

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	平成30年2月1日提出
<b>【発行者名】</b>	損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 山口 裕之
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都中央区日本橋二丁目2番16号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	須田 静
<b>【電話番号】</b>	03-5290-3469
<b>【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】</b>	SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055 SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045 SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035 （上記を総称して「SOMPOターゲットイヤー・ファンド」ということがあります。）
<b>【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】</b>	募集額 各5,000億円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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】

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

（以下、上記を総称して「SOMPOターゲットイヤー・ファンド」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。）

ただし、愛称としてそれぞれ「ハッピーボヤージュ2055」、「ハッピーボヤージュ2045」、「ハッピーボヤージュ2035」という名称を用いることがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権です。

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。）。委託会社である損保ジャパン日本興亜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5,000億円を上限とします。

上記金額には申込手数料および申込手数料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。）は含まれていません。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日<sup>1</sup>の翌営業日の基準価額<sup>2</sup>とします。

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

1 日本における委託会社及び販売会社（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、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、ユーロネクスト・パリのいずれかの休業日、あるいはニューヨーク、ロンドンまたはシンガポールの銀行の休業日には取得のお申込みを受け付けないものとします。

2 基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（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

損保ジャパン日本興亜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 <http://www.sjnk-am.co.jp/>

#### （５）【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.16%（税抜2.0%）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額です。

申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

分配金を受け取る一般コースと分配金を再投資する自動けいぞく投資コースがあります。自動けいぞく投資とは、収益分配の際に税引き後の収益分配金を、無手数料で自動的に再投資する方法です。販売会社によっては、どちらか一方のみのお取扱いとなる場合があります。各コースのお取扱いにつきましては、販売会社までお問い合わせください。

#### （６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位等の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

#### （７）【申込期間】

継続申込期間 平成30年2月2日から平成31年2月1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

損保ジャパン日本興亜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 <http://www.sjnk-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「(11)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「(11)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、「損保ジャパン日本債券マザーファンド」、「S J A M ラージキャップ・バリュー・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」、「損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)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(リスク抑制型)マザーファンド」および「SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド」(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。)の受益証券およびエマージング株式またはエマージング株式を主要投資対象とする証券投資信託を主要投資対象として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うことを基本とします。

委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンドについて金5,000億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。

一般社団法人投資信託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 ( )
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		
	(毎月)	オセアニア		
債券	年12回	中南米		
一般	(毎月)	アフリカ		
公債	日々	中近東		
社債	その他	(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)))				
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。

## &lt; 属性区分の定義 &gt;

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

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

## <ファンドの特色>

### ● ファンドの目的

国内外の株式や債券を実質的な主要投資対象とし、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。

### ● ファンドの特色

① ターゲットイヤーが異なる、「SOMP Oターゲットイヤー・ファンド 2055」、「SOMP Oターゲットイヤー・ファンド 2045」、「SOMP Oターゲットイヤー・ファンド 2035」をご用意しています。

● ターゲットイヤー・ファンドとは、決められたターゲットイヤーに向かって、徐々にリスクを低減する方向で資産配分を変更していくバランスファンドです。

※ターゲットイヤー後は、安定運用を継続します。

● 各ファンドのターゲットイヤー

SOMP Oターゲットイヤー・ファンド 2055	2055年
SOMP Oターゲットイヤー・ファンド 2045	2045年
SOMP Oターゲットイヤー・ファンド 2035	2035年

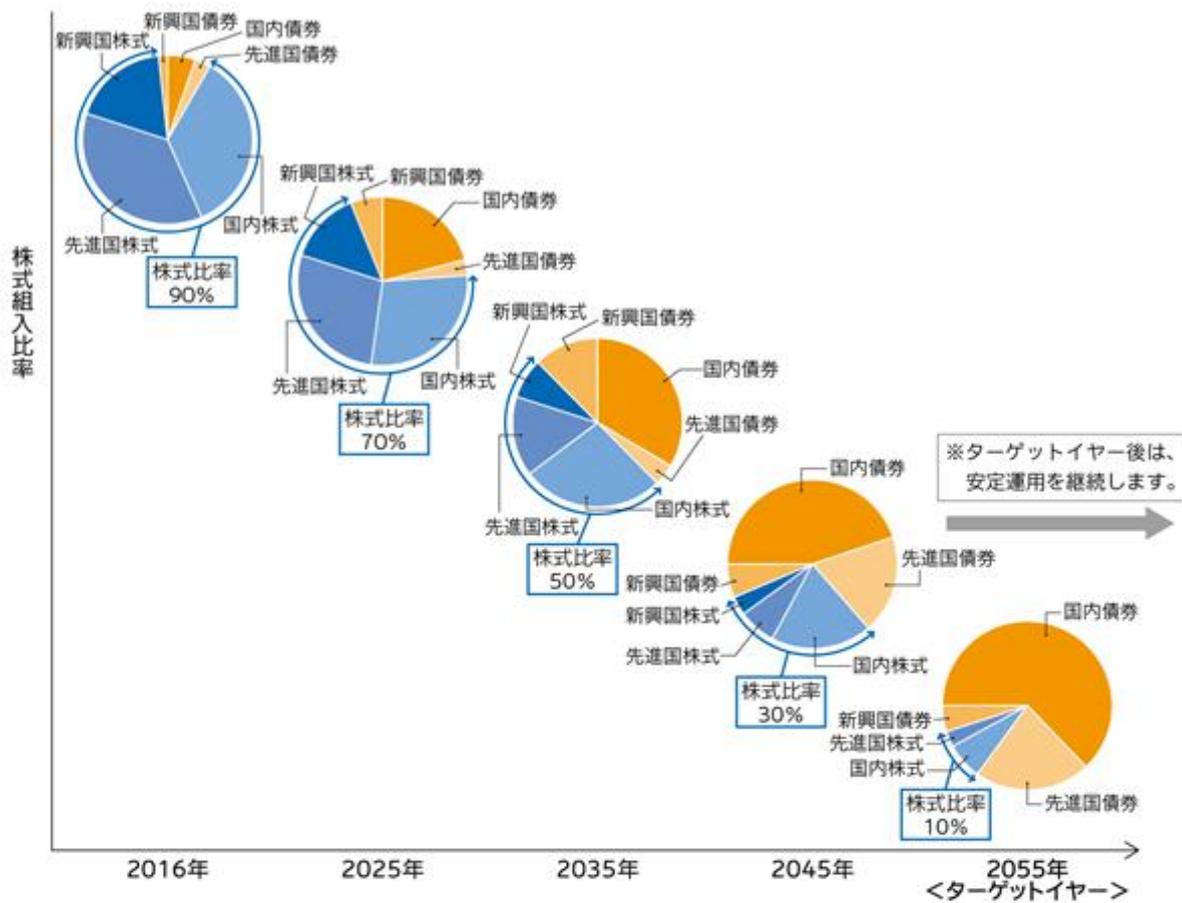
② 設定後は、ターゲットイヤーに向けて徐々に株式の投資割合を減少させ、債券の投資割合を増加させることにより、リスクを低減していきます。

● 投資割合の変更によるリスクの低減は、年1回行うことを基本とします。

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

## 運用期間中の資産配分比率のイメージ

実際には1年ごとに資産配分比率を変えていきます。



	2016年	→	2025年	→	2035年	→	2045年	→	2055年
国内債券	5%	→	21%	→	34%	→	45%	→	63%
先進国債券	3%	→	3%	→	4%	→	19%	→	22%
国内株式	35%	→	28%	→	27%	→	19%	→	7%
先進国株式	37%	→	28%	→	15%	→	7%	→	3%
新興国株式	18%	→	14%	→	8%	→	4%	→	0%
新興国債券	2%	→	6%	→	12%	→	6%	→	5%
<b>株式組入比率</b>	<b>90%</b>	→	<b>70%</b>	→	<b>50%</b>	→	<b>30%</b>	→	<b>10%</b>

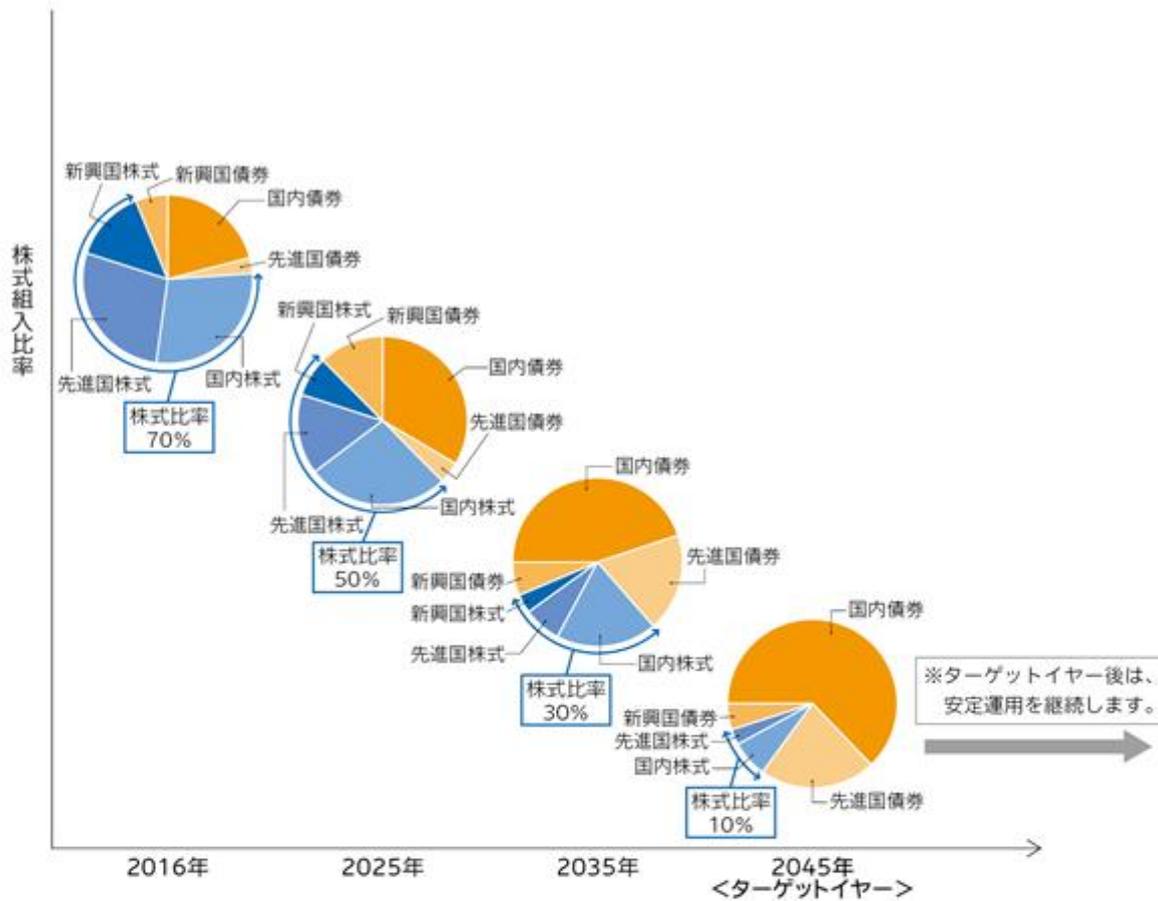
・市況動向やファンドの購入・換金の状況等により、上記の基準資産配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、ポートフォリオの修正(リバランス)を行います。

・上記は、当初設定時に計画している基準資産配分比率の推移であり、市場環境の大きな変化やファンドの購入・換金の状況等によって、基準資産配分比率を変更する場合があります。

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

## 運用期間中の資産配分比率のイメージ

実際には1年ごとに資産配分比率を変えていきます。



	2016年	→	2025年	→	2035年	→	2045年
国内債券	21%	→	34%	→	45%	→	63%
先進国債券	3%	→	4%	→	19%	→	22%
国内株式	28%	→	27%	→	19%	→	7%
先進国株式	28%	→	15%	→	7%	→	3%
新興国株式	14%	→	8%	→	4%	→	0%
新興国債券	6%	→	12%	→	6%	→	5%
株式組入比率	70%	→	50%	→	30%	→	10%

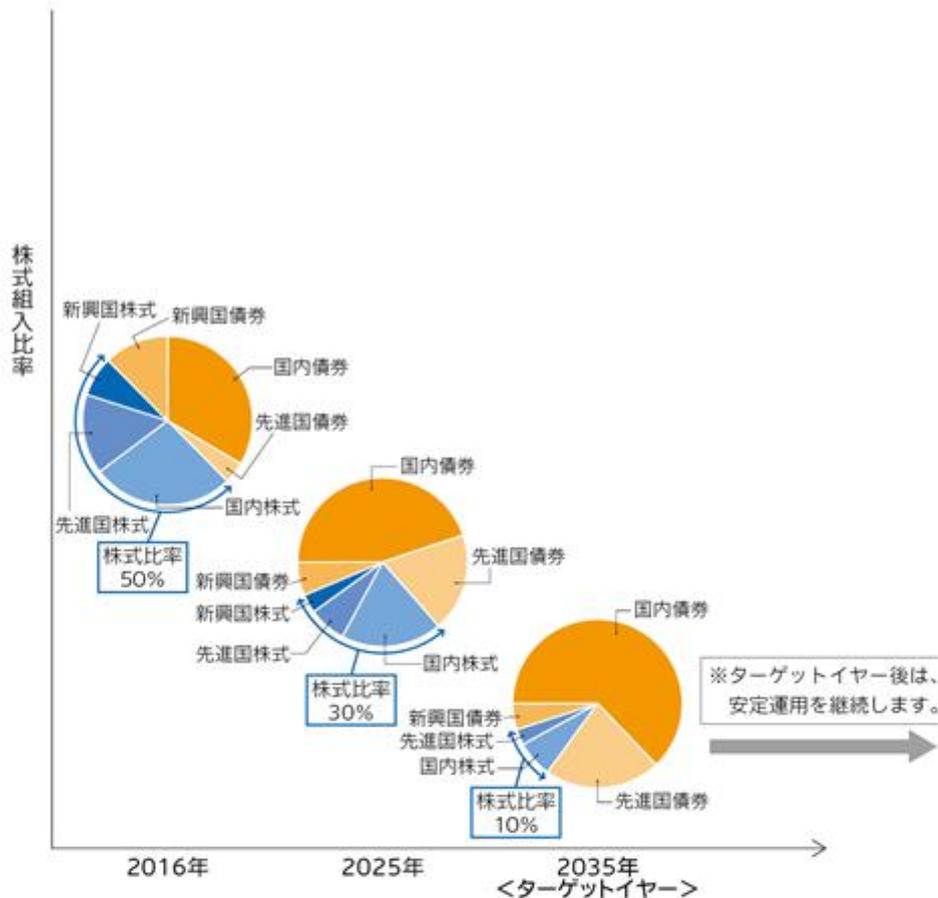
・市況動向やファンドの購入・換金の状況等により、上記の基準資産配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、ポートフォリオの修正(リバランス)を行います。

・上記は、当初設定時に計画している基準資産配分比率の推移であり、市場環境の大きな変化やファンドの購入・換金の状況等によって、基準資産配分比率を変更する場合があります。

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

## 運用期間中の資産配分比率のイメージ

実際には1年ごとに資産配分比率を変えていきます。



	2016年	→	2025年	→	2035年
国内債券	34%	→	45%	→	63%
先進国債券	4%	→	19%	→	22%
国内株式	27%	→	19%	→	7%
先進国株式	15%	→	7%	→	3%
新興国株式	8%	→	4%	→	0%
新興国債券	12%	→	6%	→	5%
<b>株式組入比率</b>	<b>50%</b>	→	<b>30%</b>	→	<b>10%</b>

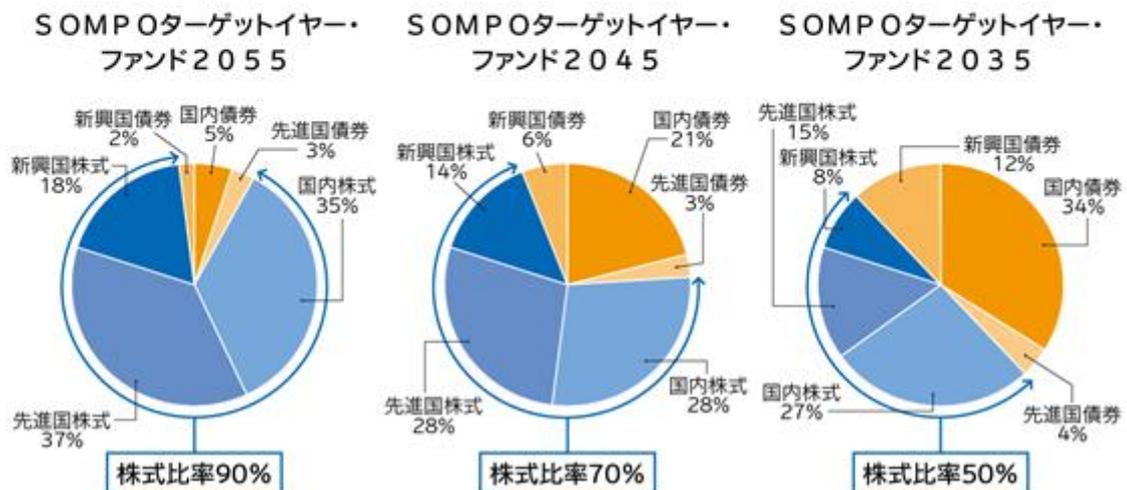
・市況動向やファンドの購入・換金の状況等により、上記の基準資産配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、ポートフォリオの修正（リバランス）を行います。

・上記は、当初設定時に計画している基準資産配分比率の推移であり、市場環境の大きな変化やファンドの購入・換金の状況等によって、基準資産配分比率を変更する場合があります。

3

当初設定時は、原則として以下の基準資産配分比率に基づき、国内外の株式や債券へ分散投資を行います。

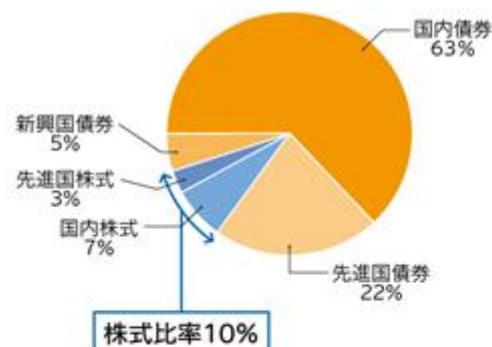
- 各ファンドの当初設定時の基準資産配分比率は以下の通りです。



4

各ファンドのターゲットイヤー以降は、以下の基準資産配分比率とし、原則として、最大許容損失(フロア)を設定し、下落リスクを低減した運用を継続します。

- ターゲットイヤーである2055年、2045年、2035年の各決算日の翌日から、安定運用を開始します。
- ターゲットイヤー以降の資産配分比率は以下の通りです(各ファンド共通)。



- ・上記は、当初設定時に計画している基準資産配分比率であり、市場環境の大きな変化やファンドの購入・換金の状況等によって、基準資産配分比率を変更する場合があります。
- ・実際の基準資産配分と異なることがあります。

#### <最大許容損失(フロア)について>

- ある期間内の最大許容損失(フロア)をあらかじめ設定しておき、最大許容損失(フロア)を超えないように、リスクのコントロールを行う運用方法です。
- 具体的には、ポートフォリオ全体のリターンが悪化した場合には、組入れ資産を同じ割合で縮小させ、短期金融商品へシフトすることで最大許容損失(フロア)の水準を下回らないよう運営します。

※リスクのコントロールを行った状態で、投資している資産の価格が上昇した場合は、その値上がり益を享受できないことがあります。

5

## 実質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。

- 各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用します。

国内外の株式や債券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
国内債券	損保ジャパン日本債券マザーファンド
国内株式	S J A M ラージキャップ・バリュー・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
先進国債券	損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド
先進国株式	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
新興国債券	SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド*
新興国株式	エマージング株式またはエマージング株式を主要投資対象とする証券投資信託

※エマージング債券の運用指図に関する権限を、コルチェスター・グローバル・インベスターズ(シンガポール)に委託します。なお、コルチェスター グローバル インベスターズ(シンガポール)は、コルチェスター グローバル インベスターズに運用の一部を再委託します。

- ・ターゲットイヤーに向けて各マザーファンドへの配分比率は変更されます。また、ベビーファンドから直接、株式や債券に投資する場合があります。
- ・一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

### コルチェスター・グローバル・インベスターズについて

1999年設立。ロンドンを拠点とする、ソブリン債券(各国の政府または政府関係機関が発行、または保証している債券)と為替の運用に特化した運用会社です。

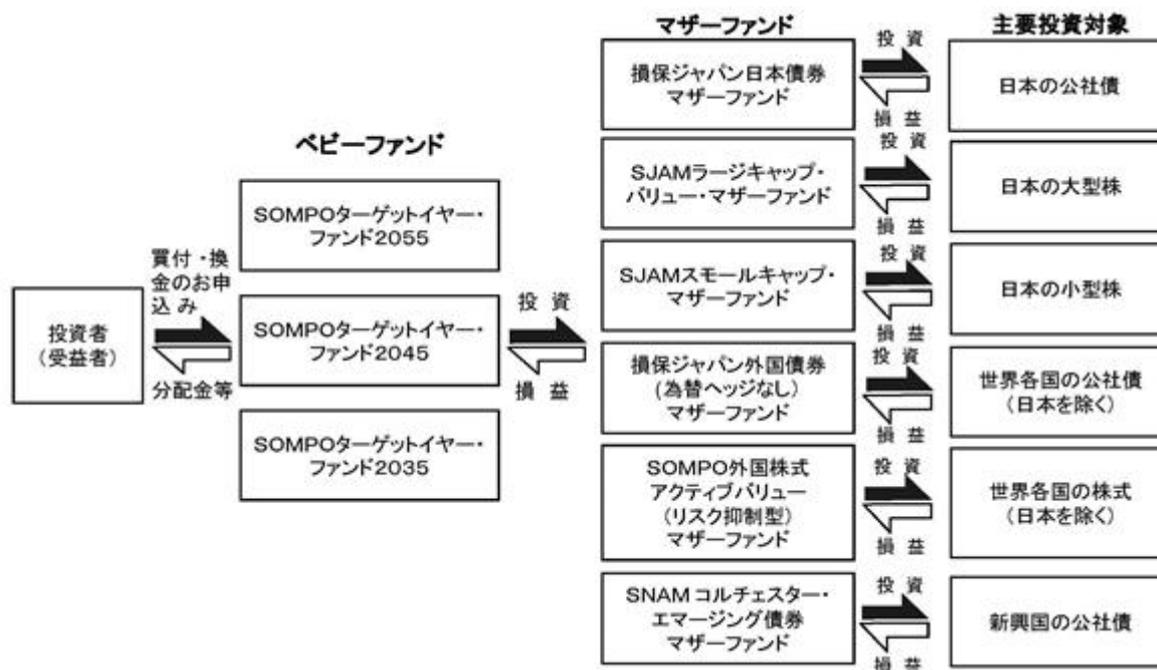
## （２）【ファンドの沿革】

平成28年10月25日 信託契約締結、設定、運用開始

## （３）【ファンドの仕組み】

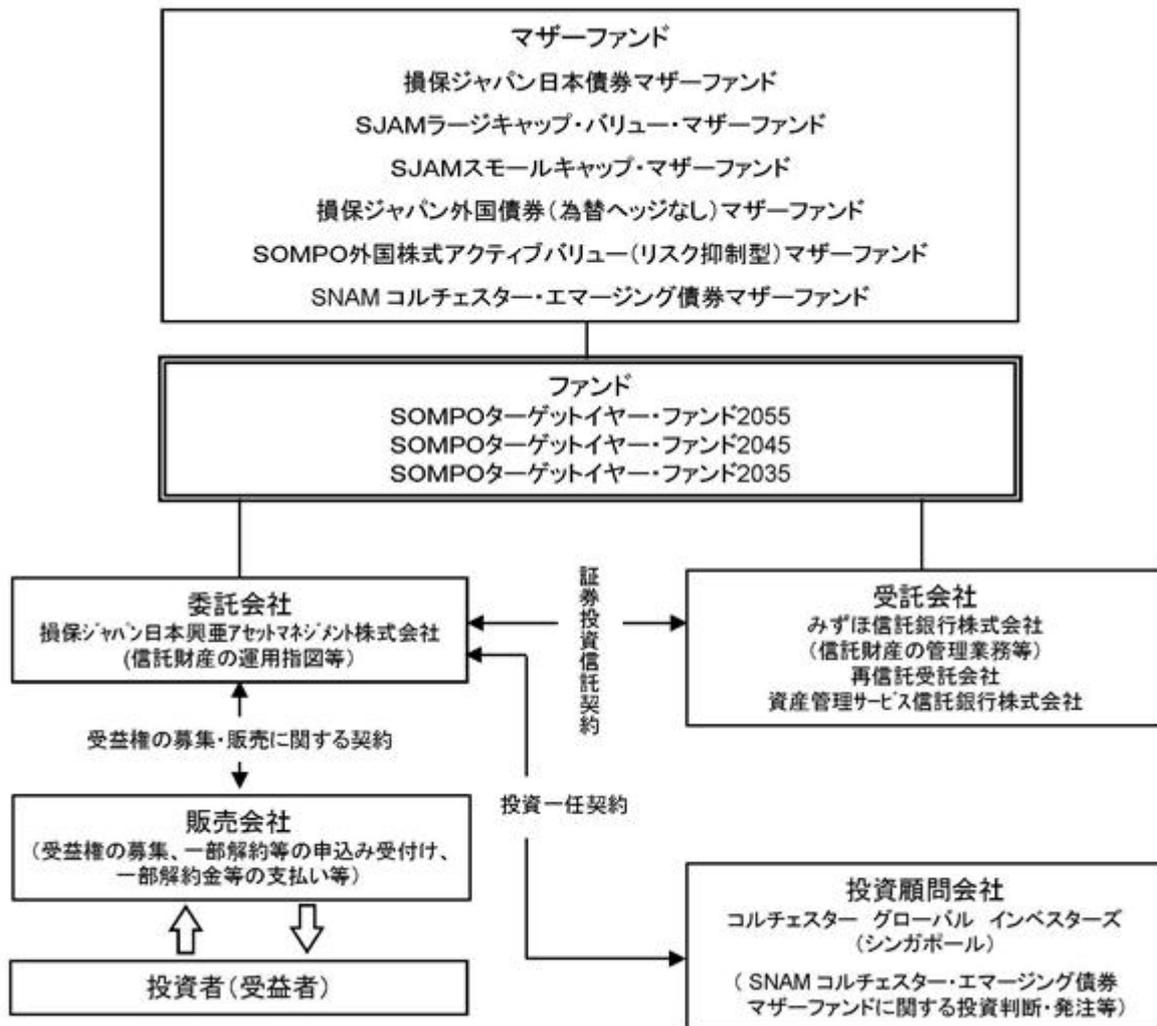
ファンドの仕組み

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」にあたりません。ただし、エマージング株式またはエマージング株式を主要投資対象とする投資信託証券については直接投資を行います。



各マザーファンドには、「SOMPOターゲットイヤー・ファンド」以外にも当該マザーファンドに投資するファンド（ベビーファンド）があります。また、今後当該マザーファンドに投資する他のファンドが設定される場合もあります。

## ファンドの関係法人図



### ファンドの関係法人

- ( ) 委託会社または委託者：損保ジャパン日本興亜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：資産管理サービス信託銀行株式会社)  
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資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。
- ( ) 投資顧問会社：コルチェスター グローバル インベスターズ(シンガポール)  
委託会社との投資一任契約に基づき、「SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド」の投資顧問会社として、公社債の運用指図および為替取引に係る権限の委託を受けて投資判断、発注等を行います。なお、運用の一部につき、運用指図に関する権限をコルチェスター グローバル インベスターズに再委託することがあります。

## 委託会社等の概況

- ( ) 資本金の額 1,550百万円（平成29年11月末現在）
- ( ) 委託会社の沿革
- 昭和61年 2月25日 安田火災投資顧問株式会社設立
- 昭和62年 2月20日 投資顧問業の登録
- 昭和62年 9月9日 投資一任業務の認可取得
- 平成3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
- 平成10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
- 平成10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
- 平成10年 3月31日 証券投資信託委託業の免許取得
- 平成14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
- 平成19年 9月30日 金融商品取引業者として登録
- 平成22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
- ( ) 大株主の状況（平成29年11月末現在）

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## a. 基本方針

この投資信託は、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。

## b. 運用方針

## 投資対象

損保ジャパン日本債券マザーファンド受益証券、S J A M ラージキャップ・バリュー・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、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、SOMPO 外国株式アクティブバリュー(リスク抑制型)マザーファンド受益証券、SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド受益証券およびエマージング株式またはエマージング株式を主要投資対象とする投資信託証券を主要投資対象とします。

## 投資態度

- ( ) 損保ジャパン日本債券マザーファンド、S J A M ラージキャップ・バリュー・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、損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)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、SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンドの受益証券およびエマージング株式またはエマージング株式を主要投資対象とする証券投資信託への投資を通じて、国内外の株式や債券へ分散投資を行うことにより、リスクを軽減しつつ信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。
- ( ) 当初設定時は、原則として以下の基準資産配分比率に基づき、ポートフォリオを構築します。

## &lt;当初設定時の基準資産配分比率&gt;

	国内債券	国内株式	先進国債券	先進国株式	新興国債券	新興国株式
ターゲットイヤー・ ファンド2055	5%	35%	3%	37%	2%	18%
ターゲットイヤー・ ファンド2045	21%	28%	3%	28%	6%	14%
ターゲットイヤー・ ファンド2035	34%	27%	4%	15%	12%	8%

- ( ) 安定運用開始時期に向けて株式への投資割合を漸減し、債券の投資割合を漸増し、原則として、以下の安定運用期間の基準資産配分比率に基づきポートフォリオを構築し、リスクを低減する運用を行います。

<安定運用開始時期>

ターゲットイヤー・ファンド2055	2055年の決算日の翌日(第40計算期間開始日)
ターゲットイヤー・ファンド2045	2045年の決算日の翌日(第30計算期間開始日)
ターゲットイヤー・ファンド2035	2035年の決算日の翌日(第20計算期間開始日)

<安定運用期間の基準資産配分比率>

	国内債券	国内株式	先進国債券	新興国債券	先進国株式	新興国株式
各ファンド共通	63%	7%	22%	5%	3%	0%

- ( ) 安定運用開始時期以降は、原則として最大許容損失(フロア)を設定し、下落リスクを低減しつつ、安定した収益の確保を目指します。
- ( ) 実質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、残存信託期間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、次に掲げるものとします。

- ( ) 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限り。)

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

委託会社は、信託金を、主として損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された「損保ジャパン日本債券マザーファンド」、「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」、「損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)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」および「S N A M コルチェスター・エマージング債券マザーファンド」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ます。)
- 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ます。)
- 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ます。)
- 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ます。)
- 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ます。）
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ます。）
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せん。）
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せん。）
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】

## a. 委託会社の運用体制と社内規程

## (運用体制)

総合投資会議は、ファンドの基本運用方針の分析と決定を行います。

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

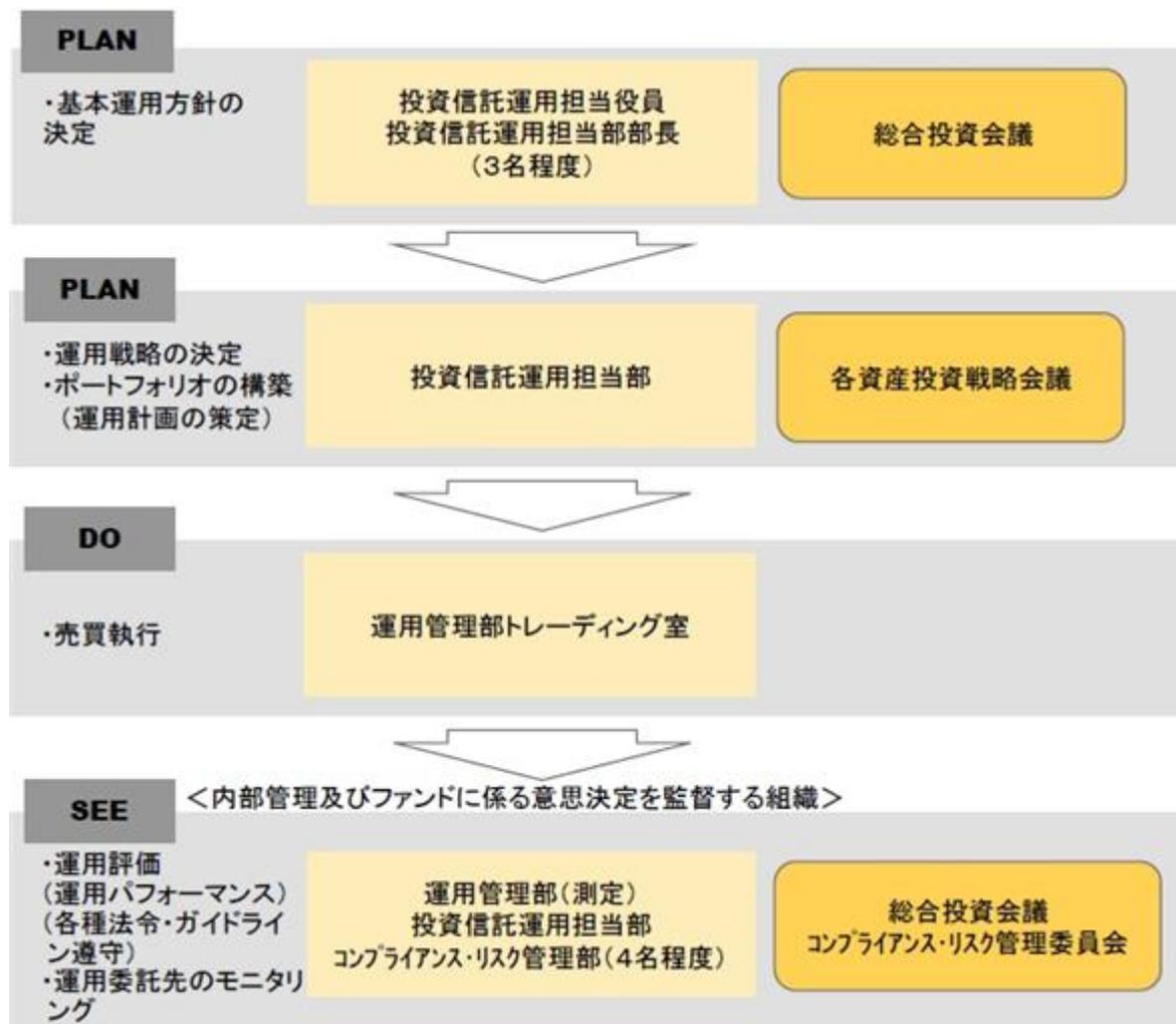
各運用担当部で策定された運用計画に基づき、運用管理部トレーディング室が最良執行の観点から売買を執行します。

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

## (社内規程)

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

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



平成29年11月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

## b. 運用委託先の運用体制等

SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンドの運用委託先であるコルチェスターでは、運用チームのインベストメントマネージャーが各プロダクトを担当し、チーフ・インベストメント・オフィサー（CIO）とともに参加する投資委員会で投資判断を行います。また、コンプライアンス部門によるチェック体制も保持します。



平成29年11月末現在のものであり、今後変更される場合もあります。

## (4) 【分配方針】

毎決算時（原則11月2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. 各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は、次の通りとします。

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055 制限を設けません。

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045 制限を設けません。

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035 信託財産の純資産総額の70%以下とします。

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10%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（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ることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡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ることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債(信託財産により借入れた公社債を含みます。)の引渡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るときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ( ) 前記( )の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ( ) 信託財産の一部解約等の事由により、前記( )の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ( ) 前記( )の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

#### 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号八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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 金利先渡取引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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 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るときは、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、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに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。))を含みません。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ( ) 前記( )の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

#### 信用リスク集中回避のための投資制限

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

#### デリバティブ取引等に係る投資制限

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

#### 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。

#### 87 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な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券又はオプションを表示する証券若しくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）を行い、又は継続することを指図してはならないとされています。

（参考）「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 - B P I 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B B B格あるいはB B B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。

金利先渡し取引および為替先渡し取引は、信託約款第20条の範囲で行います。

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

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

（参考）「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。

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

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

(参考)「S J A Mスモールキャップ・マザーファンド」の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。

金利先渡取引及び為替先渡取引は、信託約款第23条の範囲で行います。

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

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

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

(参考)「損保ジャパン外国債券(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。

金利先渡取引および為替先渡取引は、信託約款第22条の範囲で行います。

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

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

(参考)「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。

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

合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(参考)「SNAM コルチェスター・エマージング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、信託財産の成長を目指して積極的な運用を行うことを基本とします。

## 2. 運用方針

### (1) 投資対象

新興国の公社債を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

新興国の国債、地方債、政府保証債、政府系機関債、国際機関債等(以下「国債・政府機関債等」といいます。)を主要投資対象とし、信託財産の成長を目指した運用を行います。

公社債の運用指図および為替取引に係る権限をColchester Global Investors (Singapore) PTE. LTD.に委託します。なお、Colchester Global Investors (Singapore) PTE. LTD.は、ポートフォリオの決定、アジア以外の地域の為替トレード、リサーチ業務、保有資産の管理業務等に関する権限の一部をColchester Global Investors Limitedに再委託します。

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(除くBB-格未満・ヘッジなし)をベンチマークとし、これを上回る運用成果を目指します。

投資する国債・政府機関債等は、原則として、取得時においてBB-格相当以上の格付を有するものとします。

組入外貨建資産については、為替変動リスクのヘッジおよび投資収益の確保を目的として、為替ヘッジを機動的に行います。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、もしくは為替変動リスクを回避するため、国内において行われ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。)、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。)、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに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。)を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに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、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことができます。

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。

### (3) 投資制限

株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)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。

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(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。

金利先渡し取引、為替先渡し取引および直物為替先渡し取引は、信託約款第23条の範囲で行います。

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

### 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皆様へ帰属いたします。したがって、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金とは異なります。

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

ファンドの基準資産配分比率が収益の源泉となる場合もありますが、配分比率が高い資産の価格が下落した場合等には、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

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

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

##### 信用リスク

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

##### 流動性リスク

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

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

##### 為替変動リスク

外貨建資産の価格は、当該外貨と日本円との間の為替レートの変動の影響を受けて変動します。

為替レートは、各国の政治・経済情勢、外国為替市場の需給、金利変動その他の要因により、短期間に大幅に変動することがあります。当該外貨の為替レートが、円高になった場合は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

#### カントリーリスク

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

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。

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。

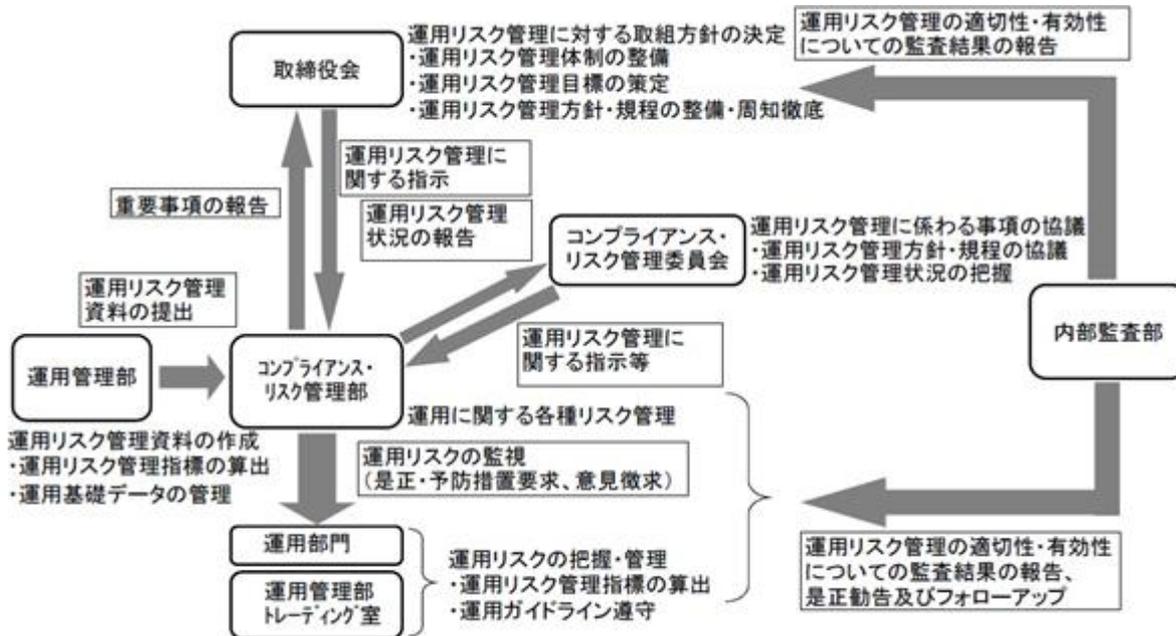
##### <ご換金時>

委託会社は、換金の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、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

該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとし、信託約款の規定に準じて算出した価額とします。

## < リスクの管理体制 >

### a . 委託会社のリスク管理体制



※運用リスクには流動性リスクを含みます。

(注) 上図は、平成29年11月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

### b . 運用委託先のリスク管理体制等

SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンドの運用委託先であるコルチェスター グローバル インベスターズ(シンガポール)では、統合的なリスク管理機関として、オペレーションチームのチーフ・オペレーティング・オフィサー(COO)を議長とするビジネス・リスク委員会がファンドおよび会社の事業リスクの管理を担っています。また、同社が行った取引については、最良執行規程に基づきレビューが行われます。

### ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移

※データは、設定日より掲載しています。

2012年12月～2017年11月

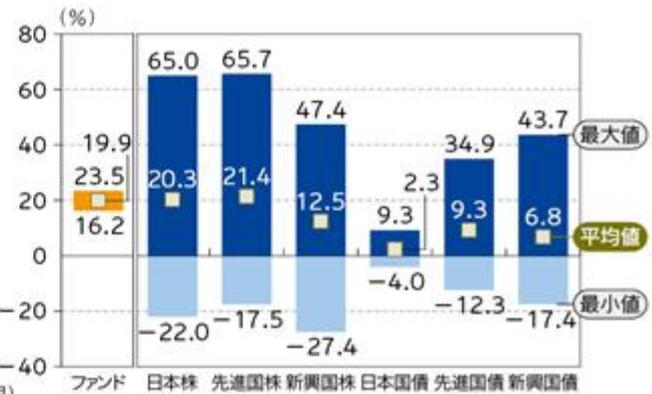
#### SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055



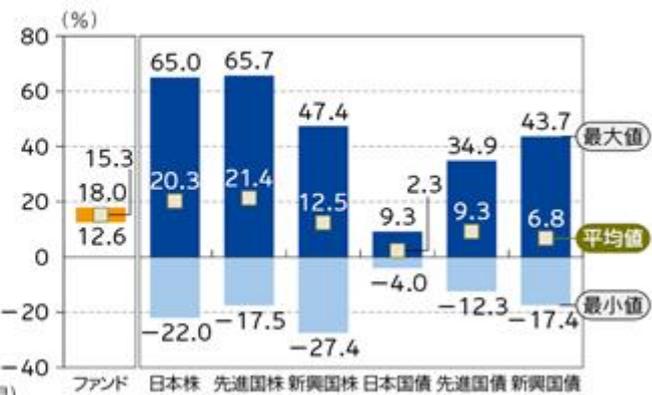
### ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

※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。

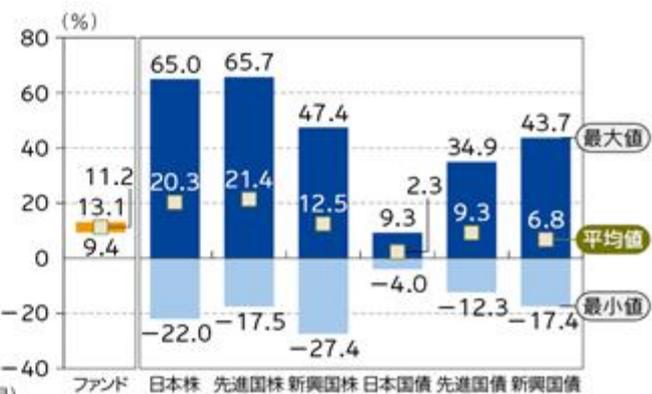
ファンド：2017年10月～2017年11月  
代表的な資産クラス：2012年12月～2017年11月



#### SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045



#### SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035



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

## 代表的な資産クラスの指数

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

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

< 申込み時に受益者が負担する費用・税金 >

時期	項目	費用・税金
申込み時	申込手数料および消費税等相当額	<p>申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に2.16%（税抜 2.0%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。</p> <p>申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。</p>

販売会社によるファンドの商品説明・投資環境の説明・事務処理等の対価

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

2 税法が改正された場合は、上記の内容が変更になることがあります。

3 自動けいぞく投資契約に基づき収益分配金を再投資する場合は、手数料はかかりません。

## (2)【換金（解約）手数料】

換金（解約）手数料はかかりません。信託財産留保額はありませぬ。

## (3)【信託報酬等】

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

・運用管理費用（信託報酬）＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

期間	信託報酬率 (年率)	内訳(税抜 年率)		
		委託会社	販売会社	受託会社
2055年の決算日まで	1.2204% (税抜1.13%)	0.50%	0.60%	0.03%
2055年の決算日の翌日以降	0.7884% (税抜0.73%)	0.35%	0.35%	0.03%

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

期間	信託報酬率 (年率)	内訳(税抜 年率)		
		委託会社	販売会社	受託会社
2045年の決算日まで	1.2204% (税抜1.13%)	0.50%	0.60%	0.03%
2045年の決算日の翌日以降	0.7884% (税抜0.73%)	0.35%	0.35%	0.03%

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

期間	信託報酬率 (年率)	内訳(税抜 年率)		
		委託会社	販売会社	受託会社
2035年の決算日まで	1.2204% (税抜1.13%)	0.50%	0.60%	0.03%
2035年の決算日の翌日以降	0.7884% (税抜0.73%)	0.35%	0.35%	0.03%

## 信託報酬を対価とする役務の内容

委託会社	ファンドの運用の対価
販売会社	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	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、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。

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

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

委託会社の報酬には、SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンドの運用指図に関する権限を委託したコルチェスター グローバル インベスターズ（シンガポール）への投資顧問報酬が含まれます。投資顧問報酬の額は、各ファンドに属するSNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンドの時価総額に当該計算期間を通じ、毎日、年率0.49%を乗じて得た額とします。〔ファンドの運用の対価〕

コルチェスター グローバル インベスターズ（シンガポール）は、委託会社から委託された「SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド」の運用の指図に関する権限の一部をコルチェスター グローバル インベスターズに再委託する場合にコルチェスター グローバル インベスターズが受ける報酬を、前記 に基づいてコルチェスター グローバル インベスターズ（シンガポール）が受け取る報酬から支払うものとします。その報酬額は前記 の率を上限とし、コルチェスター グローバル インベスターズ（シンガポール）とコルチェスター グローバル インベスターズが締結する当該親投資信託およびその他の委託業務全般を包括した業務委託契約に基づいて支払われます。〔ファンドの運用の対価〕

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

## (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。

委託会社は、前記 に定める信託事務の処理に要する諸費用のうち監査費用の支払いを信託財産のために行い、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。この場合、信託財産にかかる監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、実際の費用額（年間27万円（税抜25万円））を上限として、純資産総額に定率（年0.004752%（税抜0.0044%））を乗じて日々計算し、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からその支弁を受けることとします。なお、監査費用の上限金額については、変動する可能性があります。

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

## （５）【課税上の取扱い】

個人の受益者に対する課税

< 収益分配時 >

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

< 一部解約時および償還時 >

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

法人の受益者に対する課税

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

### （注1） 個別元本について

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

### （注2） 収益分配金の課税について

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

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

配当控除、益金不算入制度の適用はありません。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

・少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

上記は平成29年11月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

平成29年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	1,279,549	16.28
内 アメリカ	1,279,549	16.28
親投資信託受益証券	6,348,203	80.76
内 日本	6,348,203	80.76
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	233,106	2.97
純資産総額	7,860,858	100.00

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

平成29年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	877,405	12.67
内 アメリカ	877,405	12.67
親投資信託受益証券	5,883,571	84.95
内 日本	5,883,571	84.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	164,718	2.38
純資産総額	6,925,694	100.00

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

平成29年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	1,044,530	6.99
内 アメリカ	1,044,530	6.99
親投資信託受益証券	13,586,761	90.91
内 日本	13,586,761	90.91
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	314,015	2.10
純資産総額	14,945,306	100.00

（参考）マザーファンドの投資状況  
 損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成29年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	9,261,154,600	60.23
内 日本	9,161,029,400	59.58
内 メキシコ	100,125,200	0.65
特殊債券	904,929,842	5.89
内 日本	904,929,842	5.89
社債券	4,964,800,500	32.29
内 日本	4,036,394,700	26.25
内 フランス	726,720,000	4.73
内 イギリス	201,685,800	1.31
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	245,795,737	1.60
純資産総額	15,376,680,679	100.00

## S J A M ラージキャップ・バリュース・マザーファンド

平成29年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	39,955,674,190	98.20
内 日本	39,955,674,190	98.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	733,269,926	1.80
純資産総額	40,688,944,116	100.00

## S J A M スモールキャップ・マザーファンド

平成29年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	8,291,858,000	98.11
内 日本	8,291,858,000	98.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	159,640,999	1.89
純資産総額	8,451,498,999	100.00

## 損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

平成29年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	6,244,607,082	94.34
内 アメリカ	2,697,676,757	40.76
内 イタリア	948,821,047	14.33
内 フランス	556,034,937	8.40
内 ドイツ	460,355,666	6.95
内 イギリス	441,232,274	6.67
内 スペイン	349,737,588	5.28
内 ベルギー	180,519,393	2.73
内 オーストラリア	136,260,488	2.06
内 カナダ	127,060,147	1.92
内 オランダ	67,653,585	1.02
内 メキシコ	51,595,797	0.78
内 アイルランド	49,643,780	0.75
内 ポーランド	44,941,356	0.68
内 デンマーク	38,763,782	0.59
内 マレーシア	32,426,261	0.49
内 スウェーデン	22,051,423	0.33
内 ノルウェー	20,443,272	0.31
内 スイス	19,389,529	0.29
特殊債券	28,603,568	0.43
内 南アフリカ	28,603,568	0.43
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	345,937,769	5.23
純資産総額	6,619,148,419	100.00

## 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

平成29年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	219,809,417	98.14
内 アメリカ	131,449,505	58.69
内 スイス	19,012,206	8.49
内 イギリス	13,694,863	6.11
内 フランス	9,138,798	4.08
内 アイルランド	7,999,966	3.57
内 カナダ	6,563,220	2.93
内 シンガポール	6,168,537	2.75
内 バミューダ	4,186,181	1.87
内 ノルウェー	3,625,642	1.62
内 ドイツ	3,446,021	1.54
内 香港	3,146,955	1.41
内 スウェーデン	2,490,585	1.11
内 オランダ	2,170,742	0.97
内 スペイン	2,016,753	0.90
内 パナマ	1,987,654	0.89
内 デンマーク	1,454,514	0.65
内 ケイマン諸島	1,257,275	0.56
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,159,086	1.86
純資産総額	223,968,503	100.00

## SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

平成29年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	1,340,290,805	96.42
内 ブラジル	269,673,755	19.40
内 メキシコ	196,583,102	14.14
内 コロンビア	169,445,178	12.19
内 南アフリカ	139,814,917	10.06
内 マレーシア	123,709,820	8.90
内 ロシア	104,531,890	7.52
内 インドネシア	95,100,604	6.84
内 ペルー	94,465,634	6.80
内 トルコ	86,039,571	6.19
内 ポーランド	60,926,334	4.38
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	49,766,868	3.58
純資産総額	1,390,057,673	100.00

## その他資産の投資状況

平成29年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）		386,699,350	27.82
内	日本	386,699,350	27.82
為替予約取引（売建）		22,678,470	1.63
内	日本	22,678,470	1.63
直物為替先渡取引（買建）		37,181,667	2.67
内	日本	37,181,667	2.67
直物為替先渡取引（売建）		420,938,690	30.28
内	日本	420,938,690	30.28

（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。

（注4）直物為替先渡取引の時価は、価格提供会社の提供する価額で評価しております。

## （2）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

平成29年11月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率（%） 償還日	投資 比率
1	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 日本	親投資信 託受益証 券	2,175,651	1.2543 2,728,954	1.2651 2,752,416	- -	35.01%
2	SJAMラージキャップ・バ リュー・マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	669,906	2.0084 1,345,490	2.0165 1,350,865	- -	17.18%
3	SJAMスモールキャップ・マ ザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	496,537	2.6710 1,326,285	2.6713 1,326,399	- -	16.87%
4	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託 受益証券	245	5,212.56 1,277,078	5,222.64 1,279,549	- -	16.28%
5	損保ジャパン日本債券マザー ファンド 日本	親投資信 託受益証 券	375,658	1.4070 528,559	1.4087 529,189	- -	6.73%
6	損保ジャパン外国債券（為替 ヘッジなし）マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	146,199	1.5604 228,132	1.5498 226,579	- -	2.88%
7	SNAM コルチェスター・エ マージング債券マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	139,453	1.1689 163,020	1.1671 162,755	- -	2.07%

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成29年11月30日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	16.28%
親投資信託受益証券	80.76%
合計	97.03%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

平成29年11月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SOMPO外国株式アクティブ パリュウ（リスク抑制型）マ ザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	1,427,848	1.2545 1,791,377	1.2651 1,806,370	- -	26.08%
2	損保ジャパン日本債券マザー ファンド 日本	親投資信 託受益証 券	1,055,668	1.4070 1,485,403	1.4087 1,487,119	- -	21.47%
3	SJAMラージキャップ・パ リュウ・マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	483,220	2.0089 970,773	2.0165 974,413	- -	14.07%
4	SJAMスモールキャップ・マ ザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	358,662	2.6713 958,104	2.6713 958,093	- -	13.83%
5	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託 受益証券	168	5,212.44 875,690	5,222.64 877,405	- -	12.67%
6	SNAM コルチェスター・エ マージング債券マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	388,155	1.1689 453,745	1.1671 453,015	- -	6.54%
7	損保ジャパン外国債券（為替 ヘッジなし）マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	131,992	1.5610 206,045	1.5498 204,561	- -	2.95%

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成29年11月30日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	12.67%
親投資信託受益証券	84.95%
合計	97.62%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

平成29年11月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	損保ジャパン日本債券マザー ファンド 日本	親投資信 託受益証 券	3,572,563	1.4069 5,026,596	1.4087 5,032,669	- -	33.67%
2	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 日本	親投資信 託受益証 券	1,682,792	1.2545 2,111,063	1.2651 2,128,900	- -	14.24%
3	SJAMラージキャップ・バ リュー・マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	972,349	2.0130 1,957,339	2.0165 1,960,741	- -	13.12%
4	SJAMスモールキャップ・マ ザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	724,544	2.6726 1,936,488	2.6713 1,935,474	- -	12.95%
5	SNAM コルチェスター・エ マージング債券マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	1,454,177	1.1690 1,699,933	1.1671 1,697,169	- -	11.36%
6	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF アメリカ	投資信託 受益証券	200	5,212.56 1,042,513	5,222.65 1,044,530	- -	6.99%
7	損保ジャパン外国債券（為替 ヘッジなし）マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	536,720	1.5608 837,728	1.5498 831,808	- -	5.57%

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成29年11月30日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	6.99%
親投資信託受益証券	90.91%
合計	97.90%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）マザーファンドの投資資産  
 損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成29年11月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	3 8 0 2年国債 日本	国債証券	2,040,000,000	100.44 2,049,085,800	100.47 2,049,649,200	0.100000 2019/9/15	13.33%
2	3 8 1 2年国債 日本	国債証券	1,000,000,000	100.49 1,004,935,300	100.49 1,004,950,000	0.100000 2019/10/15	6.54%
3	3 4 4 10年国債 日本	国債証券	800,000,000	100.62 805,038,600	100.92 807,384,000	0.100000 2026/9/20	5.25%
4	1 3 3 5年国債 日本	国債証券	540,000,000	100.88 544,789,200	101.06 545,724,000	0.100000 2022/9/20	3.55%
5	5 5 30年国債 日本	国債証券	540,000,000	99.23 535,845,400	99.64 538,066,800	0.800000 2047/6/20	3.50%
6	3 5 30年国債 日本	国債証券	370,000,000	128.33 474,832,100	128.61 475,871,800	2.000000 2041/9/20	3.09%
7	1 5 4 20年国債 日本	国債証券	370,000,000	112.25 415,339,800	112.63 416,745,800	1.200000 2035/9/20	2.71%
8	1 5 8 20年国債 日本	国債証券	380,000,000	99.26 377,194,500	99.74 379,019,600	0.500000 2036/9/20	2.46%
9	5 4 4 東京電力 日本	社債券	300,000,000	101.71 305,131,200	101.03 303,117,600	1.976000 2018/6/25	1.97%
10	5 4 0 東京電力 日本	社債券	300,000,000	101.15 303,469,800	100.59 301,776,000	1.640000 2018/4/25	1.96%
11	1 5 1 20年国債 日本	国債証券	260,000,000	112.47 292,422,000	112.85 293,420,400	1.200000 2034/12/20	1.91%
12	3 4 5 10年国債 日本	国債証券	290,000,000	100.42 291,218,000	100.85 292,488,200	0.100000 2026/12/20	1.90%
13	1 1 3 20年国債 日本	国債証券	230,000,000	123.23 283,433,600	123.02 282,962,100	2.100000 2029/9/20	1.84%
14	1 5 2 20年国債 日本	国債証券	240,000,000	112.45 269,880,000	112.75 270,612,000	1.200000 2035/3/20	1.76%
15	1 みずほFG劣後 日本	社債券	200,000,000	103.41 206,837,000	103.32 206,658,800	0.950000 2024/7/16	1.34%
16	5 2 ソフトバンクグループ 日本	社債券	200,000,000	100.92 201,849,000	103.24 206,480,400	2.030000 2024/3/8	1.34%
17	1 4 6 20年国債 日本	国債証券	170,000,000	120.62 205,067,200	120.83 205,424,600	1.700000 2033/9/20	1.34%
18	3 4 2 10年国債 日本	国債証券	200,000,000	100.60 201,200,000	101.03 202,076,000	0.100000 2026/3/20	1.31%
19	1 エイチエスピーシーHD イギリス	社債券	200,000,000	100.56 201,121,400	100.84 201,685,800	0.450000 2021/9/24	1.31%
20	5 4 2 東京電力 日本	社債券	200,000,000	101.12 202,242,000	100.58 201,164,000	1.602000 2018/4/25	1.31%
21	3 A 明治安田劣後FR 日本	社債券	200,000,000	100.00 200,000,000	99.23 198,470,000	1.110000 2047/11/6	1.29%
22	3 A 富国生命劣後FR 日本	社債券	200,000,000	98.27 196,540,000	99.22 198,440,000	1.020000 -	1.29%
23	3 0 東レ 日本	社債券	200,000,000	99.93 199,865,200	97.69 195,389,600	0.375000 2027/7/16	1.27%
24	1 4 8 20年国債 日本	国債証券	160,000,000	117.55 188,080,000	117.81 188,502,400	1.500000 2034/3/20	1.23%
25	1 5 0 20年国債 日本	国債証券	160,000,000	115.87 185,392,000	116.19 185,910,400	1.400000 2034/9/20	1.21%

26	7 8 住宅機構 R M B S 日本	特殊債券	117,668,000	103.96 122,339,419	104.42 122,880,692	1.080000 2048/11/10	0.80%
27	7 9 住宅機構 R M B S 日本	特殊債券	117,238,000	103.97 121,904,072	104.37 122,373,024	1.070000 2048/12/10	0.80%
28	9 4 0 年国債 日本	国債証券	140,000,000	80.24 112,336,000	82.02 114,833,600	0.400000 2056/3/20	0.75%
29	1 5 7 2 0 年国債 日本	国債証券	120,000,000	94.00 112,802,400	94.66 113,601,600	0.200000 2036/6/20	0.74%
30	1 クレディ・A 劣後 フランス	社債券	100,000,000	108.15 108,151,200	108.53 108,534,400	2.114000 2025/6/26	0.71%

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成29年11月30日現在

種類	投資比率
国債証券	60.23%
特殊債券	5.89%
社債券	32.29%
合計	98.40%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## S J A M ラージキャップ・バリュー・マザーファンド

平成29年11月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	第一生命ホールディングス 日本	株式 保険業	1,495,200	1,878.20 2,808,287,857	2,296.00 3,432,979,200	- -	8.44%
2	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	903,800	3,266.76 2,952,499,663	3,744.00 3,383,827,200	- -	8.32%
3	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	1,138,600	2,665.24 3,034,653,461	2,721.00 3,098,130,600	- -	7.61%
4	ジェイ エフ イー ホールディングス 日本	株式 鉄鋼	1,109,200	2,226.80 2,469,973,546	2,642.00 2,930,506,400	- -	7.20%
5	三菱重工業 日本	株式 機械	676,200	4,345.05 2,938,123,980	4,150.00 2,806,230,000	- -	6.90%
6	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	13,274,900	195.72 2,598,210,640	203.90 2,706,752,110	- -	6.65%
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	567,100	4,251.27 2,410,900,236	4,547.00 2,578,603,700	- -	6.34%
8	日本郵船 日本	株式 海運業	781,200	2,255.92 1,762,327,270	2,618.00 2,045,181,600	- -	5.03%
9	三菱商事 日本	株式 卸売業	567,900	2,576.19 1,463,023,242	2,813.00 1,597,502,700	- -	3.93%
10	マツダ 日本	株式 輸送用機器	1,021,200	1,608.68 1,642,793,564	1,503.00 1,534,863,600	- -	3.77%
11	静岡銀行 日本	株式 銀行業	1,165,000	967.64 1,127,307,988	1,108.00 1,290,820,000	- -	3.17%
12	三井住友トラスト・ホールディングス 日本	株式 銀行業	302,300	3,898.62 1,178,553,110	4,164.00 1,258,777,200	- -	3.09%
13	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	1,532,800	703.07 1,077,673,518	792.10 1,214,130,880	- -	2.98%
14	ヤマダ電機 日本	株式 小売業	1,857,700	592.04 1,099,847,024	610.00 1,133,197,000	- -	2.79%
15	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先物取引業	1,639,800	630.13 1,033,287,502	670.50 1,099,485,900	- -	2.70%
16	ツムラ 日本	株式 医薬品	277,800	3,932.88 1,092,555,130	3,880.00 1,077,864,000	- -	2.65%
17	大和証券グループ本社 日本	株式 証券、商品先物取引業	1,449,000	633.23 917,553,616	698.00 1,011,402,000	- -	2.49%
18	三菱UFJリース 日本	株式 その他金融業	1,418,700	566.73 804,022,660	639.00 906,549,300	- -	2.23%
19	ソニーフィナンシャルホールディングス 日本	株式 保険業	475,900	1,806.17 859,558,646	1,898.00 903,258,200	- -	2.22%
20	三井物産 日本	株式 卸売業	461,700	1,661.76 767,235,220	1,705.00 787,198,500	- -	1.93%
21	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	691,300	1,070.05 739,725,603	1,088.00 752,134,400	- -	1.85%
22	日本テレビホールディングス 日本	株式 情報・通信業	350,700	1,913.65 671,118,379	2,031.00 712,271,700	- -	1.75%
23	野村不動産ホールディングス 日本	株式 不動産業	252,800	2,145.24 542,318,765	2,588.00 654,246,400	- -	1.61%
24	フジ・メディア・ホールディングス 日本	株式 情報・通信業	291,600	1,572.38 458,507,494	1,674.00 488,138,400	- -	1.20%

25	KDDI 日本	株式 情報・通信業	137,200	2,987.14 409,836,351	3,215.00 441,098,000	- -	1.08%
26	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	18,800	5,098.16 95,845,546	5,879.00 110,525,200	- -	0.27%

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成29年11月30日現在

種類	投資比率
株式	98.20%
合計	98.20%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

平成29年11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行業	国内	22.24%
鉄鋼		14.82%
輸送用機器		13.94%
保険業		10.66%
機械		6.90%
卸売業		5.86%
証券、商品先物取引業		5.19%
海運業		5.03%
情報・通信業		4.31%
小売業		2.79%
医薬品		2.65%
その他金融業		2.23%
不動産業		1.61%
合計		98.20%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各業種の時価の比率です。

## S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

平成29年11月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	ケースホールディングス 日本	株式 小売業	109,700	2,418.00 265,254,600	2,896.00 317,691,200	- -	3.76%
2	ジーエス・ユアサ コーポレーション 日本	株式 電気機器	459,000	532.00 244,188,000	580.00 266,220,000	- -	3.15%
3	シチズン時計 日本	株式 精密機器	319,000	759.00 242,121,000	815.00 259,985,000	- -	3.08%
4	青山商事 日本	株式 小売業	60,000	4,018.81 241,129,184	4,280.00 256,800,000	- -	3.04%
5	伊予銀行 日本	株式 銀行業	281,200	799.00 224,678,800	877.00 246,612,400	- -	2.92%
6	沢井製薬 日本	株式 医薬品	39,600	6,149.86 243,534,709	5,490.00 217,404,000	- -	2.57%
7	カブコン 日本	株式 情報・通信業	63,800	2,661.00 169,771,800	3,200.00 204,160,000	- -	2.42%
8	住友倉庫 日本	株式 倉庫・運輸関連業	249,000	717.00 178,533,000	796.00 198,204,000	- -	2.35%
9	島忠 日本	株式 小売業	59,800	2,750.00 164,450,000	3,230.00 193,154,000	- -	2.29%
10	大気社 日本	株式 建設業	50,900	2,845.40 144,831,185	3,770.00 191,893,000	- -	2.27%
11	ダイビル 日本	株式 不動産業	147,000	1,124.00 165,228,000	1,259.00 185,073,000	- -	2.19%
12	E P Sホールディングス 日本	株式 サービス業	75,000	2,071.63 155,372,536	2,415.00 181,125,000	- -	2.14%
13	エクセディ 日本	株式 輸送用機器	53,800	3,210.00 172,698,000	3,345.00 179,961,000	- -	2.13%
14	東邦ホールディングス 日本	株式 卸売業	77,000	2,107.03 162,241,466	2,333.00 179,641,000	- -	2.13%
15	興銀リース 日本	株式 その他金融業	61,800	2,720.00 168,096,000	2,867.00 177,180,600	- -	2.10%
16	アークス 日本	株式 小売業	67,800	2,427.00 164,550,600	2,594.00 175,873,200	- -	2.08%
17	A O K Iホールディングス 日本	株式 小売業	106,700	1,419.00 151,407,300	1,640.00 174,988,000	- -	2.07%
18	東和薬品 日本	株式 医薬品	29,000	5,437.42 157,685,365	5,830.00 169,070,000	- -	2.00%
19	ゼビオホールディングス 日本	株式 小売業	81,700	2,103.00 171,815,100	2,067.00 168,873,900	- -	2.00%
20	大和工業 日本	株式 鉄鋼	54,800	3,070.00 168,236,000	3,040.00 166,592,000	- -	1.97%
21	A D E K A 日本	株式 化学	86,000	1,856.00 159,616,000	1,896.00 163,056,000	- -	1.93%
22	北洋銀行 日本	株式 銀行業	439,100	333.21 146,315,687	360.00 158,076,000	- -	1.87%
23	リコーリース 日本	株式 その他金融業	40,900	3,755.00 153,579,500	3,855.00 157,669,500	- -	1.87%
24	日医工 日本	株式 医薬品	93,000	1,682.79 156,500,359	1,688.00 156,984,000	- -	1.86%
25	日立キャピタル 日本	株式 その他金融業	50,800	2,504.00 127,203,200	2,766.00 140,512,800	- -	1.66%

26	七十七銀行 日本	株式 銀行業	51,800	2,480.00 128,464,000	2,648.00 137,166,400	- -	1.62%
27	メイテック 日本	株式 サービス業	23,000	4,965.00 114,195,000	5,900.00 135,700,000	- -	1.61%
28	トッパン・フォームズ 日本	株式 その他製品	107,000	1,117.00 119,519,000	1,220.00 130,540,000	- -	1.54%
29	コメリ 日本	株式 小売業	34,000	3,160.00 107,440,000	3,200.00 108,800,000	- -	1.29%
30	日新製鋼 日本	株式 鉄鋼	61,800	1,427.00 88,188,600	1,730.00 106,914,000	- -	1.27%

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成29年11月30日現在

種類	投資比率
株式	98.11%
合計	98.11%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成29年11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
小売業	国内	19.20%
銀行業		9.56%
電気機器		8.01%
輸送用機器		7.30%
その他金融業		6.77%
医薬品		6.43%
鉄鋼		5.13%
サービス業		4.71%
不動産業		3.53%
建設業		3.26%
精密機器		3.08%
化学		2.96%
情報・通信業		2.90%
卸売業		2.82%
倉庫・運輸関連業		2.35%
繊維製品		1.85%
その他製品		1.54%
非鉄金属		1.06%
水産・農林業		1.00%
機械		0.98%
陸運業		0.95%
鉱業		0.85%
パルプ・紙		0.75%
電気・ガス業		0.69%
証券、商品先物取引業		0.43%
合計		98.11%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各業種の時価の比率です。

## 損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

平成29年11月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US TREASURY N/B 1.25% 2019/06/30 アメリカ	国債証券	894,159,000	99.63 890,893,214	99.21 887,166,676	1.250000 2019/6/30	13.40%
2	US TREASURY N/B 1.875% 2022/02/28 アメリカ	国債証券	516,550,500	100.24 517,841,428	99.30 512,955,308	1.875000 2022/2/28	7.75%
3	US TREASURY N/B 2.125% 2024/02/29 アメリカ	国債証券	410,103,000	100.68 412,901,366	99.42 407,728,503	2.125000 2024/2/29	6.16%
4	BUNDESSCHATZANW 0.0% 2019/06/14 ドイツ	国債証券	351,946,500	101.27 356,416,472	101.17 356,081,871	- 2019/6/14	5.38%
5	BTPS 1.35% 2022/04/15 イタリア	国債証券	337,337,400	102.97 347,382,139	103.91 350,554,279	1.350000 2022/4/15	5.30%
6	FRANCE O.A.T. 0% 2019/02/25 フランス	国債証券	345,306,000	100.85 348,271,726	100.83 348,185,852	- 2019/2/25	5.26%
7	BTPS 0.7% 2020/05/01 イタリア	国債証券	248,354,700	101.45 251,965,246	102.01 253,356,563	0.700000 2020/5/1	3.83%
8	US TREASURY N/B 1.25% 2018/12/31 アメリカ	国債証券	218,497,500	99.88 218,239,672	99.53 217,472,746	1.250000 2018/12/31	3.29%
9	BELGIAN 0328 2.25% 2023/06/22 ベルギー	国債証券	116,872,800	112.57 131,568,385	113.20 132,311,696	2.250000 2023/6/22	2.00%
10	US TREASURY N/B 2.25% 2027/08/15 アメリカ	国債証券	116,532,000	100.82 117,488,391	98.77 115,102,152	2.250000 2027/8/15	1.74%
11	SPANISH GOVT 4.85% 2020/10/31 スペイン	国債証券	80,350,050	115.84 93,081,515	114.40 91,922,064	4.850000 2020/10/31	1.39%
12	US TREASURY N/B 2.875% 2046/11/15 アメリカ	国債証券	90,760,500	99.50 90,313,050	101.04 91,709,854	2.875000 2046/11/15	1.39%
13	US TREASURY N/B 1.25% 2019/03/31 アメリカ	国債証券	81,796,500	99.82 81,655,810	99.35 81,272,184	1.250000 2019/3/31	1.23%
14	BTPS 0.65% 2020/11/01 イタリア	国債証券	70,389,300	100.95 71,060,813	101.90 71,730,216	0.650000 2020/11/1	1.08%
15	AUSTRALIAN GOVT. 3.25% 2025/04/21 オーストラリア	国債証券	61,106,400	104.80 64,041,340	106.24 64,921,883	3.250000 2025/4/21	0.98%
16	US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15 アメリカ	国債証券	47,061,000	130.92 61,612,731	131.81 62,035,810	4.625000 2040/2/15	0.94%
17	UK TSY GILT 1.5% 2026/07/22 イギリス	国債証券	60,132,000	102.68 61,749,550	102.14 61,421,831	1.500000 2026/7/22	0.93%
18	TREASURY 4.25 2027/12/07 イギリス	国債証券	48,105,600	128.90 62,012,447	127.21 61,199,944	4.250000 2027/12/7	0.92%
19	CANADA-GOVT 1.5% 2023/06/01 カナダ	国債証券	58,531,200	99.30 58,122,066	99.07 57,992,127	1.500000 2023/6/1	0.88%
20	SPANISH GOVT 5.5% 2021/04/30 スペイン	国債証券	48,475,650	120.41 58,372,438	118.73 57,556,108	5.500000 2021/4/30	0.87%
21	SPANISH GOVT 4.4% 2023/10/31 スペイン	国債証券	45,819,450	122.43 56,099,959	122.07 55,932,719	4.400000 2023/10/31	0.85%

22	US TREASURY N/B 2.75% 2047/08/15 アメリカ	国債証券	53,784,000	99.84 53,703,234	98.55 53,006,283	2.750000 2047/8/15	0.80%
23	FRANCE O.A.T. 4.5 2041/04/25 フランス	国債証券	31,874,400	160.49 51,155,543	161.95 51,622,822	4.500000 2041/4/25	0.78%
24	US TREASURY N/B 2.875% 2043/05/15 アメリカ	国債証券	48,181,500	99.99 48,177,645	101.37 48,843,995	2.875000 2043/5/15	0.74%
25	BTPS 2.0% 2025/12/01 イタリア	国債証券	44,889,780	100.30 45,027,591	104.01 46,690,757	2.000000 2025/12/1	0.71%
26	AUSTRALIAN GOVT. 5.75% 2022/07/15 オーストラリア	国債証券	39,040,200	116.52 45,492,373	116.21 45,370,958	5.750000 2022/7/15	0.69%
27	BTPS 5.75 2/1/2033 イタリア	国債証券	30,546,300	137.99 42,153,283	143.53 43,845,853	5.750000 2033/2/1	0.66%
28	FRANCE O.A.T. 2.75% 2027/10/25 フランス	国債証券	35,858,700	118.28 42,414,028	120.84 43,332,728	2.750000 2027/10/25	0.65%
29	US TREASURY N/B 2.25% 2027/02/15 アメリカ	国債証券	43,699,500	99.49 43,481,002	98.89 43,217,931	2.250000 2027/2/15	0.65%
30	FRANCE O.A.T. 5.75 2032/10/25 フランス	国債証券	25,897,950	162.57 42,103,074	165.96 42,982,050	5.750000 2032/10/25	0.65%

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成29年11月30日現在

種類	投資比率
国債証券	94.34%
特殊債券	0.43%
合計	94.77%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 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

平成29年11月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	295	20,047.98 5,914,155	19,623.31 5,788,878	- -	2.58%
2	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー	360	15,695.96 5,650,547	15,665.70 5,639,655	- -	2.52%
3	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	44	117,651.36 5,176,660	116,238.40 5,114,490	- -	2.28%
4	WELLS FARGO COMPANY アメリカ	株式 銀行	780	6,314.01 4,924,933	6,350.99 4,953,775	- -	2.21%
5	NESTLE SA-REGISTERED-B スイス	株式 食品・飲料・タバコ	500	9,647.09 4,823,546	9,669.85 4,834,929	- -	2.16%
6	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売り	230	18,419.89 4,236,576	19,860.86 4,567,998	- -	2.04%
7	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー	1,100	3,983.37 4,381,715	4,057.33 4,463,063	- -	1.99%
8	PEPSICO INC アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	330	12,350.14 4,075,549	13,091.92 4,320,334	- -	1.93%
9	THE WALT DISNEY CO. アメリカ	株式 メディア	360	11,052.61 3,978,940	11,792.14 4,245,171	- -	1.90%
10	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品・バイオテクノロジー	150	26,488.24 3,973,236	28,207.07 4,231,061	- -	1.89%
11	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品・バイオテクノロジー	442	9,516.18 4,206,155	9,527.57 4,211,186	- -	1.88%
12	US BANCORP アメリカ	株式 銀行	670	6,123.53 4,102,766	6,135.85 4,111,024	- -	1.84%
13	MEDTRONIC INC アイルランド	株式 ヘルスケア機器・サービス	440	8,832.40 3,886,259	9,200.42 4,048,187	- -	1.81%
14	VERIZON COMMUNICATIONS アメリカ	株式 電気通信サービス	720	5,313.40 3,825,655	5,591.29 4,025,732	- -	1.80%
15	ACCENTURE PLC-CL A アイルランド	株式 ソフトウェア・サービス	240	16,139.67 3,873,523	16,465.74 3,951,779	- -	1.76%
16	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	380	9,701.28 3,686,489	10,015.02 3,805,711	- -	1.70%
17	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP アメリカ	株式 銀行	240	15,534.60 3,728,306	15,656.74 3,757,619	- -	1.68%
18	EXELON CORP アメリカ	株式 公益事業	800	4,587.32 3,669,861	4,671.36 3,737,091	- -	1.67%
19	TELENOR ASA ノルウェー	株式 電気通信サービス	1,451	2,350.69 3,410,862	2,498.71 3,625,642	- -	1.62%
20	VEOLIA ENVIRONNEMENT フランス	株式 公益事業	1,252	2,719.28 3,404,544	2,829.51 3,542,555	- -	1.58%
21	VODAFONE GROUP PLC イギリス	株式 電気通信サービス	10,400	329.67 3,428,606	338.54 3,520,848	- -	1.57%
22	MUENCHENER RUECKVER AG-RE ドイツ	株式 保険	135	25,878.02 3,493,533	25,526.08 3,446,021	- -	1.54%
23	COMPASS GROUP PLC イギリス	株式 消費者サービス	1,503	2,502.99 3,762,000	2,277.49 3,423,081	- -	1.53%
24	ROSS STORES INC アメリカ	株式 小売り	400	7,185.76 2,874,306	8,510.19 3,404,079	- -	1.52%
25	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	270	12,477.88 3,369,029	12,309.81 3,323,649	- -	1.48%
26	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC アメリカ	株式 運輸	350	8,901.25 3,115,438	9,467.10 3,313,486	- -	1.48%

27	COLGATE-PALMOLIVE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	410	7,860.30 3,222,726	8,068.71 3,308,175	- -	1.48%
28	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A カナダ	株式 小売り	230	13,587.60 3,125,148	14,189.46 3,263,576	- -	1.46%
29	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD バミューダ	株式 公益事業	3,300	975.80 3,220,140	963.60 3,179,888	- -	1.42%
30	SOUTHERN CO/THE アメリカ	株式 公益事業	550	5,875.90 3,231,746	5,724.63 3,148,548	- -	1.41%

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成29年11月30日現在

種類	投資比率
株式	98.14%
合計	98.14%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

平成29年11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
医薬品・バイオテクノロジー	外国	11.14%
銀行		9.88%
ソフトウェア・サービス		9.42%
小売り		8.51%
公益事業		7.00%
電気通信サービス		6.56%
食品・飲料・タバコ		5.59%
ヘルスケア機器・サービス		5.48%
家庭用品・パーソナル用品		4.43%
素材		3.92%
資本財		3.79%
食品・生活必需品小売り		3.70%
メディア		3.44%
テクノロジー・ハードウェア		2.74%
保険		2.61%
消費者サービス		2.42%
各種金融		1.95%
エネルギー		1.83%
運輸		1.48%
耐久消費財・アパレル		1.37%
不動産	0.48%	
商業・専門サービス	0.40%	
合計		98.14%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各業種の時価の比率です。

## SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

平成29年11月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	COLOMBIA TES 10.0% 2024/07/24 コロンビア	国債証券	63,932,200	118.73 75,912,454	120.65 77,137,395	10.000000 2024/7/24	5.55%
2	BRAZIL NTN-F 10.0% 2021/01/01 ブラジル	国債証券	69,750,600	101.71 70,948,883	106.25 74,115,592	- 2021/1/1	5.33%
3	BRAZIL NTN-F 10.0% 2023/01/01 ブラジル	国債証券	68,024,100	100.55 68,404,132	104.45 71,055,934	- 2023/1/1	5.11%
4	MEXICAN BONOS 10.0% 2024/12/05 メキシコ	国債証券	58,249,800	117.31 68,335,439	115.60 67,340,263	10.000000 2024/12/5	4.84%
5	REP SOUTH AFRICA 10.5% 2026/12/21 南アフリカ	国債証券	55,268,000	111.31 61,519,643	107.16 59,228,504	10.500000 2026/12/21	4.26%
6	COLOMBIA TES 7.0% 2022/05/04 コロンビア	国債証券	49,150,210	102.64 50,448,982	104.96 51,591,009	7.000000 2022/5/4	3.71%
7	INDONESIA GOVT 8.25% 2036/05/15 インドネシア	国債証券	37,109,300	102.70 38,113,173	109.89 40,782,378	8.250000 2036/5/15	2.93%
8	BRAZIL NTN-B 6.0% 2045/05/15 ブラジル	国債証券	12,085,500	329.04 39,766,972	328.01 39,642,857	- 2045/5/15	2.85%
9	BRAZIL NTN-F 10.0% 2025/01/01 ブラジル	国債証券	36,601,800	100.31 36,718,574	103.20 37,775,619	- 2025/1/1	2.72%
10	INDONESIA GOVT 8.375% 2034/03/15 インドネシア	国債証券	30,079,200	102.25 30,755,982	109.96 33,076,291	8.375000 2034/3/15	2.38%
11	RUSSIA-OFZ 8.15% 2027/02/03 ロシア	国債証券	29,433,100	102.38 30,133,838	104.65 30,804,388	8.150000 2027/2/3	2.22%
12	REP SOUTH AFRICA 6.25% 2036/03/31 南アフリカ	国債証券	42,066,000	73.07 30,738,888	68.48 28,811,003	6.250000 2036/3/31	2.07%
13	MALAYSIA GOVT 3.492% 2020/03/31 マレーシア	国債証券	28,242,600	100.23 28,307,887	100.39 28,353,875	3.492000 2020/3/31	2.04%
14	MEXICAN BONOS 8.5 2029/05/31 メキシコ	国債証券	25,929,000	109.75 28,457,828	109.04 28,273,240	8.500000 2029/5/31	2.03%
15	PERU B SOBERANO 7.84% 2020/08/12 ペルー	国債証券	25,279,900	109.41 27,660,620	110.54 27,946,171	7.840000 2020/8/12	2.01%
16	RUSSIA-OFZ 7.05% 2028/01/19 ロシア	国債証券	25,651,300	93.49 23,982,735	96.76 24,822,506	7.050000 2028/1/19	1.79%
17	PERU B SOBERANO 8.2% 2026/08/12 ペルー	国債証券	20,085,400	115.70 23,238,854	122.39 24,583,726	8.200000 2026/8/12	1.77%
18	BRAZIL NTN-F 10.0% 2027/01/01 ブラジル	国債証券	23,135,100	100.14 23,169,320	102.48 23,709,313	- 2027/1/1	1.71%
19	TURKEY GOVT BOND 8.0% 2025/03/12 トルコ	国債証券	29,725,500	85.80 25,507,154	79.13 23,522,382	8.000000 2025/3/12	1.69%

20	MEXICAN BONOS 8.0% 2020/06/11 メキシコ	国債証券	22,733,100	102.75 23,360,014	102.14 23,221,634	8.000000 2020/6/11	1.67%
21	RUSSIA-OFZ 7.0% 2023/08/16 ロシア	国債証券	22,404,300	95.76 21,454,481	98.52 22,074,060	7.000000 2023/8/16	1.59%
22	PERU T-BOND 5.2% 2023/09/12 ペルー	国債証券	20,431,700	98.68 20,163,939	104.17 21,284,927	5.200000 2023/9/12	1.53%
23	MALAYSIA GOVT 4.059% 2024/09/30 マレーシア	国債証券	21,113,400	100.51 21,221,846	100.69 21,259,293	4.059000 2024/9/30	1.53%
24	INDONESIA GOVT 8.75% 2031/05/15 インドネシア	国債証券	18,517,300	109.75 20,323,172	114.71 21,241,935	8.750000 2031/5/15	1.53%
25	TURKEY GOVT BOND 10.6% 2026/02/11 トルコ	国債証券	23,214,200	98.78 22,932,436	90.83 21,087,314	10.600000 2026/2/11	1.52%
26	POLAND GOVT BOND 1.75% 2021/07/25 ポーランド	国債証券	21,488,000	97.61 20,974,594	98.12 21,085,959	1.750000 2021/7/25	1.52%
27	PERU T-BOND 5.7% 2024/08/12 ペルー	国債証券	19,392,800	101.73 19,729,276	106.48 20,650,810	5.700000 2024/8/12	1.49%
28	BRAZIL NTN-B 6.0% 2020/08/15 ブラジル	国債証券	6,215,400	306.37 19,042,712	322.59 20,050,569	- 2020/8/15	1.44%
29	MEXICAN BONOS 6.5% 2021/06/10 メキシコ	国債証券	19,959,300	97.86 19,533,672	98.10 19,580,272	6.500000 2021/6/10	1.41%
30	COLOMBIA TES 7.5% 2026/08/26 コロンビア	国債証券	18,038,280	104.93 18,928,506	106.45 19,202,470	7.500000 2026/8/26	1.38%

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成29年11月30日現在

種類	投資比率
国債証券	96.42%
合計	96.42%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

該当事項はありません。

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

該当事項はありません。

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

該当事項はありません。

（参考）マザーファンドの投資資産  
損保ジャパン日本債券マザーファンド  
該当事項はありません。

SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド

該当事項はありません。

SJAMスモールキャップ・マザーファンド

該当事項はありません。

損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

## SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

平成29年11月30日現在

種類	地域	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約 取引	日本	ポーランド・ズロチ買 / 円 売2018年01月	買建	4,830,000	152,083,659	152,241,600	10.95%
		トルコ・リラ買 / 円売2018 年01月	買建	2,396,000	66,651,688	66,632,760	4.79%
		ハンガリー・フォリント 買 / 円売2018年01月	買建	147,169,000	62,723,428	62,664,560	4.51%
		メキシコ・ペソ買 / 円売 2018年01月	買建	7,764,000	46,131,359	46,273,440	3.33%
		ルーマニア・レイ買 / 円売 2018年01月	買建	1,409,000	40,160,868	40,128,320	2.89%
		タイ・バーツ買 / 円売2018 年01月	買建	5,469,000	18,636,164	18,758,670	1.35%
		トルコ・リラ売 / 円買2018 年01月	売建	487,000	13,525,256	13,543,470	0.97%
		南アフリカ・ランド売 / 円 買2018年01月	売建	1,125,000	8,898,975	9,135,000	0.66%
直物為替 先渡取引	日本	チリ・ペソ買 / 円売2018年1 月	買建	23,794,893	23,794,893	23,486,864	1.69%
		インドネシア・ルピア買 / 円売2018年1月	買建	13,705,054	13,705,054	13,694,803	0.99%
		ブラジル・レアル売 / 円買 2018年1月	売建	190,375,313	190,375,313	193,211,730	13.90%
		コロンビア・ペソ売 / 円買 2018年1月	売建	23,552,880	23,552,880	23,354,489	1.68%
		インドネシア・ルピア売 / 円買2018年1月	売建	73,391,780	73,391,780	72,927,651	5.25%
		ペルー・ソル売 / 円買2018 年1月	売建	85,036,982	85,036,982	85,347,720	6.14%
		ロシア・ルーブル売 / 円買 2018年1月	売建	46,031,375	46,031,375	46,097,100	3.32%

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

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

(注3) 直物為替先渡取引の時価は、価格提供会社の提供する価額で評価しております。直物為替先渡取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

直近日(平成29年11月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成29年11月2日)	7,542,403	7,542,403	1.2498	1.2498
平成28年11月末日	5,373,285	-	1.0747	-
12月末日	5,612,362	-	1.1225	-
平成29年1月末日	5,552,052	-	1.1104	-
2月末日	5,604,593	-	1.1209	-
3月末日	5,713,043	-	1.1167	-
4月末日	5,779,971	-	1.1234	-
5月末日	5,859,395	-	1.1325	-
6月末日	6,105,070	-	1.1545	-
7月末日	6,246,841	-	1.1673	-
8月末日	6,745,382	-	1.1706	-
9月末日	7,050,607	-	1.2114	-
10月末日	7,453,556	-	1.2351	-
11月末日	7,860,858	-	1.2493	-

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

直近日（平成29年11月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成29年11月2日)	6,662,973	6,662,973	1.1900	1.1900
平成28年11月末日	5,281,266	-	1.0563	-
12月末日	5,477,078	-	1.0954	-
平成29年1月末日	5,412,987	-	1.0826	-
2月末日	5,447,586	-	1.0895	-
3月末日	5,542,421	-	1.0868	-
4月末日	5,582,097	-	1.0926	-
5月末日	5,628,735	-	1.0996	-
6月末日	5,749,884	-	1.1171	-
7月末日	6,110,965	-	1.1273	-
8月末日	6,690,275	-	1.1317	-
9月末日	6,059,976	-	1.1634	-
10月末日	6,601,030	-	1.1790	-
11月末日	6,925,694	-	1.1897	-

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

直近日（平成29年11月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成29年11月2日)	20,568,205	20,568,205	1.1398	1.1398
平成28年11月末日	5,205,573	-	1.0411	-
12月末日	5,372,787	-	1.0746	-
平成29年1月末日	5,307,268	-	1.0615	-
2月末日	5,323,433	-	1.0647	-
3月末日	5,428,847	-	1.0619	-
4月末日	5,486,210	-	1.0673	-
5月末日	5,592,789	-	1.0713	-
6月末日	6,112,590	-	1.0869	-
7月末日	6,206,929	-	1.0937	-
8月末日	16,364,315	-	1.0980	-
9月末日	16,781,556	-	1.1215	-
10月末日	20,411,504	-	1.1311	-
11月末日	14,945,306	-	1.1388	-

## 【分配の推移】

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

	収益率(%)
第1計算期間	25.0

(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。

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

	収益率(%)
第1計算期間	19.0

(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。

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

	収益率(%)
第1計算期間	14.0

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

	設定口数	解約口数
第1計算期間	6,104,082	69,288

(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。

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

	設定口数	解約口数
第1計算期間	20,589,294	14,990,300

(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。

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

	設定口数	解約口数
第1計算期間	18,121,057	75,731

(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。

## &lt; 参考情報 &gt;

基準日:2017年11月30日

## ● 基準価額・純資産の推移 2016/10/25 ~ 2017/11/30

## ● 分配の推移

## ● SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055



## ● SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

2017年11月	0円
—	—
—	—
—	—
—	—
設定来累計	0円

● 1万口当たり、税引前

## ● SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045



## ● SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

2017年11月	0円
—	—
—	—
—	—
—	—
設定来累計	0円

● 1万口当たり、税引前

## ● SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035



## ● SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

2017年11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として計算しています。
- 基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

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

## ● 主要な資産の状況

資産別構成	SOMPO		
	ターゲットイヤー・ ファンド2055	ターゲットイヤー・ ファンド2045	ターゲットイヤー・ ファンド2035
資産の種類	純資産比	純資産比	純資産比
損保ジャパン日本債券マザーファンド	6.73%	21.47%	33.67%
S J A Mラージキャップ・バリュー・マザーファンド	17.18%	14.07%	13.12%
S J A Mスモールキャップ・マザーファンド	16.87%	13.83%	12.95%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	2.88%	2.95%	5.57%
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	35.01%	26.08%	14.24%
SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド	2.07%	6.54%	11.36%
ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	16.28%	12.67%	6.99%
コール・ローン等	2.96%	2.38%	2.10%
合 計	100.00%	100.00%	100.00%

### ● 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
1	380 2年国債	国債証券	2019/09/15
2	381 2年国債	国債証券	2019/10/15
3	344 10年国債	国債証券	2026/09/20
4	133 5年国債	国債証券	2022/09/20
5	55 30年国債	国債証券	2047/06/20
組入銘柄数			83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
1	第一生命HLDGS	保険業
2	本田技研	輸送用機器
3	新日鐵住金	鉄鋼
4	JFEホールディングス	鉄鋼
5	三菱重工業	機械
組入銘柄数		26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
1	ケースホールディングス	小売業
2	ジーエス・ユアサコーポ	電気機器
3	シチズン時計	精密機器
4	青山商事	小売業
5	伊予銀行	銀行業
組入銘柄数		72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。
- 最新の運用実績は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

## ● 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	US TREASURY N/B 1.25%	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2019/06/30	13.4%
2	US TREASURY N/B 1.875%	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2022/02/28	7.8%
3	US TREASURY N/B 2.125%	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2024/02/29	6.2%
4	BUNDESSCHATZANW 0.0%	ドイツ	国債証券	ユーロ	2019/06/14	5.4%
5	BTPS 1.35%	イタリア	国債証券	ユーロ	2022/04/15	5.3%
組入銘柄数					124銘柄	

## ● 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

組入上位5銘柄					
	銘柄名	通貨	発行国/地域	業種	純資産比
1	FACEBOOK INC-A	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	2.6%
2	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ・ドル	アメリカ	ヘルスケア	2.5%
3	ALPHABET INC-CL A	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	2.3%
4	WELLS FARGO COMPANY	アメリカ・ドル	アメリカ	金融	2.2%
5	NESTLE SA-REGISTERED-B	スイス・フラン	スイス	生活必需品	2.2%
組入銘柄数			84銘柄		

## ● SNAM コルチェスター・エマージング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	COLOMBIA TES 10.0%	コロンビア	国債証券	コロンビア・ペソ	2024/07/24	5.6%
2	BRAZIL NTN-F 10.0%	ブラジル	国債証券	ブラジルレアル	2021/01/01	5.3%
3	BRAZIL NTN-F 10.0%	ブラジル	国債証券	ブラジルレアル	2023/01/01	5.1%
4	MEXICAN BONOS 10.0%	メキシコ	国債証券	メキシコ・ペソ	2024/12/05	4.8%
5	REP SOUTH AFRICA 10.5%	南アフリカ	国債証券	南アフリカ・ランド	2026/12/21	4.3%
組入銘柄数					56銘柄	

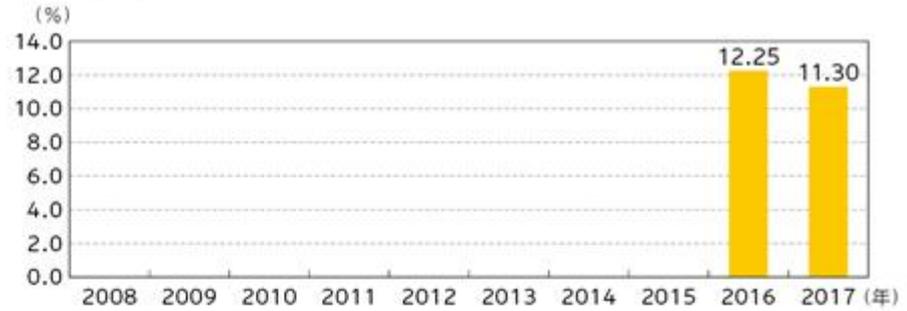
● 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

● 最新の運用実績は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。

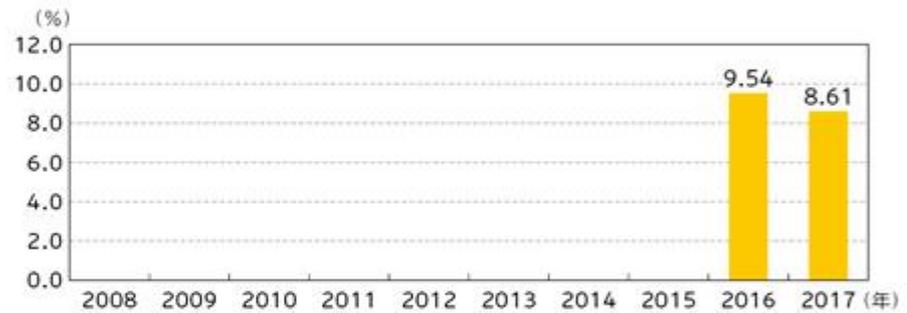
● 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

## 年間収益率の推移（暦年ベース）

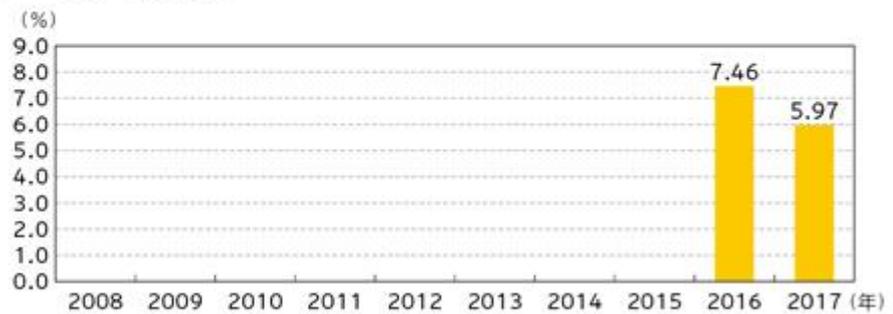
### ● SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055



### ● SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045



### ● SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035



- 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。
- 2016年は設定日（10月25日）から年末、2017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。
- 最新の運用実績は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

(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、継続申込期間中であっても、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、ユーロネクスト・パリのいずれかの休業日、あるいはニューヨーク、ロンドンまたはシンガポールの銀行の休業日においては、取得のお申込みを受付けないものとします。

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

委託会社は、取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。ファンドには、分配金を受け取る「一般コース」と、収益の分配がなされた場合で税金を差引いた後に分配金を再投資する「自動けいぞく投資コース」があり、ファンドの取得申込みの際に、いずれかのコースをお選びいただくこととなります。

販売会社によってはいずれか一つのコースのみの取扱いとなる場合もあります。

(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投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されることがあります。

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

損保ジャパン日本興亜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 <http://www.sjnk-am.co.jp/>

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

自動けいぞく投資契約に基づき収益分配金を再投資する場合は、手数料はかかりません。

申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

- (5) お申込単位は、販売会社が定める単位とします。  
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、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、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、ユーロネクスト・パリのいずれかの休業日、あるいはニューヨーク、ロンドンまたはシンガポールの銀行の休業日においては、一部解約の実行の請求を受付けないものとし、一部解約の受付は原則として午後3時までとし、それ以降のお申込みは翌営業日の取扱いとなります（受付時間については、販売会社により異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社にご確認ください。）。
- (2) 受益者は、自己に帰属する受益権について、販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。  
一部解約の単位の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。
- (3) 一部解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。解約代金は原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社の営業所等で支払われます。解約に係る手数料はありません。

ご換金時には税金が課せられます。詳しくは有価証券届出書「第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 4手数料等及び税金（5）課税上の取扱い」をご参照ください。

- (4) 委託会社は、換金の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、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、一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付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投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。

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

基準価額は、毎営業日に委託会社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

損保ジャパン日本興亜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 <http://www.sjnk-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51条第1項、第53条第1項、第54条第1項および第56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11月3日から翌年11月2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。

#### (5)【その他】

信託契約の解約

( ) 委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合、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っ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、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っ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52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52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。受託会社は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52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っ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、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っ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。
- ( ) 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にあっても、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。

#### 運用報告書に記載すべき事項の提供

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

#### 公告

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

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

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

#### 関係法人との契約の更改等

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

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

#### 信託事務処理の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について資産管理サービス信託銀行株式会社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。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としす。）に、原則として決算日から起算して5営業日目までにお支払いを開始します。収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。ただし、委託会社自ら勧誘した受益者に対する支払いは委託会社において行うものとします。

「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後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。

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

### (2) 償還金に対する請求権

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

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

### (3) 一部解約の実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、販売会社が定める単位をもって、受益権の一部解約の実行を請求することができます。ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、法兰克福証券取引所、ユーロネクスト・パリのいずれかの休業日、あるいはニューヨーク、ロンドンまたはシンガポールの銀行の休業日においては、一部解約の実行の請求を受付けないものとします。

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

### (4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### (5) 反対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）（以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、平成28年10月25日から平成29年11月2日までの財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期
		平成29年11月2日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		233,229
投資信託受益証券		1,299,873
親投資信託受益証券		6,050,440
流動資産合計		7,583,542
資産合計		7,583,542
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		1,036
未払委託者報酬		40,042
その他未払費用		61
流動負債合計		41,139
負債合計		41,139
純資産の部		
元本等		
元本		6,034,794
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,507,609
純資産合計		7,542,403
負債純資産合計		7,583,542

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 1 期 自 平成28年10月25日 至 平成29年11月 2 日
<b>営業収益</b>	
受取配当金	14,282
有価証券売買等損益	1,410,776
為替差損益	87,229
<b>営業収益合計</b>	<b>1,512,287</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	6
受託者報酬	1,903
委託者報酬	72,455
その他費用	108,051
<b>営業費用合計</b>	<b>182,415</b>
営業利益又は営業損失（ ）	1,329,872
経常利益又は経常損失（ ）	1,329,872
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,329,872
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（ ）	9,082
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	187,534
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	187,534
剰余金減少額又は欠損金増加額	715
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	715
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,507,609

## (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	<p>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。</p> <p>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。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</p> <p>但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> <p>第1期計算期間の取扱い 当ファンドは平成28年10月25日に設定されたため、当計算期間は平成28年10月25日から平成29年11月2日までとなっております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	第1期	
	平成29年11月2日現在	
1．受益権の総数	6,034,794口	
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2498円 (12,498円)	

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期	
	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2日	
1．その他費用	その他費用の内訳は、監査費用（113円）、保管費用（107,926円）、その他（12円）となっております。	
2．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	395円	
3．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（113,016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（1,207,774円）、信託約款に規定される収益調整金（186,819円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は1,507,609円（1万口当たり2,498.19円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	

## （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1期 自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2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。
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。
3．金融商品に係るリスク管理体制	（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。 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。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期
	平成29年11月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第1期
平成29年11月2日現在
該当事項はありません。

## （その他の注記）

項目	第1期	
	自 平成28年10月25日	至 平成29年11月2日
期首元本額		5,000,000円
期中追加設定元本額		1,104,082円
期中一部解約元本額		69,288円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第1期 平成29年11月2日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	239,214
親投資信託受益証券	1,101,764
合計	1,340,978

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成29年11月2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	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	245.00	11,397.40	
	アメリカ・ドル	小計	245.00	11,397.40 (1,299,873)	
投資信託受益証券 合計			245	1,299,873 (1,299,873)	
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	368,557	518,559	
		SJAMラージキャップ・バリュース・マザーファンド	628,659	1,265,490	
		SJAMスモールキャップ・マザーファンド	473,785	1,266,285	
		損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド	139,739	218,132	
		SOMPO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	2,087,648	2,618,954	
		SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド	139,453	163,020	
日本円 小計			3,837,841	6,050,440	
親投資信託受益証券 合計			3,837,841	6,050,440	
合計				7,350,313 (1,299,873)	

(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
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	17.23%	17.68%

(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ターゲットイヤー・ファンド2045】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期
		平成29年11月2日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		263,934
投資信託受益証券		795,840
親投資信託受益証券		5,645,430
流動資産合計		6,705,204
資産合計		6,705,204
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		1,083
未払委託者報酬		41,075
その他未払費用		73
流動負債合計		42,231
負債合計		42,231
純資産の部		
元本等		
元本		5,598,994
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,063,979
純資産合計		6,662,973
負債純資産合計		6,705,204

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第 1 期 自 平成28年10月25日 至 平成29年11月 2 日
<b>営業収益</b>	
受取配当金	10,458
有価証券売買等損益	1,087,315
為替差損益	78,590
<b>営業収益合計</b>	<b>1,176,363</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	109
受託者報酬	1,906
委託者報酬	72,750
その他費用	108,033
<b>営業費用合計</b>	<b>182,798</b>
営業利益又は営業損失（ ）	993,565
経常利益又は経常損失（ ）	993,565
当期純利益又は当期純損失（ ）	993,565
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（ ）	519,810
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,092,518
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,092,518
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,502,294
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,502,294
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,063,979

## (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	<p>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。</p> <p>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。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</p> <p>但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> <p>第1期計算期間の取扱い 当ファンドは平成28年10月25日に設定されたため、当計算期間は平成28年10月25日から平成29年11月2日までとなっております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	第1期	
	平成29年11月2日現在	
1. 受益権の総数		5,598,994口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）		1.1900円 (11,900円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期	
	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2日	
1. その他費用	その他費用の内訳は、監査費用（124円）、保管費用（107,906円）、その他（3円）となっております。	
2. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額		1,629円
3. 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（88,412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（385,343円）、信託約款に規定される収益調整金（590,224円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は1,063,979円（1万口当たり1,900.30円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	

## （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1期 自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2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。
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>（1）金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>（2）金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>
3．金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期
	平成29年11月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第1期
平成29年11月2日現在
該当事項はありません。

## （その他の注記）

項目	第1期
	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2日
期首元本額	5,000,000円
期中追加設定元本額	15,589,294円
期中一部解約元本額	14,990,300円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第1期
	平成29年11月2日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	57,802
親投資信託受益証券	380,033
合計	437,835

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成29年11月2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	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	150.00	6,978.00	
	アメリカ・ドル	小計	150.00	6,978.00 (795,840)	
投資信託受益証券 合計			150	795,840 (795,840)	
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	1,034,390	1,455,386	
		SJAMラージキャップ・バリュース・マザーファンド	452,446	910,773	
		SJAMスモールキャップ・マザーファンド	343,512	918,104	
		損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド	125,590	196,045	
		SOMPO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	1,372,162	1,721,377	
		SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド	379,594	443,745	
日本円 小計			3,707,694	5,645,430	
親投資信託受益証券 合計			3,707,694	5,645,430	
合計				6,441,270 (795,840)	

(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
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	11.94%	12.36%

(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ターゲットイヤー・ファンド2035】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期
		平成29年11月2日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		494,586
投資信託受益証券		1,469,652
親投資信託受益証券		18,668,629
流動資産合計		20,632,867
資産合計		20,632,867
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		1,663
未払委託者報酬		62,819
その他未払費用		180
流動負債合計		64,662
負債合計		64,662
純資産の部		
元本等		
元本		18,045,326
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,522,879
純資産合計		20,568,205
負債純資産合計		20,632,867

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第 1 期 自 平成28年10月25日 至 平成29年11月 2 日
<b>営業収益</b>	
受取配当金	5,833
有価証券売買等損益	1,389,449
為替差損益	67,518
<b>営業収益合計</b>	<b>1,462,800</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	59
受託者報酬	2,457
委託者報酬	93,973
その他費用	109,252
<b>営業費用合計</b>	<b>205,741</b>
営業利益又は営業損失（ ）	1,257,059
経常利益又は経常損失（ ）	1,257,059
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,257,059
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（ ）	4,427
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,272,353
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,272,353
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,106
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,106
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,522,879

## (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	<p>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。</p> <p>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。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</p> <p>但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> <p>第1期計算期間の取扱い 当ファンドは平成28年10月25日に設定されたため、当計算期間は平成28年10月25日から平成29年11月2日までとなっております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	第1期	
	平成29年11月2日現在	
1．受益権の総数	18,045,326口	
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1398円 (11,398円)	

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期	
	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2日	
1．その他費用	その他費用の内訳は、監査費用（230円）、保管費用（109,011円）、その他（11円）となっております。	
2．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	4,415円	
3．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（165,308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（1,087,324円）、信託約款に規定される収益調整金（1,270,247円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は2,522,879円（1万口当たり1,398.08円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	

## （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1期 自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2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。
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>（1）金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>（2）金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>
3．金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期
	平成29年11月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第1期
平成29年11月2日現在
該当事項はありません。

## （その他の注記）

項目	第1期
	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2日
期首元本額	5,000,000円
期中追加設定元本額	13,121,057円
期中一部解約元本額	75,731円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第1期
	平成29年11月2日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	129,642
親投資信託受益証券	1,140,033
合計	1,269,675

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成29年11月2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	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI EMERGING MKT ETF	277.00	12,886.04	
	アメリカ・ドル	小計	277.00	12,886.04 (1,469,652)	
投資信託受益証券 合計			277	1,469,652 (1,469,652)	
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	4,970,421	6,993,382	
		S J A M ラージキャップ・バリュー・マザーファンド	1,302,860	2,622,657	
		S J A M スモールキャップ・マザーファンド	985,271	2,633,333	
		損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド	742,461	1,158,981	
		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	2,316,059	2,905,496	
		SNAM コルチェスター・エマーシング債券マザーファンド	2,014,355	2,354,780	
日本円 小計			12,331,427	18,668,629	
親投資信託受益証券 合計			12,331,427	18,668,629	
合計				20,138,281 (1,469,652)	

(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せん。

(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
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	7.15%	7.30%

(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。

## &lt;参考&gt;

「SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055」、「SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045」及び「SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035」は、「損保ジャパン日本債券マザーファンド」「SJAMラージキャップ・バリュース・マザーファンド」「SJAMスモールキャップ・マザーファンド」「損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド」「SOMPO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」「SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券です。なお、同マザーファンドの状況は次のとおりです。

\*なお、以下は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

## 損保ジャパン日本債券マザーファンドの状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	平成29年11月2日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	528,780,888
国債証券	9,346,662,000
特殊債券	813,982,949
社債券	4,971,722,400
未収入金	1,252,894,500
未収利息	17,789,680
前払費用	2,433,738
流動資産合計	16,934,266,155
資産合計	16,934,266,155
負債の部	
流動負債	
未払金	1,454,420,300
その他未払費用	1,947
流動負債合計	1,454,422,247
負債合計	1,454,422,247
純資産の部	
元本等	
元本	11,002,070,281
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,477,773,627
純資産合計	15,479,843,908
負債純資産合計	16,934,266,155

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年11月2日現在
1．受益権の総数	11,002,070,281口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4070円 (14,070円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2日
<p>1．金融商品に対する取組方針</p> <p>2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク</p> <p>3．金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。</p> <p>（１）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>（２）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> <p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年11月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

平成29年11月2日現在
該当事項はありません。

## （その他の注記）

項目	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2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	9,655,462,931円
同期中追加設定元本額	2,007,059,980円
同期中一部解約元本額	660,452,630円
元本の内訳*	
ファンド名	
マルチアセット 動的アロケーションファンド 成長型（適格機関投資家専用）	100,857円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 標準型（適格機関投資家専用）	631,405円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 安定型（適格機関投資家専用）	1,147,058円
SNAM絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用）	119,470,915円
損保ジャパン日本債券ファンド	1,041,279,719円
ハッピーエイジング20	142,531,930円
ハッピーエイジング30	701,455,429円
ハッピーエイジング40	3,446,869,398円
ハッピーエイジング50	2,657,475,876円
ハッピーエイジング60	2,345,933,714円
パン・アフリカ株式ファンド	17,629,944円
人民元建て債券ファンド	1,487,427円
好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 円ヘッジありコース	3,524,662円
好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 円ヘッジなしコース	28,269,024円
好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 通貨セレクトコース	463,399,490円
好配当米国株式プレミアム・ファンド 通貨セレクトコース	767,834円
好配当米国株式プレミアム・ファンド 通貨セレクト・プレミアムコース	19,516,165円
好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 米ドルプレミアムコース	748,862円

インド株式集中投資ファンド	3,457,204円
SOMPOターゲットイヤー・ ファンド2035	4,970,421円
SOMPOターゲットイヤー・ ファンド2045	1,034,390円
SOMPOターゲットイヤー・ ファンド2055	368,557円
計	11,002,070,281円

\*当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年11月2日現在
	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	4,464,800
特殊債券	594,903
社債券	6,770,200
合計	11,829,903

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成29年11月2日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	380 2年国債	2,040,000,000	2,050,240,800	
	381 2年国債	1,000,000,000	1,005,240,000	
	133 5年国債	540,000,000	545,281,200	
	9 40年国債	140,000,000	113,407,000	
	340 10年国債	80,000,000	82,615,200	
	342 10年国債	200,000,000	201,672,000	
	344 10年国債	800,000,000	805,664,000	
	345 10年国債	320,000,000	322,035,200	
	348 10年国債	50,000,000	50,245,500	
	35 30年国債	370,000,000	473,699,900	
	53 30年国債	100,000,000	94,164,000	
	54 30年国債	60,000,000	59,504,400	
	55 30年国債	540,000,000	534,875,400	
	109 20年国債	120,000,000	144,109,200	
	113 20年国債	230,000,000	282,791,900	
	130 20年国債	70,000,000	84,770,000	
	131 20年国債	50,000,000	59,878,000	
	146 20年国債	170,000,000	204,963,900	
	148 20年国債	160,000,000	188,041,600	
	149 20年国債	90,000,000	105,754,500	
	150 20年国債	160,000,000	185,428,800	
	151 20年国債	260,000,000	292,619,600	
	152 20年国債	240,000,000	270,076,800	
	154 20年国債	370,000,000	415,891,100	
	157 20年国債	120,000,000	113,193,600	
	158 20年国債	380,000,000	377,720,000	
159 20年国債	20,000,000	20,190,400		
160 20年国債	90,000,000	92,281,500		
162 20年国債	70,000,000	70,186,200		
21	メキシコ国債	100,000,000	100,120,300	
国債証券 合計		8,940,000,000	9,346,662,000	
特殊債券	4 住宅金融RMB S	33,216,000	33,700,953	
	6 住宅金融RMB S	49,824,000	51,333,666	
	17 住宅金融RMB S	14,987,000	15,546,015	
	31 住宅金融RMB S	18,655,000	19,625,060	
	42 住宅金融RMB S	36,562,000	39,231,026	
	49 住宅機構RMB S	42,157,000	45,133,284	
	50 住宅機構RMB S	42,467,000	45,295,302	
	52 住宅機構RMB S	49,059,000	52,046,693	
	60 住宅機構RMB S	59,118,000	62,286,724	
	65 住宅機構RMB S	63,926,000	66,687,603	
	66 住宅機構RMB S	63,683,000	66,319,476	
	73 住宅機構RMB S	65,164,000	68,734,987	
	78 住宅機構RMB S	119,336,000	124,324,244	
79 住宅機構RMB S	118,754,000	123,717,916		
特殊債券 合計		776,908,000	813,982,949	
社債券	7 B P C E S . A .	100,000,000	100,660,400	
	1 B P C E S . A . 劣後	100,000,000	107,368,600	
	1 クレディ・A 劣後	100,000,000	108,369,600	
	5 クレディ・A 劣後FR	100,000,000	103,260,000	

1	エイチエスピーシーHD	200,000,000	201,480,000	
1 8	ルノー	100,000,000	99,930,700	
4	ソシエテG 劣後	100,000,000	106,752,200	
1	ソシエテ ジェネラル	100,000,000	100,344,500	
2 3	前田建設	100,000,000	99,653,500	
1	積水ハウス劣後FR	100,000,000	100,938,000	
3 1	双日	100,000,000	101,947,100	
2	ユニゾHD	100,000,000	99,481,400	
3 0	東レ	200,000,000	200,510,400	
2 5	太平洋セメント	100,000,000	101,386,500	
2 9	富士電機	100,000,000	99,951,800	
1 3	パナソニック	100,000,000	101,675,800	
1	三井住友FG劣後	100,000,000	102,904,500	
1	みずほFG劣後	200,000,000	206,834,800	
6 9	アコム	100,000,000	104,085,700	
7 1	アコム	100,000,000	100,870,900	
8	オリエントコーポレーション	100,000,000	99,687,200	
1 6 7	オリックス	100,000,000	100,159,100	
4 5 7	東京電力	100,000,000	102,074,500	
5 4 0	東京電力	300,000,000	302,237,100	
5 4 2	東京電力	200,000,000	201,471,600	
5 4 4	東京電力	300,000,000	303,705,000	
5 5 9	東京電力	100,000,000	102,567,500	
5 6 8	東京電力	100,000,000	102,734,700	
4 9 5	関西電力	100,000,000	102,369,600	
1	東京電力パワー	100,000,000	100,580,400	
2	東京電力パワー	100,000,000	100,978,500	
5 2	ソフトバンクグループ	200,000,000	204,736,800	
1 A	日本生命劣後FR	100,000,000	104,370,000	
2 A	日本生命劣後FR	100,000,000	99,155,000	
2 A	住友生命劣後FR	100,000,000	99,260,000	
3 A	富国生命劣後FR	200,000,000	198,540,000	
4 A	日本生命劣後FR	100,000,000	98,689,000	
3 A	明治安田劣後FR	200,000,000	200,000,000	
社債券 合計		4,900,000,000	4,971,722,400	
合計		14,616,908,000	15,132,367,349	

## 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ラージキャップ・バリュー・マザーファンドの状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	平成29年11月2日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	116,601,462
株式	39,203,471,340
未収入金	122,118,446
未収配当金	398,440,875
流動資産合計	39,840,632,123
資産合計	39,840,632,123
負債の部	
流動負債	
未払解約金	113,650,000
その他未払費用	62
流動負債合計	113,650,062
負債合計	113,650,062
純資産の部	
元本等	
元本	19,734,911,731
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	19,992,070,330
純資産合計	39,726,982,061
負債純資産合計	39,840,632,123

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年11月2日現在
1．受益権の総数	19,734,911,731口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0130円 (20,130円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2日
<p>1．金融商品に対する取組方針</p> <p>2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク</p> <p>3．金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。</p> <p>（１）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>（２）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> <p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年11月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。

## （関連当事者との取引に関する注記）

平成29年11月2日現在
該当事項はありません。

## （その他の注記）

項目	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2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	4,696,341,601円
同期中追加設定元本額	16,070,534,495円
同期中一部解約元本額	1,031,964,365円
元本の内訳*	
ファンド名	
マルチアセット 動的アロケーションファンド 成長型（適格機関投資家専用）	468,591円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 標準型（適格機関投資家専用）	341,600円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 安定型（適格機関投資家専用）	114,196円
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）	15,528,029,590円
ハッピーエイジング20	1,315,246,031円
ハッピーエイジング30	1,356,346,280円
ハッピーエイジング40	1,151,115,814円
ハッピーエイジング50	314,926,996円
ハッピーエイジング60	61,042,479円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	1,302,860円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	452,446円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	628,659円
SOMPO日本株バリュー・プラスファンド	4,896,189円
計	19,734,911,731円

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年11月2日現在
	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	3,027,869,705
合計	3,027,869,705

（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

平成29年11月2日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
野村不動産ホールディングス	249,500	2,494.00	622,253,000	
ツムラ	272,900	4,225.00	1,153,002,500	
フジ・メディア・ホールディングス	286,500	1,682.00	481,893,000	
新日鐵住金	1,118,500	2,694.00	3,013,239,000	
ジェイエフイーホールディングス	1,094,400	2,544.00	2,784,153,600	
三菱重工業	664,300	4,308.00	2,861,804,400	
マツダ	1,003,200	1,653.00	1,658,289,600	
本田技研工業	891,700	3,762.00	3,354,575,400	
三井物産	453,600	1,692.00	767,491,200	
三菱商事	560,400	2,694.00	1,509,717,600	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,505,600	773.80	1,165,033,280	
三井住友トラスト・ホールディングス	297,000	4,477.00	1,329,669,000	
三井住友フィナンシャルグループ	557,200	4,567.00	2,544,732,400	
静岡銀行	1,145,000	1,103.00	1,262,935,000	
みずほフィナンシャルグループ	13,096,500	207.20	2,713,594,800	
三菱UFJリース	1,393,600	608.00	847,308,800	
大和証券グループ本社	1,424,000	712.80	1,015,027,200	
野村ホールディングス	1,610,700	650.80	1,048,243,560	
ソニーフィナンシャルホールディングス	467,600	1,881.00	879,555,600	
第一生命ホールディングス	1,468,700	2,189.00	3,214,984,300	
日本郵船	957,700	2,564.00	2,455,542,800	
日本テレビホールディングス	344,500	2,045.00	704,502,500	
日本電信電話	127,600	5,565.00	710,094,000	
ヤマダ電機	1,824,800	606.00	1,105,828,800	
合計	32,815,500		39,203,471,340	

## (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・マザーファンドの状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	平成29年11月2日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	30,807,291
株式	8,298,587,700
未収配当金	70,430,050
流動資産合計	8,399,825,041
資産合計	8,399,825,041
負債の部	
流動負債	
その他未払費用	6
流動負債合計	6
負債合計	6
純資産の部	
元本等	
元本	3,142,857,592
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,256,967,443
純資産合計	8,399,825,035
負債純資産合計	8,399,825,041

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年11月2日現在
1．受益権の総数	3,142,857,592口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.6727円 (26,727円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2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。
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>（１）金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>（２）金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>
3．金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年11月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

平成29年11月2日現在
該当事項はありません。

## （その他の注記）

項目	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2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	3,606,398,742円
同期中追加設定元本額	82,140,791円
同期中一部解約元本額	545,681,941円
元本の内訳*	
ファンド名	
マルチアセット 動的アロケーションファンド 成長型（適格機関投資家専用）	347,464円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 標準型（適格機関投資家専用）	256,179円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 安定型（適格機関投資家専用）	84,621円
ハッピーエイジング20	980,197,392円
ハッピーエイジング30	1,020,421,687円
ハッピーエイジング40	856,398,169円
ハッピーエイジング50	234,301,635円
ハッピーエイジング60	45,397,346円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	985,271円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	343,512円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	473,785円
SOMPO日本株バリュー・プラスファンド	3,650,531円
計	3,142,857,592円

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年11月2日現在
	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	843,774,930
合計	843,774,930

（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

平成29年11月2日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
ホクト	41,900	2,006.00	84,051,400	
石油資源開発	27,900	2,393.00	66,764,700	
協和エクシオ	31,000	2,493.00	77,283,000	
大気社	50,900	3,370.00	171,533,000	
カワチ薬品	32,900	2,791.00	91,823,900	
エディオン	127,600	1,137.00	145,081,200	
アルペン	40,900	2,292.00	93,742,800	
日本毛織	88,000	1,023.00	90,024,000	
セントラル硝子	24,000	2,245.00	53,880,000	
E P Sホールディングス	69,800	2,245.00	156,701,000	
A D E K A	86,000	1,974.00	169,764,000	
日医工	93,000	1,753.00	163,029,000	
東和薬品	29,000	5,920.00	171,680,000	
りらいあコミュニケーションズ	55,000	1,343.00	73,865,000	
日新製鋼	61,800	1,643.00	101,537,400	
共英製鋼	48,000	1,815.00	87,120,000	
大和工業	54,800	3,140.00	172,072,000	
淀川製鋼所	6,000	3,205.00	19,230,000	
愛知製鋼	10,000	4,680.00	46,800,000	
U A C J	30,900	3,380.00	104,442,000	
明電舎	180,000	434.00	78,120,000	
ジーエス・ユアサコーポレーション	459,000	569.00	261,171,000	
サンケン電気	90,000	746.00	67,140,000	
日本信号	68,000	1,282.00	87,176,000	
日本航空電子工業	50,000	2,114.00	105,700,000	
新電元工業	12,000	7,780.00	93,360,000	
コーセル	54,000	1,518.00	81,972,000	
東海理化電機製作所	14,000	2,374.00	33,236,000	
ニチコン	28,000	1,438.00	40,264,000	
日立造船	142,000	570.00	80,940,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	65,800	1,324.00	87,119,200	
タチエス	42,100	2,119.00	89,209,900	
ケーヒン	47,900	2,162.00	103,559,800	
エクセディ	53,800	3,430.00	184,534,000	
愛三工業	82,800	1,290.00	106,812,000	
エフ・シー・シー	36,900	2,838.00	104,722,200	
シチズン時計	319,000	839.00	267,641,000	
トッパン・フォームズ	107,000	1,234.00	132,038,000	
オンワードホールディングス	75,000	948.00	71,100,000	
キャノンマーケティングジャパン	18,000	2,915.00	52,470,000	
阪和興業	13,000	4,360.00	56,680,000	
東邦ホールディングス	77,000	2,276.00	175,252,000	
島忠	59,800	3,220.00	192,556,000	
A O K Iホールディングス	106,700	1,578.00	168,372,600	
コメリ	34,000	3,165.00	107,610,000	
青山商事	60,000	4,190.00	251,400,000	
ゼビオホールディングス	81,700	2,189.00	178,841,300	
ケーズホールディングス	109,700	2,627.00	288,181,900	
七十七銀行	51,800	2,901.00	150,271,800	
十六銀行	5,000	3,795.00	18,975,000	
大垣共立銀行	5,000	3,215.00	16,075,000	

滋賀銀行	90,000	648.00	58,320,000	
百五銀行	55,000	537.00	29,535,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	14,000	1,865.00	26,110,000	
伊予銀行	281,200	972.00	273,326,400	
芙蓉総合リース	13,000	7,450.00	96,850,000	
興銀リース	61,800	2,945.00	182,001,000	
北洋銀行	439,100	384.00	168,614,400	
リコーリース	40,900	4,070.00	166,463,000	
日立キャピタル	50,800	2,766.00	140,512,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	49,800	737.00	36,702,600	
ダイビル	147,000	1,320.00	194,040,000	
イオンモール	15,000	2,048.00	30,720,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	67,000	1,192.00	79,864,000	
セイノーホールディングス	28,000	1,656.00	46,368,000	
日立物流	11,000	2,759.00	30,349,000	
住友倉庫	249,000	784.00	195,216,000	
テレビ朝日ホールディングス	25,000	2,275.00	56,875,000	
沖縄電力	31,000	2,819.00	87,389,000	
カブコン	63,800	2,931.00	186,997,800	
メイテック	31,000	5,400.00	167,400,000	
アークス	67,800	2,537.00	172,008,600	
合計	5,389,600		8,298,587,700	

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンドの状況

## 貸借対照表

（単位：円）

科 目	平成29年11月2日現在
資産の部	
流動資産	
預金	59,890,821
コール・ローン	244,298,213
国債証券	6,227,284,501
特殊債券	28,551,016
派生商品評価勘定	115,100
未収入金	444,181,547
未収利息	33,080,839
前払費用	3,269,674
流動資産合計	7,040,671,711
資産合計	7,040,671,711
負債の部	
流動負債	
未払金	370,530,894
その他未払費用	667
流動負債合計	370,531,561
負債合計	370,531,561
純資産の部	
元本等	
元本	4,272,980,041
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,397,160,109
純資産合計	6,670,140,150
負債純資産合計	7,040,671,711

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年11月2日現在
1．受益権の総数	4,272,980,041口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5610円 (15,610円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2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。
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>（１）金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務でありませぬ。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）に記載してあります。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>（２）金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されてあります。</p>
3．金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告してあります。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理してあります。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理してあります。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理してあります。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施してあります。</p>
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもありませぬ。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。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年11月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。

## （関連当事者との取引に関する注記）

平成29年11月2日現在
該当事項はありません。

## （その他の注記）

項目	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2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	3,817,731,686円
同期中追加設定元本額	630,220,522円
同期中一部解約元本額	174,972,167円
元本の内訳*	
ファンド名	
マルチアセット 動的アロケーションファンド 成長型（適格機関投資家専用）	54,673円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 標準型（適格機関投資家専用）	75,340円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 安定型（適格機関投資家専用）	365,899円
SNAM絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用）	13,529,185円
ハッピーエイジング20	386,661,256円
ハッピーエイジング30	1,585,710,653円
ハッピーエイジング40	1,416,680,904円
ハッピーエイジング50	463,697,931円
ハッピーエイジング60	155,196,418円
損保ジャパン外国債券ファンド（為替ヘッジなし）	249,999,992円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	742,461円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	125,590円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	139,739円
計	4,272,980,041円

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年11月2日現在	
	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券	3,800,331	
特殊債券	509,855	
合計	3,290,476	

（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）

## 通貨関連

種類	平成29年11月2日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売 建	231,981,600	-	231,928,000	53,600
ノルウェー・クローネ	72,789,600	-	72,748,000	41,600
ユーロ	159,192,000	-	159,180,000	12,000
買 建	233,679,500	-	233,741,000	61,500
アメリカ・ドル	233,679,500	-	233,741,000	61,500
合計	465,661,100	-	465,669,000	115,100

## （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

平成29年11月2日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY 27/11/15	110,000.00	147,089.80	
		US TREASURY N/B 1.0% 2018/11/30	10,000.00	9,943.70	
		US TREASURY N/B 1.25% 2018/12/31	1,950,000.00	1,943,448.00	
		US TREASURY N/B 1.25% 2019/03/31	730,000.00	727,204.10	
		US TREASURY N/B 1.25% 2019/06/30	6,670,000.00	6,632,981.50	
		US TREASURY N/B 1.875% 2022/02/28	4,610,000.00	4,593,404.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 2026/11/15	290,000.00	281,592.90	
		US TREASURY N/B 2.125% 2024/02/29	3,660,000.00	3,648,251.40	
		US TREASURY N/B 2.125% 2025/05/15	100,000.00	98,953.00	
		US TREASURY N/B 2.25% 2027/02/15	390,000.00	386,220.90	
		US TREASURY N/B 2.25% 2027/08/15	1,040,000.00	1,028,300.00	
		US TREASURY N/B 2.75% 2042/11/15	285,000.00	281,323.50	
		US TREASURY N/B 2.75% 2047/08/15	480,000.00	469,161.60	
		US TREASURY N/B 2.875% 2043/05/15	430,000.00	433,323.90	
		US TREASURY N/B 2.875% 2046/11/15	810,000.00	812,146.50	
		US TREASURY N/B 3.0% 2044/11/15	210,000.00	216,314.70	
		US TREASURY N/B 3.0% 2045/05/15	75,000.00	77,179.50	
		US TREASURY N/B 3.0% 2047/02/15	270,000.00	277,425.00	
		US TREASURY N/B 3.5% 2039/02/15	165,000.00	186,255.30	
		US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15	420,000.00	552,266.40	
			アメリカ・ドル 小計		22,705,000.00 (2,589,505,250)
	イギリス・ポンド	TREASURY 1.75% 2022/09/07	180,000.00	188,110.80	
		TREASURY 2.25% 2023/09/07	160,000.00	172,016.00	
		TREASURY 4.0 2060/01/22	60,000.00	100,862.40	
		TREASURY 4.25 2027/12/07	320,000.00	407,545.60	
		TREASURY 4.25 2036/03/07	189,000.00	260,557.29	
		TREASURY 4.25 2039/09/07	180,000.00	255,506.40	
		TREASURY 4.25 2040/12/07	30,000.00	43,103.70	
		TREASURY 4.25 2046/12/07	51,000.00	77,551.11	
		TREASURY 4.25 2049/12/07	160,000.00	252,409.60	

	TREASURY 4.25 2055/12/07	70,000.00	118,260.80	
	TREASURY 4.5 2034/09/07	125,000.00	174,695.00	
	TREASURY 4.5% 2042/12/07	70,000.00	106,000.30	
	TSY 4.25% 2032/06/07	70,000.00	93,359.70	
	UK TREASURY 6.0 2028/12/07	60,000.00	88,330.20	
	UK TSY GILT 1.5% 2026/07/22	400,000.00	408,348.00	
	UK TSY GILT 3.5% 2045/01/22	140,000.00	186,261.60	
イギリス・ポンド	小計	2,265,000.00 (342,717,150)	2,932,918.50 (443,779,898)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVT. 3.25% 2025/04/21	720,000.00	754,804.80	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75% 2027/04/21	160,000.00	187,859.20	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.25% 2019/03/15	110,000.00	115,144.70	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75% 2022/07/15	460,000.00	532,210.80	
オーストラリア・ドル	小計	1,450,000.00 (127,237,500)	1,590,019.50 (139,524,211)	
カナダ・ドル	CANADA-GOV'T 29/6/1	120,000.00	165,403.20	
	CANADA-GOVT 1.5% 2023/06/01	672,000.00	664,406.40	
	CANADA-GOVT 3.5 2020/06/01	90,000.00	94,661.10	
	CANADA-GOVT 3.5% 2045/12/01	70,000.00	86,923.90	
	CANADA-GOVT 4.25 2018/06/01	295,000.00	300,162.50	
	CANADA-GOVT 5.0 2037/06/01	100,000.00	143,193.00	
カナダ・ドル	小計	1,347,000.00 (119,492,370)	1,454,750.10 (129,050,882)	
スイス・フラン	SWISS (GOVT) 4.0% 2028/04/08	120,000.00	170,439.60	
スイス・フラン	小計	120,000.00 (13,662,000)	170,439.60 (19,404,548)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1.5% 2023/11/13	210,000.00	226,947.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5% 2025/05/12	700,000.00	811,286.00	
	Swedish Govt Bond	520,000.00	607,391.20	
スウェーデン・クローナ	小計	1,430,000.00 (19,419,400)	1,645,624.20 (22,347,577)	
デンマーク・クローネ	DENMARK - BULLET 1.5% 2023/11/15	1,350,000.00	1,479,262.50	
	DENMARK - BULLET 4.5 2039/11/15	410,000.00	694,228.40	
デンマーク・クローネ	小計	1,760,000.00 (31,363,200)	2,173,490.90 (38,731,609)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVT 2.0% 2023/05/24	750,000.00	781,740.00	
	NORWEGIAN GOVT 3.75% 2021/05/25	280,000.00	307,596.80	
	NORWEGIAN GOVT 4.5% 2019/05/22	390,000.00	413,715.90	
ノルウェー・クローネ	小計	1,420,000.00	1,503,052.70	

		(19,880,000)	(21,042,738)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVT BOND 1.5% 2020/04/25	3,500,000.00	3,468,605.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75 2022/09/23	333,000.00	379,626.66	
ポーランド・ズロチ 小計		3,833,000.00 (120,126,220)	3,848,231.66 (120,603,580)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVT 3.759% 2019/03/15	600,000.00	603,846.00	
	MALAYSIAN GOVT 3.48% 2023/03/15	255,000.00	248,933.55	
	MALAYSIAN GOVT 5.248% 2028/09/15	140,000.00	150,284.40	
	MALAYSIAN GOVT 5.734 2019/07/30	170,000.00	176,823.80	
マレーシア・リンギット 小計		1,165,000.00 (31,431,700)	1,179,887.75 (31,833,372)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONOS 5.0% 2019/12/11	1,000,000.00	960,930.00	
	MEXICAN BONOS 6.5% 2021/06/10	1,275,000.00	1,251,871.50	
	MEXICAN BONOS 8.0 2023/12/07	1,660,000.00	1,732,923.80	
	MEXICAN BONOS 8.5 2018/12/13	2,415,000.00	2,448,930.75	
	MEXICAN BONOS 8.5 2029/05/31	1,315,000.00	1,434,572.95	
	MEXICAN BONOS 8.5% 2038/11/18	670,000.00	737,716.90	
メキシコ・ペソ 小計		8,335,000.00 (49,843,300)	8,566,945.90 (51,230,336)	
ユーロ	BELGIAN 0291 5.5 2028/03/28	100,000.00	149,694.00	
	BELGIAN 0304 5.0% 2035/03/28	45,000.00	72,369.90	
	BELGIAN 0320 4.25% 2041/03/28	65,000.00	101,358.40	
	BELGIAN 0328 2.25% 2023/06/22	880,000.00	998,500.80	
	BELGIAN 0333 3.0% 2034/06/22	30,000.00	38,327.10	
	BTPS 0.65% 2020/11/01	530,000.00	539,741.40	
	BTPS 0.7% 2020/05/01	1,870,000.00	1,906,147.10	
	BTPS 1.35% 2022/04/15	2,540,000.00	2,636,824.80	
	BTPS 2.0% 2025/12/01	338,000.00	351,452.40	
	BTPS 2.45% 2033/09/01	110,000.00	111,355.20	
	BTPS 2.7% 2047/03/01	10,000.00	9,520.80	
	BTPS 3.25% 2046/09/01	120,000.00	127,819.20	
	BTPS 4.0 2020/09/01	270,000.00	300,653.10	
	BTPS 4.0 2037/02/01	50,000.00	61,054.00	
	BTPS 4.5 2020/02/01	160,000.00	176,737.60	
	BTPS 4.75% 2044/09/01	30,000.00	40,319.10	
	BTPS 5.0% 2022/03/01	210,000.00	251,338.50	
	BTPS 5.0% 2040/09/01	95,000.00	129,868.80	
	BTPS 5.75 2/1/2033	230,000.00	331,579.50	
	BTPS 7.25 2026/11/01	115,000.00	169,668.70	
	BUNDESREPUB 28/07/04	100,000.00	145,070.00	
	BUNDESSCHATZANW 0.0% 2019/06/14	1,860,000.00	1,884,031.20	
	DBR 6.5% 2027/07/04	35,000.00	55,722.45	

DEUTSCHLAND REP 0.25% 2027/02/15	670,000.00	667,306.60	
DEUTSCHLAND REP 0.5% 2025/02/15	100,000.00	103,716.00	
DEUTSCHLAND REP 1.0% 2024/08/15	30,000.00	32,210.70	
DEUTSCHLAND REP 2.5% 2046/08/15	140,000.00	184,577.40	
DEUTSCHLAND REP 4.0 2037/01/04	210,000.00	323,675.10	
DEUTSCHLAND REP 4.75 2034/07/04	40,000.00	64,623.60	
FRANCE (GOVT OF) 5.5% 2029/04/25	85,000.00	129,162.60	
FRANCE O.A.T. 0% 2019/02/25	2,600,000.00	2,622,360.00	
FRANCE O.A.T. 0.0% 2022/05/25	10,000.00	10,120.00	
FRANCE O.A.T. 1.0% 2027/05/25	60,000.00	62,187.00	
FRANCE O.A.T. 2.75% 2027/10/25	270,000.00	325,080.00	
FRANCE O.A.T. 3.25% 2045/05/25	10,000.00	13,557.00	
FRANCE O.A.T. 4.0 2038/10/25	110,000.00	162,962.80	
FRANCE O.A.T. 4.0 2060/04/25	20,000.00	32,617.60	
FRANCE O.A.T. 4.5 2041/04/25	240,000.00	384,708.00	
FRANCE O.A.T. 5.75 2032/10/25	195,000.00	322,132.20	
FRANCE(GOVT OF) 4.0% 04/25/55	70,000.00	111,604.50	
IRISH GOVT 0.8% 2022/03/15	210,000.00	219,376.50	
IRISH GOVT 1.0% 2026/05/15	150,000.00	155,101.50	
NETHERLANDS GOVT 2.25% 2022/07/15	195,000.00	218,862.15	
NETHERLANDS GOVT 2.5% 2033/01/15	70,000.00	86,516.50	
NETHERLANDS GOVT 4.0 2037/01/15	60,000.00	91,941.60	
NETHERLANDS GOVT 5.5 2028/01/15	75,000.00	112,813.50	
SPANISH GOVT 1.5% 2027/04/30	90,000.00	91,039.50	
SPANISH GOVT 4.4% 2023/10/31	345,000.00	422,794.05	
SPANISH GOVT 4.7% 2041/07/30	115,000.00	159,919.00	
SPANISH GOVT 4.85% 2020/10/31	605,000.00	694,346.40	
SPANISH GOVT 5.15% 2028/10/31	55,000.00	74,689.45	
SPANISH GOVT 5.4% 2023/01/31	170,000.00	214,047.00	
SPANISH GOVT 5.5% 2021/04/30	365,000.00	435,185.85	

		SPANISH GOVT 5.75% 2032/07/30	60,000.00	89,246.40	
		SPANISH GOVT 5.9% 2026/07/30	220,000.00	305,696.60	
		SPGB 4.2 01/31/37	120,000.00	155,557.20	
	ユーロ 小計		17,558,000.00 (2,329,068,700)	19,668,888.35 (2,609,078,040)	
国債証券 合計			5,793,746,790 (5,793,746,790)	6,227,284,501 (6,227,284,501)	
特殊債券	南アフリカ・ランド	EUROPEAN INVT BK 8.375% 2022/07/29	3,500,000.00	3,516,135.00	
	南アフリカ・ランド 小計		3,500,000.00 (28,420,000)	3,516,135.00 (28,551,016)	
特殊債券 合計			28,420,000 (28,420,000)	28,551,016 (28,551,016)	
合計			5,822,166,790 (5,822,166,790)	6,255,835,517 (6,255,835,517)	

- (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
南アフリカ・ランド	特殊債券 1銘柄	0.43%	0.46%
アメリカ・ドル	国債証券 20銘柄	38.99%	41.57%
イギリス・ポンド	国債証券 16銘柄	6.65%	7.09%
オーストラリア・ドル	国債証券 4銘柄	2.09%	2.23%
カナダ・ドル	国債証券 6銘柄	1.93%	2.06%
スイス・フラン	国債証券 1銘柄	0.29%	0.31%
スウェーデン・クローナ	国債証券 3銘柄	0.34%	0.36%
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	0.58%	0.62%
ノルウェー・クローネ	国債証券 3銘柄	0.32%	0.33%
ポーランド・ズロチ	国債証券 2銘柄	1.81%	1.93%
マレーシア・リングギット	国債証券 4銘柄	0.48%	0.51%
メキシコ・ペソ	国債証券 6銘柄	0.77%	0.82%
ユーロ	国債証券 56銘柄	39.12%	41.71%

(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。

## SOMPO外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）マザーファンドの状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	平成29年11月2日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,012,567
コール・ローン	4,130,052
株式	218,286,553
未収配当金	243,540
流動資産合計	223,672,712
資産合計	223,672,712
負債の部	
流動負債	
その他未払費用	237
流動負債合計	237
負債合計	237
純資産の部	
元本等	
元本	178,291,416
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	45,381,059
純資産合計	223,672,475
負債純資産合計	223,672,712

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年11月2日現在
1．受益権の総数	178,291,416口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2545円 (12,545円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2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。
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>（１）金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>（２）金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>
3．金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年11月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。

## （関連当事者との取引に関する注記）

平成29年11月2日現在
該当事項はありません。

## （その他の注記）

項目	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2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	102,900,000円
同期中追加設定元本額	81,897,624円
同期中一部解約元本額	6,506,208円
元本の内訳*	
ファンド名	
マルチアセット 動的アロケーションファンド 成長型（適格機関投資家専用）	812,968円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 標準型（適格機関投資家専用）	335,184円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 安定型（適格機関投資家専用）	60,262円
SNAM絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用）	62,525,376円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	2,316,059円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	1,372,162円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	2,087,648円
SOMPO外国株式アクティブバリュートファンド（リスク抑制型）	108,781,757円
計	178,291,416円

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年11月2日現在
	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	10,217,758
合計	10,217,758

（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

平成29年11月2日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
香港・ドル	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	3,300	67.70	223,410.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	3,200	45.70	146,240.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	1,000	77.25	77,250.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	2,500	30.65	76,625.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS	900	99.45	89,505.00	
香港・ドル 小計		10,900		613,030.00 (8,962,499)	
アメリカ・ドル	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	380	62.16	23,620.80	
	CISCO SYSTEMS INC	410	34.62	14,194.20	
	THE WALT DISNEY CO.	380	99.03	37,631.40	
	GENERAL ELECTRIC CO.	510	20.02	10,210.20	
	HOME DEPOT INC	230	165.38	38,037.40	
	JOHNSON & JOHNSON	360	139.98	50,392.80	
	COCA-COLA COMPANY	124	45.80	5,679.20	
	MERCK & CO. INC.	200	55.34	11,068.00	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	70	294.17	20,591.90	
	PEPSICO INC	330	110.13	36,342.90	
	PFIZER INC	1,100	35.26	38,786.00	
	PROCTER & GAMBLE CO	380	86.89	33,018.20	
	WELLS FARGO COMPANY	780	56.21	43,843.80	
	KROGER CO	660	20.90	13,794.00	
	CVS HEALTH CORPORATION	330	69.00	22,770.00	
	MCKESSON HBOC INC	50	139.67	6,983.50	
	KIMBERLY-CLARK CORP	210	112.05	23,530.50	
	AT&T INC	250	33.55	8,387.50	
	MEDTRONIC INC	280	80.31	22,486.80	
	VERIZON COMMUNICATIONS	720	47.83	34,437.60	
	CBS CORP-CLASS B	360	56.19	20,228.40	
	BANK OF NEW YORK CO INC	390	51.65	20,143.50	
	MONSANTO CO	100	121.14	12,114.00	
	CARDINAL HEALTH INC	310	62.18	19,275.80	
	GENERAL DYNAMICS CORP	100	201.62	20,162.00	
	EXPRESS SCRIPTS INC	330	62.32	20,565.60	
	INTUIT INC	170	151.36	25,731.20	
	TJX COMPANIES INC	370	69.72	25,796.40	
	GOOGLE INC-CL A	48	1,042.59	50,044.56	
	VALERO ENERGY CORP	120	80.71	9,685.20	
	APPLE INC	100	166.89	16,689.00	
	EXELON CORP	800	40.15	32,120.00	
	CARNIVAL CORP	270	64.57	17,433.90	
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	230	67.01	15,412.30	
BB&T CORP	570	49.55	28,243.50		
MASTERCARD INC-CLASS A	60	148.89	8,933.40		
VISA INC-CLASS A SHARES	270	111.07	29,988.90		
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	350	79.33	27,765.50		
ACCENTURE PLC-CL A	240	142.96	34,310.40		

	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	240	104.22	25,012.80	
	VMWARE INC-CLASS A	80	119.12	9,529.60	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	410	70.56	28,929.60	
	US BANCORP	670	54.48	36,501.60	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	240	136.94	32,865.60	
	F5 NETWORKS INC	100	120.60	12,060.00	
	AUTOZONE INC	35	584.88	20,470.80	
	JONES LANG LASALLE INC	20	130.80	2,616.00	
	ROSS STORES INC	400	63.48	25,392.00	
	SOUTHERN CO/THE	550	52.08	28,644.00	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	160	76.62	12,259.20	
	FACEBOOK INC-A	295	182.66	53,884.70	
	PHILLIPS 66	110	92.30	10,153.00	
	PPG INDUSTRIES INC	230	115.92	26,661.60	
アメリカ・ドル 小計		16,482		1,255,430.76 (143,181,879)	
イギリス・ポンド	VODAFONE GROUP PLC	10,400	2.18	22,765.60	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	1,260	13.51	17,028.90	
	COMPASS GROUP PLC	1,503	16.30	24,498.90	
	NATIONAL GRID PLC	972	8.98	8,735.36	
	IMPERIAL BRANDS PLC	283	30.73	8,698.00	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	856	7.97	6,826.60	
イギリス・ポンド 小計		15,274		88,553.36 (13,399,009)	
カナダ・ドル	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	230	157.51	36,227.30	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	230	60.45	13,903.50	
カナダ・ドル 小計		460		50,130.80 (4,447,103)	
シンガポール・ドル	OVERSEA-CHINESE BANKING	2,500	11.94	29,850.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,000	24.86	24,860.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	5,500	3.41	18,755.00	
シンガポール・ドル 小計		9,000		73,465.00 (6,161,510)	
スイス・フラン	NESTLE SA-REGISTERED-B	500	83.85	41,925.00	
	NOVARTIS AG-REG SHS	442	83.50	36,907.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	150	231.60	34,740.00	
	SWISS RE LTD	228	93.90	21,409.20	
	GIVAUDAN	9	2,244.00	20,196.00	
スイス・フラン 小計		1,329		155,177.20 (17,666,924)	
スウェーデン・クローナ	TELIASONERA AB	5,072	38.64	195,982.08	
スウェーデン・クローナ 小計		5,072		195,982.08 (2,661,436)	
デンマーク・クローネ	DANSKE BANK A/S	343	242.50	83,177.50	
デンマーク・クローネ 小計		343		83,177.50 (1,482,223)	
ノルウェー・クローネ	TELENOR ASA	1,451	174.90	253,779.90	
ノルウェー・クローネ 小計		1,451		253,779.90 (3,552,919)	
ユーロ	TOTAL SA	414	48.28	19,987.92	

	AKZO NOBEL	216	77.34	16,705.44	
	MUENCHENER RUECKVER AG-RE	147	194.60	28,606.20	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,252	20.39	25,534.54	
	VINCI S.A.	129	84.20	10,861.80	
	INDITEX	510	31.47	16,049.70	
	PUBLICIS GROUPE	157	55.32	8,685.24	
ユーロ	小計	2,825		126,430.84 (16,771,051)	
合計		63,136		218,286,553 (218,286,553)	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

(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	有価証券の合計金額 に対する比率
香港・ドル	株式 5銘柄	4.01%	4.11%
アメリカ・ドル	株式 53銘柄	64.01%	65.59%
イギリス・ポンド	株式 6銘柄	5.99%	6.14%
カナダ・ドル	株式 2銘柄	1.99%	2.04%
シンガポール・ドル	株式 3銘柄	2.75%	2.82%
スイス・フラン	株式 5銘柄	7.90%	8.09%
スウェーデン・クローナ	株式 1銘柄	1.19%	1.22%
デンマーク・クローネ	株式 1銘柄	0.66%	0.68%
ノルウェー・クローネ	株式 1銘柄	1.59%	1.63%
ユーロ	株式 7銘柄	7.50%	7.68%

(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。

## SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンドの状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	平成29年11月2日現在
資産の部	
流動資産	
預金	8,676,138
コール・ローン	26,776,972
国債証券	1,277,808,436
派生商品評価勘定	5,551,185
未収利息	16,640,869
前払費用	2,328,301
流動資産合計	1,337,781,901
資産合計	1,337,781,901
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,042,793
その他未払費用	480
流動負債合計	4,043,273
負債合計	4,043,273
純資産の部	
元本等	
元本	1,140,902,970
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	192,835,658
純資産合計	1,333,738,628
負債純資産合計	1,337,781,901

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成29年11月2日現在
1. 受益権の総数	1,140,902,970口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1690円 (11,690円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2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。
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>（１）金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務でありませぬ。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）に記載してあります。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引及び直物為替先渡取引であります。</p> <p>為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>直物為替先渡取引は信託財産に属する資産の効率的な運用または実質外貨建て資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>（２）金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されてあります。</p>
3．金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告してあります。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理してあります。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理してあります。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理してあります。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施してあります。</p>

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

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年11月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。

## (関連当事者との取引に関する注記)

平成29年11月2日現在
該当事項はありません。

## （その他の注記）

項目	自 平成28年10月25日 至 平成29年11月2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	990,000,000円
同期中追加設定元本額	159,080,630円
同期中一部解約元本額	8,177,660円
元本の内訳*	
ファンド名	
エマージング債券ファンド（為替戦略型・ヘッジなし）（適格機関投資家専用）	988,962,291円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 成長型（適格機関投資家専用）	942,339円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 標準型（適格機関投資家専用）	765,094円
マルチアセット 動的アロケーションファンド 安定型（適格機関投資家専用）	340,248円
SNAM絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用）	147,359,596円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	2,014,355円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	379,594円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	139,453円
計	1,140,902,970円

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年11月2日現在
	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	13,621,769
合計	13,621,769

（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）

## 通貨関連

種類	平成29年11月2日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売 建	5,495,013	-	5,382,690	112,323
南アフリカ・ランド	5,495,013	-	5,382,690	112,323
買 建	386,032,341	-	382,479,010	3,553,331
タイ・パーツ	17,951,150	-	18,018,720	67,570
トルコ・リラ	73,161,140	-	71,494,860	1,666,280
ハンガリー・フォリント	60,967,430	-	60,150,210	817,220
ポーランド・ズロチ	145,258,334	-	144,246,900	1,011,434
メキシコ・ペソ	49,470,630	-	49,717,120	246,490
ルーマニア・レイ	39,223,657	-	38,851,200	372,457
合計	391,527,354	-	387,861,700	3,441,008

## （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はありません。

種類	平成29年11月2日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引 直物為替先渡取引				
売 建	407,036,665	-	401,933,107	5,103,558
ブラジル・リアル	190,597,075	-	186,948,060	3,649,015
コロンビア・ペソ	21,336,844	-	20,705,603	631,241
インドネシア・ルピア	71,649,221	-	71,335,744	313,477
ペルー・ソル	83,571,496	-	83,592,740	21,244
ロシア・ルーブル	39,882,029	-	39,350,960	531,069
買 建	23,340,308	-	23,186,150	154,158
チリ・ペソ	23,340,308	-	23,186,150	154,158
合計	430,376,973	-	425,119,257	4,949,400

(注) 時価の算定方法

1. 価格提供会社の提供する価額で評価しております。
2. 直物為替先渡取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成29年11月2日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	南アフリカ・ランド	REP SOUTH AFRICA 10.5% 2026/12/21	5,710,000.00	6,223,157.70	
		REP SOUTH AFRICA 6.25% 2036/03/31	5,130,000.00	3,576,841.20	
		REP SOUTH AFRICA 7.0% 2031/02/28	2,930,000.00	2,359,030.90	
		REP SOUTH AFRICA 7.75% 2023/02/28	2,180,000.00	2,126,611.80	
		REP SOUTH AFRICA 8.75% 2048/2/28	2,210,000.00	1,944,092.80	
	南アフリカ・ランド	小計	18,160,000.00 (147,459,200)	16,229,734.40 (131,785,444)	
インドネシア・ルピア		INDONESIA GOVT 8.25% 2036/05/15	4,084,000,000.00	4,398,998,920.00	
		INDONESIA GOVT 8.375% 2034/03/15	3,624,000,000.00	3,914,789,760.00	
		INDONESIA GOVT 8.75% 2031/05/15	2,231,000,000.00	2,506,483,880.00	
	インドネシア・ルピア	小計	9,939,000,000.00 (83,487,600)	10,820,272,560.00 (90,890,289)	
コロンビア・ペソ		COLOMBIA TES 10.0% 2024/07/24	1,714,000,000.00	2,034,843,660.00	
		COLOMBIA TES 7.0% 2022/05/04	1,255,000,000.00	1,295,574,150.00	
		COLOMBIA TES 7.5% 2026/08/26	483,600,000.00	506,459,772.00	
		COLOMBIA TES 7.75% 2030/09/18	371,600,000.00	402,309,024.00	
	コロンビア・ペソ	小計	3,824,200,000.00 (142,260,240)	4,239,186,606.00 (157,697,741)	
トルコ・リラ		TURKEY GOVT BOND 10.5% 2020/01/15	280,000.00	269,810.80	
		TURKEY GOVT BOND 10.6% 2026/02/11	700,000.00	664,069.00	
		TURKEY GOVT BOND 10.7% 2021/02/17	440,000.00	422,360.40	
		TURKEY GOVT BOND 4.0% 2020/04/01	320,000.00	586,126.05	
		TURKEY GOVT BOND 6.3% 2018/02/14	70,000.00	68,744.20	
		TURKEY GOVT BOND 8.0% 2025/03/12	1,050,000.00	866,817.00	
	トルコ・リラ	小計	2,860,000.00 (85,485,400)	2,877,927.45 (86,021,252)	
ブラジル・リアル		BRAZIL NTN-B 6.0% 2020/08/15	180,000.00	580,433.40	
		BRAZIL NTN-B 6.0% 2045/05/15	330,000.00	1,115,056.80	
		BRAZIL NTN-F 10.0% 2019/01/01	90,000.00	95,620.50	
		BRAZIL NTN-F 10.0% 2021/01/01	1,910,000.00	2,018,908.20	

	BRAZIL NTN-F 10.0% 2023/01/01	1,970,000.00	2,060,147.20	
	BRAZIL NTN-F 10.0% 2025/01/01	1,060,000.00	1,100,004.40	
	BRAZIL NTN-F 10.0% 2027/01/01	560,000.00	579,000.80	
ブラジル・リアル 小計		6,100,000.00 (212,951,000)	7,549,171.30 (263,541,570)	
ペルー・ソル	PERU B SOBERANO 7.84% 2020/08/12	730,000.00	807,730.40	
	PERU B SOBERANO 8.2% 2026/08/12	500,000.00	607,590.00	
	PERU T-BOND 5.2% 2023/09/12	590,000.00	613,452.50	
	PERU T-BOND 5.7% 2024/08/12	560,000.00	594,636.00	
ペルー・ソル 小計		2,380,000.00 (83,466,600)	2,623,408.90 (92,002,951)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVT BOND 1.75% 2021/07/25	680,000.00	665,169.20	
	POLAND GOVT BOND 2.0% 2021/04/25	370,000.00	366,510.90	
	POLAND GOVT BOND 2.5% 2026/07/25	530,000.00	495,687.80	
	POLAND GOVT BOND 4.0% 2023/10/25	300,000.00	317,499.00	
ポーランド・ズロチ 小計		1,880,000.00 (58,919,200)	1,844,866.90 (57,818,129)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVT 3.26% 2018/03/01	1,220,000.00	1,221,134.60	
	MALAYSIA GOVT 3.492% 2020/03/31	1,030,000.00	1,031,246.30	
	MALAYSIA GOVT 3.62% 2021/11/30	200,000.00	199,104.00	
	MALAYSIA GOVT 3.659% 2020/10/15	470,000.00	472,138.50	
	MALAYSIA GOVT 3.882% 2022/03/10	190,000.00	191,364.20	
	MALAYSIA GOVT 3.889% 2020/07/31	420,000.00	424,384.80	
	MALAYSIA GOVT 4.16% 2021/07/15	280,000.00	284,734.80	
	MALAYSIA GOVT 4.378% 2019/11/29	530,000.00	540,759.00	
マレーシア・リンギット 小計		4,340,000.00 (117,093,200)	4,364,866.20 (117,764,091)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONOS 10.0% 2024/12/05	9,660,000.00	11,198,161.80	
	MEXICAN BONOS 6.5% 2021/06/10	2,760,000.00	2,709,933.60	
	MEXICAN BONOS 7.5 2027/06/03	2,560,000.00	2,600,704.00	
	MEXICAN BONOS 7.75% 2031/05/29	2,250,000.00	2,319,795.00	
	MEXICAN BONOS 7.75% 2042/11/13	1,740,000.00	1,774,138.80	
	MEXICAN BONOS 8.0% 2020/06/11	2,710,000.00	2,773,685.00	
	MEXICAN BONOS 8.5 2029/05/31	4,300,000.00	4,690,999.00	

	MEXICAN UDIBONOS 4.5% 2035/11/22	350,000.00	2,275,720.12	
メキシコ・ペソ	小計	26,330,000.00 (157,453,400)	30,343,137.32 (181,451,961)	
ロシア・ルーブル	RUSSIA-OFZ 6.4% 2020/05/27	7,520,000.00	7,360,726.40	
	RUSSIA-OFZ 7.0% 2023/08/16	11,730,000.00	11,556,044.10	
	RUSSIA-OFZ 7.05% 2028/01/19	13,430,000.00	13,041,470.10	
	RUSSIA-OFZ 7.5% 2021/08/18	4,630,000.00	4,653,057.40	
	RUSSIA-OFZ 8.15% 2027/02/03	13,470,000.00	14,073,321.30	
ロシア・ルーブル	小計	50,780,000.00 (99,021,000)	50,684,619.30 (98,835,008)	
国債証券	合計	1,187,596,840 (1,187,596,840)	1,277,808,436 (1,277,808,436)	
合計		1,187,596,840 (1,187,596,840)	1,277,808,436 (1,277,808,436)	

- (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
南アフリカ・ランド	国債証券 5銘柄	9.88%	10.31%
インドネシア・ルピア	国債証券 3銘柄	6.81%	7.11%
コロンビア・ペソ	国債証券 4銘柄	11.82%	12.34%
トルコ・リラ	国債証券 6銘柄	6.45%	6.73%
ブラジル・レアル	国債証券 7銘柄	19.76%	20.62%
ペルー・ソル	国債証券 4銘柄	6.90%	7.20%
ポーランド・ズロチ	国債証券 4銘柄	4.34%	4.53%
マレーシア・リングgit	国債証券 8銘柄	8.83%	9.22%
メキシコ・ペソ	国債証券 8銘柄	13.60%	14.20%
ロシア・ルーブル	国債証券 5銘柄	7.41%	7.74%

(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。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

平成29年11月30日現在

資産総額	7,867,971円
負債総額	7,113円
純資産総額（ - ）	7,860,858円
発行済数量	6,292,377口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.2493円

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

平成29年11月30日現在

資産総額	6,932,061円
負債総額	6,367円
純資産総額（ - ）	6,925,694円
発行済数量	5,821,572口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.1897円

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

平成29年11月30日現在

資産総額	14,962,654円
負債総額	17,348円
純資産総額（ - ）	14,945,306円
発行済数量	13,124,127口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.1388円

## （参考）マザーファンドの現況

## 損保ジャパン日本債券マザーファンド

平成29年11月30日現在

資産総額	15,376,680,679円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	15,376,680,679円
発行済数量	10,915,146,675口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.4087円

## S J A M ラージキャップ・バリュース・マザーファンド

平成29年11月30日現在

資産総額	40,688,944,116円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	40,688,944,116円
発行済数量	20,177,649,238口
1単位当りの純資産額（ / ）	2.0165円

## S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

平成29年11月30日現在

資産総額	8,451,498,999円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	8,451,498,999円
発行済数量	3,163,840,100口
1単位当りの純資産額（ / ）	2.6713円

## 損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

平成29年11月30日現在

資産総額	6,619,148,419円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	6,619,148,419円
発行済数量	4,271,107,052口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.5498円

## 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

平成29年11月30日現在

資産総額	223,968,503円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	223,968,503円
発行済数量	177,042,203口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.2651円

## SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

平成29年11月30日現在

資産総額	1,393,953,416円
負債総額	3,895,743円
純資産総額（ - ）	1,390,057,673円
発行済数量	1,191,023,889口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.1671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る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）に支払います。

### 11. 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（平成29年11月末現在）

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

最近5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（平成29年11月末現在）

###### 会社の意思決定機構

定款に基づき15名以内の取締役が株主総会において選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上にあたる株式を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行います。また、その選任決議は、累積投票によらないものとしします。

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

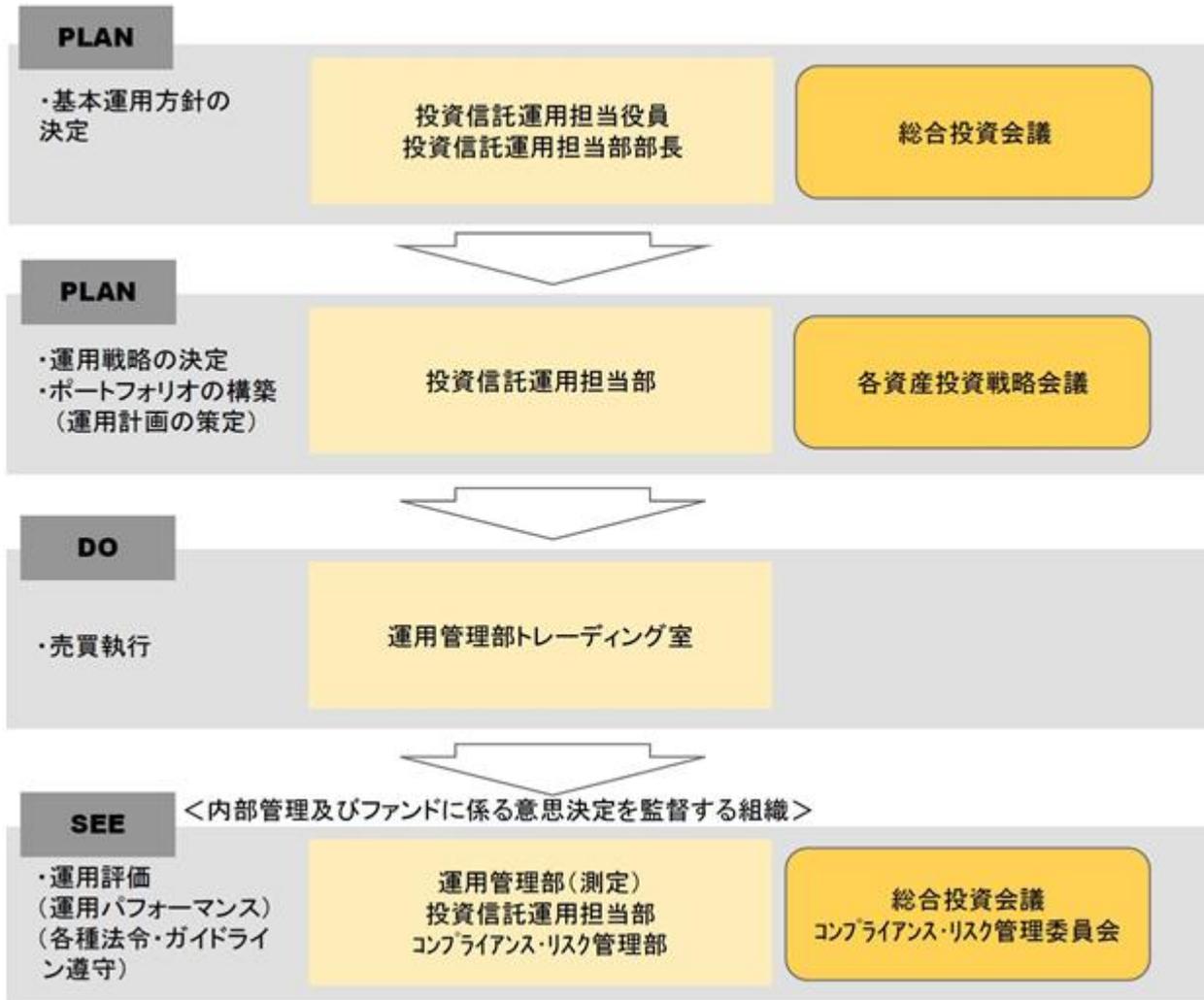
取締役会の決議によって、代表取締役を選定します。また、取締役会長、取締役社長各1名を選定することができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託会社の運用する投資信託（親投資信託を除きます。）は平成29年11月末現在、計143本（追加型株式投資信託118本、単位型株式投資信託12本、単位型公社債投資信託13本）であり、その純資産総額の合計は739,052百万円です。

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

2．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(平成28年4月1日から平成29年3月31日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

また、委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

		前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29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		4,375,837	5,032,858
2 前払費用		81,218	77,585
3 未収委託者報酬		754,788	760,025
4 未収運用受託報酬		521,498	788,836
5 未収収益		149	57
6 繰延税金資産		137,932	63,421
7 その他		421	22,446
流動資産合計		5,871,846	6,745,230
固定資産			
1 有形固定資産			
(1) 建物	* 1	37,899	31,748
(2) 器具備品	* 1	13,712	12,253
有形固定資産合計		51,612	44,002
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		128,043	47,562
(2) 長期差入保証金		161,598	161,598
(3) 繰延税金資産		133,008	161,300
(4) その他		29	30
投資その他の資産合計		422,678	370,490
固定資産合計		478,826	419,028
資産合計		6,350,672	7,164,258

区分	注記 番号	前事業年度 (平成28年3月31日)		当事業年度 (平成29年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
(負債の部)					
流動負債					
1 預り金			3,485		82,284
2 未払金					
(1) 未払配当金	* 2	500,000		500,000	
(2) 未払手数料		333,031		340,633	
(3) その他未払金		107,732	940,764	160,613	1,001,247
3 未払費用			429,958		691,223
4 未払消費税等			71,725		10,617
5 未払法人税等			346,936		143,251
6 前受収益			26,746		7,954
7 賞与引当金			58,159		120,025
8 役員賞与引当金			9,600		9,000
流動負債合計			1,887,376		2,065,604
固定負債					
1 退職給付引当金			75,674		90,737
2 資産除去債務			7,898		8,039
固定負債合計			83,572		98,776
負債合計			1,970,949		2,164,380
(純資産の部)					
株主資本					
1 資本金			1,550,000		1,550,000
2 資本剰余金					
(1) 資本準備金			413,280		413,280
資本剰余金合計			413,280		413,280
3 利益剰余金					
(1) その他利益剰余金					
繰越利益剰余金			2,424,248		3,035,695
利益剰余金合計			2,424,248		3,035,695
株主資本合計			4,387,528		4,998,975
評価・換算差額等					
1 その他有価証券評価差額金			7,804		902
評価・換算差額等合計			7,804		902
純資産合計			4,379,723		4,999,878
負債・純資産合計			6,350,672		7,164,258

## ( 2 ) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1 委託者報酬		7,038,975		5,363,843	
2 運用受託報酬		2,535,301	9,574,276	3,816,308	9,180,152
営業費用					
1 支払手数料		3,508,448		2,890,668	
2 広告宣伝費		16,724		15,637	
3 公告費		610		2,970	
4 調査費		2,046,339		2,245,765	
(1) 調査費		622,284		780,172	
(2) 委託調査費		1,420,590		1,461,574	
(3) 図書費		3,465		4,018	
5 営業雑経費		182,596		190,147	
(1) 通信費		17,360		16,450	
(2) 印刷費		151,371		160,333	
(3) 諸会費		13,864	5,754,719	13,363	5,345,189
一般管理費					
1 給料		1,299,501		1,361,632	
(1) 役員報酬		83,689		75,948	
(2) 給料・手当		1,107,914		1,147,148	
(3) 賞与		107,897		138,535	
2 福利厚生費		109,923		134,150	
3 交際費		11,516		9,622	
4 寄付金		300		300	
5 旅費交通費		38,774		36,626	
6 法人事業税		29,306		41,868	
7 租税公課		7,391		13,856	
8 不動産賃借料		214,575		212,520	
9 退職給付費用		47,701		50,781	
10 賞与引当金繰入		58,159		120,025	

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
11 役員賞与引当金繰入		9,600		9,000	
12 固定資産減価償却費		13,042		10,429	
13 諸経費		205,813	2,045,605	260,939	2,261,753
営業利益			1,773,952		1,573,209
営業外収益					
1 受取配当金		90		90	
2 受取利息		657		280	
3 有価証券売却益		19		-	
4 有価証券償還益		-		745	
5 為替差益		-		9,721	
6 雑益		6,407	7,173	2,066	12,904
営業外費用					
1 有価証券売却損		-		6	
2 為替差損		100		-	
3 雑損		0	100	8	14
経常利益			1,781,026		1,586,098
特別損失					
1 固定資産除却損	* 1	663	663	0	0
税引前当期純利益			1,780,362		1,586,098
法人税、住民税及び事業 税			659,040		428,835
法人税等調整額			52,602		45,816
当期純利益			1,173,924		1,111,446

## （ 3 ） 【 株主資本等変動計算書 】

前事業年度（自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### 有形固定資産

定率法を採用しております。

ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しています。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	15年
器具備品	3～20年

### 3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 4. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

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

#### (2) 役員賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金

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

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

### 5. 消費税等の会計処理方法

税抜方式を採用しております。

#### （会計方針の変更）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得する建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

これによる当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。

#### （追加情報）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

\* 1 . 有形固定資産の減価償却累計額は、次のとおりであります。

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
建物	72,167千円	78,317千円
器具備品	44,838	44,893

\* 2 . 関係会社項目

関係会社に対する負債は、次のとおりであります。

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
未払金		
未払配当金	500,000千円	500,000千円

## （損益計算書関係）

\* 1 . 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	当事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
器具備品	663千円	0千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日）

1．発行済株式に関する事項

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

2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3．新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4．剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日）

1．発行済株式に関する事項

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

2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3．新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

## 4．剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

## (金融商品関係)

## 1．金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	4,375,837	4,375,837	-
(2) 未収委託者報酬	754,788	754,788	-
(3) 未収運用受託報酬	521,498	521,498	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	112,293	112,293	-
資産計	5,764,418	5,764,418	-

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

注1．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券取引に関する事項

資 産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、及び(3) 未収運用受託報酬

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

(4) 投資有価証券

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

注2．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	前事業年度 （平成28年3月31日）	当事業年度 （平成29年3月31日）
非上場株式	15,750	15,750

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

## 注3．金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
(1) 預金	4,375,515	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	754,788	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	521,498	-	-	-
(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	-	96	112,197	-
合計	5,651,803	96	112,197	-

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

## 注4．社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

## 1．売買目的有価証券

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式

該当事項はありません。

## 4．その他有価証券で時価のあるもの

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

## 5．売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

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

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

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

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

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
	退職給付引当金の期首残高	64,308	千円	75,674
退職給付費用	17,374		21,913	
退職給付の支払額	6,008		6,850	
退職給付引当金の期末残高	75,674		90,737	

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

	前事業年度 (平成28年3月31日)		当事業年度 (平成29年3月31日)	
	非積立型制度の退職給付債務	75,674	千円	90,737
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	75,674		90,737	
退職給付引当金	75,674		90,737	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	75,674		90,737	

## (3) 退職給付費用

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	17,374 千円	21,913 千円

## 3. 確定拠出制度

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
当社の確定拠出制度への要拠出額	10,921 千円	12,945 千円

(ストック・オプション等関係)

該当事項はありません。

## （税効果会計関係）

## 1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
<b>繰延税金資産</b>		
ソフトウェア損金算入限度超過額	110,523千円	127,409千円
賞与引当金	17,947	37,039
退職給付引当金	23,200	27,800
未払費用否認	88,021	18,239
繰延資産損金算入限度超過額	7,634	7,090
未払事業税	22,641	6,351
その他	6,579	4,335
繰延税金資産小計	276,547	228,266
評価性引当額	4,900	2,554
繰延税金資産合計	271,647	225,712
<b>繰延税金負債</b>		
固定資産除去価額	707	588
その他有価証券評価差額金	-	402
繰延税金負債合計	707	990
繰延税金資産の純額	270,940	224,721

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

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

## （資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## 1. 当該資産除去債務の概要

本社事務所の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

## 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

## 3. 当該資産除去債務の総額の増減

	前事業年度		当事業年度	
	（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）		（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	
期首残高	7,760千円		7,898千円	
時の経過による調整額	137		140	
期末残高	7,898		8,039	

## （セグメント情報等）

## セグメント情報

当社は、投資運用事業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 関連情報

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

(単位：千円)

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

(注) 営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益
A社(注)	1,038,124

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

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

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

（2）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等  
該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

## 2．取引条件ないし取引条件の決定方針等

（注1） 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

（注2） 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 (千円)	事業の内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜ひまわり生命保険株式会社	東京都新宿区	17,250,000	生命保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用の一任（注1）	運用受託報酬の受取り	157,531	未収運用受託報酬	86,309
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	東京都新宿区	3,000,000	確定拠出年金業	-	投資信託に係る事務代行の委託等（注2）	投資信託代行手数料の支払い	400,493	未払手数料	97,637

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

## 2．取引条件ないし取引条件の決定方針等

（注1） 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

（注2） 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

SOMP Oホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

関連会社はありません。

## (1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	181,844.45円	207,593.03円
1株当たり当期純利益金額	48,740.88円	46,146.84円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
当期純利益(千円)	1,173,924	1,111,446
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)	1,173,924	1,111,446
期中平均株式数(株)	24,085	24,085

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

		第33期中間会計期間 (平成29年9月30日)
区分	注記 番号	金額(千円)
(資産の部)		
流動資産		
1 現金・預金		4,215,136
2 前払費用		91,698
3 未収委託者報酬		881,780
4 未収運用受託報酬		951,939
5 未収収益		63
6 繰延税金資産		52,329
7 その他		2,373
流動資産合計		6,195,319
固定資産		
1 有形固定資産	1	40,489
2 無形固定資産		4,535
3 投資その他の資産		
(1) 投資有価証券		60,681
(2) 長期差入保証金		161,598
(3) 繰延税金資産		185,920
(4) その他		30
投資その他の資産合計		408,229
固定資産合計		453,254
資産合計		6,648,573

		第33期中間会計期間 (平成29年9月30日)
区分	注記 番号	金額(千円)
(負債の部)		
流動負債		
1 預り金		13,359
2 未払金		
(1) 未払手数料		337,424
(2) その他未払金		174,571
未払金合計		511,996
3 未払費用		592,557
4 未払法人税等		121,912
5 前受収益		3,747
6 賞与引当金		80,017
7 役員賞与引当金		1,800
8 その他	2	27,057
流動負債合計		1,352,448
固定負債		
1 退職給付引当金		100,600
2 資産除去債務		8,110
固定負債合計		108,711
負債合計		1,461,159

		第33期中間会計期間 (平成29年9月30日)
区分	注記 番号	金額(千円)
(純資産の部)		
株主資本		
1 資本金		1,550,000
2 資本剰余金		
(1) 資本準備金		413,280
資本剰余金合計		413,280
3 利益剰余金		
(1) その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		3,221,690
利益剰余金合計		3,221,690
株主資本合計		5,184,970
評価・換算差額等		
1 その他有価証券評価差額金		2,443
評価・換算差額等合計		2,443
純資産合計		5,187,414
負債・純資産合計		6,648,573

## (2) 中間損益計算書

		第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
区分	注記 番号	金額(千円)	
営業収益			
1 委託者報酬		2,469,535	
2 運用受託報酬		1,462,281	3,931,816
営業費用			
1 支払手数料		1,187,891	
2 広告宣伝費		8,934	
3 公告費		1,770	
4 調査費		1,175,544	
(1) 調査費		442,104	
(2) 委託調査費		731,058	
(3) 図書費		2,381	
5 営業雑経費		99,171	
(1) 通信費		2,991	
(2) 印刷費		83,337	
(3) 諸会費		12,842	2,473,312
一般管理費			
1 給料		696,733	
(1) 役員報酬		40,340	
(2) 給料・手当		601,168	
(3) 賞与		55,224	
2 福利厚生費		82,614	
3 交際費		3,239	
4 旅費交通費		20,153	
5 法人事業税		18,186	
6 租税公課		3,619	
7 不動産賃借料		103,565	
8 退職給付費用		21,725	
9 賞与引当金繰入		80,017	
10 役員賞与引当金繰入		1,800	
11 固定資産減価償却費	1	3,512	
12 諸経費		149,357	1,184,525
営業利益			273,978

		第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
区分	注記 番号	金額(千円)	
営業外収益			
1 受取配当金		91	
2 受取利息		164	
3 有価証券売却益		15	
4 為替差益		3,183	
5 雑益		1,146	4,601
営業外費用			
1 雑損		71	71
経常利益			278,509
税引前中間純利益			278,509
法人税、住民税及び事業税			106,718
法人税等調整額			14,204
中間純利益			185,995

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	3,035,695	3,035,695	4,998,975
当中間期変動額						
中間純利益				185,995	185,995	185,995
株主資本以外の項目の当 中間期変動額（純額）						
当中間期変動額合計	-	-	-	185,995	185,995	185,995
当中間期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,221,690	3,221,690	5,184,970

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	902	902	4,999,878
当中間期変動額			
中間純利益			185,995
株主資本以外の項目の当 中間期変動額（純額）	1,540	1,540	1,540
当中間期変動額合計	1,540	1,540	187,536
当中間期末残高	2,443	2,443	5,187,414

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### 有形固定資産

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	15年
器具備品	3～20年

### 3．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 4．引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

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

#### (2) 役員賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金

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

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

### 5．消費税等の会計処理方法

税抜方式を採用しております。

## （会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

## （減価償却方法の変更）

当社は、有形固定資産の減価償却方法について、従来、定率法（ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については定額法）を採用しておりましたが、当中間会計期間より定額法に変更しております。

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

この変更による当中間会計期間の経常利益及び税引前中間純利益に与える影響は軽微であります。

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

		第33期中間会計期間 (平成29年9月30日)
1	有形固定資産の減価償却累計額	126,348千円
2	消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 流動負債の「その他」に含めて表示して おります。

## （中間損益計算書関係）

		第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
1	減価償却実施額 有形固定資産	3,512千円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数並びに自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

## (金融商品関係)

第33期中間会計期間（平成29年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成29年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含めておりません（注2.参照）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	4,215,136	4,215,136	-
(2) 未収委託者報酬	881,780	881,780	-
(3) 未収運用受託報酬	951,939	951,939	-
(4) 投資有価証券			
その他有価証券	44,931	44,931	-
資産計	6,093,786	6,093,786	-

## 注1. 金融商品の時価の算定方法及び有価証券取引に関する事項

## 資産

## (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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

## (4) 投資有価証券

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

## 注2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額
非上場株式	15,750

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

## （有価証券関係）

第33期中間会計期間（平成29年9月30日）

## 1．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 2．子会社株式及び関連会社株式

該当事項はありません。

## 3．その他有価証券

（単位：千円）

	種 類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差 額
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	43,657	40,100	3,557
	小 計	43,657	40,100	3,557
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	1,273	1,308	35
	小 計	1,273	1,306	35
合計		44,931	41,408	3,522

## （デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

## （ストック・オプション等関係）

該当事項はありません。

## （資産除去債務関係）

第33期中間会計期間（平成29年9月30日）

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減

期首残高	8,039千円
時の経過による調整額	71千円
中間期末残高	8,110千円

## （セグメント情報等）

セグメント情報

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）

当社は、投資運用事業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 関連情報

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えているため、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中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えているため、記載を省略しております。

## 3．主要な顧客ごとの情報

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

## （ 1株当たり情報）

	第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
1株当たり純資産額	215,379.46円
1株当たり中間純利益金額	7,722.45円
	なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
中間純利益	185,995千円
普通株主に帰属しない金額	-千円
普通株式に係る中間純利益	185,995千円
普通株式の期中平均株式数	24,085株

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

#### 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) 通常の実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

定款の変更に関しては、株主総会の特別決議が必要です。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社及び当ファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

## 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：資産管理サービス信託銀行株式会社）

資本金の額

247,369百万円（平成29年9月末現在）

事業の内容

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

#### <再信託受託会社の概要>

名称：資産管理サービス信託銀行株式会社

資本金の額：50,000百万円（平成29年9月末現在）

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

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

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
株式会社SBI証券	48,323	「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。
損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	3,000	
楽天証券株式会社	7,495	

資本金の額は、平成29年9月末現在

#### (3) 投資顧問会社

名称

Colchester Global Investors (Singapore) PTE. LTD.

資本金の額

1百万シンガポール・ドル（平成29年9月末現在）

事業の内容

投資運用業を営んでいます。ソブリン債と為替に特化した運用を行っています。

## 2【関係業務の概要】

#### (1) 受託会社

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

#### (2) 販売会社

販売会社として、受益権の募集の取扱い、収益分配金等の支払い等を行います。

#### (3) 投資顧問会社

委託会社との投資一任契約に基づき、「SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド」に関して、公社債の運用指図および為替取引に係る権限の委託を受けて投資判断、発注等を行います。

### 3【資本関係】

#### (1) 受託会社

該当事項はありません。

#### (2) 販売会社

該当事項はありません。

#### (3) 投資顧問会社

該当事項はありません。

### 第3【その他】

- 1．目論見書の表紙等に、ロゴマーク、キャッチコピー、図案、イラスト、写真、当ファンドの概略的性格を表示する文言、第三者機関から取得したユニバーサルデザインに関する認証マーク等を記載することがあります。
- 2．金融商品取引法第13条第2項第1号に定める事項に関する内容を記載した目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」という名称を使用することがあります。また、金融商品取引法第13条第2項第2号に定める事項に関する内容を記載した目論見書の別称として「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用することがあります。
- 3．投資信託説明書（請求目論見書）の表紙あるいは裏表紙に、金融商品取引法に基づき、投資家の請求により交付される目論見書である旨を記載することがあります。
- 4．投資信託説明書（請求目論見書）の表紙に課税上の取扱いに関する記載をすることがあります。
- 5．目論見書に記載する運用状況に関する情報等は、適宜更新することがあります。
- 6．目論見書の表紙等に「金融商品取引業者登録番号」、「使用開始日」等を記載することがあります。
- 7．投資信託説明書（請求目論見書）の巻末に信託約款を掲載することがあります。
- 8．目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
- 9．投資評価機関、投資評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- 10．目論見書の表紙等に以下の内容を記載することがあります。
  - ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されています。
- 11．目論見書の巻頭に、以下を記載することがあります。

## ご投資家のみなさまへ

SOMPOターゲットイヤー・ファンドは、ターゲットイヤーに向けたみなさまの資産形成を応援するバランス型ファンドです。

国内外の株式や債券へ分散投資することにより、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します。

ターゲットイヤーに向けて徐々にリスクを抑えた運用となるよう資産配分を変更していきます。資産配分の変更はファンドが自動的に行いますので、長期投資に適した投資信託です。

なお、ターゲットイヤー後は、リスクを抑えた安定運用を継続します。

投資家のみなさまのターゲットイヤーにあわせ、設定時の資産配分比率が異なる3つのファンドをご用意しています。

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント

# 独立監査人の監査報告書

平成29年6月1日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年1月5日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

新日本有限責任監査法人

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

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ターゲットイヤー・ファンド2055の平成28年10月25日から平成29年11月2日までの第1期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。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055の平成29年11月2日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年1月5日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

新日本有限責任監査法人

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

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ターゲットイヤー・ファンド2045の平成28年10月25日から平成29年11月2日までの第1期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。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045の平成29年11月2日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年1月5日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 裕 治 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 伊藤 志 保 印

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ターゲットイヤー・ファンド2035の平成28年10月25日から平成29年11月2日までの第1期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。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035の平成29年11月2日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成29年11月22日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 裕治 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 伊藤 志保 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

---

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

2．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。