837,687,400 | 1.2000000 | 2034/12/20 | 4.36 |
| 3 | 日本 | 国債証券 | 第410回利付国債（2年） | 830,000,000 | 100.39 | 833,237,000 | 100.24 | 832,008,600 | 0.1000000 | 2022/3/1 | 4.33 |
| 4 | 日本 | 国債証券 | 第43回利付国債（30年） | 660,000,000 | 126.27 | 833,444,800 | 125.51 | 828,392,400 | 1.7000000 | 2044/6/20 | 4.31 |
| 5 | 日本 | 国債証券 | 第170回利付国債（20年） | 820,000,000 | 98.69 | 809,336,000 | 97.75 | 801,607,400 | 0.3000000 | 2039/9/20 | 4.17 |
| 6 | 日本 | 国債証券 | 第360回利付国債（10年） | 710,000,000 | 100.91 | 716,484,100 | 100.62 | 714,430,400 | 0.1000000 | 2030/9/20 | 3.72 |
| 7 | 日本 | 国債証券 | 第413回利付国債（2年） | 620,000,000 | 100.46 | 622,890,900 | 100.30 | 621,897,200 | 0.1000000 | 2022/6/1 | 3.24 |
| 8 | 日本 | 国債証券 | 第417回利付国債（2年） | 600,000,000 | 100.46 | 602,766,000 | 100.39 | 602,346,000 | 0.1000000 | 2022/10/1 | 3.14 |
| 9 | 日本 | 国債証券 | 第57回利付国債（30年） | 490,000,000 | 105.74 | 518,163,800 | 104.87 | 513,872,800 | 0.8000000 | 2047/12/20 | 2.68 |
| 10 | 日本 | 国債証券 | 第171回利付国債（20年） | 460,000,000 | 97.75 | 449,650,000 | 97.55 | 448,771,400 | 0.3000000 | 2039/12/20 | 2.34 |
| 11 | 日本 | 国債証券 | 第166回利付国債（20年） | 410,000,000 | 105.43 | 432,274,100 | 105.28 | 431,680,800 | 0.7000000 | 2038/9/20 | 2.25 |
| 12 | 日本 | 社債券 | 第3回三井住友海上火災保険株式会社利払繰延条項・期限前償還条 | 400,000,000 | 100.67 | 402,714,000 | 100.61 | 402,476,000 | 0.8500000 | 2077/12/10 | 2.10 |
| 13 | 日本 | 特殊債券 | 第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年） | 400,000,000 | 100.04 | 400,168,000 | 99.96 | 399,860,000 | 0.0010000 | 2024/8/28 | 2.08 |
| 14 | 日本 | 地方債証券 | 第807回東京都公募公債 | 400,000,000 | 100.00 | 400,000,000 | 99.53 | 398,140,000 | 0.1000000 | 2030/6/20 | 2.07 |
| 15 | 日本 | 国債証券 | 第38回利付国債（30年） | 310,000,000 | 127.79 | 396,163,000 | 127.04 | 393,824,000 | 1.8000000 | 2043/3/20 | 2.05 |
| 16 | 日本 | 国債証券 | 第154回利付国債（20年） | 340,000,000 | 113.89 | 387,226,000 | 113.41 | 385,594,000 | 1.2000000 | 2035/9/20 | 2.01 |
| 17 | 日本 | 国債証券 | 第342回利付国債（10年） | 340,000,000 | 101.06 | 343,604,000 | 101.10 | 343,770,600 | 0.1000000 | 2026/3/20 | 1.79 |
| 18 | 日本 | 国債証券 | 第418回利付国債（2年） | 330,000,000 | 100.44 | 331,452,100 | 100.43 | 331,445,400 | 0.1000000 | 2022/11/1 | 1.73 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|----|-------|------------------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|-----------|------------|------|
| 19 | 日本 | 地方債証券 | 第135回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 102.45 | 307,350,000 | 102.20 | 306,621,000 | 0.6590000 | 2024/6/25 | 1.60 |
| 20 | 日本 | 国債証券 | 第152回利付国債(20年) | 270,000,000 | 113.77 | 307,181,700 | 113.27 | 305,837,100 | 1.2000000 | 2035/3/20 | 1.59 |
| 21 | 日本 | 国債証券 | 第158回利付国債(20年) | 260,000,000 | 103.08 | 268,008,000 | 102.90 | 267,563,400 | 0.5000000 | 2036/9/20 | 1.39 |
| 22 | 日本 | 国債証券 | 第113回利付国債(20年) | 180,000,000 | 119.44 | 214,999,200 | 118.28 | 212,907,600 | 2.1000000 | 2029/9/20 | 1.11 |
| 23 | 日本 | 社債券 | 第1回武田薬品工業株式会社無担保社債(劣後特約付)FR | 200,000,000 | 103.40 | 206,800,000 | 103.01 | 206,032,000 | 1.7200000 | 2079/6/6 | 1.07 |
| 24 | 日本 | 社債券 | 第1回九州電力株式会社利払繰延条項・期限前 | 200,000,000 | 100.00 | 200,000,000 | 101.64 | 203,294,000 | 0.9900000 | 2080/10/15 | 1.06 |
| 25 | 日本 | 国債証券 | 第353回利付国債(10年) | 200,000,000 | 101.45 | 202,900,000 | 101.14 | 202,292,000 | 0.1000000 | 2028/12/20 | 1.05 |
| 26 | 日本 | 社債券 | 第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付) | 200,000,000 | 99.98 | 199,960,000 | 101.06 | 202,134,000 | 0.5800000 | 2025/7/16 | 1.05 |
| 27 | 日本 | 社債券 | 第1回アサヒホールディングス株式会社利払繰延条項・期限前 | 200,000,000 | 100.00 | 200,000,000 | 100.96 | 201,920,000 | 0.9700000 | 2080/10/15 | 1.05 |
| 28 | 日本 | 地方債証券 | 第180回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 100.97 | 201,952,000 | 100.70 | 201,416,000 | 0.1900000 | 2028/3/24 | 1.05 |
| 29 | 日本 | 国債証券 | 第412回利付国債(2年) | 200,000,000 | 100.47 | 200,954,000 | 100.28 | 200,572,000 | 0.1000000 | 2022/5/1 | 1.04 |
| 30 | 日本 | 地方債証券 | 令和2年度第10回愛知県公募公債(10年) | 200,000,000 | 100.35 | 200,708,000 | 100.14 | 200,282,000 | 0.1500000 | 2030/9/20 | 1.04 |

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

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

投資有価証券の種類別投資比率

2021年1月29日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 国債証券 | 68.00 |
| 地方債証券 | 6.87 |
| 特殊債券 | 3.23 |
| 社債券 | 19.43 |
| 合計 | 97.53 |

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

2021年1月29日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 （円） | 簿価金額 （円） | 評価単価 （円） | 評価金額 （円） | 利率(%) | 償還日 | 投資 比率 (%) |
|----|---------|------|--------------------------|------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------|------------|-----------------|
| 1 | ドイツ | 国債証券 | GERMANY 0.0 220610 | 3,800,000 | 12,783.36 | 485,767,738 | 12,771.44 | 485,314,890 | 0.0000000 | 2022/6/10 | 5.38 |
| 2 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 1.5 300215 | 4,380,000 | 11,209.59 | 490,980,209 | 10,916.48 | 478,142,188 | 1.5000000 | 2030/2/15 | 5.30 |
| 3 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 2.25 270815 | 3,450,000 | 11,705.36 | 403,834,973 | 11,505.02 | 396,923,333 | 2.2500000 | 2027/8/15 | 4.40 |
| 4 | フランス | 国債証券 | FRANCE 0.0 220525 | 2,900,000 | 12,779.19 | 370,596,518 | 12,755.76 | 369,917,068 | 0.0000000 | 2022/5/25 | 4.10 |
| 5 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 2.75 250228 | 2,240,000 | 11,600.86 | 259,859,371 | 11,482.14 | 257,200,004 | 2.7500000 | 2025/2/28 | 2.85 |
| 6 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 2.125 250515 | 2,270,000 | 11,366.85 | 258,027,495 | 11,243.82 | 255,234,808 | 2.1250000 | 2025/5/15 | 2.83 |
| 7 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 2.875 490515 | 1,940,000 | 14,149.10 | 274,492,662 | 13,003.58 | 252,269,468 | 2.8750000 | 2049/5/15 | 2.80 |
| 8 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 2.125 240229 | 2,210,000 | 11,168.91 | 246,832,955 | 11,065.05 | 244,537,801 | 2.1250000 | 2024/2/29 | 2.71 |
| 9 | イタリア | 国債証券 | ITALY 1.0 220715 | 1,810,000 | 12,948.07 | 234,360,105 | 12,901.21 | 233,511,955 | 1.0000000 | 2022/7/15 | 2.59 |
| 10 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 1.875 260630 | 1,940,000 | 11,365.43 | 220,489,514 | 11,215.19 | 217,574,815 | 1.8750000 | 2026/6/30 | 2.41 |
| 11 | イタリア | 国債証券 | ITALY 2.8 281201 | 1,390,000 | 14,440.49 | 200,722,837 | 14,989.27 | 208,350,871 | 2.8000000 | 2028/12/1 | 2.31 |
| 12 | ポーランド | 国債証券 | POLAND 2.5 260725 | 6,310,000 | 3,066.21 | 193,478,372 | 3,072.33 | 193,864,583 | 2.5000000 | 2026/7/25 | 2.15 |
| 13 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 3.0 480215 | 1,340,000 | 14,634.51 | 196,102,482 | 13,230.51 | 177,288,852 | 3.0000000 | 2048/2/15 | 1.97 |
| 14 | フランス | 国債証券 | FRANCE 0.0 220225 | 1,380,000 | 12,763.09 | 176,130,736 | 12,731.22 | 175,690,889 | 0.0000000 | 2022/2/25 | 1.95 |
| 15 | ドイツ | 国債証券 | GERMANY 0 300215 | 1,250,000 | 13,281.85 | 166,023,150 | 13,354.64 | 166,933,047 | 0.0000000 | 2030/2/15 | 1.85 |
| 16 | マレーシア | 国債証券 | MALAYSIA 4.059 240930 | 6,040,000 | 2,766.62 | 167,103,870 | 2,762.41 | 166,850,076 | 4.0590000 | 2024/9/30 | 1.85 |
| 17 | ノルウェー | 国債証券 | NORWAY 2.0 230524 | 11,910,000 | 1,263.36 | 150,466,613 | 1,256.45 | 149,643,929 | 2.0000000 | 2023/5/24 | 1.66 |
| 18 | スペイン | 国債証券 | SPAIN 5.75 320730 | 640,000 | 20,526.54 | 131,369,919 | 20,665.82 | 132,261,249 | 5.7500000 | 2032/7/30 | 1.47 |
| 19 | フランス | 国債証券 | FRANCE 1.25 340525 | 810,000 | 14,935.94 | 120,981,156 | 14,953.35 | 121,122,143 | 1.2500000 | 2034/5/25 | 1.34 |
| 20 | フランス | 国債証券 | FRANCE 0.0 291125 | 900,000 | 13,056.36 | 117,507,257 | 13,078.41 | 117,705,703 | 0.0000000 | 2029/11/25 | 1.31 |
| 21 | オーストラリア | 国債証券 | AUSTRALIA 4.75 270421 | 1,160,000 | 10,190.55 | 118,210,493 | 10,064.21 | 116,744,884 | 4.7500000 | 2027/4/21 | 1.30 |
| 22 | スペイン | 国債証券 | SPAIN 1.5 270430 | 800,000 | 14,037.86 | 112,302,883 | 14,069.50 | 112,556,070 | 1.5000000 | 2027/4/30 | 1.25 |
| 23 | イギリス | 国債証券 | UK GILT 4.0 600122 | 340,000 | 31,747.42 | 107,941,252 | 29,885.02 | 101,609,070 | 4.0000000 | 2060/1/22 | 1.13 |
| 24 | カナダ | 国債証券 | CANADA 5.75 290601 | 860,000 | 11,846.91 | 101,883,505 | 11,443.82 | 98,416,937 | 5.7500000 | 2029/6/1 | 1.09 |
| 25 | スペイン | 国債証券 | SPAIN 4.7 410730 | 425,000 | 22,010.31 | 93,543,848 | 22,464.11 | 95,472,479 | 4.7000000 | 2041/7/30 | 1.06 |
| 26 | フランス | 国債証券 | FRANCE 4.0 381025 | 410,000 | 21,584.18 | 88,495,147 | 21,554.21 | 88,372,284 | 4.0000000 | 2038/10/25 | 0.98 |
| 27 | フランス | 国債証券 | FRA 0.00 240325 | 640,000 | 12,932.58 | 82,768,513 | 12,932.70 | 82,769,322 | 0.0000000 | 2024/3/25 | 0.92 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|------|------|--------------------------|---------|-----------|------------|-----------|------------|-----------|-----------|------|
| 28 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 2.875 430515 | 620,000 | 13,924.36 | 86,331,051 | 12,787.30 | 79,281,305 | 2.8750000 | 2043/5/15 | 0.88 |
| 29 | ドイツ | 国債証券 | GERMANY 2.5 460815 | 340,000 | 21,519.59 | 73,166,618 | 21,514.12 | 73,148,013 | 2.5000000 | 2046/8/15 | 0.81 |
| 30 | ベルギー | 国債証券 | BELGIUM 3.0 340622 | 400,000 | 17,876.22 | 71,504,899 | 17,979.13 | 71,916,528 | 3.0000000 | 2034/6/22 | 0.80 |

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

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

投資有価証券の種類別投資比率

2021年1月29日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 95.10 |
| 合計 | 95.10 |

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考) 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド

2021年1月29日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価単価 (円) | 簿価金額 (円) | 評価単価 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|-----------|----|---------------------------------|--|--------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------|
| 1 | アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフト ウェア・ サービス | 17,791 | 21,768.40 | 387,281,746 | 24,963.40 | 444,123,963 | 3.09 |
| 2 | アメリカ | 株式 | TRADE DESK INC/THE - CLASS A | ソフト ウェア・ サービス | 5,265 | 45,218.94 | 238,077,740 | 83,011.44 | 437,055,282 | 3.04 |
| 3 | アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | ソフト ウェア・ サービス | 19,573 | 20,211.65 | 395,602,743 | 20,710.02 | 405,357,331 | 2.82 |
| 4 | アメリカ | 株式 | FISERV INC | ソフト ウェア・ サービス | 34,308 | 10,355.01 | 355,259,779 | 10,996.51 | 377,268,608 | 2.63 |
| 5 | バミュー ダ | 株式 | IHS MARKIT LTD | 商業・専 門サービ ス | 34,304 | 8,047.04 | 276,045,990 | 9,173.34 | 314,682,393 | 2.19 |
| 6 | カナダ | 株式 | WASTE CONNECTIONS INC | 商業・専 門サービ ス | 30,122 | 10,255.75 | 308,923,906 | 10,398.89 | 313,235,497 | 2.18 |
| 7 | アメリカ | 株式 | COSTAR GROUP INC | 商業・専 門サービ ス | 3,029 | 91,574.63 | 277,379,556 | 94,220.06 | 285,392,574 | 1.99 |
| 8 | アメリカ | 株式 | DANAHER CORP | ヘルスケ ア機器・ サービス | 11,142 | 19,375.81 | 215,885,342 | 23,880.99 | 266,082,031 | 1.85 |
| 9 | アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | 小売 | 751 | 322,747.07 | 242,383,056 | 338,266.53 | 254,038,170 | 1.77 |
| 10 | アメリカ | 株式 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス | 4,768 | 40,481.82 | 193,017,322 | 51,872.23 | 247,326,795 | 1.72 |

| | | | | | | | | | | |
|----|------|------|------------------------------|------------------------|--------|------------|-------------|------------|-------------|------|
| 11 | アメリカ | 株式 | MSCI INC | 各種金融 | 5,881 | 37,939.82 | 223,124,095 | 41,293.63 | 242,847,840 | 1.69 |
| 12 | アメリカ | 株式 | SERVICENOW INC | ソフトウェア・サービス | 3,921 | 43,509.65 | 170,601,342 | 57,906.99 | 227,053,328 | 1.58 |
| 13 | アメリカ | 株式 | S&P GLOBAL INC | 各種金融 | 6,768 | 36,870.99 | 249,542,874 | 33,325.98 | 225,550,271 | 1.57 |
| 14 | アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC-CLASS A | ソフトウェア・サービス | 6,531 | 31,299.07 | 204,414,250 | 33,880.77 | 221,275,338 | 1.54 |
| 15 | アメリカ | 株式 | ROPER TECHNOLOGIES INC | 資本財 | 4,719 | 41,445.12 | 195,579,552 | 44,177.27 | 208,472,577 | 1.45 |
| 16 | アメリカ | 株式 | ADOBE SYSTEMS INC | ソフトウェア・サービス | 4,115 | 45,607.60 | 187,675,314 | 48,653.20 | 200,207,925 | 1.39 |
| 17 | アメリカ | 株式 | ALPHABET, INC | メディア・娯楽 | 1,008 | 158,644.52 | 159,913,678 | 194,657.73 | 196,214,995 | 1.37 |
| 18 | アメリカ | 株式 | TRANSUNION | 商業・専門サービス | 20,220 | 8,789.90 | 177,731,827 | 9,354.09 | 189,139,789 | 1.32 |
| 19 | アメリカ | 株式 | PAYPAL HOLDINGS INC | ソフトウェア・サービス | 7,612 | 18,096.98 | 137,754,217 | 24,844.29 | 189,114,805 | 1.32 |
| 20 | アメリカ | 株式 | METTLER TOLEDO INTERNATIONAL | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 1,350 | 88,739.04 | 119,797,708 | 122,325.18 | 165,138,998 | 1.15 |
| 21 | アメリカ | 株式 | FACEBOOK INC-A | メディア・娯楽 | 5,759 | 25,144.15 | 144,805,199 | 27,687.20 | 159,450,585 | 1.11 |
| 22 | アメリカ | 投資証券 | AMERICAN TOWER CORP | | 6,618 | 26,817.53 | 177,478,430 | 23,853.82 | 157,864,639 | 1.10 |
| 23 | アメリカ | 株式 | SALESFORCE.COM INC | ソフトウェア・サービス | 6,262 | 20,067.47 | 125,662,520 | 23,664.72 | 148,188,477 | 1.03 |
| 24 | アメリカ | 株式 | FREEPORT-MCMORAN COPPER | 素材 | 50,729 | 1,947.28 | 98,783,869 | 2,903.49 | 147,291,611 | 1.03 |
| 25 | アメリカ | 株式 | JP MORGAN CHASE & CO | 銀行 | 10,536 | 11,811.31 | 124,443,965 | 13,593.89 | 143,225,255 | 1.00 |
| 26 | アメリカ | 株式 | INTERCONTINENTALEXCHANGE INC | 各種金融 | 12,008 | 10,603.02 | 127,321,066 | 11,765.49 | 141,280,038 | 0.98 |
| 27 | アメリカ | 株式 | LENNAR CORP-CL A | 耐久消費財・アパレル | 15,812 | 7,244.47 | 114,549,673 | 8,808.70 | 139,283,304 | 0.97 |
| 28 | アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP | 半導体・半導体製造装置 | 2,487 | 43,826.22 | 108,995,823 | 54,542.73 | 135,647,792 | 0.95 |
| 29 | アメリカ | 株式 | COMCAST CORP-CL A | メディア・娯楽 | 24,743 | 4,590.87 | 113,592,117 | 5,391.16 | 133,393,670 | 0.93 |
| 30 | アメリカ | 株式 | AES CORP | 公益事業 | 50,764 | 1,922.43 | 97,590,338 | 2,564.98 | 130,208,848 | 0.91 |

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別及び業種別投資比率

2021年1月29日現在

| 種類 | 国内/外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|-------|-----------|-------------|
| 株式 | 外国 | エネルギー | 1.45 |
| | | 素材 | 3.15 |
| | | 資本財 | 7.39 |
| | | 商業・専門サービス | 7.68 |
| | | 運輸 | 0.98 |
| | | 自動車・自動車部品 | 0.74 |

| | | |
|------|------------------------|-------|
| | 耐久消費財・アパレル | 1.60 |
| | 消費者サービス | 0.69 |
| | メディア・娯楽 | 6.18 |
| | 小売 | 3.96 |
| | 食品・生活必需品小売り | 0.54 |
| | 食品・飲料・タバコ | 2.64 |
| | 家庭用品・パーソナル用品 | 0.49 |
| | ヘルスケア機器・サービス | 6.77 |
| | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.61 |
| | 銀行 | 3.74 |
| | 各種金融 | 6.02 |
| | 保険 | 1.70 |
| | 不動産 | 0.79 |
| | ソフトウェア・サービス | 19.82 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 1.83 |
| | 電気通信サービス | 0.89 |
| | 公益事業 | 1.46 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 3.70 |
| 投資証券 | | 5.14 |
| 合計 | | 96.97 |

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

【投資不動産物件】

ハッピーエイジング20

該当事項はありません。

ハッピーエイジング30

該当事項はありません。

ハッピーエイジング40

該当事項はありません。

ハッピーエイジング50

該当事項はありません。

ハッピーエイジング60

該当事項はありません。

（参考）S J A M ラージキャップ・バリュース・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）S J A M スモールキャップ・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

ハッピーエイジング20

該当事項はありません。

ハッピーエイジング30

2021年1月29日現在

| 種類 | 通貨 | 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 | ドル | 売建 | 716,314.90 | 74,819,735 | 74,833,417 | 0.54 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当銘柄の時価の比率です。

（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。

ハッピーエイジング40

2021年1月29日現在

| 種類 | 通貨 | 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 | ドル | 売建 | 1,041,283.00 | 108,762,946 | 108,782,835 | 0.60 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当銘柄の時価の比率です。

（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。

ハッピーエイジング50

該当事項はありません。

ハッピーエイジング60

該当事項はありません。

（参考）S J A Mラージキャップ・バリュー・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

ハッピーエイジング20

直近日（2021年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

| | 純資産総額（円） | | 1口当たりの純資産額（円） | |
|----------------------|----------------|----------------|---------------|--------|
| | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |
| 第11計算期間末（2011年7月15日） | 4,207,770,641 | 4,207,770,641 | 0.7237 | 0.7237 |
| 第12計算期間末（2012年7月17日） | 4,034,512,435 | 4,034,512,435 | 0.6395 | 0.6395 |
| 第13計算期間末（2013年7月16日） | 6,375,079,876 | 6,375,079,876 | 0.9828 | 0.9828 |
| 第14計算期間末（2014年7月15日） | 7,212,476,370 | 7,212,476,370 | 1.0930 | 1.0930 |
| 第15計算期間末（2015年7月15日） | 8,801,004,620 | 8,801,004,620 | 1.3543 | 1.3543 |
| 第16計算期間末（2016年7月15日） | 7,416,738,892 | 7,416,738,892 | 1.1099 | 1.1099 |
| 第17計算期間末（2017年7月18日） | 9,271,419,094 | 9,271,419,094 | 1.4045 | 1.4045 |
| 第18計算期間末（2018年7月17日） | 10,439,689,943 | 10,439,689,943 | 1.5015 | 1.5015 |
| 第19計算期間末（2019年7月16日） | 10,453,350,603 | 10,453,350,603 | 1.4179 | 1.4179 |

| | | | | | |
|----------|---------------|----------------|----------------|--------|--------|
| 第20計算期間末 | (2020年 7月15日) | 10,189,146,231 | 10,189,146,231 | 1.3797 | 1.3797 |
| | 2020年 1月末日 | 11,022,385,299 | | 1.4910 | |
| | 2月末日 | 10,018,688,273 | | 1.3593 | |
| | 3月末日 | 8,886,661,698 | | 1.2237 | |
| | 4月末日 | 9,486,002,103 | | 1.2908 | |
| | 5月末日 | 10,073,525,597 | | 1.3540 | |
| | 6月末日 | 10,037,595,594 | | 1.3545 | |
| | 7月末日 | 9,818,268,987 | | 1.3199 | |
| | 8月末日 | 10,580,176,136 | | 1.4218 | |
| | 9月末日 | 10,482,560,631 | | 1.4006 | |
| | 10月末日 | 10,225,578,780 | | 1.3660 | |
| | 11月末日 | 10,942,596,541 | | 1.4766 | |
| | 12月末日 | 11,124,144,092 | | 1.5047 | |
| | 2021年 1月末日 | 11,264,545,417 | | 1.5266 | |

ハッピーエイジング30

直近日（2021年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

| | | 純資産総額（円） | | 1口当たりの純資産額（円） | |
|----------|---------------|----------------|----------------|---------------|--------|
| | | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |
| 第11計算期間末 | (2011年 7月15日) | 5,192,320,517 | 5,192,320,517 | 0.7985 | 0.7985 |
| 第12計算期間末 | (2012年 7月17日) | 5,099,609,632 | 5,099,609,632 | 0.7258 | 0.7258 |
| 第13計算期間末 | (2013年 7月16日) | 7,661,401,181 | 7,661,401,181 | 1.0552 | 1.0552 |
| 第14計算期間末 | (2014年 7月15日) | 8,543,771,190 | 8,543,771,190 | 1.1614 | 1.1614 |
| 第15計算期間末 | (2015年 7月15日) | 10,450,600,803 | 10,450,600,803 | 1.3944 | 1.3944 |
| 第16計算期間末 | (2016年 7月15日) | 9,226,785,122 | 9,226,785,122 | 1.1894 | 1.1894 |
| 第17計算期間末 | (2017年 7月18日) | 11,485,239,619 | 11,485,239,619 | 1.4397 | 1.4397 |
| 第18計算期間末 | (2018年 7月17日) | 12,738,786,784 | 12,738,786,784 | 1.5148 | 1.5148 |
| 第19計算期間末 | (2019年 7月16日) | 12,699,403,491 | 12,699,403,491 | 1.4446 | 1.4446 |
| 第20計算期間末 | (2020年 7月15日) | 12,817,876,592 | 12,817,876,592 | 1.4293 | 1.4293 |
| | 2020年 1月末日 | 13,571,254,625 | | 1.5095 | |
| | 2月末日 | 12,681,826,254 | | 1.4078 | |
| | 3月末日 | 11,580,189,884 | | 1.3031 | |
| | 4月末日 | 12,096,456,493 | | 1.3521 | |
| | 5月末日 | 12,592,444,217 | | 1.4061 | |
| | 6月末日 | 12,610,988,998 | | 1.4085 | |
| | 7月末日 | 12,423,359,564 | | 1.3780 | |
| | 8月末日 | 13,200,574,696 | | 1.4606 | |
| | 9月末日 | 13,077,884,222 | | 1.4451 | |
| | 10月末日 | 12,809,150,311 | | 1.4133 | |
| | 11月末日 | 13,563,805,204 | | 1.5029 | |
| | 12月末日 | 13,768,666,037 | | 1.5280 | |

| | | | | |
|------------|----------------|--|--------|--|
| 2021年 1月末日 | 13,941,106,542 | | 1.5457 | |
|------------|----------------|--|--------|--|

ハッピーエイジング40

直近日(2021年1月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

| | 純資産総額(円) | | 1口当たりの純資産額(円) | |
|------------------------|----------------|----------------|---------------|--------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) |
| 第11計算期間末 (2011年 7月15日) | 7,355,736,675 | 7,355,736,675 | 0.9092 | 0.9092 |
| 第12計算期間末 (2012年 7月17日) | 7,397,925,868 | 7,397,925,868 | 0.8565 | 0.8565 |
| 第13計算期間末 (2013年 7月16日) | 9,756,993,303 | 9,756,993,303 | 1.1196 | 1.1196 |
| 第14計算期間末 (2014年 7月15日) | 10,651,044,828 | 10,651,044,828 | 1.2075 | 1.2075 |
| 第15計算期間末 (2015年 7月15日) | 12,378,839,543 | 12,378,839,543 | 1.3816 | 1.3816 |
| 第16計算期間末 (2016年 7月15日) | 11,857,174,350 | 11,857,174,350 | 1.2636 | 1.2636 |
| 第17計算期間末 (2017年 7月18日) | 13,906,785,392 | 13,906,785,392 | 1.4368 | 1.4368 |
| 第18計算期間末 (2018年 7月17日) | 15,282,979,036 | 15,282,979,036 | 1.4924 | 1.4924 |
| 第19計算期間末 (2019年 7月16日) | 16,189,690,869 | 16,189,690,869 | 1.4537 | 1.4537 |
| 第20計算期間末 (2020年 7月15日) | 16,815,567,800 | 16,815,567,800 | 1.4410 | 1.4410 |
| 2020年 1月末日 | 17,327,943,395 | | 1.5005 | |
| 2月末日 | 16,587,767,148 | | 1.4320 | |
| 3月末日 | 15,376,591,727 | | 1.3486 | |
| 4月末日 | 15,885,822,714 | | 1.3854 | |
| 5月末日 | 16,410,520,505 | | 1.4226 | |
| 6月末日 | 16,621,717,628 | | 1.4250 | |
| 7月末日 | 16,501,795,060 | | 1.4056 | |
| 8月末日 | 17,207,458,621 | | 1.4628 | |
| 9月末日 | 17,179,308,399 | | 1.4524 | |
| 10月末日 | 16,966,408,651 | | 1.4297 | |
| 11月末日 | 17,663,250,996 | | 1.4951 | |
| 12月末日 | 17,971,181,915 | | 1.5129 | |
| 2021年 1月末日 | 18,241,877,079 | | 1.5256 | |

ハッピーエイジング50

直近日(2021年1月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

| | 純資産総額(円) | | 1口当たりの純資産額(円) | |
|------------------------|---------------|---------------|---------------|--------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) |
| 第11計算期間末 (2011年 7月15日) | 3,702,379,934 | 3,702,379,934 | 1.0057 | 1.0057 |
| 第12計算期間末 (2012年 7月17日) | 3,809,563,912 | 3,809,563,912 | 0.9795 | 0.9795 |
| 第13計算期間末 (2013年 7月16日) | 4,480,882,597 | 4,480,882,597 | 1.1555 | 1.1555 |
| 第14計算期間末 (2014年 7月15日) | 4,908,333,421 | 4,908,333,421 | 1.2215 | 1.2215 |
| 第15計算期間末 (2015年 7月15日) | 5,534,439,620 | 5,534,439,620 | 1.3347 | 1.3347 |

| | | | | | |
|----------|---------------|---------------|---------------|--------|--------|
| 第16計算期間末 | (2016年 7月15日) | 5,689,949,958 | 5,689,949,958 | 1.3007 | 1.3007 |
| 第17計算期間末 | (2017年 7月18日) | 6,297,794,959 | 6,297,794,959 | 1.3890 | 1.3890 |
| 第18計算期間末 | (2018年 7月17日) | 6,875,070,157 | 6,875,070,157 | 1.4262 | 1.4262 |
| 第19計算期間末 | (2019年 7月16日) | 7,592,282,029 | 7,592,282,029 | 1.4137 | 1.4137 |
| 第20計算期間末 | (2020年 7月15日) | 7,791,444,020 | 7,791,444,020 | 1.4019 | 1.4019 |
| | 2020年 1月末日 | 8,105,867,333 | | 1.4413 | |
| | 2月末日 | 7,925,818,594 | | 1.4058 | |
| | 3月末日 | 7,470,171,741 | | 1.3493 | |
| | 4月末日 | 7,618,518,517 | | 1.3718 | |
| | 5月末日 | 7,723,010,548 | | 1.3924 | |
| | 6月末日 | 7,794,268,817 | | 1.3924 | |
| | 7月末日 | 7,731,119,245 | | 1.3826 | |
| | 8月末日 | 7,981,544,741 | | 1.4133 | |
| | 9月末日 | 7,985,173,182 | | 1.4088 | |
| | 10月末日 | 7,995,171,012 | | 1.3942 | |
| | 11月末日 | 8,190,879,431 | | 1.4328 | |
| | 12月末日 | 8,256,511,189 | | 1.4432 | |
| | 2021年 1月末日 | 8,333,298,635 | | 1.4488 | |

ハッピーエイジング60

直近日（2021年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

| | | 純資産総額（円） | | 1口当たりの純資産額（円） | |
|----------|---------------|---------------|---------------|---------------|--------|
| | | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |
| 第11計算期間末 | (2011年 7月15日) | 2,184,577,562 | 2,184,577,562 | 1.0737 | 1.0737 |
| 第12計算期間末 | (2012年 7月17日) | 2,434,101,752 | 2,434,101,752 | 1.0812 | 1.0812 |
| 第13計算期間末 | (2013年 7月16日) | 2,695,707,446 | 2,695,707,446 | 1.1485 | 1.1485 |
| 第14計算期間末 | (2014年 7月15日) | 3,031,298,200 | 3,031,298,200 | 1.1883 | 1.1883 |
| 第15計算期間末 | (2015年 7月15日) | 3,292,018,524 | 3,292,018,524 | 1.2399 | 1.2399 |
| 第16計算期間末 | (2016年 7月15日) | 3,737,464,193 | 3,737,464,193 | 1.2843 | 1.2843 |
| 第17計算期間末 | (2017年 7月18日) | 3,967,051,489 | 3,967,051,489 | 1.2846 | 1.2846 |
| 第18計算期間末 | (2018年 7月17日) | 4,186,192,577 | 4,186,192,577 | 1.3015 | 1.3015 |
| 第19計算期間末 | (2019年 7月16日) | 4,551,251,809 | 4,551,251,809 | 1.3089 | 1.3089 |
| 第20計算期間末 | (2020年 7月15日) | 4,870,043,859 | 4,870,043,859 | 1.3009 | 1.3009 |
| | 2020年 1月末日 | 4,919,879,060 | | 1.3228 | |
| | 2月末日 | 4,965,138,285 | | 1.3180 | |
| | 3月末日 | 4,807,927,207 | | 1.2893 | |
| | 4月末日 | 4,879,981,458 | | 1.2942 | |
| | 5月末日 | 4,872,379,618 | | 1.3002 | |
| | 6月末日 | 4,877,238,131 | | 1.2982 | |
| | 7月末日 | 4,934,417,456 | | 1.2966 | |
| | 8月末日 | 4,987,425,781 | | 1.3028 | |

| | | | |
|------------|---------------|--|--------|
| 9月末日 | 4,998,571,644 | | 1.3043 |
| 10月末日 | 4,972,972,028 | | 1.2949 |
| 11月末日 | 5,085,042,419 | | 1.3085 |
| 12月末日 | 5,165,468,344 | | 1.3126 |
| 2021年 1月末日 | 5,198,644,823 | | 1.3106 |

【分配の推移】

ハッピーエイジング20

| | 1口当たりの分配金(円) |
|------------|--------------|
| 第11計算期間 | 0.0000 |
| 第12計算期間 | 0.0000 |
| 第13計算期間 | 0.0000 |
| 第14計算期間 | 0.0000 |
| 第15計算期間 | 0.0000 |
| 第16計算期間 | 0.0000 |
| 第17計算期間 | 0.0000 |
| 第18計算期間 | 0.0000 |
| 第19計算期間 | 0.0000 |
| 第20計算期間 | 0.0000 |
| 第21中間計算期間末 | |

ハッピーエイジング30

| | 1口当たりの分配金(円) |
|------------|--------------|
| 第11計算期間 | 0.0000 |
| 第12計算期間 | 0.0000 |
| 第13計算期間 | 0.0000 |
| 第14計算期間 | 0.0000 |
| 第15計算期間 | 0.0000 |
| 第16計算期間 | 0.0000 |
| 第17計算期間 | 0.0000 |
| 第18計算期間 | 0.0000 |
| 第19計算期間 | 0.0000 |
| 第20計算期間 | 0.0000 |
| 第21中間計算期間末 | |

ハッピーエイジング40

| | 1口当たりの分配金(円) |
|------------|--------------|
| 第11計算期間 | 0.0000 |
| 第12計算期間 | 0.0000 |
| 第13計算期間 | 0.0000 |
| 第14計算期間 | 0.0000 |
| 第15計算期間 | 0.0000 |
| 第16計算期間 | 0.0000 |
| 第17計算期間 | 0.0000 |
| 第18計算期間 | 0.0000 |
| 第19計算期間 | 0.0000 |
| 第20計算期間 | 0.0000 |
| 第21中間計算期間末 | |

ハッピーエイジング50

| | 1口当たりの分配金(円) |
|------------|--------------|
| 第11計算期間 | 0.0000 |
| 第12計算期間 | 0.0000 |
| 第13計算期間 | 0.0000 |
| 第14計算期間 | 0.0000 |
| 第15計算期間 | 0.0000 |
| 第16計算期間 | 0.0000 |
| 第17計算期間 | 0.0000 |
| 第18計算期間 | 0.0000 |
| 第19計算期間 | 0.0000 |
| 第20計算期間 | 0.0000 |
| 第21中間計算期間末 | |

ハッピーエイジング60

| | 1口当たりの分配金(円) |
|---------|--------------|
| 第11計算期間 | 0.0000 |
| 第12計算期間 | 0.0000 |
| 第13計算期間 | 0.0000 |
| 第14計算期間 | 0.0000 |
| 第15計算期間 | 0.0000 |
| 第16計算期間 | 0.0000 |
| 第17計算期間 | 0.0000 |
| 第18計算期間 | 0.0000 |
| 第19計算期間 | 0.0000 |
| 第20計算期間 | 0.0000 |

| | |
|------------|--|
| 第21中間計算期間末 | |
|------------|--|

【収益率の推移】

ハッピーエイジング20

| | 収益率（%） |
|------------|--------|
| 第11計算期間 | 4.1 |
| 第12計算期間 | 11.6 |
| 第13計算期間 | 53.7 |
| 第14計算期間 | 11.2 |
| 第15計算期間 | 23.9 |
| 第16計算期間 | 18.0 |
| 第17計算期間 | 26.5 |
| 第18計算期間 | 6.9 |
| 第19計算期間 | 5.6 |
| 第20計算期間 | 2.7 |
| 第21中間計算期間末 | 11.7 |

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

ハッピーエイジング30

| | 収益率（%） |
|------------|--------|
| 第11計算期間 | 2.6 |
| 第12計算期間 | 9.1 |
| 第13計算期間 | 45.4 |
| 第14計算期間 | 10.1 |
| 第15計算期間 | 20.1 |
| 第16計算期間 | 14.7 |
| 第17計算期間 | 21.0 |
| 第18計算期間 | 5.2 |
| 第19計算期間 | 4.6 |
| 第20計算期間 | 1.1 |
| 第21中間計算期間末 | 9.0 |

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

ハッピーエイジング40

| | 収益率（％） |
|------------|--------|
| 第11計算期間 | 2.1 |
| 第12計算期間 | 5.8 |
| 第13計算期間 | 30.7 |
| 第14計算期間 | 7.9 |
| 第15計算期間 | 14.4 |
| 第16計算期間 | 8.5 |
| 第17計算期間 | 13.7 |
| 第18計算期間 | 3.9 |
| 第19計算期間 | 2.6 |
| 第20計算期間 | 0.9 |
| 第21中間計算期間末 | 6.5 |

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

ハッピーエイジング50

| | 収益率（％） |
|------------|--------|
| 第11計算期間 | 1.3 |
| 第12計算期間 | 2.6 |
| 第13計算期間 | 18.0 |
| 第14計算期間 | 5.7 |
| 第15計算期間 | 9.3 |
| 第16計算期間 | 2.5 |
| 第17計算期間 | 6.8 |
| 第18計算期間 | 2.7 |
| 第19計算期間 | 0.9 |
| 第20計算期間 | 0.8 |
| 第21中間計算期間末 | 3.8 |

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

ハッピーエイジング60

| | 収益率（％） |
|---------|--------|
| 第11計算期間 | 0.6 |
| 第12計算期間 | 0.7 |
| 第13計算期間 | 6.2 |
| 第14計算期間 | 3.5 |

| | |
|------------|-----|
| 第15計算期間 | 4.3 |
| 第16計算期間 | 3.6 |
| 第17計算期間 | 0.0 |
| 第18計算期間 | 1.3 |
| 第19計算期間 | 0.6 |
| 第20計算期間 | 0.6 |
| 第21中間計算期間末 | 1.0 |

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4)【設定及び解約の実績】

ハッピーエイジング20

| | 設定口数 | 解約口数 |
|------------|---------------|---------------|
| 第11計算期間 | 1,165,350,197 | 699,705,959 |
| 第12計算期間 | 1,229,841,291 | 735,754,993 |
| 第13計算期間 | 1,412,715,175 | 1,234,496,719 |
| 第14計算期間 | 1,198,615,866 | 1,086,750,393 |
| 第15計算期間 | 1,446,470,764 | 1,546,505,235 |
| 第16計算期間 | 1,316,566,721 | 1,133,015,060 |
| 第17計算期間 | 1,187,415,933 | 1,268,396,839 |
| 第18計算期間 | 1,489,193,062 | 1,137,446,811 |
| 第19計算期間 | 1,441,075,609 | 1,021,272,801 |
| 第20計算期間 | 1,610,603,019 | 1,598,232,575 |
| 第21中間計算期間末 | 700,494,438 | 714,902,561 |

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

ハッピーエイジング30

| | 設定口数 | 解約口数 |
|---------|---------------|-------------|
| 第11計算期間 | 1,120,303,076 | 542,221,678 |
| 第12計算期間 | 1,095,836,730 | 572,539,792 |
| 第13計算期間 | 1,142,944,756 | 908,933,490 |
| 第14計算期間 | 925,289,956 | 829,222,130 |
| 第15計算期間 | 1,083,572,839 | 945,383,122 |
| 第16計算期間 | 963,924,983 | 701,088,669 |
| 第17計算期間 | 1,000,840,370 | 780,753,459 |
| 第18計算期間 | 1,190,076,724 | 757,714,913 |
| 第19計算期間 | 1,151,257,690 | 770,237,275 |

| | | |
|------------|---------------|---------------|
| 第20計算期間 | 1,336,572,558 | 1,159,232,504 |
| 第21中間計算期間末 | 576,961,021 | 562,501,711 |

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

ハッピーエイジング40

| | 設定口数 | 解約口数 |
|------------|---------------|---------------|
| 第11計算期間 | 1,345,880,036 | 608,198,860 |
| 第12計算期間 | 1,339,462,020 | 792,859,126 |
| 第13計算期間 | 1,210,013,963 | 1,132,548,340 |
| 第14計算期間 | 1,187,155,993 | 1,081,548,442 |
| 第15計算期間 | 1,360,175,410 | 1,220,689,774 |
| 第16計算期間 | 1,288,216,954 | 864,776,270 |
| 第17計算期間 | 1,431,202,031 | 1,135,435,456 |
| 第18計算期間 | 1,676,258,878 | 1,115,070,892 |
| 第19計算期間 | 1,884,821,803 | 988,431,478 |
| 第20計算期間 | 2,098,383,366 | 1,565,929,863 |
| 第21中間計算期間末 | 940,369,003 | 701,654,647 |

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

ハッピーエイジング50

| | 設定口数 | 解約口数 |
|------------|---------------|-------------|
| 第11計算期間 | 731,775,658 | 384,093,994 |
| 第12計算期間 | 686,143,489 | 478,493,200 |
| 第13計算期間 | 619,762,253 | 631,166,681 |
| 第14計算期間 | 718,206,328 | 577,818,984 |
| 第15計算期間 | 849,878,441 | 721,397,173 |
| 第16計算期間 | 730,303,162 | 502,519,916 |
| 第17計算期間 | 828,831,999 | 669,291,626 |
| 第18計算期間 | 971,431,975 | 684,746,630 |
| 第19計算期間 | 1,121,171,260 | 571,339,838 |
| 第20計算期間 | 1,179,541,160 | 992,253,306 |
| 第21中間計算期間末 | 541,958,368 | 372,799,230 |

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

ハッピーエイジング60

| | 設定口数 | 解約口数 |
|------------|---------------|-------------|
| 第11計算期間 | 411,859,598 | 230,027,943 |
| 第12計算期間 | 406,833,203 | 190,166,524 |
| 第13計算期間 | 479,744,662 | 383,926,075 |
| 第14計算期間 | 553,877,726 | 350,037,487 |
| 第15計算期間 | 649,247,886 | 545,147,386 |
| 第16計算期間 | 720,837,714 | 465,830,338 |
| 第17計算期間 | 748,382,900 | 570,133,617 |
| 第18計算期間 | 671,022,511 | 542,867,692 |
| 第19計算期間 | 829,372,301 | 568,524,688 |
| 第20計算期間 | 1,060,346,963 | 793,901,262 |
| 第21中間計算期間末 | 468,177,094 | 278,711,455 |

(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:2021年1月29日

● 基準価額・純資産の推移 2011/01/31～2021/01/29

● ハッピーエイジング20



● ハッピーエイジング20

| | |
|----------|----|
| 2016年07月 | 0円 |
| 2017年07月 | 0円 |
| 2018年07月 | 0円 |
| 2019年07月 | 0円 |
| 2020年07月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

● ハッピーエイジング30



● ハッピーエイジング30

| | |
|----------|----|
| 2016年07月 | 0円 |
| 2017年07月 | 0円 |
| 2018年07月 | 0円 |
| 2019年07月 | 0円 |
| 2020年07月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

● ハッピーエイジング40



● ハッピーエイジング40

| | |
|----------|----|
| 2016年07月 | 0円 |
| 2017年07月 | 0円 |
| 2018年07月 | 0円 |
| 2019年07月 | 0円 |
| 2020年07月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

● ハッピーエイジング50



● ハッピーエイジング50

| | |
|----------|----|
| 2016年07月 | 0円 |
| 2017年07月 | 0円 |
| 2018年07月 | 0円 |
| 2019年07月 | 0円 |
| 2020年07月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

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

●ハッピーエイジング60



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

●ハッピーエイジング60

| | |
|----------|----|
| 2016年07月 | 0円 |
| 2017年07月 | 0円 |
| 2018年07月 | 0円 |
| 2019年07月 | 0円 |
| 2020年07月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

- 1万口当たり、税引前

● 主要な資産の状況

| 資産別構成 | ハッピーエイジング | | |
|----------------------------|-----------|---------|---------|
| | 20 | 30 | 40 |
| 資産の種類 | 純資産比 | 純資産比 | 純資産比 |
| SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド | 25.68% | 21.69% | 15.26% |
| SJAMスモールキャップ・マザーファンド | 25.92% | 21.90% | 15.41% |
| 損保ジャパン日本債券マザーファンド | 2.01% | 8.04% | 33.11% |
| 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド | 6.07% | 20.18% | 15.12% |
| 損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド | 33.16% | 21.06% | 14.02% |
| ISHARES CORE MSCI EMERGING | 5.52% | 5.08% | 5.08% |
| コール・ローン等 | 1.64% | 2.06% | 2.00% |
| 合計 | 100.00% | 100.00% | 100.00% |

| 資産別構成 | ハッピーエイジング | |
|----------------------------|-----------|---------|
| | 50 | 60 |
| 資産の種類 | 純資産比 | 純資産比 |
| SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド | 9.34% | 3.93% |
| SJAMスモールキャップ・マザーファンド | 9.43% | 3.96% |
| 損保ジャパン日本債券マザーファンド | 57.10% | 72.01% |
| 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド | 11.07% | 16.08% |
| 損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド | 8.00% | 2.00% |
| ISHARES CORE MSCI EMERGING | 3.47% | - |
| コール・ローン等 | 1.58% | 2.03% |
| 合計 | 100.00% | 100.00% |

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

● SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド

| 組入上位5銘柄 | | | |
|---------|-------------------|--------|------|
| | 銘柄名 | 業種 | 純資産比 |
| 1 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 6.0% |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 5.8% |
| 3 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 5.2% |
| 4 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 4.0% |
| 5 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 4.0% |
| 組入銘柄数 | | | 40銘柄 |

● SJAMスモールキャップ・マザーファンド

| 組入上位5銘柄 | | | |
|---------|-------------------|--------|------|
| | 銘柄名 | 業種 | 純資産比 |
| 1 | H. U.グループホールディングス | サービス業 | 3.2% |
| 2 | E I Z O | 電気機器 | 3.2% |
| 3 | シチズン時計 | 精密機器 | 3.1% |
| 4 | 日鉄ソリューションズ | 情報・通信業 | 3.0% |
| 5 | 東邦ホールディングス | 卸売業 | 2.9% |
| 組入銘柄数 | | | 90銘柄 |

● 損保ジャパン日本債券マザーファンド

| 組入上位5銘柄 | | | | |
|---------|----------------|------|------------|------|
| | 銘柄名 | 種類 | 償還日 | 純資産比 |
| 1 | 第138回利付国債(5年) | 国債証券 | 2023/12/20 | 5.7% |
| 2 | 第151回利付国債(20年) | 国債証券 | 2034/12/20 | 4.4% |
| 3 | 第410回利付国債(2年) | 国債証券 | 2022/3/1 | 4.3% |
| 4 | 第43回利付国債(30年) | 国債証券 | 2044/6/20 | 4.3% |
| 5 | 第170回利付国債(20年) | 国債証券 | 2039/9/20 | 4.2% |
| 組入銘柄数 | | | 87銘柄 | |

● 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

| 組入上位5銘柄 | | | | | | |
|---------|----------------------|------|------|---------|------------|------|
| | 銘柄名 | 発行国 | 種類 | 通貨 | 償還日 | 純資産比 |
| 1 | GERMANY 0.0 220610 | ドイツ | 国債証券 | ユーロ | 2022/06/10 | 5.4% |
| 2 | Treasury 1.5 300215 | アメリカ | 国債証券 | アメリカ・ドル | 2030/02/15 | 5.3% |
| 3 | Treasury 2.25 270815 | アメリカ | 国債証券 | アメリカ・ドル | 2027/08/15 | 4.4% |
| 4 | FRANCE 0.0 220525 | フランス | 国債証券 | ユーロ | 2022/05/25 | 4.1% |
| 5 | Treasury 2.75 250228 | アメリカ | 国債証券 | アメリカ・ドル | 2025/02/28 | 2.9% |
| 組入銘柄数 | | | | | 128銘柄 | |

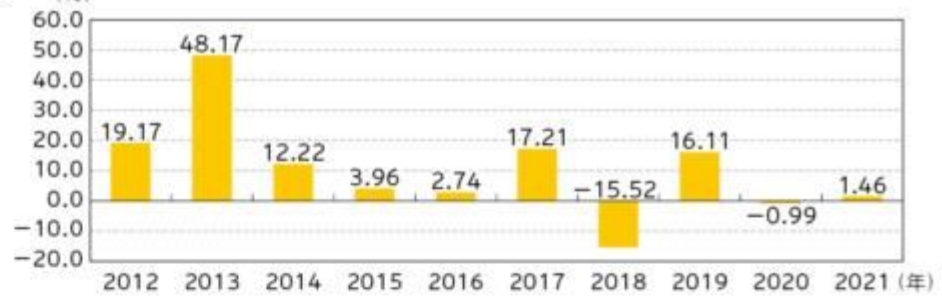
● 損保ジャパンTCW外国株式マザーファンド

| 組入上位5銘柄 | | | | | |
|---------|-----------------------------|---------|--------|----------|------|
| | 銘柄名 | 通貨 | 発行国/地域 | 業種 | 純資産比 |
| 1 | MICROSOFT CORP | アメリカ・ドル | アメリカ | 情報技術 | 3.1% |
| 2 | TRADE DESK INC/THE -CLASS A | アメリカ・ドル | アメリカ | 情報技術 | 3.0% |
| 3 | VISA INC-CLASS A SHARES | アメリカ・ドル | アメリカ | 情報技術 | 2.8% |
| 4 | FISERV INC | アメリカ・ドル | アメリカ | 情報技術 | 2.6% |
| 5 | IHS MARKIT LTD | アメリカ・ドル | アメリカ | 資本財・サービス | 2.2% |
| 組入銘柄数 | | | 228銘柄 | | |

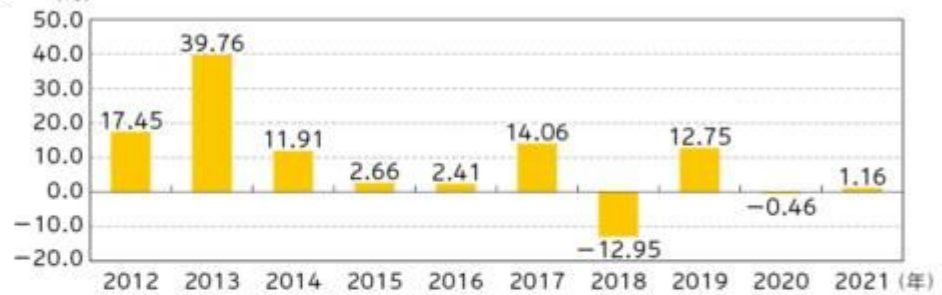
- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

年間収益率の推移（暦年ベース）

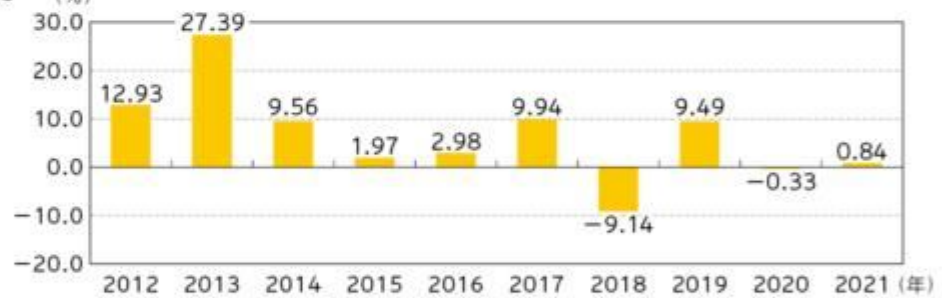
●ハッピーエイジング20 (%)



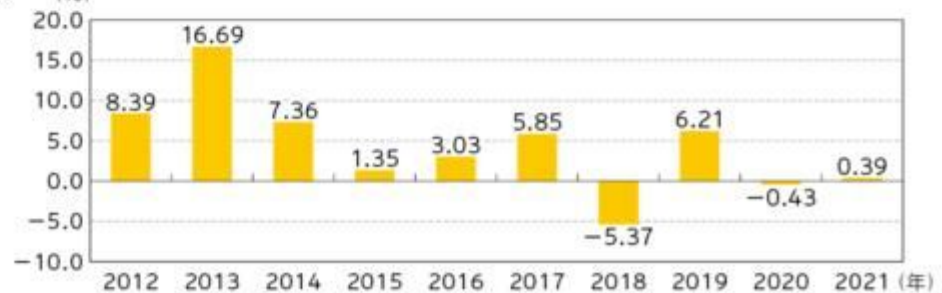
●ハッピーエイジング30 (%)



●ハッピーエイジング40 (%)

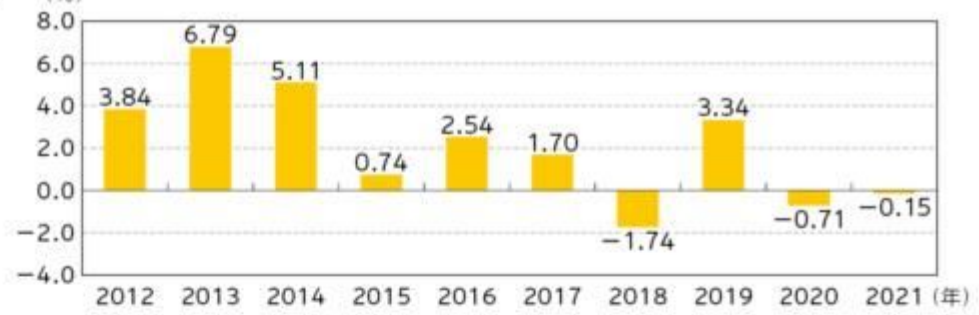


●ハッピーエイジング50 (%)



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

● ハッピーエイジング60 (%)



- 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。
- 2021年は年初から基準日までの収益率です。

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）（以下「中間財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。
- なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2020年7月16日から2021年1月15日までの中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【ハッピーエイジング20】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第20期 2020年7月15日現在 | 第21期中間計算期間末 2021年1月15日現在 |
|-----------------|----------------------|-----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 263,898,900 | 284,734,799 |
| 投資信託受益証券 | 563,990,302 | 622,222,131 |
| 親投資信託受益証券 | 9,448,551,220 | 10,578,107,962 |
| 流動資産合計 | 10,276,440,422 | 11,485,064,892 |
| 資産合計 | | |
| | 10,276,440,422 | 11,485,064,892 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 8,157,269 | 33,414,618 |
| 未払受託者報酬 | 2,676,745 | 2,960,635 |
| 未払委託者報酬 | 76,019,570 | 84,081,895 |
| 未払利息 | 607 | 647 |
| その他未払費用 | 440,000 | 440,000 |
| 流動負債合計 | 87,294,191 | 120,897,795 |
| 負債合計 | | |
| | 87,294,191 | 120,897,795 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 7,385,031,420 | 7,370,623,297 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 2,804,114,811 | 3,993,543,800 |
| 元本等合計 | 10,189,146,231 | 11,364,167,097 |
| 純資産合計 | | |
| | 10,189,146,231 | 11,364,167,097 |
| 負債純資産合計 | | |
| | 10,276,440,422 | 11,485,064,892 |

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日 | 第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
|-------------|--|--|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 10,901,070 | 6,137,614 |
| 有価証券売買等損益 | 806,015,704 | 1,303,413,508 |
| 為替差損益 | 9,656,508 | 17,764,163 |
| 営業収益合計 | 826,573,282 | 1,291,786,959 |
| 営業費用 | | |

| | 第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日 | 第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
|---|--|--|
| 支払利息 | 106,299 | 106,386 |
| 受託者報酬 | 2,894,830 | 2,960,635 |
| 委託者報酬 | 82,213,180 | 84,081,895 |
| その他費用 | 224,225 | 494,841 |
| 営業費用合計 | 85,438,534 | 87,643,757 |
| 営業利益又は営業損失() | 741,134,748 | 1,204,143,202 |
| 経常利益又は経常損失() | 741,134,748 | 1,204,143,202 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 741,134,748 | 1,204,143,202 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額() | 13,779,839 | 48,770,697 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 3,080,689,627 | 2,804,114,811 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 263,726,853 | 306,793,355 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 263,726,853 | 306,793,355 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 260,496,022 | 272,736,871 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 260,496,022 | 272,736,871 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 3,811,275,367 | 3,993,543,800 |

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

| 期別 | 第20期 2020年7月15日現在 | 第21期中間計算期間末 2021年1月15日現在 |
|----|----------------------|-----------------------------|
|----|----------------------|-----------------------------|

| | | |
|----------------------------|--|--|
| 1. 受益権の総数 | 7,385,031,420口 | 7,370,623,297口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3797円 (13,797円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5418円 (15,418円) |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第20期中間計算期間 | 第21期中間計算期間 |
|---|---|------------------------------|
| | 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日 | 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
| 1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 | 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。 | 同左 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第20期 | 第21期中間計算期間末 |
|----------------------------|--|---|
| | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
| 1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 | 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

(その他の注記)

| 項目 | 第20期 | 第21期中間計算期間 |
|-----------|------------------------------|------------------------------|
| | 自 2019年7月17日 至 2020年7月15日 | 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
| 期首元本額 | 7,372,660,976円 | 7,385,031,420円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,610,603,019円 | 700,494,438円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,598,232,575円 | 714,902,561円 |

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング30】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 第20期 2020年7月15日現在 | 第21期中間計算期間末 2021年1月15日現在 |
|-----------------|----------------------|-----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 347,365,062 | 331,565,317 |
| 投資信託受益証券 | 742,741,237 | 784,378,526 |
| 親投資信託受益証券 | 11,823,465,359 | 13,002,393,758 |
| 流動資産合計 | 12,913,571,658 | 14,118,337,601 |
| 資産合計 | 12,913,571,658 | 14,118,337,601 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 3,965,366 | 22,756,984 |
| 未払受託者報酬 | 3,381,070 | 3,682,536 |
| 未払委託者報酬 | 87,907,831 | 95,745,777 |
| 未払利息 | 799 | 753 |
| その他未払費用 | 440,000 | 440,000 |
| 流動負債合計 | 95,695,066 | 122,626,050 |
| 負債合計 | 95,695,066 | 122,626,050 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 8,968,181,534 | 8,982,640,844 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 3,849,695,058 | 5,013,070,707 |
| 元本等合計 | 12,817,876,592 | 13,995,711,551 |
| 純資産合計 | 12,817,876,592 | 13,995,711,551 |
| 負債純資産合計 | 12,913,571,658 | 14,118,337,601 |

（2）【中間損益及び剰余金計算書】

| | 第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日 | 第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 13,585,778 | 7,737,120 |
| 有価証券売買等損益 | 848,223,773 | 1,279,393,610 |
| 為替差損益 | 12,064,565 | 23,202,911 |
| 営業収益合計 | 873,874,116 | 1,263,927,819 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 128,870 | 121,626 |
| 受託者報酬 | 3,561,867 | 3,682,536 |
| 委託者報酬 | 92,608,392 | 95,745,777 |
| その他費用 | 243,940 | 508,770 |
| 営業費用合計 | 96,543,069 | 100,058,709 |
| 営業利益又は営業損失() | 777,331,047 | 1,163,869,110 |
| 経常利益又は経常損失() | 777,331,047 | 1,163,869,110 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 777,331,047 | 1,163,869,110 |
| 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() | 8,142,551 | 30,753,262 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 3,908,562,011 | 3,849,695,058 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 270,373,618 | 272,220,050 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 270,373,618 | 272,220,050 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 198,185,268 | 241,960,249 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 198,185,268 | 241,960,249 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 4,749,938,857 | 5,013,070,707 |

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（中間貸借対照表に関する注記）

| 期別 | 第20期 2020年7月15日現在 | 第21期中間計算期間末 2021年1月15日現在 |
|----------------------------|--|--|
| 1. 受益権の総数 | 8,968,181,534口 | 8,982,640,844口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4293円 (14,293円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5581円 (15,581円) |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 項目 | 第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日 | 第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
|---|---|--|
| 1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 | 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。 | 同左 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第20期 2020年7月15日現在 | 第21期中間計算期間末 2021年1月15日現在 |
|------------------------|--|---|
| 1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 | 同左 |

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

(その他の注記)

| 項目 | 第20期 自 2019年7月17日 至 2020年7月15日 | 第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
|-----------|--------------------------------------|--|
| 期首元本額 | 8,790,841,480円 | 8,968,181,534円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,336,572,558円 | 576,961,021円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,159,232,504円 | 562,501,711円 |

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング40】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第20期 2020年7月15日現在 | 第21期中間計算期間末 2021年1月15日現在 |
|-------------|----------------------|-----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 406,003,150 | 493,753,052 |
| 投資信託受益証券 | 1,003,670,630 | 1,036,170,936 |
| 親投資信託受益証券 | 15,518,517,331 | 16,906,533,340 |
| 流動資産合計 | 16,928,191,111 | 18,436,457,328 |
| 資産合計 | 16,928,191,111 | 18,436,457,328 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 6,056,515 | 38,520,780 |
| 未払受託者報酬 | 4,421,909 | 4,817,927 |
| 未払委託者報酬 | 101,703,953 | 110,812,146 |
| 未払利息 | 934 | 1,122 |
| その他未払費用 | 440,000 | 440,000 |
| 流動負債合計 | 112,623,311 | 154,591,975 |

| | 第20期 2020年7月15日現在 | 第21期中間計算期間末 2021年1月15日現在 |
|-----------------|----------------------|-----------------------------|
| 負債合計 | 112,623,311 | 154,591,975 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 11,669,105,940 | 11,907,820,296 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 5,146,461,860 | 6,374,045,057 |
| 元本等合計 | 16,815,567,800 | 18,281,865,353 |
| 純資産合計 | 16,815,567,800 | 18,281,865,353 |
| 負債純資産合計 | 16,928,191,111 | 18,436,457,328 |

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日 | 第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 16,823,769 | 10,220,798 |
| 有価証券売買等損益 | 765,600,076 | 1,252,531,613 |
| 為替差損益 | 15,376,911 | 31,224,530 |
| 営業収益合計 | 797,800,756 | 1,231,527,881 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 164,727 | 163,628 |
| 受託者報酬 | 4,563,690 | 4,817,927 |
| 委託者報酬 | 104,964,809 | 110,812,146 |
| その他費用 | 277,407 | 529,872 |
| 営業費用合計 | 109,970,633 | 116,323,573 |
| 営業利益又は営業損失() | 687,830,123 | 1,115,204,308 |
| 経常利益又は経常損失() | 687,830,123 | 1,115,204,308 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 687,830,123 | 1,115,204,308 |
| 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() | 10,532,299 | 22,567,086 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 5,053,038,432 | 5,146,461,860 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 458,051,710 | 444,876,042 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 458,051,710 | 444,876,042 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 287,251,443 | 309,930,067 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 287,251,443 | 309,930,067 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 5,901,136,523 | 6,374,045,057 |

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

| | |
|------------------------------|---|
| 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>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> <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。 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)

| 期別 | 第20期 2020年7月15日現在 | 第21期中間計算期間末 2021年1月15日現在 |
|----------------------------|--|--|
| 1. 受益権の総数 | 11,669,105,940口 | 11,907,820,296口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4410円 (14,410円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5353円 (15,353円) |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日 | 第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
|---|---|--|
| 1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 | 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。 | 同左 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第20期 2020年7月15日現在 | 第21期中間計算期間末 2021年1月15日現在 |
|------------------------|---|---|
| 1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |

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

(その他の注記)

| 項目 | 第20期 自 2019年7月17日 至 2020年7月15日 | 第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
|-----------|--------------------------------------|--|
| 期首元本額 | 11,136,652,437円 | 11,669,105,940円 |
| 期中追加設定元本額 | 2,098,383,366円 | 940,369,003円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,565,929,863円 | 701,654,647円 |

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング50】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第20期 2020年7月15日現在 | 第21期中間計算期間末 2021年1月15日現在 |
|-------------|----------------------|-----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 169,086,509 | 210,226,370 |
| 投資信託受益証券 | 299,634,286 | 289,581,148 |

| | 第20期 2020年7月15日現在 | 第21期中間計算期間末 2021年1月15日現在 |
|-----------------|----------------------|-----------------------------|
| 親投資信託受益証券 | 7,369,245,317 | 7,895,638,928 |
| 流動資産合計 | 7,837,966,112 | 8,395,446,446 |
| 資産合計 | 7,837,966,112 | 8,395,446,446 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 2,825,831 | 12,601,949 |
| 未払受託者報酬 | 2,099,801 | 2,231,364 |
| 未払委託者報酬 | 41,156,071 | 43,734,586 |
| 未払利息 | 389 | 478 |
| その他未払費用 | 440,000 | 440,000 |
| 流動負債合計 | 46,522,092 | 59,008,377 |
| 負債合計 | 46,522,092 | 59,008,377 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 5,557,795,224 | 5,726,954,362 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 2,233,648,796 | 2,609,483,707 |
| 元本等合計 | 7,791,444,020 | 8,336,438,069 |
| 純資産合計 | 7,791,444,020 | 8,336,438,069 |
| 負債純資産合計 | 7,837,966,112 | 8,395,446,446 |

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日 | 第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 4,909,703 | 2,856,425 |
| 有価証券売買等損益 | 207,315,394 | 358,930,135 |
| 為替差損益 | 4,696,392 | 9,213,988 |
| 営業収益合計 | 216,921,489 | 352,572,572 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 77,258 | 77,742 |
| 受託者報酬 | 2,141,255 | 2,231,364 |
| 委託者報酬 | 41,968,605 | 43,734,586 |
| その他費用 | 187,430 | 469,518 |
| 営業費用合計 | 44,374,548 | 46,513,210 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 172,546,941 | 306,059,362 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 172,546,941 | 306,059,362 |
| 中間純利益又は中間純損失（ ） | 172,546,941 | 306,059,362 |
| 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（ ） | 4,727,062 | 7,332,014 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 2,221,774,659 | 2,233,648,796 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 244,206,345 | 227,123,413 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 244,206,345 | 227,123,413 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 146,399,831 | 150,015,850 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 146,399,831 | 150,015,850 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 2,487,401,052 | 2,609,483,707 |

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

| 期別 | 第20期 2020年7月15日現在 | 第21期中間計算期間末 2021年1月15日現在 |
|----------------------------|--|--|
| 1. 受益権の総数 | 5,557,795,224口 | 5,726,954,362口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4019円 (14,019円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4556円 (14,556円) |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日 | 第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
|---|---|--|
| 1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 | 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。 | 同左 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第20期 2020年7月15日現在 | 第21期中間計算期間末 2021年1月15日現在 |
|----------------------------|--|---|
| 1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 | 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

（その他の注記）

| 項目 | 第20期 自 2019年7月17日 至 2020年7月15日 | 第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
|-----------|--------------------------------------|--|
| 期首元本額 | 5,370,507,370円 | 5,557,795,224円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,179,541,160円 | 541,958,368円 |
| 期中一部解約元本額 | 992,253,306円 | 372,799,230円 |

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング60】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第20期 2020年7月15日現在 | 第21期中間計算期間末 2021年1月15日現在 |
|-----------------|----------------------|-----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 117,569,699 | 139,422,004 |
| 親投資信託受益証券 | 4,777,438,260 | 5,071,108,520 |
| 流動資産合計 | 4,895,007,959 | 5,210,530,524 |
| 資産合計 | 4,895,007,959 | 5,210,530,524 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 1,880,934 | 17,042,790 |
| 未払受託者報酬 | 1,321,296 | 1,393,273 |
| 未払委託者報酬 | 21,404,912 | 22,570,901 |
| 未払利息 | 270 | 317 |
| その他未払費用 | 356,688 | 376,121 |
| 流動負債合計 | 24,964,100 | 41,383,402 |
| 負債合計 | 24,964,100 | 41,383,402 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 3,743,718,382 | 3,933,184,021 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 1,126,325,477 | 1,235,963,101 |
| 元本等合計 | 4,870,043,859 | 5,169,147,122 |
| 純資産合計 | 4,870,043,859 | 5,169,147,122 |
| 負債純資産合計 | 4,895,007,959 | 5,210,530,524 |

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日 | 第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 53,012,049 | 76,040,260 |
| 営業収益合計 | 53,012,049 | 76,040,260 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 46,179 | 51,231 |
| 受託者報酬 | 1,289,337 | 1,393,273 |
| 委託者報酬 | 20,887,145 | 22,570,901 |
| その他費用 | 124,084 | 376,121 |
| 営業費用合計 | 22,346,745 | 24,391,526 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 30,665,304 | 51,648,734 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 30,665,304 | 51,648,734 |
| 中間純利益又は中間純損失（ ） | 30,665,304 | 51,648,734 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ） | 2,055,349 | 1,385,393 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 1,073,979,128 | 1,126,325,477 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 152,019,848 | 143,279,643 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 152,019,848 | 143,279,643 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 81,939,456 | 83,905,360 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 81,939,456 | 83,905,360 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 1,172,669,475 | 1,235,963,101 |

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|--------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。 |
| 2. 費用・収益の計上基準 | 有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 期別 | 第20期 2020年7月15日現在 | 第21期中間計算期間末 2021年1月15日現在 |
|----------------------------|---|---|
| 1. 受益権の総数 | 3,743,718,382口 | 3,933,184,021口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.3009円 (1万口当たり純資産額) (13,009円) | 1口当たり純資産額 1.3142円 (1万口当たり純資産額) (13,142円) |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第20期中間計算期間 自 2019年7月17日 至 2020年1月16日 | 第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
|---|---|--|
| 1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 | 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。 | 同左 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第20期 2020年7月15日現在 | 第21期中間計算期間末 2021年1月15日現在 |
|------------------------|---|---|
| 1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |

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

(その他の注記)

| 項目 | 第20期 自 2019年7月17日 至 2020年7月15日 | 第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
|-----------|--------------------------------------|--|
| 期首元本額 | 3,477,272,681円 | 3,743,718,382円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,060,346,963円 | 468,177,094円 |
| 期中一部解約元本額 | 793,901,262円 | 278,711,455円 |

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

ハッピーエイジング・ファンド ハッピーエイジング20/ハッピーエイジング30/ハッピーエイジング40/ハッピーエイジング50/ハッピーエイジング60の主要投資対象の状況は以下のとおりです。

*なお、以下は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド

貸借対照表

| 科 目 | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
|-------------|----------------|----------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 542,004,703 | 305,148,688 |
| 株式 | 33,446,055,820 | 31,032,443,990 |
| 未収配当金 | 83,017,500 | 61,919,900 |
| 流動資産合計 | 34,071,078,023 | 31,399,512,578 |
| 資産合計 | 34,071,078,023 | 31,399,512,578 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払利息 | 1,247 | 693 |
| 流動負債合計 | 1,247 | 693 |
| 負債合計 | 1,247 | 693 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 21,381,109,390 | 17,105,036,999 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 12,689,967,386 | 14,294,474,886 |
| 元本等合計 | 34,071,076,776 | 31,399,511,885 |
| 純資産合計 | 34,071,076,776 | 31,399,511,885 |
| 負債純資産合計 | 34,071,078,023 | 31,399,512,578 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

| 期別 | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
|---------------------------|---|---|
| 1．受益権の総数 | 21,381,109,390口 | 17,105,036,999口 |
| 2．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.5935円 (1万口当たり純資産額) (15,935円) | 1口当たり純資産額 1.8357円 (1万口当たり純資産額) (18,357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 | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
|----------------------------|--|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p> | 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

（その他の注記）

| 項目 | 自 2019年7月17日 至 2020年7月15日 | 自 2020年7月16日 至 2021年1月15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 | 24,665,295,599円 | 21,381,109,390円 |
| 同期中追加設定元本額 | 5,375,602,154円 | 1,756,218,541円 |
| 同期中一部解約元本額 | 8,659,788,363円 | 6,032,290,932円 |
| 元本の内訳* | | |
| 損保ジャパン日本興亜ラージキャップ・バリュール・ファンド（F o F s用）（適格機関投資家専用） | 15,444,098,693円 | 11,179,296,047円 |
| ラージキャップ・バリュール・オープン（適格機関投資家専用） | 256,081,321円 | 255,074,285円 |
| ハッピーエイジング20 | 1,640,639,714円 | 1,653,183,070円 |
| ハッピーエイジング30 | 1,741,495,222円 | 1,720,030,438円 |
| ハッピーエイジング40 | 1,616,085,692円 | 1,592,596,080円 |
| ハッピーエイジング50 | 464,441,660円 | 448,819,490円 |
| ハッピーエイジング60 | 122,345,204円 | 118,271,197円 |

| | | |
|------------------------|-----------------|-----------------|
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035 | 36,211,440円 | 58,573,709円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045 | 24,608,480円 | 34,688,388円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055 | 23,178,039円 | 31,858,657円 |
| SOMPO日本株バリュー・プラスファンド | 11,923,925円 | 12,645,638円 |
| 計 | 21,381,109,390円 | 17,105,036,999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。

SJAMスモールキャップ・マザーファンド

貸借対照表

| 科 目 | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
|-------------|---------------|----------------|
| | 金額(円) | 金額(円) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 14,536,211 | 213,769,162 |
| 株式 | 8,926,906,400 | 9,938,306,300 |
| 未収配当金 | 9,777,000 | 8,718,000 |
| 流動資産合計 | 8,951,219,611 | 10,160,793,462 |
| 資産合計 | 8,951,219,611 | 10,160,793,462 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払利息 | 33 | 486 |
| 流動負債合計 | 33 | 486 |
| 負債合計 | 33 | 486 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 4,180,721,532 | 4,412,245,644 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 4,770,498,046 | 5,748,547,332 |
| 元本等合計 | 8,951,219,578 | 10,160,792,976 |
| 純資産合計 | 8,951,219,578 | 10,160,792,976 |
| 負債純資産合計 | 8,951,219,611 | 10,160,793,462 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 期別 | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
|----------------------------|---|---|
| 1. 受益権の総数 | 4,180,721,532口 | 4,412,245,644口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 2.1411円 (1万口当たり純資産額) (21,411円) | 1口当たり純資産額 2.3029円 (1万口当たり純資産額) (23,029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 | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
|----------------------------|--|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 | 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

（その他の注記）

| 項目 | 自 2019年7月17日 至 2020年7月15日 | 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
|------------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 4,008,847,456円 | 4,180,721,532円 |
| 同期中追加設定元本額 | 1,003,355,956円 | 438,257,677円 |
| 同期中一部解約元本額 | 831,481,880円 | 206,733,565円 |
| 元本の内訳* | | |
| ハッピーエイジング20 | 1,207,287,472円 | 1,283,357,434円 |
| ハッピーエイジング30 | 1,281,416,683円 | 1,343,697,031円 |
| ハッピーエイジング40 | 1,189,057,367円 | 1,236,333,535円 |
| ハッピーエイジング50 | 341,701,091円 | 348,415,350円 |
| ハッピーエイジング60 | 90,091,104円 | 91,815,578円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035 | 26,900,654円 | 46,534,779円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045 | 18,296,045円 | 27,601,587円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055 | 17,114,726円 | 24,735,756円 |
| SOMPO日本株バリュー・プラスファンド | 8,856,390円 | 9,754,594円 |
| 計 | 4,180,721,532円 | 4,412,245,644円 |

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

損保ジャパン日本債券マザーファンド

貸借対照表

| 科 目 | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
|---------|----------------|----------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 539,244,725 | 310,819,151 |
| 国債証券 | 13,610,820,200 | 13,031,144,800 |
| 地方債証券 | 111,405,000 | 1,320,772,000 |

| 科 目 | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
|-------------|----------------|----------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 特殊債券 | 627,444,738 | 621,556,575 |
| 社債券 | 2,796,929,000 | 3,630,696,000 |
| 未収入金 | 1,029,753,400 | - |
| 未収利息 | 24,199,731 | 22,894,466 |
| 前払費用 | 900,281 | 1,724,273 |
| 流動資産合計 | 18,740,697,075 | 18,939,607,265 |
| 資産合計 | 18,740,697,075 | 18,939,607,265 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 1,251,922,500 | - |
| 未払利息 | 1,241 | 706 |
| 流動負債合計 | 1,251,923,741 | 706 |
| 負債合計 | 1,251,923,741 | 706 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 12,082,014,010 | 13,041,978,922 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 5,406,759,324 | 5,897,627,637 |
| 元本等合計 | 17,488,773,334 | 18,939,606,559 |
| 純資産合計 | 17,488,773,334 | 18,939,606,559 |
| 負債純資産合計 | 18,740,697,075 | 18,939,607,265 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 期別 | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
|---------------------------|---|---|
| 1．受益権の総数 | 12,082,014,010口 | 13,041,978,922口 |
| 2．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.4475円 (1万口当たり純資産額) (14,475円) | 1口当たり純資産額 1.4522円 (1万口当たり純資産額) (14,522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 | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
|----------------------------|--|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 | 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

（その他の注記）

| 項目 | 自 2019年7月17日 至 2020年7月15日 | 自 2020年7月16日 至 2021年1月15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 | 11,515,341,036円 | 12,082,014,010円 |
| 同期中追加設定元本額 | 2,885,473,338円 | 1,361,042,468円 |
| 同期中一部解約元本額 | 2,318,800,364円 | 401,077,556円 |
| 元本の内訳* | | |
| SNAM絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用） | 357,397,187円 | 358,356,046円 |
| SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド（2%コース）（FofS用）（適格機関投資家専用） | 39,291,418円 | 51,710,878円 |
| SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド（4%コース）（FofS用）（適格機関投資家専用） | 51,652,028円 | 114,754,539円 |
| 損保ジャパン日本債券ファンド | 1,045,753,750円 | 1,051,715,059円 |
| ハッピーエイジング20 | 138,513,907円 | 152,782,624円 |
| ハッピーエイジング30 | 695,022,172円 | 756,219,022円 |
| ハッピーエイジング40 | 3,775,600,403円 | 4,074,147,927円 |
| ハッピーエイジング50 | 3,050,346,036円 | 3,235,471,656円 |
| ハッピーエイジング60 | 2,417,262,565円 | 2,558,320,626円 |

| | | |
|--------------------------------------|-----------------|-----------------|
| パン・アフリカ株式ファンド | 8,486,261円 | - 円 |
| 好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 円ヘッジありコース | 1,008,001円 | 966,661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 | 8,004,174円 | 7,502,335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 | 134,873,215円 | 141,396,371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 | 6,064,973円 | 6,842,858円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035 | 120,066,374円 | 244,577,515円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045 | 48,495,789円 | 84,553,171円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055 | 16,107,249円 | 28,928,646円 |
| ターゲット・リターン戦略ファンド | 168,068,508円 | 173,732,988円 |
| 計 | 12,082,014,010円 | 13,041,978,922円 |

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

| 科 目 | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
|----------|---------------|---------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 71,888,463 | 45,528,962 |
| コール・ローン | 244,444,147 | 149,426,136 |
| 国債証券 | 7,839,329,743 | 8,543,256,686 |
| 未収入金 | - | 46,177,898 |
| 未収利息 | 37,385,825 | 39,144,094 |
| 前払費用 | 5,535,361 | 13,274,018 |
| 流動資産合計 | 8,198,583,539 | 8,836,807,794 |
| 資産合計 | 8,198,583,539 | 8,836,807,794 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | - | 88,050 |
| 未払金 | - | 45,684,246 |
| 未払利息 | 562 | 339 |

| | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
|-------------|---------------|---------------|
| 科 目 | 金額（円） | 金額（円） |
| 流動負債合計 | 562 | 45,772,635 |
| 負債合計 | 562 | 45,772,635 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 4,833,266,923 | 5,170,439,642 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 3,365,316,054 | 3,620,595,517 |
| 元本等合計 | 8,198,582,977 | 8,791,035,159 |
| 純資産合計 | 8,198,582,977 | 8,791,035,159 |
| 負債純資産合計 | 8,198,583,539 | 8,836,807,794 |

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)

| 期別 | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
|--------------|-------------------|-------------------|
| 1. 受益権の総数 | 4,833,266,923口 | 5,170,439,642口 |
| 2. 計算期間の末日にお | 1口当たり純資産額 1.6963円 | 1口当たり純資産額 1.7002円 |

| | | | | |
|--------------------|--------------|-----------|--------------|-----------|
| ける1単位当たりの純 資産の額 | (1万口当たり純資産額) | (16,963円) | (1万口当たり純資産額) | (17,002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 | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15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。 | (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。 | 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 | 自 2019年7月17日 至 2020年7月15日 | 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日 |
|------------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 4,814,477,890円 | 4,833,266,923円 |
| 同期中追加設定元本額 | 1,109,077,804円 | 421,234,261円 |
| 同期中一部解約元本額 | 1,090,288,771円 | 84,061,542円 |
| 元本の内訳* | | |
| SNAM絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用） | 148,565,577円 | 146,142,063円 |
| ハッピーエイジング20 | 360,116,371円 | 390,275,559円 |

| | | |
|-------------------------|----------------|----------------|
| ハッピーエイジング30 | 1,505,793,486円 | 1,609,761,457円 |
| ハッピーエイジング40 | 1,487,240,793円 | 1,576,803,949円 |
| ハッピーエイジング50 | 505,888,215円 | 531,652,109円 |
| ハッピーエイジング60 | 465,504,311円 | 484,056,304円 |
| 損保ジャパン外国債券ファンド（為替ヘッジなし） | 327,282,180円 | 358,702,111円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035 | 23,470,456円 | 57,445,350円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045 | 5,501,752円 | 9,523,783円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055 | 3,903,782円 | 6,076,957円 |
| 計 | 4,833,266,923円 | 5,170,439,642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 | 2020年7月15日 現在 | | | | 2021年1月15日 現在 | | | |
|-----------|---------------|-----------|-----------|-------------|---------------|-----------|------------|-------------|
| | 契約額等 （円） | | 時価 （円） | 評価損益 （円） | 契約額等 （円） | | 時価 （円） | 評価損益 （円） |
| | | うち1年 超 | | | | うち1年 超 | | |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 買建 | - | - | - | - | 38,084,130 | - | 38,001,780 | 82,350 |
| ドル | - | - | - | - | 38,084,130 | - | 38,001,780 | 82,350 |
| 売建 | - | - | - | - | 46,016,100 | - | 46,021,800 | 5,700 |
| オーストラリアドル | - | - | - | - | 46,016,100 | - | 46,021,800 | 5,700 |
| 合計 | - | - | - | - | 84,100,230 | - | 84,023,580 | 88,050 |

（注）時価の算定方法

1. 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。

損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド

貸借対照表

| 科 目 | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
|-------------|----------------|----------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 206,459,846 | 153,742,033 |
| コール・ローン | 108,438,878 | 218,103,626 |
| 株式 | 12,019,712,899 | 13,202,720,742 |
| 投資証券 | 764,017,741 | 710,494,699 |
| 未収配当金 | 10,131,859 | 8,871,293 |
| 流動資産合計 | 13,108,761,223 | 14,293,932,393 |
| 資産合計 | 13,108,761,223 | 14,293,932,393 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | - | 5,435,135 |
| 未払利息 | 249 | 495 |
| 流動負債合計 | 249 | 5,435,630 |
| 負債合計 | 249 | 5,435,630 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 5,793,095,817 | 5,449,135,640 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 7,315,665,157 | 8,839,361,123 |
| 元本等合計 | 13,108,760,974 | 14,288,496,763 |
| 純資産合計 | 13,108,760,974 | 14,288,496,763 |
| 負債純資産合計 | 13,108,761,223 | 14,293,932,393 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

| | |
|----------------------------|--|
| | <p>移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>原則として取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券等の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。計算期間末日に当該取引所の最終相場がない場合には当該取引所における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> |
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> |
| 3. 費用・収益の計上基準 | <p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</p> <p>但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 期別 | 2020年7月15日現在 | | 2021年1月15日現在 | |
|----------------------------|---------------------------|----------------------|---------------------------|----------------------|
| 1. 受益権の総数 | 5,793,095,817口 | | 5,449,135,640口 | |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 2.2628円 (22,628円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 2.6222円 (26,222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 | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
|----------------------|---|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。 | 同左 |

| 項目 | 2020年7月15日現在 | 2021年1月15日現在 |
|----------------------------|--|--------------|
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 | 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

(その他の注記)

| 項目 | 自 2019年7月17日 至 2020年7月15日 | 自 2020年7月16日 至 2021年1月15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 | 5,982,754,877円 | 5,793,095,817円 |
| 同期中追加設定元本額 | 1,166,121,205円 | 215,786,745円 |
| 同期中一部解約元本額 | 1,355,780,265円 | 559,746,922円 |
| 元本の内訳* | | |
| 損保ジャパン - TCW外国株式ファンド A コース(為替ヘッジあり) | 753,256,631円 | 757,919,609円 |
| 損保ジャパン - TCW外国株式ファンド B コース(為替ヘッジなし) | 922,492,757円 | 905,194,354円 |
| ハッピーエイジング20 | 1,519,314,279円 | 1,411,981,747円 |
| ハッピーエイジング30 | 1,212,846,642円 | 1,111,828,350円 |
| ハッピーエイジング40 | 1,064,789,603円 | 968,077,388円 |
| ハッピーエイジング50 | 275,776,587円 | 254,331,641円 |
| ハッピーエイジング60 | 44,619,318円 | 39,802,551円 |
| 計 | 5,793,095,817円 | 5,449,135,640円 |

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ハッピーエイジング20

2021年1月29日現在

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 11,287,118,927円 |
| 負債総額 | 22,573,510円 |
| 純資産総額（ - ） | 11,264,545,417円 |
| 発行済数量 | 7,378,971,885口 |
| 1単位当りの純資産額（ / ） | 1.5266円 |

ハッピーエイジング30

2021年1月29日現在

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 13,963,390,140円 |
| 負債総額 | 22,283,598円 |
| 純資産総額（ - ） | 13,941,106,542円 |
| 発行済数量 | 9,019,137,866口 |
| 1単位当りの純資産額（ / ） | 1.5457円 |

ハッピーエイジング40

2021年1月29日現在

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 18,271,670,018円 |
| 負債総額 | 29,792,939円 |
| 純資産総額（ - ） | 18,241,877,079円 |
| 発行済数量 | 11,957,141,124口 |
| 1単位当りの純資産額（ / ） | 1.5256円 |

ハッピーエイジング50

2021年1月29日現在

| | |
|-----------------|----------------|
| 資産総額 | 8,345,198,206円 |
| 負債総額 | 11,899,571円 |
| 純資産総額（ - ） | 8,333,298,635円 |
| 発行済数量 | 5,751,990,736口 |
| 1単位当りの純資産額（ / ） | 1.4488円 |

ハッピーエイジング60

2021年1月29日現在

| | |
|-----------------|----------------|
| 資産総額 | 5,204,808,645円 |
| 負債総額 | 6,163,822円 |
| 純資産総額（ - ） | 5,198,644,823円 |
| 発行済数量 | 3,966,551,744口 |
| 1単位当りの純資産額（ / ） | 1.3106円 |

（参考）S J A M ラージキャップ・バリュース・マザーファンド

2021年1月29日現在

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 30,323,660,510円 |
| 負債総額 | 427円 |
| 純資産総額（ - ） | 30,323,660,083円 |
| 発行済数量 | 17,008,293,601口 |
| 1単位当りの純資産額（ / ） | 1.7829円 |

（参考）S J A M スモールキャップ・マザーファンド

2021年1月29日現在

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 10,039,677,324円 |
| 負債総額 | 311円 |
| 純資産総額（ - ） | 10,039,677,013円 |
| 発行済数量 | 4,385,206,962口 |
| 1単位当りの純資産額（ / ） | 2.2894円 |

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2021年1月29日現在

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 19,305,924,747円 |
| 負債総額 | 100,001,096円 |
| 純資産総額（ - ） | 19,205,923,651円 |
| 発行済数量 | 13,254,423,715口 |
| 1単位当りの純資産額（ / ） | 1.4490円 |

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

2021年1月29日現在

| | |
|-----------------|----------------|
| 資産総額 | 9,014,463,557円 |
| 負債総額 | 851円 |
| 純資産総額（ - ） | 9,014,462,706円 |
| 発行済数量 | 5,280,900,483口 |
| 1単位当りの純資産額（ / ） | 1.7070円 |

（参考）損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

2021年1月29日現在

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 14,379,478,622円 |
| 負債総額 | 25,254,978円 |
| 純資産総額（ - ） | 14,354,223,644円 |
| 発行済数量 | 5,480,748,375口 |
| 1単位当りの純資産額（ / ） | 2.6190円 |

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<訂正前>

- (1) 資本金の額（2020年7月末現在）
（略）
- (2) 会社の機構（2020年7月末現在）
（略）

<訂正後>

- (1) 資本金の額（2021年1月末現在）
（略）
- (2) 会社の機構（2021年1月末現在）
（略）

2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

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

委託会社の運用する投資信託（親投資信託を除きます。）は2021年1月末現在、計240本（追加型株式投資信託140本、単位型株式投資信託36本、単位型公社債投資信託64本）であり、その純資産総額の合計は1,596,814百万円です。

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

1. 委託会社であるSOMPOアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）、ならびに、同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

また、委託会社の中間財務諸表は「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに、同規則第38条第1項及び第57条第1項の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

2. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2019年4月1日から2020年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

また、委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期中間会計期間(2020年4月1日から2020年9月30日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 (2019年3月31日) | | 当事業年度 (2020年3月31日) | |
|-------------|----------|-----------------------|-----------|-----------------------|-----------|
| | | 金額(千円) | | 金額(千円) | |
| (資産の部) | | | | | |
| 流動資産 | | | | | |
| 1 現金・預金 | | | 5,031,436 | | 5,030,360 |
| 2 前払費用 | | | 77,905 | | 88,889 |
| 3 未収委託者報酬 | | | 892,311 | | 1,062,114 |
| 4 未収運用受託報酬 | | | 1,133,534 | | 958,520 |
| 5 未収収益 | | | 52 | | 44 |
| 6 その他 | | | 5,489 | | 1,347 |
| 流動資産合計 | | | 7,140,730 | | 7,141,276 |
| 固定資産 | | | | | |
| 1 有形固定資産 | | | | | |
| (1) 建物 | 1 | | 23,660 | | 19,412 |
| (2) 器具備品 | 1 | | 24,492 | | 102,336 |
| 有形固定資産合計 | | | 48,153 | | 121,748 |
| 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 | | | 189,407 | | 378,390 |
| (2) 長期差入保証金 | | | 161,598 | | 161,598 |
| (3) 繰延税金資産 | | | 369,181 | | 402,032 |
| (4) その他 | | | 31 | | 32 |
| 投資その他の資産合計 | | | 720,218 | | 942,053 |
| 固定資産合計 | | | 772,907 | | 1,068,337 |
| 資産合計 | | | 7,913,637 | | 8,209,613 |

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 (2019年3月31日) | | 当事業年度 (2020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 | | | 12,372 | | 6,729 |
| 2 未払金 | | | | | |
| (1) 未払配当金 | 2 | 240,000 | | 3,000,000 | |
| (2) 未払手数料 | | 320,577 | | 351,384 | |
| (3) その他未払金 | | 193,367 | 753,944 | 180,135 | 3,531,520 |
| 3 未払費用 | | | 985,047 | | 973,410 |
| 4 未払消費税等 | | | 15,760 | | 47,391 |

| | | | | | |
|----------------|--|--|-----------|--|-----------|
| 5 未払法人税等 | | | 225,326 | | 152,972 |
| 6 賞与引当金 | | | 125,066 | | 115,230 |
| 7 役員賞与引当金 | | | 7,200 | | 5,400 |
| 流動負債合計 | | | 2,124,718 | | 4,832,655 |
| 固定負債 | | | | | |
| 1 退職給付引当金 | | | 134,243 | | 150,881 |
| 2 資産除去債務 | | | 8,327 | | 8,475 |
| 固定負債合計 | | | 142,570 | | 159,356 |
| 負債合計 | | | 2,267,288 | | 4,992,011 |
| (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 | | | 3,675,113 | | 1,257,468 |
| 利益剰余金合計 | | | 3,675,113 | | 1,257,468 |
| 株主資本合計 | | | 5,638,393 | | 3,220,749 |
| 評価・換算差額等 | | | | | |
| 1 その他有価証券評価差額金 | | | 7,956 | | 3,147 |
| 評価・換算差額等合計 | | | 7,956 | | 3,147 |
| 純資産合計 | | | 5,646,349 | | 3,217,602 |
| 負債・純資産合計 | | | 7,913,637 | | 8,209,613 |
| | | | | | |

(2) 【損益計算書】

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日) | | 当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) | |
|-----------|----------|--|-----------|--|-----------|
| | | 金額(千円) | | 金額(千円) | |
| 営業収益 | | | | | |
| 1 委託者報酬 | | 4,693,325 | | 4,761,002 | |
| 2 運用受託報酬 | | 3,479,650 | 8,172,976 | 3,408,951 | 8,169,953 |
| 営業費用 | | | | | |
| 1 支払手数料 | | 2,096,873 | | 2,057,148 | |
| 2 広告宣伝費 | | 30,230 | | 16,106 | |
| 3 公告費 | | 200 | | 200 | |
| 4 調査費 | | 2,532,683 | | 2,381,706 | |
| (1) 調査費 | | 1,070,321 | | 1,067,053 | |
| (2) 委託調査費 | | 1,457,726 | | 1,311,310 | |
| (3) 図書費 | | 4,635 | | 3,342 | |
| 5 営業雑経費 | | 165,973 | | 184,920 | |
| (1) 通信費 | | 6,109 | | 6,023 | |
| (2) 印刷費 | | 145,335 | | 163,235 | |
| (3) 諸会費 | | 14,528 | 4,825,961 | 15,660 | 4,640,082 |
| 一般管理費 | | | | | |

| | | | | | | |
|--------------|-----------|---|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 1 | 給料 | | 1,523,789 | | 1,567,354 | |
| | (1) 役員報酬 | | 75,540 | | 83,506 | |
| | (2) 給料・手当 | | 1,260,953 | | 1,286,043 | |
| | (3) 賞与 | | 187,295 | | 197,805 | |
| 2 | 福利厚生費 | | 183,912 | | 188,710 | |
| 3 | 交際費 | | 10,052 | | 13,169 | |
| 4 | 寄付金 | | 300 | | 300 | |
| 5 | 旅費交通費 | | 39,791 | | 45,892 | |
| 6 | 法人事業税 | | 41,849 | | 50,010 | |
| 7 | 租税公課 | | 15,555 | | 26,124 | |
| 8 | 不動産賃借料 | | 208,923 | | 211,714 | |
| 9 | 退職給付費用 | | 58,381 | | 67,288 | |
| 10 | 賞与引当金繰入 | | 125,066 | | 115,230 | |
| 11 | 役員賞与引当金繰入 | | 7,200 | | 5,400 | |
| 12 | 固定資産減価償却費 | | 11,976 | | 13,153 | |
| 13 | 諸経費 | | 353,873 | 2,580,671 | 349,338 | 2,653,688 |
| 営業利益 | | | | 766,343 | | 876,182 |
| 営業外収益 | | | | | | |
| 1 | 受取配当金 | | 98 | | 191 | |
| 2 | 受取利息 | | 281 | | 272 | |
| 3 | 有価証券売却益 | | 12,029 | | - | |
| 4 | 有価証券償還益 | | - | | 1,358 | |
| 5 | 保険配当金 | | 366 | | 448 | |
| 6 | 雑益 | | 2,459 | 15,236 | 1,033 | 3,305 |
| 営業外費用 | | | | | | |
| 1 | 有価証券売却損 | | - | | 2 | |
| 2 | 為替差損 | | 3,184 | | 2,620 | |
| 3 | 事務過誤費 | | 4,341 | | - | |
| 4 | 雑損 | | 198 | 7,724 | 266 | 2,889 |
| 経常利益 | | | | 773,855 | | 876,598 |
| 特別損失 | | | | | | |
| 1 | 固定資産除却損 | 1 | 7 | | 409 | |
| 2 | 商号変更費用 | | - | 7 | 13,256 | 13,666 |
| 税引前当期純利益 | | | | 773,847 | | 862,932 |
| 法人税・住民税及び事業税 | | | | 342,518 | | 309,915 |
| 法人税等調整額 | | | | 97,828 | | 29,339 |
| 当期純利益 | | | | 529,156 | | 582,355 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | | |
|--------|-----------|---------|---------|---------------------|-----------|-----------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益剰余金 | | 株主資本合計 |
| | | 資本準備金 | 資本剰余金合計 | その他利益剰余金 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 | 3,385,956 | 3,385,956 | 5,349,236 |
| 当期変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | 240,000 | 240,000 | 240,000 |

| | | | | | | |
|---------------------|-----------|---------|---------|-----------|-----------|-----------|
| 当期純利益 | | | | 529,156 | 529,156 | 529,156 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | | | | | |
| 当期変動額合計 | - | - | - | 289,156 | 289,156 | 289,156 |
| 当期末残高 | 1,550,000 | 413,280 | 413,280 | 3,675,113 | 3,675,113 | 5,638,393 |

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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 | 3,675,113 | 3,675,113 | 5,638,393 |
| 当期変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | 3,000,000 | 3,000,000 | 3,000,000 |
| 当期純利益 | | | | 582,355 | 582,355 | 582,355 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | | | | | |
| 当期変動額合計 | - | - | - | 2,417,644 | 2,417,644 | 2,417,644 |
| 当期末残高 | 1,550,000 | 413,280 | 413,280 | 1,257,468 | 1,257,468 | 3,220,749 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|--------|--------------|------------|-----------|
| | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 7,956 | 7,956 | 5,646,349 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 3,000,000 |
| 当期純利益 | | | 582,355 |

| | | | |
|---------------------|--------|--------|-----------|
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 11,103 | 11,103 | 11,103 |
| 当期変動額合計 | 11,103 | 11,103 | 2,428,747 |
| 当期末残高 | 3,147 | 3,147 | 3,217,602 |

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

| | |
|------|-------|
| 建物 | 15年 |
| 器具備品 | 2～20年 |

3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

4. 引当金の計上基準

（1）賞与引当金

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

（2）役員賞与引当金

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

（3）退職給付引当金

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

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

5. 消費税等の会計処理方法

税抜方式を採用しております。

（表示方法の変更）

（損益計算書）

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

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外収益」の「その他」に表示していた2,826千円は、「保険配当金」366千円及び「その他」2,459千円として組み替えております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産の減価償却累計額は、次のとおりであります。

（単位：千円）

| | 前事業年度 (2019年3月31日) | 当事業年度 (2020年3月31日) |
|------|-----------------------|-----------------------|
| 建物 | 86,787 | 91,036 |
| 器具備品 | 52,226 | 59,912 |

2 関係会社項目

関係会社に対する負債は、次のとおりであります。

（単位：千円）

| | 前事業年度 (2019年3月31日) | 当事業年度 (2020年3月31日) |
|-------|-----------------------|-----------------------|
| 未払金 | | |
| 未払配当金 | 240,000 | 3,000,000 |

（損益計算書関係）

1 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。

（単位：千円）

| | 前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日) | 当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) |
|------|--|--|
| 器具備品 | 7 | 409 |

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4. 剰余金の配当に関する事項

（1）配当金支払額

| （決議） | 株式の 種類 | 配当金の 総額 | 1株当たり 配当額 | 基準日 | 効力発生日 |
|--------------------|-----------|------------|--------------|-----|------------|
| 2019年3月27日 取締役会 | 普通 株式 | 240,000千円 | 9,964円 | - | 2019年3月31日 |

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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 |
|--------------------|-----------|-------------|--------------|-----|------------|
| 2020年3月11日 取締役会 | 普通 株式 | 3,000,000千円 | 124,558円 | - | 2020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(2019年3月31日)

(単位:千円)

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|-----------------------|-----------|-----------|----|
| (1) 現金・預金 | 5,031,436 | 5,031,436 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 892,311 | 892,311 | - |
| (3) 未収運用受託報酬 | 1,133,534 | 1,133,534 | - |
| (4) 投資有価証券 その他有価証券 | 188,657 | 188,657 | - |
| 資産計 | 7,245,941 | 7,245,941 | - |

| | | | |
|----------|---------|---------|---|
| (1) 未払費用 | 985,047 | 985,047 | - |
| 負債計 | 985,047 | 985,047 | - |

当事業年度(2020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 | 5,030,360 | 5,030,360 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 1,062,114 | 1,062,114 | - |
| (3) 未収運用受託報酬 | 958,520 | 958,520 | - |
| (4) 投資有価証券 其他有価証券 | 377,640 | 377,640 | - |
| 資産計 | 7,428,635 | 7,428,635 | - |
| (1) 未払金 | 3,531,520 | 3,531,520 | - |
| (2) 未払費用 | 973,410 | 973,410 | - |
| 負債計 | 4,504,931 | 4,504,931 | - |

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) 未払金及び(2) 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 (2019年3月31日) | 当事業年度 (2020年3月31日) |
|-------|-----------------------|-----------------------|
| 非上場株式 | 750 | 750 |

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

注3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|------------------------------------|-----------|-------------|--------------|------|
| (1) 預金 | 5,031,283 | - | - | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 892,311 | - | - | - |
| (3) 未収運用受託報酬 | 1,133,534 | - | - | - |
| (4) 投資有価証券 其他有価証券のうち 満期があるもの | | | | |
| 株式 | - | - | - | - |
| 債券 | - | - | - | - |
| その他 | - | 177,539 | 11,118 | - |
| 合計 | 7,057,129 | 177,539 | 11,118 | - |

当事業年度(2020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 | 5,030,197 | - | - | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 1,062,114 | - | - | - |
| (3) 未収運用受託報酬 | 958,520 | - | - | - |
| (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 | - | 157,275 | 19,415 | 200,950 |
| 合計 | 7,050,832 | 157,275 | 19,415 | 200,950 |

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(2019年3月31日)

(単位:千円)

| | 種類 | 貸借対照表 計上額 | 取得原価 | 差額 |
|--------------------------|---------|--------------|---------|--------|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの | (1) 株式 | - | - | - |
| | (2) 債券 | - | - | - |
| | (3) その他 | 176,630 | 165,000 | 11,630 |
| | 小計 | 176,630 | 165,000 | 11,630 |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの | (1) 株式 | - | - | - |
| | (2) 債券 | - | - | - |
| | (3) その他 | 12,027 | 12,189 | 161 |
| | 小計 | 12,027 | 12,189 | 161 |
| 合計 | | 188,657 | 177,189 | 11,468 |

当事業年度(2020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 | 233,779 | 229,700 | 4,079 |
| | 小計 | 233,779 | 229,700 | 4,079 |
| | (1) 株式 | - | - | - |

| | | | | |
|--------------------------|---------|---------|---------|-------|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの | (2) 債券 | - | - | - |
| | (3) その他 | 143,861 | 151,087 | 7,226 |
| | 小計 | 143,861 | 151,087 | 7,226 |
| 合計 | | 377,640 | 380,787 | 3,147 |

5. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

| 種類 | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|---------|--------|---------|---------|
| (1) 株式 | 24,900 | 9,900 | - |
| (2) 債券 | - | - | - |
| (3) その他 | 13,229 | 2,130 | 0 |
| 合計 | 38,129 | 12,030 | 0 |

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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 | 97 | - | 2 |
| 合計 | 97 | - | 2 |

(退職給付関係)

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

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

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

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

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

| | 前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日) | 当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) |
|--------------|--|--|
| 退職給付引当金の期首残高 | 112,624 | 134,243 |
| 退職給付費用 | 23,211 | 27,786 |
| 退職給付の支払額 | 1,592 | 11,148 |
| 退職給付引当金の期末残高 | 134,243 | 150,881 |

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

(単位:千円)

| | 前事業年度 (2019年3月31日) | 当事業年度 (2020年3月31日) |
|---------------------|-----------------------|-----------------------|
| 非積立型制度の退職給付債務 | 134,243 | 150,881 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 134,243 | 150,881 |
| 退職給付引当金 | 134,243 | 150,881 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 134,243 | 150,881 |

(3) 退職給付費用

(単位:千円)

| | 前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日) | 当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) |
|----------------|--|--|
| 簡便法で計算した退職給付費用 | 23,211 | 27,786 |

3. 確定拠出制度

(単位:千円)

| | 前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日) | 当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) |
|-----------------|--|--|
| 当社の確定拠出制度への要拠出額 | 25,915 | 30,681 |

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位:千円)

| | 前事業年度 (2019年3月31日) | 当事業年度 (2020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 | 259,327 | 301,391 |
| 退職給付引当金 | 41,105 | 46,199 |
| 賞与引当金 | 38,295 | 35,283 |
| 未払事業税 | 14,487 | 11,335 |
| 未払金否認 | 14,684 | 4,762 |
| 繰延資産損金算入限度超過額 | 5,949 | 4,021 |
| その他 | 4,944 | 6,059 |
| 繰延税金資産 小計 | 378,793 | 409,054 |
| 将来減算一時差異等の合計に係る評価性引当額 | 2,645 | 3,648 |
| 評価性引当額 小計 | 2,645 | 3,648 |
| 繰延税金資産 合計 | 376,148 | 405,406 |
| 繰延税金負債 | | |
| 株式譲渡損益 | 3,031 | 3,031 |
| 固定資産除去価額 | 424 | 343 |
| その他有価証券評価差額金 | 3,512 | - |
| 繰延税金負債 合計 | 6,967 | 3,374 |
| 繰延税金資産の純額 | 369,181 | 402,032 |

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

| | 前事業年度 (2019年3月31日) | 当事業年度 (2020年3月31日) |
|--------------------|---|-----------------------|
| 法定実効税率 (調整) | 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。 | 30.6% |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目 | | 1.3 |
| 住民税均等割 | | 0.3 |
| 評価性引当額の増減 | | 0.1 |
| その他 | | 0.2 |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | | 32.5 |

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

本社事務所の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位：千円)

| | 前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日) | 当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) |
|------------|--|--|
| 期首残高 | 8,181 | 8,327 |
| 時の経過による調整額 | 145 | 147 |
| 期末残高 | 8,327 | 8,475 |

(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 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

(単位：千円)

| 日本 | 欧州 | 中東 | 米国 | アジア | 合計 |
|-----------|---------|---------|---------|--------|-----------|
| 7,315,521 | 575,733 | 128,375 | 117,530 | 35,814 | 8,172,976 |

(注) 営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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 | 米国 | 中東 | アジア | 合計 |
|-----------|---------|---------|---------|--------|-----------|
| 7,171,851 | 490,694 | 259,796 | 192,226 | 55,384 | 8,169,953 |

(注) 営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

- (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等記載すべき重要な取引はありません。
- (2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等該当事項はありません。
- (3) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 (千円) | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|-------------|-------------------|--------|-------------|---------|----------------|-----------------|----------------------|--------------|----------|--------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 損保ジャパンDC証券株式会社 | 東京都新宿区 | 3,000,000 | 確定拠出年金業 | - | 投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託代行手数料の支払 (注1) | 488,979 | 未払手数料 | 107,223 |
| 同一の親会社を持つ会社 | SOMPOひまわり生命保険株式会社 | 東京都新宿区 | 17,250,000 | 生命保険業 | - | 投資顧問契約に基づく資産運用 | 運用受託報酬の受取り (注2) | 165,115 | 未収運用受託報酬 | 88,523 |

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

注2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

(注2) 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

注3. 損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社は、2020年4月1日に商号を損保ジャパンDC証券株式会社に変更しております。

注4. 損保ジャパン日本興亜ひまわり生命保険株式会社は、2019年10月1日に商号をSOMPOひまわり生命保険株式会社に変更しております。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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DC証券株式会社 | 東京都新宿区 | 3,000,000 | 確定拠出年金業 | - | 投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託代行手数料の支払 (注1) | 498,922 | 未払手数料 | 115,372 |

| | | | | | | | | | | |
|-------------|-------------------|--------|------------|-------|---|----------------|----------------|---------|----------|--------|
| 同一の親会社を持つ会社 | SOMPOひまわり生命保険株式会社 | 東京都新宿区 | 17,250,000 | 生命保険業 | - | 投資顧問契約に基づく資産運用 | 運用受託報酬の受取り(注2) | 169,211 | 未収運用受託報酬 | 94,179 |
|-------------|-------------------|--------|------------|-------|---|----------------|----------------|---------|----------|--------|

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

注2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

(注2) 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

注3. 損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社は、2020年4月1日に商号を損保ジャパンDC証券株式会社に変更しております。

注4. 損保ジャパン日本興亜ひまわり生命保険株式会社は、2019年10月1日に商号をSOMPOひまわり生命保険株式会社に変更しております。

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

SOMPOホールディングス株式会社(東京証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

関連会社はありません。

(1株当たり情報)

| | 前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日) | 当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) |
|-----------------|--|--|
| 1株当たり純資産額(円) | 234,434.27 | 133,593.60 |
| 1株当たり当期純利益金額(円) | 21,970.39 | 24,179.19 |

(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いません。

(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 2018年4月1日 至 2019年3月31日) | 当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) |
|------------------|--|--|
| 当期純利益(千円) | 529,156 | 582,355 |
| 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) | 529,156 | 582,355 |
| 期中平均株式数(株) | 24,085 | 24,085 |

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

| | | 第36期中間会計期間 (2020年9月30日) |
|------------|------|----------------------------|
| 区分 | 注記番号 | 金額(千円) |
| (資産の部) | | |
| 流動資産 | | |
| 1 現金・預金 | | 1,766,457 |
| 2 前払費用 | | 69,125 |
| 3 未収委託者報酬 | | 1,119,626 |
| 4 未収運用受託報酬 | | 902,998 |

| | | | |
|---|-------------|---|-----------|
| 5 | 立替金 | | 128,883 |
| | 流動資産合計 | | 3,987,090 |
| | 固定資産 | | |
| 1 | 有形固定資産 | 1 | 122,515 |
| 2 | 無形固定資産 | | 4,535 |
| 3 | 投資その他の資産 | | |
| | (1) 投資有価証券 | | 414,544 |
| | (2) 長期差入保証金 | | 173,961 |
| | (3) 繰延税金資産 | | 374,373 |
| | (4) その他 | | 32 |
| | 投資その他の資産合計 | | 962,912 |
| | 固定資産合計 | | 1,089,962 |
| | 資産合計 | | 5,077,053 |

| | | 第36期中間会計期間 (2020年9月30日) | |
|----------|--------------|----------------------------|-----------|
| 区分 | 注記 番号 | 金額(千円) | |
| (負債の部) | | | |
| 流動負債 | | | |
| 1 | 預り金 | | 7,039 |
| 2 | 未払金 | | |
| | (1) 未払手数料 | | 390,718 |
| | (2) その他未払金 | | 156,186 |
| | 未払金合計 | | 546,905 |
| 3 | 未払費用 | | 483,858 |
| 4 | 未払法人税等 | | 153,068 |
| 5 | 賞与引当金 | | 99,733 |
| 6 | 役員賞与引当金 | | 2,850 |
| 7 | その他 | 2 | 39,105 |
| | 流動負債合計 | | 1,332,560 |
| 固定負債 | | | |
| 1 | 退職給付引当金 | | 166,200 |
| 2 | 資産除去債務 | | 8,550 |
| | 固定負債合計 | | 174,751 |
| | 負債合計 | | 1,507,311 |
| (純資産の部) | | | |
| 株主資本 | | | |
| 1 | 資本金 | | 1,550,000 |
| 2 | 資本剰余金 | | |
| | (1) 資本準備金 | | 413,280 |
| | 資本剰余金合計 | | 413,280 |
| 3 | 利益剰余金 | | |
| | (1) その他利益剰余金 | | |
| | 繰越利益剰余金 | | 1,590,499 |
| | 利益剰余金合計 | | 1,590,499 |
| | 株主資本合計 | | 3,553,779 |
| 評価・換算差額等 | | | |
| 1 | その他有価証券評価差額金 | | 15,961 |
| | 評価・換算差額等合計 | | 15,961 |
| | 純資産合計 | | 3,569,741 |
| | 負債・純資産合計 | | 5,077,053 |

(2) 中間損益計算書

| | | 第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) | |
|------|----------|---|-----------|
| 区分 | 注記 番号 | 金額(千円) | |
| 営業収益 | | | |
| 1 | 委託者報酬 | 2,355,607 | |
| 2 | 運用受託報酬 | 1,630,262 | 3,985,870 |

| | | | | |
|--------------|---|--|-----------|-----------|
| 営業費用 | | | | |
| 1 支払手数料 | | | 1,032,095 | |
| 2 広告宣伝費 | | | 6,136 | |
| 3 公告費 | | | 470 | |
| 4 調査費 | | | 1,067,833 | |
| (1) 調査費 | | | 454,735 | |
| (2) 委託調査費 | | | 611,197 | |
| (3) 図書費 | | | 1,900 | |
| 5 営業雑経費 | | | 81,638 | |
| (1) 通信費 | | | 8,075 | |
| (2) 印刷費 | | | 61,202 | |
| (3) 諸会費 | | | 12,359 | 2,188,175 |
| 一般管理費 | | | | |
| 1 給料 | | | 742,875 | |
| (1) 役員報酬 | | | 34,668 | |
| (2) 給料・手当 | | | 663,270 | |
| (3) 賞与 | | | 44,935 | |
| 2 福利厚生費 | | | 101,533 | |
| 3 交際費 | | | 1,439 | |
| 4 旅費交通費 | | | 958 | |
| 5 法人事業税 | | | 20,554 | |
| 6 租税公課 | | | 3,749 | |
| 7 不動産賃借料 | | | 103,790 | |
| 8 退職給付費用 | | | 37,578 | |
| 9 賞与引当金繰入 | | | 99,733 | |
| 10 役員賞与引当金繰入 | | | 2,850 | |
| 11 固定資産減価償却費 | 1 | | 8,278 | |
| 12 諸経費 | | | 179,160 | 1,302,502 |
| 営業利益 | | | | 495,192 |
| 営業外収益 | | | | |
| 1 受取配当金 | | | 183 | |
| 2 雑益 | | | 166 | 350 |
| 営業外費用 | | | | |
| 1 為替差損 | | | 2,796 | |
| 2 雑損 | | | 320 | 3,116 |
| 経常利益 | | | | 492,425 |
| 特別損失 | | | | |
| 1 固定資産除却損 | | | 0 | |
| 2 商号変更費用 | | | 3,305 | 3,305 |
| 税引前中間純利益 | | | | 489,120 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | | | 135,476 |
| 法人税等調整額 | | | | 20,614 |
| 中間純利益 | | | | 333,030 |

(3) 中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | | 株主資本 合計 |
|-------------------------------|-----------|-----------|-------------|--------------|-------------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益剰余金 | | |
| | | 資本 準備金 | 資本剰余金 合計 | その他利益 剰余金 | 利益剰余金 合計 | |
| 当期首残高 | 1,550,000 | 413,280 | 413,280 | 1,257,468 | 1,257,468 | 3,220,749 |
| 当中間期変動額 | | | | | | |
| 中間純利益 | | | | 333,030 | 333,030 | 333,030 |
| 株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額） | | | | | | |
| 当中間期変動 額合計 | - | - | - | 333,030 | 333,030 | 333,030 |
| 当中間期末残高 | 1,550,000 | 413,280 | 413,280 | 1,590,499 | 1,590,499 | 3,553,779 |

| | 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 | 3,147 | 3,147 | 3,217,602 |
| 当中間期変動額 | | | |
| 中間純利益 | | | 333,030 |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | 19,109 | 19,109 | 19,109 |
| 当中間期変動額合計 | 19,109 | 19,109 | 352,139 |
| 当中間期末残高 | 15,961 | 15,961 | 3,569,741 |

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 15年

器具備品 2～20年

3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

4. 引当金の計上基準

（1）賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、賞与支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

（2）役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、当事業年度における支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

（3）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当中間会計期間末における要支給額を計上しております。

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

5. 消費税等の会計処理方法

税抜方式を採用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

| | 第36期中間会計期間 (2020年9月30日) |
|------------------|---|
| 1 有形固定資産の減価償却累計額 | 158,726千円 |
| 2 消費税等の取扱い | 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 流動負債の「その他」に含めて表示して おりません。 |

(中間損益計算書関係)

| | 第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) |
|---------------------|---|
| 1 減価償却実施額 有形固定資産 | 8,278千円 |

(中間株主資本等変動計算書関係)

第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数並びに自己株式の種類及び株式数に関する事項

| | 当事業年度期首 株式数(株) | 当中間会計期間 増加株式数(株) | 当中間会計期間 減少株式数(株) | 当中間会計期間 末株式数(株) |
|-------|-------------------|---------------------|---------------------|--------------------|
| 発行済株式 | | | | |
| 普通株式 | 24,085 | - | - | 24,085 |
| 合計 | 24,085 | - | - | 24,085 |
| 自己株式 | | | | |
| 普通株式 | - | - | - | - |
| 合計 | - | - | - | - |

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

該当事項はありません。

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間の末日後となるもの

該当事項はありません。

(金融商品関係)

第36期中間会計期間 (2020年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

2020年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含めておりません(注2.参照)。

(単位：千円)

| | 中間貸借対照表 計上額 | 時価 | 差額 |
|-----------------------|----------------|-----------|----|
| (1) 現金・預金 | 1,766,457 | 1,766,457 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 1,119,626 | 1,119,626 | - |
| (3) 未収運用受託報酬 | 902,998 | 902,998 | - |
| (4) 投資有価証券 その他有価証券 | 413,794 | 413,794 | - |
| 資産計 | 4,202,876 | 4,202,876 | - |
| (1) 未払金 | 546,905 | 546,905 | - |

| | | | |
|------------|-----------|-----------|---|
| (2) 未払費用 | 483,858 | 483,858 | - |
| (3) 未払法人税等 | 153,068 | 153,068 | - |
| 負債計 | 1,183,831 | 1,183,831 | - |

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) 未払金、(2) 未払費用及び(3) 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)

| | |
|-------|------------|
| | 中間貸借対照表計上額 |
| 非上場株式 | 750 |

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

(有価証券関係)

第36期中間会計期間 (2020年9月30日)

1. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

2. 子会社株式及び関連会社株式

該当事項はありません。

3. その他有価証券

(単位：千円)

| | 種類 | 中間貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|------------------------|---------|------------|---------|--------|
| 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | (1) 株式 | - | - | - |
| | (2) 債券 | - | - | - |
| | (3) その他 | 385,259 | 360,687 | 24,571 |
| | 小計 | 385,259 | 360,687 | 24,571 |
| 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | (1) 株式 | - | - | - |
| | (2) 債券 | - | - | - |
| | (3) その他 | 28,535 | 30,100 | 1,564 |
| | 小計 | 28,535 | 30,100 | 1,564 |
| 合計 | | 413,794 | 390,787 | 23,006 |

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(ストック・オプション等関係)

該当事項はありません。

(資産除去債務関係)

第36期中間会計期間（2020年9月30日）

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減

| | |
|------------|---------|
| 期首残高 | 8,475千円 |
| 時の経過による調整額 | 75千円 |
| 中間期末残高 | 8,550千円 |

(セグメント情報等)

セグメント情報

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

当社は、投資運用事業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

(単位：千円)

| 日本 | 欧州 | 北米 | 中東 | アジア | 合計 |
|-----------|---------|---------|---------|--------|-----------|
| 3,476,579 | 149,363 | 169,375 | 117,564 | 27,988 | 3,985,870 |

(注) 営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

| | 第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) |
|--------------|---|
| 1株当たり純資産額 | 148,214.30 円 |
| 1株当たり中間純利益金額 | 13,827.29 円 なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 |

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) |
|--------------|---|
| 中間純利益 | 333,030 千円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | - 千円 |
| 普通株式に係る中間純利益 | 333,030 千円 |
| 普通株式の期中平均株式数 | 24,085 株 |

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年3月15日

SOMPO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
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 蒲谷 剛史
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング20の2020年7月16日から2021年1月15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。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング20の2021年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年7月16日から2021年1月15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。

中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、SOMPOアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽

表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

- ・ 中間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、監査人は、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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

SOMPO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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2021年3月15日

SOMPO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
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 蒲谷 剛史
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング30の2020年7月16日から2021年1月15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。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング30の2021年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年7月16日から2021年1月15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。

中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、SOMPOアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽

表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

- ・ 中間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、監査人は、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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

SOMPO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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2021年3月15日

SOMPO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
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 蒲谷 剛史
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング40の2020年7月16日から2021年1月15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。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング40の2021年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年7月16日から2021年1月15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。

中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、SOMPOアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽

表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

- ・ 中間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、監査人は、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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

SOMPO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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2021年3月15日

SOMPO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
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 蒲谷剛史
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング50の2020年7月16日から2021年1月15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。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング50の2021年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年7月16日から2021年1月15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。

中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、SOMPOアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽

表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

- ・ 中間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、監査人は、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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

SOMPO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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2021年3月15日

SOMPO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
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 蒲谷 剛史
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング60の2020年7月16日から2021年1月15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。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング60の2021年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年7月16日から2021年1月15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。

中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、SOMPOアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽

表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

- ・ 中間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、監査人は、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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

SOMPO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. XBR L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

2020年6月11日

SOMPO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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 蒲 谷 剛 史
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志 保
業務執行社員

監査意見

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S O M P Oアセットマネジメント株式会社（旧損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社）の2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、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。

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、S O M P Oアセットマネジメント株式会社（旧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2020年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年11月26日

SOMPO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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 蒲谷剛史
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保
業務執行社員

中間監査意見

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SOMPOアセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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、SOMPOアセットマネジメント株式会社の2020年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間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、監査人は、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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。