

【表紙】

| | |
|--|--|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 2023年10月17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。 |

第一部【証券情報】

（１）【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

以下、上記のそれぞれをまたは上記を総称して「ファンド」または「ハッピーエイジング・ファンド」ということがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権です。

各ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（１１）振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるSOMPOアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

委託会社の依頼により信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、2,000億円を上限とします。

上記金額には申込手数料及び申込手数料に係る消費税及び地方消費税に相当する金額（以下、「消費税等相当額」といいます。）は含まれていません。

（４）【発行（売出）価格】

各ファンドについて、取得申込受付日¹の翌営業日の基準価額²とします。

上記金額には申込手数料及び申込手数料に係る消費税等相当額は含まれていません。

1 日本における委託会社および販売会社（受益権の取得の申込みの取扱いを行う第一種金融商品取引業を行う者及び登録金融機関を総称して、以下「販売会社」といいます。）の営業日に限り、申込みの取扱いは行われず。ただし、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所、フランクフルト証券取引所、パリ証券取引所のいずれかの取引所あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、取得の申込みを受付けないものとします。

2 基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入有価証券を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されることがあります。

各ファンドの基準価額については、委託会社または販売会社に問い合わせることにより知ることができ、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

（５）【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.2%（税抜2.0%）を上限として販売会社が定めた手数料率を乗じて得た額です。

申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

各ファンドは自動けいぞく投資専用ファンドです。自動けいぞく投資とは、収益分配の際に税引き後の収益分配金を、無手数料で自動的に再投資する方法です。

自動けいぞく投資契約に基づく定時定額購入サービスをお申込みの場合および確定拠出年金制度に基づくお申込みの場合は、上記にかかわらず、申込手数料はありません。また、同サービスおよび確定拠出年金制度に基づくお申込みの場合、「ハッピーエイジング・ファンド」の各ファンド間の乗換え（以下「スイッチング」といいます。）の申込手数料もかかりません。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位等の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

（７）【申込期間】

継続申込期間 2023年10月18日から2024年4月17日までです。

継続申込期間は上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

（８）【申込取扱場所】

申込取扱場所は、原則として販売会社の本支店等とします。販売会社については、委託会社までお問い合わせください。

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

（９）【払込期日】

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

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

（１０）【払込取扱場所】

原則として申込取扱場所と同じです。

（１１）【振替機関に関する事項】

各ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

申込証拠金

ありません。

日本以外の地域における発行

ありません。

振替受益権について

各ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、前記「(1 1) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および前記「(1 1) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

「ハッピーエイジング・ファンド」は、リスク水準の異なる5本のファンドから構成されており、中長期的に信託財産の着実な成長を図ることを目的に、「S」AMラージキャップ・バリュース・マザーファンド」、「S」AMスモールキャップ・マザーファンド、「損保ジャパン日本債券マザーファンド」、「損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド」、「損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド」の受益証券及びエマージング株式又はエマージング株式を主要投資対象とする証券投資信託の受益証券を主要投資対象として運用を行うことを基本とします。

委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンド金2,000億円を限度として信託金を追加できません。また、委託会社は、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

一般社団法人投資信託協会が定める各ファンドの商品分類および属性区分は以下の通りです。

商品分類表

| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産 (収益の源泉) |
|---------|--------|-------------------|
| 単位型 | 国内 | 株式 |
| 追加型 | 海外 | 債券 |
| | 内外 | 不動産投信 |
| | | その他資産() |
| | | 資産複合 |

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

<各ファンドの商品分類の定義>

| 項目 | 該当する商品分類 | 内容 |
|-------------------|----------|--|
| 単位型・追加型 | 追加型 | 一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。 |
| 投資対象地域 | 内外 | 目論見書又は信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| 投資対象資産 (収益の源泉) | 資産複合 | 目論見書又は信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |

属性区分表

| 投資対象資産 | 決算頻度 | 投資対象地域 | 投資形態 | 為替ヘッジ |
|--------|------|------------------|--------------|-----------|
| 株式 | 年1回 | グローバル (日本を含む) | ファミリーファンド | あり () |
| 一般 | 年2回 | 日本 | ファンド・オブ・ファンズ | なし |
| 大型株 | 年4回 | 北米 | | |

| | | | |
|---------|-------------|--------|--|
| 中小型株 | 年6回 (隔月) | 欧州 | |
| 債券 | 年12回 | アジア | |
| 一般 | (毎月) | オセアニア | |
| 公債 | 日々 | 中南米 | |
| | | アフリカ | |
| 社債 | その他 | 中近東 | |
| | () | (中東) | |
| その他債券 | | エマージング | |
| クレジット属性 | | | |
| () | | | |
| 不動産投信 | | | |
| その他資産 | | | |
| (投資信託証券 | | | |
| (資産複合(株 | | | |
| 式、債券)) | | | |
| 資産複合 | | | |
| () | | | |
| 資産配分固定型 | | | |
| 資産配分変更型 | | | |

(注1) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(注2) ファミリーファンドの場合、投資信託証券を通じて収益の源泉となる資産に投資をしますので、商品分類表と属性区分表の「投資対象資産」は異なります。

(注3) 属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

<当ファンドの属性区分の定義>

| 項目 | 該当する属性区分 | 内容 |
|--------|----------------------------|--|
| 投資対象資産 | その他資産(投資信託証券(資産複合(株式、債券))) | 目論見書又は信託約款において、投資信託証券を通じて、株式および債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。 |
| 決算頻度 | 年1回 | 目論見書又は信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。 |
| 投資対象地域 | グローバル(日本を含む) | 目論見書又は信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| 投資形態 | ファミリーファンド | 目論見書又は信託約款において、マザーファンド(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資するものをいいます。 |
| 為替ヘッジ | 為替ヘッジなし | 目論見書又は信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。 |

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

<ファンドの特色>

ファンドの目的

日本及び世界各国の株式や公社債を実質的な主要投資対象とし、中長期的に信託財産の着実な成長を目標として運用を行います。

● ファンドの特色

- 1** 国内株式・国内債券にとどまらず世界各国の株式及び債券に積極的に分散投資を行うことによって、リスクを軽減しつつ信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指します。

| 投資対象資産 | 投資対象とするマザーファンド ^{※1} 等 |
|----------|--|
| 国内株式 | SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド SJAMスモールキャップ・マザーファンド |
| 国内債券 | 損保ジャパン日本債券マザーファンド |
| 外国債券 | 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド |
| 外国株式 | 損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド ^{※2} |
| エマージング株式 | エマージング株式または エマージング株式を主要投資対象とする証券投資信託 |

※1 マザーファンドについては、後掲「ファンドの仕組み」をご参照下さい。

※2 運用スタイル毎のアロケーションと北米株式の運用指図に関する権限を、TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANYに委託します。

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。
2023年6月末現在の同グループの運用資産は、約2,100億米ドル(約30兆4,479億円[※])です。
※2023年6月末時点の為替レートで換算。

- 2** 長期的な視点から基準資産配分比率を決定し、当該比率をめどに投資を行います。基準資産配分比率は、次の手順で決定、見直しを行います。

1. 長期的視点から、国内外の長期的な過去データに基づく分析と将来に対する見通しに基づいて、各資産毎の長期的期待収益率、標準偏差、相関係数等を予測します。
2. 予測した各数値を基に、各ファンドの最適な資産配分比率を求め、基準資産配分比率とします。経済情勢の変化等により長期的に市場環境に大きな影響があると判断した場合には、基準資産配分比率の見直しを行います。

3

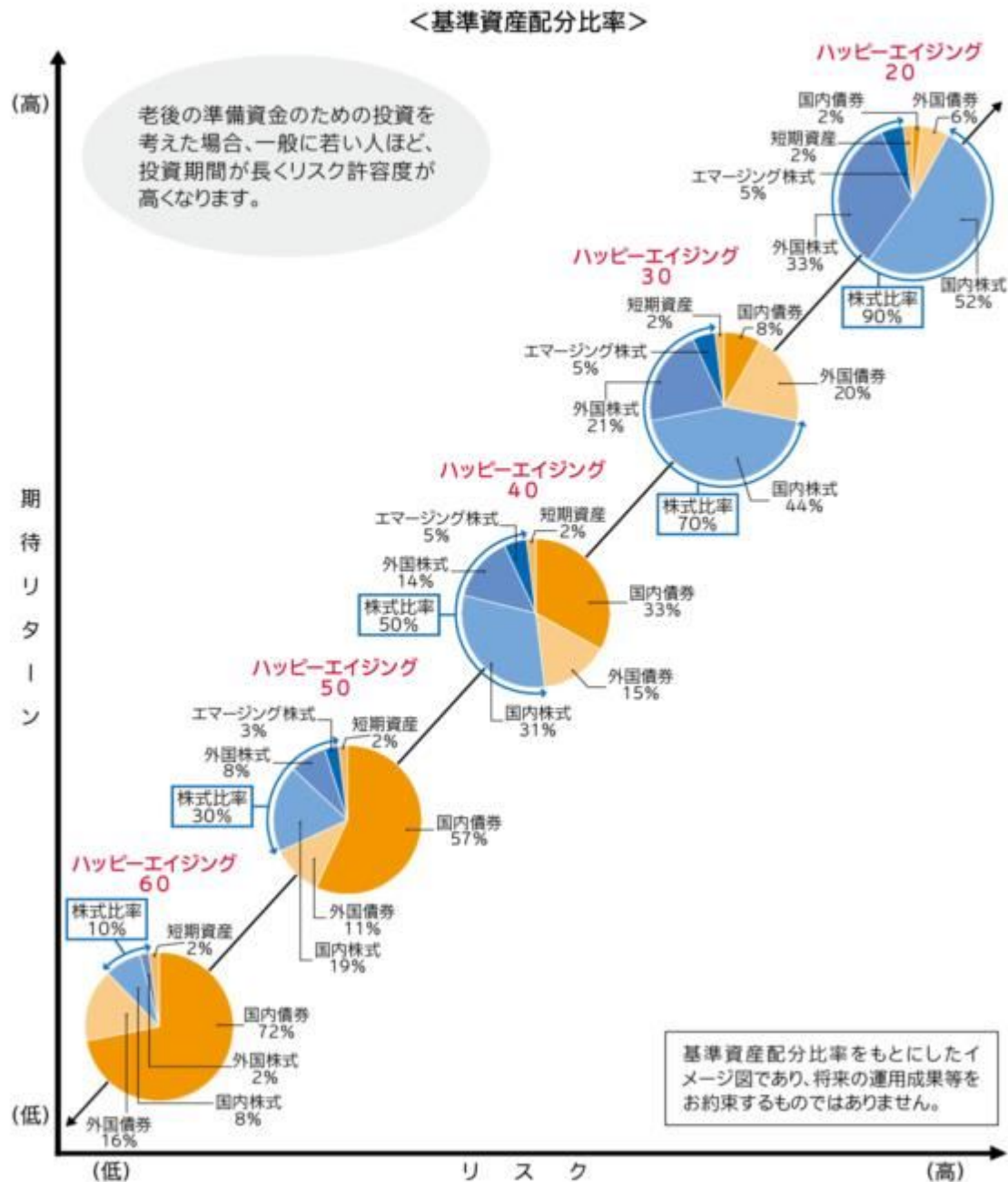
各ファンドの特徴は、以下のとおりです。

| | |
|-------------|--|
| ハッピーエイジング20 | 国内外の株式の基準組入比率を90%とするファンドです。リスクを積極的にとりながら資産の大きな成長を目指します。5つのファンドの中では最もリスクが高く、投資期間が長く積極的運用をお考えの方に適したファンドです。 |
| ハッピーエイジング30 | 国内外の株式の基準組入比率を70%とするファンドです。5つのファンドの中では比較的高いリスクをとり適度に高い収益を目指します。資産の成長性を重視した運用をお考えの方に適したファンドです。 |
| ハッピーエイジング40 | 国内外の株式の基準組入比率を50%とするファンドです。5つのファンドの中では、リスクのレベルは中位に位置し、リスク・リターンのバランスを重視した運用を目指します。積極性と安定性とバランスのとれた運用をお考えの方に適したファンドです。 |
| ハッピーエイジング50 | 国内外の株式の基準組入比率を30%とするファンドです。5つのファンドの中では比較的低位にリスクを設定し安定した運用を目指します。安定性に重点を置きつつ適度の収益性をも考慮した運用をお考えの方に適したファンドです。 |
| ハッピーエイジング60 | 国内外の株式の基準組入比率を10%とするファンドです。5つのファンドの中では最もリスクを抑え、より安定した運用を目指します。投資期間が比較的短く安定性を重視した運用をお考えの方に適しています。 |

4

投資目的、投資期間、リスク許容度等に応じて、リスク水準の異なる5種類のファンドからご選択いただけます。

- ハッピーエイジング20が、最も積極的(高リスク)運用を行うファンドで、ハッピーエイジング60が、最も安定的(低リスク)運用を行うファンドです。



※各マザーファンドの受益証券への投資を通じて、上記の基準資産配分比率を目標に投資を行います。ただし、各マザーファンドの組入比率は、0%を下限とし、基準資産配分比率の±5%程度の範囲とします。なお、市況動向によっては、内外の有価証券等への直接投資を行うことがあります。

5

各ファンドの運用は、以下の個別資産毎のベンチマーク(運用を評価するための指標)を基準資産配分比率で加重平均したものを総合ベンチマークとし、これを上回る運用成果を目指します。

| 資産 | ベンチマーク |
|----------|---------------------------------|
| 国内株式 | 東証株価指数(TOPIX) |
| 国内債券 | NOMURA-BPI総合指数 |
| 外国債券 | FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース) |
| 外国株式 | MSCIコクサイ インデックス(円換算ベース) |
| エマージング株式 | MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース) |
| 短期資産 | 有担コール翌日物 |

●東証株価指数(TOPIX)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社J P X 総研又は株式会社J P X 総研の関連会社に帰属します。

●NOMURA-BPI総合指数とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づき構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。なお、NOMURA-BPI総合指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。

●FTSE 世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)とは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く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指数です。なお、FTSE 世界

国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

●MSCIコクサイ インデックスとは、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数です。MSCIコクサイ インデックス(円換算ベース)は、MSCIコクサイ インデックス(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。なお、MSCI Index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。

●MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数です。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(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(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。なお、MSCI Index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。

(2)【ファンドの沿革】

2000年7月31日

信託契約締結、設定、運用開始

2002年7月1日

ファンドの名称を下記の通り変更

<変更後>

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

ハッピーエイジング・ファンド(総称)

<変更前>

ライフタイム20

ライフタイム30

ライフタイム40

ライフタイム50

ライフタイム60

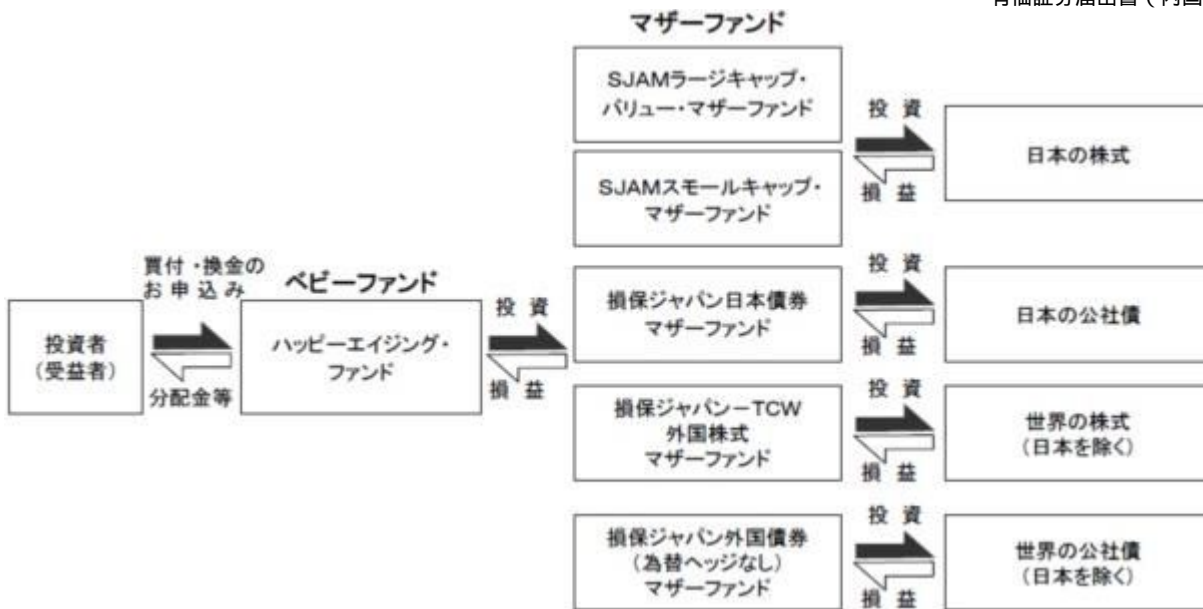
安田火災シグナ・ライフ
タイム・ファンド(総称)

- 2003年2月14日 「シグナ日本株アクティブ・マザーファンド」の運用委託先を、シグナ・インターナショナル・インベストメント・アドバイザーズ株式会社から興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社に変更するとともにマザーファンドの名称を「シグナ日本株アクティブ・マザーファンド」から「損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド」に変更
「シグナ日本債券マザーファンド」の運用委託先であるシグナ・インターナショナル・インベストメント・アドバイザーズ株式会社への委託を行わず、当社が運用する方法に変更するとともに、マザーファンドの名称を「シグナ日本債券マザーファンド」から「損保ジャパン日本債券マザーファンド」に変更
- 2005年10月8日 ファンドの基本資産配分比率及び投資配分について、損保ジャパンDC証券株式会社からの助言を受けて当社が策定する方法から、助言を受けずに策定する方法に変更
主要投資対象とするマザーファンドのうち、「損保ジャパン外国債券マザーファンド」を「損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド」に変更
主要投資対象ごとの基本資産配分比率を規定する方法から、株式の組入比率を規定する方法に変更
- 2012年3月30日 マザーファンドの評価、入れ替えを行わないこととし、その助言に関する損保ジャパンDC証券株式会社との投資顧問契約を解約。
- 2015年4月14日 主要投資対象とするマザーファンドのうち、「損保ジャパン日本株マザーファンド」、「損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド」を「S J A Mラージキャップ・バリュース・マザーファンド」、「S J A Mスモールキャップ・マザーファンド」に変更

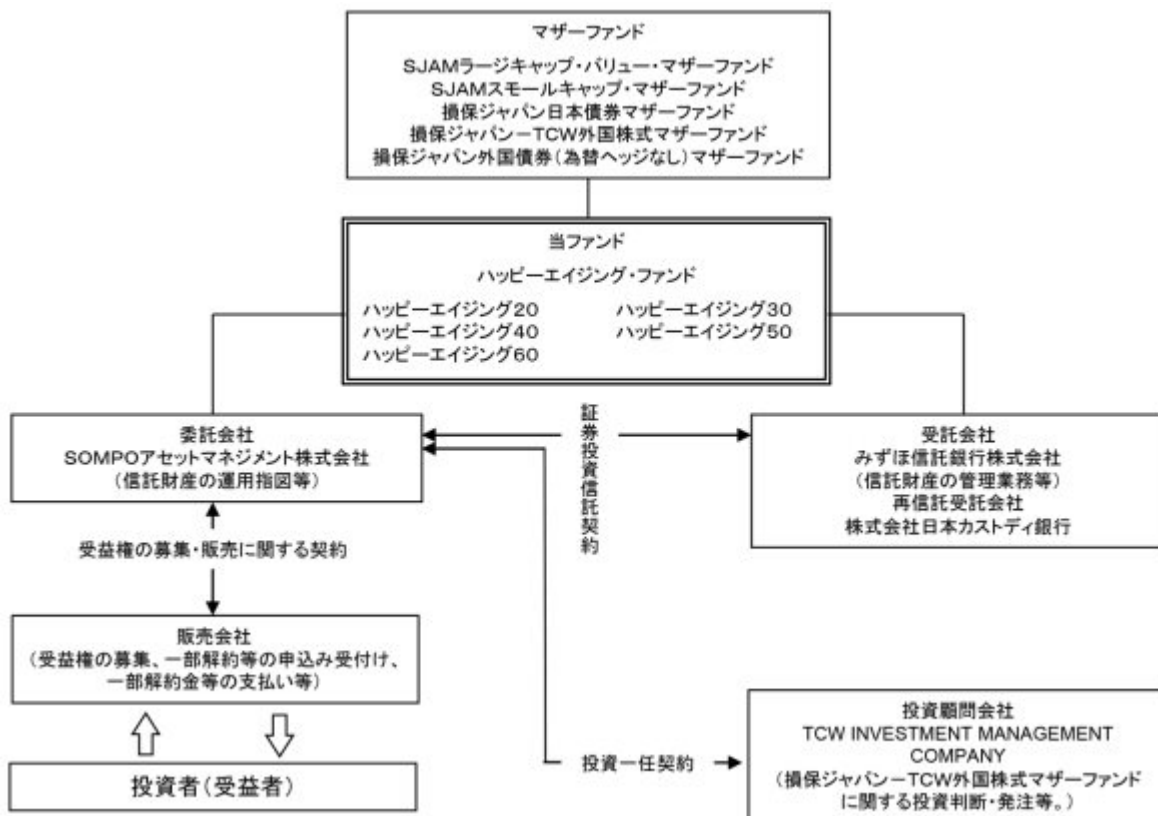
(3)【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。当ファンドは「ベビーファンド」にあたります。ただし、ベビーファンドから有価証券等に直接投資することもあります。



ファンドの関係法人図



ファンドの関係法人

() 委託会社または委託者：SOMPOアセットマネジメント株式会社

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

() 販売会社

委託会社との受益権の募集・販売に関する契約に基づき、各ファンドの販売会社として、受益権の募集・販売の取扱い、目論見書・運用報告書の交付、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金の再投資、一部解約金・収益分配金・償還金の支払い、取引報告書等の交付等を行います。

() 受託会社または受託者：みずほ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行)

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

() 投資顧問会社：TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY〔略称：TCW〕

TCWは、委託会社との投資一任契約に基づき、「損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド」に関して、委託会社より、運用スタイル毎のアロケーションと北米株式の運用の指図に関する権限の委託を受けて投資判断、発注等を行います。

委託会社等の概況

() 資本金の額 1,550百万円 (2023年7月末現在)

() 委託会社の沿革

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

() 大株主の状況 (2023年7月末現在)

| 名称 | 住所（所在地） | 所有株式数 （株） | 持株比率 （％） |
|-------------------|-------------------|--------------|-------------|
| SOMPOホールディングス株式会社 | 東京都新宿区西新宿一丁目26番1号 | 24,085 | 100.0 |

2【投資方針】

(1)【投資方針】

a. 基本方針

当ファンドは、中長期的に信託財産の着実な成長を目標として運用を行います。

b. 運用方針

投資対象

「SJAMラージキャップ・バリュース・マザーファンド」、「SJAMスモールキャップ・マザーファンド」、「損保ジャパン日本債券マザーファンド」、「損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド」、「損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド」の受益証券およびエマー

ジング株式又はエマージング株式を主要投資対象とする証券投資信託を主要投資対象とします。このほか、内外の有価証券等に直接投資することがあります。

投資態度

- () 主として上記のマザーファンドの受益証券等への投資を通して、国内株式・国内債券にとどまらず世界各国の株式および債券に積極的に分散投資を行うことによって、リスクを軽減しつつ信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指します。
- () 各マザーファンドを通じて実質的に投資する株式(当ファンドが直接投資する株式を含みます。)への配分比率は、ハッピーエイジング20で信託財産の純資産総額の概ね90%程度、ハッピーエイジング30で信託財産の純資産総額の概ね70%程度、ハッピーエイジング40で信託財産の純資産総額の概ね50%程度、ハッピーエイジング50で信託財産の純資産総額の概ね30%程度、ハッピーエイジング60で信託財産の純資産総額の概ね10%程度となることを目処に投資を行います。
- () 資金動向、市況動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- () 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限りません。)
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形
- () 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

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

1. SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド
2. SJAMスモールキャップ・マザーファンド
3. 損保ジャパン日本債券マザーファンド
4. 損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド
5. 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. 株券または新株引受権証券
7. 国債証券
8. 地方債証券
9. 特別の法律により法人の発行する債券
10. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下、「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
11. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
12. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
13. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)

14. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
15. コマーシャル・ペーパー
16. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
17. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前記1.から16.までの証券または証書の性質を有するもの
18. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
19. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
20. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
21. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
22. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
23. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
24. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
25. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
26. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
27. 外国の者に対する権利で前記26.の有価証券の性質を有するもの
なお、前記6.の証券ならびに証書、17.および22.の証券または証書のうち6.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、7.から11.までの証券ならびに17.および22.の証券または証書のうち7.から11.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、18.の証券および19.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前記5.の権利の性質を有するもの

前記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前記 1.から6.までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(3) 【運用体制】

a. 委託会社の運用体制と社内規程

(運用体制)

総合投資会議は、ファンドの基本運用方針の分析と決定を行います。

各資産投資戦略会議は、総合投資会議の基本運用方針に基づき、ファンドの運用戦略を決定し、

各運用担当部が運用計画を策定します。

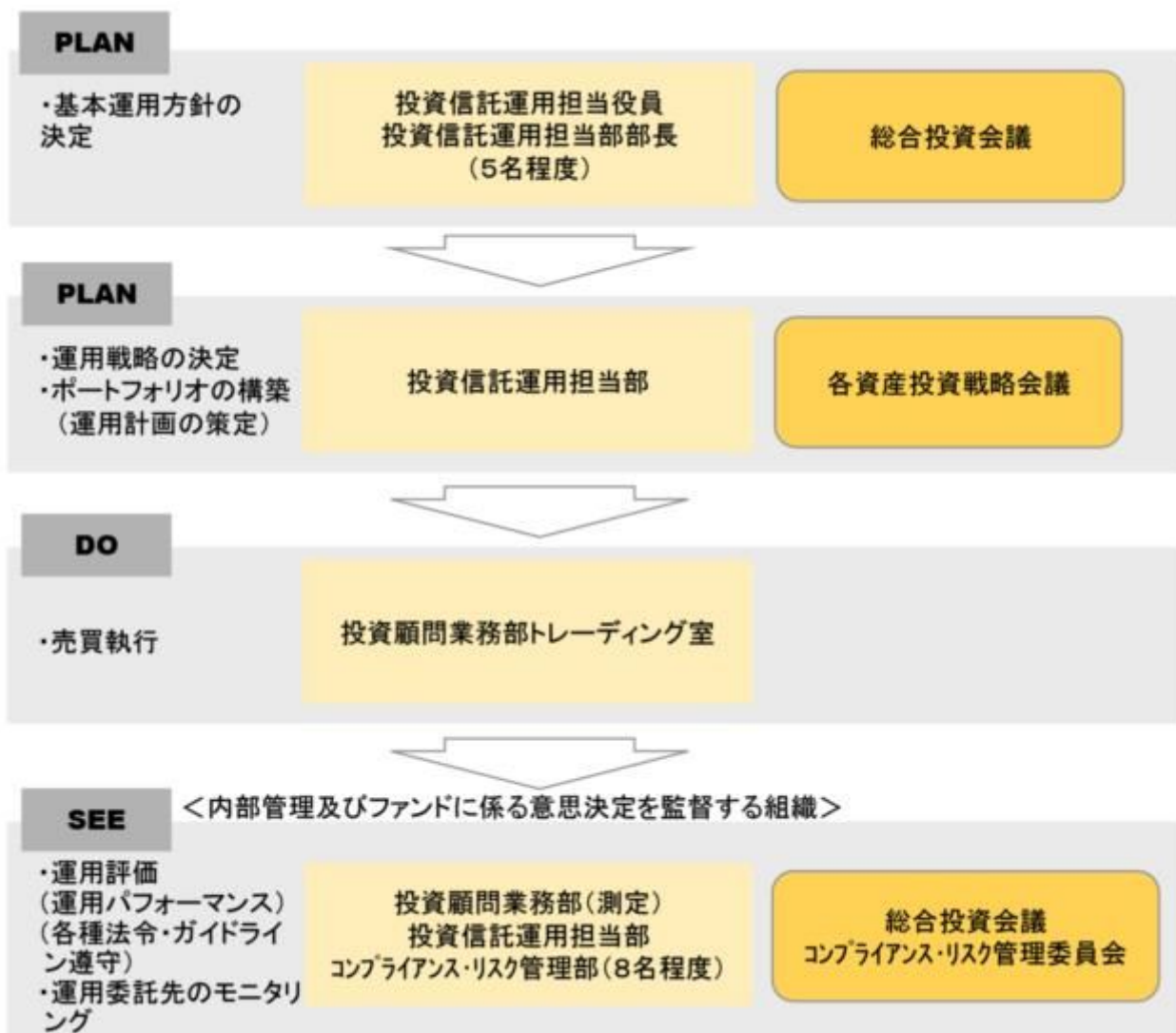
各運用担当部で策定された運用計画に基づき、投資顧問業務部トレーディング室が最良執行の観点から売買を執行します。

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

（社内規程）

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

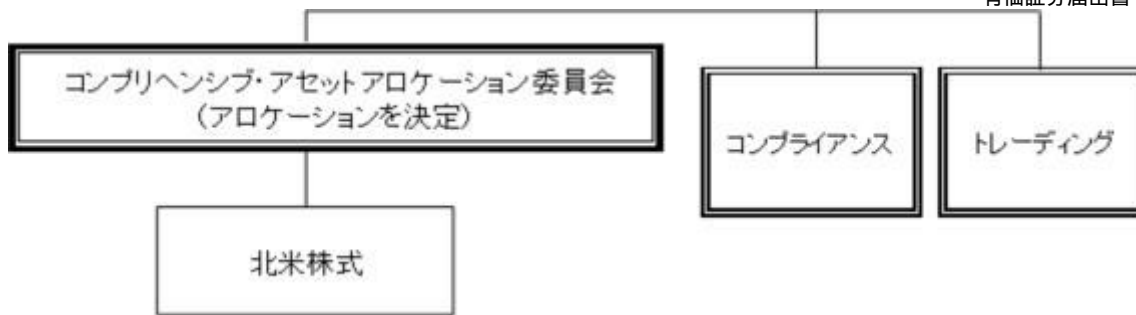
また、外部委託先の管理体制については、当社が当社以外の者に業務を委託するときの基本事項等を定めた「外部委託管理規程」に従い、定期モニタリング等を実施しています。



2023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。

b. 運用委託先の運用体制等

損保ジャパン・TCW外国株式マザーファンドの運用委託先であるTCWでは、主に資産配分を担当するコンプリヘンシブ・アセットアロケーション委員会ならびに各プロダクト毎に編成されたチームが連携して運用を行っております。また、コンプライアンス部門によるチェック体制も保持しています。



（本組織図は、2023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。）

（４）【分配方針】

毎決算時（原則として7月15日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子、配当収入と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

中長期的な観点から、複利効果による資産の成長を目指すために分配を抑えるファンドです。

（５）【投資制限】

a. 当ファンドの信託約款に基づく投資制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。以下において同じ。）への投資制限「ハッピーエイジング20」

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

実質投資割合とは、実質投資額（信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と親投資信託に属する当該株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額）を信託財産の純資産総額で除したものです。また、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する親投資信託の時価総額に親投資信託の信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。以下同じ。

「ハッピーエイジング30」

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

「ハッピーエイジング40」

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。

「ハッピーエイジング50」

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。

「ハッピーエイジング60」

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%未満とします。

デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

投資する株式等の範囲

- () 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- () 前記()の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

新株引受権証券等への投資制限

委託会社は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と親投資信託に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

投資信託証券への投資制限

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（親投資信託受益証券および上場投資信託証券（取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）なもの））ならびに信託財産に既に組み入れている株式等が転換等により投資信託証券に該当することとなった投資信託証券を除きます。）の時価総額と親投資信託に属する当該投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

信用取引の指図および範囲

- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- () 前記()の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額と親投資信託に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- () 信託財産の一部解約等の事由により、前記()の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

公社債の空売りの指図および範囲

- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うこ

との指図をすることができるものとします。

- () 前記()の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- () 信託財産の一部解約等の事由により、前記()の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

先物取引等の運用指図

- () 委託会社は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。
- () 委託会社は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- () 委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図

- () 委託会社は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下、「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- () スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- () スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- () 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

- () 委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- () 金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- () 金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- () 委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

同一銘柄の株式への投資制限

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額と親投資信託に属する当該同一銘柄の株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の5を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と親投資信託に属する当該同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の5を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

同一銘柄の転換社債等への投資制限

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額と親投資信託に属する当該同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の10を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

有価証券の貸付の指図および範囲

- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の1.および2.の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- () 前記1.および2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- () 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の借入れの指図および範囲

- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- () 前記()の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- () 信託財産の一部解約等の事由により、前記()の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- () 前記()の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約の指図

- () 委託会社は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- () 前記()の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- () 前記()の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

信用リスク集中回避のための投資制限

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

21 デリバティブ取引等に係る投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

22 資金の借入れ

- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- () 一部解約に伴う支払資金の手当にかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- () 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- () 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

23 受託会社による資金の立替え

- () 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。
- () 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰入れることができます。
- () 前記()および()の立替え金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

b. 法令に基づく投資制限

同一の法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権（株主総会において決議することができ

る事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図してはならないとされています。

デリバティブ取引に係る投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令)

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券又はオプションを表示する証券若しくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。)を行い、又は継続することを指図してはならないとされています。

(参考)「S」AMラージキャップ・バリュー・マザーファンド」の運用の基本方針

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の中長期的成長を目指して、積極的な運用を行います。

2. 運用方針

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象といたします。

(2) 投資態度

原則としてRussell/Nomura Large Cap Value インデックス採用銘柄でかつ、当社の日本株式ユニバース構成銘柄より投資銘柄を選定します。

独自の調査分析に基づいて算出した理論株価と市場価格を比較し、割安となっている銘柄に投資することを基本にリスク管理を行いつつ最適なポートフォリオを構築し、「Russell/Nomura Large Cap Value インデックス(配当を含むトータルリターンインデックス)」を中長期的に上回る運用成果を目指します。

転換社債、ならびに新株予約権付社債や新株引受権証券および新株予約権証券(外貨建てを含みます。)等に投資する場合があります。

株式(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式を含む。)の組入比率は原則として信託財産総額の50%超(高位に維持)を基本とします。なお、株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含む。)への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。ただし、資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

有価証券先物取引等は、信託約款第21条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第22条の範囲で行います。

金利先渡取引及び為替先渡取引は、信託約款第23条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則と

して、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

(参考)「S J A Mスモールキャップ・マザーファンド」の運用の基本方針

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の中長期的成長を目指して、積極的な運用を行います。

2. 運用方針

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象といたします。

(2) 投資態度

原則として、Russell/Nomura Small Cap インデックス採用銘柄でかつ、当社の日本株式ユニバース構成銘柄より投資銘柄を選定します。

独自の調査分析に基づいて算出した理論株価と市場価格を比較し、割安となっている銘柄に投資することを基本にリスクを軽減しつつ、「Russell/Nomura Small Cap インデックス(配当を含むトータルリターンインデックス)」を中長期的に上回る運用成果を目指します。

株式(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式を含む。)の組入比率は原則として信託財産総額の50%超(高位に維持)を基本とします。なお、株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含む。)への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

投資環境によっては、防衛的な観点から運用者の判断で、主要投資対象への投資を大幅に縮小する場合があります。

資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

有価証券先物取引等は、信託約款第21条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第22条の範囲で行います。

金利先渡取引及び為替先渡取引は、信託約款第23条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

（参考）「損保ジャパン日本債券マザーファンド」の運用の基本方針

1．基本方針

この投資信託は、主に日本の公社債に投資を行い、中長期的に信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

2．運用方針

(1) 投資対象

日本の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として、日本の公社債を中心に分散投資を行い、インカムの確保を図るとともに金利低下や格付け上昇に伴うキャピタルゲインの獲得を狙い、NOMURA - BPI総合指数を中長期的に上回る投資成果を目指します。

投資に際しては、内外いずれかの評価機関からBBB格あるいはBBB格相当以上の格付を得ている信用度の高い銘柄とします。格付を取得していない公社債については、客観的に同等の信用力があると判断した場合には投資を行うことがあります。

運用期間を通じて、ポートフォリオの見直しを随時行い、個別組入銘柄変更やデュレーション調整等を行います。

外貨建資産については、為替変動リスクを回避するため、対円で原則100%為替ヘッジを行います。

資金動向、市況動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 運用制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の株式等への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

有価証券先物取引等は、信託約款第18条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第19条の範囲で行います。

金利先渡取引および為替先渡取引は、信託約款第20条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

（参考）「損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド」の運用の基本方針

1．基本方針

この投資信託は、主に外国の株式に投資し、積極的に収益の獲得を目指して運用を行います。

2．運用方針

(1) 投資対象

日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主にモルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル・コクサイ指数（以下、「MSCIコクサイ指数」といいます。）に採用されている国の株式に積極的に投資を行い、同指数を上回る投資成果を目指します。

運用にあたっては、TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY（米国）に運用スタイル毎のアロケーションと北米株式の運用の指図に関する権限を委託します。

運用スタイル毎のアロケーションに関しては、TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANYが各市場の企業の過去及び予想業績成長率、市場間の相対的魅力度の分析、各国の金利・物価上昇率・為替レート・中央銀行の金融政策などのファンダメンタルズ分析などの情報を集約して市場間の相対的魅力度を順位付けし、リスクを考慮したうえで、決定します。

運用スタイル毎のアロケーションが決定されると、ボトム・アップ・アプローチにより銘柄を選択します。

株式への投資割合は、原則として高位とします。

資金動向、市況動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 運用制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券等への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

投資信託証券（上場投資信託証券（取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）なものを含みます。以下同じ。））ならびに信託財産に既に組み入れていた株式等が転換等により投資信託証券に該当することとなった投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

有価証券先物取引等は、信託約款第20条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第21条の範囲で行います。

金利先渡取引および為替先渡取引は、信託約款第22条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

（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」の運用の基本方針

1. 基本方針

この投資信託は、主に日本を除く世界各国の公社債に投資を行い、中長期的に信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

2. 運用方針

(1) 投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として日本を除く先進各国の政府、政府機関等の発行する外国債券を中心に分散投資を行い、国内債より相対的に高いインカムの確保を図るとともに金利低下や格付け上昇に伴うキャピタルゲインの獲得を狙い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）を中長期的に上回る

投資成果を目指します。

投資対象国は、原則としてA格相当以上の長期債格付が付与された国とし、FTSE世界国債インデックス採用国を中心とします。ポートフォリオの見直しは随時行い、各国の政治・経済動向の変化や市況動向、リスク分散等を勘案して、国別の投資比率の変更やデュレーション調整等を行います。また、債券の組入比率は高位に保つことを原則とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

資金動向、市況動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 運用制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

有価証券先物取引等は、信託約款第20条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第21条の範囲で行います。

金利先渡取引および為替先渡取引は、信託約款第22条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

3【投資リスク】

各ファンドの基準価額は、組入れられる有価証券等の値動き等による影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資者の皆様へに帰属いたします。したがって、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金とは異なります。

各ファンドの主なリスクは以下のとおりです。

基準価額の変動要因は、以下に限定されるものではありません。

<当ファンドの投資にかかるリスク>

資産配分のリスク

各ファンドの基準資産配分比率が収益の源泉となる場合もありますが、配分比率が高い資産の価格が下落した場合等には株式、債券市場全体やベンチマークの収益率を下回ることがあります。

価格変動リスク

株式や公社債の価格は、国内外の政治・経済情勢、市況等の影響を受けて変動します。

また、一般に、金利が上昇すると、公社債の価格は下落します。組入れている株式や公社債の価格の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

信用リスク

株式や公社債の価格は、発行体の財務状態、経営、業績等の悪化及びそれらに関する外部評価の悪化等により下落することがあります。組入れている株式や公社債の価格の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また発行体の倒産や債務不履行等の場合は、株式や公社債の価値がなくなることもあり、ファンドの基準価額が大きく下落する場合があります。

流動性リスク

国内外の政治・経済情勢の急変、天災地変、発行体の財務状態の悪化等により、有価証券等の取引量が減少することがあります。この場合、ファンドにとって最適な時期や価格で、有価証券等を売買できないことがあり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

また、取引量の著しい減少や取引停止の場合には、有価証券等の売買ができなかったり、想定外に不利な価格での売買となり、ファンドの基準価額が大きく下落する場合があります。

為替変動リスク

外貨建資産の価格は、当該外貨と日本円との間の為替レートの変動の影響を受けて変動します。為替レートは、各国の政治・経済情勢、外国為替市場の需給、金利変動その他の要因により、短期間に大幅に変動することがあります。当該外貨の為替レートが、円高になった場合は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

カントリーリスク

一般的に、主要先進国以外の国では、主要先進国に比べて、経済が脆弱である可能性があり、国内外の政治・経済情勢、取引制度、税制の変化等の影響を受けやすく、また市場規模や取引量が小さいこと等から有価証券等の価格がより大きく変動することがあり、ファンドの基準価額が大きく下落することがあります。

コール・ローン等の短期金融商品の取引相手の債務不履行等により、当該金融商品等の取引ができなかった場合等は、ファンドが影響を受ける場合があります。

<その他の留意点>

クーリングオフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用はありません。

大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、ファンドの基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込の受付が中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。収益分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。投資者のファンドの購入価額によっては、収益分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、収益分配金額より基準価額の値上がりの方が小さかった場合も同様です。

マザーファンドに投資する別のベビーファンドの追加設定・解約等により、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額が影響を受ける場合があります。

ファンドとベンチマークは組入銘柄や国別配分比率が異なることがあり、ファンドの運用成績はベンチマークを下回る場合があります。

ファンドに関連する法令・税制・会計等は今後変更される可能性があります。これに伴い、ファンドの基準価額が影響を受ける場合があります。

販売会社より委託会社に対して申込金額の払込みが実際になされるまでは、ファンドも委託会社もいかなる責任も負いません。

委託会社は収益分配金、償還金および一部解約金を販売会社に対して支払った後は、受益者への支払いについての責任を負いません。

委託会社はファンドの設定・運用について、販売会社はお申込代金の預かり等を含む販売について、それぞれ責任を有し、互いに他について責任を負いません。

お申込み、ご換金に関わる留意点

<お申込時>

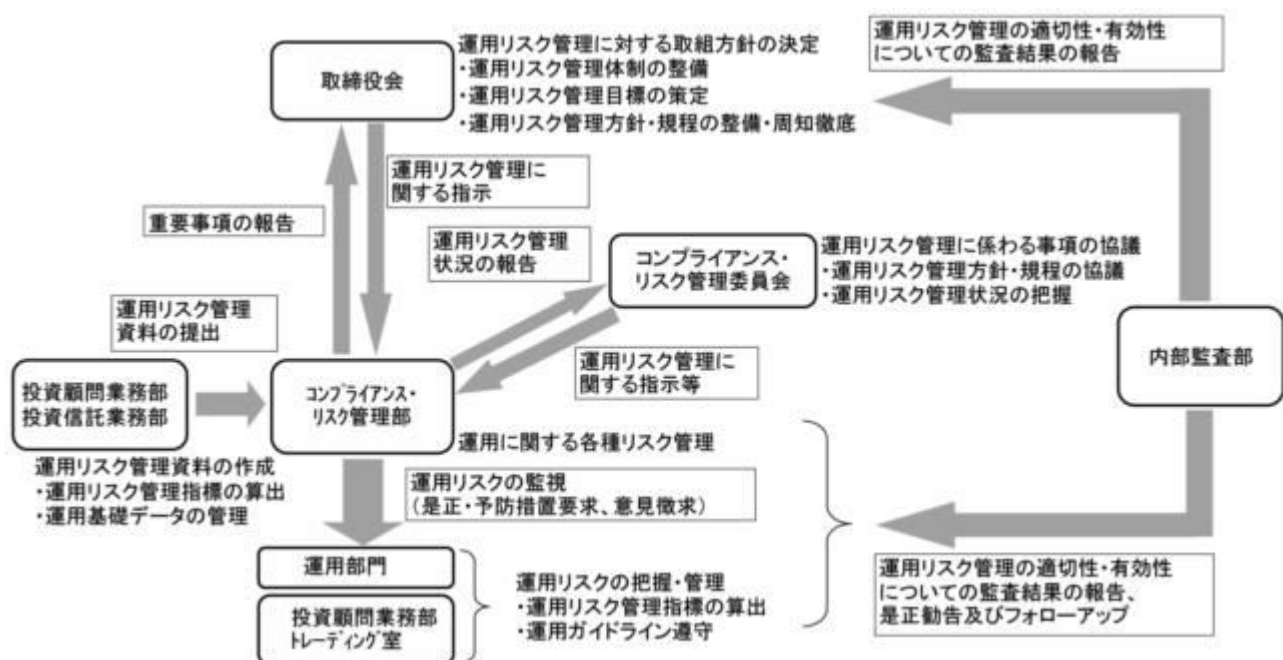
委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、取引市場における流動性が極端に減少した場合、取引市場の混乱、自然災害、テロ、大規模停電、システム障害等により基準価額の算出が困難となった場合、その他やむを得ない事情があると判断したとき（「緊急事態発生時」といいます。）は、取得申込みの受付を中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付を取り消すことができるものとします。

<ご換金時>

委託会社は、緊急事態発生時には、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、および既に受付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができるものとします。一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付け中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとし、信託約款の規定に準じて算出した価額とします。

<リスクの管理体制>

a. 委託会社のリスク管理体制



※運用リスクには流動性リスクを含みます。

(注) 上図は、2023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。

流動性リスクに対する管理体制

委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策等を策定しています。流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢については、担当役員が監督し、管理状況およびその有効性等については、定期的に社内委員会に報告されます。

b. 運用委託先のリスク管理体制等

損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンドの運用委託先であるTCWにおいては、投資制限の遵守状況について、独立の組織であるコンプライアンス部門のチェックを常に受けております。また、TCWが行った取引については、TCW社内のトレーディング委員会においてレビューが行われます。

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移

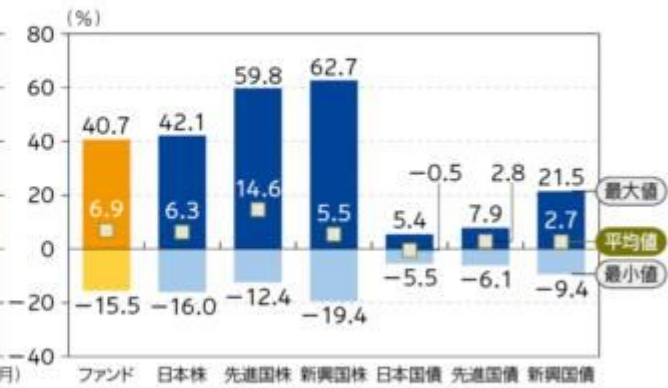
2018年8月～2023年7月

ハッピーエイジング20



ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

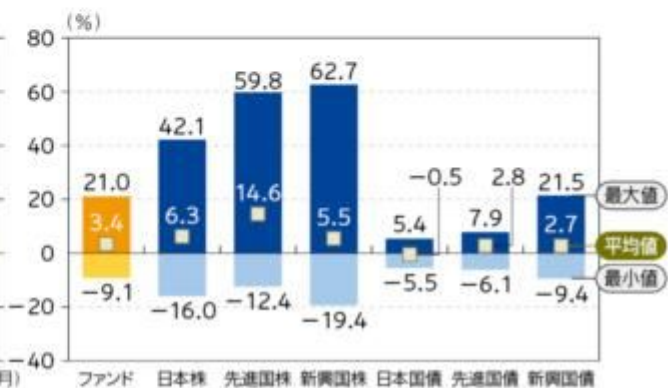
2018年8月～2023年7月



ハッピーエイジング30



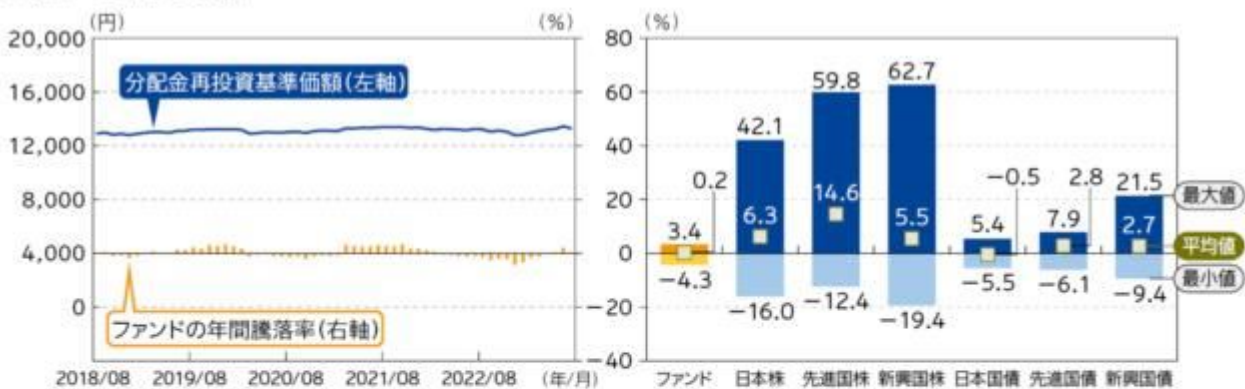
ハッピーエイジング40



ハッピーエイジング50



ハッピーエイジング60



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

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

代表的な資産クラスの指数

| | |
|---|---|
| 日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み) 日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社に帰属します。 | 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、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Index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。 |
| 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、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。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円換算しています。なお、MSCI Index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。 | 日本国債:NOMURA-BPI 国債 野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。 |
| 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、日本を除く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指数です。なお、FTSE 世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。 | 新興国債:J PモルガンG B I - E Mグローバル・ディバースィファイド(円ベース) J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、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。なお、J PモルガンG B I - E Mグローバル・ディバースィファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。 |

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

< 申込み時に受益者が負担する費用・税金 >

| 時期 | 項目 | 費用・税金 |
|----|----|-------|
|----|----|-------|

| | | | |
|------|----------------------------|---|---|
| 申込み時 | 申込手数料 及び 消費税等相 当額 | 申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準 価額に、2.2%（税抜 2.0%）を上限として販売 会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。 申込手数料率の詳細につきましては、販売会社 までお問い合わせください。 | 販売会社によるファ ンドの商品説明・投 資環境の説明・事務 処理等の対価 |
|------|----------------------------|---|---|

- 1 基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きま
す。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産
総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総
口数で除した価額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されることが
あります。
- 2 税法が改正された場合は、上記の内容が変更になることがあります。
- 3 定時定額購入サービス契約を結ばれた場合および確定拠出年金制度に基づく申込みの場合、お申
込手数料はありません。

（2）【換金（解約）手数料】

換金（解約）手数料はかかりません。信託財産留保額はありせん。

（3）【信託報酬等】

委託会社及び受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し
て以下の率を乗じて得た金額とし、委託会社と受託会社との間の配分も下表のとおりです（下記 のとお
り、委託会社は販売会社への配分を一旦収受します。）。

・運用管理費用（信託報酬）＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

| ファンド名 | 信託報酬率 （年率） | 内訳（税抜 年率） | | |
|---------------------|----------------------|-----------|--------|--------|
| | | 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 |
| ハッピー エイジング 20 | 1.617% (税抜1.470%) | 0.590% | 0.830% | 0.050% |
| ハッピー エイジング 30 | 1.485% (税抜1.350%) | 0.530% | 0.770% | 0.050% |
| ハッピー エイジング 40 | 1.320% (税抜1.200%) | 0.470% | 0.680% | 0.050% |
| ハッピー エイジング 50 | 1.133% (税抜1.030%) | 0.410% | 0.570% | 0.050% |
| ハッピー エイジング 60 | 0.946% (税抜0.860%) | 0.350% | 0.460% | 0.050% |

信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。毎計算期間の最初の6ヵ月終了
日および毎計算期末、または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬に対する消費税等相当額を信託報酬支弁のときに信託財産の中から支弁します。（税額は、税法改正時には変更となります。）

信託報酬の販売会社への配分は、販売会社の行う業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、取扱残高に応じて支払います。委託会社は、信託報酬を収受したときは、販売会社に対して代行手数料を遅滞なく支払うものとします。なお、販売会社への配分には、消費税等相当額が含まれています。

委託会社の報酬には、損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託したTCWへの投資顧問報酬が含まれます。投資顧問報酬の額は、各ファンドの純資産総額に当該計算期間を通じて毎日、年0.082%以内の率を乗じて得た金額とします。〔ファンドの運用の対価〕

（４）【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

| | |
|------|----------------------|
| 監査費用 | 監査法人に支払うファンド監査にかかる費用 |
|------|----------------------|

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

個人の受益者に対する課税

< 収益分配時 >

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率が適用されます。

< 一部解約時および償還時 >

一部解約時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得等として課税対象となり、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率が適用されます。

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。

（注1） 個別元本について

- ・追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- ・受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ・ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合等については個別元本の計算方法が異なる場合があります。受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記＜収益分配金の課税について＞をご参照ください。）

（注2） 収益分配金の課税について

- ・追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

配当控除、益金不算入制度の適用はありません。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。

ハッピーエイジング20、30および40は非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「つみたてNISA（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によってはつみたてNISAでの取扱い対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

- ・少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」および非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「つみたてNISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

（注）上記は2023年12月末までの制度となります。2024年1月1日以降は一定額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

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

上記は2023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。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

ハッピーエイジング20

2023年7月31日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 1,013,385,514 | 4.92 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 19,170,617,455 | 92.98 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 434,084,330 | 2.10 |
| 純資産総額 | | 20,618,087,299 | 100.00 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ハッピーエイジング30

2023年7月31日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 1,055,673,342 | 4.87 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 20,163,997,173 | 93.03 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 455,010,443 | 2.10 |
| 純資産総額 | | 21,674,680,958 | 100.00 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ハッピーエイジング40

2023年7月31日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 1,291,551,170 | 5.14 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 23,379,528,528 | 92.99 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 471,475,118 | 1.87 |
| 純資産総額 | | 25,142,554,816 | 100.00 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ハッピーエイジング50

2023年7月31日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 341,119,362 | 3.22 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 10,083,168,126 | 95.09 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 179,904,268 | 1.69 |
| 純資産総額 | | 10,604,191,756 | 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

2023年7月31日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|----|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 5,310,485,005 | 97.99 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 109,161,512 | 2.01 |
| 純資産総額 | | 5,419,646,517 | 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

2023年7月31日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|----|----------------|---------|
| 株式 | 日本 | 34,356,198,920 | 99.12 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 304,344,911 | 0.88 |
| 純資産総額 | | 34,660,543,831 | 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

2023年7月31日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|----|----------------|---------|
| 株式 | 日本 | 16,689,842,050 | 99.85 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 25,837,359 | 0.15 |
| 純資産総額 | | 16,715,679,409 | 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

2023年7月31日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|------|----------------|---------|
| 国債証券 | 日本 | 22,014,751,500 | 78.99 |
| 地方債証券 | 日本 | 987,563,000 | 3.54 |
| 特殊債券 | 日本 | 853,207,688 | 3.06 |
| 社債券 | 日本 | 3,373,838,000 | 12.11 |
| | フランス | 100,352,000 | 0.36 |
| | イギリス | 99,557,000 | 0.36 |
| | | 3,573,747,000 | 12.82 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 440,716,916 | 1.59 |
| 純資産総額 | | 27,869,986,104 | 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

2023年7月31日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-------|---------|---------------|---------|
| 国債証券 | アメリカ | 6,193,687,895 | 48.18 |
| | フランス | 1,013,837,890 | 7.89 |
| | イタリア | 940,106,225 | 7.31 |
| | ドイツ | 860,440,949 | 6.69 |
| | 中国 | 704,768,527 | 5.48 |
| | スペイン | 631,491,594 | 4.91 |
| | イギリス | 570,100,019 | 4.43 |
| | カナダ | 226,705,767 | 1.76 |
| | ベルギー | 222,134,601 | 1.73 |
| | オーストラリア | 195,778,380 | 1.52 |
| | オランダ | 180,515,391 | 1.40 |
| | メキシコ | 132,673,548 | 1.03 |
| | オーストリア | 117,969,518 | 0.92 |
| | アイルランド | 71,737,405 | 0.56 |
| | ポーランド | 68,263,437 | 0.53 |
| | マレーシア | 59,661,647 | 0.46 |
| | フィンランド | 47,559,470 | 0.37 |
| | シンガポール | 42,021,120 | 0.33 |

| | | | |
|-----------------------|--------|----------------|--------|
| | デンマーク | 36,935,891 | 0.29 |
| | スウェーデン | 27,192,287 | 0.21 |
| | ノルウェー | 24,581,995 | 0.19 |
| | | 12,368,163,556 | 96.21 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 486,939,860 | 3.79 |
| 純資産総額 | | 12,855,103,416 | 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 - T C W外国株式マザーファンド

2023年7月31日現在

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|---------|----------------|---------|
| 株式 | アメリカ | 15,814,604,561 | 73.99 |
| | ドイツ | 659,305,389 | 3.08 |
| | アイルランド | 561,312,589 | 2.63 |
| | フランス | 434,047,534 | 2.03 |
| | イギリス | 421,401,823 | 1.97 |
| | カナダ | 358,998,036 | 1.68 |
| | スイス | 275,466,288 | 1.29 |
| | シンガポール | 264,075,979 | 1.24 |
| | オランダ | 220,420,888 | 1.03 |
| | オーストラリア | 214,211,111 | 1.00 |
| | スウェーデン | 72,892,219 | 0.34 |
| | ベルギー | 54,808,077 | 0.26 |
| | スペイン | 52,882,409 | 0.25 |
| | バミューダ | 38,878,382 | 0.18 |
| | デンマーク | 37,436,241 | 0.18 |
| | プエルトリコ | 23,813,357 | 0.11 |
| | ノルウェー | 22,001,524 | 0.10 |
| | ケイマン | 15,879,692 | 0.07 |
| | フィンランド | 11,249,639 | 0.05 |
| | 香港 | 5,380,608 | 0.03 |
| | | 19,559,066,346 | 91.51 |
| 投資証券 | アメリカ | 848,924,282 | 3.97 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 964,659,213 | 4.52 |
| 純資産総額 | | 21,372,649,841 | 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

2023年7月31日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 (円) | 簿価金額 (円) | 評価単価 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|------|---------------|--------------------------------|---------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン-TTCW外国株式マ ザーファンド | 1,593,282,662 | 4.1319 | 6,583,366,132 | 4.2177 | 6,719,988,283 | 32.59 |
| 2 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | SJAMスモールキャップ・マ ザーファンド | 1,414,955,481 | 3.6388 | 5,148,760,668 | 3.8566 | 5,456,917,308 | 26.47 |
| 3 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | SJAMラージキャップ・バ リユー・マザーファンド | 1,740,296,919 | 2.9613 | 5,153,541,267 | 3.0886 | 5,375,081,064 | 26.07 |
| 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 | 665,235,740 | 1.8227 | 1,212,530,640 | 1.8308 | 1,217,913,592 | 5.91 |
| 5 | アメリカ | 投資信託受 益証券 | ISHARES CORE MSCI EMERGING | 137,793 | 7,202.15 | 992,406,860 | 7,354.40 | 1,013,385,514 | 4.92 |
| 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 | 287,974,997 | 1.4000 | 403,171,809 | 1.3915 | 400,717,208 | 1.94 |

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 4.92 |
| 親投資信託受益証券 | 92.98 |
| 合計 | 97.89 |

(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

2023年7月31日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 (円) | 簿価金額 (円) | 評価単価 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|----|---------------|--------------------------------|---------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | SJAMスモールキャップ・マ ザーファンド | 1,265,571,641 | 3.6387 | 4,605,035,531 | 3.8566 | 4,880,803,590 | 22.52 |
| 2 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | SJAMラージキャップ・バ リユー・マザーファンド | 1,553,631,197 | 2.9613 | 4,600,768,064 | 3.0886 | 4,798,545,315 | 22.14 |
| 3 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン-TTCW外国株式マ ザーファンド | 1,069,562,121 | 4.1319 | 4,419,323,728 | 4.2177 | 4,511,092,157 | 20.81 |
| 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 | 2,339,169,197 | 1.8228 | 4,264,056,739 | 1.8308 | 4,282,550,965 | 19.76 |
| 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 | 1,215,239,056 | 1.4000 | 1,701,352,232 | 1.3915 | 1,691,005,146 | 7.80 |

| | | | | | | | | | |
|---|------|----------|----------------------------|---------|----------|---------------|----------|---------------|------|
| 6 | アメリカ | 投資信託受益証券 | ISHARES CORE MSCI EMERGING | 143,543 | 7,202.15 | 1,033,819,265 | 7,354.40 | 1,055,673,342 | 4.87 |
|---|------|----------|----------------------------|---------|----------|---------------|----------|---------------|------|

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|-----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 4.87 |
| 親投資信託受益証券 | 93.03 |
| 合計 | 97.90 |

（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

2023年7月31日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 （円） | 簿価金額 （円） | 評価単価 （円） | 評価金額 （円） | 投資 比率 （%） |
|----|------|---------------|----------------------------|---------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン日本債券マザーファンド | 5,854,966,678 | 1.4000 | 8,197,014,370 | 1.3915 | 8,147,186,132 | 32.40 |
| 2 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | SJAMスモールキャップ・マザーファンド | 1,042,282,608 | 3.6387 | 3,792,553,726 | 3.8566 | 4,019,667,106 | 15.99 |
| 3 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | SJAMラージキャップ・パリュウ・マザーファンド | 1,278,526,155 | 2.9613 | 3,786,099,503 | 3.0886 | 3,948,855,882 | 15.71 |
| 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 | 2,049,013,557 | 1.8229 | 3,735,301,430 | 1.8308 | 3,751,334,020 | 14.92 |
| 5 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド | 832,796,403 | 4.1319 | 3,441,031,458 | 4.2177 | 3,512,485,388 | 13.97 |
| 6 | アメリカ | 投資信託受益証券 | ISHARES CORE MSCI EMERGING | 175,616 | 7,202.15 | 1,264,814,055 | 7,354.40 | 1,291,551,170 | 5.14 |

（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

2023年7月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|-----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 5.14 |
| 親投資信託受益証券 | 92.99 |
| 合計 | 98.12 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

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

2023年7月31日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 (円) | 簿価金額 (円) | 評価単価 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|------|---------------|----------------------------|---------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン日本債券マザーファンド | 4,300,371,551 | 1.4000 | 6,020,530,953 | 1.3915 | 5,983,967,013 | 56.43 |
| 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 | 638,904,504 | 1.8231 | 1,164,809,671 | 1.8308 | 1,169,706,365 | 11.03 |
| 3 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | SJAMスモールキャップ・マザーファンド | 271,363,996 | 3.6387 | 987,412,173 | 3.8566 | 1,046,542,386 | 9.87 |
| 4 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド | 333,234,261 | 2.9613 | 986,806,618 | 3.0886 | 1,029,227,338 | 9.71 |
| 5 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド | 202,414,829 | 4.1319 | 836,362,940 | 4.2177 | 853,725,024 | 8.05 |
| 6 | アメリカ | 投資信託受 益証券 | ISHARES CORE MSCI EMERGING | 46,383 | 7,202.15 | 334,057,662 | 7,354.40 | 341,119,362 | 3.22 |

（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投資比率

2023年7月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|-----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 3.22 |
| 親投資信託受益証券 | 95.09 |
| 合計 | 98.30 |

（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

2023年7月31日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 (円) | 簿価金額 (円) | 評価単価 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|----|---------------|----------------------------|---------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン日本債券マザーファンド | 2,787,452,989 | 1.4000 | 3,902,446,804 | 1.3915 | 3,878,740,834 | 71.57 |
| 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 | 476,825,635 | 1.8232 | 869,367,303 | 1.8308 | 872,972,372 | 16.11 |
| 3 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | SJAMスモールキャップ・マザーファンド | 58,842,011 | 3.6387 | 214,108,426 | 3.8566 | 226,930,099 | 4.19 |
| 4 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド | 71,996,498 | 2.9613 | 213,203,230 | 3.0886 | 222,368,383 | 4.10 |

| | | | | | | | | | |
|---|----|---------------|-----------------------------|------------|--------|-------------|--------|-------------|------|
| 5 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 損保ジャパン - TCW外国株式マ ザーファンド | 25,955,691 | 4.1319 | 107,246,320 | 4.2177 | 109,473,317 | 2.02 |
|---|----|---------------|-----------------------------|------------|--------|-------------|--------|-------------|------|

（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

2023年7月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 97.99 |
| 合計 | 97.99 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）S J A M ラージキャップ・バリュース・マザーファンド

2023年7月31日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価単価 （円） | 簿価金額 （円） | 評価単価 （円） | 評価金額 （円） | 投資 比率 （%） |
|----|----|----|-----------------------------|-----------|-----------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 株式 | 三井住友フィナン シャルグループ | 銀行業 | 361,200 | 5,990.59 | 2,163,801,108 | 6,694.00 | 2,417,872,800 | 6.98 |
| 2 | 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナン シャル・グループ | 銀行業 | 2,084,400 | 996.39 | 2,076,875,316 | 1,146.00 | 2,388,722,400 | 6.89 |
| 3 | 日本 | 株式 | アイシン | 輸送用機 器 | 498,800 | 3,719.69 | 1,855,381,372 | 4,615.00 | 2,301,962,000 | 6.64 |
| 4 | 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機 器 | 364,900 | 3,479.06 | 1,269,508,994 | 4,513.00 | 1,646,793,700 | 4.75 |
| 5 | 日本 | 株式 | 三井住友トラスト・ ホールディングス | 銀行業 | 289,800 | 4,957.37 | 1,436,645,826 | 5,527.00 | 1,601,724,600 | 4.62 |
| 6 | 日本 | 株式 | キリンホールディン グス | 食料品 | 741,200 | 2,008.95 | 1,489,033,740 | 2,102.50 | 1,558,373,000 | 4.50 |
| 7 | 日本 | 株式 | マキタ | 機械 | 346,300 | 3,468.27 | 1,201,061,901 | 3,987.00 | 1,380,698,100 | 3.98 |
| 8 | 日本 | 株式 | 日本精工 | 機械 | 1,469,800 | 746.36 | 1,096,999,928 | 918.90 | 1,350,599,220 | 3.90 |
| 9 | 日本 | 株式 | 東レ | 繊維製品 | 1,634,700 | 801.72 | 1,310,571,684 | 795.20 | 1,299,913,440 | 3.75 |
| 10 | 日本 | 株式 | 三菱地所 | 不動産業 | 683,000 | 1,627.93 | 1,111,876,190 | 1,737.00 | 1,186,371,000 | 3.42 |
| 11 | 日本 | 株式 | コンコルディア・ フィナンシャルグ ループ | 銀行業 | 1,782,300 | 549.98 | 980,245,072 | 649.50 | 1,157,603,850 | 3.34 |
| 12 | 日本 | 株式 | 旭化成 | 化学 | 1,184,800 | 962.96 | 1,140,915,008 | 968.40 | 1,147,360,320 | 3.31 |
| 13 | 日本 | 株式 | 京セラ | 電気機器 | 137,300 | 6,733.89 | 924,563,097 | 7,644.00 | 1,049,521,200 | 3.03 |
| 14 | 日本 | 株式 | 鹿島建設 | 建設業 | 442,900 | 1,610.80 | 713,423,320 | 2,246.00 | 994,753,400 | 2.87 |
| 15 | 日本 | 株式 | 住友重機械工業 | 機械 | 269,100 | 2,999.77 | 807,238,107 | 3,493.00 | 939,966,300 | 2.71 |
| 16 | 日本 | 株式 | 日揮ホールディン グス | 建設業 | 439,100 | 1,759.46 | 772,578,886 | 1,991.00 | 874,248,100 | 2.52 |
| 17 | 日本 | 株式 | 王子ホールディン グス | パルプ・ 紙 | 1,444,000 | 537.96 | 776,823,010 | 561.00 | 810,084,000 | 2.34 |
| 18 | 日本 | 株式 | ヤマトホールディン グス | 陸運業 | 283,800 | 2,333.80 | 662,332,440 | 2,662.00 | 755,475,600 | 2.18 |
| 19 | 日本 | 株式 | 日本ハム | 食料品 | 183,700 | 3,812.08 | 700,279,096 | 4,104.00 | 753,904,800 | 2.18 |

| | | | | | | | | | | |
|----|----|----|----------------|---------|-----------|----------|-------------|----------|-------------|------|
| 20 | 日本 | 株式 | 総合警備保障 | サービス業 | 861,200 | 702.15 | 604,691,580 | 868.60 | 748,038,320 | 2.16 |
| 21 | 日本 | 株式 | 第一生命ホールディングス | 保険業 | 236,100 | 2,848.90 | 672,625,398 | 2,905.50 | 685,988,550 | 1.98 |
| 22 | 日本 | 株式 | スズケン | 卸売業 | 163,900 | 3,484.82 | 571,161,998 | 4,149.00 | 680,021,100 | 1.96 |
| 23 | 日本 | 株式 | 住友電気工業 | 非鉄金属 | 370,300 | 1,671.54 | 618,971,262 | 1,820.00 | 673,946,000 | 1.94 |
| 24 | 日本 | 株式 | パナソニックホールディングス | 電気機器 | 367,400 | 1,191.43 | 437,731,382 | 1,760.00 | 646,624,000 | 1.87 |
| 25 | 日本 | 株式 | 大阪瓦斯 | 電気・ガス業 | 264,200 | 2,234.85 | 590,447,617 | 2,238.00 | 591,279,600 | 1.71 |
| 26 | 日本 | 株式 | JFEホールディングス | 鉄鋼 | 255,200 | 1,746.81 | 445,785,912 | 2,297.00 | 586,194,400 | 1.69 |
| 27 | 日本 | 株式 | 日本テレビホールディングス | 情報・通信業 | 393,100 | 1,082.66 | 425,593,646 | 1,349.00 | 530,291,900 | 1.53 |
| 28 | 日本 | 株式 | ENEOSホールディングス | 石油・石炭製品 | 1,005,800 | 483.10 | 485,901,980 | 515.40 | 518,389,320 | 1.50 |
| 29 | 日本 | 株式 | アルプスアルパイン | 電気機器 | 378,000 | 1,421.60 | 537,364,800 | 1,255.50 | 474,579,000 | 1.37 |
| 30 | 日本 | 株式 | SUBARU | 輸送用機器 | 169,900 | 2,203.42 | 374,361,058 | 2,686.50 | 456,436,350 | 1.32 |

(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

2023年7月31日現在

| 種類 | 国内/外国 | 業種 | 投資比率(%) |
|--------|-------|---------|---------|
| 株式 | 国内 | 建設業 | 6.46 |
| | | 食料品 | 6.67 |
| | | 繊維製品 | 3.75 |
| | | パルプ・紙 | 2.34 |
| | | 化学 | 4.29 |
| | | 医薬品 | 1.09 |
| | | 石油・石炭製品 | 1.50 |
| | | 鉄鋼 | 1.69 |
| | | 非鉄金属 | 1.94 |
| | | 機械 | 11.26 |
| | | 電気機器 | 7.06 |
| | | 輸送用機器 | 12.71 |
| | | 電気・ガス業 | 1.71 |
| | | 陸運業 | 2.18 |
| | | 情報・通信業 | 1.53 |
| | | 卸売業 | 1.96 |
| | | 銀行業 | 21.83 |
| | | 保険業 | 1.98 |
| その他金融業 | 1.09 | | |
| 不動産業 | 3.93 | | |
| サービス業 | 2.16 | | |

| | |
|----|-------|
| 合計 | 99.12 |
|----|-------|

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

（参考）S J A M スモールキャップ・マザーファンド

2023年7月31日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価単価 （円） | 簿価金額 （円） | 評価単価 （円） | 評価金額 （円） | 投資 比率 （%） |
|----|----|----|--------------------|--------|-----------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 株式 | めぶきフィナンシャルグループ | 銀行業 | 1,626,000 | 276.99 | 450,389,037 | 377.40 | 613,652,400 | 3.67 |
| 2 | 日本 | 株式 | 八十二銀行 | 銀行業 | 818,000 | 485.87 | 397,445,550 | 731.90 | 598,694,200 | 3.58 |
| 3 | 日本 | 株式 | 豊田合成 | 輸送用機器 | 197,400 | 2,282.05 | 450,476,712 | 3,028.00 | 597,727,200 | 3.58 |
| 4 | 日本 | 株式 | ジェイテクト | 機械 | 425,800 | 1,003.70 | 427,378,156 | 1,338.50 | 569,933,300 | 3.41 |
| 5 | 日本 | 株式 | いよぎんホールディングス | 銀行業 | 512,000 | 635.97 | 325,621,278 | 1,003.50 | 513,792,000 | 3.07 |
| 6 | 日本 | 株式 | E I Z O | 電気機器 | 101,000 | 3,794.73 | 383,268,297 | 5,050.00 | 510,050,000 | 3.05 |
| 7 | 日本 | 株式 | 日本テレビホールディングス | 情報・通信業 | 348,400 | 1,165.60 | 406,095,990 | 1,349.00 | 469,991,600 | 2.81 |
| 8 | 日本 | 株式 | 森永乳業 | 食料品 | 97,000 | 4,105.44 | 398,228,270 | 4,797.00 | 465,309,000 | 2.78 |
| 9 | 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 | 282,600 | 779.05 | 220,159,838 | 1,512.00 | 427,291,200 | 2.56 |
| 10 | 日本 | 株式 | エン・ジャパン | サービス業 | 150,900 | 2,357.26 | 355,710,884 | 2,807.00 | 423,576,300 | 2.53 |
| 11 | 日本 | 株式 | 東邦ホールディングス | 卸売業 | 143,200 | 1,881.48 | 269,427,939 | 2,774.00 | 397,236,800 | 2.38 |
| 12 | 日本 | 株式 | 群馬銀行 | 銀行業 | 658,100 | 386.13 | 254,115,348 | 601.70 | 395,978,770 | 2.37 |
| 13 | 日本 | 株式 | マブチモーター | 電気機器 | 96,700 | 3,887.68 | 375,938,987 | 4,082.00 | 394,729,400 | 2.36 |
| 14 | 日本 | 株式 | ほくほくフィナンシャルグループ | 銀行業 | 295,200 | 821.46 | 242,495,362 | 1,271.00 | 375,199,200 | 2.24 |
| 15 | 日本 | 株式 | 第四北越フィナンシャルグループ | 銀行業 | 101,600 | 2,602.78 | 264,442,559 | 3,550.00 | 360,680,000 | 2.16 |
| 16 | 日本 | 株式 | 北洋銀行 | 銀行業 | 1,064,600 | 228.85 | 243,635,261 | 310.00 | 330,026,000 | 1.97 |
| 17 | 日本 | 株式 | ケーズホールディングス | 小売業 | 238,500 | 1,210.76 | 288,766,785 | 1,305.00 | 311,242,500 | 1.86 |
| 18 | 日本 | 株式 | 総合警備保障 | サービス業 | 350,000 | 720.82 | 252,289,962 | 868.60 | 304,010,000 | 1.82 |
| 19 | 日本 | 株式 | 九州フィナンシャルグループ | 銀行業 | 435,200 | 412.67 | 179,593,984 | 691.00 | 300,723,200 | 1.80 |
| 20 | 日本 | 株式 | 日本ライフライン | 卸売業 | 299,000 | 980.96 | 293,309,489 | 996.00 | 297,804,000 | 1.78 |
| 21 | 日本 | 株式 | トラスコ中山 | 卸売業 | 133,500 | 1,971.21 | 263,157,799 | 2,189.00 | 292,231,500 | 1.75 |
| 22 | 日本 | 株式 | 東洋インキSCホールディングス | 化学 | 125,800 | 1,886.83 | 237,363,826 | 2,192.00 | 275,753,600 | 1.65 |
| 23 | 日本 | 株式 | 東亜合成 | 化学 | 194,200 | 1,101.48 | 213,908,688 | 1,346.50 | 261,490,300 | 1.56 |
| 24 | 日本 | 株式 | ひろぎんホールディングス | 銀行業 | 290,300 | 646.28 | 187,617,012 | 878.60 | 255,057,580 | 1.53 |
| 25 | 日本 | 株式 | サワイグループホールディングス | 医薬品 | 68,000 | 3,862.87 | 262,675,202 | 3,545.00 | 241,060,000 | 1.44 |
| 26 | 日本 | 株式 | 青山商事 | 小売業 | 182,900 | 944.00 | 172,658,310 | 1,297.00 | 237,221,300 | 1.42 |
| 27 | 日本 | 株式 | 百五銀行 | 銀行業 | 464,500 | 331.42 | 153,945,966 | 475.00 | 220,637,500 | 1.32 |
| 28 | 日本 | 株式 | 東邦瓦斯 | 電気・ガス業 | 78,000 | 2,490.62 | 194,268,470 | 2,663.50 | 207,753,000 | 1.24 |
| 29 | 日本 | 株式 | 共英製鋼 | 鉄鋼 | 95,100 | 1,489.17 | 141,620,424 | 2,137.00 | 203,228,700 | 1.22 |
| 30 | 日本 | 株式 | ちゅうぎんフィナンシャルグループ | 銀行業 | 212,900 | 900.99 | 191,821,326 | 954.50 | 203,213,050 | 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

2023年7月31日現在

| 種類 | 国内/外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|-------|-------|----------|-------------|
| 株式 | 国内 | 建設業 | 1.20 |
| | | 食料品 | 2.78 |
| | | 繊維製品 | 0.73 |
| | | パルプ・紙 | 1.22 |
| | | 化学 | 7.58 |
| | | 医薬品 | 2.86 |
| | | ガラス・土石製品 | 0.51 |
| | | 鉄鋼 | 1.22 |
| | | 非鉄金属 | 0.16 |
| | | 金属製品 | 1.18 |
| | | 機械 | 4.65 |
| | | 電気機器 | 9.52 |
| | | 輸送用機器 | 4.96 |
| | | 精密機器 | 1.48 |
| | | その他製品 | 1.37 |
| | | 電気・ガス業 | 1.78 |
| | | 陸運業 | 0.26 |
| | | 情報・通信業 | 3.21 |
| | | 卸売業 | 6.77 |
| | | 小売業 | 6.60 |
| 銀行業 | 30.72 | | |
| 不動産業 | 1.13 | | |
| サービス業 | 7.97 | | |
| 合計 | | | 99.85 |

（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

2023年7月31日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 (円) | 簿価金額 (円) | 評価単価 (円) | 評価金額 (円) | 利率(%) | 償還日 | 投資 比率 (%) |
|----|----|------|----------------|---------------|-------------|---------------|-------------|---------------|----------|-----------|-----------------|
| 1 | 日本 | 国債証券 | 第360回利付国債(10年) | 1,410,000,000 | 98.45 | 1,388,243,700 | 97.98 | 1,381,602,600 | 0.100000 | 2030/9/20 | 4.96 |
| 2 | 日本 | 国債証券 | 第364回利付国債(10年) | 1,200,000,000 | 97.51 | 1,170,120,000 | 97.06 | 1,164,744,000 | 0.100000 | 2031/9/20 | 4.18 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|----|-------|--------------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|-----------|------------|------|
| 3 | 日本 | 国債証券 | 第351回利付国債(10年) | 950,000,000 | 99.85 | 948,603,500 | 99.66 | 946,770,000 | 0.1000000 | 2028/6/20 | 3.40 |
| 4 | 日本 | 国債証券 | 第151回利付国債(20年) | 860,000,000 | 106.13 | 912,718,000 | 105.10 | 903,911,600 | 1.2000000 | 2034/12/20 | 3.24 |
| 5 | 日本 | 国債証券 | 第352回利付国債(10年) | 850,000,000 | 99.76 | 848,028,000 | 99.49 | 845,673,500 | 0.1000000 | 2028/9/20 | 3.03 |
| 6 | 日本 | 国債証券 | 第154回利付国債(20年) | 780,000,000 | 105.84 | 825,591,000 | 104.83 | 817,681,800 | 1.2000000 | 2035/9/20 | 2.93 |
| 7 | 日本 | 国債証券 | 第150回利付国債(5年) | 800,000,000 | 100.06 | 800,544,000 | 99.91 | 799,320,000 | 0.0050000 | 2026/12/20 | 2.87 |
| 8 | 日本 | 国債証券 | 第183回利付国債(20年) | 700,000,000 | 105.47 | 738,303,500 | 103.47 | 724,290,000 | 1.4000000 | 2042/12/20 | 2.60 |
| 9 | 日本 | 国債証券 | 第369回利付国債(10年) | 700,000,000 | 100.40 | 702,842,000 | 99.50 | 696,563,000 | 0.5000000 | 2032/12/20 | 2.50 |
| 10 | 日本 | 国債証券 | 第368回利付国債(10年) | 700,000,000 | 97.71 | 683,977,000 | 96.99 | 678,979,000 | 0.2000000 | 2032/9/20 | 2.44 |
| 11 | 日本 | 国債証券 | 第148回利付国債(5年) | 620,000,000 | 100.11 | 620,719,200 | 99.98 | 619,907,000 | 0.0050000 | 2026/6/20 | 2.22 |
| 12 | 日本 | 国債証券 | 第366回利付国債(10年) | 540,000,000 | 97.99 | 529,173,000 | 97.47 | 526,370,400 | 0.2000000 | 2032/3/20 | 1.89 |
| 13 | 日本 | 国債証券 | 第158回利付国債(5年) | 520,000,000 | 100.00 | 520,000,000 | 99.79 | 518,918,400 | 0.1000000 | 2028/3/20 | 1.86 |
| 14 | 日本 | 国債証券 | 第154回利付国債(5年) | 450,000,000 | 100.24 | 451,120,500 | 100.08 | 450,369,000 | 0.1000000 | 2027/9/20 | 1.62 |
| 15 | 日本 | 国債証券 | 第367回利付国債(10年) | 450,000,000 | 97.85 | 440,347,500 | 97.24 | 437,584,500 | 0.2000000 | 2032/6/20 | 1.57 |
| 16 | 日本 | 国債証券 | 第365回利付国債(10年) | 450,000,000 | 97.31 | 437,926,500 | 96.85 | 435,861,000 | 0.1000000 | 2031/12/20 | 1.56 |
| 17 | 日本 | 国債証券 | 第159回利付国債(20年) | 450,000,000 | 97.69 | 439,623,000 | 96.70 | 435,168,000 | 0.6000000 | 2036/12/20 | 1.56 |
| 18 | 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 | 99.99 | 399,968,000 | 99.99 | 399,960,000 | 0.0010000 | 2024/8/28 | 1.44 |
| 19 | 日本 | 国債証券 | 第166回利付国債(20年) | 410,000,000 | 98.50 | 403,854,100 | 96.30 | 394,866,900 | 0.7000000 | 2038/9/20 | 1.42 |
| 20 | 日本 | 国債証券 | 第357回利付国債(10年) | 400,000,000 | 99.08 | 396,332,000 | 98.68 | 394,736,000 | 0.1000000 | 2029/12/20 | 1.42 |
| 21 | 日本 | 地方債証券 | 第807回東京都公募債 | 400,000,000 | 97.58 | 390,340,000 | 97.20 | 388,812,000 | 0.1000000 | 2030/6/20 | 1.40 |
| 22 | 日本 | 国債証券 | 第449回利付国債(2年) | 380,000,000 | 100.09 | 380,353,400 | 100.02 | 380,102,600 | 0.0050000 | 2025/6/1 | 1.36 |
| 23 | 日本 | 国債証券 | 第150回利付国債(20年) | 320,000,000 | 108.37 | 346,803,200 | 107.34 | 343,494,400 | 1.4000000 | 2034/9/20 | 1.23 |
| 24 | 日本 | 特殊債券 | 第3回地方公共団体金融機構債券(15年) | 300,000,000 | 104.42 | 313,263,000 | 104.13 | 312,393,000 | 1.1760000 | 2029/1/26 | 1.12 |
| 25 | 日本 | 国債証券 | 第158回利付国債(20年) | 320,000,000 | 96.65 | 309,296,000 | 95.69 | 306,220,800 | 0.5000000 | 2036/9/20 | 1.10 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|----|-------|------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|-----------|------------|------|
| 26 | 日本 | 地方債証券 | 第135回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 100.60 | 301,815,000 | 100.57 | 301,719,000 | 0.6590000 | 2024/6/25 | 1.08 |
| 27 | 日本 | 国債証券 | 第156回利付国債（5年） | 300,000,000 | 100.59 | 301,785,000 | 100.39 | 301,176,000 | 0.2000000 | 2027/12/20 | 1.08 |
| 28 | 日本 | 国債証券 | 第147回利付国債（5年） | 300,000,000 | 100.12 | 300,360,000 | 100.01 | 300,039,000 | 0.0050000 | 2026/3/20 | 1.08 |
| 29 | 日本 | 国債証券 | 第350回利付国債（10年） | 300,000,000 | 100.02 | 300,069,000 | 99.81 | 299,445,000 | 0.1000000 | 2028/3/20 | 1.07 |
| 30 | 日本 | 国債証券 | 第145回利付国債（20年） | 270,000,000 | 111.39 | 300,763,800 | 110.57 | 298,549,800 | 1.7000000 | 2033/6/20 | 1.07 |

（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

2023年7月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|-------|---------|
| 国債証券 | 78.99 |
| 地方債証券 | 3.54 |
| 特殊債券 | 3.06 |
| 社債券 | 12.82 |
| 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。

（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

2023年7月31日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価（円） | 簿価金額（円） | 評価単価（円） | 評価金額（円） | 利率（%） | 償還日 | 投資比率（%） |
|----|------|------|-----------------------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|-----------|------------|---------|
| 1 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 4.125 250131 | 8,920,000 | 13,905.36 | 1,240,358,905 | 13,881.69 | 1,238,246,774 | 4.1250000 | 2025/1/31 | 9.63 |
| 2 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 1.75 291115 | 4,950,000 | 12,427.38 | 615,155,634 | 12,308.44 | 609,267,935 | 1.7500000 | 2029/11/15 | 4.74 |
| 3 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 4.125 321115 | 4,170,000 | 14,422.99 | 601,438,813 | 14,246.78 | 594,090,752 | 4.1250000 | 2032/11/15 | 4.62 |
| 4 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 3.125 290831 | 4,400,000 | 13,449.41 | 591,774,438 | 13,326.07 | 586,347,093 | 3.1250000 | 2029/8/31 | 4.56 |
| 5 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 2.75 280215 | 3,760,000 | 13,317.81 | 500,749,668 | 13,225.84 | 497,291,937 | 2.7500000 | 2028/2/15 | 3.87 |
| 6 | ドイツ | 国債証券 | GERMANY 0.0 261009 | 3,020,000 | 14,195.51 | 428,704,408 | 14,244.53 | 430,184,879 | 0.0000000 | 2026/10/9 | 3.35 |
| 7 | イタリア | 国債証券 | ITALY 1.45 250515 | 2,710,000 | 14,927.58 | 404,537,459 | 14,968.22 | 405,638,791 | 1.4500000 | 2025/5/15 | 3.16 |
| 8 | フランス | 国債証券 | FRANCE 0.0 250225 | 2,470,000 | 14,725.28 | 363,714,531 | 14,763.35 | 364,654,937 | 0.0000000 | 2025/2/25 | 2.84 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|------|------|--------------------------|------------|-----------|-------------|-----------|-------------|-----------|------------|------|
| 9 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 0.75 260331 | 2,520,000 | 12,804.59 | 322,675,704 | 12,756.13 | 321,454,551 | 0.7500000 | 2026/3/31 | 2.50 |
| 10 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 1.75 410815 | 2,730,000 | 9,850.82 | 268,927,642 | 9,688.38 | 264,492,868 | 1.7500000 | 2041/8/15 | 2.06 |
| 11 | スペイン | 国債証券 | SPAIN 0.0 280131 | 1,860,000 | 13,420.68 | 249,624,768 | 13,476.50 | 250,663,027 | 0.0000000 | 2028/1/31 | 1.95 |
| 12 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 4.0 521115 | 1,670,000 | 14,284.22 | 238,546,570 | 14,057.35 | 234,757,781 | 4.0000000 | 2052/11/15 | 1.83 |
| 13 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 1.5 270131 | 1,800,000 | 12,842.58 | 231,166,568 | 12,777.60 | 229,996,960 | 1.5000000 | 2027/1/31 | 1.79 |
| 14 | 中国 | 国債証券 | CGB 2.8 321115 | 11,000,000 | 1,985.62 | 218,418,501 | 1,985.30 | 218,383,797 | 2.8000000 | 2032/11/15 | 1.70 |
| 15 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 2.25 270215 | 1,460,000 | 13,177.94 | 192,397,948 | 13,108.00 | 191,376,907 | 2.2500000 | 2027/2/15 | 1.49 |
| 16 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 2.375 290515 | 1,310,000 | 12,925.73 | 169,327,160 | 12,811.74 | 167,833,924 | 2.3750000 | 2029/5/15 | 1.31 |
| 17 | スペイン | 国債証券 | SPAIN 0.5 311031 | 1,290,000 | 12,362.56 | 159,477,108 | 12,392.72 | 159,866,127 | 0.5000000 | 2031/10/31 | 1.24 |
| 18 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 3.0 480215 | 1,340,000 | 11,721.98 | 157,074,611 | 11,534.20 | 154,558,406 | 3.0000000 | 2048/2/15 | 1.20 |
| 19 | 中国 | 国債証券 | CGB 2.8 300325 | 7,500,000 | 1,993.04 | 149,478,557 | 1,992.63 | 149,447,782 | 2.8000000 | 2030/3/25 | 1.16 |
| 20 | イタリア | 国債証券 | ITALY 0.95 320601 | 1,190,000 | 12,055.47 | 143,460,101 | 12,139.08 | 144,455,053 | 0.9500000 | 2032/6/1 | 1.12 |
| 21 | 中国 | 国債証券 | CGB 2.6 320901 | 7,000,000 | 1,953.81 | 136,767,011 | 1,953.48 | 136,743,829 | 2.6000000 | 2032/9/1 | 1.06 |
| 22 | ベルギー | 国債証券 | BELGIUM 3.0 340622 | 880,000 | 15,263.13 | 134,315,610 | 15,245.67 | 134,161,950 | 3.0000000 | 2034/6/22 | 1.04 |
| 23 | メキシコ | 国債証券 | MEXICO 8.5 290531 | 16,000,000 | 835.64 | 133,703,796 | 829.20 | 132,673,548 | 8.5000000 | 2029/5/31 | 1.03 |
| 24 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 1.625 310515 | 1,090,000 | 12,023.74 | 131,058,873 | 11,891.03 | 129,612,332 | 1.6250000 | 2031/5/15 | 1.01 |
| 25 | フランス | 国債証券 | FRANCE 2.0 321125 | 880,000 | 14,311.05 | 125,937,324 | 14,316.52 | 125,985,445 | 2.0000000 | 2032/11/25 | 0.98 |
| 26 | 中国 | 国債証券 | CGB 2.8 290324 | 6,000,000 | 1,999.07 | 119,944,778 | 1,995.51 | 119,731,064 | 2.8000000 | 2029/3/24 | 0.93 |
| 27 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 2.875 490515 | 1,040,000 | 11,494.01 | 119,537,713 | 11,296.32 | 117,481,753 | 2.8750000 | 2049/5/15 | 0.91 |
| 28 | フランス | 国債証券 | FRA 0.75 281125 | 800,000 | 13,895.92 | 111,167,382 | 13,937.43 | 111,499,458 | 0.7500000 | 2028/11/25 | 0.87 |
| 29 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 2.0 510815 | 1,160,000 | 9,459.30 | 109,727,962 | 9,300.16 | 107,881,916 | 2.0000000 | 2051/8/15 | 0.84 |
| 30 | アメリカ | 国債証券 | Treasury 1.25 310815 | 900,000 | 11,600.83 | 104,407,558 | 11,472.53 | 103,252,814 | 1.2500000 | 2031/8/15 | 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

2023年7月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 96.21 |
| 合計 | 96.21 |

(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

2023年7月31日現在

| 順位 | 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価単価 （円） | 簿価金額 （円） | 評価単価 （円） | 評価金額 （円） | 投資 比率 （%） |
|----|--------|----|------------------------------|--------------------|--------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------|
| 1 | アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 18,264 | 48,737.55 | 890,142,761 | 47,700.01 | 871,193,145 | 4.08 |
| 2 | アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | ソフトウェア・サービス | 18,414 | 34,395.27 | 633,354,507 | 33,233.67 | 611,964,937 | 2.86 |
| 3 | アメリカ | 株式 | TRADE DESK INC/THE - CLASS A | ソフトウェア・サービス | 42,376 | 12,784.56 | 541,758,909 | 12,750.73 | 540,325,210 | 2.53 |
| 4 | アメリカ | 株式 | FISERV INC | ソフトウェア・サービス | 29,870 | 18,114.32 | 541,074,810 | 17,619.84 | 526,304,630 | 2.46 |
| 5 | アメリカ | 株式 | ORACLE CORPORATION | ソフトウェア・サービス | 29,811 | 16,759.92 | 499,630,073 | 16,351.11 | 487,442,949 | 2.28 |
| 6 | アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP | 半導体・半導体製造装置 | 7,031 | 65,496.07 | 460,502,880 | 65,903.47 | 463,367,333 | 2.17 |
| 7 | アメリカ | 株式 | S&P GLOBAL INC | 金融サービス | 7,945 | 58,839.46 | 467,479,576 | 55,282.79 | 439,221,808 | 2.06 |
| 8 | アメリカ | 株式 | MSCI INC | 金融サービス | 5,155 | 70,379.27 | 362,805,150 | 77,572.97 | 399,888,669 | 1.87 |
| 9 | アイルランド | 株式 | LINDE PLC | 素材 | 7,128 | 53,866.04 | 383,957,181 | 54,796.44 | 390,589,086 | 1.83 |
| 10 | アメリカ | 株式 | OTIS WORLDWIDE CORP | 資本財 | 28,708 | 12,481.48 | 358,318,437 | 12,694.34 | 364,429,357 | 1.71 |
| 11 | カナダ | 株式 | WASTE CONNECTIONS INC | 商業・専門サービス | 18,005 | 19,944.43 | 359,099,563 | 19,938.79 | 358,998,036 | 1.68 |
| 12 | アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC-CLASS A | ソフトウェア・サービス | 6,465 | 56,698.13 | 366,553,437 | 55,395.57 | 358,132,368 | 1.68 |
| 13 | アメリカ | 株式 | DANAHER CORP | ヘルスケア機器・サービス | 9,766 | 33,517.02 | 327,327,288 | 36,662.06 | 358,041,755 | 1.68 |
| 14 | アメリカ | 株式 | ALPHABET, INC | メディア・娯楽 | 19,000 | 17,629.70 | 334,964,456 | 18,750.41 | 356,257,974 | 1.67 |
| 15 | アメリカ | 株式 | SERVICENOW INC | ソフトウェア・サービス | 3,919 | 83,507.80 | 327,267,102 | 80,288.05 | 314,648,883 | 1.47 |
| 16 | アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | 一般消費財・サービス流通・小売り | 15,857 | 18,827.95 | 298,554,854 | 18,637.64 | 295,537,116 | 1.38 |
| 17 | アメリカ | 株式 | ROPER TECHNOLOGIES INC | 資本財 | 3,999 | 67,176.43 | 268,638,560 | 69,413.62 | 277,585,098 | 1.30 |
| 18 | アメリカ | 株式 | HEICO CORP | 資本財 | 10,959 | 24,447.01 | 267,914,864 | 24,564.02 | 269,197,123 | 1.26 |
| 19 | アメリカ | 株式 | MOTOROLA SOLUTIONS INC | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 6,253 | 41,091.34 | 256,944,183 | 41,029.31 | 256,556,329 | 1.20 |
| 20 | アメリカ | 株式 | SALESFORCE INC | ソフトウェア・サービス | 7,845 | 32,141.15 | 252,147,400 | 31,802.83 | 249,493,217 | 1.17 |
| 21 | アメリカ | 株式 | PEPSICO INC | 食品・飲料・タバコ | 9,106 | 26,168.26 | 238,288,185 | 26,828.00 | 244,295,774 | 1.14 |
| 22 | アメリカ | 株式 | FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 金融サービス | 3,947 | 59,221.49 | 233,747,249 | 61,534.81 | 242,877,914 | 1.14 |
| 23 | アメリカ | 株式 | LENNAR CORP-CL A | 耐久消費財・アパレル | 13,425 | 18,381.07 | 246,765,976 | 18,013.14 | 241,826,493 | 1.13 |

| | | | | | | | | | | |
|----|------|----|------------------------------|------------------------|--------|------------|-------------|------------|-------------|------|
| 24 | 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 | 1,183 | 187,273.00 | 221,543,966 | 184,460.65 | 218,216,954 | 1.02 |
| 25 | アメリカ | 株式 | FAIR ISAAC CORP | ソフトウェア・サービス | 1,847 | 118,025.72 | 217,993,510 | 116,296.02 | 214,798,751 | 1.01 |
| 26 | アメリカ | 株式 | BROADCOM INC | 半導体・半導体製造装置 | 1,684 | 128,332.03 | 216,111,154 | 126,843.39 | 213,604,279 | 1.00 |
| 27 | アメリカ | 株式 | JP MORGAN CHASE & CO | 銀行 | 9,601 | 21,621.97 | 207,592,616 | 22,119.60 | 212,370,305 | 0.99 |
| 28 | アメリカ | 株式 | GENERAL ELECTRIC CO. | 資本財 | 11,809 | 15,667.40 | 185,016,395 | 16,125.55 | 190,426,718 | 0.89 |
| 29 | アメリカ | 株式 | DARDEN RESTAURANTS | 消費者サービス | 8,049 | 23,859.17 | 192,042,480 | 23,615.29 | 190,079,505 | 0.89 |
| 30 | アメリカ | 株式 | MCKESSON HBOC INC | ヘルスケア機器・サービス | 3,252 | 58,033.11 | 188,723,706 | 56,795.40 | 184,698,652 | 0.86 |

（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

2023年7月31日現在

| 種類 | 国内/外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|--------------------|-------|------------------------|----------|
| 株式 | 外国 | エネルギー | 1.39 |
| | | | 0.65 |
| | | 素材 | 4.31 |
| | | 資本財 | 7.49 |
| | | 商業・専門サービス | 2.03 |
| | | 運輸 | 1.27 |
| | | 自動車・自動車部品 | 1.11 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 2.84 |
| | | 消費者サービス | 1.14 |
| | | メディア・娯楽 | 3.63 |
| | | 一般消費財・サービス流通・小売り | 3.66 |
| | | 生活必需品流通・小売り | 0.81 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 2.59 |
| | | 家庭用品・パーソナル用品 | 0.46 |
| | | ヘルスケア機器・サービス | 6.61 |
| | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 6.15 |
| | | 銀行 | 2.49 |
| | | 金融サービス | 8.65 |
| | | 保険 | 1.72 |
| | | エクイティ不動産投資信託（REIT） | 0.16 |
| ソフトウェア・サービス | 22.70 | | |
| テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 2.74 | | |
| 電気通信サービス | 0.48 | | |

| | | |
|------|-------------|-------|
| | 公益事業 | 0.97 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 4.86 |
| | 不動産管理・開発 | 0.60 |
| 投資証券 | | 3.97 |
| 合計 | | 95.49 |

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

【投資不動産物件】

ハッピーエイジング20

該当事項はありません。

ハッピーエイジング30

該当事項はありません。

ハッピーエイジング40

該当事項はありません。

ハッピーエイジング50

該当事項はありません。

ハッピーエイジング60

該当事項はありません。

（参考）S J A M ラージキャップ・バリュー・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）S J A M スモールキャップ・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン - T C W 外国株式マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

ハッピーエイジング20

該当事項はありません。

ハッピーエイジング30

該当事項はありません。

ハッピーエイジング40

該当事項はありません。

ハッピーエイジング50

該当事項はありません。

ハッピーエイジング60

該当事項はありません。

（参考）S J A Mラージキャップ・バリュー・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

ハッピーエイジング20

直近日（2023年7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 |
| 第21計算期間末（2021年7月15日） | 13,007,644,754 | 13,007,644,754 | 1.7449 | 1.7449 |
| 第22計算期間末（2022年7月15日） | 14,848,476,768 | 14,848,476,768 | 1.8338 | 1.8338 |
| 第23計算期間末（2023年7月18日） | 19,858,295,497 | 19,858,295,497 | 2.2346 | 2.2346 |
| 2022年7月末日 | 15,268,982,445 | | 1.8810 | |
| 8月末日 | 15,521,346,363 | | 1.9024 | |
| 9月末日 | 15,062,489,053 | | 1.8340 | |
| 10月末日 | 15,951,223,014 | | 1.9272 | |
| 11月末日 | 16,052,928,572 | | 1.9391 | |
| 12月末日 | 15,781,850,321 | | 1.8903 | |
| 2023年1月末日 | 16,503,815,135 | | 1.9555 | |
| 2月末日 | 17,178,080,688 | | 2.0160 | |
| 3月末日 | 17,249,378,905 | | 1.9895 | |
| 4月末日 | 17,910,147,139 | | 2.0539 | |
| 5月末日 | 18,293,158,970 | | 2.1013 | |
| 6月末日 | 19,857,872,703 | | 2.2480 | |
| 7月末日 | 20,618,087,299 | | 2.3126 | |

ハッピーエイジング30

直近日（2023年7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 |
| 第21計算期間末 | (2021年 7月15日) | 15,539,022,049 | 15,539,022,049 | 1.7142 | 1.7142 |
| 第22計算期間末 | (2022年 7月15日) | 17,096,530,694 | 17,096,530,694 | 1.7915 | 1.7915 |
| 第23計算期間末 | (2023年 7月18日) | 21,009,810,852 | 21,009,810,852 | 2.0822 | 2.0822 |
| | 2022年 7月末日 | 17,497,509,785 | | 1.8237 | |
| | 8月末日 | 17,657,624,295 | | 1.8357 | |
| | 9月末日 | 17,214,201,741 | | 1.7815 | |
| | 10月末日 | 17,981,824,448 | | 1.8528 | |
| | 11月末日 | 17,945,519,433 | | 1.8572 | |
| | 12月末日 | 17,566,732,810 | | 1.8095 | |
| | 2023年 1月末日 | 18,155,697,518 | | 1.8612 | |
| | 2月末日 | 18,703,826,783 | | 1.9094 | |
| | 3月末日 | 18,707,888,610 | | 1.8937 | |
| | 4月末日 | 19,364,900,108 | | 1.9450 | |
| | 5月末日 | 19,794,167,264 | | 1.9837 | |
| | 6月末日 | 21,162,470,052 | | 2.1014 | |
| | 7月末日 | 21,674,680,958 | | 2.1417 | |

ハッピーエイジング40

直近日（2023年7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 |
| 第21計算期間末 | (2021年 7月15日) | 19,994,471,155 | 19,994,471,155 | 1.6425 | 1.6425 |
| 第22計算期間末 | (2022年 7月15日) | 21,277,799,746 | 21,277,799,746 | 1.6752 | 1.6752 |
| 第23計算期間末 | (2023年 7月18日) | 24,582,794,992 | 24,582,794,992 | 1.8528 | 1.8528 |
| | 2022年 7月末日 | 21,650,140,843 | | 1.6974 | |
| | 8月末日 | 21,859,842,857 | | 1.7039 | |
| | 9月末日 | 21,421,502,790 | | 1.6623 | |
| | 10月末日 | 22,143,548,916 | | 1.7071 | |
| | 11月末日 | 22,024,375,116 | | 1.7077 | |
| | 12月末日 | 21,660,395,420 | | 1.6698 | |

| | | | |
|------------|----------------|--|--------|
| 2023年 1月末日 | 22,184,768,425 | | 1.7024 |
| 2月末日 | 22,630,595,960 | | 1.7369 |
| 3月末日 | 22,767,862,756 | | 1.7341 |
| 4月末日 | 23,287,517,844 | | 1.7682 |
| 5月末日 | 23,662,893,535 | | 1.7931 |
| 6月末日 | 24,810,145,750 | | 1.8702 |
| 7月末日 | 25,142,554,816 | | 1.8877 |

ハッピーエイジング50

直近日（2023年7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 |
| 第21計算期間末（2021年 7月15日） | 8,938,896,753 | 8,938,896,753 | 1.5168 | 1.5168 |
| 第22計算期間末（2022年 7月15日） | 9,555,136,567 | 9,555,136,567 | 1.5150 | 1.5150 |
| 第23計算期間末（2023年 7月18日） | 10,534,193,457 | 10,534,193,457 | 1.5977 | 1.5977 |
| 2022年 7月末日 | 9,705,200,527 | | 1.5288 | |
| 8月末日 | 9,740,010,037 | | 1.5303 | |
| 9月末日 | 9,592,633,992 | | 1.5019 | |
| 10月末日 | 9,793,084,896 | | 1.5251 | |
| 11月末日 | 9,702,887,861 | | 1.5212 | |
| 12月末日 | 9,566,338,736 | | 1.4921 | |
| 2023年 1月末日 | 9,721,517,864 | | 1.5075 | |
| 2月末日 | 9,885,459,058 | | 1.5313 | |
| 3月末日 | 9,965,145,963 | | 1.5378 | |
| 4月末日 | 10,143,803,022 | | 1.5579 | |
| 5月末日 | 10,237,538,568 | | 1.5708 | |
| 6月末日 | 10,633,513,516 | | 1.6136 | |
| 7月末日 | 10,604,191,756 | | 1.6124 | |

ハッピーエイジング60

直近日（2023年7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 |
| 第21計算期間末 | (2021年 7月15日) | 5,345,944,070 | 5,345,944,070 | 1.3367 | 1.3367 |
| 第22計算期間末 | (2022年 7月15日) | 5,430,316,764 | 5,430,316,764 | 1.3192 | 1.3192 |
| 第23計算期間末 | (2023年 7月18日) | 5,407,525,651 | 5,407,525,651 | 1.3284 | 1.3284 |
| | 2022年 7月末日 | 5,494,269,940 | | 1.3246 | |
| | 8月末日 | 5,491,248,815 | | 1.3208 | |
| | 9月末日 | 5,367,636,195 | | 1.3042 | |
| | 10月末日 | 5,435,522,344 | | 1.3135 | |
| | 11月末日 | 5,411,317,677 | | 1.3031 | |
| | 12月末日 | 5,293,529,356 | | 1.2781 | |
| | 2023年 1月末日 | 5,283,525,979 | | 1.2814 | |
| | 2月末日 | 5,330,290,868 | | 1.2969 | |
| | 3月末日 | 5,414,405,150 | | 1.3091 | |
| | 4月末日 | 5,435,763,889 | | 1.3189 | |
| | 5月末日 | 5,450,507,187 | | 1.3247 | |
| | 6月末日 | 5,493,994,209 | | 1.3444 | |
| | 7月末日 | 5,419,646,517 | | 1.3291 | |

【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計算期間 | 0.0000 |
| 第22計算期間 | 0.0000 |
| 第23計算期間 | 0.0000 |

ハッピーエイジング30

| | 1口当たりの分配金（円） |
|---------|--------------|
| 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計算期間 | 0.0000 |
| 第22計算期間 | 0.0000 |
| 第23計算期間 | 0.0000 |

ハッピーエイジング40

| | 1口当たりの分配金（円） |
|---------|--------------|
| 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計算期間 | 0.0000 |
| 第22計算期間 | 0.0000 |
| 第23計算期間 | 0.0000 |

ハッピーエイジング50

| | 1口当たりの分配金（円） |
|---------|--------------|
| 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計算期間 | 0.0000 |

| | |
|---------|--------|
| 第22計算期間 | 0.0000 |
| 第23計算期間 | 0.0000 |

ハッピーエイジング60

| | 1口当たりの分配金（円） |
|---------|--------------|
| 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計算期間 | 0.0000 |
| 第22計算期間 | 0.0000 |
| 第23計算期間 | 0.0000 |

【収益率の推移】

ハッピーエイジング20

| | 収益率（％） |
|---------|--------|
| 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計算期間 | 26.5 |
| 第22計算期間 | 5.1 |
| 第23計算期間 | 21.9 |

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

ハッピーエイジング30

| | 収益率（％） |
|---------|--------|
| 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計算期間 | 19.9 |
| 第22計算期間 | 4.5 |
| 第23計算期間 | 16.2 |

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

ハッピーエイジング40

| | 収益率（％） |
|---------|--------|
| 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計算期間 | 14.0 |
| 第22計算期間 | 2.0 |
| 第23計算期間 | 10.6 |

（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計算期間 | 8.2 |

| | |
|---------|-----|
| 第22計算期間 | 0.1 |
| 第23計算期間 | 5.5 |

（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60

| | 収益率（％） |
|---------|--------|
| 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計算期間 | 2.8 |
| 第22計算期間 | 1.3 |
| 第23計算期間 | 0.7 |

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

（4）【設定及び解約の実績】

ハッピーエイジング20

| | 設定口数 | 解約口数 |
|---------|---------------|---------------|
| 第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計算期間 | 1,531,705,313 | 1,462,004,315 |
| 第22計算期間 | 1,809,374,192 | 1,167,066,487 |
| 第23計算期間 | 1,970,503,276 | 1,180,964,726 |

（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計算期間 | 1,265,453,871 | 1,168,570,454 |
| 第22計算期間 | 1,339,833,107 | 861,811,651 |
| 第23計算期間 | 1,422,792,677 | 875,614,531 |

（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計算期間 | 1,997,361,636 | 1,493,623,313 |
| 第22計算期間 | 1,936,260,527 | 1,407,258,165 |
| 第23計算期間 | 1,879,507,225 | 1,313,399,096 |

（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計算期間 | 1,148,879,543 | 813,439,718 |
| 第22計算期間 | 1,182,086,451 | 768,455,642 |
| 第23計算期間 | 1,054,270,671 | 767,967,640 |

(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計算期間 | 925,573,626 | 669,909,997 |
| 第22計算期間 | 765,693,880 | 648,752,129 |
| 第23計算期間 | 651,604,071 | 697,314,060 |

(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:2023年7月31日

基準価額・純資産の推移 2013/07/31～2023/07/31

●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



分配の推移

●ハッピーエイジング20

| | |
|----------|----|
| 2019年07月 | 0円 |
| 2020年07月 | 0円 |
| 2021年07月 | 0円 |
| 2022年07月 | 0円 |
| 2023年07月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

●ハッピーエイジング30

| | |
|----------|----|
| 2019年07月 | 0円 |
| 2020年07月 | 0円 |
| 2021年07月 | 0円 |
| 2022年07月 | 0円 |
| 2023年07月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

●ハッピーエイジング40

| | |
|----------|----|
| 2019年07月 | 0円 |
| 2020年07月 | 0円 |
| 2021年07月 | 0円 |
| 2022年07月 | 0円 |
| 2023年07月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

●ハッピーエイジング50

| | |
|----------|----|
| 2019年07月 | 0円 |
| 2020年07月 | 0円 |
| 2021年07月 | 0円 |
| 2022年07月 | 0円 |
| 2023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



●ハッピーエイジング60

| | |
|----------|----|
| 2019年07月 | 0円 |
| 2020年07月 | 0円 |
| 2021年07月 | 0円 |
| 2022年07月 | 0円 |
| 2023年07月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

- 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。

● 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 | 26.07% | 22.14% | 15.71% |
| SJAMスモールキャップ・マザーファンド | 26.47% | 22.52% | 15.99% |
| 損保ジャパン日本債券マザーファンド | 1.94% | 7.80% | 32.40% |
| 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド | 5.91% | 19.76% | 14.92% |
| 損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド | 32.59% | 20.81% | 13.97% |
| ISHARES CORE MSCI EMERGING | 4.92% | 4.87% | 5.14% |
| コール・ローン等 | 2.10% | 2.10% | 1.87% |
| 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 | 9.71% | 4.10% |
| SJAMスモールキャップ・マザーファンド | 9.87% | 4.19% |
| 損保ジャパン日本債券マザーファンド | 56.43% | 71.57% |
| 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド | 11.03% | 16.11% |
| 損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド | 8.05% | 2.02% |
| ISHARES CORE MSCI EMERGING | 3.22% | - |
| コール・ローン等 | 1.69% | 2.01% |
| 合計 | 100.00% | 100.00% |

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

● SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド

| 組入上位5銘柄 | | | |
|---------|-------------------|-------|------|
| | 銘柄名 | 業種 | 純資産比 |
| 1 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 7.0% |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 6.9% |
| 3 | アイシン | 輸送用機器 | 6.6% |
| 4 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 4.8% |
| 5 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 銀行業 | 4.6% |
| 組入銘柄数 | | | 37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 | めぶきフィナンシャルグループ | 銀行業 | 3.7% |
| 2 | 八十二銀行 | 銀行業 | 3.6% |
| 3 | 豊田合成 | 輸送用機器 | 3.6% |
| 4 | ジェイテクト | 機械 | 3.4% |
| 5 | いよぎんホールディングス | 銀行業 | 3.1% |
| 組入銘柄数 | | | 88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360回利付国債(10年) | 国債証券 | 2030/9/20 | 5.0% |
| 2 | 第364回利付国債(10年) | 国債証券 | 2031/9/20 | 4.2% |
| 3 | 第351回利付国債(10年) | 国債証券 | 2028/6/20 | 3.4% |
| 4 | 第151回利付国債(20年) | 国債証券 | 2034/12/20 | 3.2% |
| 5 | 第352回利付国債(10年) | 国債証券 | 2028/9/20 | 3.0% |
| 組入銘柄数 | | | 107銘柄 | |

● 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

| 組入上位5銘柄 | | | | | | |
|---------|-----------------------|------|------|---------|------------|------|
| | 銘柄名 | 発行国 | 種類 | 通貨 | 償還日 | 純資産比 |
| 1 | Treasury 4.125 250131 | アメリカ | 国債証券 | アメリカ・ドル | 2025/01/31 | 9.6% |
| 2 | Treasury 1.75 291115 | アメリカ | 国債証券 | アメリカ・ドル | 2029/11/15 | 4.7% |
| 3 | Treasury 4.125 321115 | アメリカ | 国債証券 | アメリカ・ドル | 2032/11/15 | 4.6% |
| 4 | Treasury 3.125 290831 | アメリカ | 国債証券 | アメリカ・ドル | 2029/08/31 | 4.6% |
| 5 | Treasury 2.75 280215 | アメリカ | 国債証券 | アメリカ・ドル | 2028/02/15 | 3.9% |
| 組入銘柄数 | | | | | 139銘柄 | |

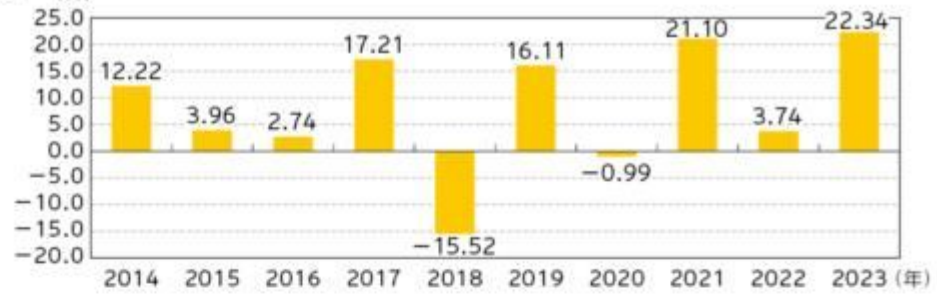
● 損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド

| 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 | 4.1% |
| 2 | VISA INC-CLASS A SHARES | アメリカ・ドル | アメリカ | 金融 | 2.9% |
| 3 | TRADE DESK INC/THE - CLASS A | アメリカ・ドル | アメリカ | コミュニケーション・サービス | 2.5% |
| 4 | FISERV INC | アメリカ・ドル | アメリカ | 金融 | 2.5% |
| 5 | ORACLE CORPORATION | アメリカ・ドル | アメリカ | 情報技術 | 2.3% |
| 組入銘柄数 | | | 228銘柄 | | |

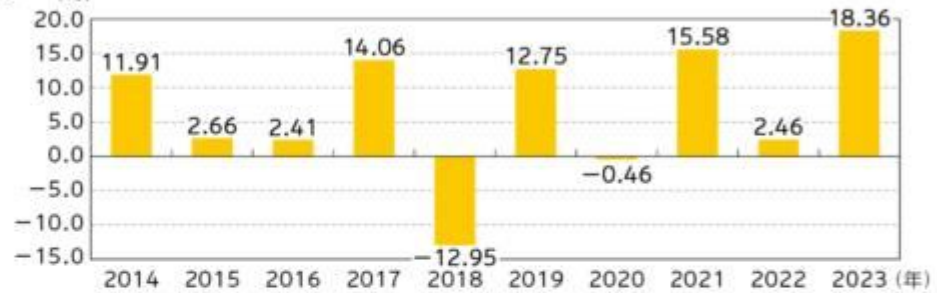
- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

年間収益率の推移（暦年ベース）

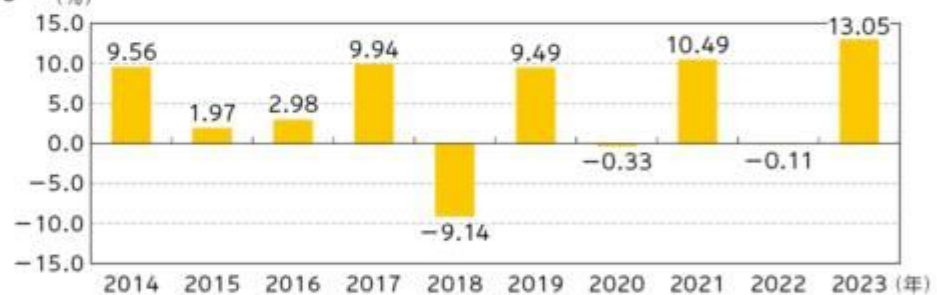
● ハッピーエイジング20 (%)



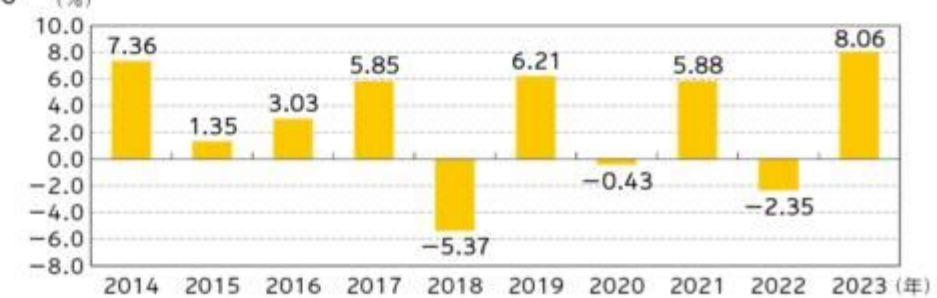
● ハッピーエイジング30 (%)



● ハッピーエイジング40 (%)

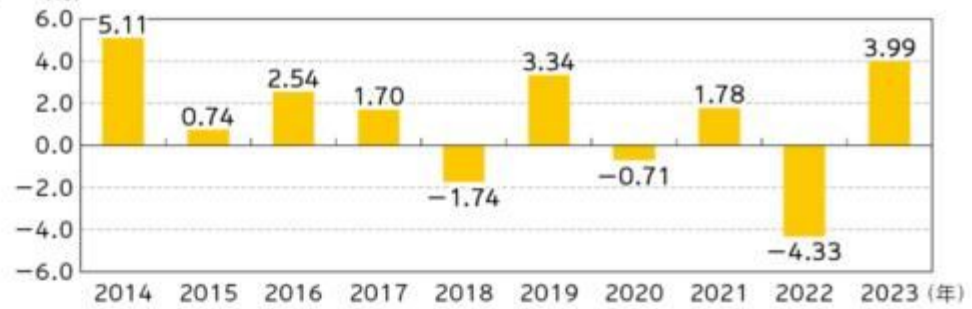


● ハッピーエイジング50 (%)



- 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。

● 2023年は年初から基準日までの収益率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- (1) 申込期間内における毎営業日において、いつでも申込みいただくことができます。ただし、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所、フランクフルト証券取引所、パリ証券取引所のいずれかの取引所あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、取得の申込みを受付けないものとしします。

お申込みの受付は原則として午後3時までとし、それ以降のお申込みは、翌営業日の取扱いとなります。（受付時間については、販売会社により異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社にご確認ください。）

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、取引市場における流動性が極端に減少した場合、取引市場の混乱、自然災害、テロ、大規模停電、システム障害等により基準価額の算出が困難となった場合、その他やむを得ない事情があると判断したとき（「緊急事態発生時」といいます。）は、取得申込みの受付を中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付を取り消すことができるものとしします。

- (2) 受益権の取得申込者は、販売会社に取引口座を開設します。

- (3) 当該受益権の申込価額は、取得申込受付日の翌営業日における基準価額 としします。

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。ただし、便宜上1万口当たりには換算した価額で表示されることがあります。

当ファンドの基準価額については、委託会社または販売会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

- (4) お申込みには申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額を要します。申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.2%（税抜2.0%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。

定時定額購入サービスを申込まれた場合および確定拠出年金制度に基づき申込まれた場合には、申込手数料はありません。

定時定額購入サービスを申込まれた場合および確定拠出年金制度に基づき申込まれた場合で、「ハッピーエイジング・ファンド」の各ファンド間のスイッチングの場合にも、申込手数料はありません。

申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

- (5) お申込単位は販売会社が定める単位としします。

申込単位等の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

- (6) 取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益

権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

2【換金（解約）手続等】

- (1) 受益者は、日本における委託会社及び販売会社の各営業日に一部解約の実行を請求することができます。ただし、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所、フランクフルト証券取引所、パリ証券取引所のいずれかの取引所あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、解約請求を受け付けないものとします。一部解約の受付は原則として午後3時までとし、それ以降のお申込みは翌営業日の取扱いとなります。（受付時間については、販売会社により異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社にご確認ください。）
- (2) 受益者は、自己に帰属する受益権について販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。
一部解約の単位の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。
- (3) 一部解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。解約代金は原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社の営業所等で支払われます。解約に係る手数料はありません。

ご換金時には税金が課せられます。詳しくは有価証券届出書「第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 4手数料等及び税金（5）課税上の取扱い」をご参照ください。
- (4) 委託会社は、緊急事態発生時には、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、および既に受付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができるものとします。一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付け中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとし、信託約款の規定に準じて算出した価額とします。
- (5) 換金の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。
- (6) 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求を制限する場合があります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額は、原則として各営業日に委託会社が計算します。

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入有価証券を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。ただし、一般社団法人投資信託協会規則に別段の定めがある場合には同規則の定めるところによります。また外国為替の予約取引の評価は、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によって計算します。ただし、一般社団法人投資信託協会規則に別段の定めがある場合には同規則の定めるところによります。

基準価額は、毎営業日に委託会社及び販売会社に問い合わせることにより知ることができます。また基準価額は原則として、翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。なお基準価額は1万口単位で表示されたものが発表されます。

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、取引市場における流動性が極端に減少した場合、取引市場の混乱、自然災害、テロ、大規模停電、システム障害等により基準価額の公表を中止することがあります。

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。ただし、この信託期間中に信託約款第49条第8項、第50条第1項、第51条第1項、第52条第1項及び第54条第2項に規定する事由が生じた場合にはこの信託を終了させることができます。

（４）【計算期間】

原則として、毎年7月16日から翌年7月15日までとします。

なお、前記の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下、「該当日」といいます。）が休業日のときは各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託約款第4条に定める信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

信託契約の解約

- （ ） 委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が1億口を下回ることとなった場合、またはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- （ ） 委託会社は、前記（ ）の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この

信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行います。

- () 前記()の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- () 前記()の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前記()の信託契約の解約をしません。
- () 委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- () 前記()から()までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記()の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

信託契約に関する監督官庁の命令

- () 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- () 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、信託約款第55条(信託約款の変更)の規定にしたがいます。

委託会社の登録取消等に伴う取扱い

- () 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。
- () 前記()の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、信託約款第55条第4項に該当する場合(当該約款変更について異議を申し出た受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超える場合)を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

- () 委託会社は、事業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。
- () 委託会社は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- () 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款第55条の規定にしたがい、新受託会社を選任します。
- () 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

- () 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- () 委託会社は、前記()の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対し

て書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

- () 前記()の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- () 前記()の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前記()の信託約款の変更をしません。
- () 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

運用報告書に記載すべき事項の提供

- () 委託会社は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。
- () 前記()の規定にかかわらず、委託会社は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

公告

- () 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。
<https://www.sompo-am.co.jp/>
- () 前記()の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

関係法人との契約の更改等

委託会社と販売会社との間の募集・販売の取扱い等に関する契約は、当事者の別段の意思表示のない限り、1年毎に自動的に更新されます。募集・販売の取扱い等に関する契約は、当事者間の合意により変更することができます。

委託会社と運用委託先との間の投資一任契約は、原則として、ファンドの償還日に終了するものとします。ただし、運用委託先が契約に違反した場合等には、契約の中止または変更をすることができます。

信託事務処理の再信託

受託会社は、当ファンドに係る信託事務の処理の一部について株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することができます。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

4【受益者の権利等】

当ファンドの受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。この受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。受益者の有する主な権利は次のとおりです。なお、信託約款には受益者集会に関する規定はありません。また、ファンド資産に生じた利益及び損失は、全て受益者に帰属します。

(1) 収益分配金に対する請求権

当ファンドの収益分配金は、原則として自動的に当ファンドに再投資される性格を有します。分配金は税引き後再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。また委託会社の直接募集に係る受益者に対して委託会社は遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。

なお、収益分配金を再投資しない契約を別に締結した受益者は、委託会社の決定した収益分配金

を持分に応じて請求する権利を有します。収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、毎計算期間の終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から販売会社を通じて受益者に支払います。ただし、委託会社自ら勧誘した受益者に対する支払いは委託会社において行うものとします。

なお、収益分配金の請求権は、支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、償還金を持ち分に応じて委託会社に請求する権利を有します。償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。償還金は、償還日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から受益者に支払われます。償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。なお、委託会社自ら勧誘した受益者に対する支払いは、委託会社において行うものとします。

償還金の請求権は、支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

(3) 一部解約の実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について販売会社が定める単位をもって、受益権の一部解約の実行を請求することができます。なお、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所、フランクフルト証券取引所、パリ証券取引所のいずれかの取引所あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、解約請求を受付けないものとします。

受付は原則として午後3時までとし、それ以降の受付は翌営業日の取扱いになります（受付時間については、販売会社により異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社にご確認ください。）。一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。なお、委託会社自ら勧誘した受益者に対する支払いは、委託会社において行うものとします。

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者に係る信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

(5) 反対者の買取請求権

信託契約の解約または重大な信託約款の変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、法令に基づき、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）（以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2022年7月16日から2023年7月18日までの財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ハッピーエイジング20】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | - | 616,985,310 |
| コール・ローン | 488,980,781 | - |
| 投資信託受益証券 | 656,187,388 | 977,693,586 |
| 親投資信託受益証券 | 13,828,449,093 | 18,428,126,024 |
| 流動資産合計 | 14,973,617,262 | 20,022,804,920 |
| 資産合計 | 14,973,617,262 | 20,022,804,920 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 10,481,255 | 19,762,550 |
| 未払受託者報酬 | 3,884,655 | 4,907,882 |
| 未払委託者報酬 | 110,324,238 | 139,383,749 |
| 未払利息 | 1,473 | - |
| その他未払費用 | 448,873 | 455,242 |
| 流動負債合計 | 125,140,494 | 164,509,423 |
| 負債合計 | 125,140,494 | 164,509,423 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 8,097,040,123 | 8,886,578,673 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 6,751,436,645 | 10,971,716,824 |
| 元本等合計 | 14,848,476,768 | 19,858,295,497 |
| 純資産合計 | 14,848,476,768 | 19,858,295,497 |
| 負債純資産合計 | 14,973,617,262 | 20,022,804,920 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第22期 | | 第23期 | |
|---|------|----------------------------|------|----------------------------|
| | 自 | 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 | 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取配当金 | | 23,548,210 | | 18,130,949 |
| 有価証券売買等損益 | | 704,300,466 | | 3,692,164,410 |
| 為替差損益 | | 182,269,492 | | 1,677,316 |
| 営業収益合計 | | 910,118,168 | | 3,711,972,675 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払利息 | | 339,742 | | 267,080 |
| 受託者報酬 | | 7,737,570 | | 9,258,465 |
| 委託者報酬 | | 219,747,014 | | 262,940,166 |
| その他費用 | | 1,025,118 | | 1,301,999 |
| 営業費用合計 | | 228,849,444 | | 273,767,710 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | | 681,268,724 | | 3,438,204,965 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | | 681,268,724 | | 3,438,204,965 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | | 681,268,724 | | 3,438,204,965 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） | | 63,076,743 | | 180,158,597 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | | 5,552,912,336 | | 6,751,436,645 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 1,456,167,645 | | 1,959,474,491 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 1,456,167,645 | | 1,959,474,491 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 875,835,317 | | 997,240,680 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 875,835,317 | | 997,240,680 |
| 分配金 | | - | | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | | 6,751,436,645 | | 10,971,716,824 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。 |
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 3. 費用・収益の計上基準 | 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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。 計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年7月15日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を2023年7月18日としております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 期別 | 第22期 2022年7月15日現在 | | 第23期 2023年7月18日現在 | |
|----------------------------|----------------------|----------------|----------------------|----------------|
| | 1. 受益権の総数 | 8,097,040,123口 | | 8,886,578,673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 | 1.8338円 | 1口当たり純資産額 | 2.2346円 |
| | (1万口当たり純資産額) | (18,338円) | (1万口当たり純資産額) | (22,346円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第22期 | | 第23期 | |
|---|--|------------|--|------------|
| | 自 | 至 | 自 | 至 |
| | 2021年7月16日 | 2022年7月15日 | 2022年7月16日 | 2023年7月18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 | |
| 2. 分配金の計算過程 | 計算期間末における経費控除後の配当等収益（256,631,226円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（361,560,755円）、信託約款に規定される収益調整金（6,930,081,286円）及び分配準備積立金（2,952,661,993円）より分配対象収益は10,500,935,260円（1万口当たり12,968.83円）であります。分配を行っておりません。 | | 計算期間末における経費控除後の配当等収益（382,044,791円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（2,876,001,577円）、信託約款に規定される収益調整金（8,426,026,776円）及び分配準備積立金（3,105,494,611円）より分配対象収益は14,789,567,755円（1万口当たり16,642.57円）であります。分配を行っておりません。 | |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第22期 | | 第23期 | |
|--------------------------|--|------------|------------|------------|
| | 自 | 至 | 自 | 至 |
| | 2021年7月16日 | 2022年7月15日 | 2022年7月16日 | 2023年7月18日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。 | | 同左 | |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。</p> <p>為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> | | 同左 | |

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|----------------------------|--|------------------------------|
| | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> | 同左 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価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。</p> | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|----------------------|--|--------------|
| | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | <p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> | 同左 |

| 項目 | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|------------|--|----------------------|
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 | 同左 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|----------------------|----------------------|
| 該当事項はありません。 | 同左 |

（その他の注記）

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|-----------|------------------------------|------------------------------|
| | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
| 期首元本額 | 7,454,732,418円 | 8,097,040,123円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,809,374,192円 | 1,970,503,276円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,167,066,487円 | 1,180,964,726円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|-----------|----------------------|----------------------|
| | 当期の損益に含まれた評価差額（円） | |
| 投資信託受益証券 | 247,315,051 | 74,147,479 |
| 親投資信託受益証券 | 844,512,377 | 3,506,306,989 |
| 合計 | 597,197,326 | 3,580,454,468 |

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2023年7月18日現在

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|--------------|-------|----------------------------|---------------|---------------------------------|----|
| 投資信託受益証券 | ドル | ISHARES CORE MSCI EMERGING | 137,793 | 7,039,844.37 | |
| | ドル 小計 | | 137,793 | 7,039,844.37 (977,693,586) | |
| 投資信託受益証券 合計 | | | 137,793 | 977,693,586 (977,693,586) | |
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド | 1,589,287,285 | 6,566,776,132 | |
| | | 損保ジャパン日本債券マザーファンド | 279,458,435 | 391,241,809 | |
| | | 損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド | 633,117,982 | 1,154,490,640 | |
| | | SJAMラージキャップ・バリュウ・マザーファンド | 1,746,410,960 | 5,171,646,775 | |
| | | SJAMスモールキャップ・マザーファンド | 1,413,683,642 | 5,143,970,668 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | | 5,661,958,304 | 18,428,126,024 | |
| 合計 | | | | 19,405,819,610 (977,693,586) | |

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

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額です。

2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入 投資信託受益証券 時価比率 | 有価証券の合計金額に対する比率 |
|----|-----|------------------------|-----------------|
|----|-----|------------------------|-----------------|

| | | | | |
|----|----------|-----|-------|-------|
| ドル | 投資信託受益証券 | 1銘柄 | 4.92% | 5.04% |
|----|----------|-----|-------|-------|

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング30】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | - | 631,444,792 |
| コール・ローン | 503,596,676 | - |
| 投資信託受益証券 | 771,919,336 | 1,018,492,016 |
| 親投資信託受益証券 | 15,948,558,219 | 19,508,833,514 |
| 流動資産合計 | 17,224,074,231 | 21,158,770,322 |
| 資産合計 | 17,224,074,231 | 21,158,770,322 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 6,069,256 | 5,104,507 |
| 未払受託者報酬 | 4,482,334 | 5,311,061 |
| 未払委託者報酬 | 116,540,768 | 138,087,512 |
| 未払利息 | 1,517 | - |
| その他未払費用 | 449,662 | 456,390 |
| 流動負債合計 | 127,543,537 | 148,959,470 |
| 負債合計 | 127,543,537 | 148,959,470 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 9,543,086,407 | 10,090,264,553 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 7,553,444,287 | 10,919,546,299 |
| 元本等合計 | 17,096,530,694 | 21,009,810,852 |
| 純資産合計 | 17,096,530,694 | 21,009,810,852 |
| 負債純資産合計 | 17,224,074,231 | 21,158,770,322 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第22期 | | 第23期 | |
|--|------|----------------------------|------|----------------------------|
| | 自 | 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 | 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取配当金 | | 28,922,042 | | 19,245,616 |
| 有価証券売買等損益 | | 714,418,108 | | 3,131,552,714 |
| 為替差損益 | | 217,634,642 | | 1,354,969 |
| 営業収益合計 | | 960,974,792 | | 3,149,443,361 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払利息 | | 359,297 | | 298,800 |
| 受託者報酬 | | 8,992,679 | | 10,224,827 |
| 委託者報酬 | | 233,809,632 | | 265,845,328 |
| その他費用 | | 1,043,256 | | 1,329,290 |
| 営業費用合計 | | 244,204,864 | | 277,698,245 |
| 営業利益又は営業損失 () | | 716,769,928 | | 2,871,745,116 |
| 経常利益又は経常損失 () | | 716,769,928 | | 2,871,745,116 |
| 当期純利益又は当期純損失 () | | 716,769,928 | | 2,871,745,116 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 () | | 34,055,103 | | 87,161,927 |
| 期首剰余金又は期首欠損金 () | | 6,473,957,098 | | 7,553,444,287 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 1,014,368,266 | | 1,278,012,575 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 1,014,368,266 | | 1,278,012,575 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 617,595,902 | | 696,493,752 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 617,595,902 | | 696,493,752 |
| 分配金 | | - | | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金 () | | 7,553,444,287 | | 10,919,546,299 |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。 |
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 3. 費用・収益の計上基準 | 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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。 計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年7月15日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を2023年7月18日としております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 期別 | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|----------------------------|--|--|
| 1. 受益権の総数 | 9,543,086,407口 | 10,090,264,553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) 1.7915円 (17,915円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.0822円 (20,822円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|---|--|--|
| | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18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 |
| 2. 分配金の計算過程 | 計算期間末における経費控除後の配当等収益（283,767,973円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（398,946,852円）、信託約款に規定される収益調整金（5,739,688,731円）及び分配準備積立金（3,871,397,959円）より分配対象収益は10,293,801,515円（1万口当たり10,786.63円）であります。分配を行っておりません。 | 計算期間末における経費控除後の配当等収益（401,380,182円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（2,383,203,007円）、信託約款に規定される収益調整金（6,724,769,258円）及び分配準備積立金（4,163,699,011円）より分配対象収益は13,673,051,458円（1万口当たり13,550.71円）であります。分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|--------------------------|--|------------------------------|
| | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>（1）金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。</p> <p>為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>（2）金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> | 同左 |

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|----------------------------|--|------------------------------|
| | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> | 同左 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価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。</p> | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|----------------------|--|--------------|
| | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | <p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> | 同左 |

| 項目 | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|------------|--|----------------------|
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 | 同左 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|----------------------|----------------------|
| 該当事項はありません。 | 同左 |

（その他の注記）

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|-----------|------------------------------|------------------------------|
| | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
| 期首元本額 | 9,065,064,951円 | 9,543,086,407円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,339,833,107円 | 1,422,792,677円 |
| 期中一部解約元本額 | 861,811,651円 | 875,614,531円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|-----------|----------------------|----------------------|
| | 当期の損益に含まれた評価差額（円） | |
| 投資信託受益証券 | 296,749,760 | 82,857,419 |
| 親投資信託受益証券 | 900,477,053 | 2,925,836,269 |
| 合計 | 603,727,293 | 3,008,693,688 |

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2023年7月18日現在

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|--------------|-------|----------------------------|---------------|-----------------------------------|----|
| 投資信託受益証券 | ドル | ISHARES CORE MSCI EMERGING | 143,543 | 7,333,611.87 | |
| | ドル 小計 | | 143,543 | 7,333,611.87 (1,018,492,016) | |
| 投資信託受益証券 合計 | | | 143,543 | 1,018,492,016 (1,018,492,016) | |
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド | 1,079,652,915 | 4,461,017,879 | |
| | | 損保ジャパン日本債券マザーファンド | 1,193,294,452 | 1,670,612,232 | |
| | | 損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド | 2,252,688,094 | 4,107,776,739 | |
| | | SJAMラージキャップ・バリュース・マザーファンド | 1,561,113,070 | 4,622,924,134 | |
| | | SJAMスモールキャップ・マザーファンド | 1,276,967,744 | 4,646,502,530 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | | 7,363,716,275 | 19,508,833,514 | |
| 合計 | | | | 20,527,325,530 (1,018,492,016) | |

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

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額です。

2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入 投資信託受益証券 時価比率 | 有価証券の合計金額に対する比率 |
|----|-----|------------------------|-----------------|
|----|-----|------------------------|-----------------|

| | | | | |
|----|----------|-----|-------|-------|
| ドル | 投資信託受益証券 | 1銘柄 | 4.85% | 4.96% |
|----|----------|-----|-------|-------|

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング40】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | - | 635,168,280 |
| コール・ローン | 613,486,511 | - |
| 投資信託受益証券 | 991,571,180 | 1,246,062,113 |
| 親投資信託受益証券 | 19,818,736,741 | 22,865,458,239 |
| 流動資産合計 | 21,423,794,432 | 24,746,688,632 |
| 資産合計 | 21,423,794,432 | 24,746,688,632 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 10,033,247 | 10,167,005 |
| 未払受託者報酬 | 5,646,190 | 6,386,225 |
| 未払委託者報酬 | 129,862,239 | 146,883,194 |
| 未払利息 | 1,848 | - |
| その他未払費用 | 451,162 | 457,216 |
| 流動負債合計 | 145,994,686 | 163,893,640 |
| 負債合計 | 145,994,686 | 163,893,640 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 12,701,846,625 | 13,267,954,754 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 8,575,953,121 | 11,314,840,238 |
| 元本等合計 | 21,277,799,746 | 24,582,794,992 |
| 純資産合計 | 21,277,799,746 | 24,582,794,992 |
| 負債純資産合計 | 21,423,794,432 | 24,746,688,632 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第22期 | | 第23期 | |
|--|------|----------------------------|------|----------------------------|
| | 自 | 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 | 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取配当金 | | 37,151,767 | | 23,493,360 |
| 有価証券売買等損益 | | 365,732,211 | | 2,603,171,148 |
| 為替差損益 | | 277,584,479 | | 2,487,296 |
| 営業収益合計 | | 680,468,457 | | 2,629,151,804 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払利息 | | 454,573 | | 363,216 |
| 受託者報酬 | | 11,386,864 | | 12,453,557 |
| 委託者報酬 | | 261,897,818 | | 286,431,654 |
| その他費用 | | 1,083,649 | | 1,401,069 |
| 営業費用合計 | | 274,822,904 | | 300,649,496 |
| 営業利益又は営業損失 () | | 405,645,553 | | 2,328,502,308 |
| 経常利益又は経常損失 () | | 405,645,553 | | 2,328,502,308 |
| 当期純利益又は当期純損失 () | | 405,645,553 | | 2,328,502,308 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 () | | 27,262,564 | | 74,846,221 |
| 期首剰余金又は期首欠損金 () | | 7,821,626,892 | | 8,575,953,121 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 1,282,040,496 | | 1,374,702,371 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 1,282,040,496 | | 1,374,702,371 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 906,097,256 | | 889,471,341 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 906,097,256 | | 889,471,341 |
| 分配金 | | - | | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金 () | | 8,575,953,121 | | 11,314,840,238 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。 |
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 3. 費用・収益の計上基準 | 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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。 計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年7月15日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を2023年7月18日としております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 期別 | 第22期 2022年7月15日現在 | | 第23期 2023年7月18日現在 | |
|----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------|-----------------|
| | 1. 受益権の総数 | 12,701,846,625口 | | 13,267,954,754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 | 1.6752円 | 1口当たり純資産額 | 1.8528円 |
| | (1万口当たり純資産額) | (16,752円) | (1万口当たり純資産額) | (18,528円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|---|---|--|
| | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18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 |
| 2. 分配金の計算過程 | 計算期間末における経費控除後の配当等収益（225,422,612円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（152,960,377円）、信託約款に規定される収益調整金（6,683,415,589円）及び分配準備積立金（3,683,234,233円）より分配対象収益は10,745,032,811円（1万口当たり8,459.40円）ですが、分配を行っておりません。 | 計算期間末における経費控除後の配当等収益（373,686,383円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（1,879,969,704円）、信託約款に規定される収益調整金（7,556,839,292円）及び分配準備積立金（3,671,141,807円）より分配対象収益は13,481,637,186円（1万口当たり10,161.02円）ですが、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|--------------------------|--|------------------------------|
| | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>（1）金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。</p> <p>為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>（2）金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> | 同左 |

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|----------------------------|--|------------------------------|
| | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> | 同左 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価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。</p> | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|----------------------|--|--------------|
| | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | <p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> | 同左 |

| 項目 | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|------------|--|----------------------|
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 | 同左 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|----------------------|----------------------|
| 該当事項はありません。 | 同左 |

（その他の注記）

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|-----------|------------------------------|------------------------------|
| | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
| 期首元本額 | 12,172,844,263円 | 12,701,846,625円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,936,260,527円 | 1,879,507,225円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,407,258,165円 | 1,313,399,096円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|-----------|----------------------|----------------------|
| | 当期の損益に含まれた評価差額（円） | |
| 投資信託受益証券 | 379,331,029 | 95,929,650 |
| 親投資信託受益証券 | 626,737,739 | 2,320,749,314 |
| 合計 | 247,406,710 | 2,416,678,964 |

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2023年7月18日現在

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|--------------|-------|----------------------------|----------------|-----------------------------------|----|
| 投資信託受益証券 | ドル | ISHARES CORE MSCI EMERGING | 175,616 | 8,972,221.44 | |
| | ドル 小計 | | 175,616 | 8,972,221.44 (1,246,062,113) | |
| 投資信託受益証券 合計 | | | 175,616 | 1,246,062,113 (1,246,062,113) | |
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド | 845,047,445 | 3,491,651,537 | |
| | | 損保ジャパン日本債券マザーファンド | 5,778,688,836 | 8,090,164,370 | |
| | | 損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド | 1,983,477,615 | 3,616,871,430 | |
| | | SJAMラージキャップ・バリュウ・マザーファンド | 1,291,251,930 | 3,823,784,340 | |
| | | SJAMスモールキャップ・マザーファンド | 1,056,142,733 | 3,842,986,562 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | | 10,954,608,559 | 22,865,458,239 | |
| 合計 | | | | 24,111,520,352 (1,246,062,113) | |

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

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額です。

2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入 投資信託受益証券 時価比率 | 有価証券の合計金額に対する比率 |
|----|-----|------------------------|-----------------|
| | | | |

| | | | | |
|----|----------|-----|-------|-------|
| ドル | 投資信託受益証券 | 1銘柄 | 5.07% | 5.17% |
|----|----------|-----|-------|-------|

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング50】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | - | 258,807,801 |
| コール・ローン | 268,854,042 | - |
| 投資信託受益証券 | 240,697,585 | 329,104,973 |
| 親投資信託受益証券 | 9,103,146,891 | 10,015,967,725 |
| 流動資産合計 | 9,612,698,518 | 10,603,880,499 |
| 資産合計 | 9,612,698,518 | 10,603,880,499 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 4,515,715 | 11,994,352 |
| 未払受託者報酬 | 2,553,414 | 2,778,927 |
| 未払委託者報酬 | 50,046,874 | 54,466,887 |
| 未払利息 | 810 | - |
| その他未払費用 | 445,138 | 446,876 |
| 流動負債合計 | 57,561,951 | 69,687,042 |
| 負債合計 | 57,561,951 | 69,687,042 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 6,306,865,858 | 6,593,168,889 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 3,248,270,709 | 3,941,024,568 |
| 元本等合計 | 9,555,136,567 | 10,534,193,457 |
| 純資産合計 | 9,555,136,567 | 10,534,193,457 |
| 負債純資産合計 | 9,612,698,518 | 10,603,880,499 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第22期 | | 第23期 | |
|---|------|----------------------------|------|----------------------------|
| | 自 | 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 | 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取配当金 | | 8,851,963 | | 5,936,672 |
| 有価証券売買等損益 | | 18,813,727 | | 645,566,302 |
| 為替差損益 | | 67,624,208 | | 1,795,950 |
| 営業収益合計 | | 95,289,898 | | 653,298,924 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払利息 | | 212,036 | | 157,756 |
| 受託者報酬 | | 5,134,336 | | 5,474,179 |
| 委託者報酬 | | 100,632,811 | | 107,293,731 |
| その他費用 | | 941,468 | | 1,082,864 |
| 営業費用合計 | | 106,920,651 | | 114,008,530 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | | 11,630,753 | | 539,290,394 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | | 11,630,753 | | 539,290,394 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | | 11,630,753 | | 539,290,394 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） | | 1,599,016 | | 17,768,146 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | | 3,045,661,704 | | 3,248,270,709 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 613,347,524 | | 567,262,922 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 613,347,524 | | 567,262,922 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 397,508,750 | | 396,031,311 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 397,508,750 | | 396,031,311 |
| 分配金 | | - | | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | | 3,248,270,709 | | 3,941,024,568 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。 |
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 3. 費用・収益の計上基準 | 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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。 計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年7月15日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を2023年7月18日としております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 期別 | 第22期 2022年7月15日現在 | | 第23期 2023年7月18日現在 | |
|----------------------------|----------------------|----------------|----------------------|----------------|
| | 1. 受益権の総数 | 6,306,865,858口 | | 6,593,168,889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 | 1.5150円 | 1口当たり純資産額 | 1.5977円 |
| | (1万口当たり純資産額) | (15,150円) | (1万口当たり純資産額) | (15,977円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第22期 | | 第23期 | |
|---|---|------------|--|------------|
| | 自 | 至 | 自 | 至 |
| | 2021年7月16日 | 2022年7月15日 | 2022年7月16日 | 2023年7月18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 | |
| 2. 分配金の計算過程 | 計算期間末における経費控除後の配当等収益（21,954,163円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,520,909,444円）及び分配準備積立金（1,041,121,615円）より分配対象収益は3,583,985,222円（1万口当たり5,682.64円）ですが、分配を行っておりません。 | | 計算期間末における経費控除後の配当等収益（112,759,655円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（377,534,646円）、信託約款に規定される収益調整金（2,804,428,631円）及び分配準備積立金（943,546,551円）より分配対象収益は4,238,269,483円（1万口当たり6,428.25円）ですが、分配を行っておりません。 | |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第22期 | | 第23期 | |
|--------------------------|--|------------|------------|------------|
| | 自 | 至 | 自 | 至 |
| | 2021年7月16日 | 2022年7月15日 | 2022年7月16日 | 2023年7月18日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。 | | 同左 | |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。</p> <p>為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> | | 同左 | |

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|----------------------------|--|------------------------------|
| | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> | 同左 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価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。</p> | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|----------------------|--|--------------|
| | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | <p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> | 同左 |

| 項目 | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|------------|--|----------------------|
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 | 同左 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|----------------------|----------------------|
| 該当事項はありません。 | 同左 |

（その他の注記）

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|-----------|------------------------------|------------------------------|
| | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
| 期首元本額 | 5,893,235,049円 | 6,306,865,858円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,182,086,451円 | 1,054,270,671円 |
| 期中一部解約元本額 | 768,455,642円 | 767,967,640円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|-----------|----------------------|----------------------|
| | 当期の損益に含まれた評価差額（円） | |
| 投資信託受益証券 | 93,167,242 | 24,375,468 |
| 親投資信託受益証券 | 75,547,292 | 550,449,913 |
| 合計 | 17,619,950 | 574,825,381 |

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2023年7月18日現在

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|--------------|-------|----------------------------|---------------|---------------------------------|----|
| 投資信託受益証券 | ドル | ISHARES CORE MSCI EMERGING | 46,383 | 2,369,707.47 | |
| | ドル 小計 | | 46,383 | 2,369,707.47 (329,104,973) | |
| 投資信託受益証券 合計 | | | 46,383 | 329,104,973 (329,104,973) | |
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド | 207,413,232 | 857,010,733 | |
| | | 損保ジャパン日本債券マザーファンド | 4,286,893,538 | 6,001,650,953 | |
| | | 損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド | 624,716,025 | 1,139,169,671 | |
| | | SJAMラージキャップ・バリュウ・マザーファンド | 339,902,027 | 1,006,551,872 | |
| | | SJAMスモールキャップ・マザーファンド | 278,007,117 | 1,011,584,496 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | | 5,736,931,939 | 10,015,967,725 | |
| 合計 | | | | 10,345,072,698 (329,104,973) | |

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

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額です。

2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入 投資信託受益証券 時価比率 | 有価証券の合計金額に対する比率 |
|----|-----|------------------------|-----------------|
|----|-----|------------------------|-----------------|

| | | | | |
|----|----------|-----|-------|-------|
| ドル | 投資信託受益証券 | 1銘柄 | 3.12% | 3.18% |
|----|----------|-----|-------|-------|

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング60】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

| | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | - | 153,935,839 |
| コール・ローン | 118,368,167 | - |
| 親投資信託受益証券 | 5,346,222,267 | 5,281,138,374 |
| 流動資産合計 | 5,464,590,434 | 5,435,074,213 |
| 資産合計 | 5,464,590,434 | 5,435,074,213 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 8,640,841 | 1,627,093 |
| 未払受託者報酬 | 1,467,093 | 1,483,569 |
| 未払委託者報酬 | 23,766,898 | 24,033,741 |
| 未払利息 | 356 | - |
| その他未払費用 | 398,482 | 404,159 |
| 流動負債合計 | 34,273,670 | 27,548,562 |
| 負債合計 | 34,273,670 | 27,548,562 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 4,116,323,762 | 4,070,613,773 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 1,313,993,002 | 1,336,911,878 |
| 元本等合計 | 5,430,316,764 | 5,407,525,651 |
| 純資産合計 | 5,430,316,764 | 5,407,525,651 |
| 負債純資産合計 | 5,464,590,434 | 5,435,074,213 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第22期 | | 第23期 | |
|---|------|-------------------|------|-------------------|
| | 自 | 2021年7月16日 | 自 | 2022年7月16日 |
| | 至 | 2022年7月15日 | 至 | 2023年7月18日 |
| 営業収益 | | | | |
| 有価証券売買等損益 | | 19,122,524 | | 89,756,107 |
| 営業収益合計 | | 19,122,524 | | 89,756,107 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払利息 | | 114,387 | | 77,522 |
| 受託者報酬 | | 2,990,304 | | 2,989,897 |
| 委託者報酬 | | 48,442,830 | | 48,436,115 |
| その他費用 | | 813,849 | | 871,161 |
| 営業費用合計 | | 52,361,370 | | 52,374,695 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | | 71,483,894 | | 37,381,412 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | | 71,483,894 | | 37,381,412 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | | 71,483,894 | | 37,381,412 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） | | 5,591,942 | | 4,558,540 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | | 1,346,562,059 | | 1,313,993,002 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 251,527,715 | | 203,027,654 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 251,527,715 | | 203,027,654 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 218,204,820 | | 222,048,730 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 218,204,820 | | 222,048,730 |
| 分配金 | | - | | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | | 1,313,993,002 | | 1,336,911,878 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。 |
| 2. 費用・収益の計上基準 | 有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。 |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年7月15日を計算期間の末日としておりますが、該日が休業日のため、当計算期間末日を2023年7月18日としております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 期別 | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|----------------------------|--|--|
| 1. 受益権の総数 | 4,116,323,762口 | 4,070,613,773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) 1.3192円 (13,192円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3284円 (13,284円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第22期 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 第23期 自 2022年7月16日 至 2023年7月18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 |
| 2. 分配金の計算過程 | 計算期間末における経費控除後の配当等収益(2,969,914円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,045,753,459円)及び分配準備積立金(265,269,629円)より分配対象収益は1,313,993,002円(1万口当たり3,192.13円)ですが、分配を行っておりません。 | 計算期間末における経費控除後の配当等収益(25,478,763円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,085,016,359円)及び分配準備積立金(226,416,756円)より分配対象収益は1,336,911,878円(1万口当たり3,284.28円)ですが、分配を行っておりません。 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第22期 | 第23期 |
|----------------------------|---|------------------------------|
| | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> | 同左 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> | 同左 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|------------|--|---|
| | 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <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 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|----------------------|----------------------|
| 該当事項はありません。 | 同左 |

（その他の注記）

| 項目 | 第22期 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 第23期 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|-----------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| | 期首元本額 | 3,999,382,011円 |
| 期中追加設定元本額 | 765,693,880円 | 651,604,071円 |
| 期中一部解約元本額 | 648,752,129円 | 697,314,060円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 第22期 2022年7月15日現在 | 第23期 2023年7月18日現在 |
|-----------|----------------------|----------------------|
| | 当期の損益に含まれた評価差額（円） | 当期の損益に含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 30,728,095 | 73,028,236 |

| | | |
|----|------------|------------|
| 合計 | 30,728,095 | 73,028,236 |
|----|------------|------------|

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2023年7月18日現在

| 種 類 | 銘 柄 | 券面総額 | 評価額 (円) | 備考 |
|-----------|-----------------------------|---------------|---------------|----|
| 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 | 26,774,515 | 110,629,618 | |
| | 損保ジャパン日本債券マザーファンド | 2,771,676,289 | 3,880,346,804 | |
| | 損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド | 469,249,961 | 855,677,303 | |
| | S J A Mラージキャップ・バリュー・マザーファンド | 72,457,936 | 214,569,685 | |
| | S J A Mスモールキャップ・マザーファンド | 60,437,784 | 219,914,964 | |
| 合計 | | 3,400,596,485 | 5,281,138,374 | |

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

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

| | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|-------------|----------------|----------------|
| 科 目 | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | - | 357,412,727 |
| コール・ローン | 374,774,641 | - |
| 株式 | 39,820,774,580 | 32,929,236,960 |
| 未収配当金 | 33,438,000 | 41,828,400 |
| 流動資産合計 | 40,228,987,221 | 33,328,478,087 |
| 資産合計 | 40,228,987,221 | 33,328,478,087 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 64,590,126 | - |
| 未払利息 | 1,129 | - |
| その他未払費用 | 48,457 | 11,074 |
| 流動負債合計 | 64,639,712 | 11,074 |
| 負債合計 | 64,639,712 | 11,074 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 17,267,476,729 | 11,254,715,997 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 22,896,870,780 | 22,073,751,016 |
| 元本等合計 | 40,164,347,509 | 33,328,467,013 |
| 純資産合計 | 40,164,347,509 | 33,328,467,013 |
| 負債純資産合計 | 40,228,987,221 | 33,328,478,087 |

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 | 2022年7月15日現在 | | 2023年7月18日現在 | |
|----------------------------|---------------------------|----------------------|---------------------------|----------------------|
| 1. 受益権の総数 | | 17,267,476,729口 | | 11,254,715,997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) | 2.3260円 (23,260円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 2.9613円 (29,613円) |

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|--------------------------|---|------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>（1）金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>（2）金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> | 同左 |

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|---------------------------|--|------------------------------|
| 3．金融商品に係るリスク管理体制 | <p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> | 同左 |
| 4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|---------------------|---|--------------|
| 1．貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |

| 項目 | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|------------|--|--------------|
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 | 同左 |

(関連当事者との取引に関する注記)

| 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|--------------|--------------|
| 該当事項はありません。 | 同左 |

(その他の注記)

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|--|------------------------------|------------------------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 21,880,170,683円 | 17,267,476,729円 |
| 同期中追加設定元本額 | 6,876,575,486円 | 1,099,872,896円 |
| 同期中一部解約元本額 | 11,489,269,440円 | 7,112,633,628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・ファンド(F o F s用)(適格機関投資家専用) | 11,879,495,307円 | 5,900,357,943円 |
| ハッピーエイジング20 | 1,643,900,535円 | 1,746,410,960円 |
| ハッピーエイジング30 | 1,582,508,315円 | 1,561,113,070円 |
| ハッピーエイジング40 | 1,381,043,630円 | 1,291,251,930円 |
| ハッピーエイジング50 | 379,440,798円 | 339,902,027円 |
| ハッピーエイジング60 | 90,558,169円 | 72,457,936円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035 | 150,331,327円 | 161,161,419円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045 | 81,700,902円 | 98,385,486円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055 | 62,049,545円 | 72,945,879円 |
| SOMPO日本株バリュー・プラスファンド | 15,339,602円 | - 円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065 | 1,108,599円 | 10,445,037円 |

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|----------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| SOMPO世界分散ファンド(安定型) < DC 年金 > | - 円 | 103,287円 |
| SOMPO世界分散ファンド(安定成長型) < DC年金 > | - 円 | 74,357円 |
| SOMPO世界分散ファンド(成長型) < DC 年金 > | - 円 | 106,666円 |
| 計 | 17,267,476,729円 | 11,254,715,997円 |

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|----|--------------------------|--------------------------|
| | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円) |
| 株式 | 215,838,920 | 2,842,680,198 |
| 合計 | 215,838,920 | 2,842,680,198 |

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年7月18日現在

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|------------|-----------|----------|---------------|----|
| | | 単価 | 金額 | |
| 鹿島建設 | 629,200 | 2,131.00 | 1,340,825,200 | |
| 大和ハウス工業 | 95,500 | 3,669.00 | 350,389,500 | |
| 日揮ホールディングス | 439,100 | 1,868.50 | 820,458,350 | |
| 日本ハム | 183,700 | 3,945.00 | 724,696,500 | |
| 麒麟ホールディングス | 741,200 | 2,073.00 | 1,536,507,600 | |
| 東レ | 1,634,700 | 776.50 | 1,269,344,550 | |
| 王子ホールディングス | 1,318,200 | 524.70 | 691,659,540 | |

| | | | |
|---------------------|------------|----------|----------------|
| 旭化成 | 1,184,800 | 951.60 | 1,127,455,680 |
| サワイグループホールディングス | 106,600 | 3,521.00 | 375,338,600 |
| E N E O Sホールディングス | 1,005,800 | 487.90 | 490,729,820 |
| J F Eホールディングス | 255,200 | 2,022.50 | 516,142,000 |
| 住友電気工業 | 370,300 | 1,700.00 | 629,510,000 |
| 住友重機械工業 | 269,100 | 3,333.00 | 896,910,300 |
| 日本精工 | 1,469,800 | 876.10 | 1,287,691,780 |
| マキタ | 346,300 | 3,999.00 | 1,384,853,700 |
| パナソニックホールディングス | 367,400 | 1,681.50 | 617,783,100 |
| アルプスアルパイン | 378,000 | 1,247.50 | 471,555,000 |
| スタンレー電気 | 105,500 | 2,696.00 | 284,428,000 |
| 京セラ | 137,300 | 7,643.00 | 1,049,383,900 |
| アイシン | 498,800 | 4,477.00 | 2,233,127,600 |
| 本田技研工業 | 364,900 | 4,220.00 | 1,539,878,000 |
| S U B A R U | 169,900 | 2,490.50 | 423,135,950 |
| 大阪瓦斯 | 217,700 | 2,132.50 | 464,245,250 |
| ヤマトホールディングス | 283,800 | 2,623.50 | 744,549,300 |
| 日本テレビホールディングス | 393,100 | 1,336.50 | 525,378,150 |
| スズケン | 163,900 | 3,952.00 | 647,732,800 |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 1,501,900 | 590.80 | 887,322,520 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 2,391,200 | 1,083.00 | 2,589,669,600 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 289,800 | 5,249.00 | 1,521,160,200 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 361,200 | 6,406.00 | 2,313,847,200 |
| 第一生命ホールディングス | 175,500 | 2,745.00 | 481,747,500 |
| クレディセゾン | 314,700 | 2,234.00 | 703,039,800 |
| 三井不動産 | 59,700 | 2,756.50 | 164,563,050 |
| 三菱地所 | 683,000 | 1,679.00 | 1,146,757,000 |
| 総合警備保障 | 861,200 | 786.60 | 677,419,920 |
| 合計 | 19,768,000 | | 32,929,236,960 |

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

SJAMスモールキャップ・マザーファンド

貸借対照表

| | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|-------------|----------------|----------------|
| 科 目 | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | - | 148,633,105 |
| コール・ローン | 131,224,417 | - |
| 株式 | 12,649,865,400 | 15,712,176,330 |
| 未収配当金 | 22,725,500 | 25,535,900 |
| 流動資産合計 | 12,803,815,317 | 15,886,345,335 |
| 資産合計 | 12,803,815,317 | 15,886,345,335 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払利息 | 395 | - |
| その他未払費用 | 2,386 | 9,389 |
| 流動負債合計 | 2,781 | 9,389 |
| 負債合計 | 2,781 | 9,389 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 4,638,855,031 | 4,365,939,040 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 8,164,957,505 | 11,520,396,906 |
| 元本等合計 | 12,803,812,536 | 15,886,335,946 |
| 純資産合計 | 12,803,812,536 | 15,886,335,946 |
| 負債純資産合計 | 12,803,815,317 | 15,886,345,335 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | |
|-------------------|----|
| 1．有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式 |
|-------------------|----|

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

(貸借対照表に関する注記)

| 期別 | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|----------------------------|--|--|
| 1. 受益権の総数 | 4,638,855,031口 | 4,365,939,040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) 2.7601円 (27,601円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.6387円 (36,387円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|--------------------------|---|------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は(有価証券に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> | 同左 |

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|---------------------------|---|------------------------------|
| 3．金融商品に係るリスク管理体制 | <p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> | 同左 |
| 4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|---------------------|---|--------------|
| 1．貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |

| 項目 | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|------------|--|--------------|
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 | 同左 |

(関連当事者との取引に関する注記)

| 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|--------------|--------------|
| 該当事項はありません。 | 同左 |

(その他の注記)

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18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 | 4,378,241,610円 | 4,638,855,031円 |
| 同期中追加設定元本額 | 751,139,276円 | 383,098,782円 |
| 同期中一部解約元本額 | 490,525,855円 | 656,014,773円 |
| 元本の内訳* | | |
| ハッピーエイジング20 | 1,407,370,236円 | 1,413,683,642円 |
| ハッピーエイジング30 | 1,368,270,928円 | 1,276,967,744円 |
| ハッピーエイジング40 | 1,194,131,905円 | 1,056,142,733円 |
| ハッピーエイジング50 | 328,102,611円 | 278,007,117円 |
| ハッピーエイジング60 | 78,311,465円 | 60,437,784円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035 | 126,662,418円 | 131,824,018円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045 | 68,874,559円 | 80,473,334円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055 | 52,791,250円 | 59,662,074円 |
| SOMPO日本株バリュー・プラスファンド | 13,405,190円 | - 円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065 | 934,469円 | 8,513,066円 |
| SOMPO世界分散ファンド(安定型) < DC年金 > | - 円 | 81,269円 |
| SOMPO世界分散ファンド(安定成長型) < DC年金 > | - 円 | 59,501円 |

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC 年金＞ | - 円 | 86,758円 |
| 計 | 4,638,855,031円 | 4,365,939,040円 |

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|----|--------------------------|--------------------------|
| | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円） | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円） |
| 株式 | 389,795,638 | 2,642,040,417 |
| 合計 | 389,795,638 | 2,642,040,417 |

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2023年7月18日現在

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----------|---------|----------|-------------|----|
| | | 単価 | 金額 | |
| エクシオグループ | 67,700 | 2,829.00 | 191,523,300 | |
| 森永乳業 | 94,000 | 4,680.00 | 439,920,000 | |
| 東洋紡 | 96,700 | 1,033.00 | 99,891,100 | |
| 日本毛織 | 13,600 | 1,136.00 | 15,449,600 | |
| レンゴー | 17,500 | 854.10 | 14,946,750 | |
| ザ・バック | 56,600 | 3,225.00 | 182,535,000 | |
| 住友精化 | 42,500 | 4,490.00 | 190,825,000 | |
| 東亜合成 | 194,200 | 1,280.00 | 248,576,000 | |
| 日本触媒 | 19,300 | 5,305.00 | 102,386,500 | |
| カネカ | 14,500 | 3,981.00 | 57,724,500 | |

| | | | | |
|--------------------|---------|----------|-------------|--|
| 日本化薬 | 111,300 | 1,212.00 | 134,895,600 | |
| 三洋化成工業 | 4,800 | 4,230.00 | 20,304,000 | |
| 太陽ホールディングス | 37,200 | 2,580.00 | 95,976,000 | |
| D I C | 27,100 | 2,578.50 | 69,877,350 | |
| 東洋インキ S C ホールディングス | 125,800 | 2,089.00 | 262,796,200 | |
| 東和薬品 | 13,000 | 1,744.00 | 22,672,000 | |
| 杏林製薬 | 93,800 | 1,733.00 | 162,555,400 | |
| サワイグループホールディングス | 61,000 | 3,521.00 | 214,781,000 | |
| 太平洋セメント | 29,000 | 2,687.00 | 77,923,000 | |
| 共英製鋼 | 95,100 | 1,974.00 | 187,727,400 | |
| 東プレ | 120,900 | 1,566.00 | 189,329,400 | |
| ジェイテクト | 425,800 | 1,276.00 | 543,320,800 | |
| 不二越 | 40,000 | 3,775.00 | 151,000,000 | |
| 明電舎 | 29,000 | 1,995.00 | 57,855,000 | |
| マブチモーター | 96,700 | 3,909.00 | 378,000,300 | |
| E I Z O | 101,000 | 4,760.00 | 480,760,000 | |
| アルプスアルパイン | 70,600 | 1,247.50 | 88,073,500 | |
| コーセル | 148,000 | 1,240.00 | 183,520,000 | |
| イリソ電子工業 | 33,600 | 4,015.00 | 134,904,000 | |
| 市光工業 | 367,800 | 507.00 | 186,474,600 | |
| 太平洋工業 | 97,700 | 1,284.00 | 125,446,800 | |
| 豊田合成 | 197,400 | 2,694.00 | 531,795,600 | |
| エフ・シー・シー | 38,700 | 1,817.00 | 70,317,900 | |
| テイ・エス テック | 14,500 | 1,801.00 | 26,114,500 | |
| シチズン時計 | 250,000 | 871.00 | 217,750,000 | |
| フジシールインターナショナル | 36,700 | 1,504.00 | 55,196,800 | |
| リンテック | 72,500 | 2,284.00 | 165,590,000 | |
| 沖縄電力 | 77,400 | 1,112.00 | 86,068,800 | |
| 東邦瓦斯 | 66,500 | 2,416.50 | 160,697,250 | |
| セイノーホールディングス | 100,000 | 2,107.00 | 210,700,000 | |
| 日本テレビホールディングス | 348,400 | 1,336.50 | 465,636,600 | |
| テレビ朝日ホールディングス | 36,700 | 1,711.00 | 62,793,700 | |
| 日本ライフライン | 299,000 | 979.00 | 292,721,000 | |
| 東邦ホールディングス | 143,200 | 2,696.50 | 386,138,800 | |
| トラスコ中山 | 133,500 | 2,134.00 | 284,889,000 | |
| スズケン | 34,800 | 3,952.00 | 137,529,600 | |

| | | | | |
|----------------------|------------|----------|----------------|--|
| ユニテッドアローズ | 26,100 | 2,390.00 | 62,379,000 | |
| コメリ | 60,000 | 2,903.00 | 174,180,000 | |
| 青山商事 | 182,900 | 1,250.00 | 228,625,000 | |
| イズミ | 12,500 | 3,459.00 | 43,237,500 | |
| ゼビオホールディングス | 150,000 | 1,090.00 | 163,500,000 | |
| ケーズホールディングス | 209,000 | 1,257.00 | 262,713,000 | |
| パローホールディングス | 29,000 | 2,017.00 | 58,493,000 | |
| いよぎんホールディングス | 512,000 | 842.50 | 431,360,000 | |
| ちゅうぎんフィナンシャルグループ | 212,900 | 882.10 | 187,799,090 | |
| めぶきフィナンシャルグループ | 1,626,000 | 342.80 | 557,392,800 | |
| 九州フィナンシャルグループ | 580,700 | 653.50 | 379,487,450 | |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 282,600 | 1,440.00 | 406,944,000 | |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 101,600 | 3,205.00 | 325,628,000 | |
| ひろぎんホールディングス | 290,300 | 856.20 | 248,554,860 | |
| 十六フィナンシャルグループ | 52,000 | 3,165.00 | 164,580,000 | |
| 群馬銀行 | 658,100 | 541.00 | 356,032,100 | |
| 七十七銀行 | 79,300 | 2,685.00 | 212,920,500 | |
| 八十二銀行 | 808,100 | 669.80 | 541,265,380 | |
| 滋賀銀行 | 23,300 | 2,835.00 | 66,055,500 | |
| 百五銀行 | 464,500 | 443.00 | 205,773,500 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 295,200 | 1,186.50 | 350,254,800 | |
| 山陰合同銀行 | 175,400 | 857.00 | 150,317,800 | |
| 北洋銀行 | 1,064,600 | 290.00 | 308,734,000 | |
| クレディセゾン | 18,000 | 2,234.00 | 40,212,000 | |
| ゴールドクレスト | 68,700 | 1,844.00 | 126,682,800 | |
| U T グループ | 53,200 | 2,829.00 | 150,502,800 | |
| 総合警備保障 | 314,500 | 786.60 | 247,385,700 | |
| H . U . グループホールディングス | 42,900 | 2,746.00 | 117,803,400 | |
| エン・ジャパン | 150,900 | 2,543.00 | 383,738,700 | |
| ソラスト | 239,000 | 653.00 | 156,067,000 | |
| カナモト | 59,000 | 2,333.00 | 137,647,000 | |
| 合計 | 13,437,400 | | 15,712,176,330 | |

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

損保ジャパン日本債券マザーファンド

貸借対照表

| | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|-------------|----------------|----------------|
| 科 目 | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | - | 399,756,680 |
| コール・ローン | 250,204,706 | - |
| 国債証券 | 17,492,390,700 | 22,165,196,800 |
| 地方債証券 | 1,003,486,000 | 990,722,000 |
| 特殊債券 | 900,669,059 | 855,042,904 |
| 社債券 | 4,570,645,000 | 3,574,911,000 |
| 未収利息 | 26,744,596 | 31,737,353 |
| 前払費用 | 795,030 | 2,946,488 |
| 流動資産合計 | 24,244,935,091 | 28,020,313,225 |
| 資産合計 | 24,244,935,091 | 28,020,313,225 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払利息 | 754 | - |
| その他未払費用 | 5,396 | 12,219 |
| 流動負債合計 | 6,150 | 12,219 |
| 負債合計 | 6,150 | 12,219 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 17,116,439,892 | 20,014,367,959 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 7,128,489,049 | 8,005,933,047 |
| 元本等合計 | 24,244,928,941 | 28,020,301,006 |
| 純資産合計 | 24,244,928,941 | 28,020,301,006 |
| 負債純資産合計 | 24,244,935,091 | 28,020,313,225 |

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 | 2022年7月15日現在 | | 2023年7月18日現在 | |
|----------------------------|---|---|-----------------|--|
| 1. 受益権の総数 | 17,116,439,892口 | | 20,014,367,959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 1.4165円 (1万口当たり純資産額) (14,165円) | 1口当たり純資産額 1.4000円 (1万口当たり純資産額) (14,000円) | | |

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|--------------------------|---|------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | <p>当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。</p> | |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>同左</p> <p>（1）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>（2）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> | |

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|---------------------------|--|------------------------------|
| 3．金融商品に係るリスク管理体制 | <p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> | 同左 |
| 4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|---------------------|---|--------------|
| 1．貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |

| 項目 | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|------------|--|--------------|
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 | 同左 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|--------------|--------------|
| 該当事項はありません。 | 同左 |

（その他の注記）

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18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 | 16,154,207,306円 | 17,116,439,892円 |
| 同期中追加設定元本額 | 3,893,291,405円 | 4,167,154,478円 |
| 同期中一部解約元本額 | 2,931,058,819円 | 1,269,226,411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） | 183,953,697円 | 175,546,001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） | 16,935,801円 | 29,504,992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） | 46,694,043円 | 72,139,249円 |
| 損保ジャパン国内債券ファンド（適格機関投資家専用） | 1,402,216,872円 | 2,018,765,203円 |
| マルチアセット戦略ファンド（4%型）（非課税適格機関投資家専用） | 151,492,862円 | 255,120,264円 |
| 損保ジャパン日本債券ファンド | 1,028,082,252円 | 987,722,964円 |
| ハッピーエイジング20 | 212,761,297円 | 279,458,435円 |
| ハッピーエイジング30 | 977,861,146円 | 1,193,294,452円 |
| ハッピーエイジング40 | 4,996,790,493円 | 5,778,688,836円 |
| ハッピーエイジング50 | 3,869,293,417円 | 4,286,893,538円 |
| ハッピーエイジング60 | 2,770,527,646円 | 2,771,676,289円 |

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|-----------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| 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 | 853,167円 | - 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 | 7,134,805円 | - 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 | 119,066,941円 | 123,634,912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 | 8,453,357円 | 13,146,595円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035 | 865,223,283円 | 1,271,679,781円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045 | 272,099,329円 | 442,556,466円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055 | 91,939,162円 | 157,761,650円 |
| ターゲット・リターン戦略ファンド | 94,491,593円 | 147,650,347円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065 | 568,729円 | 6,576,522円 |
| SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞ | - 円 | 1,937,127円 |
| SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞ | - 円 | 407,277円 |
| SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞ | - 円 | 207,059円 |
| 計 | 17,116,439,892円 | 20,014,367,959円 |

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|-------|--------------------------|--------------------------|
| | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円） | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円） |
| 国債証券 | 520,836,400 | 210,323,700 |
| 地方債証券 | 17,745,000 | 12,764,000 |
| 特殊債券 | 14,041,122 | 8,655,589 |
| 社債券 | 69,932,000 | 16,148,000 |
| 合計 | 622,554,522 | 247,891,289 |

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2023年7月18日現在

| 種 類 | 銘 柄 | 券面総額 (円) | 評価額 (円) | 備考 |
|----------------|----------------|-------------|-------------|----|
| 国債証券 | 第444回利付国債(2年) | 200,000,000 | 200,276,000 | |
| | 第447回利付国債(2年) | 190,000,000 | 190,209,000 | |
| | 第449回利付国債(2年) | 380,000,000 | 380,353,400 | |
| | 第144回利付国債(5年) | 200,000,000 | 200,594,000 | |
| | 第145回利付国債(5年) | 100,000,000 | 100,326,000 | |
| | 第147回利付国債(5年) | 300,000,000 | 300,360,000 | |
| | 第148回利付国債(5年) | 620,000,000 | 620,719,200 | |
| | 第150回利付国債(5年) | 800,000,000 | 800,544,000 | |
| | 第154回利付国債(5年) | 450,000,000 | 451,120,500 | |
| | 第156回利付国債(5年) | 300,000,000 | 301,785,000 | |
| | 第157回利付国債(5年) | 100,000,000 | 100,488,000 | |
| | 第158回利付国債(5年) | 520,000,000 | 520,000,000 | |
| | 第10回利付国債(40年) | 100,000,000 | 85,619,000 | |
| | 第11回利付国債(40年) | 100,000,000 | 82,436,000 | |
| | 第12回利付国債(40年) | 130,000,000 | 95,572,100 | |
| | 第14回利付国債(40年) | 180,000,000 | 139,465,800 | |
| | 第15回利付国債(40年) | 110,000,000 | 93,784,900 | |
| | 第349回利付国債(10年) | 120,000,000 | 120,184,800 | |
| | 第350回利付国債(10年) | 300,000,000 | 300,069,000 | |
| | 第351回利付国債(10年) | 950,000,000 | 948,603,500 | |
| | 第352回利付国債(10年) | 850,000,000 | 848,028,000 | |
| | 第357回利付国債(10年) | 400,000,000 | 396,332,000 | |
| 第359回利付国債(10年) | 250,000,000 | 246,860,000 | | |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第360回利付国債(10年) | 1,410,000,000 | 1,388,243,700 | |
| 第361回利付国債(10年) | 800,000,000 | 785,528,000 | |
| 第362回利付国債(10年) | 100,000,000 | 97,950,000 | |
| 第364回利付国債(10年) | 1,200,000,000 | 1,170,120,000 | |
| 第365回利付国債(10年) | 450,000,000 | 437,926,500 | |
| 第366回利付国債(10年) | 540,000,000 | 529,173,000 | |
| 第367回利付国債(10年) | 450,000,000 | 440,347,500 | |
| 第368回利付国債(10年) | 700,000,000 | 683,977,000 | |
| 第369回利付国債(10年) | 700,000,000 | 702,842,000 | |
| 第38回利付国債(30年) | 100,000,000 | 111,770,000 | |
| 第43回利付国債(30年) | 240,000,000 | 263,592,000 | |
| 第49回利付国債(30年) | 200,000,000 | 207,250,000 | |
| 第55回利付国債(30年) | 50,000,000 | 45,314,000 | |
| 第57回利付国債(30年) | 120,000,000 | 108,175,200 | |
| 第58回利付国債(30年) | 300,000,000 | 269,463,000 | |
| 第60回利付国債(30年) | 210,000,000 | 191,883,300 | |
| 第61回利付国債(30年) | 100,000,000 | 86,794,000 | |
| 第63回利付国債(30年) | 150,000,000 | 119,650,500 | |
| 第66回利付国債(30年) | 20,000,000 | 15,764,200 | |
| 第67回利付国債(30年) | 200,000,000 | 165,798,000 | |
| 第68回利付国債(30年) | 190,000,000 | 156,989,400 | |
| 第70回利付国債(30年) | 100,000,000 | 84,605,000 | |
| 第71回利付国債(30年) | 90,000,000 | 75,980,700 | |
| 第72回利付国債(30年) | 100,000,000 | 84,323,000 | |
| 第74回利付国債(30年) | 110,000,000 | 100,178,100 | |
| 第75回利付国債(30年) | 130,000,000 | 127,454,600 | |
| 第76回利付国債(30年) | 290,000,000 | 290,901,900 | |
| 第77回利付国債(30年) | 120,000,000 | 126,051,600 | |
| 第113回利付国債(20年) | 180,000,000 | 200,667,600 | |
| 第130回利付国債(20年) | 10,000,000 | 11,116,700 | |
| 第131回利付国債(20年) | 30,000,000 | 33,112,500 | |
| 第145回利付国債(20年) | 270,000,000 | 300,763,800 | |
| 第148回利付国債(20年) | 50,000,000 | 54,731,500 | |
| 第149回利付国債(20年) | 40,000,000 | 43,779,200 | |
| 第150回利付国債(20年) | 320,000,000 | 346,803,200 | |
| 第151回利付国債(20年) | 860,000,000 | 912,718,000 | |

| | | | | |
|----------|---------------------------------|----------------|----------------|--|
| | 第152回利付国債(20年) | 170,000,000 | 180,237,400 | |
| | 第154回利付国債(20年) | 780,000,000 | 825,591,000 | |
| | 第158回利付国債(20年) | 320,000,000 | 309,296,000 | |
| | 第159回利付国債(20年) | 450,000,000 | 439,623,000 | |
| | 第167回利付国債(20年) | 270,000,000 | 254,167,200 | |
| | 第170回利付国債(20年) | 240,000,000 | 216,460,800 | |
| | 第171回利付国債(20年) | 200,000,000 | 179,744,000 | |
| | 第174回利付国債(20年) | 250,000,000 | 225,862,500 | |
| | 第176回利付国債(20年) | 200,000,000 | 182,516,000 | |
| | 第179回利付国債(20年) | 50,000,000 | 45,231,000 | |
| | 第180回利付国債(20年) | 180,000,000 | 171,502,200 | |
| | 第181回利付国債(20年) | 80,000,000 | 77,372,800 | |
| | 第182回利付国債(20年) | 290,000,000 | 289,768,000 | |
| | 第183回利付国債(20年) | 450,000,000 | 472,356,000 | |
| 国債証券 合計 | | 22,510,000,000 | 22,165,196,800 | |
| 地方債証券 | 第807回東京都公募公債 | 400,000,000 | 390,340,000 | |
| | 令和2年度第10回愛知県公募公債(10年) | 200,000,000 | 195,220,000 | |
| | 第15回埼玉県公募公債(20年) | 100,000,000 | 103,347,000 | |
| | 第135回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 301,815,000 | |
| 地方債証券 合計 | | 1,000,000,000 | 990,722,000 | |
| 特殊債券 | 第3回地方公共団体金融機構債券(15年) | 300,000,000 | 313,263,000 | |
| | 第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年) | 400,000,000 | 399,968,000 | |
| | 第78回地方公共団体金融機構債券(20年) | 100,000,000 | 87,490,000 | |
| | 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 18,304,000 | 19,001,382 | |
| | 第65回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 34,404,000 | 35,320,522 | |
| 特殊債券 合計 | | 852,708,000 | 855,042,904 | |
| 社債券 | 第1回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債(劣後特約付) | 100,000,000 | 100,370,000 | |
| | 第10回ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー期限前償還 | 100,000,000 | 99,661,000 | |
| | 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 | 200,578,000 | |
| | 第1回帝人株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 100,000,000 | 96,140,000 | |
| | 第1回大陽日酸株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社 | 100,000,000 | 100,220,000 | |

| | | | |
|------------------------------------|---------------|----------------|--|
| 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 | 202,186,000 | |
| E N E O Sホールディングス株式会社第1回利払繰延条項・期限前 | 200,000,000 | 197,536,000 | |
| 日本製鉄株式会社第1回無担保社債(劣後特約付)FR | 100,000,000 | 100,008,000 | |
| 第1回ジェイエフイーホールディングス無担保社債(劣後特約付) | 200,000,000 | 195,854,000 | |
| 第2回パナソニック株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担 | 100,000,000 | 97,510,000 | |
| 第1回ドンキホーテホールディングス無担保社債(劣後特約付) | 100,000,000 | 100,273,000 | |
| 第1回ニプロ利払繰延条項・期限前償還条項付無担 | 100,000,000 | 99,642,000 | |
| 第27回SBIホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定) | 200,000,000 | 199,916,000 | |
| 第64回アイフル株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約) | 100,000,000 | 100,131,000 | |
| 第2回株式会社T&Dホールディングス無担保社債(劣後特約付) | 100,000,000 | 99,708,000 | |
| 第1回株式会社商船三井利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社 | 100,000,000 | 101,069,000 | |
| 第1回関西電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社 | 200,000,000 | 198,998,000 | |
| 第1回中国電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社 | 100,000,000 | 94,482,000 | |
| 第1回東北電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社 | 200,000,000 | 203,670,000 | |
| 第1回九州電力株式会社利払繰延条項・期限前 | 200,000,000 | 200,488,000 | |
| 第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付) | 100,000,000 | 99,983,000 | |
| 第65回東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付) | 200,000,000 | 199,866,000 | |
| 第3回第一生命ホールディングス永久社債(劣後特約付) | 200,000,000 | 190,542,000 | |
| 第3回A号富国生命劣後FR | 200,000,000 | 197,606,000 | |
| 大樹生命保険株式会社第1回利払繰延条項・期限前 | 100,000,000 | 98,474,000 | |
| 社債券 合計 | 3,600,000,000 | 3,574,911,000 | |
| 合計 | | 27,585,872,704 | |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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 | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|-------------|----------------|----------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 45,887,725 | 73,350,438 |
| 金銭信託 | - | 22,744,682 |
| コール・ローン | 32,937,604 | - |
| 国債証券 | 10,881,883,617 | 12,326,266,829 |
| 未収利息 | 73,800,500 | 79,941,862 |
| 前払費用 | 12,504,589 | 32,926,826 |
| 流動資産合計 | 11,047,014,035 | 12,535,230,637 |
| 資産合計 | 11,047,014,035 | 12,535,230,637 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払利息 | 99 | - |
| その他未払費用 | 2,774 | 3,034 |
| 流動負債合計 | 2,873 | 3,034 |
| 負債合計 | 2,873 | 3,034 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 6,017,631,324 | 6,874,125,125 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 5,029,379,838 | 5,661,102,478 |
| 元本等合計 | 11,047,011,162 | 12,535,227,603 |
| 純資産合計 | 11,047,011,162 | 12,535,227,603 |
| 負債純資産合計 | 11,047,014,035 | 12,535,230,637 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | |
|--------------------|------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券 |
|--------------------|------|

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

(貸借対照表に関する注記)

| 期別 | 2022年7月15日現在 | | 2023年7月18日現在 | |
|----------------------------|---------------------------|----------------------|---------------------------|----------------------|
| 1. 受益権の総数 | 6,017,631,324口 | | 6,874,125,125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) | 1.8358円 (18,358円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.8235円 (18,235円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|-----------------|--|------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。 | |

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|--------------------------|---|------------------------------|
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。</p> <p>為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> | 同左 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> | 同左 |

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|----------------------------|--|------------------------------|
| 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。 | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|----------------------|--|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 | 同左 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|--------------|--------------|
| 該当事項はありません。 | 同左 |

（その他の注記）

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18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 | 5,665,562,447円 | 6,017,631,324円 |
| 同期中追加設定元本額 | 749,547,449円 | 1,100,681,132円 |
| 同期中一部解約元本額 | 397,478,572円 | 244,187,331円 |
| 元本の内訳* | | |

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| SNAM絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用） | 68,189,678円 | 65,567,474円 |
| ハッピーエイジング20 | 501,318,508円 | 633,117,982円 |
| ハッピーエイジング30 | 1,920,027,492円 | 2,252,688,094円 |
| ハッピーエイジング40 | 1,783,789,953円 | 1,983,477,615円 |
| ハッピーエイジング50 | 586,425,430円 | 624,716,025円 |
| ハッピーエイジング60 | 483,521,354円 | 469,249,961円 |
| 損保ジャパン外国債券ファンド（為替ヘッジなし） | 420,490,039円 | 442,468,887円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035 | 210,369,272円 | 334,003,690円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045 | 27,753,497円 | 42,753,152円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055 | 15,495,840円 | 22,739,075円 |
| SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065 | 250,261円 | 2,771,964円 |
| SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞ | - 円 | 153,864円 |
| SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞ | - 円 | 105,153円 |
| SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞ | - 円 | 312,189円 |
| 計 | 6,017,631,324円 | 6,874,125,125円 |

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|------|--------------------------|--------------------------|
| | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円） | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円） |
| 国債証券 | 1,091,887,776 | 521,848,450 |
| 合計 | 1,091,887,776 | 521,848,450 |

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2023年7月18日現在

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---------------------|-----------|-----------------------|-----------|--------------|----|
| 国債証券 | ドル | Treasury 0.75 260331 | 2,520,000 | 2,288,967.18 | |
| | | Treasury 1.25 310815 | 900,000 | 740,636.72 | |
| | | Treasury 1.5 270131 | 1,800,000 | 1,639,828.11 | |
| | | Treasury 1.5 300215 | 30,000 | 25,816.40 | |
| | | Treasury 1.625 310515 | 1,090,000 | 929,693.36 | |
| | | Treasury 1.75 291115 | 4,950,000 | 4,363,734.37 | |
| | | Treasury 1.75 410815 | 2,730,000 | 1,907,694.13 | |
| | | Treasury 1.875 260630 | 540,000 | 503,697.65 | |
| | | Treasury 2.0 261115 | 150,000 | 139,517.57 | |
| | | Treasury 2.0 510815 | 1,160,000 | 778,378.11 | |
| | | Treasury 2.125 250515 | 280,000 | 266,754.68 | |
| | | Treasury 2.25 270215 | 1,460,000 | 1,364,814.84 | |
| | | Treasury 2.25 270815 | 100,000 | 92,972.65 | |
| | | Treasury 2.375 290515 | 1,310,000 | 1,201,157.41 | |
| | | Treasury 2.75 250228 | 690,000 | 666,577.73 | |
| | | Treasury 2.75 280215 | 3,760,000 | 3,552,171.86 | |
| | | Treasury 2.75 320815 | 50,000 | 45,910.15 | |
| | | Treasury 2.75 421115 | 485,000 | 396,695.89 | |
| | | Treasury 2.75 470815 | 440,000 | 349,215.62 | |
| | | Treasury 2.875 430515 | 620,000 | 514,769.53 | |
| | | Treasury 2.875 490515 | 1,040,000 | 847,965.62 | |
| | | Treasury 3.0 441115 | 500,000 | 419,355.47 | |
| | | Treasury 3.0 450515 | 75,000 | 62,727.53 | |
| Treasury 3.0 480215 | 1,340,000 | 1,114,241.40 | | | |
| Treasury 3.0 520815 | 600,000 | 502,734.37 | | | |

| | | | |
|--------|-----------------------|------------|----------------------------------|
| | Treasury 3.125 290831 | 4,400,000 | 4,197,875.00 |
| | Treasury 3.375 330515 | 80,000 | 77,175.00 |
| | Treasury 3.5 390215 | 195,000 | 186,217.38 |
| | Treasury 3.75 300531 | 80,000 | 79,175.00 |
| | Treasury 4.0 521115 | 1,670,000 | 1,692,179.68 |
| | Treasury 4.125 250131 | 8,920,000 | 8,798,743.74 |
| | Treasury 4.125 321115 | 4,170,000 | 4,266,431.25 |
| | Treasury 4.625 400215 | 220,000 | 238,837.50 |
| | Treasury 6.125 271115 | 60,000 | 64,736.71 |
| ドル | 合計 | 48,415,000 | 44,317,399.61 (6,154,800,457) |
| カナダドル | CANADA 0.5 301201 | 1,170,000 | 944,884.31 |
| | CANADA 3.5 451201 | 90,000 | 91,939.05 |
| | CANADA 5.0 370601 | 130,000 | 152,611.48 |
| | CANADA 5.75 290601 | 860,000 | 958,558.69 |
| カナダドル | 合計 | 2,250,000 | 2,147,993.53 (226,076,319) |
| メキシコペソ | MEXICO 8.5 290531 | 16,000,000 | 15,822,560.00 |
| メキシコペソ | 合計 | 16,000,000 | 15,822,560.00 (131,393,702) |
| ユーロ | AUSTRIA 0.75 261020 | 460,000 | 427,133.92 |
| | AUSTRIA 3.8 620126 | 50,000 | 56,666.00 |
| | AUSTRIA 4.15 370315 | 250,000 | 275,527.50 |
| | BELGIUM 0.8 270622 | 250,000 | 229,786.00 |
| | BELGIUM 3.0 340622 | 880,000 | 864,600.00 |
| | BELGIUM 4.25 410328 | 155,000 | 172,505.70 |
| | BELGIUM 5.0 350328 | 45,000 | 52,601.49 |
| | BELGIUM 5.5 280328 | 100,000 | 111,129.20 |
| | FINLAND 0.75 310415 | 360,000 | 305,749.44 |
| | FRA 0.75 281125 | 800,000 | 715,593.06 |
| | FRANCE 0.0 250225 | 2,470,000 | 2,341,258.66 |
| | FRANCE 0.0 291125 | 590,000 | 492,434.06 |
| | FRANCE 0.0 320525 | 10,000 | 7,734.80 |
| | FRANCE 0.25 261125 | 100,000 | 91,132.80 |
| | FRANCE 0.75 520525 | 130,000 | 68,897.92 |
| | FRANCE 1.0 270525 | 100,000 | 92,778.00 |

| | | | |
|---------------------|-----------|--------------|--|
| FRANCE 1.25 340525 | 430,000 | 358,218.90 | |
| FRANCE 2.0 321125 | 880,000 | 810,668.32 | |
| FRANCE 2.75 271025 | 10,000 | 9,913.34 | |
| FRANCE 3.0 330525 | 50,000 | 49,930.00 | |
| FRANCE 3.25 450525 | 110,000 | 108,442.18 | |
| FRANCE 4.0 381025 | 250,000 | 272,400.00 | |
| FRANCE 4.0 550425 | 320,000 | 357,822.08 | |
| FRANCE 4.0 600425 | 280,000 | 317,501.35 | |
| FRANCE 4.5 410425 | 60,000 | 69,579.60 | |
| FRANCE 5.5 290425 | 35,000 | 39,697.70 | |
| FRANCE 5.75 321025 | 265,000 | 323,599.15 | |
| GERMANY 0 310215 | 430,000 | 358,448.86 | |
| GERMANY 0.0 261009 | 3,020,000 | 2,759,603.52 | |
| GERMANY 0.0 310815 | 130,000 | 107,156.92 | |
| GERMANY 0.0 500815 | 180,000 | 93,648.60 | |
| GERMANY 0.25 290215 | 620,000 | 547,865.48 | |
| GERMANY 1.7 320815 | 450,000 | 423,360.00 | |
| GERMANY 2.3 330215 | 400,000 | 394,742.40 | |
| GERMANY 2.5 460815 | 490,000 | 488,437.88 | |
| GERMANY 4.0 370104 | 310,000 | 359,841.80 | |
| IRELAND 1.0 260515 | 310,000 | 293,036.80 | |
| IRELAND 2.0 450218 | 210,000 | 168,277.20 | |
| ITALY 0.95 320601 | 1,190,000 | 923,463.80 | |
| ITALY 1.45 250515 | 2,710,000 | 2,604,039.00 | |
| ITALY 2.0 251201 | 18,000 | 17,328.84 | |
| ITALY 2.2 270601 | 50,000 | 47,385.60 | |
| ITALY 2.45 330901 | 400,000 | 346,280.00 | |
| ITALY 2.7 470301 | 230,000 | 175,030.00 | |
| ITALY 2.8 281201 | 550,000 | 525,599.80 | |
| ITALY 2.8 670301 | 160,000 | 111,035.52 | |
| ITALY 3.25 460901 | 240,000 | 201,607.68 | |
| ITALY 4.0 370201 | 370,000 | 360,733.01 | |
| ITALY 4.75 440901 | 30,000 | 31,262.46 | |
| ITALY 5.0 400901 | 515,000 | 553,630.15 | |
| ITALY 7.25 261101 | 115,000 | 127,548.80 | |

| | | | | |
|-----|-------------------------|------------|---------------|-----------------|
| | NETHERLANDS 0.5 260715 | 310,000 | 287,952.80 | |
| | NETHERLANDS 2.5 330115 | 530,000 | 518,028.36 | |
| | NETHERLANDS 2.75 470115 | 150,000 | 149,435.70 | |
| | NETHERLANDS 4.0 370115 | 60,000 | 67,446.00 | |
| | NETHERLANDS 5.5 280115 | 125,000 | 138,518.75 | |
| | SPAIN 0.0 260131 | 10,000 | 9,191.00 | |
| | SPAIN 0.0 280131 | 1,860,000 | 1,606,854.00 | |
| | SPAIN 0.25 240730 | 330,000 | 318,373.44 | |
| | SPAIN 0.5 311031 | 1,290,000 | 1,026,566.52 | |
| | SPAIN 1.5 270430 | 220,000 | 206,213.48 | |
| | SPAIN 2.15 251031 | 10,000 | 9,740.94 | |
| | SPAIN 3.45 660730 | 120,000 | 106,792.80 | |
| | SPAIN 4.2 370131 | 120,000 | 126,569.28 | |
| | SPAIN 4.7 410730 | 515,000 | 573,930.42 | |
| | SPAIN 5.15 281031 | 55,000 | 59,944.06 | |
| | SPAIN 5.75 320730 | 10,000 | 11,825.48 | |
| ユーロ | 合計 | 28,283,000 | 26,260,048.32 | (4,101,031,746) |
| ポンド | UK GILT 1.5 260722 | 580,000 | 526,002.00 | |
| | UK GILT 3.5 450122 | 390,000 | 329,600.54 | |
| | UK GILT 4.0 600122 | 340,000 | 312,583.42 | |
| | UK GILT 4.25 271207 | 90,000 | 88,173.00 | |
| | UK GILT 4.25 320607 | 480,000 | 475,824.00 | |
| | UK GILT 4.25 360307 | 269,000 | 262,148.40 | |
| | UK GILT 4.25 390907 | 380,000 | 363,432.00 | |
| | UK GILT 4.25 401207 | 100,000 | 95,528.00 | |
| | UK GILT 4.25 461207 | 71,000 | 67,139.95 | |
| | UK GILT 4.25 491207 | 160,000 | 151,470.40 | |
| | UK GILT 4.25 551207 | 70,000 | 66,951.50 | |
| | UK GILT 4.5 340907 | 125,000 | 125,357.90 | |
| | UK GILT 4.5 421207 | 70,000 | 68,866.70 | |
| | UK GILT 6.0 281207 | 60,000 | 63,829.86 | |
| | UK GILT 0.25 310731 | 90,000 | 64,891.44 | |
| | UK GILT 1.625 711022 | 100,000 | 46,818.60 | |
| ポンド | 合計 | 3,375,000 | 3,108,617.71 | |

| | | | |
|----------------|------------------------|------------|------------------------------------|
| | | | (564,835,837) |
| スウェーデンクローナ | SWEDEN 2.5 250512 | 1,610,000 | 1,583,019.62 |
| | SWEDEN 3.5 390330 | 400,000 | 445,600.00 |
| スウェーデンクローナ 合計 | | 2,010,000 | 2,028,619.62 (27,508,082) |
| ノルウェークローネ | NORWAY 1.375 300819 | 2,100,000 | 1,785,252.00 |
| ノルウェークローネ 合計 | | 2,100,000 | 1,785,252.00 (24,636,477) |
| デンマーククローネ | DENMARK 4.5 391115 | 1,460,000 | 1,779,796.64 |
| デンマーククローネ 合計 | | 1,460,000 | 1,779,796.64 (37,304,537) |
| ポーランドズロチ | POLAND 2.5 260725 | 2,100,000 | 1,943,550.00 |
| ポーランドズロチ 合計 | | 2,100,000 | 1,943,550.00 (68,348,045) |
| オーストラリアドル | AUSTRALIA 3.25 250421 | 370,000 | 364,756.50 |
| | AUSTRALIA 3.75 370421 | 950,000 | 913,307.24 |
| | AUSTRALIA 4.75 270421 | 790,000 | 813,458.02 |
| オーストラリアドル 合計 | | 2,110,000 | 2,091,521.76 (197,983,449) |
| シンガポールドル | SINGAPORE 2.875 290701 | 400,000 | 395,800.00 |
| シンガポールドル 合計 | | 400,000 | 395,800.00 (41,594,622) |
| マレーシアリングgit | MALAYSIA 3.733 280615 | 1,900,000 | 1,906,358.35 |
| | MALAYSIA 4.059 240930 | 10,000 | 10,074.54 |
| | MALAYSIA 5.248 280915 | 11,000 | 11,775.26 |
| マレーシアリングgit 合計 | | 1,921,000 | 1,928,208.15 (58,970,389) |
| オフショア人民元 | CGB 2.6 320901 | 7,000,000 | 6,936,079.92 |
| | CGB 2.8 290324 | 6,000,000 | 6,082,947.60 |
| | CGB 2.8 300325 | 7,500,000 | 7,580,740.50 |
| | CGB 2.8 321115 | 11,000,000 | 11,077,000.00 |
| | CGB 2.91 281014 | 4,000,000 | 4,085,574.00 |
| オフショア人民元 合計 | | 35,500,000 | 35,762,342.02 (691,783,167) |
| 合計 | | | 12,326,266,829 (12,326,266,829) |

（注）１．通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額です。

２．合計欄における（ ）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

３．外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入債券 時価比率 | 有価証券の合計金額に対する比率 |
|-------------|-----------|--------------|-----------------|
| ドル | 国債証券 34銘柄 | 49.10% | 49.93% |
| カナダドル | 国債証券 4銘柄 | 1.80% | 1.83% |
| メキシコペソ | 国債証券 1銘柄 | 1.05% | 1.07% |
| ユーロ | 国債証券 67銘柄 | 32.72% | 33.27% |
| ポンド | 国債証券 16銘柄 | 4.51% | 4.58% |
| スウェーデンクローナ | 国債証券 2銘柄 | 0.22% | 0.22% |
| ノルウェークローネ | 国債証券 1銘柄 | 0.20% | 0.20% |
| デンマーククローネ | 国債証券 1銘柄 | 0.30% | 0.30% |
| ポーランドズロチ | 国債証券 1銘柄 | 0.55% | 0.55% |
| オーストラリアドル | 国債証券 3銘柄 | 1.58% | 1.61% |
| シンガポールドル | 国債証券 1銘柄 | 0.33% | 0.34% |
| マレーシアリングgit | 国債証券 3銘柄 | 0.47% | 0.48% |
| オフショア人民元 | 国債証券 5銘柄 | 5.52% | 5.61% |

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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 | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|-------------|----------------|----------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 372,730,333 | 594,270,705 |
| 金銭信託 | - | 240,165,791 |
| コール・ローン | 556,715,278 | - |
| 株式 | 15,288,259,122 | 19,509,322,662 |
| 投資証券 | 877,005,672 | 842,860,303 |
| 未収配当金 | 15,772,444 | 17,221,681 |
| 流動資産合計 | 17,110,482,849 | 21,203,841,142 |
| 資産合計 | 17,110,482,849 | 21,203,841,142 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払利息 | 1,677 | - |
| その他未払費用 | 10,068 | 6,525 |
| 流動負債合計 | 11,745 | 6,525 |
| 負債合計 | 11,745 | 6,525 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 5,164,892,145 | 5,131,731,342 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 11,945,578,959 | 16,072,103,275 |
| 元本等合計 | 17,110,471,104 | 21,203,834,617 |
| 純資産合計 | 17,110,471,104 | 21,203,834,617 |
| 負債純資産合計 | 17,110,482,849 | 21,203,841,142 |

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>株式</p> <p>移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>原則として取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券等の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。計算期間末日に当該取引所の最終相場がない場合には当該取引所における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>原則として取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券等の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。計算期間末日に当該取引所の最終相場がない場合には当該取引所における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。</p> |
| 2．外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 3．費用・収益の計上基準 | 受取配当金 |

| | |
|----------------------------|---|
| 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>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p> <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> |
|----------------------------|---|

(貸借対照表に関する注記)

| 期別 | 2022年7月15日現在 | | 2023年7月18日現在 | |
|----------------------------|----------------|-----------------------------------|----------------|-----------------------------------|
| 1. 受益権の総数 | 5,164,892,145口 | | 5,131,731,342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 | 3.3128円 (1万口当たり純資産額) (33,128円) | 1口当たり純資産額 | 4.1319円 (1万口当たり純資産額) (41,319円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|-----------------|--|------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。 | |

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|--------------------------|---|------------------------------|
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。</p> <p>為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> | 同左 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> | 同左 |

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|----------------------------|--|------------------------------|
| 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。 | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|----------------------|--|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 | 同左 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|--------------|--------------|
| 該当事項はありません。 | 同左 |

（その他の注記）

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18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 | 5,135,837,985円 | 5,164,892,145円 |
| 同期中追加設定元本額 | 934,300,922円 | 557,930,295円 |
| 同期中一部解約元本額 | 905,246,762円 | 591,091,098円 |
| 元本の内訳* | | |

| 項目 | 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 | 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日 |
|--|------------------------------|------------------------------|
| 損保ジャパン - T C W外国株式ファンド A コース（為替ヘッジあり） | 707,274,529円 | 649,704,029円 |
| 損保ジャパン - T C W外国株式ファンド B コース（為替ヘッジなし） | 743,999,779円 | 733,851,921円 |
| ハッピーエイジング20 | 1,478,675,733円 | 1,589,287,285円 |
| ハッピーエイジング30 | 1,081,004,742円 | 1,079,652,915円 |
| ハッピーエイジング40 | 892,861,163円 | 845,047,445円 |
| ハッピーエイジング50 | 228,675,939円 | 207,413,232円 |
| ハッピーエイジング60 | 32,400,260円 | 26,774,515円 |
| 計 | 5,164,892,145円 | 5,131,731,342円 |

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 2022年7月15日現在 | 2023年7月18日現在 |
|------|--------------------------|--------------------------|
| | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円） | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円） |
| 株式 | 2,900,350,709 | 3,659,141,247 |
| 投資証券 | 104,387,616 | 46,124,044 |
| 合計 | 3,004,738,325 | 3,613,017,203 |

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2023年7月18日現在

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|-------------------------|--------|--------|--------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| ドル | EXXON MOBIL CORP | 10,192 | 101.38 | 1,033,264.96 | |
| | BAKER HUGHES COMPANY | 29,847 | 34.65 | 1,034,198.55 | |
| | CONOCOPHILLIPS | 228 | 106.44 | 24,268.32 | |
| | MARATHON PETROLEUM CORP | 261 | 118.13 | 30,831.93 | |
| | NOV INC | 1,949 | 18.16 | 35,393.84 | |
| | CORTEVA INC | 707 | 54.59 | 38,595.13 | |

| | | | |
|------------------------------|--------|--------|--------------|
| DUPONT DE NEMOURS INC | 11,081 | 72.58 | 804,258.98 |
| FREEMONT-MCMORAN COPPER | 20,749 | 40.46 | 839,504.54 |
| LINDE PLC | 7,128 | 382.11 | 2,723,680.08 |
| AGCO CORP | 364 | 136.23 | 49,587.72 |
| ARCOSA INC | 1,127 | 75.89 | 85,528.03 |
| CARLISLE COS INC | 33 | 268.74 | 8,868.42 |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGY | 8,157 | 81.19 | 662,266.83 |
| GENERAL ELECTRIC CO. | 11,809 | 111.14 | 1,312,452.26 |
| HEICO CORP | 10,959 | 173.42 | 1,900,509.78 |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 16,869 | 69.37 | 1,170,202.53 |
| MANITOWOC COMPANY INC | 3,542 | 19.05 | 67,475.10 |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 28,708 | 88.54 | 2,541,806.32 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 3,999 | 476.53 | 1,905,643.47 |
| TEREX CORP | 612 | 62.40 | 38,188.80 |
| WABTEC CORP | 821 | 112.66 | 92,493.86 |
| JACOBS SOLUTIONS INC | 267 | 122.10 | 32,600.70 |
| TRANSUNION | 7,584 | 79.94 | 606,264.96 |
| WASTE CONNECTIONS INC | 18,111 | 141.48 | 2,562,344.28 |
| FEDEX CORP | 351 | 254.73 | 89,410.23 |
| HERTZ GLOBAL HLDGS INC | 880 | 18.14 | 15,963.20 |
| KIRBY CORP | 795 | 75.36 | 59,911.20 |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 1,699 | 53.33 | 90,607.67 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CLB | 5,832 | 182.74 | 1,065,739.68 |
| AMERICAN AXLE & MFG HOLDINGS | 2,990 | 8.67 | 25,923.30 |
| BORGWARNER INC | 1,600 | 45.40 | 72,640.00 |
| GENERAL MOTORS CO | 12,134 | 38.75 | 470,192.50 |
| PHINIA INC | 320 | 28.18 | 9,017.60 |
| DR HORTON INC | 2,931 | 128.05 | 375,314.55 |
| LENNAR CORP-CL A | 13,455 | 130.39 | 1,754,397.45 |
| NIKE INC -CL B | 7,100 | 108.71 | 771,841.00 |
| PULTEGROUP INC | 4,140 | 81.70 | 338,238.00 |
| TOLL BROTHERS INC | 4,924 | 82.72 | 407,313.28 |
| DARDEN RESTAURANTS | 8,299 | 169.25 | 1,404,605.75 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 725 | 149.00 | 108,025.00 |
| TRAVEL + LEISURE CO | 681 | 41.99 | 28,595.19 |
| WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC | 3,060 | 74.30 | 227,358.00 |
| ALPHABET, INC | 19,238 | 125.06 | 2,405,904.28 |
| COMCAST CORP-CL A | 28,301 | 42.09 | 1,191,189.09 |
| FOX CORP CLASS A | 18,625 | 33.44 | 622,820.00 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 1,734 | 40.29 | 69,862.86 |
| VIACOMCBS INC-CLASS B | 15,026 | 15.36 | 230,799.36 |
| WARNER BROS DISCOVERY INC | 58,495 | 12.31 | 720,073.45 |

| | | | |
|------------------------------|--------|----------|--------------|
| AMAZON.COM INC | 16,052 | 133.56 | 2,143,905.12 |
| DICKS SPORTING GOODS INC | 6,032 | 133.68 | 806,357.76 |
| DOLLAR TREE INC | 390 | 149.11 | 58,152.90 |
| EBAY INC | 1,150 | 47.19 | 54,268.50 |
| FOOT LOCKER INC | 1,052 | 25.33 | 26,647.16 |
| GUESS? INC | 762 | 19.73 | 15,034.26 |
| HOME DEPOT INC | 3,010 | 316.05 | 951,310.50 |
| TARGET CORP | 2,574 | 130.01 | 334,645.74 |
| ULTA BEAUTY INC | 1,681 | 472.72 | 794,642.32 |
| WILLIAMS SONOMA | 119 | 125.14 | 14,891.66 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 2,190 | 552.96 | 1,210,982.40 |
| SPROUTS FARMERS MARKET INC | 896 | 37.96 | 34,012.16 |
| CONAGRA BRANDS INC | 11,193 | 32.28 | 361,310.04 |
| KEURIG DR PEPPER INC | 11,545 | 31.61 | 364,937.45 |
| PEPSICO INC | 9,106 | 185.63 | 1,690,346.78 |
| COTY INC-CL A | 6,791 | 12.37 | 84,004.67 |
| ACADIA HEALTHCARE CO INC | 1,226 | 73.09 | 89,608.34 |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 1,441 | 370.36 | 533,688.76 |
| AMEDISYS INC | 171 | 91.03 | 15,566.13 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 16,946 | 52.61 | 891,529.06 |
| CENTENE CORP | 18,397 | 65.07 | 1,197,092.79 |
| DANAHER CORP | 9,766 | 237.76 | 2,321,964.16 |
| DEXCOM INC | 7,644 | 137.45 | 1,050,667.80 |
| ENVISTA HOLDINGS CORP | 1,279 | 35.22 | 45,046.38 |
| HENRY SCHEIN INC | 583 | 80.23 | 46,774.09 |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 2,197 | 353.84 | 777,386.48 |
| MCKESSON HBOC INC | 3,252 | 411.67 | 1,338,750.84 |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 1,987 | 299.91 | 595,921.17 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 1,989 | 484.08 | 962,835.12 |
| ABBVIE INC | 5,583 | 134.83 | 752,755.89 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 8,303 | 118.25 | 981,829.75 |
| AMGEN INC | 2,407 | 227.84 | 548,410.88 |
| GILEAD SCIENCES INC | 10,963 | 77.48 | 849,413.24 |
| IQVIA HOLDINGS INC | 4,424 | 221.37 | 979,340.88 |
| METTLER TOLEDO INTERNATIONAL | 1,183 | 1,328.46 | 1,571,568.18 |
| PERRIGO CO PLC | 1,201 | 33.20 | 39,873.20 |
| ZOETIS INC | 6,629 | 170.73 | 1,131,769.17 |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A | 49 | 1,364.00 | 66,836.00 |
| JP MORGAN CHASE & CO | 9,846 | 153.38 | 1,510,179.48 |
| POPULAR INC | 2,330 | 63.32 | 147,535.60 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 2,946 | 343.00 | 1,010,478.00 |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 15,080 | 80.94 | 1,220,575.20 |

| | | | |
|------------------------------|--------|--------|--------------|
| BANK OF NEW YORK CO INC | 6,418 | 43.54 | 279,439.72 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 3,134 | 344.25 | 1,078,879.50 |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 2,949 | 27.69 | 81,657.81 |
| EVERCORE PARTNERS INC-CL A | 388 | 133.72 | 51,883.36 |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 3,947 | 420.10 | 1,658,134.70 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 184 | 258.48 | 47,560.32 |
| INTERCONTINENTALEXCHANGE INC | 8,599 | 116.64 | 1,002,987.36 |
| MORGAN STANLEY | 7,640 | 86.37 | 659,866.80 |
| MSCI INC | 5,155 | 499.25 | 2,573,633.75 |
| ONEMAIN HOLDINGS INC | 1,340 | 47.04 | 63,033.60 |
| REDWOOD TRUST INC | 17,387 | 6.61 | 114,928.07 |
| S&P GLOBAL INC | 7,992 | 417.39 | 3,335,780.88 |
| SCHWAB(CHARLES)CORP | 10,100 | 58.64 | 592,264.00 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 2,019 | 80.61 | 162,751.59 |
| ASSURED GUARANTY LTD | 755 | 57.65 | 43,525.75 |
| METLIFE INC | 13,846 | 59.00 | 816,914.00 |
| AMERICOLD REALTY TRUST INC | 7,427 | 32.59 | 242,045.93 |
| ADOBE SYSTEMS INC | 2,188 | 522.00 | 1,142,136.00 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC | 2,218 | 92.46 | 205,076.28 |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 5,194 | 152.73 | 793,279.62 |
| DXC TECHNOLOGY CO | 1,243 | 27.96 | 34,754.28 |
| FAIR ISAAC CORP | 1,847 | 837.24 | 1,546,382.28 |
| FISERV INC | 29,420 | 128.51 | 3,780,764.20 |
| INTL BUSINESS MACHINES CO | 6,169 | 134.24 | 828,126.56 |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 6,558 | 402.20 | 2,637,627.60 |
| MICROSOFT CORP | 18,434 | 345.73 | 6,373,186.82 |
| ORACLE CORPORATION | 29,811 | 118.89 | 3,544,229.79 |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 6,582 | 73.49 | 483,711.18 |
| SALESFORCE INC | 8,352 | 228.00 | 1,904,256.00 |
| SERVICENOW INC | 3,984 | 592.38 | 2,360,041.92 |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A | 2,463 | 184.21 | 453,709.23 |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A | 43,058 | 90.69 | 3,904,930.02 |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 18,510 | 243.99 | 4,516,254.90 |
| AVNET INC | 1,606 | 49.20 | 79,015.20 |
| CORNING INC | 11,949 | 33.60 | 401,486.40 |
| FLEX LTD | 47,096 | 28.21 | 1,328,578.16 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 22,554 | 29.33 | 661,508.82 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 6,253 | 291.49 | 1,822,686.97 |
| AES CORP | 33,648 | 21.38 | 719,394.24 |
| NISOURCE INC | 10,418 | 27.47 | 286,182.46 |
| SEMPRA ENERGY | 418 | 146.12 | 61,078.16 |
| ANALOG DEVICES INC | 150 | 196.36 | 29,454.00 |

| | | | | |
|-----|--|-----------|--------|------------------------------------|
| | ASML HOLDING NV-NY REG SHS | 1,453 | 754.49 | 1,096,273.97 |
| | BROADCOM INC | 1,729 | 910.35 | 1,573,995.15 |
| | ENPHASE ENERGY INC | 2,586 | 189.67 | 490,486.62 |
| | NVIDIA CORP | 7,259 | 464.61 | 3,372,603.99 |
| | ON SEMICONDUCTOR CORP | 13,014 | 104.33 | 1,357,750.62 |
| | CBRE GROUP INC - A | 1,083 | 88.14 | 95,455.62 |
| | JONES LANG LASALLE INC | 4,703 | 168.66 | 793,207.98 |
| | ドル 小計 | 1,072,034 | | 123,261,730.22 (17,118,589,092) |
| ユーロ | NESTE OIL OYJ | 1,740 | 35.57 | 61,891.80 |
| | TOTAL SA | 5,785 | 50.96 | 294,803.60 |
| | BASF AG | 10,560 | 45.21 | 477,417.60 |
| | HEIDELBERG MATERIALS AG | 6,337 | 71.36 | 452,208.32 |
| | AIRBUS GROUP | 809 | 133.52 | 108,017.68 |
| | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | 1,752 | 57.63 | 100,967.76 |
| | SIEMENS AG | 927 | 149.92 | 138,975.84 |
| | VINCI S.A. | 3,275 | 105.52 | 345,578.00 |
| | DHL GROUP REG | 9,277 | 45.82 | 425,118.52 |
| | BAYERISCHE MOTOREN WERKE | 4,713 | 106.80 | 503,348.40 |
| | CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN | 9,452 | 27.21 | 257,188.92 |
| | CONTINENTAL AG | 3,291 | 69.24 | 227,868.84 |
| | ADIDAS-SALOMON AG | 1,856 | 172.64 | 320,419.84 |
| | KERING | 341 | 490.25 | 167,175.25 |
| | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 174 | 859.00 | 149,466.00 |
| | UNIVERSAL MUSIC GROUP BV | 2,880 | 21.18 | 60,998.40 |
| | VIVENDI | 4,891 | 8.38 | 40,996.36 |
| | INDITEX | 5,879 | 35.15 | 206,646.85 |
| | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 6,287 | 51.29 | 322,460.23 |
| | DANONE | 3,383 | 55.21 | 186,775.43 |
| | KONINKLIJKE PHILIPS NV | 3,206 | 20.20 | 64,777.23 |
| | SANOFI | 2,816 | 94.16 | 265,154.56 |
| | ING GROEP N.V. | 9,807 | 12.89 | 126,412.23 |
| | ALLIANZ AG-REG | 2,974 | 210.20 | 625,134.80 |
| | AXA | 14,372 | 26.46 | 380,283.12 |
| | MUENCHENER RUECKVER AG-RE | 619 | 335.40 | 207,612.60 |
| | SAP SE | 6,017 | 128.40 | 772,582.80 |
| | ORANGE | 18,619 | 10.50 | 195,648.45 |
| | TELEFONICA S.A. | 34,703 | 3.66 | 127,151.79 |
| | ENGIE | 11,729 | 14.98 | 175,700.42 |
| | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 3,866 | 28.94 | 111,882.04 |
| | ASML HOLDING NV | 107 | 664.70 | 71,122.90 |
| | INFINEON TECHNOLOGIES AG | 752 | 37.94 | 28,530.88 |

| | | | | |
|------------|--------------------------------|---------|----------|---------------------------------|
| | ユーロ 小計 | 193,196 | | 8,000,317.46 (1,249,409,577) |
| ポンド | BP PLC | 2,565 | 4.52 | 11,604.06 |
| | SHELL PLC-NEW | 14,299 | 23.08 | 330,020.92 |
| | RIO TINTO PLC | 7,473 | 50.86 | 380,076.78 |
| | KINGFISHER PLC | 27,134 | 2.32 | 63,140.81 |
| | BRITISH AMERICAN TOBACCO | 6,518 | 25.22 | 164,416.55 |
| | DIAGEO PLC | 5,175 | 33.47 | 173,233.12 |
| | HALEON PLC | 17,031 | 3.16 | 53,937.17 |
| | RECKITT&COLMAN PLC | 3,023 | 57.70 | 174,427.10 |
| | UNILEVER PLC | 5,746 | 40.19 | 230,960.47 |
| | GSK PLC | 17,280 | 13.18 | 227,854.08 |
| | LLOYDS BANKING GROUP PLC | 627,811 | 0.44 | 281,510.45 |
| | VODAFONE GROUP PLC | 213,101 | 0.71 | 153,198.30 |
| | ポンド 小計 | 947,156 | | 2,244,379.81 (407,803,811) |
| スイスフラン | NESTLE SA-REGISTERED-B | 5,194 | 104.74 | 544,019.56 |
| | NOVARTIS AG-REG SHS | 5,386 | 84.92 | 457,379.12 |
| | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 2,163 | 268.20 | 580,116.60 |
| | SWISS RE LTD | 1,626 | 90.38 | 146,957.88 |
| | スイスフラン 小計 | 14,369 | | 1,728,473.16 (279,165,700) |
| スウェーデンクローナ | ASSA ABLOY AB-B | 20,811 | 255.80 | 5,323,453.80 |
| | スウェーデンクローナ 小計 | 20,811 | | 5,323,453.80 (72,186,033) |
| ノルウェークローネ | TELENOR ASA | 14,595 | 104.70 | 1,528,096.50 |
| | ノルウェークローネ 小計 | 14,595 | | 1,528,096.50 (21,087,731) |
| デンマーククローネ | NOVO NORDISK A/S-B | 1,922 | 1,072.00 | 2,060,384.00 |
| | デンマーククローネ 小計 | 1,922 | | 2,060,384.00 (43,185,648) |
| オーストラリアドル | WOODSIDE ENERGY GROUP LTD | 456 | 35.94 | 16,388.64 |
| | BHP BILLITON LTD | 11,835 | 45.26 | 535,652.10 |
| | CSL LIMITED | 1,053 | 258.82 | 272,537.46 |
| | ANZ GROUP HOLDINGS LTD | 18,736 | 24.54 | 459,781.44 |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK | 6,137 | 27.12 | 166,435.44 |
| | WESTPAC BANKING CORP | 31,719 | 21.43 | 679,738.17 |
| | オーストラリアドル 小計 | 69,936 | | 2,130,533.25 (201,676,277) |
| 香港ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS | 18,128 | 47.70 | 864,705.60 |
| | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD | 15,500 | 40.85 | 633,175.00 |

| | | | | | |
|-------------|------------------------------|-----------|-------|----------------|------------------|
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 3,000 | 97.45 | 292,350.00 | |
| 香港ドル 小計 | | 36,628 | | 1,790,230.60 | (31,812,397) |
| シンガポールドル | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 5,200 | 32.47 | 168,844.00 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 20,800 | 27.71 | 576,368.00 | |
| | CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI | 17,000 | 3.41 | 57,970.00 | |
| シンガポールドル 小計 | | 43,000 | | 803,182.00 | (84,406,396) |
| 合計 | | 2,413,647 | | 19,509,322,662 | (19,509,322,662) |

(2) 株式以外の有価証券

2023年7月18日現在

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----------------|--------|-----------------------------------|---------|--------------|----|
| 投資証券 | ドル | AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 4,619 | 167,946.84 | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 6,465 | 1,204,170.90 | |
| | | APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 18,170 | 158,987.50 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 941 | 182,619.87 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 342 | 20,831.22 | |
| | | BRIGHTSPIRE CAPITAL INC | 30,729 | 219,405.06 | |
| | | CHATHAM LODGING TRUST | 13,438 | 128,736.04 | |
| | | COUSINS PROPERTIES INC | 5,063 | 119,790.58 | |
| | | EQUINIX INC | 273 | 220,466.61 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 2,838 | 192,558.30 | |
| | | GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 5,829 | 281,598.99 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 1,191 | 72,984.48 | |
| | | KILROY REALTY CORP | 776 | 25,367.44 | |
| | | KITE REALTY GROUP TRUST | 9,901 | 227,723.00 | |
| | | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 1,713 | 262,928.37 | |
| | | PROLOGIS INC | 1,305 | 167,013.90 | |
| | | REALTY INCOME CORP | 1,000 | 61,290.00 | |
| | | RITHM CAPITAL CORP | 29,239 | 278,062.89 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 4,521 | 549,979.65 | |
| | | SITE CENTERS CORP | 5,175 | 73,226.25 | |
| | | TPG RE FINANCE TRUST INC | 25,254 | 184,859.28 | |
| | | VENTAS INC | 3,133 | 150,102.03 | |
| | | VICI PROPERTIES INC | 11,710 | 369,450.50 | |
| WELLTOWER INC | 1,630 | 129,226.40 | | | |
| WEYERHAEUSER CO | 18,050 | 619,656.50 | | | |
| | | | 203,305 | 6,068,982.60 | |

| | | | | |
|----|-------|---------|---------------|---------------|
| | ドル 合計 | | (842,860,303) | |
| 合計 | | 203,305 | 842,860,303 | (842,860,303) |

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額です。

2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入株式 時価比率 | 組入 投資証券 時価比率 | 有価証券の合計金額に対す る比率 |
|------------|------|--------------|--------------------|---------------------|
| ドル | 株式 | 139銘柄 | 80.73% | 88.25% |
| | 投資証券 | 25銘柄 | 3.98% | |
| ユーロ | 株式 | 33銘柄 | 5.89% | 6.14% |
| ポンド | 株式 | 12銘柄 | 1.92% | 2.00% |
| スイスフラン | 株式 | 4銘柄 | 1.32% | 1.37% |
| スウェーデンクローナ | 株式 | 1銘柄 | 0.34% | 0.35% |
| ノルウェークローネ | 株式 | 1銘柄 | 0.10% | 0.10% |
| デンマーククローネ | 株式 | 1銘柄 | 0.20% | 0.21% |
| オーストラリアドル | 株式 | 6銘柄 | 0.95% | 0.99% |
| 香港ドル | 株式 | 3銘柄 | 0.15% | 0.16% |
| シンガポールドル | 株式 | 3銘柄 | 0.40% | 0.41% |

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

2023年7月31日現在

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 20,643,561,272円 |
| 負債総額 | 25,473,973円 |
| 純資産総額(-) | 20,618,087,299円 |
| 発行済数量 | 8,915,581,547口 |
| 1単位当りの純資産額(/) | 2.3126円 |

ハッピーエイジング30

2023年7月31日現在

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 21,699,016,723円 |
| 負債総額 | 24,335,765円 |
| 純資産総額(-) | 21,674,680,958円 |
| 発行済数量 | 10,120,120,076口 |
| 1単位当りの純資産額(/) | 2.1417円 |

ハッピーエイジング40

2023年7月31日現在

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 25,168,640,342円 |
| 負債総額 | 26,085,526円 |
| 純資産総額(-) | 25,142,554,816円 |
| 発行済数量 | 13,318,802,065口 |
| 1単位当りの純資産額(/) | 1.8877円 |

ハッピーエイジング50

2023年7月31日現在

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 10,628,712,578円 |
| 負債総額 | 24,520,822円 |
| 純資産総額(-) | 10,604,191,756円 |
| 発行済数量 | 6,576,585,287口 |
| 1単位当りの純資産額(/) | 1.6124円 |

ハッピーエイジング60

2023年7月31日現在

| | |
|-----------------|----------------|
| 資産総額 | 5,426,053,659円 |
| 負債総額 | 6,407,142円 |
| 純資産総額（ - ） | 5,419,646,517円 |
| 発行済数量 | 4,077,762,629口 |
| 1単位当りの純資産額（ / ） | 1.3291円 |

（参考）S J A Mラージキャップ・バリュー・マザーファンド

2023年7月31日現在

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 34,660,569,756円 |
| 負債総額 | 25,925円 |
| 純資産総額（ - ） | 34,660,543,831円 |
| 発行済数量 | 11,222,265,032口 |
| 1単位当りの純資産額（ / ） | 3.0886円 |

（参考）S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

2023年7月31日現在

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 16,715,694,064円 |
| 負債総額 | 14,655円 |
| 純資産総額（ - ） | 16,715,679,409円 |
| 発行済数量 | 4,334,308,205口 |
| 1単位当りの純資産額（ / ） | 3.8566円 |

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2023年7月31日現在

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 27,870,015,371円 |
| 負債総額 | 29,267円 |
| 純資産総額（ - ） | 27,869,986,104円 |
| 発行済数量 | 20,029,218,913口 |
| 1単位当りの純資産額（ / ） | 1.3915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

2023年7月31日現在

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 12,975,310,114円 |
| 負債総額 | 120,206,698円 |
| 純資産総額（ - ） | 12,855,103,416円 |
| 発行済数量 | 7,021,533,535口 |
| 1単位当りの純資産額（ / ） | 1.8308円 |

（参考）損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

2023年7月31日現在

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 21,372,669,509円 |
| 負債総額 | 19,668円 |
| 純資産総額（ - ） | 21,372,649,841円 |
| 発行済数量 | 5,067,416,498口 |
| 1単位当りの純資産額（ / ） | 4.2177円 |

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

1．名義書換

該当事項はありません。

2．受益者名簿

作成しません。

3．受益者集会

開催しません。

4．受益者に対する特典

ありません。

5．譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

6．受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

7．受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

前記の申請のある場合には、前記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

委託会社は、前記に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたとときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替

停止日や振替停止期間を設けることができます。

8. 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

9. 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

10. 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払います。

11. 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

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】

(1) 資本金の額（2023年7月末現在）

| | |
|--------------|----------|
| 資本金の額 | 1,550百万円 |
| 会社が発行する株式の総数 | 50,000株 |
| 発行済株式総数 | 24,085株 |

最近5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2023年7月末現在）

会社の意思決定機構

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

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

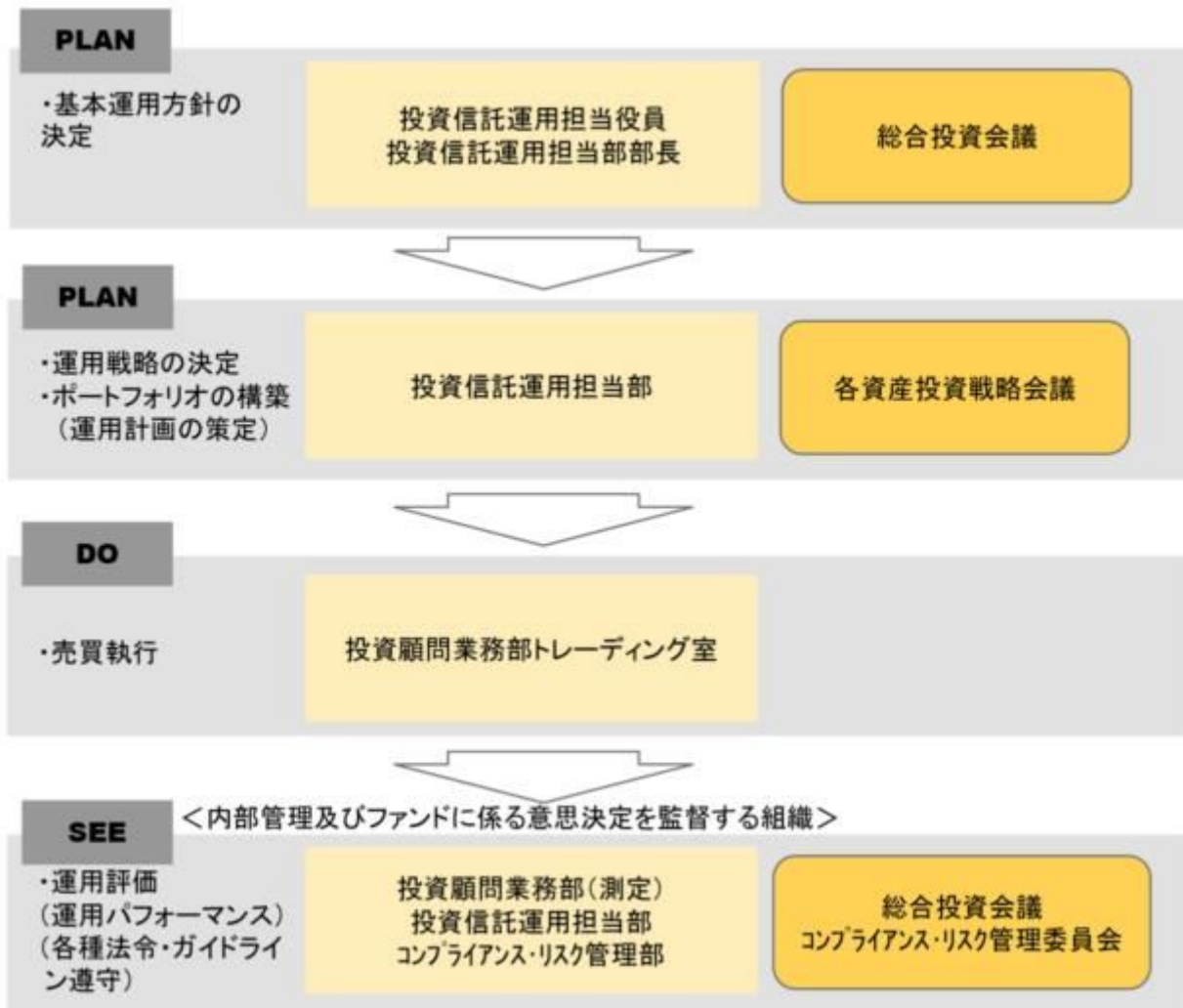
取締役会の決議によって、代表取締役を選定します。また、取締役会長、取締役社長各1名を選定することができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

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



2【事業の内容及び営業の概況】

「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2023年7月末現在、計287本（追加型株式投資信託163本、単位型株式投資信託80本、単位型公社債投資信託44本）であり、その純資産総額の合計は1,760,406百万円です。

3【委託会社等の経理状況】

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。

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(2022年4月1日から2023年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

| | 前事業年度 (2022年3月31日) | 当事業年度 (2023年3月31日) |
|--|-----------------------|-----------------------|
| | | |

| 区分 | 注記 番号 | 金額（千円） | | 金額（千円） | |
|---------------|----------|--------|-----------|--------|-----------|
| | | | | | |
| （資産の部） | | | | | |
| 流動資産 | | | | | |
| 1 現金・預金 | | | 3,870,549 | | 3,546,171 |
| 2 前払費用 | | | 102,011 | | 101,203 |
| 3 未収委託者報酬 | | | 1,137,463 | | 1,194,368 |
| 4 未収運用受託報酬 | | | 1,220,102 | | 2,618,849 |
| 5 その他 | | | 6,676 | | 3,043 |
| 流動資産合計 | | | 6,336,803 | | 7,463,635 |
| 固定資産 | | | | | |
| 1 有形固定資産 | | | | | |
| （1）建物 | 1 | | 12,438 | | 8,078 |
| （2）器具備品 | 1 | | 97,847 | | 73,225 |
| 有形固定資産合計 | | | 110,285 | | 81,304 |
| 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 | | | 551,730 | | 658,124 |
| （2）長期差入保証金 | | | 173,961 | | 173,961 |
| （3）繰延税金資産 | | | 369,976 | | 348,349 |
| （4）その他 | | | 32 | | 32 |
| 投資その他の資産合計 | | | 1,095,700 | | 1,180,467 |
| 固定資産合計 | | | 1,210,521 | | 1,266,307 |
| 資産合計 | | | 7,547,325 | | 8,729,943 |

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 （2022年3月31日） | | 当事業年度 （2023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 | | | 6,032 | | 7,771 |
| 2 未払金 | | | | | |
| （1）未払配当金 | 2 | 700,000 | | 770,000 | |
| （2）未払手数料 | | 421,565 | | 460,087 | |
| （3）その他未払金 | 2 | 526,525 | 1,648,091 | 141,725 | 1,371,812 |
| 3 未払費用 | | | 1,048,260 | | 1,873,823 |
| 4 未払消費税等 | | | 191,700 | | 214,504 |
| 5 未払法人税等 | | | 118,353 | | 262,245 |
| 6 賞与引当金 | | | 171,866 | | 205,460 |
| 7 役員賞与引当金 | | | 6,600 | | 6,600 |
| 流動負債合計 | | | 3,190,904 | | 3,942,217 |
| 固定負債 | | | | | |
| 1 退職給付引当金 | | | 208,284 | | 245,172 |
| 2 資産除去債務 | | | 9,265 | | 9,422 |
| 固定負債合計 | | | 217,549 | | 254,594 |
| 負債合計 | | | 3,408,454 | | 4,196,812 |
| （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 | | | 2,129,605 | 2,544,383 |
| 利益剰余金合計 | | | 2,129,605 | 2,544,383 |
| 株主資本合計 | | | 4,092,885 | 4,507,664 |
| 評価・換算差額等 | | | | |
| 1 その他有価証券評価差額金 | | | 45,985 | 25,466 |
| 評価・換算差額等合計 | | | 45,985 | 25,466 |
| 純資産合計 | | | 4,138,870 | 4,533,130 |
| 負債・純資産合計 | | | 7,547,325 | 8,729,943 |
| | | | | |

(2) 【損益計算書】

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | | 当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) | |
|-----------|----------|--|------------|--|------------|
| | | 金額(千円) | | 金額(千円) | |
| 営業収益 | | | | | |
| 1 委託者報酬 | | 6,276,724 | | 6,268,013 | |
| 2 運用受託報酬 | | 4,403,451 | 10,680,175 | 5,283,477 | 11,551,491 |
| 営業費用 | | | | | |
| 1 支払手数料 | | 2,660,547 | | 2,600,324 | |
| 2 広告宣伝費 | | 27,018 | | 25,984 | |
| 3 公告費 | | 200 | | 200 | |
| 4 調査費 | | 2,998,033 | | 3,945,034 | |
| (1) 調査費 | | 982,738 | | 1,032,243 | |
| (2) 委託調査費 | | 2,012,478 | | 2,909,783 | |
| (3) 図書費 | | 2,815 | | 3,007 | |
| 5 営業雑経費 | | 128,682 | | 149,447 | |
| (1) 通信費 | | 13,042 | | 13,489 | |
| (2) 印刷費 | | 97,704 | | 115,724 | |
| (3) 諸会費 | | 17,935 | 5,814,481 | 20,233 | 6,720,990 |
| 一般管理費 | | | | | |
| 1 給料 | | 1,654,831 | | 1,754,897 | |
| (1) 役員報酬 | | 57,475 | | 59,540 | |
| (2) 給料・手当 | | 1,373,956 | | 1,460,378 | |
| (3) 賞与 | | 223,399 | | 234,978 | |
| 2 福利厚生費 | | 207,945 | | 231,703 | |
| 3 交際費 | | 7,538 | | 10,365 | |
| 4 寄付金 | | 300 | | 1,300 | |
| 5 旅費交通費 | | 6,738 | | 29,102 | |
| 6 法人事業税 | | 56,077 | | 53,595 | |
| 7 租税公課 | | 30,211 | | 26,705 | |

| | | | | | | |
|--------------|-----------|---|---------|-----------|---------|-----------|
| 8 | 不動産賃借料 | | 220,595 | | 221,573 | |
| 9 | 退職給付費用 | | 79,199 | | 87,487 | |
| 10 | 賞与引当金繰入 | | 171,866 | | 205,460 | |
| 11 | 役員賞与引当金繰入 | | 6,600 | | 6,600 | |
| 12 | 固定資産減価償却費 | | 37,983 | | 39,296 | |
| 13 | 諸経費 | | 428,184 | 2,908,072 | 437,986 | 3,106,075 |
| 営業利益 | | | | 1,957,622 | | 1,724,425 |
| 営業外収益 | | | | | | |
| 1 | 受取配当金 | | 626 | | 8,687 | |
| 2 | 受取利息 | | 0 | | 0 | |
| 3 | 有価証券売却益 | | 7,179 | | - | |
| 4 | 有価証券償還益 | | 1,198 | | 3,726 | |
| 5 | 為替差益 | | 10,426 | | 11,910 | |
| 6 | 保険配当金 | | 467 | | 621 | |
| 7 | 雑益 | | 1,537 | 21,434 | 2,493 | 27,439 |
| 営業外費用 | | | | | | |
| 1 | 事務過誤費 | | - | | 9,164 | |
| 2 | 雑損 | | 363 | | 394 | |
| 3 | 債権回収損 | | 5,471 | 5,835 | - | 9,558 |
| 経常利益 | | | | 1,973,220 | | 1,742,306 |
| 特別損失 | | | | | | |
| 1 | 有価証券評価損 | | - | | 4,032 | |
| 2 | 固定資産除却損 | 1 | 0 | 0 | - | 4,032 |
| 税引前当期純利益 | | | | 1,973,220 | | 1,738,274 |
| 法人税・住民税及び事業税 | | | | 617,244 | | 522,813 |
| 法人税等調整額 | | | | 3,808 | | 30,682 |
| 当期純利益 | | | | 1,359,783 | | 1,184,778 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | | 株主資本 合計 |
|---------------------------------|-----------|-----------|-------------|--------------|-------------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益剰余金 | | |
| | | 資本 準備金 | 資本剰余金 合計 | その他利益 剰余金 | 利益剰余金 合計 | |
| 当期首残高 | 1,550,000 | 413,280 | 413,280 | 1,469,821 | 1,469,821 | 3,433,101 |
| 当期変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | 700,000 | 700,000 | 700,000 |
| 当期純利益 | | | | 1,359,783 | 1,359,783 | 1,359,783 |
| 株主資本以外の 項目の当期 変動額（純 額） | | | | | | |
| 当期変動額合 計 | - | - | - | 659,783 | 659,783 | 659,783 |
| 当期末残高 | 1,550,000 | 413,280 | 413,280 | 2,129,605 | 2,129,605 | 4,092,885 |

評価・換算差額等

| | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | 純資産合計 |
|---------------------|--------------|------------|-----------|
| 当期首残高 | 41,732 | 41,732 | 3,474,834 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 700,000 |
| 当期純利益 | | | 1,359,783 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 4,252 | 4,252 | 4,252 |
| 当期変動額合計 | 4,252 | 4,252 | 664,036 |
| 当期末残高 | 45,985 | 45,985 | 4,138,870 |

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | | 株主資本合計 |
|---------------------|-----------|---------|---------|---------------------|-----------|-----------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益剰余金 | | |
| | | 資本準備金 | 資本剰余金合計 | その他利益剰余金 繰越利益剰余金 | 利益剰余金合計 | |
| 当期首残高 | 1,550,000 | 413,280 | 413,280 | 2,129,605 | 2,129,605 | 4,092,885 |
| 当期変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | 770,000 | 770,000 | 770,000 |
| 当期純利益 | | | | 1,184,778 | 1,184,778 | 1,184,778 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | | | | | | |
| 当期変動額合計 | - | - | - | 414,778 | 414,778 | 414,778 |
| 当期末残高 | 1,550,000 | 413,280 | 413,280 | 2,544,383 | 2,544,383 | 4,507,664 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|---------------------|--------------|------------|-----------|
| | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 45,985 | 45,985 | 4,138,870 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 770,000 |
| 当期純利益 | | | 1,184,778 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 20,518 | 20,518 | 20,518 |
| 当期変動額合計 | 20,518 | 20,518 | 394,259 |
| 当期末残高 | 25,466 | 25,466 | 4,533,130 |

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

市場価格のない株式等以外のもの

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。

市場価格のない株式等

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. 収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 投資信託事業は、信託約款に基づきファンドごとの日々の純資産総額に対し信託報酬率を乗じた額を、運用期間に応じて収益として認識しております。

また、成功報酬型の収益は、信託約款に基づきファンドごとに取り決めている運用パフォーマンスの結果に応じ、報酬を受領する権利が確定した時点で収益を認識しております。

(2) 投資顧問事業は、投資顧問契約に基づきファンドごとの資産残高に対し報酬料率を乗じた額を、運用期間に応じて収益として認識しております。

また、成功報酬型の収益は、投資顧問契約に基づき契約ごとに取り決めている運用パフォーマンスの結果に応じ、報酬を受領する権利が確定した時点で収益を認識しております。

6. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1) 消費税等の会計処理

税抜方式を採用しております。

会計方針の変更

（時価の算定に関する会計基準の適用指針）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる、当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。

注記事項

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産の減価償却累計額は、次のとおりであります。

（単位：千円）

| | 前事業年度 (2022年3月31日) | 当事業年度 (2023年3月31日) |
|------|-----------------------|-----------------------|
| 建物 | 99,675 | 104,035 |
| 器具備品 | 108,702 | 143,638 |

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 (2022年3月31日) | 当事業年度 (2023年3月31日) |
|--------|-----------------------|-----------------------|
| 未払金 | | |
| 未払配当金 | 700,000 | 770,000 |
| その他未払金 | 345,346 | - |

（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 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | 当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) |
|------|--|--|
| 器具備品 | 0 | - |

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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. 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 |
|--------------------|-----------|------------|--------------|-----|------------|
| 2022年3月30日 取締役会 | 普通 株式 | 700,000千円 | 29,063円 | - | 2022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 2022年4月1日 至 2023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. 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 |
|--------------------|-------|-----------|----------|-----|------------|
| 2023年3月30日 取締役会 | 普通株式 | 770,000千円 | 31,970円 | - | 2023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。

前事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|-----------|----------|---------|----|
| 投資有価証券（２） | 550,980 | 550,980 | - |
| 資産計 | 550,980 | 550,980 | - |

当事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|-----------|----------|---------|----|
| 投資有価証券（２） | 657,374 | 657,374 | - |
| 資産計 | 657,374 | 657,374 | - |

- （１）「現金・預金」、「未収委託者報酬」、「未収運用受託報酬」、「未払金」及び「未払費用」は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

- （２）以下の市場価格のない株式等は、投資有価証券には含まれておりません。当該金融商品の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：千円）

| 区分 | 前事業年度 （2022年3月31日） | 当事業年度 （2023年3月31日） |
|-------|-----------------------|-----------------------|
| 非上場株式 | 750 | 750 |

注１．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（2022年3月31日）

（単位：千円）

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|--|------|-------------|--------------|------|
| | | | | |

| | | | | |
|--------------|-----------|---------|--------|---------|
| (1) 預金 | 3,870,414 | - | - | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 1,137,463 | - | - | - |
| (3) 未収運用受託報酬 | 1,220,102 | - | - | - |
| (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 | 44,728 | 201,061 | 32,679 | 272,511 |
| 合計 | 6,272,708 | 201,061 | 32,679 | 272,511 |

当事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|--------------|-----------|-------------|--------------|---------|
| (1) 預金 | 3,546,149 | - | - | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 1,194,368 | - | - | - |
| (3) 未収運用受託報酬 | 2,618,849 | - | - | - |
| (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 | 147,960 | 90,026 | 150,462 | 268,926 |
| 合計 | 7,507,327 | 90,026 | 150,462 | 268,926 |

注2．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。

3．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

| | |
|---------|--|
| レベル1の時価 | 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価 |
| レベル2の時価 | 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の算定に係るインプットを用いて算定した時価 |
| レベル3の時価 | 観察できない時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価 |

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価で貸借対照表に計上している金融商品

前事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

| 区分 | 時価 | | | |
|--------|------|---------|---------|---------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| 投資有価証券 | - | 370,250 | 180,730 | 550,980 |
| 資産計 | - | 370,250 | 180,730 | 550,980 |

当事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

| 区分 | 時価 | | | |
|----|------|------|------|----|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| | | | | |

| | | | | |
|--------|---|---------|---------|---------|
| 投資有価証券 | - | 462,624 | 194,750 | 657,374 |
| 資産計 | - | 462,624 | 194,750 | 657,374 |

(2) 期首残高から当事業年度末残高への調整表、当事業年度の損益に記載した評価損益

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

| | 投資有価証券 | 合計 |
|---|---------|---------|
| 期首残高 | 240,805 | 240,805 |
| 当事業年度の損益又は評価・換算差額等 | | |
| 損益の計上 | - | - |
| その他有価証券評価差額金 | 1,012 | 1,012 |
| 購入、売却、発行及び決済 | | |
| 購入 | - | - |
| 売却 | 61,087 | 61,087 |
| 発行 | - | - |
| 決済 | - | - |
| レベル3の時価への振替 | - | - |
| レベル3の時価からの振替 | - | - |
| 当事業年度末残高 | 180,730 | 180,730 |
| 当事業年度の損益に計上した額のうち貸借対照表において保有する金融資産又は金融負債の評価損益 | - | - |

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

| | 投資有価証券 | 合計 |
|---|---------|---------|
| 期首残高 | 180,730 | 180,730 |
| 当事業年度の損益又は評価・換算差額等 | | |
| 損益の計上 | - | - |
| その他有価証券評価差額金 | 14,020 | 14,020 |
| 購入、売却、発行及び決済 | | |
| 購入 | - | - |
| 売却 | - | - |
| 発行 | - | - |
| 決済 | - | - |
| レベル3の時価への振替 | - | - |
| レベル3の時価からの振替 | - | - |
| 当事業年度末残高 | 194,750 | 194,750 |
| 当事業年度の損益に計上した額のうち貸借対照表において保有する金融資産又は金融負債の評価損益 | - | - |

(3) 時価の評価プロセスの説明

時価の算定にあたっては、投資信託の基準価額を用いております。

(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（2022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 | 473,762 | 404,700 | 69,062 |
| | 小計 | 473,762 | 404,700 | 69,062 |
| 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 | 77,218 | 80,000 | 2,782 |
| | 小計 | 77,218 | 80,000 | 2,782 |
| 合計 | | 550,980 | 484,700 | 66,280 |

当事業年度（2023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 | 371,165 | 294,700 | 76,465 |
| | 小計 | 371,165 | 294,700 | 76,465 |
| 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 | 286,209 | 330,000 | 43,790 |
| | 小計 | 286,209 | 330,000 | 43,790 |
| 合計 | | 657,374 | 624,700 | 32,674 |

5. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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 | 117,179 | 7,179 | - |
| 合計 | 117,179 | 7,179 | - |

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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 | - | - | - |
| 合計 | - | - | - |

（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 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | 当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) |
|--------------|--|--|
| 退職給付引当金の期首残高 | 177,918 | 208,284 |
| 退職給付費用 | 34,032 | 37,940 |
| 退職給付の支払額 | 3,666 | 1,052 |
| 退職給付引当金の期末残高 | 208,284 | 245,172 |

（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 (2022年3月31日) | 当事業年度 (2023年3月31日) |
|---------------------|-----------------------|-----------------------|
| 非積立型制度の退職給付債務 | 208,284 | 245,172 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 208,284 | 245,172 |
| 退職給付引当金 | 208,284 | 245,172 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 208,284 | 245,172 |

（3）退職給付費用

（単位：千円）

| | 前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | 当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) |
|----------------|--|--|
| 簡便法で計算した退職給付費用 | 34,032 | 37,940 |

3. 確定拠出制度

（単位：千円）

| | 前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | 当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) |
|-----------------|--|--|
| 当社の確定拠出制度への要拠出額 | 37,490 | 41,080 |

（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 (2022年3月31日) | 当事業年度 (2023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 | 221,681 | 176,793 |
| 退職給付引当金 | 63,776 | 75,071 |
| 賞与引当金 | 52,625 | 62,912 |

| | | |
|---------------------------|---------|---------|
| 繰延資産損金算入限度超過額 | 20,401 | 21,910 |
| 未払事業税 | 25,882 | 15,571 |
| 未払金否認 | 6,551 | 7,604 |
| その他 | 5,629 | 7,100 |
| 繰延税金資産 小計 | 396,548 | 366,961 |
| 将来減算一時差異等の合計に係る 評価性引当額 | 2,933 | 4,119 |
| 評価性引当額 小計 | 2,933 | 4,119 |
| 繰延税金資産 合計 | 393,615 | 362,842 |
| 繰延税金負債 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 20,295 | 11,240 |
| 株式譲渡損益 | 3,031 | 3,031 |
| 固定資産除去価額 | 313 | 222 |
| 繰延税金負債 合計 | 23,639 | 14,493 |
| 繰延税金資産の純額 | 369,976 | 348,349 |

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

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

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

本社事務所及び事業継続用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0.2%～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 2021年4月1日 至 2022年3月31日） | 当事業年度 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日） |
|------------|--|--|
| 期首残高 | 9,111 | 9,265 |
| 取得 | - | - |
| 時の経過による調整額 | 154 | 157 |
| 期末残高 | 9,265 | 9,422 |

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

（単位：千円）

| | 前事業年度 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日） | 当事業年度 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日） |
|--------------|--|--|
| 投資信託事業（基本報酬） | 6,264,774 | 6,264,984 |
| 投資信託事業（成功報酬） | 11,950 | 3,029 |
| 投資顧問事業（基本報酬） | 3,421,061 | 2,834,396 |
| 投資顧問事業（成功報酬） | 982,389 | 2,449,080 |
| 合計 | 10,680,175 | 11,551,491 |

（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 2021年4月1日 至 2022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 | 北米 | 中東 | アジア | 合計 |
|-----------|---------|---------|---------|--------|------------|
| 9,517,226 | 543,068 | 371,551 | 203,473 | 44,855 | 10,680,175 |

（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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

| 顧客の名称又は氏名 | 営業収益 |
|-----------------|-----------|
| 年金積立金管理運用独立行政法人 | 2,064,709 |

（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

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金（億円） | 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） |
|-----|-------------------|--------|---------|-------|----------------|-----------|------------|----------|---------|----------|
| 親会社 | SOMPOホールディングス株式会社 | 東京都新宿区 | 1,000 | 経営管理 | 直接100% | 連結納税 | 連結納税に伴う支払い | 493,587 | 未払金（注1） | 345,346 |

注1．取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）連結納税制度による連結法人税等の支払予定額であります。

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 (億円) | 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 | 30 | 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) | 625,470 | 未払手数料 | 147,871 |
| 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 | 172 | 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) | 178,392 | 未収運用受託報酬 | 97,841 |

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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 (億円) | 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 | 30 | 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) | 677,364 | 未払手数料 | 168,088 |
| 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 | 172 | 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) | 176,500 | 未収運用受託報酬 | 96,493 |

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

注2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

(注2) 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

SOMPOホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

関連会社はありません。

(1 株当たり情報)

| | 前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | 当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) |
|-----------------|--|--|
| 1株当たり純資産額(円) | 171,844.33 | 188,213.85 |
| 1株当たり当期純利益金額(円) | 56,457.70 | 49,191.55 |

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

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

| | 前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | 当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) |
|------------------|--|--|
| 当期純利益(千円) | 1,359,783 | 1,184,778 |
| 普通株主に帰属しない金額(千円) | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益(千円) | 1,359,783 | 1,184,778 |
| 期中平均株式数(株) | 24,085 | 24,085 |

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)において同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更

該当事項はありません。

- (2) 訴訟事件その他の重要事項
該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称

みずほ信託銀行株式会社（再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行）

資本金の額

247,369百万円（2023年3月末現在）

事業の内容

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

<再信託受託会社の概要>

名称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2023年3月末現在）

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

再信託の目的：原信託契約に係る信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2)販売会社

| 名称 | 資本金の額 ¹ (単位：百万円) | 事業の内容 |
|-------------------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 岩井コスモ証券株式会社 | 13,500 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| auカブコム証券株式会社 | 7,196 | |
| SMB C日興証券株式会社 | 10,000 | |
| 株式会社SBI証券 | 48,323 | |
| 岡三にいがた証券株式会社 | 852 | |
| 静岡東海証券株式会社 ² | 600 | |
| 損保ジャパンDC証券株式会社 | 3,000 | |
| 松井証券株式会社 | 11,945 | |
| マネックス証券株式会社 | 12,200 | |
| みずほ証券株式会社 | 125,167 | |
| 楽天証券株式会社 | 19,495 | |
| 株式会社イオン銀行 ³ | 51,250 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 株式会社大東銀行 ⁴ | 14,743 | |
| PayPay銀行株式会社 | 72,216 | |
| 株式会社みずほ銀行 | 1,404,065 | |

| | | |
|--------------|--------|------------------------|
| 損害保険ジャパン株式会社 | 70,000 | 保険業法に基づき損害保険業を営んでいません。 |
|--------------|--------|------------------------|

- 1 資本金の額は、2023年3月末現在
- 2 ハッピーエイジング30、40のみの取扱いとなります。
- 3 ハッピーエイジング20、30、40のみの取扱いとなります。
- 4 ハッピーエイジング40のみの取扱いとなります。

(3)投資顧問会社

TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY

資本金の額 38,965千ドル(2022年12月末現在)

(5,170百万円、1ドル=132.7円換算)

事業の内容

米国において有価証券等に係る投資顧問業務及び投資信託委託業務を行っています。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

受託会社として、信託財産の保管・管理業務などを行い、収益分配金、一部解約金及び償還金の交付等を行います。

(2) 販売会社

販売会社として、受益権の募集の取扱い、収益分配金等の支払い等を行います。

(3) 投資顧問会社

TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY

委託会社との投資一任契約に基づき、「損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド」に関して、外国株式の運用の指図に関する権限の委託を受けて投資判断、発注等を行います。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

(3) 投資顧問会社

該当事項はありません。

第3【その他】

- 1 目論見書の表紙等に、ロゴマーク、キャッチコピー、図案、イラスト、写真、当ファンドの概略的性格を表示する文言、第三者機関から取得したユニバーサルデザインに関する認証マーク等を記載することがあります。
- 2 金融商品取引法第13条第2項第1号に定める事項に関する内容を記載した目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」という名称を使用することがあります。また、金融商品取引法第13条第2項第2号に定める事項に関する内容を記載した目論見書の別称として「投資信託説明書(請求目論見書)」という名称を使用することがあります。

3. 投資信託説明書(請求目論見書)の表紙あるいは裏表紙に、金融商品取引法に基づき、投資家の請求により交付される目論見書である旨を記載することがあります。
4. 投資信託説明書(請求目論見書)の表紙に課税上の取扱いに関する記載をすることがあります。
5. 目論見書に記載する運用状況に関する情報等は、適宜更新することがあります。
6. 目論見書の表紙等に「金融商品取引業者登録番号」、「使用開始日」等を記載することがあります。
7. 投資信託説明書(請求目論見書)の巻末に信託約款を掲載することがあります。
8. 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
9. 投資評価機関、投資評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
10. 目論見書の表紙等に以下の内容を記載することがあります。
 - ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されています。
11. 目論見書の巻頭に、以下を記載することがあります。

ご投資家のみなさまへ

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

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

SOMPOアセットマネジメント

独立監査人の監査報告書

2023年6月12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 森重俊寛
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林弘幸
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SOMPOアセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38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、SOMPOアセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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、継続企業の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、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。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容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. 上記の監査報告書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。

独立監査人の監査報告書

2023年9月21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 森 重 俊 寛
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 雅 人
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、「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2022年7月16日から2023年7月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、ハッピーエイジング20の2023年7月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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、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、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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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。

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、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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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

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. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年9月21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 森 重 俊 寛
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 雅 人
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、「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2022年7月16日から2023年7月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、ハッピーエイジング30の2023年7月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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、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、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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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。

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、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、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。
- 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、経営者に対して、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

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. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年9月21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 森 重 俊 寛
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 雅 人
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、「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2022年7月16日から2023年7月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、ハッピーエイジング40の2023年7月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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、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、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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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。

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、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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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

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 . 上記の監査報告書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。

独立監査人の監査報告書

2023年9月21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 森 重 俊 寛
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 雅 人
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、「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2022年7月16日から2023年7月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、ハッピーエイジング50の2023年7月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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、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、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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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。

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、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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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

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. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年9月21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 森 重 俊 寛
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 雅 人
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、「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2022年7月16日から2023年7月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、ハッピーエイジング60の2023年7月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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、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、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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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。

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、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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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

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. 上記の監査報告書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。