

【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】	2026年9月14日提出
【発行者名】	S O M P O アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 山口 力
【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】	布施 雅子
【電話番号】	03-5290-3400
【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】	S O M P O 世界分散ファンド（安定型）＜D C 年金＞ S O M P O 世界分散ファンド（安定成長型）＜D C 年金＞ S O M P O 世界分散ファンド（成長型）＜D C 年金＞ S O M P O 世界分散ファンド（安定型）＜D C 年金＞ 募集額 2,000億円を上限とします。
【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】	S O M P O 世界分散ファンド（安定成長型）＜D C 年金＞ 募集額 2,000億円を上限とします。 S O M P O 世界分散ファンド（成長型）＜D C 年金＞ 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】

S O M P O世界分散ファンド（安定型）<DC年金>

S O M P O世界分散ファンド（安定成長型）<DC年金>

S O M P O世界分散ファンド（成長型）<DC年金>

（以下、上記を総称して「S O M P O世界分散ファンド<DC年金>」または総称してあるいは個別に「ファンド」ということがあります。）

なお、ファンドの名称について、以下の略称にて表記することがあります。

ファンドの名称	略称
S O M P O世界分散ファンド（安定型）<DC年金>	安定型
S O M P O世界分散ファンド（安定成長型）<DC年金>	安定成長型
S O M P O世界分散ファンド（成長型）<DC年金>	成長型

（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。

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S O M P O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。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日^１の翌営業日の基準価額^２とします。

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

<取得申込不可日>

- ・ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、パリ証券取引所の休業日
- ・ニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日

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資産運用業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。

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

S O M P O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】

申込手数料はありません。

（６）【申込単位】

1円単位を最低単位として、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 2026年9月15日から2027年3月12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

S O M P O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】

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

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

（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】

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

（１２）【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

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】

ファンドは、「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」、「S O M P O 外国株式アクティブバリュース（リスク抑制型）マザーファンド」、「損保ジャパン日本債券マザーファンド」、「損保ジャパン外国債券マザーファンド」、「損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド」および「損保ジャパン」- R E I T マザーファンド」（以下それぞれ「マザーファンド」または「親投資信託」ということがあります。）の受益証券ならびに新興国株式および海外の不動産投資信託証券を主要投資対象とする上場投資信託証券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。

ファンドの目的は、以下の通りです。

安定型	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
安定成長型	信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
成長型	信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンドについて金2,000億円を限度として信託金を追加できます。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。

一般社団法人資産運用業協会が定める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）ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

< 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 (部分ヘッジ)
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	欧州		
	(隔月)	アジア		
	年 12 回	オセアニア		
債券	(毎月)	中南米		
一般	日々	アフリカ		
公債	その他	中近東		
社債	()	(中東)		
		エマージング		
その他債券 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、不 動産投信)))				
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注1) 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。

< 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、不動産投 信)))	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、債券および不動産投信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	為替ヘッジあり（部分ヘッジ）	目論見書又は信託約款において、外貨建資産に対して部分的に為替ヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

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、一般社団法人資産運用業協会のホームページ（<https://www.imaj.or.jp/>）をご参照ください。

<ファンドの特色>

● ファンドの目的

安定型

安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

安定成長型

信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

成長型

信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

● ファンドの特色

1

実質的に国内外の株式、債券、不動産投資信託証券（リート）へ分散投資を行います。

● 各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用します。

国内外の株式、債券およびリートへの投資は以下のマザーファンド等を通じて行います。

投資対象資産	投資対象とするマザーファンド等
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
外国株式	S O M P O外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）マザーファンド 新興国株式を主要投資対象とする上場投資信託証券
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
国内リート	損保ジャパンＪ－ＲＥＩＴマザーファンド
外国リート	外国不動産投資信託証券を主要投資対象とする上場投資信託証券

● 外貨建債券への投資にあたっては、一部為替ヘッジを行います。

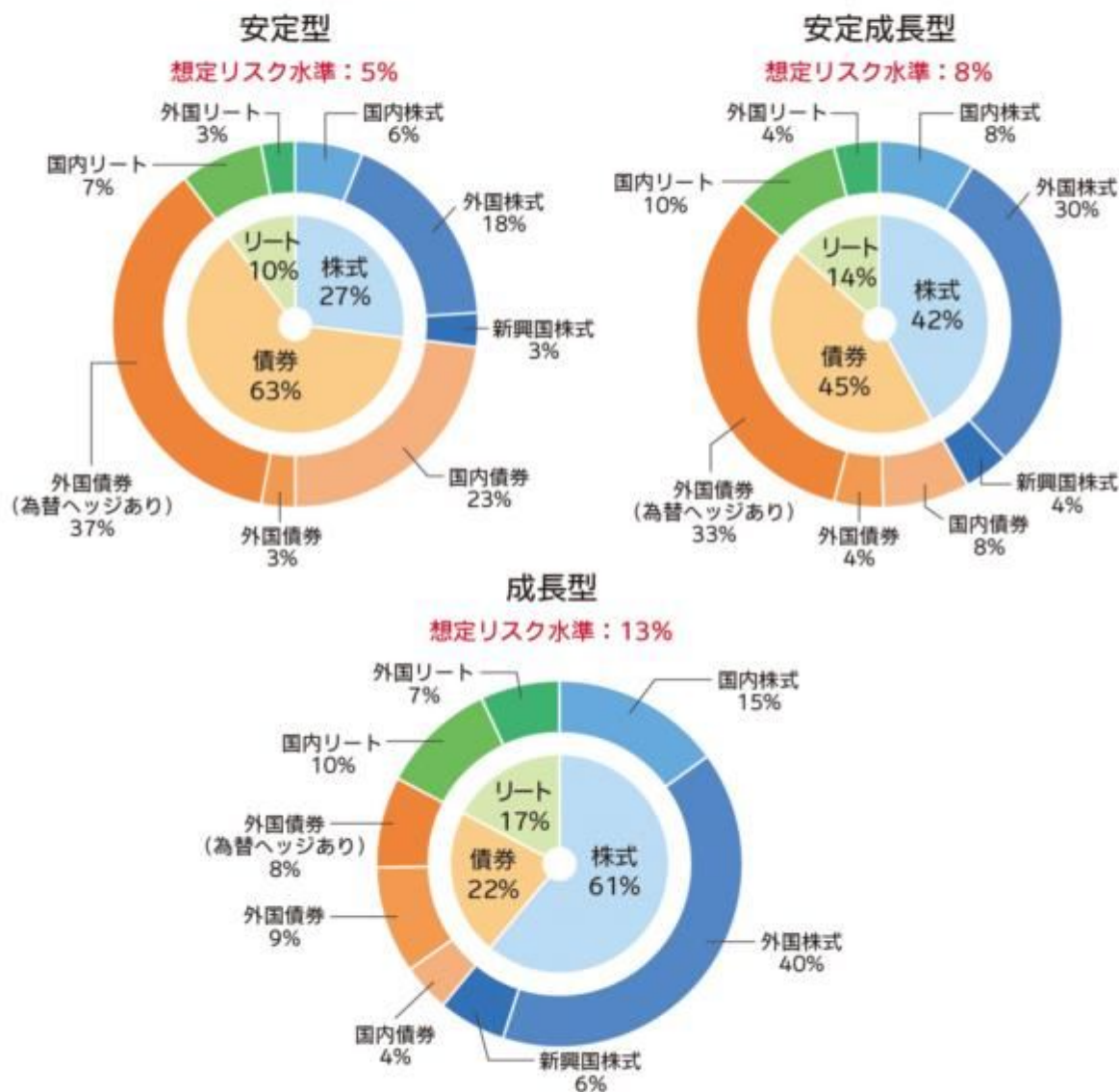
当該為替ヘッジは、損保ジャパン外国債券マザーファンドにて行います。

2

「安定型」「安定成長型」「成長型」の3つのファンドがあります。

- 3つのファンドは各資産への投資配分比率が異なります。
- 投資配分比率は、ポートフォリオの想定リスク水準を踏まえて長期的な視点のほか短期的な視点も考慮して、決定します。投資配分比率の見直しは原則として年4回行います。
- ・想定リスク水準とは、各ファンドの基準価額の振れ幅の目安であり、月次リターン標準偏差を年率換算した値で計測します。

<想定リスク水準と投資配分比率>



※上記数値は2026年6月現在のものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。
 ※上記グラフの各数値は四捨五入して算出した値のため合計が100%とならないことがあります。
 ※想定リスク水準は、市場環境等により見直しを行う場合があります。
 また、実際の基準価額の振れ幅が、想定リスク水準を上回る場合や下回る場合があります。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

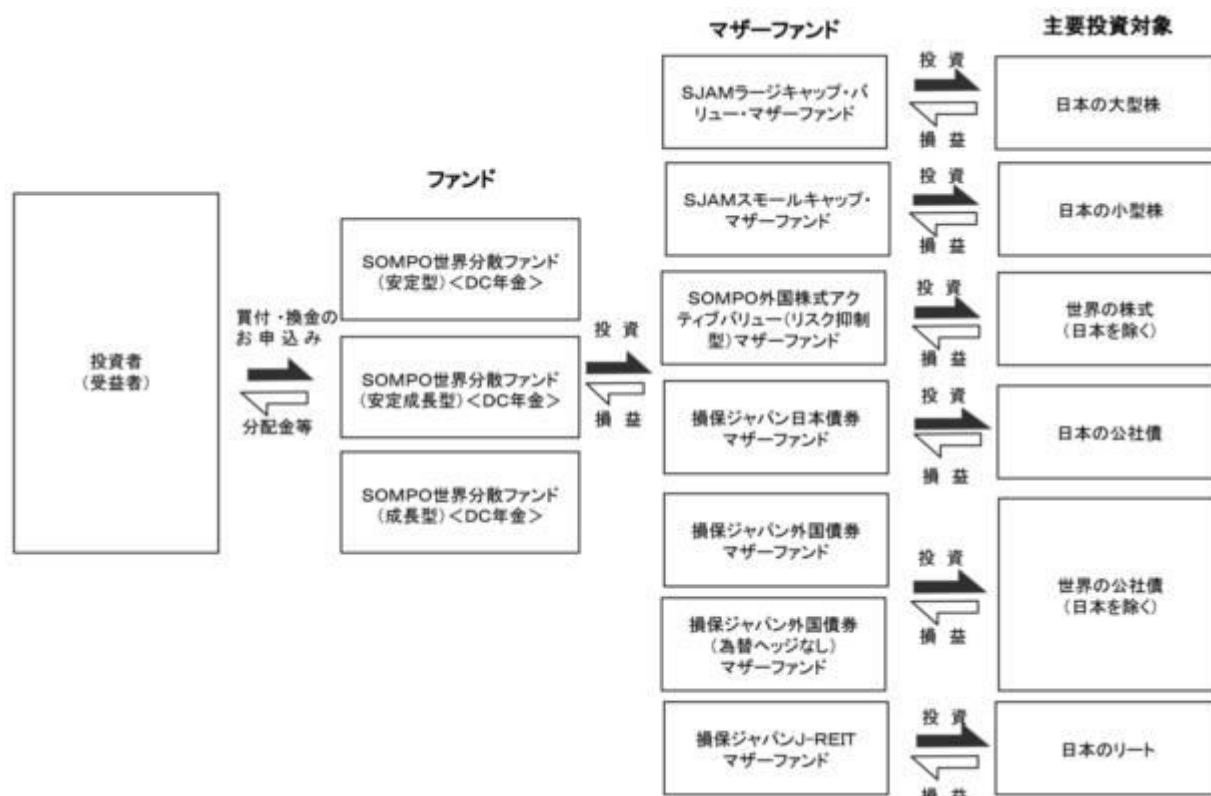
(2) 【ファンドの沿革】

2022年12月15日 信託契約締結、設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

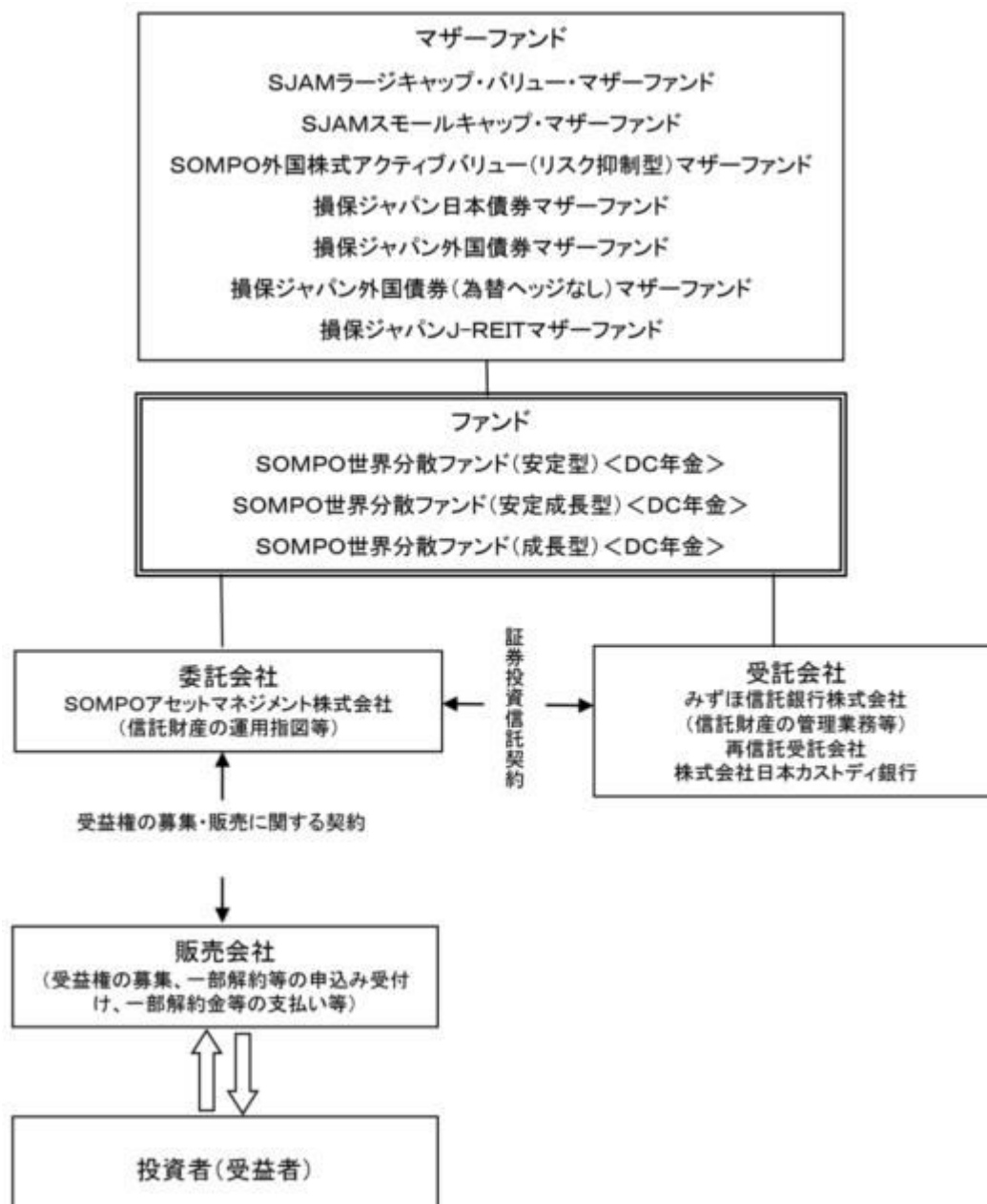
ファンドの仕組み

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。ファンドは「ベビーファンド」にあたります。



ただし、新興国株式および海外の不動産投資信託証券を主要投資対象とする上場投資信託証券については直接投資を行います。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。

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

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、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、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、一部解約金および償還金の交付、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。

委託会社等の概況

() 資本金の額 1,550百万円 (2026年6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	S O M P O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（2026年6月末現在）

名称	住所（所在地）	所有株式数 （株）	持株比率 （％）
S O M P O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

<安定型>

この投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

<安定成長型>

この投資信託は、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

<成長型>

この投資信託は、信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

b. 運用方針

投資対象

S J A Mラージキャップ・バリュース・マザーファンド受益証券、S J A Mスモールキャップ・マザーファンド受益証券、S O M P O外国株式アクティブバリュース（リスク抑制型）マザーファンド受益証券、損保ジャパン日本債券マザーファンド受益証券、損保ジャパン外国債券マザーファンド受益証券、損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド受益証券、損保ジャパンJ-R E I Tマザーファンド受益証券、ならびに新興国株式および海外の不動産投資信託証券を主要投資対象とする上場投資信託証券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、S O M P O外国株式アクティブバリュース（リスク抑制型）マザーファンド、損保ジャパン日本債券マザーファンド、損保ジャパン外国債券マザーファン

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、損保ジャパンＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券および上場投資信託証券等への投資を通して、国内外の株式、債券、不動産投資信託証券へ分散投資を行います。

- （ ）各資産への投資配分比率については、ポートフォリオの想定リスク水準を踏まえて長期的な視点のほか、短期的な視点も考慮して決定します。
- （ ）外貨建債券への投資にあたっては、一部為替ヘッジを行います。
- （ ）資金動向、市況動向、その他特殊な状況等によっては、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、次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいい、以下同じ。）とします。

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、）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

委託会社は、信託金を、主として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「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」、「SOMPO外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）マザーファンド」、「損保ジャパン日本債券マザーファンド」、「損保ジャパン外国債券マザーファンド」、「損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド」および「損保ジャパンＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- １．株券または新株引受権証書
- ２．国債証券
- ３．地方債証券
- ４．特別の法律により法人の発行する債券
- ５．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。）
- ６．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、）
- ７．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、）
- ８．協同組織金融機関に係る優先出資証券（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、）
- ９．資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（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、）
- １０．コマーシャル・ペーパー
- １１．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
- １２．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１１．までの証券または証書の性質を有するもの
- １３．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、）
- １４．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、）

15. 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。）
16. 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。
17. 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。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 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。
20. 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。）
21. 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
22. 外国の者に対する権利で前記21.の有価証券の性質を有するもの

なお、前記1.の証券ならびに証書、12.および17.の証券または証書のうち1.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、2.から6.までの証券ならびに12.および17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.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 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】

（運用体制）

総合投資会議は、ファンドの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。

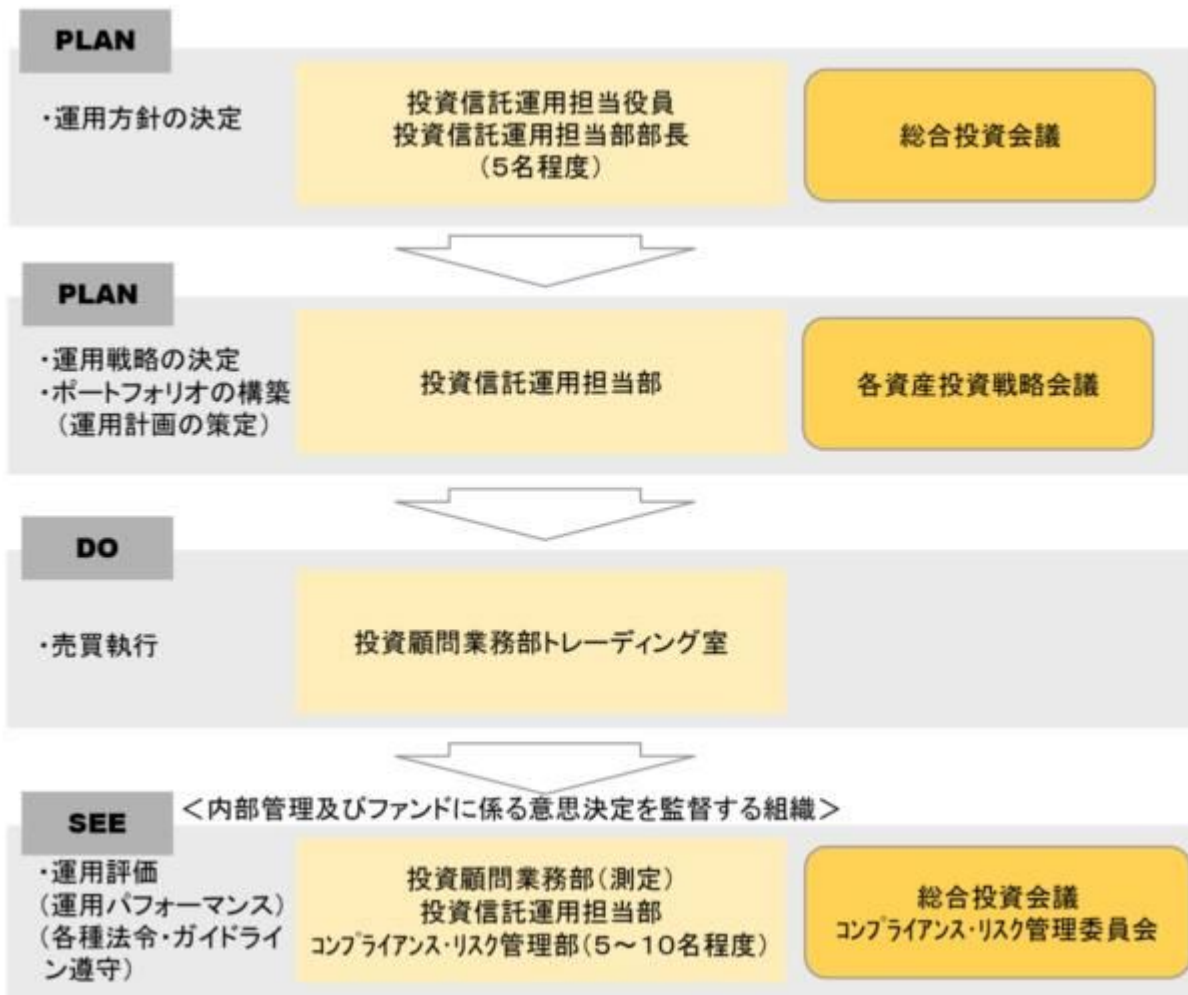
各運用担当部で策定された運用計画に基づき、投資顧問業務部トレーディング室が最良執行の観点から売買を執行します。

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。



2026年6月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

(4) 【分配方針】

毎決算時（原則12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、経費控除後の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、必ず分配を行うものではありません。

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. ファンドの信託約款に基づく投資制限

株式への実質投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への実質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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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%以下とします。

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（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。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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（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。以下同じ。）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。）なものをいいます。以下同じ。）ならびに信託財産に既に組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。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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ます。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。

信用取引の指図範囲

- （ ） 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（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売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）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。

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たときは、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()の借入に係る品借料は信託財産中から支弁します。

先物取引等の運用指図

- () 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およ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およ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、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およ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、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図

- () 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引およ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。
- () 金利先渡取引およ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。
- () 金利先渡取引およ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、金利先渡取引およ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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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および公社債を次の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たときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

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、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約を指図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（親投資信託の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（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外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を含みます。）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

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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。

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り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係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係る借入期間は、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係る借入期間は、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。

21 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、株式の配当金およ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()の立替金の決済および利息については、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 J A M ラージキャップ・バリュー・マザーファンド」の信託約款の運用の基本方針

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。）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。

金利先渡し取引及び為替先渡し取引は、信託約款第23条の範囲で行います。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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」の信託約款の運用の基本方針

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。

金利先渡し取引及び為替先渡し取引は、信託約款第23条の範囲で行います。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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）「SOMPO外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）マザーファンド」の信託約款の運用の基本方針

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長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

主として日本を除く世界各国の株式に投資し、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

銘柄選定にあたっては、当社が独自に開発した外国株式評価モデルにより算出した投資価値と市場価値とを比較した相対的割安度を測定します。

相対的割安度の高い銘柄を中心に、ベンチマークであるMSCIコクサイ インデックス（配当込み）と比較してリスク水準を抑えたポートフォリオを構築し、中長期的にベンチマークを上回る運用成果を目指します。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向、その他特殊な状況等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（3）投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資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%以下とします。

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%以下とします。

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%以下とします。

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。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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。）なものをいいます。以下同じ。））ならびに信託財産に既に組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%以下とします。

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。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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。

（参考）「損保ジャパン日本債券マザーファンド」の信託約款の運用の基本方針

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。）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。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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マザーファンド」の信託約款の運用の基本方針

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、円ヘッジ・円ベース）を中長期的に上回る投資成果を目指します。

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円ベースで100%ヘッジを基本とします。

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。

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。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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（ヘッジなし）マザーファンド」の信託約款の運用の基本方針

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。）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。

金利先渡し取引および為替先渡し取引は、信託約款第22条の範囲で行います。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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」- R E I T マザーファンド」の信託約款の運用の基本方針

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目指して運用を行います。

2. 運用方針

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所（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号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。）に上場または店頭登録されている不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（一般社団法人資産運用業協会規

則に定める不動産投資信託証券で、上場等の前の新規募集又は売出し、若しくは上場等の後の追加募集又は売出しに係るものを含みます。以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

（２）投資態度

わが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）している不動産投資信託証券（ＲＥＩＴ）を主要投資対象とします。

東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）を運用上のベンチマークとし、同インデックスを上回る運用成果を目指します。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を基本とします。なお、市況動向によっては、一時的に不動産投資信託証券の組入比率を引き下げることがあります。

資金動向、市況動向その他特殊な状況等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

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。

（３）投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への直接投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

一般社団法人資産運用業協会の規則に定める一の者に対する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、35%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、一般社団法人資産運用業協会の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。

３【投資リスク】

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みなさまに帰属いたします。したがって、投資者のみなさま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。

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。

< ファンドの投資にかかるリスク >

資産配分のリスク

ファンドの投資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、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

価格変動リスク

株式の価格は、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。

公社債の価格は、国内外の政治・経済情勢、金融政策等の影響を受けて変動します。一般に、金利が上昇すると、公社債の価格は下落します。

リートの価格は、国内外の政治・経済情勢、金融政策、不動産市況や保有する不動産の状況等の影響を受けて変動します。

組入れている有価証券の価格の下落は、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

株式や公社債及びリートの価格は、発行体の財務状態、経営、業績、保有する不動産の状況等の悪化及びそれらに関する外部評価が悪化した場合には下落することがあります。組入れている株式や公社債及び

リートの価格の下落は、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、株式や公社債及びリート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。

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。

また、ファンドは外貨建債券に対して部分的に為替ヘッジを行います。円金利よりも金利水準の高い通貨の為替ヘッジを行った場合、金利差に相当するヘッジコストが発生し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

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。

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ある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、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

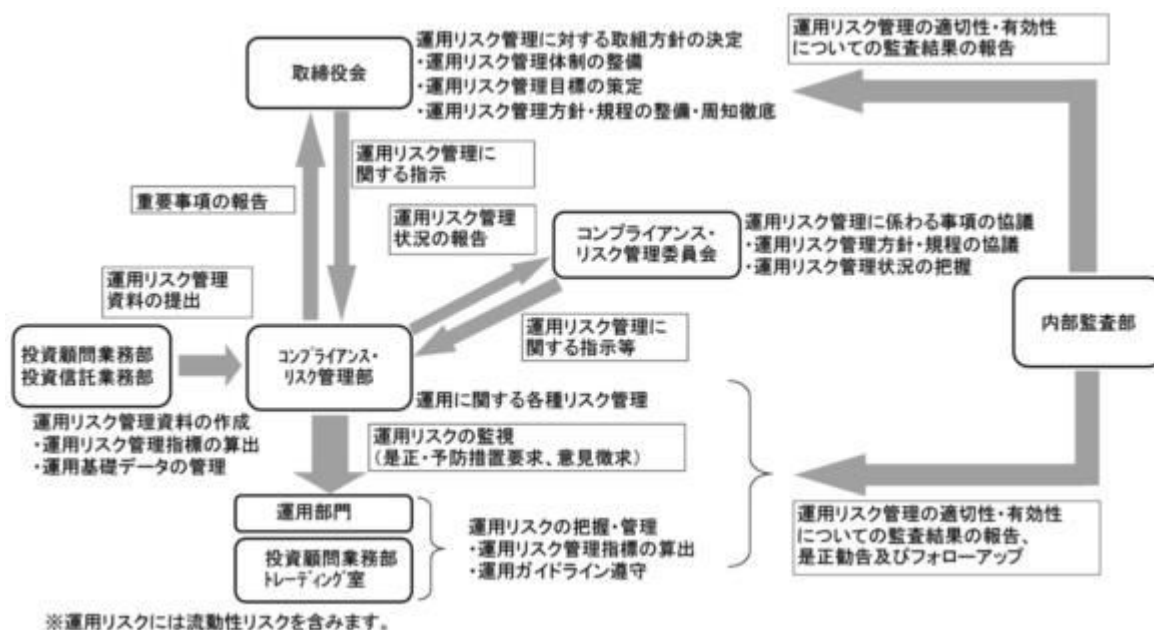
<お申込時>

委託会社は、取得申込金額が多額であると判断した場合、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低下した場合、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、一部解約の請求金額が多額であると判断した場合、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低下した場合、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、当該受益権の一部解約の価額は、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>



(注) 上図は、2026年6月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

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。

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移

※データは、設定日より掲載しています。

安定型



ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

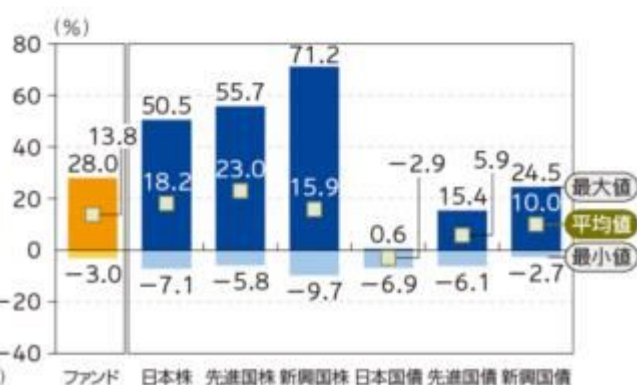
※ファンドと代表的な資産クラスの対象期間が異なりますので、
ご注意ください。



安定成長型



成長型



2021年7月～2026年6月

ファンド : 2023年12月～2026年6月
代表的な資産クラス: 2021年7月～2026年6月

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

代表的な資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	日本の株式市場を広くに調羅するとともに、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・ディバーシファイド (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・ディバーシ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。信託財産留保額ははありません。

(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年率0.913%（税抜0.83%）を乗じて得た金額とし、委託会社と受託会社との間の配分は以下のとおりです（下記のとおり、委託会社は販売会社への配分を一旦収受します。）。

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

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ヵ月終了日及び毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬に係る消費税およ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。）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。

(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】

ファンドは確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度専用ファンドです。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。なお、税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合は、内容が変更されることがあります。

配当控除、益金不算入制度の適用はありません。

（参考情報）ファンドの総経費率

●直近の運用報告書の作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下のとおりです。

ファンド名	総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
安定型	0.99%	0.91%	0.08%
安定成長型	1.02%	0.91%	0.11%
成長型	1.03%	0.91%	0.12%

※対象期間は2024年12月17日から2025年12月15日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除きます。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞

2026年6月30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	1,131,296	4.94
親投資信託受益証券	日本	21,405,957	93.43
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	—	373,439	1.63

純資産総額	22,910,692	100.00
-------	------------	--------

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

その他資産の投資状況

2026年6月30日現在

資産の種類	建別	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建	—	162,377	0.71

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

S O M P O世界分散ファンド（安定成長型）＜D C年金＞

2026年6月30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	3,327,931	7.81
親投資信託受益証券	日本	38,787,784	90.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	—	515,412	1.21
純資産総額		42,631,127	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。

S O M P O世界分散ファンド（成長型）＜D C年金＞

2026年6月30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	6,739,612	12.65
親投資信託受益証券	日本	45,882,622	86.14
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	—	643,718	1.21
純資産総額		53,265,952	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・マザーファンド

2026年6月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	104,604,962,930	98.94
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	—	1,125,225,274	1.06
純資産総額		105,730,188,204	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

2026年6月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	29,702,504,430	99.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	—	252,216,632	0.84

純資産総額	29,954,721,062	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 O M P O外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）マザーファンド

2026年6月30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	2,001,034,260	66.23
	フランス	126,013,361	4.17
	ドイツ	123,774,285	4.10
	イギリス	96,073,129	3.18
	オーストラリア	74,231,930	2.46
	アイルランド	67,951,218	2.25
	スイス	55,505,956	1.84
	シンガポール	43,458,486	1.44
	オランダ	37,660,029	1.25
	スペイン	37,489,892	1.24
	フィンランド	34,415,918	1.14
	デンマーク	32,682,841	1.08
	スウェーデン	22,962,156	0.76
	ジャージー	14,796,762	0.49
	カナダ	14,382,443	0.48
	ベルギー	9,797,764	0.32
	バミューダ	9,374,190	0.31
	ノルウェー	6,944,614	0.23
		2,808,549,234	92.96
投資証券	アメリカ	13,807,664	0.46
	シンガポール	7,142,154	0.24
		20,949,818	0.69
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	—	191,690,504	6.35
純資産総額		3,021,189,556	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

2026年6月30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	29,714,525,400	76.32
地方債証券	日本	915,542,253	2.35
特殊債券	日本	395,791,149	1.02
社債券	日本	6,661,822,000	17.11
	フランス	299,028,000	0.77
	イギリス	99,547,000	0.26
		7,060,397,000	18.13

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	—	846,647,803	2.18
純資産総額		38,932,903,605	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マザーファンド

2026年6月30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	650,572,379	42.87
	中国	232,863,415	15.35
	イタリア	92,134,577	6.07
	フランス	85,298,110	5.62
	イギリス	79,107,280	5.21
	ドイツ	60,586,184	3.99
	スペイン	50,287,924	3.31
	カナダ	34,929,091	2.30
	オランダ	27,539,541	1.81
	ベルギー	25,955,295	1.71
	オーストラリア	24,392,292	1.61
	シンガポール	22,616,360	1.49
	オーストリア	20,015,878	1.32
	メキシコ	17,688,452	1.17
	フィンランド	13,500,790	0.89
	ポルトガル	12,860,113	0.85
	ポーランド	9,871,046	0.65
	アイルランド	8,501,324	0.56
	デンマーク	5,540,858	0.37
	ノルウェー	3,634,432	0.24
	スウェーデン	2,896,124	0.19
		1,480,791,465	97.59
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	—	36,629,762	2.41
純資産総額		1,517,421,227	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

その他資産の投資状況

2026年6月30日現在

資産の種類	建別	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建	—	1,483,566,740	97.77

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（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

2026年6月30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	11,481,272,776	51.89
	中国	2,228,799,592	10.07
	イタリア	1,322,387,895	5.98
	フランス	1,270,826,367	5.74
	イギリス	1,105,245,027	4.99
	ドイツ	1,064,560,728	4.81
	スペイン	861,378,695	3.89
	カナダ	394,951,865	1.78
	ベルギー	289,078,777	1.31
	オランダ	235,442,938	1.06
	メキシコ	228,124,352	1.03
	オーストラリア	218,392,879	0.99
	オーストリア	200,817,300	0.91
	ポーランド	182,797,162	0.83
	ポルトガル	110,102,502	0.50
	アイルランド	88,344,842	0.40
	マレーシア	77,272,882	0.35
	ノルウェー	74,142,426	0.34
	シンガポール	70,172,274	0.32
	フィンランド	60,753,558	0.27
	デンマーク	42,577,121	0.19
	スウェーデン	36,201,556	0.16
		21,643,643,514	97.81
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	—	484,615,330	2.19
純資産総額		22,128,258,844	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 J - R E I T マザーファンド

2026年6月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	10,701,472,800	98.49
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	—	163,655,864	1.51
純資産総額		10,865,128,664	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】

S O M P O 世界分散ファンド（安定型）＜ D C 年金 ＞

2026年6月30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	損保ジャパン外国債券マザーファンド	5,969,708	1.3881	8,287,118	1.3914	8,306,251	36.25
2	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファンド	4,149,132	1.2800	5,311,030	1.2524	5,196,372	22.68
3	日本	親投資信託 受益証券	S O M P O外国株式アクティブバ リュウ（リスク抑制型）マザー ファンド	1,024,970	3.7455	3,839,070	4.0386	4,139,443	18.07
4	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパンＪ－ＲＥＩＴマザー ファンド	502,989	3.5697	1,795,569	3.4153	1,717,858	7.50
5	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	293,002	2.2629	663,049	2.3458	687,324	3.00
6	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mラージキャップ・バ リュウ・マザーファンド	106,353	5.3989	574,198	6.4215	682,945	2.98
7	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド	82,527	7.0554	582,264	8.1884	675,764	2.95
8	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES GLOBAL REIT ETF	126	4,227.00	532,603	4,555.03	573,935	2.51
9	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	42	10,862.26	456,215	13,270.50	557,361	2.43

（注１）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注２）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	4.94
親投資信託受益証券	93.43
合計	98.37

（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。

S O M P O世界分散ファンド（安定成長型）＜ＤＣ年金＞

2026年6月30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	損保ジャパン外国債券マザーファンド	9,842,634	1.3884	13,666,189	1.3914	13,695,040	32.12
2	日本	親投資信託 受益証券	S O M P O外国株式アクティブバ リュウ（リスク抑制型）マザー ファンド	3,104,287	3.7349	11,594,251	4.0386	12,536,973	29.41
3	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパンＪ－ＲＥＩＴマザー ファンド	1,161,579	3.5537	4,127,958	3.4153	3,967,140	9.31
4	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	2,564,150	1.2759	3,271,755	1.2524	3,211,341	7.53
5	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	779,337	2.2663	1,766,217	2.3458	1,828,168	4.29
6	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mラージキャップ・バ リュウ・マザーファンド	276,767	5.4746	1,515,208	6.4215	1,777,259	4.17
7	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド	216,387	7.1641	1,550,223	8.1884	1,771,863	4.16
8	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES GLOBAL REIT ETF	381	4,243.90	1,616,929	4,555.03	1,735,470	4.07
9	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	120	11,215.10	1,345,813	13,270.50	1,592,461	3.74

（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

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	7.81
親投資信託受益証券	90.98
合計	98.79

（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。

S O M P O 世界分散ファンド（成長型）＜D C 年金＞

2026年6月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	親投資信託 受益証券	S O M P O 外国株式アクティブバ リュウ（リスク抑制型）マザー ファンド	5,256,285	3.7872	19,906,896	4.0386	21,228,032	39.85
2	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン J - R E I T マザー ファンド	1,573,829	3.5158	5,533,379	3.4153	5,375,098	10.09
3	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	2,135,006	2.2791	4,866,026	2.3458	5,008,297	9.40
4	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券マザーファ ンド	3,044,986	1.3886	4,228,565	1.3914	4,236,793	7.95
5	日本	親投資信託 受益証券	S J A M ラージキャップ・バ リュウ・マザーファンド	609,598	5.6349	3,435,067	6.4215	3,914,533	7.35
6	日本	親投資信託 受益証券	S J A M スモールキャップ・マ ザーファンド	476,691	7.3034	3,481,475	8.1884	3,903,336	7.33
7	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES GLOBAL REIT ETF	827	4,241.20	3,507,473	4,555.03	3,767,018	7.07
8	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	224	11,831.93	2,650,354	13,270.50	2,972,594	5.58
9	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	1,769,829	1.2733	2,253,650	1.2524	2,216,533	4.16

（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

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	12.65
親投資信託受益証券	86.14
合計	98.79

（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・バリュウ・マザーファンド

2026年6月30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	本田技研工業	輸送用機器	3,408,000	1,501.17	5,116,005,401	1,480.00	5,043,840,000	4.77
2	日本	株式	N T T	情報・通信業	32,313,800	151.01	4,879,929,677	145.00	4,685,501,000	4.43
3	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,681,300	3,431.39	5,769,212,799	2,725.00	4,581,542,500	4.33
4	日本	株式	三井住友トラストグループ	銀行業	727,200	5,485.21	3,988,851,824	6,057.00	4,404,650,400	4.17
5	日本	株式	西日本旅客鉄道	陸運業	1,410,000	2,857.27	4,028,758,683	2,725.00	3,842,250,000	3.63
6	日本	株式	デンソー	輸送用機器	1,972,400	2,116.81	4,175,197,875	1,876.00	3,700,222,400	3.50
7	日本	株式	アサヒグループホールディングス	食料品	2,266,900	1,659.28	3,761,436,837	1,548.00	3,509,161,200	3.32
8	日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	1,027,600	2,942.12	3,023,329,821	3,207.00	3,295,513,200	3.12
9	日本	株式	三井化学	化学	1,485,300	2,301.60	3,418,579,159	2,133.00	3,168,144,900	3.00
10	日本	株式	J F Eホールディングス	鉄鋼	2,005,500	1,997.10	4,005,202,160	1,560.00	3,128,580,000	2.96
11	日本	株式	オムロン	電気機器	513,400	5,170.32	2,654,443,082	5,800.00	2,977,720,000	2.82
12	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	849,200	3,637.55	3,089,011,363	3,408.00	2,894,073,600	2.74
13	日本	株式	ダイキン工業	機械	106,600	20,667.00	2,203,102,429	24,685.00	2,631,421,000	2.49
14	日本	株式	積水ハウス	建設業	767,700	3,323.81	2,551,691,374	3,382.00	2,596,361,400	2.46
15	日本	株式	三井不動産	不動産業	1,727,300	1,670.80	2,885,974,728	1,499.00	2,589,222,700	2.45
16	日本	株式	旭化成	化学	1,444,200	1,736.05	2,507,203,707	1,791.00	2,586,562,200	2.45
17	日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	1,321,100	2,032.80	2,685,539,666	1,957.00	2,585,392,700	2.45
18	日本	株式	京セラ	電気機器	695,700	2,653.43	1,845,991,251	3,561.00	2,477,387,700	2.34
19	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	385,700	5,955.48	2,297,029,998	6,346.00	2,447,652,200	2.31
20	日本	株式	ヤマトホールディングス	陸運業	1,318,700	1,836.03	2,421,179,000	1,834.50	2,419,155,150	2.29
21	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	702,800	3,437.04	2,415,555,651	3,410.00	2,396,548,000	2.27
22	日本	株式	明治ホールディングス	食料品	631,000	3,856.00	2,433,140,405	3,784.00	2,387,704,000	2.26
23	日本	株式	クボタ	機械	887,800	3,029.15	2,689,286,853	2,685.50	2,384,186,900	2.25
24	日本	株式	住友林業	建設業	1,728,200	1,413.60	2,442,992,231	1,350.50	2,333,934,100	2.21
25	日本	株式	東北電力	電気・ガス業	2,049,800	1,203.92	2,467,813,583	1,064.50	2,182,012,100	2.06
26	日本	株式	ニトリホールディングス	小売業	866,000	2,962.66	2,565,666,752	2,414.50	2,090,957,000	1.98
27	日本	株式	王子ホールディングス	パルプ・紙	2,533,300	923.05	2,338,369,744	795.40	2,014,986,820	1.91
28	日本	株式	A G C	ガラス・土石製品	289,300	6,277.60	1,816,109,680	6,965.00	2,014,974,500	1.91
29	日本	株式	京成電鉄	陸運業	1,546,400	1,324.93	2,048,877,420	1,161.00	1,795,370,400	1.70
30	日本	株式	ゆうちょ銀行	銀行業	572,700	3,044.36	1,743,509,062	3,063.00	1,754,180,100	1.66

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別及び業種別投資比率

2026年6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	5.76
		食料品	6.95
		繊維製品	1.29

	パルプ・紙	1.91
	化学	6.83
	医薬品	0.97
	ゴム製品	2.27
	ガラス・土石製品	1.91
	鉄鋼	2.96
	非鉄金属	1.56
	金属製品	1.29
	機械	7.12
	電気機器	7.47
	輸送用機器	12.60
	電気・ガス業	2.06
	陸運業	11.96
	情報・通信業	4.43
	小売業	4.42
	銀行業	12.71
	不動産業	2.45
合計		98.94

（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

2026年6月30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	カカコム	サービス業	346,300	2,013.22	697,179,975	3,390.00	1,173,957,000	3.92
2	日本	株式	ジェイテクト	機械	583,700	1,580.35	922,451,473	1,991.50	1,162,438,550	3.88
3	日本	株式	レンゴー	パルプ・紙	710,300	983.06	698,271,285	1,417.50	1,006,850,250	3.36
4	日本	株式	セリア	小売業	250,300	3,196.09	799,983,013	3,635.00	909,840,500	3.04
5	日本	株式	日本M & A センター ホールディングス	サービス業	1,405,000	753.54	1,058,724,190	636.70	894,563,500	2.99
6	日本	株式	マブチモーター	電気機器	525,200	1,301.15	683,364,779	1,569.50	824,301,400	2.75
7	日本	株式	日揮ホールディングス	建設業	308,700	1,571.30	485,063,012	2,504.50	773,139,150	2.58
8	日本	株式	ケースホールディングス	小売業	400,300	1,594.59	638,318,251	1,905.50	762,771,650	2.55
9	日本	株式	日本化薬	化学	359,500	1,480.03	532,071,793	1,993.00	716,483,500	2.39
10	日本	株式	エス・エム・エス	サービス業	317,600	1,557.71	494,728,708	2,234.00	709,518,400	2.37
11	日本	株式	イズミ	小売業	730,200	1,039.79	759,259,096	961.00	701,722,200	2.34
12	日本	株式	住友重機械工業	機械	137,500	3,879.25	533,397,127	5,058.00	695,475,000	2.32
13	日本	株式	トヨタ紡織	輸送用機器	315,600	2,480.05	782,705,471	2,126.00	670,965,600	2.24
14	日本	株式	京成電鉄	陸運業	577,800	1,194.22	690,023,982	1,161.00	670,825,800	2.24
15	日本	株式	不二越	機械	111,400	4,190.07	466,774,826	5,930.00	660,602,000	2.21
16	日本	株式	E I Z O	電気機器	264,100	2,256.59	595,966,617	2,488.00	657,080,800	2.19
17	日本	株式	日本ライフライン	卸売業	455,100	1,436.38	653,699,741	1,295.00	589,354,500	1.97
18	日本	株式	ベルシステム24 ホールディングス	サービス業	435,300	1,398.36	608,708,611	1,353.00	588,960,900	1.97

19	日本	株式	ニッポン	食料品	208,200	2,350.63	489,401,973	2,806.00	584,209,200	1.95
20	日本	株式	トラスコ中山	卸売業	249,300	2,415.70	602,234,552	2,274.00	566,908,200	1.89
21	日本	株式	エン	サービス業	492,700	1,546.73	762,077,820	1,136.00	559,707,200	1.87
22	日本	株式	サワイグループホールディングス	医薬品	326,500	1,981.69	647,024,116	1,685.00	550,152,500	1.84
23	日本	株式	カナモト	サービス業	98,900	4,056.20	401,158,229	5,310.00	525,159,000	1.75
24	日本	株式	東亜合成	化学	287,900	1,586.83	456,848,555	1,740.50	501,089,950	1.67
25	日本	株式	コーセーホールディングス	化学	89,000	5,566.31	495,402,398	5,023.00	447,047,000	1.49
26	日本	株式	デンカ	化学	87,300	2,524.05	220,349,873	4,336.00	378,532,800	1.26
27	日本	株式	アルフレッサ ホールディングス	卸売業	171,100	2,318.04	396,617,965	2,174.00	371,971,400	1.24
28	日本	株式	コメリ	小売業	101,600	3,382.28	343,639,962	3,555.00	361,188,000	1.21
29	日本	株式	ツムラ	医薬品	87,000	3,782.28	329,058,756	3,719.00	323,553,000	1.08
30	日本	株式	メニコン	精密機器	187,600	1,250.00	234,501,735	1,659.00	311,228,400	1.04

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別及び業種別投資比率

2026年6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	2.83
		食料品	3.49
		パルプ・紙	4.60
		化学	13.56
		医薬品	3.27
		ガラス・土石製品	0.44
		鉄鋼	0.99
		金属製品	1.01
		機械	8.41
		電気機器	11.51
		輸送用機器	3.47
		精密機器	1.04
		その他製品	0.59
		電気・ガス業	1.03
		陸運業	3.15
		情報・通信業	0.26
		卸売業	7.23
		小売業	11.02
		銀行業	3.29
		不動産業	0.23
		サービス業	17.74
合計			99.16

（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 O M P O外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）マザーファンド

2026年6月30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	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3,310	44,319.38	146,697,166	45,751.75	151,438,321	5.01
2	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	2,310	45,610.47	105,360,207	57,429.22	132,661,506	4.39
3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1,980	79,839.01	158,081,248	59,852.08	118,507,123	3.92
4	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	3,340	32,035.83	106,999,699	31,661.17	105,748,335	3.50
5	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	1,326	54,776.08	72,633,083	55,480.54	73,567,201	2.44
6	アメリカ	株式	APPLIED MATERIALS INC	半導体・半導体製造装置	570	40,270.61	22,954,250	112,802.58	64,297,476	2.13
7	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,463	31,050.59	45,427,016	41,979.43	61,415,919	2.03
8	アメリカ	株式	KLA CORP	半導体・半導体製造装置	1,300	20,509.13	26,661,874	45,207.75	58,770,078	1.95
9	アメリカ	株式	UNION PACIFIC CORP	運輸	1,300	36,563.58	47,532,664	44,283.75	57,568,879	1.91
10	アメリカ	株式	ROCKWELL AUTOMATION INC	資本財	700	59,071.11	41,349,780	78,325.56	54,827,898	1.81
11	アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,590	16,188.77	41,928,919	21,010.01	54,415,947	1.80
12	アメリカ	株式	QUALCOMM INCORPORATED	半導体・半導体製造装置	1,680	29,216.59	49,083,872	30,646.24	51,485,685	1.70
13	アメリカ	株式	COCA-COLA COMPANY	食品・飲料・タバコ	3,690	11,287.31	41,650,200	13,421.53	49,525,459	1.64
14	アメリカ	株式	CVS HEALTH CORPORATION	ヘルスケア機器・サービス	2,860	12,665.39	36,223,043	16,820.35	48,106,219	1.59
15	アメリカ	株式	UNITED PARCEL SERVICE-CLB	運輸	2,740	15,990.67	43,814,455	17,539.74	48,058,898	1.59
16	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	837	61,810.83	51,735,666	56,968.03	47,682,246	1.58
17	アメリカ	株式	COLGATE-PALMOLIVE CO	家庭用品・パーソナル用品	3,110	12,931.68	40,217,535	15,004.83	46,665,040	1.54
18	アメリカ	株式	ULTA BEAUTY INC	一般消費財・サービス流通・小売り	610	84,695.88	51,664,489	74,556.49	45,479,463	1.51
19	アイルランド	株式	MEDTRONIC INC	ヘルスケア機器・サービス	3,230	14,733.99	47,590,819	13,142.22	42,449,379	1.41
20	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	1,820	6,170.82	11,230,893	21,390.01	38,929,820	1.29
21	アメリカ	株式	JP MORGAN CHASE & CO	銀行	720	50,073.38	36,052,840	53,489.64	38,512,542	1.27
22	アメリカ	株式	ALLSTATE CORP	保険	980	31,914.08	31,275,804	39,197.69	38,413,744	1.27
23	スペイン	株式	INDITEX	一般消費財・サービス流通・小売り	3,651	9,424.49	34,408,824	10,268.39	37,489,892	1.24

24	フランス	株式	SANOFI	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,676	15,801.50	42,284,833	13,993.92	37,447,743	1.24
25	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,900	11,857.25	22,528,792	19,113.30	36,315,276	1.20
26	ドイツ	株式	INFINEON TECHNOLOGIES AG	半導体・半導体製造装置	2,467	6,503.93	16,045,199	14,501.78	35,775,901	1.18
27	オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	5,281	4,949.91	26,140,513	6,673.51	35,242,855	1.17
28	フィンランド	株式	NESTE OIL OYJ	エネルギー	6,730	3,284.40	22,104,026	5,113.80	34,415,918	1.14
29	アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	1,280	39,810.23	50,957,106	25,646.25	32,827,203	1.09
30	デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,185	7,759.90	32,475,191	7,809.51	32,682,841	1.08

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別及び業種別投資比率

2026年6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.03
		素材	5.29
		資本財	5.00
		商業・専門サービス	0.52
		運輸	3.89
		耐久消費財・アパレル	1.95
		メディア・娯楽	5.33
		一般消費財・サービス流通・小売り	6.23
		生活必需品流通・小売り	3.13
		食品・飲料・タバコ	3.53
		家庭用品・パーソナル用品	1.77
		ヘルスケア機器・サービス	3.59
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.53
		銀行	4.46
		金融サービス	3.49
		保険	3.84
		ソフトウェア・サービス	7.03
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.21
		電気通信サービス	1.77
		公益事業	1.13
		半導体・半導体製造装置	13.23
投資証券	—	—	0.69
合計			93.66

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

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2026年6月30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377回利付国債（10年）	2,760,000,000	90.70	2,503,573,000	90.31	2,492,611,200	1.2000000	2034/12/20	6.40
2	日本	国債証券	第366回利付国債（10年）	2,050,000,000	90.14	1,847,984,500	90.16	1,848,321,000	0.2000000	2032/3/20	4.75
3	日本	国債証券	第179回利付国債（5年）	1,650,000,000	98.33	1,622,469,000	97.12	1,602,562,500	1.0000000	2030/6/20	4.12
4	日本	国債証券	第184回利付国債（5年）	1,300,000,000	99.68	1,295,900,000	99.58	1,294,644,000	1.8000000	2031/3/20	3.33
5	日本	国債証券	第381回利付国債（10年）	1,350,000,000	98.33	1,327,456,500	95.69	1,291,828,500	2.1000000	2035/12/20	3.32
6	日本	国債証券	第183回利付国債（20年）	1,560,000,000	81.74	1,275,284,000	75.04	1,170,624,000	1.4000000	2042/12/20	3.01
7	日本	国債証券	第382回利付国債（10年）	1,150,000,000	97.80	1,124,792,000	97.84	1,125,171,500	2.4000000	2036/3/20	2.89
8	日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	910,000,000	92.89	845,299,000	92.54	842,141,300	0.1000000	2030/12/20	2.16
9	日本	国債証券	第181回利付国債（5年）	720,000,000	100.04	720,300,100	97.96	705,319,200	1.3000000	2030/9/20	1.81
10	日本	国債証券	第162回利付国債（5年）	680,000,000	98.05	666,754,400	97.57	663,523,600	0.3000000	2028/9/20	1.70
11	日本	国債証券	第82回利付国債（30年）	950,000,000	66.30	629,926,000	64.24	610,299,000	1.8000000	2054/3/20	1.57
12	日本	国債証券	第483回利付国債（2年）	600,000,000	100.02	600,138,000	100.11	600,666,000	1.4000000	2028/4/1	1.54
13	日本	国債証券	第173回利付国債（20年）	830,000,000	70.23	582,963,400	68.78	570,907,200	0.4000000	2040/6/20	1.47
14	日本	国債証券	第192回利付国債（20年）	660,000,000	86.24	569,236,800	84.36	556,795,800	2.4000000	2045/3/20	1.43
15	日本	国債証券	第183回利付国債（5年）	550,000,000	99.64	548,046,000	98.92	544,093,000	1.6000000	2030/12/20	1.40
16	日本	国債証券	第479回利付国債（2年）	500,000,000	99.79	498,965,000	99.62	498,115,000	1.0000000	2027/12/1	1.28
17	日本	国債証券	第369回利付国債（10年）	550,000,000	91.29	502,147,500	90.14	495,770,000	0.5000000	2032/12/20	1.27
18	日本	国債証券	第376回利付国債（10年）	550,000,000	90.44	497,420,000	88.63	487,487,000	0.9000000	2034/9/20	1.25
19	日本	国債証券	第169回利付国債（5年）	500,000,000	97.19	485,950,000	97.38	486,940,000	0.5000000	2029/3/20	1.25
20	日本	国債証券	第172回利付国債（5年）	500,000,000	98.22	491,105,000	97.03	485,160,000	0.5000000	2029/6/20	1.25

21	日本	国債証券	第372回利付国債（10年）	500,000,000	92.98	464,935,000	90.23	451,175,000	0.8000000	2033/9/20	1.16
22	日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	430,000,000	97.85	420,780,800	97.53	419,400,500	0.1000000	2028/6/20	1.08
23	日本	国債証券	第375回利付国債（10年）	450,000,000	94.90	427,050,000	90.66	407,992,500	1.1000000	2034/6/20	1.05
24	日本	国債証券	第185回利付国債（5年）	400,000,000	100.60	402,436,000	100.47	401,904,000	2.0000000	2031/3/20	1.03
25	日本	国債証券	第368回利付国債（10年）	440,000,000	92.10	405,257,600	88.93	391,300,800	0.2000000	2032/9/20	1.01
26	日本	国債証券	第178回利付国債（5年）	400,000,000	99.77	399,108,000	97.51	390,072,000	1.0000000	2030/3/20	1.00
27	日本	社債券	第36回NTTファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定同順）	400,000,000	97.85	391,432,000	96.20	384,828,000	0.9230000	2029/12/20	0.99
28	日本	社債券	第52回鹿島建設株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	400,000,000	100.00	400,000,000	95.43	381,740,000	1.7340000	2032/9/10	0.98
29	日本	国債証券	第195回利付国債（20年）	400,000,000	100.06	400,240,000	94.50	378,004,000	3.2000000	2045/12/20	0.97
30	日本	国債証券	第83回利付国債（30年）	500,000,000	82.82	414,144,500	70.81	354,080,000	2.2000000	2054/6/20	0.91

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

（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

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	76.32
地方債証券	2.35
特殊債券	1.02
社債券	18.13
合計	97.83

（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マザーファンド

2026年6月30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 2.75 280215	1,620,000	15,944.89	258,307,359	15,890.74	257,430,142	2.7500000	2028/2/15	16.96
2	アメリカ	国債証券	Treasury 4.5 290531	540,000	16,567.02	89,461,950	16,411.53	88,622,313	4.5000000	2029/5/31	5.84
3	中国	国債証券	CGB 2.67 331125	1,500,000	2,564.72	38,470,873	2,567.60	38,514,136	2.6700000	2033/11/25	2.54

4	アメリカ	国債証券	Treasury 3.375 330515	230,000	15,355.37	35,317,352	15,406.75	35,435,528	3.3750000	2033/5/15	2.34
5	中国	国債証券	CGB 1.83 350825	1,300,000	2,382.95	30,978,391	2,403.46	31,245,074	1.8300000	2035/8/25	2.06
6	アメリカ	国債証券	Treasury 4.375 360515	180,000	16,157.17	29,082,907	16,246.61	29,243,901	4.3750000	2036/5/15	1.93
7	アメリカ	国債証券	Treasury 1.75 291115	180,000	14,845.99	26,722,796	15,045.17	27,081,322	1.7500000	2029/11/15	1.78
8	イタリア	国債証券	ITALY 3.85 340701	140,000	19,052.88	26,674,042	19,135.53	26,789,747	3.8500000	2034/7/1	1.77
9	中国	国債証券	CGB 2.8 321115	1,000,000	2,575.96	25,759,692	2,572.28	25,722,834	2.8000000	2032/11/15	1.70
10	アメリカ	国債証券	Treasury 2.25 270815	160,000	15,706.36	25,130,177	15,910.41	25,456,661	2.2500000	2027/8/15	1.68
11	中国	国債証券	CGB 2.6 320901	1,000,000	2,538.47	25,384,700	2,536.85	25,368,593	2.6000000	2032/9/1	1.67
12	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 421115	200,000	12,068.87	24,137,750	12,474.21	24,948,432	2.7500000	2042/11/15	1.64
13	中国	国債証券	CGB 2.8 290324	1,000,000	2,497.26	24,972,680	2,486.77	24,867,736	2.8000000	2029/3/24	1.64
14	中国	国債証券	CGB 2.91 281014	1,000,000	2,496.17	24,961,758	2,480.77	24,807,755	2.9100000	2028/10/14	1.63
15	イタリア	国債証券	ITALY 2.8 281201	130,000	18,607.28	24,189,472	18,588.01	24,164,413	2.8000000	2028/12/1	1.59
16	中国	国債証券	CGB 2.04 270225	1,000,000	2,408.22	24,082,225	2,400.05	24,000,583	2.0400000	2027/2/25	1.58
17	アメリカ	国債証券	Treasury 2.375 290515	140,000	15,351.56	21,492,189	15,485.40	21,679,572	2.3750000	2029/5/15	1.43
18	カナダ	国債証券	CANADA 0.5 301201	200,000	9,933.33	19,866,666	10,260.91	20,521,825	0.5000000	2030/12/1	1.35
19	フランス	国債証券	FRANCE 3.5 351125	110,000	18,425.13	20,267,652	18,490.51	20,339,568	3.5000000	2035/11/25	1.34
20	ドイツ	国債証券	GERMANY 2.6 350815	110,000	18,067.11	19,873,831	18,199.12	20,019,032	2.6000000	2035/8/15	1.32
21	オーストリア	国債証券	AUSTRIA 4.15 370315	90,000	20,178.83	18,160,951	20,147.58	18,132,824	4.1500000	2037/3/15	1.19
22	シンガポール	国債証券	SINGAPORE 2.875 290701	130,000	13,030.01	16,939,018	12,994.86	16,893,325	2.8750000	2029/7/1	1.11
23	イタリア	国債証券	ITALY 3.25 320715	90,000	18,593.90	16,734,511	18,637.61	16,773,849	3.2500000	2032/7/15	1.11
24	スペイン	国債証券	SPAIN 3.1 310730	80,000	18,719.77	14,975,820	18,783.87	15,027,101	3.1000000	2031/7/30	0.99
25	アメリカ	国債証券	Treasury 5.0 560515	90,000	16,395.04	14,755,542	16,599.30	14,939,372	5.0000000	2056/5/15	0.98
26	アメリカ	国債証券	Treasury 4.625 400215	90,000	15,998.58	14,398,726	16,280.86	14,652,779	4.6250000	2040/2/15	0.97
27	オランダ	国債証券	NETHERLANDS 2.5 330115	80,000	18,340.56	14,672,451	18,247.83	14,598,270	2.5000000	2033/1/15	0.96
28	アメリカ	国債証券	Treasury 6.125 271115	85,000	17,048.41	14,491,150	16,684.30	14,181,657	6.1250000	2027/11/15	0.93
29	フランス	国債証券	FRANCE 4.0 550425	80,000	17,307.61	13,846,090	17,380.27	13,904,216	4.0000000	2055/4/25	0.92
30	中国	国債証券	CGB 3.0 531015	500,000	2,953.09	14,765,458	2,762.31	13,811,564	3.0000000	2053/10/15	0.91

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

（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

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.59
合計	97.59

（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

2026年6月30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 2.75 280215	40,870,000	15,945.40	6,516,888,256	15,890.74	6,494,549,364	2.7500000	2028/2/15	29.35
2	アメリカ	国債証券	Treasury 4.5 290531	7,940,000	16,635.23	1,320,837,389	16,411.53	1,303,076,226	4.5000000	2029/5/31	5.89
3	アメリカ	国債証券	Treasury 3.375 330515	3,190,000	15,347.25	489,577,493	15,406.75	491,475,365	3.3750000	2033/5/15	2.22
4	中国	国債証券	CGB 1.83 350825	17,000,000	2,382.95	405,102,033	2,403.46	408,589,425	1.8300000	2035/8/25	1.85
5	イタリア	国債証券	ITALY 3.25 320715	2,110,000	18,557.97	391,573,376	18,637.60	393,253,566	3.2500000	2032/7/15	1.78
6	イタリア	国債証券	ITALY 2.8 281201	2,115,000	18,581.33	392,995,288	18,588.01	393,136,414	2.8000000	2028/12/1	1.78
7	ドイツ	国債証券	GERMANY 1.9 270916	1,810,000	18,387.89	332,820,948	18,400.02	333,040,510	1.9000000	2027/9/16	1.51
8	アメリカ	国債証券	Treasury 4.375 360515	2,000,000	16,157.17	323,143,414	16,246.61	324,932,241	4.3750000	2036/5/15	1.47
9	アメリカ	国債証券	Treasury 1.75 410815	2,730,000	10,534.41	287,589,581	10,996.84	300,213,944	1.7500000	2041/8/15	1.36
10	アメリカ	国債証券	Treasury 4.625 310531	1,740,000	16,886.09	293,818,013	16,580.90	288,507,782	4.6250000	2031/5/31	1.30
11	中国	国債証券	CGB 2.18 260815	12,000,000	2,405.19	288,623,059	2,389.07	286,689,086	2.1800000	2026/8/15	1.30
12	スペイン	国債証券	SPAIN 3.1 310730	1,510,000	18,722.13	282,704,253	18,783.87	283,636,540	3.1000000	2031/7/30	1.28
13	中国	国債証券	CGB 2.8 321115	11,000,000	2,575.96	283,356,603	2,572.28	282,951,170	2.8000000	2032/11/15	1.28
14	ドイツ	国債証券	GERMANY 2.6 350815	1,550,000	18,084.19	280,305,083	18,199.12	282,086,415	2.6000000	2035/8/15	1.27
15	フランス	国債証券	FRANCE 3.5 351125	1,450,000	18,452.07	267,555,135	18,490.51	268,112,482	3.5000000	2035/11/25	1.21
16	フランス	国債証券	FRANCE 4.0 550425	1,540,000	17,321.96	266,758,316	17,380.26	267,656,151	4.0000000	2055/4/25	1.21
17	フランス	国債証券	FRANCE 5.5 290425	1,335,000	19,911.30	265,815,944	19,904.18	265,720,809	5.5000000	2029/4/25	1.20
18	イタリア	国債証券	ITALY 3.85 340701	1,310,000	19,007.14	248,993,629	19,135.53	250,675,495	3.8500000	2034/7/1	1.13
19	中国	国債証券	CGB 2.67 331125	9,500,000	2,564.72	243,648,864	2,567.60	243,922,864	2.6700000	2033/11/25	1.10
20	中国	国債証券	CGB 2.04 270225	10,000,000	2,408.22	240,822,256	2,400.05	240,005,833	2.0400000	2027/2/25	1.08
21	ドイツ	国債証券	GERMANY 2.5 540815	1,540,000	15,216.86	234,339,673	15,518.42	238,983,803	2.5000000	2054/8/15	1.08
22	アメリカ	国債証券	Treasury 3.875 330815	1,340,000	15,787.66	211,554,715	15,864.74	212,587,538	3.8750000	2033/8/15	0.96
23	アメリカ	国債証券	Treasury 4.125 530815	1,480,000	14,097.48	208,642,732	14,351.21	212,398,001	4.1250000	2053/8/15	0.96
24	フランス	国債証券	FRANCE 3.5 331125	1,030,000	18,664.74	192,246,873	18,778.47	193,418,300	3.5000000	2033/11/25	0.87
25	オーストリア	国債証券	AUSTRIA 4.15 370315	950,000	20,187.75	191,783,699	20,147.58	191,402,030	4.1500000	2037/3/15	0.86
26	スペイン	国債証券	SPAIN 3.45 341031	1,010,000	18,813.09	190,012,294	18,925.55	191,148,065	3.4500000	2034/10/31	0.86
27	アメリカ	国債証券	Treasury 5.0 560515	1,150,000	16,395.04	188,543,037	16,599.30	190,891,982	5.0000000	2056/5/15	0.86

28	中国	国債証券	CGB 2.8 300325	7,500,000	2,520.48	189,036,042	2,515.95	188,696,418	2.8000000	2030/3/25	0.85
29	ポーランド	国債証券	POLAND 1.75 320425	5,000,000	3,661.82	183,091,133	3,655.94	182,797,162	1.7500000	2032/4/25	0.83
30	スペイン	国債証券	SPAIN 4.7 410730	865,000	20,529.45	177,579,752	20,716.64	179,198,951	4.7000000	2041/7/30	0.81

（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

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.81
合計	97.81

（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 J - R E I T マザーファンド

2026年6月30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	投資証券	日本ビルファンド投資法人	7,756	123,546	958,228,190	125,900	976,480,400	8.99
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	8,199	113,296	928,916,103	115,800	949,444,200	8.74
3	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	5,194	154,752	803,782,062	151,800	788,449,200	7.26
4	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	8,573	85,902	736,441,784	86,800	744,136,400	6.85
5	日本	投資証券	K D X不動産投資法人	4,779	159,270	761,153,901	154,900	740,267,100	6.81
6	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	3,975	129,784	515,894,045	128,600	511,185,000	4.70
7	日本	投資証券	森トラストリート投資法人	6,679	73,590	491,513,830	74,300	496,249,700	4.57
8	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	3,192	157,866	503,910,747	155,300	495,717,600	4.56
9	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	5,102	92,210	470,456,396	94,900	484,179,800	4.46
10	日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	3,498	134,025	468,820,569	137,100	479,575,800	4.41
11	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,031	75,616	456,045,946	79,300	478,258,300	4.40
12	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3,900	121,184	472,621,149	120,500	469,950,000	4.33
13	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	5,601	83,171	465,843,762	80,400	450,320,400	4.14
14	日本	投資証券	G L P 投資法人	3,096	134,092	415,149,513	137,400	425,390,400	3.92
15	日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,249	107,888	350,528,878	107,800	350,242,200	3.22
16	日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,162	140,885	304,595,240	141,900	306,787,800	2.82
17	日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	2,556	113,154	289,222,818	112,100	286,527,600	2.64
18	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	2,536	95,290	241,656,141	93,300	236,608,800	2.18
19	日本	投資証券	S O S I L A 物流リート投資法人	2,023	119,732	242,219,699	113,400	229,408,200	2.11
20	日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	1,616	121,114	195,720,396	119,500	193,112,000	1.78
21	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	910	187,464	170,592,291	184,900	168,259,000	1.55
22	日本	投資証券	星野リゾート・リート投資法人	693	244,450	169,404,017	239,800	166,181,400	1.53
23	日本	投資証券	日本リート投資法人	1,447	86,775	125,564,762	83,700	121,113,900	1.11
24	日本	投資証券	グローバル・ワン不動産投資法人	925	108,194	100,080,302	109,200	101,010,000	0.93

25	日本	投資証券	ザイマックス・リート投資法人	504	107,976	54,419,907	104,400	52,617,600	0.48
----	----	------	----------------	-----	---------	------------	---------	------------	------

（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

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	98.49
合計	98.49

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

S O M P O世界分散ファンド（安定型）＜D C 年金＞

該当事項はありません。

S O M P O世界分散ファンド（安定成長型）＜D C 年金＞

該当事項はありません。

S O M P O世界分散ファンド（成長型）＜D C 年金＞

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）S O M P O外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）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J - R E I T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】

S O M P O世界分散ファンド（安定型）＜D C 年金＞

2026年6月30日現在

種類	通貨	買建 / 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資比率 （％）
----	----	---------	----	-------------	-------------	-------------

為替予約取引	ドル	買建	1,000.00	162,188	162,377	0.71
--------	----	----	----------	---------	---------	------

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当銘柄の時価の比率です。

（注2）為替予約取引の時価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

S O M P O世界分散ファンド（安定成長型）＜D C 年金＞

該当事項はありません。

S O M P O世界分散ファンド（成長型）＜D C 年金＞

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）S O M P O外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）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マザーファンド

2026年6月30日現在

種類	通貨	買建 / 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資比率 （％）
為替予約取引	ドル	売建	3,995,000.00	635,514,528	648,384,505	42.73
	カナダドル	売建	306,000.00	35,291,683	34,921,332	2.30
	メキシコペソ	売建	1,956,000.00	17,884,998	18,122,535	1.19
	ユーロ	売建	2,149,000.00	399,037,370	398,211,849	26.24
	ポンド	売建	371,000.00	79,447,869	79,737,657	5.25
	スウェーデンクローナ	売建	181,000.00	3,120,029	3,024,093	0.20
	ノルウェークローネ	売建	233,000.00	4,007,180	3,805,053	0.25
	デンマーククローネ	売建	237,000.00	5,890,303	5,876,486	0.39
	ポーランドズロチ	売建	230,000.00	10,074,851	9,921,947	0.65
	オーストラリアドル	売建	225,000.00	25,675,312	25,083,157	1.65
	シンガポールドル	売建	184,000.00	22,961,139	23,095,367	1.52
	オフショア人民元	売建	9,787,000.00	230,564,201	233,382,759	15.38

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当銘柄の時価の比率です。

（注2）為替予約取引の時価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

（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J - R E I T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】

S O M P O世界分散ファンド（安定型）＜ＤＣ年金＞

直近日（2026年6月末）、同日前１年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）		１口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末（2023年12月15日）	10,449,187	10,449,187	1.0271	1.0271
第2計算期間末（2024年12月16日）	11,955,023	11,955,023	1.0603	1.0603
第3計算期間末（2025年12月15日）	16,568,966	16,568,966	1.1105	1.1105
2025年 6月末日	14,440,958	—	1.0543	—
7月末日	15,013,403	—	1.0677	—
8月末日	15,362,475	—	1.0769	—
9月末日	15,708,101	—	1.0858	—
10月末日	16,215,084	—	1.1033	—
11月末日	16,622,236	—	1.1141	—
12月末日	16,649,422	—	1.1156	—
2026年 1月末日	17,188,562	—	1.1174	—
2月末日	17,585,533	—	1.1429	—
3月末日	17,426,545	—	1.1000	—
4月末日	18,030,064	—	1.1219	—
5月末日	18,539,986	—	1.1351	—
6月末日	22,910,692	—	1.1396	—

S O M P O世界分散ファンド（安定成長型）＜ＤＣ年金＞

直近日（2026年6月末）、同日前１年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）		１口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末（2023年12月15日）	5,697,195	5,697,195	1.0678	1.0678
第2計算期間末（2024年12月16日）	14,439,527	14,439,527	1.1385	1.1385
第3計算期間末（2025年12月15日）	27,824,757	27,824,757	1.2555	1.2555
2025年 6月末日	22,125,181	—	1.1411	—
7月末日	23,603,888	—	1.1698	—
8月末日	24,845,429	—	1.1871	—
9月末日	25,839,421	—	1.2017	—
10月末日	26,623,456	—	1.2320	—
11月末日	27,859,884	—	1.2563	—
12月末日	28,059,267	—	1.2654	—
2026年 1月末日	27,321,508	—	1.2717	—
2月末日	28,123,679	—	1.3084	—
3月末日	28,778,507	—	1.2470	—
4月末日	30,530,923	—	1.2920	—

5月末日	35,564,985	—	1.3161	—
6月末日	42,631,127	—	1.3242	—

SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞

直近日（2026年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末（2023年12月15日）	6,510,521	6,510,521	1.1294	1.1294
第2計算期間末（2024年12月16日）	17,146,251	17,146,251	1.2622	1.2622
第3計算期間末（2025年12月15日）	28,047,494	28,047,494	1.4490	1.4490
2025年 6月末日	21,319,922	—	1.2611	—
7月末日	22,987,528	—	1.3080	—
8月末日	24,137,242	—	1.3329	—
9月末日	25,122,110	—	1.3581	—
10月末日	26,624,334	—	1.4059	—
11月末日	27,944,936	—	1.4437	—
12月末日	28,332,861	—	1.4628	—
2026年 1月末日	29,748,737	—	1.4768	—
2月末日	30,983,086	—	1.5371	—
3月末日	30,435,031	—	1.4490	—
4月末日	32,687,654	—	1.5265	—
5月末日	34,227,907	—	1.5695	—
6月末日	53,265,952	—	1.5827	—

【分配の推移】

SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4中間計算期間末	—

SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4中間計算期間末	—

SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000

第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4中間計算期間末	—

【収益率の推移】

S O M P O 世界分散ファンド（安定型）＜D C 年金＞

	収益率（％）
第1計算期間	2.7
第2計算期間	3.2
第3計算期間	4.7
第4中間計算期間末	2.3

（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。

S O M P O 世界分散ファンド（安定成長型）＜D C 年金＞

	収益率（％）
第1計算期間	6.8
第2計算期間	6.6
第3計算期間	10.3
第4中間計算期間末	5.0

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

S O M P O 世界分散ファンド（成長型）＜D C 年金＞

	収益率（％）
第1計算期間	12.9
第2計算期間	11.8
第3計算期間	14.8
第4中間計算期間末	8.6

（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。

（４）【設定及び解約の実績】

S O M P O 世界分散ファンド（安定型）＜D C 年金＞

	設定口数	解約口数
第1計算期間	10,173,838	—
第2計算期間	1,100,943	—
第3計算期間	4,011,594	366,436
第4中間計算期間末	4,921,474	285

（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。

S O M P O世界分散ファンド（安定成長型）＜D C 年金＞

	設定口数	解約口数
第1計算期間	5,335,472	—
第2計算期間	7,415,991	68,600
第3計算期間	10,758,907	1,278,752
第4中間計算期間末	11,212,743	1,857,045

（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。

S O M P O世界分散ファンド（成長型）＜D C 年金＞

	設定口数	解約口数
第1計算期間	5,764,785	—
第2計算期間	8,928,502	1,108,338
第3計算期間	6,819,639	1,048,424
第4中間計算期間末	14,044,054	190,701

（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。

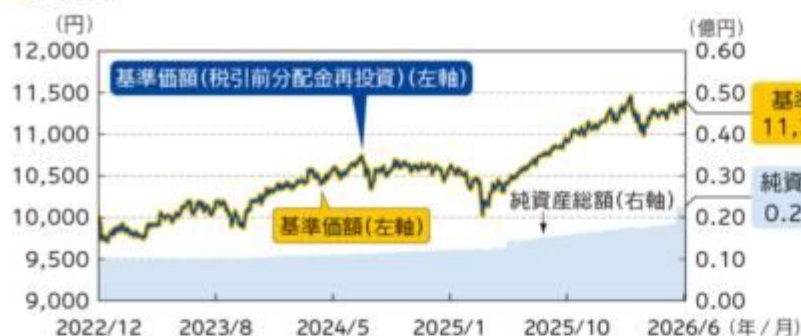
参考情報

基準日:2026年6月30日

基準価額・純資産の推移 2022/12/15～2026/06/30

分配の推移

●安定型



●安定型

2023年12月	0円
2024年12月	0円
2025年12月	0円
-	-
-	-
設定来累計	0円

● 1万口当たり、税引前

●安定成長型

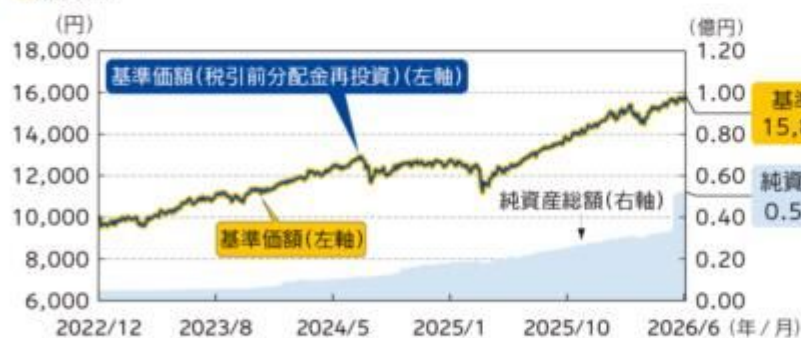


●安定成長型

2023年12月	0円
2024年12月	0円
2025年12月	0円
-	-
-	-
設定来累計	0円

● 1万口当たり、税引前

●成長型



●成長型

2023年12月	0円
2024年12月	0円
2025年12月	0円
-	-
-	-
設定来累計	0円

● 1万口当たり、税引前

- 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。

- 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。

主要な資産の状況

	安定型	安定成長型	成長型
資産別構成			
資産の種類	純資産比	純資産比	純資産比
損保ジャパン外国債券マザーファンド	36.25%	32.12%	7.95%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	22.68%	7.53%	4.16%
SOMPO外国株式アクティブバリュー（リスク抑制）マザー	18.07%	29.41%	39.85%
損保ジャパンJ-REITマザーファンド	7.50%	9.31%	10.09%
SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	2.98%	4.17%	7.35%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	2.95%	4.16%	7.33%
損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド	3.00%	4.29%	9.40%
ISHARES CORE MSCI EMERGING	2.43%	3.74%	5.58%
ISHARES GLOBAL REIT ETF	2.51%	4.07%	7.07%
コール・ローン等	1.63%	1.21%	1.21%
合 計	100.00%	100.00%	100.00%

● 損保ジャパン外国債券マザーファンド

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 2.75 280215	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2028/02/15	17.0%
2	Treasury 4.5 290531	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2029/05/31	5.8%
3	CGB 2.67 331125	中国	国債証券	オフショア・人民元	2033/11/25	2.5%
4	Treasury 3.375 330515	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2033/05/15	2.3%
5	CGB 1.83 350825	中国	国債証券	オフショア・人民元	2035/08/25	2.1%
組入銘柄数					136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377回利付国債(10年)	国債証券	2034/12/20	6.4%	
2 第366回利付国債(10年)	国債証券	2032/03/20	4.7%	
3 第179回利付国債(5年)	国債証券	2030/06/20	4.1%	
4 第184回利付国債(5年)	国債証券	2031/03/20	3.3%	
5 第381回利付国債(10年)	国債証券	2035/12/20	3.3%	
組入銘柄数			130銘柄	

● SOMPO外国株式アクティブバリュー（リスク抑制）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	APPLE INC	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	5.0%
2	ALPHABET INC-CL A	アメリカ・ドル	アメリカ	コミュニケーション・サービス	4.4%
3	MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	3.9%
4	NVIDIA CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	3.5%
5	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ・ドル	アメリカ	金融	2.4%
組入銘柄数			101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。

● 損保ジャパンＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

組入上位5銘柄		
銘柄名	業 種	純資産比
1 日本ビルファンド投資法人	オフィスREIT	9.0%
2 ジャパンリアルエステイト投資法人	オフィスREIT	8.7%
3 野村不動産マスターファンド投資法人	各種REIT	7.3%
4 日本プロロジスリート投資法人	工業用REIT	6.9%
5 K D X不動産投資法人	各種REIT	6.8%
組入銘柄数		25銘柄

● S J A M 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 本田技研工業	輸送用機器	4.8%
2 N T T	情報・通信業	4.4%
3 トヨタ自動車	輸送用機器	4.3%
4 三井住友トラストグループ	銀行業	4.2%
5 西日本旅客鉄道	陸運業	3.6%
組入銘柄数		43銘柄

● S J A M 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 カカクコム	サービス業	3.9%
2 ジェイテクト	機械	3.9%
3 レンゴー	パルプ・紙	3.4%
4 セリア	小売業	3.0%
5 日本M & A センターホールディングス	サービス業	3.0%
組入銘柄数		87銘柄

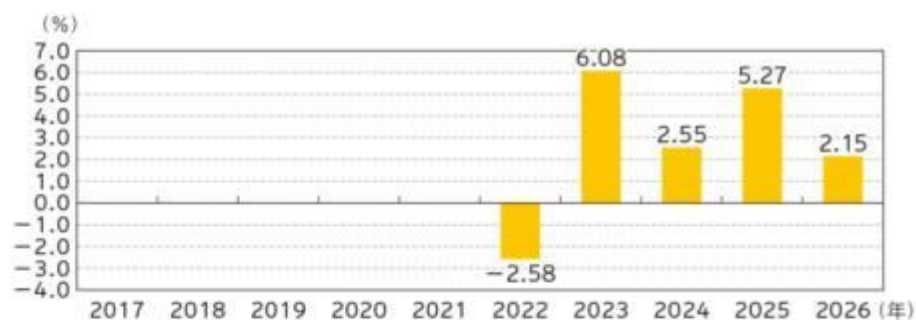
● 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

組入上位5銘柄						
	銘 柄 名	発行国	種 類	通 貨	償還日	純資産比
1	Treasury 2.75 280215	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2028/02/15	29.3%
2	Treasury 4.5 290531	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2029/05/31	5.9%
3	Treasury 3.375 330515	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2033/05/15	2.2%
4	CGB 1.83 350825	中国	国債証券	オフショア・人民元	2035/08/25	1.8%
5	ITALY 3.25 320715	イタリア	国債証券	ユーロ	2032/07/15	1.8%
組入銘柄数					160銘柄	

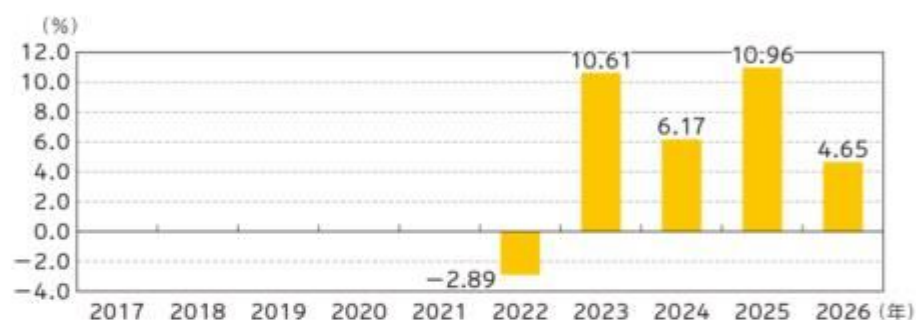
- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

年間収益率の推移（暦年ベース）

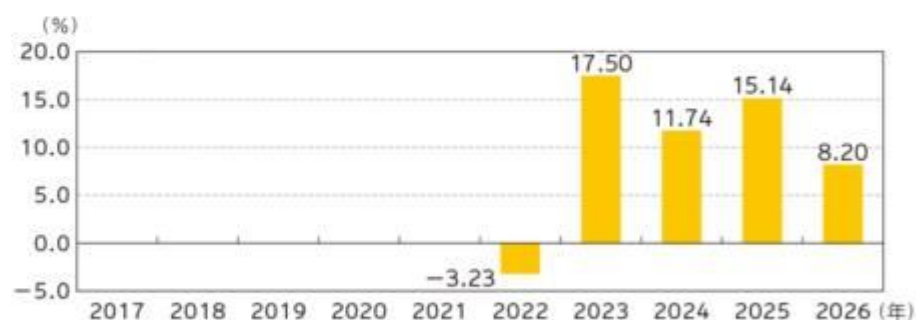
● 安定型



● 安定成長型



● 成長型



- 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。
- 2022年は設定日（12月15日）から年末、2026年は年初から基準日までの収益率です。
- 各ファンドはベンチマークを設定していません。

- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値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、下記

の取得申込不可日にあたる日は取得のお申込みの受付はできません。

< 取得申込不可日 >

- ・ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、パリ証券取引所の休業日
- ・ニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日

お申込みの受付は、原則として午後3時30分までに販売会社所定の事務手続きが完了したものとし、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、取得申込金額が多額であると判断した場合、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低下した場合、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。

（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資産運用業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。

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

S O M P O 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） お申込手数料はありません。

（5） お申込単位は、販売会社が定める単位とします。ファンドは確定拠出年金制度による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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およ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、下記の日においては一部解約の実行の請求を受け付けられないものとします。

< 解約申込不可日 >

- ・ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、パリ証券取引所の休業日
- ・ニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日

一部解約の受付は、原則として午後3時30分までに販売会社所定の事務手続きが完了したものとし、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。

一部解約の請求金額が多額であると判断した場合、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低下した場合、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により、有価証券の売却や売却代金の入金が遅延したとき等は、一部解約金の支払いを延期する場合があります。

- (4) 委託会社は、一部解約の請求金額が多額であると判断した場合、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低下した場合、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、当該受益権の一部解約の価額は、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資産運用業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、一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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およ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低下した場合、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52条第１項、第54条第１項、第55条第１項および第57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】

ファンドの計算期間は、原則として毎年12月16日から翌年12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、各ファンドの受益権の口数が10億口を下回っているとき、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、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- () 前記()の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下()において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- () 前記()の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- () 前記()から()までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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()から()までの手続を行うことが困難な場合にも適用しません。

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53条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53条第2項の書面決議で否決された場合を除き、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。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。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53条の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- () 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。

信託約款の変更等

- () 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またはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併

合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合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。なお、この信託約款は本()から()までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- () 委託会社は、前記()の事項(前記()の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前記()の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- () 前記()の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下()において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- () 前記()の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- () 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- () 前記()から()までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- () 前記()から()までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

運用状況に係る情報の提供

- () 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項に定める事項に係る情報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、受益者から前記()に定める情報の提供について、書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行うものとします。

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。

信託事務処理の再信託

受託会社は、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】

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および損失は、すべて受益者に帰属します。

（１）収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持ち分に応じて請求する権利を有します。

委託会社は原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金を販売会社に支払います。この場合、販売会社は受益者に対して遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。分配金は自動的に再投資されますが、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。

（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て）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います。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。ただし、下記の日においては一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

< 解約申込不可日 >

- ・ ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、パリ証券取引所の休業日
- ・ ニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日

受付は、原則として午後３時30分までに販売会社所定の事務手続きが完了したものとし、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）反対受益者の受益権買取請求の不適用

受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な信託約款の変更等を行う場合において、反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

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）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）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、2024年12月17日から2025年12月15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】

【SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2024年12月16日現在	第3期 2025年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	48,607	120
コール・ローン	139,470	261,777
投資信託受益証券	720,822	705,971
親投資信託受益証券	11,098,950	15,671,974
未収利息	-	2
流動資産合計	12,007,849	16,639,844
資産合計	12,007,849	16,639,844
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	1,897	2,547
未払委託者報酬	50,436	67,651
その他未払費用	493	680
流動負債合計	52,826	70,878
負債合計	52,826	70,878
純資産の部		
元本等		
元本	11,274,781	14,919,939
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	680,242	1,649,027
元本等合計	11,955,023	16,568,966
純資産合計	11,955,023	16,568,966
負債純資産合計	12,007,849	16,639,844

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
営業収益		
受取配当金	14,542	21,888
受取利息	5	385
有価証券売買等損益	390,293	862,368
為替差損益	46,268	3,773
営業収益合計	451,108	888,414
営業費用		
支払利息	1	-
受託者報酬	3,714	4,586
委託者報酬	98,584	122,246
その他費用	4,219	5,800
営業費用合計	106,518	132,632
営業利益又は営業損失（ ）	344,590	755,782
経常利益又は経常損失（ ）	344,590	755,782
当期純利益又は当期純損失（ ）	344,590	755,782
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（ ）	-	3,406
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	275,349	680,242
剰余金増加額又は欠損金減少額	60,303	230,577
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	60,303	230,577
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	20,980
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	20,980
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	680,242	1,649,027

（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、以下の通り原則として時価で評価しております。 市場価格のある有価証券については、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。 市場価格のない有価証券については、計算期間末日または知りうる直近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12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、前計算期間末日を2024年12月16日としております。

（貸借対照表に関する注記）

期別	第2期 2024年12月16日現在	第3期 2025年12月15日現在
1．受益権の総数	11,274,781口	14,919,939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 1.0603円 (1万口当たり純資産額) (10,603円)	1口当たり純資産額 1.1105円 (1万口当たり純資産額) (11,105円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期 自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
1．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（197,568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（147,022円）、信託約款に規定される収益調整金（62,610円）及び分配準備積立金（273,042円）より分配対象収益は680,242円（1万口当たり603.30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（303,546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（455,642円）、信託約款に規定される収益調整金（288,557円）及び分配準備積立金（601,282円）より分配対象収益は1,649,027円（1万口当たり1,105.23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2期 自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15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

項目	第2期 自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	（１）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、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。 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。 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。 （２）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	第2期 2024年12月16日現在	第3期 2025年12月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 （２）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 2024年12月16日現在	第3期 2025年12月15日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	第2期 自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
期首元本額	10,173,838円	11,274,781円
期中追加設定元本額	1,100,943円	4,011,594円
期中一部解約元本額	- 円	366,436円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第2期 2024年12月16日現在	第3期 2025年12月15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）
投資信託受益証券	32,816	80,149
親投資信託受益証券	284,980	745,597
合計	317,796	825,746

（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

2025年12月15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	47	3,143.83	
		ISHARES GLOBAL REIT ETF	55	1,381.05	
	ドル 小計		102	4,524.88 (705,971)	
投資信託受益証券 合計			102	705,971 (705,971)	
親投資信託 受益証券	日本円	損保ジャパン日本債券マザーファ ンド	2,917,744	3,760,096	
		損保ジャパン外国債券マザーファ ンド	4,290,080	5,959,779	
		損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	218,490	489,483	
		S J A Mラージキャップ・バ リュウ・マザーファンド	98,237	509,417	
		S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド	75,116	511,427	
		損保ジャパン J - R E I T マザー ファンド	393,055	1,433,117	
		S O M P O 外国株式アクティブバ リュウ（リスク抑制型）マザー ファンド	837,949	3,008,655	

親投資信託受益証券 合計	8,830,671	15,671,974	
合計		16,377,945 (705,971)	

（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 2銘柄	4.26%	4.31%

（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。

【SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2024年12月16日現在	第3期 2025年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	23,593	8
コール・ローン	196,861	438,669
投資信託受益証券	1,089,345	1,615,563
親投資信託受益証券	13,185,435	25,884,508
未収利息	-	4
流動資産合計	14,495,234	27,938,752
資産合計	14,495,234	27,938,752
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	1,995	4,078
未払委託者報酬	53,196	108,805
その他未払費用	516	1,112
流動負債合計	55,707	113,995
負債合計	55,707	113,995
純資産の部		
元本等		
元本	12,682,863	22,163,018
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,756,664	5,661,739
元本等合計	14,439,527	27,824,757
純資産合計	14,439,527	27,824,757
負債純資産合計	14,495,234	27,938,752

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
営業収益		
受取配当金	16,531	39,337
受取利息	11	695
有価証券売買等損益	599,502	2,585,280
為替差損益	44,638	25,348
営業収益合計	660,682	2,650,660
営業費用		
受託者報酬	3,368	6,987
委託者報酬	89,902	186,342
その他費用	22,547	12,526
営業費用合計	115,817	205,855
営業利益又は営業損失（ ）	544,865	2,444,805
経常利益又は経常損失（ ）	544,865	2,444,805
当期純利益又は当期純損失（ ）	544,865	2,444,805
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（ ）	3,046	41,514
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	361,723	1,756,664
剰余金増加額又は欠損金減少額	859,274	1,681,595
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	859,274	1,681,595
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,152	179,811
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,152	179,811
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,756,664	5,661,739

（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、以下の通り原則として時価で評価しております。 市場価格のある有価証券については、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。 市場価格のない有価証券については、計算期間末日または知りうる直近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12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、前計算期間末日を2024年12月16日としております。

（貸借対照表に関する注記）

期別	第2期 2024年12月16日現在	第3期 2025年12月15日現在
1．受益権の総数	12,682,863口	22,163,018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 1.1385円 (1万口当たり純資産額) (11,385円)	1口当たり純資産額 1.2555円 (1万口当たり純資産額) (12,555円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期 自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
1．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（220,136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（321,683円）、信託約款に規定される収益調整金（872,996円）及び分配準備積立金（341,849円）より分配対象収益は1,756,664円（1万口当たり1,385.04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（559,698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（1,843,593円）、信託約款に規定される収益調整金（2,445,437円）及び分配準備積立金（813,011円）より分配対象収益は5,661,739円（1万口当たり2,554.55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2期 自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15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

項目	第2期 自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	（１）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、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。 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。 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。 （２）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	第2期 2024年12月16日現在	第3期 2025年12月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 （２）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 2024年12月16日現在	第3期 2025年12月15日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	第2期 自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
期首元本額	5,335,472円	12,682,863円
期中追加設定元本額	7,415,991円	10,758,907円
期中一部解約元本額	68,600円	1,278,752円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第2期 2024年12月16日現在	第3期 2025年12月15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）
投資信託受益証券	43,618	169,761
親投資信託受益証券	534,086	2,347,154
合計	577,704	2,516,915

（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

2025年12月15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	103	6,889.67	
		ISHARES GLOBAL REIT ETF	138	3,465.18	
	ドル 小計		241	10,354.85 (1,615,563)	
投資信託受益証券 合計			241	1,615,563 (1,615,563)	
親投資信託 受益証券	日本円	損保ジャパン日本債券マザーファ ンド	1,091,111	1,406,114	
		損保ジャパン外国債券マザーファ ンド	5,887,724	8,179,226	
		損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	468,487	1,049,551	
		S J A Mラージキャップ・バ リュウ・マザーファンド	234,300	1,214,986	
		S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド	178,311	1,214,030	
		損保ジャパン J - R E I T マザー ファンド	1,245,558	4,541,429	
		S O M P O 外国株式アクティブバ リュウ（リスク抑制型）マザー ファンド	2,305,855	8,279,172	

親投資信託受益証券 合計	11,411,346	25,884,508	
合計		27,500,071 (1,615,563)	

（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 2銘柄	5.81%	5.87%

（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。

【SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2024年12月16日現在	第3期 2025年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	24,509	60,908
コール・ローン	176,134	397,739
投資信託受益証券	2,058,479	2,881,793
親投資信託受益証券	14,948,791	24,818,921
未収利息	-	3
流動資産合計	17,207,913	28,159,364
資産合計	17,207,913	28,159,364
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	2,212	4,006
未払委託者報酬	58,865	106,762
その他未払費用	585	1,102
流動負債合計	61,662	111,870
負債合計	61,662	111,870
純資産の部		
元本等		
元本	13,584,949	19,356,164
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,561,302	8,691,330
元本等合計	17,146,251	28,047,494
純資産合計	17,146,251	28,047,494
負債純資産合計	17,207,913	28,159,364

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
営業収益		
受取配当金	27,111	72,067
受取利息	18	607
有価証券売買等損益	1,070,419	3,544,556
為替差損益	97,428	21,433
営業収益合計	1,194,976	3,638,663
営業費用		
受託者報酬	3,752	7,087
委託者報酬	99,786	188,796
その他費用	34,045	15,051
営業費用合計	137,583	210,934
営業利益又は営業損失（ ）	1,057,393	3,427,729
経常利益又は経常損失（ ）	1,057,393	3,427,729
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,057,393	3,427,729
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（ ）	65,096	6,043
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	745,736	3,561,302
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,993,379	1,968,538
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,993,379	1,968,538
剰余金減少額又は欠損金増加額	170,110	272,282
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	170,110	272,282
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,561,302	8,691,330

（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、以下の通り原則として時価で評価しております。 市場価格のある有価証券については、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。 市場価格のない有価証券については、計算期間末日または知りうる直近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12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、前計算期間末日を2024年12月16日としております。

（貸借対照表に関する注記）

期別	第2期 2024年12月16日現在	第3期 2025年12月15日現在
1．受益権の総数	13,584,949口	19,356,164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 1.2622円 (1万口当たり純資産額) (12,622円)	1口当たり純資産額 1.4490円 (1万口当たり純資産額) (14,490円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期 自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
1．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（253,774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（738,523円）、信託約款に規定される収益調整金（1,990,366円）及び分配準備積立金（578,639円）より分配対象収益は3,561,302円（1万口当たり2,621.47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（574,840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（2,858,932円）、信託約款に規定される収益調整金（3,785,485円）及び分配準備積立金（1,472,073円）より分配対象収益は8,691,330円（1万口当たり4,490.18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2期 自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15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

項目	第2期 自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	（１）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、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。 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。 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。 （２）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	第2期 2024年12月16日現在	第3期 2025年12月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 （２）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 2024年12月16日現在	第3期 2025年12月15日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	第2期 自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
期首元本額	5,764,785円	13,584,949円
期中追加設定元本額	8,928,502円	6,819,639円
期中一部解約元本額	1,108,338円	1,048,424円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第2期 2024年12月16日現在	第3期 2025年12月15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）
投資信託受益証券	67,040	269,504
親投資信託受益証券	868,742	3,100,147
合計	935,782	3,369,651

（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

2025年12月15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	147	9,832.83	
		ISHARES GLOBAL REIT ETF	344	8,637.84	
	ドル 小計		491	18,470.67 (2,881,793)	
投資信託受益証券 合計			491	2,881,793 (2,881,793)	
親投資信託 受益証券	日本円	損保ジャパン日本債券マザーファ ンド	856,406	1,103,650	
		損保ジャパン外国債券マザーファ ンド	1,330,669	1,848,565	
		損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	1,003,778	2,248,763	
		S J A Mラージキャップ・バ リュウ・マザーファンド	380,107	1,971,082	
		S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド	289,116	1,968,446	
		損保ジャパン J - R E I Tマザー ファンド	1,307,878	4,768,653	
		S O M P O外国株式アクティブバ リュウ（リスク抑制型）マザー ファンド	3,038,508	10,909,762	

親投資信託受益証券 合計	8,206,462	24,818,921	
合計		27,700,714	
		(2,881,793)	

（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 2銘柄	10.27%	10.40%

（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。

（参考）

S O M P O世界分散ファンド（安定型）／（安定成長型）／（成長型）＜ＤＣ年金＞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。

S J A Mラージキャップ・バリュー・マザーファンド

貸借対照表

	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	403,125,316	1,194,247,668
株式	66,397,217,290	113,146,466,540
未収配当金	-	13,628,700
未収利息	1,214	11,451
流動資産合計	66,800,343,820	114,354,354,359
資産合計	66,800,343,820	114,354,354,359
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	17,447,030,740	22,052,109,822
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	49,353,313,080	92,302,244,537
元本等合計	66,800,343,820	114,354,354,359
純資産合計	66,800,343,820	114,354,354,359
負債純資産合計	66,800,343,820	114,354,354,359

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	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す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。 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	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
1. 受益権の総数	17,447,030,740口	22,052,109,822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) 3.8288円 (38,288円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 5.1856円 (51,856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 2023年12月16日 至 2024年12月16日	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は(有価証券に関する注記)に記載しております。 (2) 金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

項目	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
2．時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	11,079,181,459円	17,447,030,740円
同期中追加設定元本額	8,994,711,965円	7,483,266,272円
同期中一部解約元本額	2,626,862,684円	2,878,187,190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）	11,802,042,221円	16,834,681,393円
一任専用・国内株式ラージキャップ・バリュー運用ファンド（適格機関投資家専用）	- 円	68,662,817円
ハッピーエイジング20	2,019,077,571円	1,896,028,981円
ハッピーエイジング30	1,631,332,575円	1,492,327,780円
ハッピーエイジング40	1,236,396,213円	1,082,579,360円
ハッピーエイジング50	308,428,152円	260,788,420円
ハッピーエイジング60	60,802,494円	47,787,893円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド2035	166,816,402円	143,202,761円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド2045	114,242,140円	113,970,980円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド2055	84,420,799円	82,801,043円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド2065	23,123,395円	28,565,750円
S O M P O 世界分散ファンド（安定型）＜D C 年金＞	66,783円	98,237円
S O M P O 世界分散ファンド（安定成長型）＜D C 年金＞	132,611円	234,300円
S O M P O 世界分散ファンド（成長型）＜D C 年金＞	149,384円	380,107円
計	17,447,030,740円	22,052,109,822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	2024年12月16日現在	2025年12月15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	1,137,906,126	21,463,417,978
合計	1,137,906,126	21,463,417,978

（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

2025年12月15日現在

銘 柄	株 式 数	評 価 額		備 考
		単 価	金 額	
日揮ホールディングス	752,600	1,888.50	1,421,285,100	
明治ホールディングス	752,300	3,346.00	2,517,195,800	
アサヒグループホールディングス	2,152,000	1,740.00	3,744,480,000	
キリンホールディングス	1,157,300	2,374.50	2,748,008,850	
東レ	1,602,100	1,048.50	1,679,801,850	
王子ホールディングス	2,472,000	832.00	2,056,704,000	
旭化成	3,537,200	1,405.00	4,969,766,000	
三井化学	838,300	3,927.00	3,292,004,100	
サワイグループホールディングス	806,100	2,287.50	1,843,953,750	
A G C	446,100	5,284.00	2,357,192,400	
J F E ホールディングス	1,446,300	1,990.50	2,878,860,150	
住友金属鉱山	688,800	5,706.00	3,930,292,800	
S U M C O	2,479,500	1,313.50	3,256,823,250	
ナブテスコ	285,400	3,906.00	1,114,772,400	
住友重機械工業	534,400	4,319.00	2,308,073,600	
クボタ	1,173,900	2,256.00	2,648,318,400	
日本精工	3,118,700	955.10	2,978,670,370	
マキタ	206,500	4,894.00	1,010,611,000	
オムロン	606,000	4,020.00	2,436,120,000	
パナソニック ホールディングス	1,040,100	2,154.00	2,240,375,400	
スタンレー電気	617,300	3,091.00	1,908,074,300	
ローム	387,600	2,077.50	805,239,000	
浜松ホトニクス	723,400	1,713.50	1,239,545,900	
京セラ	1,727,300	2,248.00	3,882,970,400	
太陽誘電	1,269,300	3,519.00	4,466,666,700	
村田製作所	467,000	3,271.00	1,527,557,000	
デンソー	1,495,600	2,135.00	3,193,106,000	
トヨタ自動車	1,361,300	3,350.00	4,560,355,000	
本田技研工業	2,791,700	1,609.50	4,493,241,150	
京成電鉄	2,045,200	1,246.00	2,548,319,200	
東日本旅客鉄道	288,900	4,200.00	1,213,380,000	
ヤマトホールディングス	1,191,600	2,206.50	2,629,265,400	
N I P P O N E X P R E S Sホールディン	953,500	3,349.00	3,193,271,500	
N T T	30,049,800	155.40	4,669,738,920	
ニトリホールディングス	392,200	2,884.00	1,131,104,800	
めぶきフィナンシャルグループ	1,433,500	1,073.00	1,538,145,500	
ゆうちょ銀行	1,137,100	2,091.50	2,378,244,650	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,359,000	2,558.00	3,476,322,000	

三井住友トラストグループ	962,100	4,731.00	4,551,695,100	
三井住友フィナンシャルグループ	510,200	5,090.00	2,596,918,000	
八十二銀行	1,874,000	1,723.00	3,228,902,000	
三菱地所	629,400	3,942.00	2,481,094,800	
合計	79,762,600		113,146,466,540	

（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。

S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

貸借対照表

	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	250,553,322	57,298,395
株式	21,691,675,060	26,901,178,440
未収配当金	23,849,100	35,153,150
未収利息	755	549
流動資産合計	21,966,078,237	26,993,630,534
資産合計	21,966,078,237	26,993,630,534
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	4,368,469,670	3,964,683,597
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	17,597,608,567	23,028,946,937
元本等合計	21,966,078,237	26,993,630,534
純資産合計	21,966,078,237	26,993,630,534
負債純資産合計	21,966,078,237	26,993,630,534

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。
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	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
1. 受益権の総数	4,368,469,670口	3,964,683,597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 5.0283円 (1万口当たり純資産額) (50,283円)	1口当たり純資産額 6.8085円 (1万口当たり純資産額) (68,085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 2023年12月16日 至 2024年12月16日	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は(有価証券に関する注記)に記載しております。 (2) 金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

項目	自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,139,316,922円	4,368,469,670円
同期中追加設定元本額	466,987,197円	285,357,242円
同期中一部解約元本額	237,834,449円	689,143,315円
元本の内訳＊		
ハッピーエイジング２０	1,562,400,349円	1,452,041,717円
ハッピーエイジング３０	1,262,430,015円	1,141,630,906円
ハッピーエイジング４０	956,920,273円	844,450,264円
ハッピーエイジング５０	238,683,071円	204,220,606円
ハッピーエイジング６０	47,050,912円	37,682,692円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド２０３５	129,111,113円	110,652,805円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド２０４５	88,413,985円	87,551,675円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド２０５５	65,335,031円	63,962,788円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド２０６５	17,854,459円	21,947,601円
S O M P O世界分散ファンド（安定型）＜ＤＣ年金＞	50,744円	75,116円
S O M P O世界分散ファンド（安定成長型）＜ＤＣ年金＞	104,116円	178,311円
S O M P O世界分散ファンド（成長型）＜ＤＣ年金＞	115,602円	289,116円
計	4,368,469,670円	3,964,683,597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	2024年12月16日現在	2025年12月15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	689,940,173	1,965,113,399
合計	689,940,173	1,965,113,399

（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

2025年12月15日現在

銘 柄	株 式 数	評価額		備考
		単 価	金 額	
日揮ホールディングス	332,500	1,888.50	627,926,250	
ニッポン	185,700	2,356.00	437,509,200	
森永製菓	46,300	2,620.50	121,329,150	
森永乳業	23,100	3,657.00	84,476,700	
S F o o d s	73,200	2,642.00	193,394,400	
レンゴー	762,100	1,182.50	901,183,250	
ザ・バック	205,400	1,271.00	261,063,400	
東洋紡	203,100	1,223.00	248,391,300	

住友精化	18,500	5,350.00	98,975,000	
東亜合成	290,000	1,628.00	472,120,000	
デンカ	94,000	2,746.00	258,124,000	
カネカ	27,800	4,347.00	120,846,600	
K Hネオケム	106,600	2,529.00	269,591,400	
日本ゼオン	119,900	1,780.00	213,422,000	
ダイキョーニシカワ	129,200	773.00	99,871,600	
日本化薬	386,100	1,683.50	649,999,350	
三洋化成工業	46,300	4,950.00	229,185,000	
a r t i e n c e	55,600	3,480.00	193,488,000	
タカラバイオ	296,600	787.00	233,424,200	
ツムラ	60,900	3,848.00	234,343,200	
杏林製薬	74,100	1,508.00	111,742,800	
サワイグループホールディングス	290,700	2,287.50	664,976,250	
ニチハ	35,200	3,180.00	111,936,000	
共英製鋼	40,700	2,422.00	98,575,400	
東ブレ	154,100	2,362.00	363,984,200	
オーエスジー	248,300	2,349.00	583,256,700	
ナブテスコ	21,300	3,906.00	83,197,800	
住友重機械工業	229,800	4,319.00	992,506,200	
日本精工	78,400	955.10	74,879,840	
ジェイテクト	634,900	1,760.50	1,117,741,450	
不二越	70,100	4,315.00	302,481,500	
スター精密	27,800	2,207.00	61,354,600	
マブチモーター	281,600	2,870.50	808,332,800	
E I Z O	231,700	2,222.00	514,837,400	
コーセル	211,300	1,183.00	249,967,900	
イリソ電子工業	83,300	3,250.00	270,725,000	
スタンレー電気	37,000	3,091.00	114,367,000	
太陽誘電	215,000	3,519.00	756,585,000	
ニチコン	268,800	1,654.00	444,595,200	
市光工業	545,000	506.00	275,770,000	
小糸製作所	26,800	2,303.00	61,720,400	
トヨタ紡織	397,100	2,498.50	992,154,350	
豊田合成	87,600	3,871.00	339,099,600	
テイ・エス テック	51,000	1,800.00	91,800,000	
メニコン	201,200	1,597.00	321,316,400	
リンテック	27,800	4,275.00	118,845,000	
中国電力	71,300	993.70	70,850,810	
沖縄電力	62,700	1,069.00	67,026,300	
福山通運	74,100	4,330.00	320,853,000	
アルフレッサ ホールディングス	106,100	2,450.00	259,945,000	

第一興商	156,600	1,664.50	260,660,700	
日本ライフライン	235,300	1,561.00	367,303,300	
シークス	195,700	1,312.00	256,758,400	
P A L T A C	74,100	4,858.00	359,977,800	
トラスコ中山	210,500	2,377.00	500,358,500	
スズケン	17,400	6,249.00	108,732,600	
セリア	240,000	3,615.00	867,600,000	
ドトール・日レスホールディングス	31,500	2,571.00	80,986,500	
ユナイテッドアローズ	122,700	2,387.00	292,884,900	
コメリ	93,100	3,500.00	325,850,000	
青山商事	67,300	2,480.00	166,904,000	
イズミ	172,400	3,035.00	523,234,000	
ゼビオホールディングス	213,100	1,038.00	221,197,800	
ケースホールディングス	429,500	1,583.00	679,898,500	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	34,900	2,422.00	84,527,800	
九州フィナンシャルグループ	507,800	1,030.00	523,034,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	138,500	3,100.00	429,350,000	
第四北越フィナンシャルグループ	373,900	1,681.00	628,525,900	
ひろぎんホールディングス	46,000	1,602.00	73,692,000	
山陰合同銀行	369,500	1,475.00	545,012,500	
北洋銀行	212,300	846.00	179,605,800	
日本M & A センターホールディングス	1,054,800	729.80	769,793,040	
エス・エム・エス	192,800	1,370.00	264,136,000	
H . U . グループホールディングス	46,000	3,294.00	151,524,000	
ビー・エム・エル	73,800	3,860.00	284,868,000	
エン	359,600	1,463.00	526,094,800	
ベルシステム24ホールディングス	187,400	1,414.00	264,983,600	
ソラスト	492,700	863.00	425,200,100	
カナモト	37,800	3,820.00	144,396,000	
合計	14,734,700		26,901,178,440	

（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。

S O M P O外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）マザーファンド

貸借対照表

	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		

	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
流動資産		
預金	3,746,228	10,574,792
コール・ローン	14,331,578	75,228,175
株式	1,830,162,791	2,250,687,547
投資証券	15,220,339	19,261,944
未収配当金	1,750,177	2,544,083
未収利息	43	721
流動資産合計	1,865,211,156	2,358,297,262
資産合計	1,865,211,156	2,358,297,262
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	594,081,240	656,812,022
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,271,129,916	1,701,485,240
元本等合計	1,865,211,156	2,358,297,262
純資産合計	1,865,211,156	2,358,297,262
負債純資産合計	1,865,211,156	2,358,297,262

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

期別	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
1．受益権の総数	594,081,240口	656,812,022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) 3.1397円 (31,397円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.5905円 (35,905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 2023年12月16日 至 2024年12月16日	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	（１）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、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。 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。 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。 （２）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 （２）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）		
項目	自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	570,926,575円	594,081,240円
同期中追加設定元本額	131,648,090円	182,138,289円
同期中一部解約元本額	108,493,425円	119,407,507円
元本の内訳＊		
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2035	162,270,369円	151,265,910円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2045	168,195,665円	182,720,066円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2055	200,319,984円	232,483,440円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2065	59,094,364円	84,160,294円
S O M P O世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞	685,803円	837,949円
S O M P O世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞	1,347,356円	2,305,855円
S O M P O世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞	2,167,699円	3,038,508円
計	594,081,240円	656,812,022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	2024年12月16日現在	2025年12月15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	48,562,902	87,944,524
投資証券	4,645	2,258
合計	48,567,547	87,946,782

（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

2025年12月15日現在					
通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ドル	CONOCOPHILLIPS	1,150	95.54	109,871.00	
	AMCOR PLC	9,510	8.23	78,267.30	
	AVERY DENNISON CORPORATION	430	182.60	78,518.00	
	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	1,030	44.39	45,721.70	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	300	328.69	98,607.00	
	LOCKHEED MARTIN CORPORAT	50	480.25	24,012.50	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	700	405.18	283,626.00	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	1,890	75.68	143,035.20	

FEDEX CORP	120	284.34	34,120.80
UNION PACIFIC CORP	1,110	239.95	266,344.50
UNITED PARCEL SERVICE-CLB	1,830	100.92	184,683.60
NIKE INC -CL B	3,170	67.47	213,879.90
ALPHABET INC-CL A	2,410	309.29	745,388.90
META PLATFORMS INC-CLASS A	280	644.23	180,384.40
AMAZON.COM INC	800	226.19	180,952.00
HOME DEPOT INC	747	359.65	268,658.55
LOWE'S COMPANIES INC	170	247.29	42,039.30
ROSS STORES INC	580	182.09	105,612.20
TJX COMPANIES INC	600	156.14	93,684.00
ULTA BEAUTY INC	510	601.59	306,810.90
SYSCO CORP	2,150	74.34	159,831.00
TARGET CORP	150	97.09	14,563.50
WAL-MART STORES INC	1,980	116.70	231,066.00
COCA-COLA COMPANY	3,310	70.52	233,421.20
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,350	78.34	184,099.00
ESTEE LAUDER COMPANIES INC	470	104.10	48,927.00
CVS HEALTH CORPORATION	2,580	79.42	204,903.60
MEDTRONIC INC	2,900	99.87	289,623.00
BIOGEN INC	190	174.10	33,079.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	760	52.41	39,831.60
JOHNSON & JOHNSON	1,863	211.58	394,173.54
MERCK & CO. INC.	1,160	100.30	116,348.00
BANK OF AMERICA CORP	970	55.14	53,485.80
CITIGROUP INC	400	111.80	44,720.00
JP MORGAN CHASE & CO	640	318.52	203,852.80
TRUIST FINANCIAL CORP	3,140	49.89	156,654.60
S&P GLOBAL INC	430	501.03	215,442.90
VISA INC-CLASS A SHARES	1,096	347.83	381,221.68
ALLSTATE CORP	880	207.18	182,318.40
AON CORP	170	353.79	60,144.30
MARSH&MCLENNAN COS	470	186.21	87,518.70
ACCENTURE PLC-CL A	680	271.56	184,660.80
ADOBE SYSTEMS INC	800	356.43	285,144.00
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	430	85.88	36,928.40
MICROSOFT CORP	1,550	478.53	741,721.50
SALESFORCE INC	1,080	262.23	283,208.40
APPLE INC	2,600	278.28	723,528.00
CISCO SYSTEMS INC	1,710	77.80	133,038.00
VERIZON COMMUNICATIONS	4,120	40.89	168,466.80
DOMINION RESOURCE INC/VA	300	59.33	17,799.00

	EXELON CORP	550	43.57	23,963.50	
	NEXTERA ENERGY INC	1,450	81.65	118,392.50	
	APPLIED MATERIALS INC	430	259.21	111,460.30	
	BROADCOM INC	210	359.93	75,585.30	
	INTEL CORP	5,290	37.81	200,014.90	
	KLA CORP	110	1,193.92	131,331.20	
	NVIDIA CORP	2,990	175.02	523,309.80	
	QUALCOMM INCORPORATED	1,120	178.29	199,684.80	
	TEXAS INSTRUMENTS INCORPORATED	420	179.42	75,356.40	
ドル 小計		81,286		10,853,036.97 (1,693,290,828)	
カナダドル	TC ENERGY CORP	400	75.27	30,108.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	1,600	49.87	79,792.00	
カナダドル 小計		2,000		109,900.00 (12,450,571)	
ユーロ	NESTE OIL OYJ	7,553	18.31	138,333.19	
	TOTAL SA	2,759	55.59	153,372.81	
	AIR LIQUIDE SA	149	158.60	23,631.40	
	BASF AG	2,974	44.84	133,354.16	
	VINCI S.A.	1,145	119.30	136,598.50	
	DHL GROUP REG	696	46.98	32,698.08	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	184	624.50	114,908.00	
	INDITEX	1,410	55.76	78,621.60	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	646	54.14	34,974.44	
	HEINEKEN NV	281	69.64	19,568.84	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	3,619	22.74	82,296.06	
	SANOFI	2,170	83.32	180,804.40	
	ALLIANZ AG-REG	302	380.40	114,880.80	
	MUENCHENER RUECKVER AG-RE	190	558.00	106,020.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	3,746	36.29	135,942.34	
ユーロ 小計		27,824		1,486,004.62 (271,998,285)	
ポンド	RIO TINTO PLC	2,331	55.89	130,279.59	
	PERSIMMON PLC	4,408	13.05	57,524.40	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	2,549	42.38	108,026.62	
	DIAGEO PLC	964	16.64	16,040.96	
	GSK PLC	5,849	18.24	106,715.00	
	VODAFONE GROUP PLC	24,270	0.94	22,964.27	
ポンド 小計		40,371		441,550.84 (92,067,765)	
スイスフラン	GEBERIT AG-REG	93	615.60	57,250.80	
	NESTLE SA-REGISTERED-B	743	77.95	57,916.85	

	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	423	316.80	134,006.40	
	SWISS RE LTD	150	130.05	19,507.50	
スイスフラン 小計		1,409		268,681.55 (52,629,342)	
スウェーデンクローナ	ASSA ABLOY AB-B	2,704	357.60	966,950.40	
スウェーデンクローナ 小計		2,704		966,950.40 (16,273,775)	
ノルウェークローネ	TELENOR ASA	5,178	144.10	746,149.80	
ノルウェークローネ 小計		5,178		746,149.80 (11,505,629)	
デンマーククローネ	NOVO NORDISK A/S-B	3,449	321.15	1,107,646.35	
デンマーククローネ 小計		3,449		1,107,646.35 (27,148,412)	
オーストラリアドル	BHP BILLITON LTD	4,540	45.59	206,978.60	
	WOOLWORTHS LTD	3,590	29.56	106,120.40	
	CSL LIMITED	196	183.93	36,050.28	
	WESTPAC BANKING CORP	1,612	38.80	62,545.60	
オーストラリアドル 小計		9,938		411,694.88 (42,696,876)	
シンガポールドル	OVERSEA-CHINESE BANKING	6,700	19.20	128,640.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	3,600	34.72	124,992.00	
シンガポールドル 小計		10,300		253,632.00 (30,626,064)	
合計		184,459		2,250,687,547 (2,250,687,547)	

(2) 株式以外の有価証券

2025年12月15日現在

2020年12月15日現在

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	ドル	CROWN CASTLE INC	640	58,214.40	
		PUBLIC STORAGE	80	21,997.60	
	ドル 合計		720	80,212.00 (12,514,676)	
	シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	20,100	55,878.00	
	シンガポールドル 合計		20,100	55,878.00 (6,747,268)	
合計			20,820	19,261,944 (19,261,944)	

(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 59銘柄	71.80%	—	75.15%
	投資証券 2銘柄	—	0.53%	
カナダドル	株式 2銘柄	0.53%	—	0.55%
ユーロ	株式 15銘柄	11.53%	—	11.98%
ポンド	株式 6銘柄	3.90%	—	4.06%
スイスフラン	株式 4銘柄	2.23%	—	2.32%
スウェーデンクローナ	株式 1銘柄	0.69%	—	0.72%
ノルウェークローネ	株式 1銘柄	0.49%	—	0.51%
デンマーククローネ	株式 1銘柄	1.15%	—	1.20%
オーストラリアドル	株式 4銘柄	1.81%	—	1.88%
シンガポールドル	株式 2銘柄	1.30%	—	1.65%
	投資証券 1銘柄	—	0.29%	

（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。

損保ジャパン日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	326,339
コール・ローン	363,089,456	514,560,023
国債証券	23,138,826,300	27,087,213,400
地方債証券	676,673,000	-
特殊債券	432,273,262	41,116,824
社債券	8,401,763,000	7,730,858,000
未収入金	-	1,453,326,500
未収利息	73,138,786	104,746,671
前払費用	20,159,272	34,970,127
流動資産合計	33,105,923,076	36,967,117,884
資産合計	33,105,923,076	36,967,117,884
負債の部		
流動負債		
未払金	-	1,614,087,500
流動負債合計	-	1,614,087,500
負債合計	-	1,614,087,500
純資産の部		
元本等		
元本	24,466,336,326	27,432,802,580
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,639,586,750	7,920,227,804
元本等合計	33,105,923,076	35,353,030,384
純資産合計	33,105,923,076	35,353,030,384

	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
負債純資産合計	33,105,923,076	36,967,117,884

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

期別	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
1．受益権の総数	24,466,336,326口	27,432,802,580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 1.3531円 （1万口当たり純資産額）（13,531円）	1口当たり純資産額 1.2887円 （1万口当たり純資産額）（12,887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 2023年12月16日 至 2024年12月16日	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	（１）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。 （２）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左
3．金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	21,059,086,462円	24,466,336,326円
同期中追加設定元本額	5,046,173,876円	6,975,676,383円
同期中一部解約元本額	1,638,924,012円	4,009,210,129円
元本の内訳*		
S O M P O ターゲット・リターン戦略ファンド（2%コース）（F o F s 用）（適格機関投資家専用）	26,470,833円	13,322,664円
S O M P O ターゲット・リターン戦略ファンド（4%コース）（F o F s 用）（適格機関投資家専用）	57,224,876円	25,310,400円
損保ジャパン国内債券ファンド（適格機関投資家専用）	2,018,911,969円	1,134,475,605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）	655,282,877円	301,137,475円
損保ジャパン日本債券ファンド	947,958,600円	951,517,352円
ハッピーエイジング20	430,584,576円	557,404,986円
ハッピーエイジング30	1,644,513,587円	2,073,969,097円
ハッピーエイジング40	7,297,799,947円	8,808,459,985円
ハッピーエイジング50	5,130,290,830円	5,979,872,362円
ハッピーエイジング60	3,033,734,868円	3,287,283,752円
好配当グローバルR E I T プレミアム・ファンド 通貨セレクトコース	100,588,016円	97,401,732円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド2035	2,031,205,550円	2,574,354,745円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド2045	759,210,442円	1,108,115,145円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド2055	309,564,500円	481,082,219円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド2065	19,610,796円	34,229,800円
S O M P O 世界分散ファンド（安定型）＜D C 年金＞	2,013,570円	2,917,744円
S O M P O 世界分散ファンド（安定成長型）＜D C 年金＞	818,835円	1,091,111円
S O M P O 世界分散ファンド（成長型）＜D C 年金＞	551,654円	856,406円
計	24,466,336,326円	27,432,802,580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

	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
--	---------------	---------------

種類	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	74,686,700	486,372,400
地方債証券	3,328,000	-
特殊債券	2,449,638	658,658
社債券	15,647,000	63,089,000
合計	96,111,338	550,120,058

（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

2025年12月15日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	第 4 7 1 回利付国債（ 2 年 ）	800,000,000	800,000,000	
	第 4 7 2 回利付国債（ 2 年 ）	240,000,000	239,268,000	
	第 4 7 3 回利付国債（ 2 年 ）	800,000,000	798,272,000	
	第 4 7 5 回利付国債（ 2 年 ）	1,050,000,000	1,048,404,000	
	第 4 7 6 回利付国債（ 2 年 ）	1,700,000,000	1,696,702,000	
	第 4 7 7 回利付国債（ 2 年 ）	160,000,000	159,900,800	
	第 1 5 5 回利付国債（ 5 年 ）	250,000,000	246,305,000	
	第 1 6 2 回利付国債（ 5 年 ）	680,000,000	664,795,200	
	第 1 6 6 回利付国債（ 5 年 ）	340,000,000	332,336,400	
	第 1 7 2 回利付国債（ 5 年 ）	500,000,000	487,060,000	
	第 1 7 3 回利付国債（ 5 年 ）	100,000,000	97,454,000	
	第 1 7 4 回利付国債（ 5 年 ）	270,000,000	264,095,100	
	第 1 7 7 回利付国債（ 5 年 ）	2,800,000,000	2,774,940,000	
	第 1 7 8 回利付国債（ 5 年 ）	400,000,000	393,964,000	
	第 1 7 9 回利付国債（ 5 年 ）	1,000,000,000	982,610,000	
	第 1 8 1 回利付国債（ 5 年 ）	620,000,000	616,404,000	
	第 1 4 回利付国債（ 4 0 年 ）	350,000,000	163,149,000	
	第 1 7 回利付国債（ 4 0 年 ）	480,000,000	345,705,600	
	第 3 5 1 回利付国債（ 1 0 年 ）	430,000,000	419,443,500	
	第 3 6 2 回利付国債（ 1 0 年 ）	550,000,000	512,226,000	
	第 3 6 5 回利付国債（ 1 0 年 ）	900,000,000	825,741,000	
	第 3 6 6 回利付国債（ 1 0 年 ）	50,000,000	45,926,500	
	第 3 6 8 回利付国債（ 1 0 年 ）	440,000,000	399,850,000	
	第 3 6 9 回利付国債（ 1 0 年 ）	300,000,000	277,185,000	

第 3 7 1 回利付国債（ 1 0 年 ）	30,000,000	27,248,400	
第 3 7 2 回利付国債（ 1 0 年 ）	300,000,000	279,759,000	
第 3 7 3 回利付国債（ 1 0 年 ）	300,000,000	274,122,000	
第 3 7 5 回利付国債（ 1 0 年 ）	1,100,000,000	1,038,191,000	
第 3 7 9 回利付国債（ 1 0 年 ）	150,000,000	144,642,000	
第 4 3 回利付国債（ 3 0 年 ）	240,000,000	202,264,800	
第 5 5 回利付国債（ 3 0 年 ）	50,000,000	32,613,000	
第 5 7 回利付国債（ 3 0 年 ）	300,000,000	192,705,000	
第 5 8 回利付国債（ 3 0 年 ）	60,000,000	38,225,400	
第 6 0 回利付国債（ 3 0 年 ）	570,000,000	366,681,000	
第 6 8 回利付国債（ 3 0 年 ）	90,000,000	49,677,300	
第 7 2 回利付国債（ 3 0 年 ）	100,000,000	54,958,000	
第 7 4 回利付国債（ 3 0 年 ）	100,000,000	59,411,000	
第 7 5 回利付国債（ 3 0 年 ）	1,580,000,000	1,016,730,000	
第 7 6 回利付国債（ 3 0 年 ）	100,000,000	65,840,000	
第 7 7 回利付国債（ 3 0 年 ）	200,000,000	138,308,000	
第 7 9 回利付国債（ 3 0 年 ）	800,000,000	493,368,000	
第 8 0 回利付国債（ 3 0 年 ）	80,000,000	57,760,000	
第 8 3 回利付国債（ 3 0 年 ）	500,000,000	395,665,000	
第 8 4 回利付国債（ 3 0 年 ）	210,000,000	162,164,100	
第 8 6 回利付国債（ 3 0 年 ）	100,000,000	82,665,000	
第 1 1 3 回利付国債（ 2 0 年 ）	180,000,000	185,329,800	
第 1 3 1 回利付国債（ 2 0 年 ）	30,000,000	30,309,900	
第 1 4 8 回利付国債（ 2 0 年 ）	50,000,000	48,904,000	
第 1 4 9 回利付国債（ 2 0 年 ）	300,000,000	292,602,000	
第 1 5 0 回利付国債（ 2 0 年 ）	320,000,000	308,560,000	
第 1 5 1 回利付国債（ 2 0 年 ）	160,000,000	151,208,000	
第 1 5 2 回利付国債（ 2 0 年 ）	70,000,000	65,908,500	
第 1 5 9 回利付国債（ 2 0 年 ）	150,000,000	128,328,000	
第 1 6 0 回利付国債（ 2 0 年 ）	940,000,000	808,400,000	
第 1 6 2 回利付国債（ 2 0 年 ）	100,000,000	83,835,000	
第 1 6 6 回利付国債（ 2 0 年 ）	700,000,000	578,095,000	
第 1 6 8 回利付国債（ 2 0 年 ）	210,000,000	163,804,200	
第 1 6 9 回利付国債（ 2 0 年 ）	180,000,000	137,235,600	
第 1 7 1 回利付国債（ 2 0 年 ）	200,000,000	149,986,000	
第 1 7 3 回利付国債（ 2 0 年 ）	30,000,000	22,478,400	
第 1 7 4 回利付国債（ 2 0 年 ）	1,000,000,000	743,110,000	
第 1 7 5 回利付国債（ 2 0 年 ）	500,000,000	374,695,000	
第 1 7 6 回利付国債（ 2 0 年 ）	800,000,000	594,392,000	
第 1 7 7 回利付国債（ 2 0 年 ）	100,000,000	72,403,000	
第 1 8 2 回利付国債（ 2 0 年 ）	100,000,000	78,985,000	
第 1 8 3 回利付国債（ 2 0 年 ）	560,000,000	462,464,800	

	第185回利付国債（20年）	600,000,000	465,390,000	
	第188回利付国債（20年）	60,000,000	49,943,400	
	第190回利付国債（20年）	210,000,000	179,102,700	
	第191回利付国債（20年）	660,000,000	579,744,000	
	第193回利付国債（20年）	600,000,000	567,264,000	
国債証券 合計		30,980,000,000	27,087,213,400	
特殊債券	第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,448,000	14,518,072	
	第65回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,753,000	26,598,752	
特殊債券 合計		42,201,000	41,116,824	
社債券	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 期限前償還条項付非	100,000,000	99,839,000	
	第15回クレディ・アグリコル・エス・エー期 限前償還条項付非上	300,000,000	298,635,000	
	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	99,544,000	
	第37回清水建設株式会社無担保社債（社債間 限定同順位特約付）	100,000,000	97,454,000	
	第52回鹿島建設株式会社無担保社債（社債間 限定同順位特約付）	400,000,000	392,160,000	
	第30回大和ハウス工業株式会社無担保社債 （特定社債間限定同順	200,000,000	197,052,000	
	第3回コカ・コーラ ボトラーズジャパンホー ルディングス株式会	300,000,000	284,724,000	
	第2回不二製油グループ本社株式会社利払繰延 条項・期限前償還条	100,000,000	97,711,000	
	第7回ヒューリ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	98,987,000	
	第4回東急不動産ホールディングス株式会社利 払繰延条項・期限前	100,000,000	100,000,000	
	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	96,052,000	
	第2回武田薬品工業株式会社利払繰延条項・期 限前償還条項付無担	300,000,000	297,225,000	
	第13回楽天株式会社無担保社債（社債間限定 同順位特約付）	200,000,000	183,032,000	
	第17回楽天グループ株式会社無担保社債（社 債間限定同順位特約	100,000,000	94,736,000	
	第24回楽天グループ株式会社無担保社債（社 債間限定同順位特約	100,000,000	99,572,000	
	第4回E N E O Sホールディングス株式会社利 払繰延条項・期限前	200,000,000	196,198,000	
	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	196,338,000	
	第17回株式会社L I X I L 無担保社債（社債 間限定同順位特約付	200,000,000	195,306,000	
	第1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	200,000,000	198,790,000	
	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	96,780,000	
	第24回パナソニック ホールディングス株式 会社無担保社債（社	300,000,000	293,190,000	

第6回GMOフィナンシャルホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,532,000	
第3回株式会社かんぽ生命保険利払繰延条項・期限前償還条項付無	200,000,000	188,086,000	
第4回株式会社かんぽ生命保険利払繰延条項・期限前償還条項付無	100,000,000	94,752,000	
第1回株式会社ゼンショーホールディングス利払繰延条項・期限前	100,000,000	99,364,000	
第32回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債（実質）	100,000,000	97,624,000	
第36回NTTファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定同順）	400,000,000	387,580,000	
第57回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債（社債間）	200,000,000	187,512,000	
第40回東京センチュリー株式会社無担保社債（社債間限定同順位）	100,000,000	97,317,000	
第37回SBIホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定）	100,000,000	99,317,000	
第42回SBIホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定）	300,000,000	295,200,000	
第6回オリックス株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保	100,000,000	97,468,000	
第6回東日本旅客鉄道株式会社サステナビリティボンド・無担保普	100,000,000	91,405,000	
第30回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特）	200,000,000	184,148,000	
第2回株式会社U-NEXT HOLDINGS無担保社債（社債）	100,000,000	99,106,000	
第53回株式会社光通信無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	98,912,000	
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	198,282,000	
第562回関西電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	182,572,000	
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	89,744,000	
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	199,372,000	
第496回九州電力株式会社社債（一般担保付）	300,000,000	272,658,000	
第80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	191,084,000	
第5回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債（社債間）	200,000,000	182,246,000	
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	185,924,000	
第3回A号富国生命劣後FR	200,000,000	198,328,000	
社債券 合計	8,000,000,000	7,730,858,000	
合計		34,859,188,224	

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マザーファンド

貸借対照表

	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	37,428,841	48,731,586
コール・ローン	2,705,121	10,121,297
国債証券	1,708,443,866	1,964,354,092
派生商品評価勘定	-	104,345
未収利息	12,490,131	12,971,632
前払費用	2,002,047	3,193,194
流動資産合計	1,763,070,006	2,039,476,146
資産合計	1,763,070,006	2,039,476,146
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	39,752,253	17,264,581
未払金	629,914	28,715,183
流動負債合計	40,382,167	45,979,764
負債合計	40,382,167	45,979,764
純資産の部		
元本等		
元本	1,228,080,925	1,434,982,766
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	494,606,914	558,513,616
元本等合計	1,722,687,839	1,993,496,382
純資産合計	1,722,687,839	1,993,496,382
負債純資産合計	1,763,070,006	2,039,476,146

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 個別法に基づき、以下のとおり、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 ただし、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法による時価法によっております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3．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。
4．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。
5．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。

（貸借対照表に関する注記）

期別	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
1. 受益権の総数	1,228,080,925口	1,434,982,766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 1.4027円 (1万口当たり純資産額) (14,027円)	1口当たり純資産額 1.3892円 (1万口当たり純資産額) (13,892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 2023年12月16日 至 2024年12月16日	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、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。 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。 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。 (2) 金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

項目	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,041,112,059円	1,228,080,925円
同期中追加設定元本額	944,585,930円	1,445,565,665円
同期中一部解約元本額	757,617,064円	1,238,663,824円
元本の内訳*		
S O M P Oターゲット・リターン戦略ファンド（2%コース）（F o F s用）（適格機関投資家専用）	14,310,282円	31,338,813円
S O M P Oターゲット・リターン戦略ファンド（4%コース）（F o F s用）（適格機関投資家専用）	34,966,003円	51,664,140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）	396,089,771円	595,419,275円
損保ジャパン外国債券ファンド	775,320,374円	745,052,065円
S O M P O世界分散ファンド（安定型）＜D C年金＞	3,081,080円	4,290,080円
S O M P O世界分散ファンド（安定成長型）＜D C年金＞	3,311,555円	5,887,724円
S O M P O世界分散ファンド（成長型）＜D C年金＞	1,001,860円	1,330,669円
計	1,228,080,925円	1,434,982,766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	2024年12月16日現在	2025年12月15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	10,671,617	2,808,241
合計	10,671,617	2,808,241

（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）

種類	2024年12月16日 現在				2025年12月15日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引								
売建	1,702,796,207	-	1,742,548,460	39,752,253	1,969,186,060	-	1,986,346,296	17,160,236
ドル	786,063,486	-	805,468,575	19,405,089	939,695,127	-	943,696,248	4,001,121
カナダドル	41,245,837	-	41,680,280	434,443	33,740,656	-	34,395,441	654,785

メキシコペソ	13,399,800	-	13,963,392	563,592	16,610,055	-	16,969,186	359,131
ユーロ	528,949,318	-	541,317,189	12,367,871	591,366,112	-	600,051,342	8,685,230
ポンド	91,589,543	-	93,398,393	1,808,850	105,346,870	-	106,907,528	1,560,658
スウェーデンクローナ	5,000,427	-	5,116,460	116,033	2,890,826	-	2,959,352	68,526
ノルウェークローネ	3,105,299	-	3,167,468	62,169	3,563,571	-	3,583,842	20,271
デンマーククローネ	5,631,273	-	5,764,140	132,867	5,667,988	-	5,754,398	86,410
ポーランドズロチ	9,146,500	-	9,448,425	301,925	10,592,250	-	10,799,675	207,425
オーストラリアドル	22,983,851	-	23,064,657	80,806	23,415,777	-	23,901,570	485,793
シンガポールドル	19,837,566	-	20,275,232	437,666	21,807,968	-	21,960,993	153,025
オフショア人民元	175,843,307	-	179,884,249	4,040,942	214,488,860	-	215,366,721	877,861
合計	1,702,796,207	-	1,742,548,460	39,752,253	1,969,186,060	-	1,986,346,296	17,160,236

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

- ３．換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

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

2025年12月15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 1.25 310815	60,000	52,157.81	
		Treasury 1.5 270131	40,000	39,092.18	
		Treasury 1.5 300215	10,000	9,163.28	
		Treasury 1.625 310515	10,000	8,943.35	
		Treasury 1.75 291115	180,000	167,589.84	
		Treasury 1.75 410815	70,000	46,924.60	
		Treasury 2.0 510815	30,000	17,182.03	
		Treasury 2.25 270215	10,000	9,850.78	
		Treasury 2.25 270815	260,000	254,546.09	
		Treasury 2.375 290515	140,000	134,394.53	
		Treasury 2.375 510515	10,000	6,299.21	
		Treasury 2.75 280215	340,000	334,382.03	
		Treasury 2.75 421115	200,000	152,960.93	
		Treasury 2.75 470815	50,000	35,648.43	
		Treasury 2.875 430515	60,000	46,371.09	
		Treasury 3.0 441115	15,000	11,567.57	

	Treasury 3.0 450515	90,000	69,011.71	
	Treasury 3.0 470215	40,000	30,043.75	
	Treasury 3.0 480215	60,000	44,561.71	
	Treasury 3.0 520815	80,000	57,290.62	
	Treasury 3.5 390215	50,000	45,404.29	
	Treasury 3.75 300531	40,000	40,054.68	
	Treasury 4.0 340215	80,000	79,700.00	
	Treasury 4.0 351115	150,000	147,679.68	
	Treasury 4.0 521115	110,000	95,416.40	
	Treasury 4.125 321115	10,000	10,108.20	
	Treasury 4.25 350815	770,000	774,571.87	
	Treasury 4.5 290531	1,190,000	1,223,096.87	
	Treasury 4.5 331115	10,000	10,319.53	
	Treasury 4.625 310531	1,220,000	1,268,657.02	
	Treasury 4.625 400215	90,000	90,576.56	
	Treasury 4.625 551115	70,000	67,473.43	
	Treasury 4.75 531115	120,000	117,796.87	
	Treasury 4.75 550815	410,000	403,145.30	
	Treasury 6.125 271115	85,000	89,070.70	
ドル 合計		6,160,000	5,991,052.94	(934,724,079)
カナダドル	CANADA 0.5 301201	200,000	176,744.49	
	CANADA 3.5 451201	20,000	19,252.26	
	CANADA 5.0 370601	28,000	31,789.34	
	CANADA 5.75 290601	69,000	75,535.44	
カナダドル 合計		317,000	303,321.53	(34,363,296)
メキシコペソ	MEXICO 8.5 290531	1,160,000	1,165,127.20	
	MEXICO 8.5 381118	770,000	722,383.20	
メキシコペソ 合計		1,930,000	1,887,510.40	(16,348,671)
ユーロ	AUSTRIA 3.8 620126	10,000	9,892.80	
	AUSTRIA 4.15 370315	90,000	97,338.60	
	BELGIUM 0.8 270622	30,000	29,402.66	
	BELGIUM 3.0 340622	35,000	34,477.81	
	BELGIUM 4.25 410328	30,000	31,464.00	
	BELGIUM 5.0 350328	5,000	5,674.29	
	BELGIUM 5.5 280328	37,000	39,613.94	
	FINLAND 0.75 310415	80,000	72,283.52	
	FRA 0.75 281125	20,000	19,021.16	
	FRANCE 0.0 270225	10,000	9,745.49	
	FRANCE 0.0 291125	110,000	99,159.50	
	FRANCE 0.0 320525	200,000	164,352.60	

FRANCE 0.75 520525	10,000	4,358.59	
FRANCE 1.0 270525	10,000	9,830.27	
FRANCE 1.25 340525	10,000	8,442.41	
FRANCE 2.75 271025	25,000	25,204.95	
FRANCE 3.2 350525	220,000	214,435.98	
FRANCE 3.25 450525	40,000	35,148.36	
FRANCE 3.5 331125	30,000	30,366.21	
FRANCE 3.5 351125	10,000	9,932.86	
FRANCE 4.0 381025	75,000	76,282.80	
FRANCE 4.0 550425	60,000	55,777.08	
FRANCE 4.0 600425	20,000	18,226.92	
FRANCE 5.75 321025	30,000	34,777.20	
GERMANY 0.0 500815	10,000	4,306.95	
GERMANY 0.25 290215	210,000	197,323.35	
GERMANY 0.5 280215	30,000	28,975.50	
GERMANY 1.7 320815	40,000	37,819.28	
GERMANY 2.5 460815	50,000	43,487.00	
GERMANY 2.5 540815	50,000	41,215.75	
GERMANY 2.6 350815	230,000	225,042.12	
GERMANY 4.0 370104	80,000	87,682.08	
IRELAND 2.0 450218	20,000	15,695.70	
IRELAND 2.4 300515	30,000	29,838.90	
ITALY 0.95 320601	40,000	35,082.84	
ITALY 2.2 270601	70,000	70,044.10	
ITALY 2.45 330901	40,000	37,845.28	
ITALY 2.7 470301	10,000	7,962.60	
ITALY 2.8 281201	150,000	151,483.50	
ITALY 2.8 670301	30,000	21,321.84	
ITALY 3.25 320715	120,000	120,922.80	
ITALY 3.85 340701	120,000	124,167.72	
ITALY 4.0 370201	105,000	108,864.94	
ITALY 4.5 531001	10,000	10,233.26	
ITALY 4.75 440901	50,000	54,426.90	
ITALY 5.0 400901	5,000	5,616.82	
NETHERLANDS 2.5 330115	80,000	78,658.24	
NETHERLANDS 2.75 470115	30,000	26,677.68	
NETHERLANDS 4.0 370115	20,000	21,658.24	
NETHERLANDS 5.5 280115	20,000	21,336.20	
OBRIGACÕES 1.95 290615	30,000	29,623.68	
OBRIGACÕES 2.25 340418	20,000	18,867.00	
OBRIGACÕES 4.1 450215	20,000	20,931.70	
SPAIN 0.5 311031	150,000	131,495.70	

	SPAIN 1.5 270430	10,000	9,911.88	
	SPAIN 3.1 310730	100,000	101,563.00	
	SPAIN 3.45 341031	50,000	50,909.90	
	SPAIN 3.45 660730	30,000	25,676.88	
	SPAIN 4.0 541031	10,000	9,792.15	
	SPAIN 4.2 370131	30,000	32,109.60	
	SPAIN 4.7 410730	20,000	22,272.00	
	SPAIN 4.9 400730	10,000	11,361.58	
	SPAIN 5.15 281031	10,000	10,765.40	
	SPAIN 6.0 290131	15,000	16,617.84	
ユーロ 合計		3,352,000	3,234,797.90	(592,097,407)
ポンド	UK GILT 3.5 450122	50,000	39,981.58	
	UK GILT 4.0 600122	37,000	29,865.02	
	UK GILT 4.25 271207	30,000	30,321.24	
	UK GILT 4.25 320607	50,000	50,375.54	
	UK GILT 4.25 360307	15,000	14,565.39	
	UK GILT 4.25 390907	25,000	23,464.39	
	UK GILT 4.25 401207	10,000	9,264.98	
	UK GILT 4.25 461207	8,000	7,044.23	
	UK GILT 4.25 491207	20,000	17,345.94	
	UK GILT 4.25 551207	30,000	25,500.00	
	UK GILT 4.5 340907	40,000	40,185.92	
	UK GILT 4.5 421207	5,000	4,684.82	
	UK GILT 6.0 281207	50,000	53,131.12	
	UK GILT 0.25 310731	10,000	8,146.58	
	UK GILT 1.625 711022	20,000	8,053.00	
	UK GILT 3.75 270307	115,000	114,981.31	
	UK GILT 4.625 340131	30,000	30,457.03	
ポンド 合計		545,000	507,368.09	(105,791,320)
スウェーデンクローナ	SWEDEN 3.5 390330	160,000	168,438.40	
スウェーデンクローナ 合計		160,000	168,438.40	(2,834,818)
ノルウェークローネ	NORWAY 1.375 300819	250,000	222,785.00	
ノルウェークローネ 合計		250,000	222,785.00	(3,435,344)
デンマーククローネ	DENMARK 4.5 391115	190,000	224,292.15	
デンマーククローネ 合計		190,000	224,292.15	(5,497,400)
ポーランドズロチ	POLAND 1.75 320425	270,000	225,019.11	
ポーランドズロチ 合計		270,000	225,019.11	(9,749,425)

オーストラリアドル	AUSTRALIA 3.75 370421	130,000	118,116.70	
	AUSTRALIA 4.75 270421	100,000	100,984.00	
オーストラリアドル 合計		230,000	219,100.70 (22,722,933)	
シンガポールドル	SINGAPORE 2.875 290701	130,000	134,875.00	
	SINGAPORE 3.5 270301	45,000	46,084.50	
シンガポールドル 合計		175,000	180,959.50 (21,850,859)	
オフショア人民元	CGB 1.83 350825	1,300,000	1,299,213.68	
	CGB 2.04 270225	1,000,000	1,008,301.30	
	CGB 2.18 260815	500,000	502,763.45	
	CGB 2.6 320901	1,000,000	1,056,603.00	
	CGB 2.67 331125	1,500,000	1,599,899.40	
	CGB 2.8 290324	1,000,000	1,042,626.10	
	CGB 2.8 300325	500,000	526,329.10	
	CGB 2.8 321115	1,000,000	1,071,002.70	
	CGB 2.91 281014	1,000,000	1,043,077.40	
	CGB 3.0 531015	500,000	573,269.95	
オフショア人民元 合計		9,300,000	9,723,086.08 (214,938,540)	
合計			1,964,354,092 (1,964,354,092)	

（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 35銘柄	46.89%	47.58%
カナダドル	国債証券 4銘柄	1.72%	1.75%
メキシコペソ	国債証券 2銘柄	0.82%	0.83%
ユーロ	国債証券 64銘柄	29.70%	30.14%
ポンド	国債証券 17銘柄	5.31%	5.39%
スウェーデンクローナ	国債証券 1銘柄	0.14%	0.14%
ノルウェークローネ	国債証券 1銘柄	0.17%	0.17%
デンマーククローネ	国債証券 1銘柄	0.28%	0.28%
ポーランドズロチ	国債証券 1銘柄	0.49%	0.50%
オーストラリアドル	国債証券 2銘柄	1.14%	1.16%
シンガポールドル	国債証券 2銘柄	1.10%	1.11%
オフショア人民元	国債証券 10銘柄	10.78%	10.94%

（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

注記事項（デリバティブ取引等に関する注記）において表示した表は、「投資信託財産計算規則」附属明細表別紙様式第1号第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に求められている項目（記載上の注意を含む。）を満たしているため、省略いたします。

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

	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	237,404,941	470,579,450
コール・ローン	69,426,135	55,797,873
国債証券	15,924,261,650	18,884,074,235
未収利息	108,871,185	127,731,576
前払費用	25,450,764	42,019,509
流動資産合計	16,365,414,675	19,580,202,643
資産合計	16,365,414,675	19,580,202,643
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	33,120	-
未払金	-	375,506,244
流動負債合計	33,120	375,506,244
負債合計	33,120	375,506,244
純資産の部		
元本等		
元本	7,940,466,773	8,572,316,846
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,424,914,782	10,632,379,553
元本等合計	16,365,381,555	19,204,696,399
純資産合計	16,365,381,555	19,204,696,399
負債純資産合計	16,365,414,675	19,580,202,643

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

（貸借対照表に関する注記）

期別	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
1．受益権の総数	7,940,466,773口	8,572,316,846口
2．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.0610円 (1万口当たり純資産額) (20,610円)	1口当たり純資産額 2.2403円 (1万口当たり純資産額) (22,403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 2023年12月16日 至 2024年12月16日	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	（１）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、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。 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。 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。 （２）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左
3．金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2．時価の算定方法	（１）有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	（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。

（関連当事者との取引に関する注記）

2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	7,172,757,883円	7,940,466,773円
同期中追加設定元本額	1,068,485,066円	1,129,193,985円
同期中一部解約元本額	300,776,176円	497,343,912円
元本の内訳＊		
ハッピーエイジング２０	852,988,133円	963,408,144円
ハッピーエイジング３０	2,714,759,890円	2,987,144,683円
ハッピーエイジング４０	2,190,317,010円	2,306,679,496円
ハッピーエイジング５０	653,742,963円	664,836,886円
ハッピーエイジング６０	445,139,180円	420,850,475円
損保ジャパン外国債券ファンド（為替ヘッジなし）	451,759,658円	485,960,548円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド２０３５	528,581,519円	615,348,212円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド２０４５	61,704,283円	76,732,927円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド２０５５	31,962,675円	38,742,407円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド２０６５	7,335,398円	10,922,313円
S O M P O 世界分散ファンド（安定型）＜ＤＣ年金＞	265,371円	218,490円
S O M P O 世界分散ファンド（安定成長型）＜ＤＣ年金＞	408,196円	468,487円
S O M P O 世界分散ファンド（成長型）＜ＤＣ年金＞	1,502,497円	1,003,778円
計	7,940,466,773円	8,572,316,846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	2024年12月16日現在	2025年12月15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	21,437,175	249,324
合計	21,437,175	249,324

（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）

種類	2024年12月16日 現在				2025年12月15日 現在			
	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	123,070,400	-	123,103,520	33,120	-	-	-	-
ドル	123,070,400	-	123,103,520	33,120	-	-	-	-
合計	123,070,400	-	123,103,520	33,120	-	-	-	-

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

３．換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

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

2025年12月15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 1.25 310815	320,000	278,175.00	
		Treasury 1.5 270131	200,000	195,460.93	
		Treasury 1.5 300215	30,000	27,489.84	
		Treasury 1.625 310515	20,000	17,886.71	
		Treasury 1.75 291115	950,000	884,501.95	
		Treasury 1.75 410815	2,730,000	1,830,059.75	
		Treasury 2.0 510815	1,160,000	664,371.88	
		Treasury 2.25 270215	60,000	59,104.68	
		Treasury 2.25 270815	100,000	97,902.34	
		Treasury 2.375 290515	10,000	9,599.60	
		Treasury 2.75 280215	2,930,000	2,881,586.32	
		Treasury 2.75 320815	50,000	46,558.59	
		Treasury 2.75 421115	485,000	370,930.27	
		Treasury 2.75 470815	440,000	313,706.25	
		Treasury 2.875 430515	620,000	479,167.96	
		Treasury 2.875 490515	1,040,000	744,818.75	
		Treasury 3.0 441115	500,000	385,585.94	
		Treasury 3.0 450515	75,000	57,509.76	
		Treasury 3.0 480215	1,340,000	995,211.71	
		Treasury 3.0 520815	320,000	229,162.49	
		Treasury 3.125 290831	100,000	98,152.34	
		Treasury 3.375 330515	340,000	326,612.50	
		Treasury 3.5 390215	5,000	4,540.42	
		Treasury 3.625 530515	20,000	16,169.53	
		Treasury 3.75 300531	830,000	831,134.76	
		Treasury 3.875 330815	240,000	237,871.87	
		Treasury 4.0 340215	410,000	408,462.50	
		Treasury 4.0 351115	100,000	98,453.12	

	Treasury 4.0 521115	10,000	8,674.21	
	Treasury 4.125 321115	10,000	10,108.20	
	Treasury 4.125 530815	1,480,000	1,310,089.05	
	Treasury 4.25 350815	9,500,000	9,556,406.24	
	Treasury 4.5 290531	4,740,000	4,871,831.25	
	Treasury 4.625 310531	13,540,000	14,080,013.24	
	Treasury 4.625 350215	190,000	197,043.35	
	Treasury 4.625 400215	220,000	221,409.37	
	Treasury 4.625 550215	200,000	192,570.31	
	Treasury 4.625 551115	100,000	96,390.62	
	Treasury 4.75 531115	750,000	736,230.46	
	Treasury 4.75 550815	5,100,000	5,014,734.37	
	Treasury 6.125 271115	60,000	62,873.43	
ドル 合計		51,325,000	48,948,561.86 (7,636,954,621)	
カナダドル	CANADA 0.5 301201	1,570,000	1,387,444.27	
	CANADA 3.5 451201	990,000	952,986.92	
	CANADA 5.0 370601	130,000	147,593.40	
	CANADA 5.75 290601	860,000	941,456.23	
カナダドル 合計		3,550,000	3,429,480.82 (388,525,882)	
メキシコペソ	MEXICO 7.75 341123	10,000,000	9,255,600.00	
	MEXICO 8.5 290301	52,000,000	52,265,200.00	
メキシコペソ 合計		62,000,000	61,520,800.00 (532,862,409)	
ユーロ	AUSTRIA 3.8 620126	50,000	49,464.00	
	AUSTRIA 4.15 370315	950,000	1,027,463.00	
	BELGIUM 0.8 270622	410,000	401,836.47	
	BELGIUM 3.0 340622	40,000	39,403.21	
	BELGIUM 4.25 410328	915,000	959,652.00	
	BELGIUM 5.0 350328	45,000	51,068.61	
	BELGIUM 5.5 280328	100,000	107,064.72	
	FINLAND 0.75 310415	360,000	325,275.84	
	FRA 0.75 281125	10,000	9,510.58	
	FRANCE 0.0 270225	1,600,000	1,559,278.40	
	FRANCE 0.0 291125	30,000	27,043.50	
	FRANCE 0.0 320525	1,730,000	1,421,649.99	
	FRANCE 0.75 280225	220,000	212,473.80	
	FRANCE 0.75 520525	10,000	4,358.59	
	FRANCE 1.0 270525	10,000	9,830.27	
	FRANCE 1.25 340525	10,000	8,442.41	
	FRANCE 2.0 321125	760,000	705,143.20	
	FRANCE 2.75 271025	10,000	10,081.98	

FRANCE 3.0 330525	50,000	49,185.35	
FRANCE 3.2 350525	950,000	925,973.55	
FRANCE 3.25 450525	310,000	272,399.79	
FRANCE 3.5 331125	480,000	485,859.36	
FRANCE 3.5 351125	50,000	49,664.30	
FRANCE 4.0 381025	930,000	945,906.72	
FRANCE 4.0 550425	770,000	715,805.86	
FRANCE 4.0 600425	280,000	255,176.88	
FRANCE 4.5 410425	10,000	10,580.80	
FRANCE 5.5 290425	35,000	38,249.75	
FRANCE 5.75 321025	15,000	17,388.60	
GERMANY 0 310215	10,000	8,818.80	
GERMANY 0.0 310815	10,000	8,690.84	
GERMANY 0.0 500815	20,000	8,613.90	
GERMANY 0.25 290215	1,160,000	1,089,976.60	
GERMANY 0.5 280215	10,000	9,658.50	
GERMANY 1.7 320815	1,710,000	1,616,774.22	
GERMANY 1.9 270916	2,150,000	2,141,314.00	
GERMANY 2.2 340215	80,000	76,775.36	
GERMANY 2.3 330215	10,000	9,764.90	
GERMANY 2.5 460815	500,000	434,870.00	
GERMANY 2.5 540815	710,000	585,263.65	
GERMANY 2.6 330815	110,000	109,168.62	
GERMANY 2.6 350815	600,000	587,066.40	
GERMANY 4.0 370104	510,000	558,973.26	
IRELAND 2.0 450218	210,000	164,804.85	
IRELAND 2.4 300515	310,000	308,335.30	
ITALY 0.95 320601	1,510,000	1,324,377.21	
ITALY 2.2 270601	1,490,000	1,490,938.70	
ITALY 2.45 330901	310,000	293,300.92	
ITALY 2.7 470301	10,000	7,962.60	
ITALY 2.8 281201	1,255,000	1,267,411.95	
ITALY 2.8 670301	160,000	113,716.48	
ITALY 3.25 320715	100,000	100,769.00	
ITALY 3.25 460901	10,000	8,758.04	
ITALY 3.85 340701	810,000	838,132.11	
ITALY 4.0 370201	640,000	663,557.76	
ITALY 4.5 531001	260,000	266,064.76	
ITALY 4.75 440901	630,000	685,778.94	
ITALY 5.0 400901	15,000	16,850.46	
NETHERLANDS 2.5 330115	530,000	521,110.84	
NETHERLANDS 2.75 470115	250,000	222,314.00	

	NETHERLANDS 4.0 370115	360,000	389,848.32	
	NETHERLANDS 5.5 280115	125,000	133,351.25	
	OBRIGACOES 1.95 290615	300,000	296,236.80	
	OBRIGACOES 2.25 340418	150,000	141,502.50	
	OBRIGACOES 4.1 450215	150,000	156,987.75	
	SPAIN 0.0 280131	10,000	9,541.85	
	SPAIN 0.5 311031	1,510,000	1,323,723.38	
	SPAIN 1.5 270430	530,000	525,329.64	
	SPAIN 3.1 310730	150,000	152,344.50	
	SPAIN 3.45 341031	1,010,000	1,028,379.98	
	SPAIN 3.45 660730	200,000	171,179.20	
	SPAIN 4.0 541031	200,000	195,843.00	
	SPAIN 4.2 370131	120,000	128,438.40	
	SPAIN 4.7 410730	865,000	963,264.00	
	SPAIN 5.15 281031	55,000	59,209.70	
	SPAIN 5.75 320730	10,000	11,706.60	
ユーロ 合計		32,975,000	31,922,031.37	
			(5,843,008,621)	
ポンド	UK GILT 3.5 450122	710,000	567,738.50	
	UK GILT 4.0 600122	340,000	274,435.40	
	UK GILT 4.25 271207	90,000	90,963.73	
	UK GILT 4.25 320607	480,000	483,605.18	
	UK GILT 4.25 360307	849,000	824,401.14	
	UK GILT 4.25 390907	780,000	732,089.15	
	UK GILT 4.25 401207	100,000	92,649.88	
	UK GILT 4.25 461207	321,000	282,649.91	
	UK GILT 4.25 491207	160,000	138,767.53	
	UK GILT 4.25 551207	70,000	59,500.00	
	UK GILT 4.5 340907	125,000	125,581.01	
	UK GILT 4.5 421207	70,000	65,587.48	
	UK GILT 6.0 281207	260,000	276,281.85	
	UK GILT 0.25 310731	290,000	236,250.93	
	UK GILT 1.625 711022	100,000	40,265.00	
	UK GILT 3.75 270307	700,000	699,886.27	
	UK GILT 4.625 340131	300,000	304,570.38	
ポンド 合計		5,745,000	5,295,223.34	
			(1,104,107,018)	
スウェーデンクローナ	SWEDEN 3.5 390330	2,000,000	2,105,480.00	
スウェーデンクローナ 合計		2,000,000	2,105,480.00	
			(35,435,228)	
ノルウェークローネ	NORWAY 1.375 300819	29,100,000	25,932,174.00	
ノルウェークローネ 合計		29,100,000	25,932,174.00	
			(399,874,123)	

デンマーククローネ	DENMARK 4.5 391115	1,460,000	1,723,508.10	
デンマーククローネ 合計		1,460,000	1,723,508.10	(42,243,183)
ポーランドズロチ	POLAND 1.75 320425	13,800,000	11,500,977.12	
ポーランドズロチ 合計		13,800,000	11,500,977.12	(498,303,985)
オーストラリアドル	AUSTRALIA 3.75 370421	950,000	863,160.50	
	AUSTRALIA 4.75 270421	1,090,000	1,100,725.60	
オーストラリアドル 合計		2,040,000	1,963,886.10	(203,674,627)
シンガポールドル	SINGAPORE 2.875 290701	540,000	560,250.00	
シンガポールドル 合計		540,000	560,250.00	(67,650,187)
マレーシアリングgit	MALAYSIA 3.733 280615	1,900,000	1,928,769.61	
	MALAYSIA 5.248 280915	11,000	11,612.72	
マレーシアリングgit 合計		1,911,000	1,940,382.33	(73,852,697)
オフショア人民元	CGB 1.83 350825	17,000,000	16,989,717.38	
	CGB 2.04 270225	10,000,000	10,083,013.00	
	CGB 2.18 260815	12,000,000	12,066,322.80	
	CGB 2.6 320901	7,000,000	7,396,221.00	
	CGB 2.67 331125	9,500,000	10,132,696.20	
	CGB 2.8 290324	6,000,000	6,255,756.60	
	CGB 2.8 300325	7,500,000	7,894,936.50	
	CGB 2.8 321115	11,000,000	11,781,029.70	
	CGB 2.91 281014	4,000,000	4,172,309.60	
	CGB 3.0 531015	5,500,000	6,305,969.45	
オフショア人民元 合計		89,500,000	93,077,972.23	(2,057,581,654)
合計			18,884,074,235	(18,884,074,235)

（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 41銘柄	39.77%	40.44%
カナダドル	国債証券 4銘柄	2.02%	2.06%
メキシコペソ	国債証券 2銘柄	2.77%	2.82%
ユーロ	国債証券 76銘柄	30.42%	30.94%
ポンド	国債証券 17銘柄	5.75%	5.85%
スウェーデンクローナ	国債証券 1銘柄	0.18%	0.19%
ノルウェークローネ	国債証券 1銘柄	2.08%	2.12%

デンマーククローネ	国債証券	1銘柄	0.22%	0.22%
ポーランドズロチ	国債証券	1銘柄	2.59%	2.64%
オーストラリアドル	国債証券	2銘柄	1.06%	1.08%
シンガポールドル	国債証券	1銘柄	0.35%	0.36%
マレーシアリンギット	国債証券	2銘柄	0.38%	0.39%
オフショア人民元	国債証券	10銘柄	10.71%	10.90%

（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」- R E I T マザーファンド

貸借対照表

	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,882,745	88,044,988
投資証券	774,640,600	11,394,746,400
未収配当金	5,855,829	81,086,243
未収利息	8	844
流動資産合計	783,379,182	11,563,878,475
資産合計	783,379,182	11,563,878,475
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	280,988,956	3,171,551,454
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	502,390,226	8,392,327,021
元本等合計	783,379,182	11,563,878,475
純資産合計	783,379,182	11,563,878,475
負債純資産合計	783,379,182	11,563,878,475

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	投資証券 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	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
1. 受益権の総数	280,988,956口	3,171,551,454口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.7879円 (1万口当たり純資産額) (27,879円)	1口当たり純資産額 3.6461円 (1万口当たり純資産額) (36,461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 2023年12月16日 至 2024年12月16日	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は(有価証券に関する注記)に記載しております。 (2) 金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

2024年12月16日現在	2025年12月15日現在
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

項目	自 2023年12月16日 至 2024年12月16日	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	320,813,333円	280,988,956円
同期中追加設定元本額	836,767円	2,949,728,651円
同期中一部解約元本額	40,661,144円	59,166,153円
元本の内訳＊		
J - R E I T運用ファンド2025 - 07（適格機関投資家専用）	- 円	1,505,109,917円
J - R E I T運用ファンド2025 - 08（適格機関投資家専用）	- 円	1,440,976,124円
損保ジャパン・グローバルR E I Tファンド（毎月分配型）	279,585,645円	222,518,922円
S O M P O世界分散ファンド（安定型）＜D C年金＞	301,862円	393,055円
S O M P O世界分散ファンド（安定成長型）＜D C年金＞	476,883円	1,245,558円
S O M P O世界分散ファンド（成長型）＜D C年金＞	624,566円	1,307,878円
計	280,988,956円	3,171,551,454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	2024年12月16日現在	2025年12月15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）
投資証券	61,287,922	676,646,163
合計	61,287,922	676,646,163

（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

2025年12月15日現在

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 （円）	備考
投資証券	S O S I L A物流リート投資法人	2,569	313,161,100	
	森ヒルズリート投資法人	3,651	542,538,600	
	産業ファンド投資法人	2,542	380,029,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,631	651,118,600	
	G L P投資法人	3,029	438,296,300	
	日本プロロジスリート投資法人	7,998	729,417,600	
	星野リゾート・リート投資法人	917	229,433,400	
	ヒューリックリート投資法人	3,097	537,948,900	
	日本リート投資法人	745	74,053,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	5,033	851,583,600	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,516	419,810,400	

三菱地所物流リート投資法人	1,570	204,100,000	
ザイマックス・リート投資法人	293	33,724,300	
日本ビルファンド投資法人	5,397	776,628,300	
ジャパンリアルエステイト投資法人	7,998	1,034,141,400	
日本都市ファンド投資法人	2,489	303,409,100	
日本プライムリアルティ投資法人	2,464	260,937,600	
東急リアル・エステート投資法人	888	180,796,800	
森トラストリート投資法人	6,994	540,636,200	
フロンティア不動産投資法人	4,955	460,815,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	4,161	427,750,800	
K D X 不動産投資法人	4,280	749,428,000	
大和証券オフィス投資法人	302	111,740,000	
大和ハウスリート投資法人	4,193	591,632,300	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,978	429,103,600	
ジャパンエクセレント投資法人	825	122,512,500	
合計	89,515	11,394,746,400	

（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。

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。

【中間財務諸表】

- 1．当ファンドの中間財務諸表は、「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）ならびに同規則第284条および第307条の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2．当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2025年12月16日から2026年6月15日までの中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2025年12月15日現在	第4期中間計算期間末 2026年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	120	328
コール・ローン	261,777	295,874
投資信託受益証券	705,971	1,118,793
親投資信託受益証券	15,671,974	21,213,638
未収利息	2	4
流動資産合計	16,639,844	22,628,637
資産合計	16,639,844	22,628,637
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	2,547	2,900
未払委託者報酬	67,651	77,341
その他未払費用	680	788
流動負債合計	70,878	81,029
負債合計	70,878	81,029
純資産の部		
元本等		
元本	14,919,939	19,841,128
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,649,027	2,706,480
元本等合計	16,568,966	22,547,608
純資産合計	16,568,966	22,547,608
負債純資産合計	16,639,844	22,628,637

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2024年12月17日 至 2025年6月16日	第4期中間計算期間 自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
営業収益		
受取配当金	12,957	13,033
受取利息	124	547
有価証券売買等損益	59,102	495,365
為替差損益	46,412	27,711
営業収益合計	92,433	536,656
営業費用		
受託者報酬	2,039	2,900
委託者報酬	54,595	77,341
その他費用	580	13,602
営業費用合計	57,214	93,843
営業利益又は営業損失（ ）	149,647	442,813
経常利益又は経常損失（ ）	149,647	442,813
中間純利益又は中間純損失（ ）	149,647	442,813
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	-	6
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	680,242	1,649,027
剰余金増加額又は欠損金減少額	111,840	614,677
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	111,840	614,677
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	31
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	31
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	642,435	2,706,480

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 市場価格のある有価証券については、原則として取引所における中間計算期間末日の最終相場（外貨建証券等の場合は中間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。中間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。 市場価格のない有価証券については、中間計算期間末日または知りうる直近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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。
3．費用・収益の計上基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

期別	第3期 2025年12月15日現在	第4期中間計算期間末 2026年6月15日現在
1．受益権の総数	14,919,939口	19,841,128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) 1.1105円 (11,105円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1364円 (11,364円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第3期中間計算期間 自 2024年12月17日 至 2025年6月16日	第4期中間計算期間 自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
1．その他費用	-	その他費用の内訳は、監査費用（788円）、カストディフィー（12,814円）となっております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2025年12月15日現在	第4期中間計算期間末 2026年6月15日現在
1．中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はあります。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はあります。
2．時価の算定方法	（１）有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 （２）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15日	第4期中間計算期間 自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
期首元本額	11,274,781円	14,919,939円
期中追加設定元本額	4,011,594円	4,921,474円
期中一部解約元本額	366,436円	285円

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

【S O M P O 世界分散ファンド（安定成長型）＜D C 年金＞】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2025年12月15日現在	第4期中間計算期間末 2026年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	8	90,242
コール・ローン	438,669	492,773
投資信託受益証券	1,615,563	3,290,435
親投資信託受益証券	25,884,508	37,795,887
未収利息	4	8
流動資産合計	27,938,752	41,669,345
資産合計	27,938,752	41,669,345
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	4,078	4,910
未払委託者報酬	108,805	130,997
その他未払費用	1,112	1,395
流動負債合計	113,995	137,302
負債合計	113,995	137,302
純資産の部		
元本等		
元本	22,163,018	31,518,716
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,661,739	10,013,327
元本等合計	27,824,757	41,532,043
純資産合計	27,824,757	41,532,043
負債純資産合計	27,938,752	41,669,345

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2024年12月17日 至 2025年6月16日	第4期中間計算期間 自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
営業収益		
受取配当金	20,411	29,414
受取利息	222	993
有価証券売買等損益	13,438	1,567,316
為替差損益	85,611	61,146
営業収益合計	51,540	1,658,869
営業費用		
受託者報酬	2,909	4,910
委託者報酬	77,537	130,997
その他費用	6,834	15,856
営業費用合計	87,280	151,763
営業利益又は営業損失（ ）	138,820	1,507,106
経常利益又は経常損失（ ）	138,820	1,507,106
中間純利益又は中間純損失（ ）	138,820	1,507,106
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	111	19,770
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,756,664	5,661,739
剰余金増加額又は欠損金減少額	916,347	3,338,840
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	916,347	3,338,840
剰余金減少額又は欠損金増加額	104,773	474,588
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	104,773	474,588
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,429,529	10,013,327

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 市場価格のある有価証券については、原則として取引所における中間計算期間末日の最終相場（外貨建証券等の場合は中間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。中間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。 市場価格のない有価証券については、中間計算期間末日または知りうる直近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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。
3．費用・収益の計上基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

期別	第3期 2025年12月15日現在	第4期中間計算期間末 2026年6月15日現在
1．受益権の総数	22,163,018口	31,518,716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) 1.2555円 (12,555円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3177円 (13,177円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第3期中間計算期間 自 2024年12月17日 至 2025年6月16日	第4期中間計算期間 自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
1．その他費用	-	その他費用の内訳は、監査費用（1,395円）、カストディフィー（14,461円）となっております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2025年12月15日現在	第4期中間計算期間末 2026年6月15日現在
1．中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	（１）有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 （２）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15日	第4期中間計算期間 自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
期首元本額	12,682,863円	22,163,018円
期中追加設定元本額	10,758,907円	11,212,743円
期中一部解約元本額	1,278,752円	1,857,045円

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

【SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2025年12月15日現在	第4期中間計算期間末 2026年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	60,908	241,050
コール・ローン	397,739	490,350
投資信託受益証券	2,881,793	6,659,843
親投資信託受益証券	24,818,921	45,016,080
未収利息	3	8
流動資産合計	28,159,364	52,407,331
資産合計	28,159,364	52,407,331
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	4,006	5,285
未払委託者報酬	106,762	140,807
その他未払費用	1,102	1,498
流動負債合計	111,870	147,590
負債合計	111,870	147,590
純資産の部		
元本等		
元本	19,356,164	33,209,517
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	8,691,330	19,050,224
元本等合計	28,047,494	52,259,741
純資産合計	28,047,494	52,259,741
負債純資産合計	28,159,364	52,407,331

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2024年12月17日 至 2025年6月16日	第4期中間計算期間 自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
営業収益		
受取配当金	37,980	52,263
受取利息	172	1,078
有価証券売買等損益	22,785	2,693,785
為替差損益	159,918	102,623
営業収益合計	144,551	2,849,749
営業費用		
受託者報酬	3,081	5,285
委託者報酬	82,034	140,807
その他費用	9,320	12,042
営業費用合計	94,435	158,134
営業利益又は営業損失（ ）	238,986	2,691,615
経常利益又は経常損失（ ）	238,986	2,691,615
中間純利益又は中間純損失（ ）	238,986	2,691,615
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	4,519	17,082
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,561,302	8,691,330
剰余金増加額又は欠損金減少額	881,365	7,770,789
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	881,365	7,770,789
剰余金減少額又は欠損金増加額	78,087	86,428
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	78,087	86,428
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	4,130,113	19,050,224

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

期別	第3期 2025年12月15日現在	第4期中間計算期間末 2026年6月15日現在
1．受益権の総数	19,356,164口	33,209,517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 1.4490円 (1万口当たり純資産額) (14,490円)	1口当たり純資産額 1.5736円 (1万口当たり純資産額) (15,736円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2025年12月15日現在	第4期中間計算期間末 2026年6月15日現在
1．中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	第3期 自 2024年12月17日 至 2025年12月15日	第4期中間計算期間 自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
期首元本額	13,584,949円	19,356,164円
期中追加設定元本額	6,819,639円	14,044,054円
期中一部解約元本額	1,048,424円	190,701円

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（参考）
S O M P O世界分散ファンド（安定型）／（安定成長型）／（成長型）＜D C 年金＞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。

S J A Mラージキャップ・バリュース・マザーファンド

貸借対照表

	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,194,247,668	1,380,757,524
株式	113,146,466,540	104,664,938,160
未収配当金	13,628,700	626,442,450
未収利息	11,451	22,697
流動資産合計	114,354,354,359	106,672,160,831
資産合計	114,354,354,359	106,672,160,831
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	22,052,109,822	16,439,350,011
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	92,302,244,537	90,232,810,820
元本等合計	114,354,354,359	106,672,160,831
純資産合計	114,354,354,359	106,672,160,831
負債純資産合計	114,354,354,359	106,672,160,831

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。
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	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
1．受益権の総数	22,052,109,822口	16,439,350,011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 5.1856円 (1万口当たり純資産額) (51,856円)	1口当たり純資産額 6.4888円 (1万口当たり純資産額) (64,888円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 （２）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日	自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	17,447,030,740円	22,052,109,822円
同期中追加設定元本額	7,483,266,272円	408,443,095円
同期中一部解約元本額	2,878,187,190円	6,021,202,906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）	16,834,681,393円	11,662,508,304円
一任専用・国内株式ラージキャップ・バリュー運用ファンド（適格機関投資家専用）	68,662,817円	58,215,039円
ハッピーエイジング２０	1,896,028,981円	1,785,442,313円
ハッピーエイジング３０	1,492,327,780円	1,367,439,280円
ハッピーエイジング４０	1,082,579,360円	952,600,456円
ハッピーエイジング５０	260,788,420円	217,546,034円
ハッピーエイジング６０	47,787,893円	36,760,487円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド２０３５	143,202,761円	129,051,722円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド２０４５	113,970,980円	110,840,520円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド２０５５	82,801,043円	83,062,828円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド２０６５	28,565,750円	34,896,540円
S O M P O 世界分散ファンド（安定型）＜D C 年金＞	98,237円	106,353円
S O M P O 世界分散ファンド（安定成長型）＜D C 年金＞	234,300円	273,652円
S O M P O 世界分散ファンド（成長型）＜D C 年金＞	380,107円	606,483円
計	22,052,109,822円	16,439,350,011円

＊当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

S J A M スモールキャップ・マザーファンド

貸借対照表

	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		

	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
コール・ローン	57,298,395	535,987,881
株式	26,901,178,440	29,198,440,100
未収配当金	35,153,150	252,298,370
未収利息	549	8,810
流動資産合計	26,993,630,534	29,986,735,161
資産合計	26,993,630,534	29,986,735,161
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	3,964,683,597	3,642,662,243
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	23,028,946,937	26,344,072,918
元本等合計	26,993,630,534	29,986,735,161
純資産合計	26,993,630,534	29,986,735,161
負債純資産合計	26,993,630,534	29,986,735,161

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。
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	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
1．受益権の総数	3,964,683,597口	3,642,662,243口
2．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 6.8085円 (1万口当たり純資産額) (68,085円)	1口当たり純資産額 8.2321円 (1万口当たり純資産額) (82,321円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2．時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日	自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,368,469,670円	3,964,683,597円
同期中追加設定元本額	285,357,242円	171,150,796円
同期中一部解約元本額	689,143,315円	493,172,150円
元本の内訳＊		
ハッピーエイジング２０	1,452,041,717円	1,377,701,805円
ハッピーエイジング３０	1,141,630,906円	1,055,177,193円
ハッピーエイジング４０	844,450,264円	735,083,753円
ハッピーエイジング５０	204,220,606円	167,876,503円
ハッピーエイジング６０	37,682,692円	28,368,600円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド２０３５	110,652,805円	100,604,998円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド２０４５	87,551,675円	85,526,790円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド２０５５	63,962,788円	64,094,683円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド２０６５	21,947,601円	27,465,748円
S O M P O 世界分散ファンド（安定型）＜ＤＣ年金＞	75,116円	81,305円
S O M P O 世界分散ファンド（安定成長型）＜ＤＣ年金＞	178,311円	213,944円
S O M P O 世界分散ファンド（成長型）＜ＤＣ年金＞	289,116円	466,921円
計	3,964,683,597円	3,642,662,243円

＊当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

S O M P O 外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）マザーファンド

貸借対照表

	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	10,574,792	21,303,116
コール・ローン	75,228,175	112,767,376
株式	2,250,687,547	2,786,963,511
投資証券	19,261,944	22,265,103
未収配当金	2,544,083	3,099,609
未収利息	721	1,853
流動資産合計	2,358,297,262	2,946,400,568
資産合計	2,358,297,262	2,946,400,568
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	656,812,022	735,014,618
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,701,485,240	2,211,385,950
元本等合計	2,358,297,262	2,946,400,568
純資産合計	2,358,297,262	2,946,400,568
負債純資産合計	2,358,297,262	2,946,400,568

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

期別	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
1．受益権の総数	656,812,022口	735,014,618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 3.5905円 (1万口当たり純資産額) (35,905円)	1口当たり純資産額 4.0086円 (1万口当たり純資産額) (40,086円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2．時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日	自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	594,081,240円	656,812,022円
同期中追加設定元本額	182,138,289円	112,104,649円
同期中一部解約元本額	119,407,507円	33,902,053円
元本の内訳 *		

項目	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日	自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2035	151,265,910円	153,713,845円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2045	182,720,066円	199,903,210円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2055	232,483,440円	256,864,907円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2065	84,160,294円	115,283,301円
S O M P O世界分散ファンド（安定型）＜D C年金＞	837,949円	1,024,970円
S O M P O世界分散ファンド（安定成長型）＜D C年金＞	2,305,855円	3,044,860円
S O M P O世界分散ファンド（成長型）＜D C年金＞	3,038,508円	5,179,525円
計	656,812,022円	735,014,618円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

損保ジャパン日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	326,339	391,824
コール・ローン	514,560,023	375,842,216
国債証券	27,087,213,400	29,964,649,500
地方債証券	-	915,549,768
特殊債券	41,116,824	400,155,423
社債券	7,730,858,000	7,061,271,000
未収入金	1,453,326,500	2,573,336,000
未収利息	104,746,671	112,518,334
前払費用	34,970,127	49,228,938
流動資産合計	36,967,117,884	41,452,943,003
資産合計	36,967,117,884	41,452,943,003
負債の部		
流動負債		
未払金	1,614,087,500	2,573,947,200
流動負債合計	1,614,087,500	2,573,947,200
負債合計	1,614,087,500	2,573,947,200
純資産の部		
元本等		
元本	27,432,802,580	30,857,092,094
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,920,227,804	8,021,903,709
元本等合計	35,353,030,384	38,878,995,803
純資産合計	35,353,030,384	38,878,995,803
負債純資産合計	36,967,117,884	41,452,943,003

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、地方債証券、特殊債券及び社債券

2. 費用・収益の計上基準	個別法に基づき、以下のとおり、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 ただし、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 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	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
1. 受益権の総数	27,432,802,580口	30,857,092,094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 1.2887円 (1万口当たり純資産額) (12,887円)	1口当たり純資産額 1.2600円 (1万口当たり純資産額) (12,600円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日	自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	24,466,336,326円	27,432,802,580円
同期中追加設定元本額	6,975,676,383円	4,373,822,407円
同期中一部解約元本額	4,009,210,129円	949,532,893円
元本の内訳*		
S O M P Oターゲット・リターン戦略ファンド（2%コース）（F o F s用）（適格機関投資家専用）	13,322,664円	12,430,444円
S O M P Oターゲット・リターン戦略ファンド（4%コース）（F o F s用）（適格機関投資家専用）	25,310,400円	28,153,270円
損保ジャパン国内債券ファンド（適格機関投資家専用）	1,134,475,605円	1,168,218,791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）	301,137,475円	281,940,074円
損保ジャパン日本債券ファンド	951,517,352円	968,929,874円
ハッピーエイジング20	557,404,986円	688,779,355円
ハッピーエイジング30	2,073,969,097円	2,493,753,554円
ハッピーエイジング40	8,808,459,985円	10,171,072,772円
ハッピーエイジング50	5,979,872,362円	6,545,905,327円
ハッピーエイジング60	3,287,283,752円	3,318,387,540円
好配当グローバルR E I Tプレミアム・ファンド 通貨セレクトコース	97,401,732円	104,545,007円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2035	2,574,354,745円	3,014,583,680円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2045	1,108,115,145円	1,388,872,788円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2055	481,082,219円	610,493,000円
S O M P Oターゲットイヤー・ファンド2065	34,229,800円	52,743,126円

項目	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日	自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
S O M P O 世界分散ファンド（安定型）＜D C 年金＞	2,917,744円	4,085,254円
S O M P O 世界分散ファンド（安定成長型）＜D C 年金＞	1,091,111円	2,476,318円
S O M P O 世界分散ファンド（成長型）＜D C 年金＞	856,406円	1,721,920円
計	27,432,802,580円	30,857,092,094円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

損保ジャパン外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	48,731,586	18,186,121
コール・ローン	10,121,297	109,079,951
国債証券	1,964,354,092	1,371,799,999
派生商品評価勘定	104,345	670,364
未収利息	12,971,632	8,289,442
前払費用	3,193,194	3,149,264
流動資産合計	2,039,476,146	1,511,175,141
資産合計	2,039,476,146	1,511,175,141
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,264,581	5,128,074
未払金	28,715,183	-
流動負債合計	45,979,764	5,128,074
負債合計	45,979,764	5,128,074
純資産の部		
元本等		
元本	1,434,982,766	1,088,446,377
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	558,513,616	417,600,690
元本等合計	1,993,496,382	1,506,047,067
純資産合計	1,993,496,382	1,506,047,067
負債純資産合計	2,039,476,146	1,511,175,141

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 個別法に基づき、以下のとおり、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 ただし、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法による時価法によっております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3．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。

4. 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。
5. 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。

(貸借対照表に関する注記)

期別	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
1. 受益権の総数	1,434,982,766口	1,088,446,377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) 1.3892円 (13,892円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3837円 (13,837円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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

(その他の注記)

項目	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日	自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,228,080,925円	1,434,982,766円
同期中追加設定元本額	1,445,565,665円	335,112,673円
同期中一部解約元本額	1,238,663,824円	681,649,062円
元本の内訳*		
S O M P Oターゲット・リターン戦略ファンド（2%コース）（F o F s用）（適格機関投資家専用）	31,338,813円	12,777,228円
S O M P Oターゲット・リターン戦略ファンド（4%コース）（F o F s用）（適格機関投資家専用）	51,664,140円	31,960,749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）	595,419,275円	319,328,898円
損保ジャパン外国債券ファンド	745,052,065円	705,874,340円
S O M P O世界分散ファンド（安定型）＜D C年金＞	4,290,080円	5,940,959円
S O M P O世界分散ファンド（安定成長型）＜D C年金＞	5,887,724円	9,591,088円
S O M P O世界分散ファンド（成長型）＜D C年金＞	1,330,669円	2,973,115円
計	1,434,982,766円	1,088,446,377円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

種類	2025年12月15日 現在				2026年6月15日 現在			
	契約額等 （円）	うち1年 超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち1年 超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引 為替予約取引								
売建	1,969,186,060	-	1,986,346,296	17,160,236	1,382,644,039	-	1,387,101,749	4,457,710
ドル	939,695,127	-	943,696,248	4,001,121	587,874,758	-	591,101,129	3,226,371
カナダドル	33,740,656	-	34,395,441	654,785	35,291,683	-	35,063,713	227,970
メキシコペソ	16,610,055	-	16,969,186	359,131	17,884,998	-	18,166,154	281,156
ユーロ	591,366,112	-	600,051,342	8,685,230	359,851,716	-	359,792,219	59,497
債券	105,346,870	-	106,907,528	1,560,658	79,447,869	-	79,783,290	335,421
スウェーデンクローナ	2,890,826	-	2,959,352	68,526	3,120,029	-	3,090,629	29,400
ノルウェークローネ	3,563,571	-	3,583,842	20,271	4,007,180	-	3,924,488	82,692
デンマーククローネ	5,667,988	-	5,754,398	86,410	5,890,303	-	5,888,336	1,967
ポーランドズロチ	10,592,250	-	10,799,675	207,425	10,074,851	-	10,052,725	22,126
オーストラリアドル	23,415,777	-	23,901,570	485,793	25,675,312	-	25,428,600	246,712
シンガポールドル	21,807,968	-	21,960,993	153,025	22,961,139	-	22,995,584	34,445
オフショア人民元	214,488,860	-	215,366,721	877,861	230,564,201	-	231,814,882	1,250,681
合計	1,969,186,060	-	1,986,346,296	17,160,236	1,382,644,039	-	1,387,101,749	4,457,710

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

- ３．換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	470,579,450	285,750,855
コール・ローン	55,797,873	108,902,349
国債証券	18,884,074,235	21,311,250,535
未収利息	127,731,576	120,554,374
前払費用	42,019,509	77,378,473
流動資産合計	19,580,202,643	21,903,836,586
資産合計	19,580,202,643	21,903,836,586
負債の部		
流動負債		
未払金	375,506,244	-

	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
流動負債合計	375,506,244	-
負債合計	375,506,244	-
純資産の部		
元本等		
元本	8,572,316,846	9,464,889,500
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	10,632,379,553	12,438,947,086
元本等合計	19,204,696,399	21,903,836,586
純資産合計	19,204,696,399	21,903,836,586
負債純資産合計	19,580,202,643	21,903,836,586

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

（貸借対照表に関する注記）

期別	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
1．受益権の総数	8,572,316,846口	9,464,889,500口
2．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.2403円 （1万口当たり純資産額）（22,403円）	1口当たり純資産額 2.3142円 （1万口当たり純資産額）（23,142円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2．時価の算定方法	（1）有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 （2）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日	自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	7,940,466,773円	8,572,316,846円
同期中追加設定元本額	1,129,193,985円	1,296,019,520円
同期中一部解約元本額	497,343,912円	403,446,866円
元本の内訳＊		
ハッピーエイジング２０	963,408,144円	1,123,626,045円
ハッピーエイジング３０	2,987,144,683円	3,390,142,129円
ハッピーエイジング４０	2,306,679,496円	2,514,068,216円
ハッピーエイジング５０	664,836,886円	686,959,873円
ハッピーエイジング６０	420,850,475円	401,019,377円
損保ジャパン外国債券ファンド（為替ヘッジなし）	485,960,548円	504,046,694円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド２０３５	615,348,212円	684,567,464円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド２０４５	76,732,927円	92,430,784円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド２０５５	38,742,407円	48,133,166円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド２０６５	10,922,313円	16,756,615円
S O M P O 世界分散ファンド（安定型）＜ＤＣ年金＞	218,490円	288,739円
S O M P O 世界分散ファンド（安定成長型）＜ＤＣ年金＞	468,487円	758,022円
S O M P O 世界分散ファンド（成長型）＜ＤＣ年金＞	1,003,778円	2,092,376円
計	8,572,316,846円	9,464,889,500円

＊当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

損保ジャパンＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

貸借対照表

	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	88,044,988	49,956,904
投資証券	11,394,746,400	10,685,801,700
未収配当金	81,086,243	77,418,884
未収利息	844	821
流動資産合計	11,563,878,475	10,813,178,309
資産合計	11,563,878,475	10,813,178,309
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	3,171,551,454	3,181,726,966
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,392,327,021	7,631,451,343
元本等合計	11,563,878,475	10,813,178,309
純資産合計	11,563,878,475	10,813,178,309
負債純資産合計	11,563,878,475	10,813,178,309

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	投資証券 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。
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	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
1．受益権の総数	3,171,551,454口	3,181,726,966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 3.6461円 (1万口当たり純資産額) (36,461円)	1口当たり純資産額 3.3985円 (1万口当たり純資産額) (33,985円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年12月15日現在	2026年6月15日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2．時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	自 2024年12月17日 至 2025年12月15日	自 2025年12月16日 至 2026年6月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	280,988,956円	3,171,551,454円
同期中追加設定元本額	2,949,728,651円	34,083,244円
同期中一部解約元本額	59,166,153円	23,907,732円
元本の内訳*		
J - R E I T運用ファンド2025 - 07（適格機関投資家専用）	1,505,109,917円	1,503,973,405円
J - R E I T運用ファンド2025 - 08（適格機関投資家専用）	1,440,976,124円	1,439,466,908円
損保ジャパン・グローバルREITファンド（毎月分配型）	222,518,922円	235,059,969円
S O M P O世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞	393,055円	502,989円
S O M P O世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞	1,245,558円	1,149,866円
S O M P O世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞	1,307,878円	1,573,829円
計	3,171,551,454円	3,181,726,966円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

S O M P O 世界分散ファンド（安定型）＜D C 年金＞

2026年6月30日現在

資産総額	22,919,232円
負債総額	8,540円
純資産総額（ - ）	22,910,692円
発行済数量	20,103,629口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.1396円

S O M P O 世界分散ファンド（安定成長型）＜D C 年金＞

2026年6月30日現在

資産総額	42,646,867円
負債総額	15,740円
純資産総額（ - ）	42,631,127円
発行済数量	32,193,826口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.3242円

S O M P O 世界分散ファンド（成長型）＜D C 年金＞

2026年6月30日現在

資産総額	53,285,746円
負債総額	19,794円
純資産総額（ - ）	53,265,952円
発行済数量	33,654,209口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.5827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

2026年6月30日現在

資産総額	106,779,225,594円
負債総額	1,049,037,390円
純資産総額（ - ）	105,730,188,204円
発行済数量	16,464,983,659口
1単位当りの純資産額（ / ）	6.4215円

（参考）S J A M スモールキャップ・マザーファンド

2026年6月30日現在

資産総額	30,735,597,698円
負債総額	780,876,636円
純資産総額（ - ）	29,954,721,062円
発行済数量	3,658,183,993口
1単位当りの純資産額（ / ）	8.1884円

（参考）S O M P O外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）マザーファンド

2026年6月30日現在

資産総額	3,021,189,556円
負債総額	—円
純資産総額（ - ）	3,021,189,556円
発行済数量	748,074,391口
1単位当りの純資産額（ / ）	4.0386円

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2026年6月30日現在

資産総額	38,932,903,605円
負債総額	—円
純資産総額（ - ）	38,932,903,605円
発行済数量	31,085,854,581口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.2524円

（参考）損保ジャパン外国債券マザーファンド

2026年6月30日現在

資産総額	1,533,771,315円
負債総額	16,350,088円
純資産総額（ - ）	1,517,421,227円
発行済数量	1,090,595,295口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.3914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

2026年6月30日現在

資産総額	22,128,258,844円
負債総額	—円
純資産総額（ - ）	22,128,258,844円
発行済数量	9,432,982,162口
1単位当りの純資産額（ / ）	2.3458円

（参考）損保ジャパンJ - R E I Tマザーファンド

2026年6月30日現在

資産総額	10,865,128,664円
負債総額	—円
純資産総額（ - ）	10,865,128,664円
発行済数量	3,181,344,107口
1単位当りの純資産額（ / ）	3.4153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てします。）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（2026年6月末現在）

資本金の額	1,550百万円
会社が発行する株式の総数	50,000株
発行済株式総数	24,085株
最近5年間に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（2026年6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。

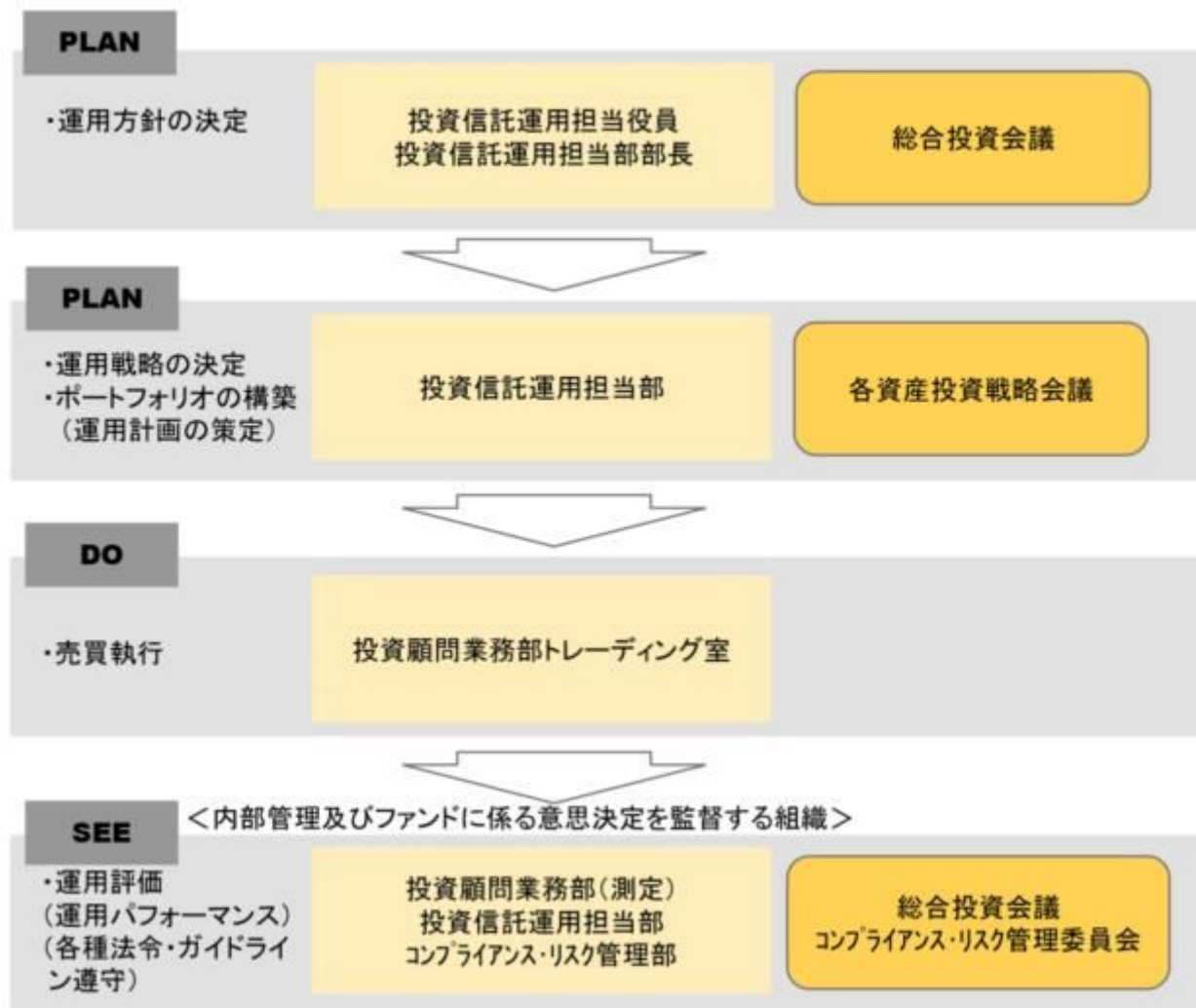
取締役会の決議によって、代表取締役を選定します。また、取締役会長、取締役社長各1名を選定することができます。

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2026年6月末現在、計288本（追加型株式投資信託176本、単位型株式投資信託82本、単位型公社債投資信託30本）であり、その純資産総額の合計は2,032,826百万円です。

3【委託会社等の経理状況】

- 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）、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。
- 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(2025年4月1日から2026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 (2025年3月31日)	当事業年度 (2026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			4,269,903	4,762,020
2 前払費用			104,386	103,724
3 未収委託者報酬			1,826,714	2,232,967
4 未収運用受託報酬			1,177,062	3,399,152
5 その他			170,005	5,918
流動資産合計			7,548,072	10,503,783
固定資産				
1 有形固定資産				
（1）建物	1		3,997	5,163
（2）器具備品	1		86,858	137,462
有形固定資産合計			90,856	142,625
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			880,236	1,210,218
（2）長期差入保証金			173,961	173,961
（3）繰延税金資産			423,116	477,685
（4）その他			30	30
投資その他の資産合計			1,477,345	1,861,894
固定資産合計			1,572,736	2,009,055
資産合計			9,120,808	12,512,839

		前事業年度 (2025年3月31日)		当事業年度 (2026年3月31日)	
区分	注記 番号	金額（千円）		金額（千円）	
（負債の部）					
流動負債					
1 預り金			9,211		7,307
2 未払金					
（1）未払手数料		628,983		737,903	
（2）その他未払金	2	323,996	952,980	290,746	1,028,649
3 未払費用			1,011,693		3,046,167
4 未払消費税等			-		413,209
5 未払法人税等			355,431		762,276
6 賞与引当金			199,137		209,649
7 役員賞与引当金			5,700		13,668
流動負債合計			2,534,153		5,480,929
固定負債					
1 退職給付引当金			278,036		304,363
2 資産除去債務			9,699		9,721
固定負債合計			287,735		314,085
負債合計			2,821,888		5,795,014
（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			4,249,144		4,587,617
利益剰余金合計			4,249,144		4,587,617
株主資本合計			6,212,424		6,550,897
評価・換算差額等					
1 その他有価証券評価差額金			86,495		166,927
評価・換算差額等合計			86,495		166,927
純資産合計			6,298,919		6,717,824
負債・純資産合計			9,120,808		12,512,839

（２）【損益計算書】

		前事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)		当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)	
区分	注記 番号	金額（千円）		金額（千円）	
営業収益					

1	委託者報酬		9,303,999		10,038,987	
2	運用受託報酬		3,676,517	12,980,517	6,333,370	16,372,358
	営業費用					
1	支払手数料		3,656,749		3,657,391	
2	広告宣伝費		29,623		37,005	
3	公告費		470		200	
4	調査費		3,823,073		5,808,354	
(1)	調査費		1,574,634		1,564,427	
(2)	委託調査費		2,245,446		4,241,018	
(3)	図書費		2,992		2,908	
5	営業雑経費		151,565		152,928	
(1)	通信費		18,200		17,454	
(2)	印刷費		111,241		115,449	
(3)	諸会費		22,123	7,661,482	20,024	9,655,879
	一般管理費					
1	給料		1,871,844		1,945,461	
(1)	役員報酬		58,922		60,792	
(2)	給料・手当		1,554,708		1,605,828	
(3)	賞与		258,213		278,840	
2	福利厚生費		265,624		285,970	
3	交際費		16,599		16,889	
4	寄付金		3,330		2,000	
5	旅費交通費		34,315		40,756	
6	法人事業税		60,847		76,651	
7	租税公課		22,682		17,593	
8	不動産賃借料		219,845		218,486	
9	退職給付費用		99,690		106,714	
10	賞与引当金繰入		199,137		209,649	
11	役員賞与引当金繰入		5,700		13,668	
12	固定資産減価償却費		22,258		25,472	
13	諸経費		535,615	3,357,490	589,602	3,548,917
	営業利益			1,961,544		3,167,561
	営業外収益					
1	受取配当金		5,008		12,943	
2	受取利息		0		2	
3	有価証券売却益		-		11,556	
4	有価証券償還益		18,714		1,036	
5	為替差益		-		4,812	
6	保険配当金		927		1,871	
7	雑益		966	25,617	1,721	33,944
	営業外費用					
1	有価証券売却損		301		-	
2	為替差損		3,541		-	
3	事務過誤費		13,117		1,313	
4	雑損		58	17,017	9	1,323
	経常利益			1,970,144		3,200,182
	特別損失					
1	有価証券評価損		3,789		-	
2	固定資産除却損	1	-	3,789	217	217
	税引前当期純利益			1,966,355		3,199,964
	法人税・住民税及び事業税			672,903		1,053,081
	法人税等調整額			80,362		91,590
	当期純利益			1,373,813		2,238,472

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2024年4月1日 至 2025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	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	2,875,330	2,875,330	4,838,610
当期変動額						
剰余金の配当						
当期純利益				1,373,813	1,373,813	1,373,813
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						

当期変動額 合計	-	-	-	1,373,813	1,373,813	1,373,813
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	4,249,144	4,249,144	6,212,424

	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	92,755	92,755	4,931,365
当期変動額			
剰余金の配 当			
当期純利益			1,373,813
株主資本以 外の項目の 当期変動額 （純額）	6,259	6,259	6,259
当期変動額 合計	6,259	6,259	1,367,554
当期末残高	86,495	86,495	6,298,919

当事業年度（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

（単位：千円）

当事業年度（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計
		資本 準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	4,249,144	4,249,144	6,212,424
当期変動額						
剰余金の配当				1,900,000	1,900,000	1,900,000
当期純利益				2,238,472	2,238,472	2,238,472
株主資本以 外の項目の 当期変動額 （純額）						
当期変動額 合計	-	-	-	338,472	338,472	338,472
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	4,587,617	4,587,617	6,550,897

	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	86,495	86,495	6,298,919
当期変動額			
剰余金の配 当			1,900,000
当期純利益			2,238,472
株主資本以 外の項目の 当期変動額 （純額）	80,431	80,431	80,431
当期変動額 合計	80,431	80,431	418,904
当期末残高	166,927	166,927	6,717,824

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。

未適用の会計基準等

・「リースに関する会計基準」（企業会計基準第34号 2024年9月13日）

・「リースに関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日）

(1) 概要

国際的な会計基準と同様に、借手のすべてのリース取引について資産・負債を計上する等の取扱いが定められました。

(2) 適用予定日

2028年3月期の期首から適用します。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「リースに関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

・「後発事象に関する会計基準」（企業会計基準第41号 2026年1月9日）

・「後発事象に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第35号 2026年1月9日）

(1) 概要

「後発事象に関する会計基準」等は、後発事象の定義、会計処理及び開示等を取り扱う包括的な会計基準を設定することを優先的な課題とし、日本公認会計士協会 監査・保証基準委員会 監査基準報告書560実務指針第1号「後発事象に関する監査上の取扱い」で示されている会計に関する内容を原則として踏襲して企業会計基準委員会に移管することを基本的な方針として、表現の見直し及び後発事象の評価期間の整理を行うとともに、財務諸表の公表の承認に関する注記を新たに求める等、後発事象に関する会計処理及び開示について定められました。

(2) 適用予定日

2028年3月期の期首から適用します。

注記事項

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額は、次のとおりであります。

(単位：千円)

	前事業年度 (2025年3月31日)	当事業年度 (2026年3月31日)
建物	109,313	109,948
器具備品	198,439	216,433

2 関係会社項目

該当事項はありません。

(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 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
器具備品	-	217

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2024年4月1日 至 2025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

該当事項はありません。

(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

(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
2025年5月29日 取締役会	普通 株式	1,900,000千円	78,887円	2025年3月31日	2025年5月30日

当事業年度（自 2025年4月1日 至 2026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
2025年5月29日 取締役会	普通 株式	1,900,000千円	78,887円	2025年3月31日	2025年5月30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

(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
2026年5月28日 取締役会	普通 株式	2,100,000千円	87,191円	2026年3月31日	2026年5月29日

(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（2025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 ）	879,486	879,486	-
資産計	879,486	879,486	-

当事業年度（2026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 ）	1,209,468	1,209,468	-
資産計	1,209,468	1,209,468	-

(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 (2025年3月31日)	当事業年度 (2026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（2025年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
(1) 預金	4,269,903	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,826,714	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	1,177,062	-	-	-
(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	5,797	348,002	267,217	258,470
合計	7,279,477	348,002	267,217	258,470

当事業年度（2026年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
(1) 預金	4,762,020	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	2,232,967	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	3,399,152	-	-	-
(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	9,981	726,699	64,215	408,573
合計	10,404,121	726,699	64,215	408,573

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（2025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	-	429,524	449,962	879,486
資産計	-	429,524	449,962	879,486

当事業年度（2026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	-	653,297	556,171	1,209,468

資産計	-	653,297	556,171	1,209,468
-----	---	---------	---------	-----------

注１．時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

非上場投資信託は、委託会社から提示された基準価額によっており、レベル２又はレベル３の時価に分類しております。

注２．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。

（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 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

（単位：千円）

	投資有価証券	合計
期首残高	257,147	257,147
当事業年度の損益又は評価・換算差額等		
損益の計上	301	301
その他有価証券評価差額金	2,815	2,815
購入、売却、発行及び決済		
購入	200,000	200,000
売却	9,699	9,699
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	449,962	449,962
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 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

（単位：千円）

	投資有価証券	合計
期首残高	449,962	449,962
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	106,208	106,208
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	556,171	556,171
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	-	-

（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（2025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	545,788	401,000	144,788
	小計	545,788	401,000	144,788
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	333,698	352,179	18,481
	小計	333,698	352,179	18,481
合計		879,486	753,179	126,307

当事業年度（2026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	717,391	459,740	257,651
	小計	717,391	459,740	257,651
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	492,077	505,968	13,891
	小計	492,077	505,968	13,891
合計		1,209,468	965,708	243,760

５．売却したその他有価証券

前事業年度（自 2024年4月1日 至 2025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	9,699	-	301
合計	9,699	-	301

当事業年度（自 2025年4月1日 至 2026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	101,556	11,556	-
合計	101,556	11,556	-

（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 2024年4月1日 至 2025年3月31日）	当事業年度 （自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）
退職給付引当金の期首残高	257,375	278,036
退職給付費用	49,146	51,180
退職給付の支払額	28,485	24,852
退職給付引当金の期末残高	278,036	304,363

（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 （2025年3月31日）	当事業年度 （2026年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	278,036	304,363
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	278,036	304,363
退職給付引当金	278,036	304,363
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	278,036	304,363

（３）退職給付費用

（単位：千円）

	前事業年度 （自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）	当事業年度 （自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）
簡便法で計算した退職給付費用	49,146	51,180

３．確定拠出制度

（単位：千円）

	前事業年度 （自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）	当事業年度 （自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）
当社の確定拠出制度への要拠出額	43,907	46,390

（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 （2025年3月31日）	当事業年度 （2026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	189,581	224,930
繰延資産損金算入限度超過額	94,289	116,254
退職給付引当金	87,514	95,935
賞与引当金	60,975	66,081
未払事業税	21,580	41,919
未払金否認	9,142	9,376
その他	8,596	7,574
繰延税金資産 小計	471,677	562,069
将来減算一時差異等の合計に係る評価性引当額	5,522	4,334
評価性引当額 小計	5,522	4,334
繰延税金資産 合計	466,155	557,735

繰延税金負債		
其他有価証券評価差額金	39,812	76,833
株式譲渡損益	3,120	3,120
固定資産除去価額	107	97
繰延税金負債 合計	43,039	80,050
繰延税金資産の純額	423,116	477,685

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

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 2024年4月1日 至 2025年3月31日）	当事業年度 （自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）
期首残高	9,582	9,699
取得	-	-
時の経過による調整額	116	22
期末残高	9,699	9,721

（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 2024年4月1日 至 2025年3月31日）	当事業年度 （自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）
投資信託事業（基本報酬）	9,178,614	9,261,563
投資信託事業（成功報酬）	125,385	777,423
投資顧問事業（基本報酬）	3,192,013	3,286,355
投資顧問事業（成功報酬）	484,504	3,047,015
合計	12,980,517	16,372,358

（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 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%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 2025年4月1日 至 2026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	2,845,501

(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
該当事項はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
該当事項はありません。

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

前事業年度（自 2024年4月1日 至 2025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）	1,002,331	未払手数料	247,773
同一の親会社を持つ会社	S O M P O リスクマネジメント株式会社	東京都新宿区	0	リスクコンサルティング業	-	投資信託等に係る委託調査	投資信託等委託調査費の支払（注2）	197,617	未払費用	193,125

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) 委託調査費の支払いについては、一般的取引条件によっております。

当事業年度（自 2025年4月1日 至 2026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D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)	1,148,467	未払手数料	314,249
同一の親会社を持つ会社	SOMPOリスクマネジメント株式会社	東京都新宿区	0	リスクコンサルティング業	-	投資信託等に係る委託調査	投資信託等委託調査費の支払(注2)	202,016	未払費用	213,508

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) 委託調査費の支払いについては、一般的取引条件によっております。

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

2.親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1)親会社情報

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 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
1株当たり純資産額(円)	261,528.74	278,921.49
1株当たり当期純利益金額(円)	57,040.22	92,940.54

(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 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
当期純利益(千円)	1,373,813	2,238,472
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)	1,373,813	2,238,472
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（2026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（2026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、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

資本金の額は、2026年3月末現在

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【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。

第3【その他】

- 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、ファンドの概略的性格を表示する文言等を記載することがあります。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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

SOMPO世界分散ファンド<DC年金>は、長期的な視点から、国内外の株式、債券、リートに分散投資を行う、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、投資配分比率が異なる3つのファンド（安定型）／（安定成長型）／（成長型）をご用意しています。

各ファンドにおける資産別の投資配分比率は、市場環境に合わせて、原則四半期毎に見直します。

SOMPOアセットマネジメント

独立監査人の監査報告書

2026年6月11日

S O M P O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 大 場 康 生
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているS O M P Oアセットマネジメント株式会社の2025年4月1日から2026年3月31日までの第41期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、S O M P Oアセットマネジメント株式会社の2026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するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用し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．XBRL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

2026年2月16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
業務執行社員

公認会計士 森 重 俊 寛

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 徳 山 勇 樹

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SOMPO世界分散ファンド（安定型）<DC年金>の2024年12月17日から2025年12月15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、SOMPO世界分散ファンド（安定型）<DC年金>の2025年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

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

S O M P O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

2026年2月16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
業務執行社員

公認会計士 森 重 俊 寛

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 徳 山 勇 樹

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SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）<DC年金>の2024年12月17日から2025年12月15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、SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）<DC年金>の2025年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

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

S O M P O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

2026年2月16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
業務執行社員

公認会計士 森 重 俊 寛

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 徳 山 勇 樹

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SOMPO世界分散ファンド（成長型）<DC年金>の2024年12月17日から2025年12月15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、SOMPO世界分散ファンド（成長型）<DC年金>の2025年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

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

S O M P O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。

独立監査人の中間監査報告書

2026年8月20日

S O M P O 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
業務執行社員

公認会計士 森 重 俊 寛

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 徳 山 勇 樹

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているS O M P O 世界分散ファンド（安定型）<DC年金>の2025年12月16日から2026年6月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、S O M P O 世界分散ファンド（安定型）<DC年金>の2026年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年12月16日から2026年6月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、S O M P O アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性

及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

S O M P O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．上記の中間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。

独立監査人の中間監査報告書

2026年8月20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
業務執行社員

公認会計士 森 重 俊 寛

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 徳 山 勇 樹

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞の2025年12月16日から2026年6月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞の2026年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年12月16日から2026年6月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、SOMPOアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性

及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

S O M P O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．上記の中間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。

独立監査人の中間監査報告書

2026年8月20日

S O M P O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
業務執行社員

公認会計士 森 重 俊 寛

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 徳 山 勇 樹

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているS O M P O世界分散ファンド（成長型）<DC年金>の2025年12月16日から2026年6月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、S O M P O世界分散ファンド（成長型）<DC年金>の2026年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年12月16日から2026年6月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、S O M P Oアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性

及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

S O M P O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．上記の中間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。