

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年7月22日提出
【発行者名】	SOMPOアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 小嶋 信弘
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋二丁目2番16号
【事務連絡者氏名】	津田 浩平
【電話番号】	03-5290-3432
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	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
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	募集額 5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2020年1月23日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）につきまして、有価証券報告書の提出に伴い、訂正すべき事項がありましたので、これを訂正するものであります。

2【訂正の内容】

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

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」および「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。

第一部【証券情報】

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

<訂正前>

(略)

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（2020年4月1日付でSOMPOアセットマネジメント株式会社に商号変更する予定です。以下同じ。）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。

(略)

<訂正後>

(略)

委託会社であるSOMPOアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

(略)

(4)【発行（売出）価格】

<訂正前>

(略)

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 <https://www.sjnk-am.co.jp/>（2020年4月1日付で<https://www.sompo-am.co.jp/>に変更する予定です。以下同じ。）

<訂正後>

(略)

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

(8)【申込取扱場所】

<訂正前>

(略)

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

<訂正後>

(略)

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432 (受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

< 訂正前 >

(略)

< ファンドの特色 >

(略)

投資対象とする外国投資信託に関して

「TCW ファンズ - TCW ハイ インカム US エクイティ プレミアム ファンド」の運用は、TCW アセット マネジメント カンパニーが行います。

TCW アセット マネジメント カンパニーについて

ロサンゼルスを拠点とするTCWグループ(1971年設立)傘下の運用会社です。2019年6月末現在の同グループの運用資産は、約2,053億米ドル(約22兆1,292億円*)です。

※2019年6月末時点の為替レートで換算。

(略)

< 訂正後 >

(略)

< ファンドの特色 >

(略)

投資対象とする外国投資信託に関して

「TCW ファンズ - TCW ハイ インカム US エクイティ プレミアム ファンド」の運用は、TCW アセット マネジメント カンパニーが行います。

TCW アセット マネジメント カンパニーについて

ロサンゼルスを拠点とするTCWグループ(1971年設立)傘下の運用会社です。2019年12月末現在の同グループの運用資産は、約2,174億米ドル(約23兆8,183億円*)です。

※2019年12月末時点の為替レートで換算。

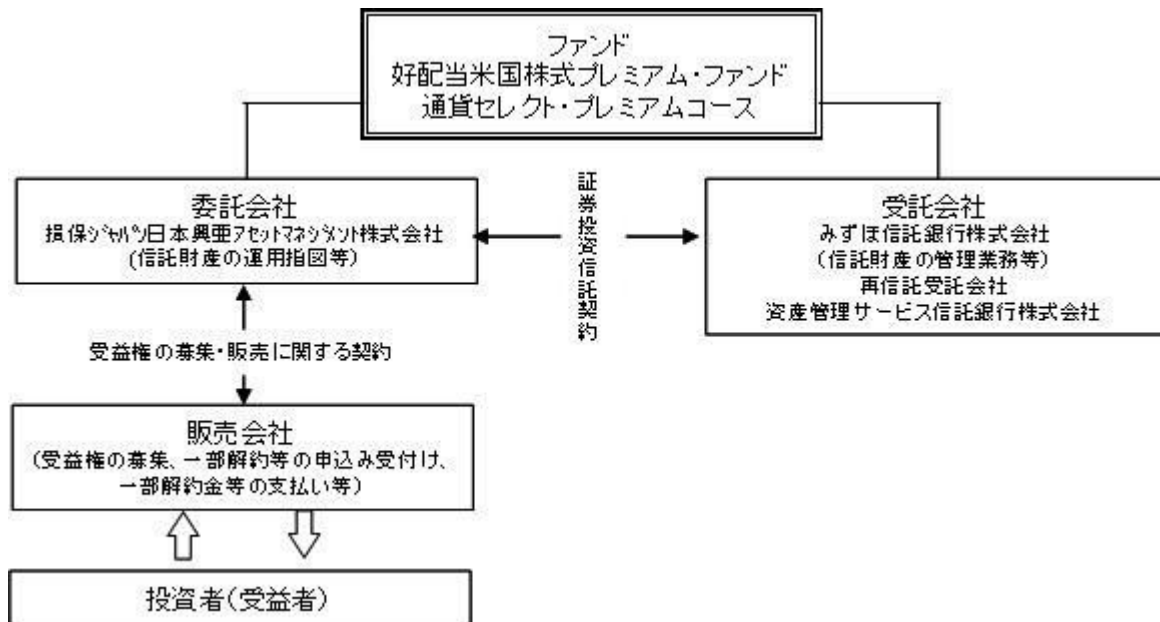
(略)

(3)【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

ファンドの仕組み
(略)

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。

(略)

() 受託会社または受託者：みずほ信託銀行株式会社

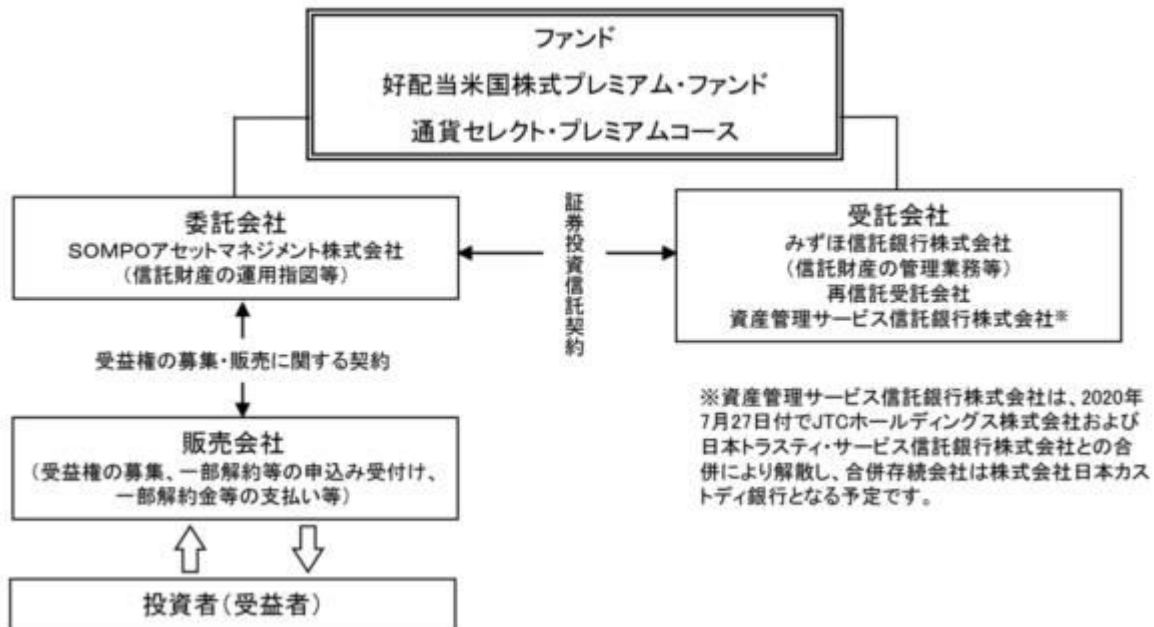
(再信託受託会社：資産管理サービス信託銀行株式会社)

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。

<訂正後>

ファンドの仕組み
(略)

ファンドの関係法人図



ファンドの関係法人

- () 委託会社または委託者：SOMPOアセットマネジメント株式会社

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

(略)

- () 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。

資産管理サービス信託銀行株式会社は、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社との合併により解散し、合併存続会社は株式会社日本カストディ銀行となる予定です。以下同じ。

< 訂正前 >

委託会社等の概況

- () 資本金の額 1,550百万円 (2019年10月末現在)

- () 委託会社の沿革

1986年	2月25日	安田火災投資顧問株式会社設立
1987年	2月20日	投資顧問業の登録
1987年	9月9日	投資一任業務の認可取得
1991年	6月1日	プリンソン・パートナーズ投資顧問株式会社と合併し、安田火災プリンソン投資顧問株式会社に商号変更
1998年	1月1日	安田火災グローバル・アセット・マネジメント株式会社に商号変更
1998年	3月3日	安田火災グローバル投信投資顧問株式会社に商号変更
1998年	3月31日	証券投資信託委託業の免許取得

2002年	7月1日	損保ジャパン・アセットマネジメント株式会社に商号変更
2007年	9月30日	金融商品取引業者として登録
2010年	10月1日	ゼスト・アセットマネジメント株式会社と合併し、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社に商号変更
2020年	4月1日	SOMPOアセットマネジメント株式会社に商号変更(予定)

()大株主の状況(2019年10月末現在)

(略)

<訂正後>

委託会社等の概況

()資本金の額 1,550百万円 (2020年4月末現在)

()委託会社の沿革

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

()大株主の状況(2020年4月末現在)

(略)

2【投資方針】

(2)【投資対象】

<訂正前>

(略)

名 称	損保ジャパン日本債券マザーファンド
形 態	国内籍親投資信託(円建て)
運用の基本方針	主として、日本の公社債を中心に分散投資を行い、インカムの確保を図るとともに金利低下や格付け上昇に伴うキャピタルゲインの獲得を狙い、NOMURA-BPI総合指数を中長期的に上回る投資成果を目指します。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
設 定 日	2000年7月31日
信 託 期 間	無期限
決 算 日	原則として、毎年7月15日
信 託 報 酬 等	ありません。
申込・解約手数料	ありません。
委 託 会 社	損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社
受 託 会 社	みずほ信託銀行株式会社

<訂正後>

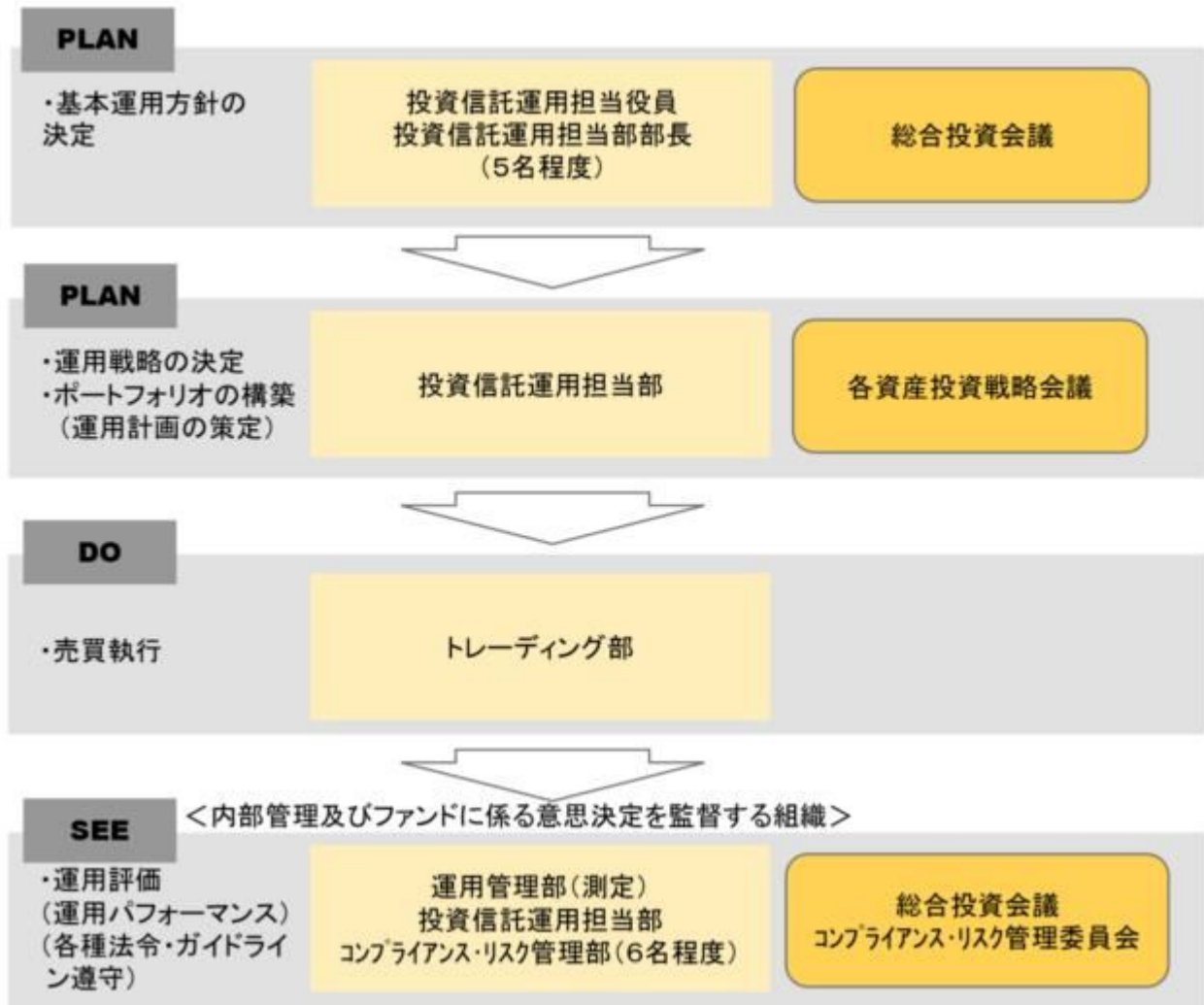
(略)

名 称	損保ジャパン日本債券マザーファンド
形 態	国内籍親投資信託(円建て)
運用の基本方針	主として、日本の公社債を中心に分散投資を行い、インカムの確保を図るとともに金利低下や格付け上昇に伴うキャピタルゲインの獲得を狙い、NOMURA-BPI総合指数を中長期的に上回る投資成果を目指します。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
設 定 日	2000年7月31日
信 託 期 間	無期限
決 算 日	原則として、毎年7月15日
信 託 報 酬 等	ありません。
申込・解約手数料	ありません。
委 託 会 社	SOMPOアセットマネジメント株式会社
受 託 会 社	みずほ信託銀行株式会社

(3) 【運用体制】

<訂正前>

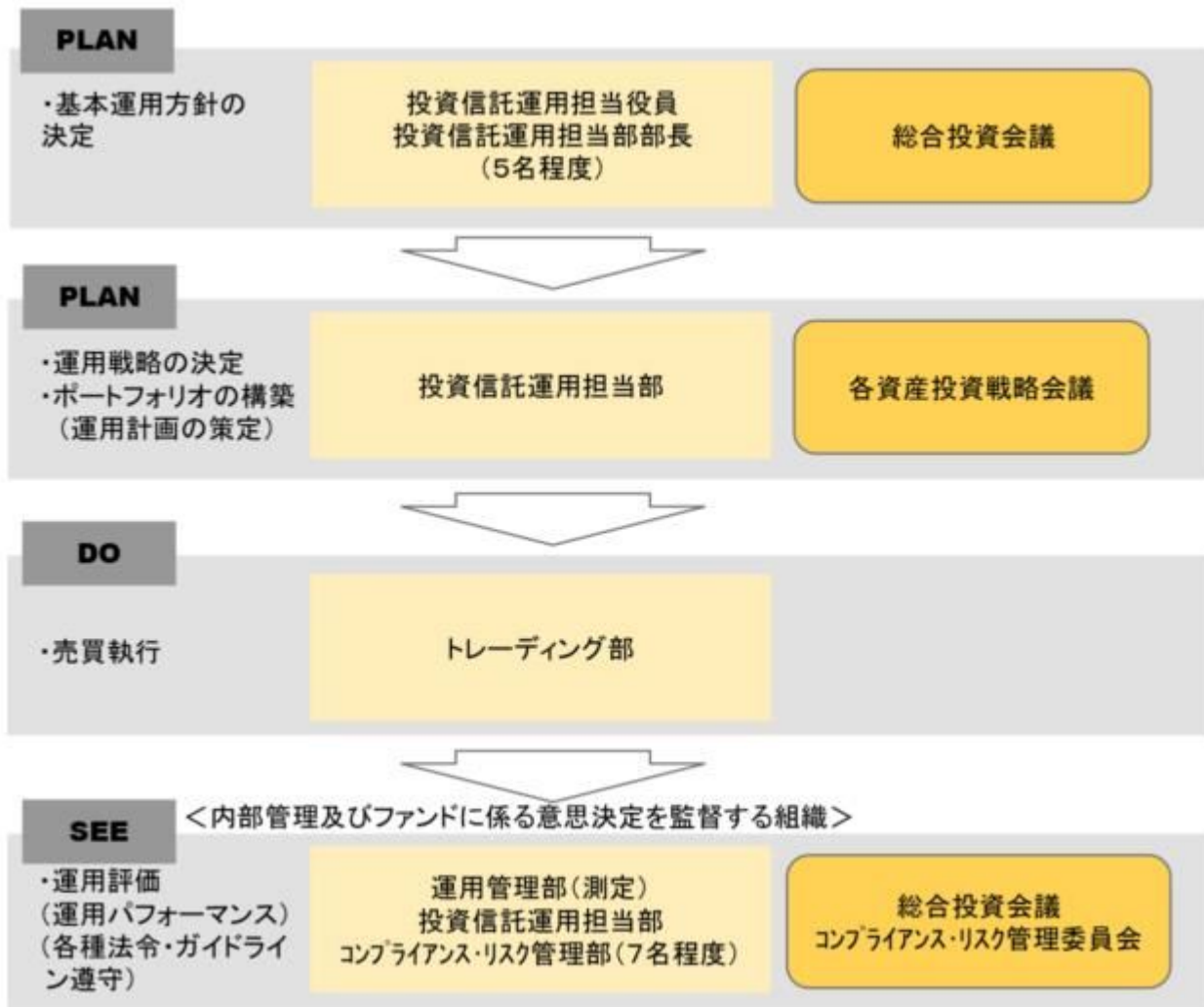
(略)



2019年10月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

<訂正後>

(略)



2020年4月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

<リスクの管理体制>

(略)

(注) 上図は、2019年10月末現在のものであり、今後変更されることもあります。



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

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

代表的な資産クラスの指数

<p>日本株: 東証株価指数(TOPIX) (配当込み)</p> <p>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。</p>	<p>先進国株: MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)</p> <p>MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p>
<p>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)</p> <p>MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p>	<p>日本国債: NOMURA-BPI 国債</p> <p>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。</p>
<p>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)</p> <p>FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。</p>	<p>新興国債: J.P. Morgan Global EME Global Diversified Fund (円ベース)</p> <p>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。</p>

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

<訂正後>

(略)

<リスクの管理体制>

(略)

(注) 上図は、2020年4月末現在のものであり、今後変更されることもあります。



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

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

代表的な資産クラスの指数

<p>日本株: 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)</p> <p>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。</p>	<p>先進国株: MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)</p> <p>MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p>
<p>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)</p> <p>MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p>	<p>日本国債: NOMURA-BPI 国債</p> <p>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。</p>
<p>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)</p> <p>FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。</p>	<p>新興国債: J Pモルガン G B I - E Mグローバル・ディバーシファイド(円ベース)</p> <p>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。</p>

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

4 【手数料等及び税金】

(5) 【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

(略)

上記は2019年10月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

< 訂正後 >

(略)

上記は2020年4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】

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

2020年4月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン	805,164,890	94.28
親投資信託受益証券	日本	8,237,251	0.96
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		40,652,338	4.76
純資産総額		854,054,479	100.00

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

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

(参考) 損保ジャパン日本債券マザーファンド

2020年4月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	12,239,360,800	72.37
地方債証券	日本	112,195,000	0.66
特殊債券	日本	632,968,672	3.74
社債券	日本	3,410,885,200	20.17
	フランス	207,801,000	1.23
		3,618,686,200	21.40
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		307,991,946	1.83
純資産総額		16,911,202,618	100.00

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

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

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

2020年4月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
1	ケイマン	投資信託受益証券	TCW High Income US EQ Pre CuSep	1,036,248.25	755	782,367,428	777	805,164,890	94.28

2	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファ ンド	5,652,018	1.4562	8,230,468	1.4574	8,237,251	0.96
---	----	---------------	-----------------------	-----------	--------	-----------	--------	-----------	------

(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

2020年4月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	94.28
親投資信託受益証券	0.96
合計	95.24

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考) 損保ジャパン日本債券マザーファンド

2020年4月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率(%)	償還日	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第139回利 付国債(5 年)	1,020,000,000	100.88	1,029,042,000	101.11	1,031,373,000	0.1000000	2024/3/20	6.10
2	日本	国債証券	第357回利 付国債(10 年)	1,000,000,000	101.52	1,015,230,000	101.45	1,014,520,000	0.1000000	2029/12/20	6.00
3	日本	国債証券	第142回利 付国債(5 年)	750,000,000	101.01	757,575,000	101.23	759,285,000	0.1000000	2024/12/20	4.49
4	日本	国債証券	第138回利 付国債(5 年)	720,000,000	101.13	728,150,400	101.04	727,509,600	0.1000000	2023/12/20	4.30
5	日本	国債証券	第38回利付 国債(30 年)	510,000,000	134.23	684,606,500	131.98	673,098,000	1.8000000	2043/3/20	3.98
6	日本	国債証券	第140回利 付国債(5 年)	660,000,000	102.16	674,256,000	101.16	667,702,200	0.1000000	2024/6/20	3.95
7	日本	国債証券	第355回利 付国債(10 年)	620,000,000	102.58	635,996,000	101.61	629,982,000	0.1000000	2029/6/20	3.73
8	日本	国債証券	第410回利 付国債(2 年)	600,000,000	100.46	602,785,600	100.53	603,198,000	0.1000000	2022/3/1	3.57
9	日本	国債証券	第154回利 付国債(20 年)	420,000,000	117.13	491,958,600	115.18	483,785,400	1.2000000	2035/9/20	2.86
10	日本	国債証券	第162回利 付国債(20 年)	450,000,000	107.10	481,954,400	105.65	475,452,000	0.6000000	2037/9/20	2.81
11	日本	特殊債券	第60回政府 保証株式会社 日本政策投資 銀行社債	400,000,000	100.28	401,136,000	99.70	398,812,000	0.0010000	2027/1/29	2.36

12	日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	340,000,000	116.07	394,640,400	114.87	390,575,000	1.2000000	2034/12/20	2.31
13	日本	国債証券	第171回利付国債(20年)	380,000,000	98.97	376,086,000	100.00	380,000,000	0.3000000	2039/12/20	2.25
14	日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	370,000,000	102.22	378,227,400	101.95	377,229,800	0.1000000	2028/3/20	2.23
15	日本	国債証券	第158回利付国債(20年)	360,000,000	105.68	380,448,000	104.26	375,350,400	0.5000000	2036/9/20	2.22
16	日本	国債証券	第152回利付国債(20年)	270,000,000	113.90	307,530,000	114.95	310,373,100	1.2000000	2035/3/20	1.84
17	日本	国債証券	第35回利付国債(30年)	210,000,000	136.77	287,221,200	134.71	282,891,000	2.0000000	2041/9/20	1.67
18	日本	国債証券	第146回利付国債(20年)	210,000,000	123.31	258,961,500	120.97	254,055,900	1.7000000	2033/9/20	1.50
19	日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	240,000,000	101.06	242,544,000	101.51	243,624,000	0.1000000	2029/9/20	1.44
20	日本	国債証券	第57回利付国債(30年)	210,000,000	111.77	234,735,900	110.09	231,191,100	0.8000000	2047/12/20	1.37
21	日本	国債証券	第130回利付国債(20年)	190,000,000	122.36	232,497,300	120.08	228,169,100	1.8000000	2031/9/20	1.35
22	日本	国債証券	第43回利付国債(30年)	170,000,000	133.57	227,080,700	130.92	222,564,000	1.7000000	2044/6/20	1.32
23	日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	180,000,000	122.68	220,833,000	120.33	216,608,400	2.1000000	2029/9/20	1.28
24	日本	社債券	第1回武田薬品工業株式会社無担保社債(劣後特約付)FR	200,000,000	102.54	205,098,000	102.00	204,004,000	1.7200000	2079/6/6	1.21
25	日本	社債券	第34回東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	100.00	200,000,000	100.58	201,178,000	0.7500000	2025/4/23	1.19
26	日本	社債券	第568回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	101.07	202,152,000	100.29	200,596,000	1.1550000	2020/9/8	1.19
27	日本	社債券	第12回東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	100.26	200,524,000	100.17	200,346,000	0.4400000	2023/4/19	1.18
28	日本	社債券	第3回A号明治安田生命劣後FR	200,000,000	101.70	203,414,000	99.28	198,576,000	1.1100000	2047/11/6	1.17
29	日本	社債券	第3回A号富国生命劣後FR	200,000,000	100.01	200,020,000	98.42	196,840,000	1.0200000	9999/99/99	1.16
30	日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	190,000,000	102.28	194,332,000	101.78	193,395,300	0.1000000	2028/12/20	1.14

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

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

投資有価証券の種類別投資比率

2020年4月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	72.37
地方債証券	0.66
特殊債券	3.74
社債券	21.40
合計	98.18

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

【投資不動産物件】

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
該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

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

直近日（2020年4月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間末（2014年4月24日）	1,500,240,455	1,537,593,396	0.9238	0.9468
第2特定期間末（2014年10月24日）	4,780,372,117	4,909,756,538	0.8498	0.8728
第3特定期間末（2015年4月24日）	8,672,928,621	8,916,458,604	0.8191	0.8421

第4特定期間末	(2015年10月26日)	6,390,914,918	6,574,726,926	0.5911	0.6081
第5特定期間末	(2016年 4月25日)	4,224,556,491	4,296,811,748	0.4677	0.4757
第6特定期間末	(2016年10月24日)	3,445,432,415	3,511,938,582	0.4144	0.4224
第7特定期間末	(2017年 4月24日)	3,204,687,069	3,266,865,184	0.4123	0.4203
第8特定期間末	(2017年10月24日)	2,728,458,350	2,784,804,749	0.3874	0.3954
第9特定期間末	(2018年 4月24日)	1,965,993,556	2,002,995,166	0.3188	0.3248
第10特定期間末	(2018年10月24日)	1,610,523,794	1,629,748,680	0.2932	0.2967
第11特定期間末	(2019年 4月24日)	1,472,789,805	1,491,141,904	0.2809	0.2844
第12特定期間末	(2019年10月24日)	1,364,336,243	1,382,125,346	0.2684	0.2719
第13特定期間末	(2020年 4月24日)	825,195,351	841,768,133	0.1743	0.1778
	2019年 4月末日	1,452,872,997		0.2774	
	5月末日	1,384,095,320		0.2651	
	6月末日	1,397,980,913		0.2688	
	7月末日	1,428,285,636		0.2768	
	8月末日	1,321,742,536		0.2563	
	9月末日	1,358,967,235		0.2654	
	10月末日	1,372,681,647		0.2720	
	11月末日	1,353,470,821		0.2721	
	12月末日	1,345,406,253		0.2784	
	2020年 1月末日	1,301,819,689		0.2730	
	2月末日	1,166,040,041		0.2457	
	3月末日	822,807,599		0.1738	
	4月末日	854,054,479		0.1790	

【分配の推移】

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

	1口当たりの分配金(円)
第1特定期間	0.1380
第2特定期間	0.1380
第3特定期間	0.1380
第4特定期間	0.1200
第5特定期間	0.0660
第6特定期間	0.0480
第7特定期間	0.0480
第8特定期間	0.0480
第9特定期間	0.0360
第10特定期間	0.0235
第11特定期間	0.0210
第12特定期間	0.0210
第13特定期間	0.0210

【収益率の推移】

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

	収益率（％）
第1特定期間	6.2
第2特定期間	6.9
第3特定期間	12.6
第4特定期間	13.2
第5特定期間	9.7
第6特定期間	1.1
第7特定期間	11.1
第8特定期間	5.6
第9特定期間	8.4
第10特定期間	0.7
第11特定期間	3.0
第12特定期間	3.0
第13特定期間	27.2

（注）各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（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】

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

	設定口数	解約口数
第1特定期間	1,965,007,425	340,966,488
第2特定期間	5,609,625,685	1,608,256,971
第3特定期間	8,115,222,345	3,152,371,860
第4特定期間	4,203,508,273	3,979,297,349
第5特定期間	1,037,170,047	2,817,733,928
第6特定期間	433,026,446	1,151,662,691
第7特定期間	817,372,385	1,358,378,910
第8特定期間	724,065,752	1,453,030,229
第9特定期間	464,802,587	1,341,167,426
第10特定期間	229,168,286	903,278,589
第11特定期間	212,121,214	461,489,040
第12特定期間	268,195,663	429,051,618
第13特定期間	313,792,037	661,312,348

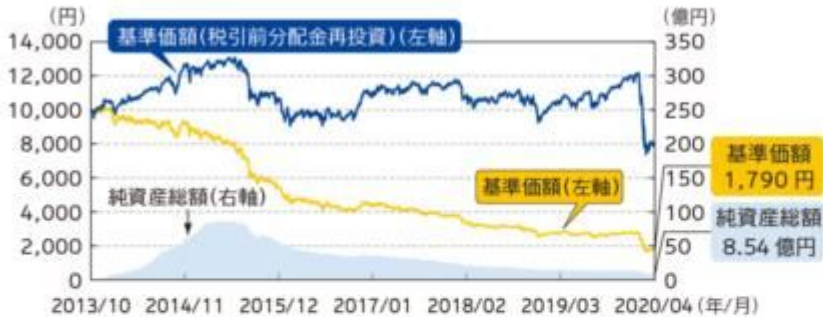
（注1）本邦外における設定及び解約はございません。

（注2）設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

参考情報

基準日：2020年4月30日

基準価額・純資産の推移 2013/10/25～2020/04/30



- 基準価額(税引前分配金再投資)は、税引前の分配金を再投資したものと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。

分配の推移

2019年12月	35円
2020年01月	35円
2020年02月	35円
2020年03月	35円
2020年04月	35円
直近1年間累計	420円
設定来累計	8,665円

- 1万口当たり、税引前

主要な資産の状況

● 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

資産別構成	
資産の種類	純資産比
TCW HighIncome US EQ Pre CuSeP	94.28%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	0.96%
コール・ローン等	4.76%
合計	100.00%

《主要投資対象の投資信託証券の運用状況》

● TCW ファンズ-TCW ハイ インカム US エクイティ プレミアム ファンド

TCW アセット マネジメント カンパニーが作成したデータを掲載しております。

資産別構成	
資産の種類	純資産比
株式	91.2%
現金等	8.8%
合計	100.0%

組入上位 10 銘柄

	銘柄名	通貨	発行国/地域	業種	純資産比
1	DR HORTON INC	米ドル	アメリカ	一般消費財・サービス	7.3%
2	MICROSOFT CORP	米ドル	アメリカ	情報技術	6.6%
3	NEXTERA ENERGY INC	米ドル	アメリカ	公益事業	5.1%
4	JOHNSON & JOHNSON COMMON STOCK	米ドル	アメリカ	ヘルスケア	4.8%
5	APPLE INC	米ドル	アメリカ	情報技術	4.0%
6	CISCO SYSTEMS INC COMMON STOCK	米ドル	アメリカ	情報技術	3.9%
7	DISNEY WALT CO COM	米ドル	アメリカ	コミュニケーション・サービス	3.9%
8	ABBOTT LABORATORIES	米ドル	アメリカ	ヘルスケア	3.8%
9	WAL-MART STORES INC	米ドル	アメリカ	生活必需品	3.7%
10	TEXAS INSTRUMENTS INC	米ドル	アメリカ	情報技術	3.7%
銘柄数					24銘柄

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

● 損保ジャパン日本債券マザーファンド

組入上位 10 銘柄

	銘柄名	種類	償還日	純資産比
1	第 139 回利付国債(5年)	国債証券	2024/03/20	6.1%
2	第 357 回利付国債(10年)	国債証券	2029/12/20	6.0%
3	第 142 回利付国債(5年)	国債証券	2024/12/20	4.5%
4	第 138 回利付国債(5年)	国債証券	2023/12/20	4.3%
5	第 38 回利付国債(30年)	国債証券	2043/03/20	4.0%
6	第 140 回利付国債(5年)	国債証券	2024/06/20	4.0%
7	第 355 回利付国債(10年)	国債証券	2029/06/20	3.7%
8	第 410 回利付国債(2年)	国債証券	2022/03/01	3.6%
9	第 154 回利付国債(20年)	国債証券	2035/09/20	2.9%
10	第 162 回利付国債(20年)	国債証券	2037/09/20	2.8%
銘柄数				80 銘柄

● 年間収益率の推移(暦年ベース)



- ファンドの年間収益率は基準価額（税引前分配金再投資）を使用して計算しています。
- 2013 年は設定日（10 月 25 日）から年末、2020 年は年初から基準日までの収益率です。
- 当ファンドはベンチマークを設定していません。

- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値は四捨五入して表示している場合、合計が 100% とならないことがあります。

第 2 【管理及び運営】

1 【申込（販売）手続等】

< 訂正前 >

(略)

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

(略)

<訂正後>

(略)

委託会社の照会先
SOMPOアセットマネジメント株式会社
電話番号 0120-69-5432 (受付時間：営業日の午前9時～午後5時)
ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

(略)

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

<訂正前>

(略)

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

<訂正後>

(略)

委託会社の照会先
SOMPOアセットマネジメント株式会社
電話番号 0120-69-5432 (受付時間：営業日の午前9時～午後5時)
ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

(5)【その他】

<訂正前>

(略)

公告

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

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

(略)

<訂正後>

(略)

公告

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

<https://www.sompo-am.co.jp/>

(略)

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. 当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
3. 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、2019年10月25日から2020年4月24日までの財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【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】

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前 期 2019年10月24日現在	当 期 2020年4月24日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	95,889,207	52,150,136
投資信託受益証券	1,294,117,717	782,367,428
親投資信託受益証券	13,542,373	8,230,468
流動資産合計	1,403,549,297	842,748,032
資産合計	1,403,549,297	842,748,032
負債の部		
流動負債		
未払金	16,700,000	-
未払収益分配金	17,789,103	16,572,782
未払解約金	3,595,449	238,861
未払受託者報酬	36,321	23,392
未払委託者報酬	1,089,601	701,803
未払利息	170	155
その他未払費用	2,410	15,688
流動負債合計	39,213,054	17,552,681
負債合計	39,213,054	17,552,681
純資産の部		
元本等		
元本	5,082,601,009	4,735,080,698
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,718,264,766	3,909,885,347
元本等合計	1,364,336,243	825,195,351
純資産合計	1,364,336,243	825,195,351
負債純資産合計	1,403,549,297	842,748,032

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前 期 自 2019年4月25日 至 2019年10月24日	当 期 自 2019年10月25日 至 2020年4月24日
営業収益		
受取配当金	260,635,252	277,524,428
有価証券売買等損益	210,495,163	615,322,194

	前 期		当 期	
	自	2019年4月25日 至 2019年10月24日	自	2019年10月25日 至 2020年4月24日
営業収益合計		50,140,089		337,797,766
営業費用				
支払利息		29,342		19,052
受託者報酬		224,719		199,449
委託者報酬		6,741,642		5,983,496
その他費用		17,422		73,106
営業費用合計		7,013,125		6,275,103
営業利益又は営業損失()		43,126,964		344,072,869
経常利益又は経常損失()		43,126,964		344,072,869
当期純利益又は当期純損失()		43,126,964		344,072,869
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()		626,661		2,732,158
期首剰余金又は期首欠損金()		3,770,667,159		3,718,264,766
剰余金増加額又は欠損金減少額		314,269,567		488,211,871
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		314,269,567		488,211,871
剰余金減少額又は欠損金増加額		196,209,234		237,785,926
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		196,209,234		237,785,926
分配金		108,158,243		100,705,815
期末剰余金又は期末欠損金()		3,718,264,766		3,909,885,347

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

期別	前 期		当 期	
	2019年10月24日現在		2020年4月24日現在	
1. 受益権の総数		5,082,601,009口		4,735,080,698口
2. 元本の欠損		3,718,264,766円		3,909,885,347円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	0.2684円	1口当たり純資産額	0.1743円
	(1万口当たり純資産額)	(2,684円)	(1万口当たり純資産額)	(1,743円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前 期 自 2019年4月25日 至 2019年10月24日	当 期 自 2019年10月25日 至 2020年4月24日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2019年4月25日 至2019年5月24日) 計算期間末における経費控除後の配当等収益 (40,485,643円)(本ファンドに帰属すべき 親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益(0円)、信託約款に規定される収益調整金 (1,358,654,529円)及び分配準備積立金 (281,136,170円)より分配対象収益は 1,680,276,342円(1万口当たり3,223.09円) であり、うち18,246,274円(1万口当たり35 円)を分配金額としております。</p> <p>(自2019年5月25日 至2019年6月24日) 計算期間末における経費控除後の配当等収益 (41,536,625円)(本ファンドに帰属すべき 親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益(0円)、信託約款に規定される収益調整金 (1,363,790,156円)及び分配準備積立金 (299,640,883円)より分配対象収益は 1,704,967,664円(1万口当たり3,268.38円) であり、うち18,257,866円(1万口当たり35 円)を分配金額としております。</p> <p>(自2019年6月25日 至2019年7月24日) 計算期間末における経費控除後の配当等収益 (41,587,409円)(本ファンドに帰属すべき 親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益(0円)、信託約款に規定される収益調整金 (1,347,773,363円)及び分配準備積立金 (316,512,309円)より分配対象収益は 1,705,873,081円(1万口当たり3,314.38円) であり、うち18,014,047円(1万口当たり35 円)を分配金額としております。</p> <p>(自2019年7月25日 至2019年8月26日) 計算期間末における経費控除後の配当等収益 (42,338,333円)(本ファンドに帰属すべき 親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益(0円)、信託約款に規定される収益調整金 (1,346,349,903円)及び分配準備積立金 (337,087,452円)より分配対象収益は 1,725,775,688円(1万口当たり3,361.95円) であり、うち17,966,261円(1万口当たり35 円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2019年10月25日 至2019年11月25日) 計算期間末における経費控除後の配当等収益 (43,904,241円)(本ファンドに帰属すべき 親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益(0円)、信託約款に規定される収益調整金 (1,313,650,606円)及び分配準備積立金 (392,118,589円)より分配対象収益は 1,749,673,436円(1万口当たり3,518.17円) であり、うち17,406,306円(1万口当たり35 円)を分配金額としております。</p> <p>(自2019年11月26日 至2019年12月24日) 計算期間末における経費控除後の配当等収益 (43,704,618円)(本ファンドに帰属すべき 親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益(0円)、信託約款に規定される収益調整金 (1,285,333,987円)及び分配準備積立金 (405,919,072円)より分配対象収益は 1,734,957,677円(1万口当たり3,573.44円) であり、うち16,992,939円(1万口当たり35 円)を分配金額としております。</p> <p>(自2019年12月25日 至2020年1月24日) 計算期間末における経費控除後の配当等収益 (43,423,472円)(本ファンドに帰属すべき 親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益(0円)、信託約款に規定される収益調整金 (1,262,161,248円)及び分配準備積立金 (420,602,540円)より分配対象収益は 1,726,187,260円(1万口当たり3,630.21円) であり、うち16,642,668円(1万口当たり35 円)を分配金額としております。</p> <p>(自2020年1月25日 至2020年2月25日) 計算期間末における経費控除後の配当等収益 (44,318,999円)(本ファンドに帰属すべき 親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益(0円)、信託約款に規定される収益調整金 (1,264,401,825円)及び分配準備積立金 (440,893,990円)より分配対象収益は 1,749,614,814円(1万口当たり3,689.25円) であり、うち16,598,566円(1万口当たり35 円)を分配金額としております。</p>

項目	前 期		当 期	
	自 2019年4月25日 至 2019年10月24日		自 2019年10月25日 至 2020年4月24日	
	<p>（自2019年8月27日 至2019年9月24日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益 （43,851,250円）（本ファンドに帰属すべき 親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益（0円）、信託約款に規定される収益調整金 （1,342,516,587円）及び分配準備積立金 （357,588,941円）より分配対象収益は 1,743,956,778円（1万口当たり3,412.87円） であり、うち17,884,692円（1万口当たり35 円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年9月25日 至2019年10月24日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益 （43,832,470円）（本ファンドに帰属すべき 親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益（0円）、信託約款に規定される収益調整金 （1,339,163,829円）及び分配準備積立金 （377,891,117円）より分配対象収益は 1,760,887,416円（1万口当たり3,464.53円） であり、うち17,789,103円（1万口当たり35 円）を分配金額としております。</p>		<p>（自2020年2月26日 至2020年3月24日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益 （46,131,719円）（本ファンドに帰属すべき 親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益（0円）、信託約款に規定される収益調整金 （1,263,056,422円）及び分配準備積立金 （458,990,248円）より分配対象収益は 1,768,178,389円（1万口当たり3,752.36円） であり、うち16,492,554円（1万口当たり35 円）を分配金額としております。</p> <p>（自2020年3月25日 至2020年4月24日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益 （48,816,504円）（本ファンドに帰属すべき 親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益（0円）、信託約款に規定される収益調整金 （1,276,963,854円）及び分配準備積立金 （483,346,827円）より分配対象収益は 1,809,127,185円（1万口当たり3,820.67円） であり、うち16,572,782円（1万口当たり35 円）を分配金額としております。</p>	

（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	前 期		当 期	
	自 2019年4月25日 至 2019年10月24日		自 2019年10月25日 至 2020年4月24日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。		同左	
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>（1）金融商品の内容 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>		同左	

項目	前 期	当 期
	自 2019年4月25日 至 2019年10月24日	自 2019年10月25日 至 2020年4月24日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期	当 期
	2019年10月24日現在	2020年4月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

項目	前 期 2019年10月24日現在	当 期 2020年4月24日現在
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前 期 2019年10月24日現在	当 期 2020年4月24日現在
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

項目	前 期	当 期
	自 2019年4月25日 至 2019年10月24日	自 2019年10月25日 至 2020年4月24日
期首元本額	5,243,456,964円	5,082,601,009円
期中追加設定元本額	268,195,663円	313,792,037円
期中一部解約元本額	429,051,618円	661,312,348円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前 期 2019年10月24日現在	当 期 2020年4月24日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	2,562,827	13,282,597
親投資信託受益証券	81,114	16,783
合計	2,643,941	13,299,380

(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

2020年4月24日現在

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	TCW High Income US EQ Pre CuSep	1,036,248	782,367,428	
投資信託受益証券 合計		1,036,248	782,367,428	
親投資信託受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファンド	5,652,018	8,230,468	
親投資信託受益証券 合計		5,652,018	8,230,468	
合計			790,597,896	

(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。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

好配当米国株式プレミアム・ファンド 通貨セレクト・プレミアムコースの主要投資対象の状況は以下のとおりです。

*なお、以下は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

損保ジャパン日本債券マザーファンド

貸借対照表

科目	2019年10月24日現在	2020年4月24日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	96,171,219	178,066,839
国債証券	12,538,148,200	12,229,747,700
地方債証券	115,035,000	111,965,000
特殊債証券	344,898,216	633,394,427
社債証券	4,168,188,200	3,615,817,000
未収利息	18,892,898	17,043,706

科 目	2019年10月24日現在	2020年4月24日現在
	金額（円）	金額（円）
前払費用	2,373,285	1,584,064
流動資産合計	17,283,707,018	16,787,618,736
資産合計	17,283,707,018	16,787,618,736
負債の部		
流動負債		
未払利息	171	531
その他未払費用	-	9,651
流動負債合計	171	10,182
負債合計	171	10,182
純資産の部		
元本等		
元本	11,764,309,467	11,528,656,972
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,519,397,380	5,258,951,582
元本等合計	17,283,706,847	16,787,608,554
純資産合計	17,283,706,847	16,787,608,554
負債純資産合計	17,283,707,018	16,787,618,736

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

期別	2019年10月24日現在	2020年4月24日現在
1. 受益権の総数	11,764,309,467口	11,528,656,972口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.4692円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,692円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.4562円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,562円)</p>

(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 2019年4月25日 至 2019年10月24日	自 2019年10月25日 至 2020年4月24日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は(有価証券に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年10月24日現在	2020年4月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

2019年10月24日現在	2020年4月24日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	自 2019年4月25日 至 2019年10月24日	自 2019年10月25日 至 2020年4月24日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	11,559,953,243円	11,764,309,467円
同期中追加設定元本額	999,070,574円	1,416,233,297円
同期中一部解約元本額	794,714,350円	1,651,885,792円
元本の内訳*		
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）	87,253円	- 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）	910,608円	- 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）	1,642,919円	- 円
SNAM絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用）	298,951,279円	356,621,489円
SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド（2%コース）（F o F s用）（適格機関投資家専用）	- 円	29,246,106円

項目	自 2019年4月25日 至 2019年10月24日	自 2019年10月25日 至 2020年4月24日
SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド (4%コース)(FofS用)(適格機関投資 家専用)	- 円	34,752,024円
損保ジャパン日本債券ファンド	1,081,020,029円	1,076,670,639円
ハッピーエイジング20	140,754,506円	124,549,929円
ハッピーエイジング30	706,130,097円	646,855,746円
ハッピーエイジング40	3,750,769,035円	3,505,430,391円
ハッピーエイジング50	3,012,550,914円	2,917,016,379円
ハッピーエイジング60	2,293,025,362円	2,393,162,786円
パン・アフリカ株式ファンド	13,837,729円	9,901,573円
好配当グローバルREITプレミアム・ファン ド 円ヘッジありコース	1,512,353円	925,396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	11,613,726円	7,548,570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	216,363,333円	120,286,900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	9,217,515円	5,652,018円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド203 5	67,762,457円	101,894,317円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド204 5	28,295,568円	40,216,602円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド205 5	8,869,478円	12,081,529円
ターゲット・リターン戦略ファンド	120,995,306円	145,844,578円
計	11,764,309,467円	11,528,656,972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	2019年10月24日現在	2020年4月24日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	29,101,700	94,027,100
地方債証券	358,000	3,428,000
特殊債券	948,158	4,972,089
社債券	1,040,200	49,650,400
合計	31,448,058	152,077,589

(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

2020年4月24日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	第410回利付国債(2年)	600,000,000	603,048,000	
	第138回利付国債(5年)	720,000,000	727,272,000	
	第139回利付国債(5年)	1,020,000,000	1,030,995,600	
	第140回利付国債(5年)	660,000,000	667,299,600	
	第141回利付国債(5年)	60,000,000	60,704,400	
	第142回利付国債(5年)	750,000,000	759,127,500	
	第10回利付国債(40年)	60,000,000	69,757,200	
	第12回利付国債(40年)	80,000,000	82,002,400	
	第342回利付国債(10年)	40,000,000	40,618,800	
	第345回利付国債(10年)	40,000,000	40,698,800	
	第350回利付国債(10年)	370,000,000	376,785,800	
	第353回利付国債(10年)	190,000,000	193,146,400	
	第355回利付国債(10年)	620,000,000	629,120,200	
	第356回利付国債(10年)	240,000,000	243,283,200	
	第357回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,012,580,000	
	第35回利付国債(30年)	210,000,000	282,926,700	
	第38回利付国債(30年)	510,000,000	673,174,500	
	第43回利付国債(30年)	170,000,000	222,586,100	
	第53回利付国債(30年)	100,000,000	104,942,000	
	第57回利付国債(30年)	210,000,000	231,487,200	
	第58回利付国債(30年)	70,000,000	77,220,500	
	第60回利付国債(30年)	160,000,000	180,862,400	
	第62回利付国債(30年)	60,000,000	61,395,000	
	第63回利付国債(30年)	50,000,000	49,804,500	
	第65回利付国債(30年)	10,000,000	9,960,300	
	第113回利付国債(20年)	180,000,000	216,446,400	
	第130回利付国債(20年)	190,000,000	227,817,600	
	第131回利付国債(20年)	80,000,000	95,016,000	
	第144回利付国債(20年)	140,000,000	164,848,600	
	第146回利付国債(20年)	210,000,000	253,589,700	

	第149回利付国債(20年)	40,000,000	47,448,000	
	第150回利付国債(20年)	120,000,000	140,845,200	
	第151回利付国債(20年)	340,000,000	389,776,000	
	第152回利付国債(20年)	270,000,000	309,725,100	
	第154回利付国債(20年)	420,000,000	482,743,800	
	第157回利付国債(20年)	80,000,000	79,502,400	
	第158回利付国債(20年)	360,000,000	374,767,200	
	第162回利付国債(20年)	450,000,000	475,074,000	
	第166回利付国債(20年)	10,000,000	10,725,500	
	第167回利付国債(20年)	30,000,000	31,086,900	
	第170回利付国債(20年)	120,000,000	119,889,600	
	第171回利付国債(20年)	380,000,000	379,646,600	
国債証券 合計		11,420,000,000	12,229,747,700	
地方債証券	第15回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	111,965,000	
地方債証券 合計		100,000,000	111,965,000	
特殊債券	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	400,000,000	399,376,000	
	第78回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	97,479,000	
	第17回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,541,000	11,762,818	
	第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,063,000	13,407,732	
	第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,364,000	27,569,625	
	第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,693,000	32,515,243	
	第65回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,895,000	51,284,009	
特殊債券 合計		630,556,000	633,394,427	
社債券	第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債(劣後特約付)	100,000,000	102,807,000	
	第1回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(劣後特約付)	100,000,000	104,969,000	
	第23回前田建設工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	99,966,000	
	第1回積水ハウス株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保	100,000,000	101,131,000	
	第2回ユニゾホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同)	100,000,000	89,661,000	
	第30回東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,799,000	
	第21回大王製紙株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,524,000	
	第1回大陽日酸株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	100,000,000	101,544,000	
	第1回武田薬品工業株式会社無担保社債(劣後特約付)FR	200,000,000	203,972,000	
	日本製鉄株式会社第1回無担保社債(劣後特約付)FR	100,000,000	97,958,000	
	第29回富士電機株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約)	100,000,000	100,131,000	
	第1回日本生命第1回劣後ローン流動化株式会社利払繰延条項・期	100,000,000	100,660,000	

第1回ドンキホーテホールディングス無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	100,900,000	
第28回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	100,926,000	
第7回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	100,155,000	
第69回アコム株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,098,000	
第2回株式会社T&Dホールディングス無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	99,140,000	
第11回京阪神ビルディング株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	100,410,000	
第3回日本航空株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	93,386,000	
第547回東京電力株式会社社債(一般担保付)	120,000,000	120,498,000	
第565回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,171,000	
第566回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,245,000	
第568回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	200,640,000	
第12回東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	200,028,000	
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	99,823,000	
第27回東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	99,894,000	
第34回東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	200,338,000	
第3回A号富国生命劣後FR	200,000,000	196,800,000	
第3回A号明治安田生命劣後FR	200,000,000	198,138,000	
第2回A号住友生命劣後FR	100,000,000	100,105,000	
社債券 合計	3,620,000,000	3,615,817,000	
合計		16,590,924,127	

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。

The TCW Funds - TCW High Income US Equity Premium Fund

貸借対照表

2019年3月31日現在
アメリカドル

資産

現金	579,015
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	12,245,198
未収配当金	4,170
資産合計	12,828,383

負債

損益を通じて公正価値で測定する金融負債	255,035
未払管理報酬	28,178
未払助言報酬	25,226
未払専門家報酬	22,250
未払保管報酬	17,570
その他未払費用	6,001
負債合計	354,260

償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産	12,474,123
----------------------	------------

クラス当たりの純資産額（アメリカドル）：

通貨 セレクト シェア クラス	-
通貨セレクト プレミアム シェア クラス	12,474,123

発行済み口数（口）：

通貨セレクト シェア クラス	-
通貨セレクト プレミアム シェア クラス	832,939

1口当たりの純資産額（アメリカドル）：

通貨セレクト シェア クラス	-
通貨セレクト プレミアム シェア クラス	14.98

組入資産の明細

2019年3月31日現在

評価金額

（アメリカドル）

数量 純損益を通じて公正価値で測定される金融資産

	普通株式	
	アメリカ	
	Applications Software (純資産比率 5.9%)	
6,200	Microsoft Corp	731,228
	Banks (6.8%)	
2,600	JPMorgan Chase & Co	263,198
12,200	Wells Fargo & Co	589,504
	Total Banks	852,702
	Computers (6.1%)	
2,460	Apple Inc	467,277
4,200	NetApp Inc	291,228
	Total Computers	758,505
	Cosmetics/Personal Care (3.5%)	
4,200	Procter & Gamble Co/The	437,010

	Distribution/Wholesale (3.9%)	
9,600	KAR Auction Services Inc	492,576
	Electric (4.3%)	
2,750	NextEra Energy Inc	531,630
	Home Builders (2.4%)	
7,300	DR Horton Inc	302,074
	Insurance (4.7%)	
13,700	American International Group Inc	589,922
	Investment Companies (4.4%)	
32,000	Ares Capital Corp	548,480
	Machinery-Diversified (3.6%)	
5,700	Xylem Inc/NY	450,528
	Media (3.0%)	
3,500	Nexstar Media Group Inc	379,295
	Oil&Gas (4.9%)	
9,200	ConocoPhillips	614,008
	Pharmaceuticals (8.1%)	
3,400	Johnson & Johnson	475,286
12,700	Pfizer Inc	539,369
	Total Pharmaceuticals	1,014,655
	Real Estate (1.5%)	
3,700	CBRE Group Inc	182,965
	Retail (9.3%)	
1,800	Home Depot Inc/The	345,402
4,155	Target Corp	333,480
4,900	Walmart Inc	477,897
	Total Retail	1,156,779
	Semiconductors (3.4%)	
8,000	Intel Corp	429,600

数量	純損益を通じて公正価値で測定される金融資産	評価金額 (アメリカドル)
----	-----------------------	------------------

	普通株式 (続き)	
	アメリカ (続き)	
	Telecommunications (10.1%)	
10,000	AT&T Inc	313,600
8,700	Cisco Systems Inc	469,713
8,000	Verizon Communications Inc	473,040
	Total Telecommunications	1,256,353
	アメリカ合計	10,728,310
	普通株式合計	10,728,310
	不動産投資信託 (11.9%)	
	アメリカ	
4,000	American Tower Corp	788,240
1,500	Equinix Inc	679,740
	アメリカ合計	1,467,980

不動産投資信託合計

1,467,980

先物為替取引評価益(0.4%)

48,908

純損益を通じて公正価値で測定される金融資産合計(取得金額:11,272,990アメリカドル(98.2%))

12,245,198

数量	純損益を通じて公正価値で測定される金融負債	公正価値 (アメリカドル)
	売建オプション アメリカ 株式オプション(-1.2%)	
(2,500)	American International Group I	(487)
(4,000)	American Tower Corp.	(31,400)
(2,000)	Apple Inc.	(7,450)
(8,500)	AT & T Inc.	(4,505)
(6,500)	Cisco Systems Inc.	(1,885)
(6,500)	Conocophillips	(2,307)
(3,700)	Dr Horton Inc.	(1,776)
(800)	Equinix Inc.	(3,840)
(1,300)	Home Depot Inc.	(9,977)
(7,000)	Intel Corp.	(2,975)
(2,500)	Johnson & Johnson	(5,063)
(2,000)	JPMorgan Chase & Co.	(100)
(8,000)	Kar Auction Services Inc.	(18,600)
(4,000)	Microsoft Corp.	(4,200)
(3,000)	Netapp Inc.	(4,740)
(3,500)	Nexstar Media Group Inc.	(6,825)
(1,500)	Nextera Energy Inc.	(2,250)
(10,000)	Pfizer Inc.	(6,250)
(3,500)	Procter & Gamble Co.	(9,013)
(3,000)	Target Corp.	(10,200)
(5,000)	Verizon Communications Inc.	(8,975)
(3,500)	Walmart Inc.	(1,295)
(6,100)	Wells Fargo & Co.	(427)
(3,000)	Xylem Inc.	(2,700)
	株式オプション合計(-1.2%)	(147,240)
	通貨オプション(-0.2%)	
(2,300,000)	USD Put BRL Call @ 3.78 OTC Opt	(1,992)
(2,300,000)	USD Put IDR Call @ 14,195 OTC Opt	(5,035)
(2,300,000)	USD Put INR Call @ 69.45 OTC Opt	(8,726)
(2,300,000)	USD Put MXN Call @ 19.23 OTC Opt	(6,171)
(2,300,000)	USD Put PHP Call @ 51.95 OTC Opt	(398)
	通貨オプション合計(-0.2%)	(22,322)
	先物為替取引評価損(-0.7%)	(85,473)
	純損益を通じて公正価値で測定される金融負債合計 (取得金額:-138,172アメリカドル)(-2.1%)	(255,035)
	純損益を通じて公正価値で測定される金融資産・負債 合計(取得金額:11,134,818アメリカドル)(96.1%)	11,990,163
	その他負債超過資産(3.9%)	483,960
	純資産(100.0%)	12,474,123

(注1)TCWアセットマネジメントカンパニーからのデータ提供を受けて作成しております。

(注2)作成時点において、入手可能な直近計算期間の財務諸表を用いております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

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

2020年4月30日現在

資産総額	854,497,518円
負債総額	443,039円
純資産総額(-)	854,054,479円
発行済数量	4,770,627,332口
1単位当りの純資産額(/)	0.1790円

(参考)損保ジャパン日本債券マザーファンド

2020年4月30日現在

資産総額	16,911,213,961円
負債総額	11,343円
純資産総額(-)	16,911,202,618円
発行済数量	11,603,816,744口
1単位当りの純資産額(/)	1.4574円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<訂正前>

(1) 資本金の額（2019年10月末現在）

(略)

(2) 会社の機構（2019年10月末現在）

(略)

<訂正後>

(1) 資本金の額（2020年4月末現在）

(略)

(2) 会社の機構（2020年4月末現在）

(略)

2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

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

委託会社の運用する投資信託（親投資信託を除きます。）は2020年4月末現在、計210本（追加型株式投資信託134本、単位型株式投資信託25本、単位型公社債投資信託51本）であり、その純資産総額の合計は872,830百万円です。

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

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

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

(1)【貸借対照表】

		前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020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			5,031,436		5,030,360
2 前払費用			77,905		88,889
3 未収委託者報酬			892,311		1,062,114
4 未収運用受託報酬			1,133,534		958,520
5 未収収益			52		44
6 その他			5,489		1,347
流動資産合計			7,140,730		7,141,276
固定資産					
1 有形固定資産					
(1) 建物	1		23,660		19,412
(2) 器具備品	1		24,492		102,336
有形固定資産合計			48,153		121,748
2 無形固定資産					
(1) 電話加入権			4,535		4,535
無形固定資産合計			4,535		4,535
3 投資その他の資産					
(1) 投資有価証券			189,407		378,390
(2) 長期差入保証金			161,598		161,598
(3) 繰延税金資産			369,181		402,032
(4) その他			31		32
投資その他の資産合計			720,218		942,053
固定資産合計			772,907		1,068,337
資産合計			7,913,637		8,209,613

区分	注記 番号	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
(負債の部)					
流動負債					
1 預り金			12,372		6,729
2 未払金					
(1) 未払配当金	2	240,000		3,000,000	
(2) 未払手数料		320,577		351,384	
(3) その他未払金		193,367	753,944	180,135	3,531,520
3 未払費用			985,047		973,410
4 未払消費税等			15,760		47,391
5 未払法人税等			225,326		152,972
6 賞与引当金			125,066		115,230
7 役員賞与引当金			7,200		5,400
流動負債合計			2,124,718		4,832,655
固定負債					
1 退職給付引当金			134,243		150,881
2 資産除去債務			8,327		8,475
固定負債合計			142,570		159,356
負債合計			2,267,288		4,992,011

(純資産の部)				
株主資本				
1 資本金			1,550,000	1,550,000
2 資本剰余金				
(1) 資本準備金			413,280	413,280
資本剰余金合計			413,280	413,280
3 利益剰余金				
(1) その他利益剰余金				
繰越利益剰余金			3,675,113	1,257,468
利益剰余金合計			3,675,113	1,257,468
株主資本合計			5,638,393	3,220,749
評価・換算差額等				
1 その他有価証券評価差額金			7,956	3,147
評価・換算差額等合計			7,956	3,147
純資産合計			5,646,349	3,217,602
負債・純資産合計			7,913,637	8,209,613

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1 委託者報酬		4,693,325		4,761,002	
2 運用受託報酬		3,479,650	8,172,976	3,408,951	8,169,953
営業費用					
1 支払手数料		2,096,873		2,057,148	
2 広告宣伝費		30,230		16,106	
3 公告費		200		200	
4 調査費		2,532,683		2,381,706	
(1) 調査費		1,070,321		1,067,053	
(2) 委託調査費		1,457,726		1,311,310	
(3) 図書費		4,635		3,342	
5 営業雑経費		165,973		184,920	
(1) 通信費		6,109		6,023	
(2) 印刷費		145,335		163,235	
(3) 諸会費		14,528	4,825,961	15,660	4,640,082
一般管理費					
1 給料		1,523,789		1,567,354	
(1) 役員報酬		75,540		83,506	
(2) 給料・手当		1,260,953		1,286,043	
(3) 賞与		187,295		197,805	
2 福利厚生費		183,912		188,710	
3 交際費		10,052		13,169	
4 寄付金		300		300	
5 旅費交通費		39,791		45,892	
6 法人事業税		41,849		50,010	

7	租税公課		15,555		26,124	
8	不動産賃借料		208,923		211,714	
9	退職給付費用		58,381		67,288	
10	賞与引当金繰入		125,066		115,230	
11	役員賞与引当金繰入		7,200		5,400	
12	固定資産減価償却費		11,976		13,153	
13	諸経費		353,873	2,580,671	349,338	2,653,688
営業利益				766,343		876,182
営業外収益						
1	受取配当金		98		191	
2	受取利息		281		272	
3	有価証券売却益		12,029		-	
4	有価証券償還益		-		1,358	
5	保険配当金		366		448	
6	雑益		2,459	15,236	1,033	3,305
営業外費用						
1	有価証券売却損		-		2	
2	為替差損		3,184		2,620	
3	事務過誤費		4,341		-	
4	雑損		198	7,724	266	2,889
経常利益				773,855		876,598
特別損失						
1	固定資産除却損	1	7		409	
2	商号変更費用		-	7	13,256	13,666
税引前当期純利益				773,847		862,932
法人税・住民税及び事業税				342,518		309,915
法人税等調整額				97,828		29,339
当期純利益				529,156		582,355

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計
		資本 準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	3,385,956	3,385,956	5,349,236
当期変動額						
剰余金の配当				240,000	240,000	240,000
当期純利益				529,156	529,156	529,156
株主資本以外の 項目の当期 変動額（純 額）						
当期変動額合 計	-	-	-	289,156	289,156	289,156
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,675,113	3,675,113	5,638,393

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本 準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	3,675,113	3,675,113	5,638,393
当期変動額						
剰余金の配当				3,000,000	3,000,000	3,000,000
当期純利益				582,355	582,355	582,355
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）						
当期変動額合 計	-	-	-	2,417,644	2,417,644	2,417,644
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	1,257,468	1,257,468	3,220,749

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価差 額金	評価・換 算差額等 合計	
当期首残高	7,956	7,956	5,646,349
当期変動額			
剰余金の配当			3,000,000
当期純利益			582,355
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）	11,103	11,103	11,103
当期変動額合 計	11,103	11,103	2,428,747
当期末残高	3,147	3,147	3,217,602

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	15年
器具備品	2～20年

3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

4. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 役員賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

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

5. 消費税等の会計処理方法

税抜方式を採用しております。

(表示方法の変更)

(損益計算書)

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

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額は、次のとおりであります。

(単位：千円)

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

2 関係会社項目

関係会社に対する負債は、次のとおりであります。

（単位：千円）

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

（損益計算書関係）

1 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。

（単位：千円）

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4. 剰余金の配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額	1株当たり配当額	基準日	効力発生日
2020年3月11日 取締役会	普通株式	3,000,000千円	124,558円	-	2020年3月31日

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	5,031,436	5,031,436	-
(2) 未収委託者報酬	892,311	892,311	-
(3) 未収運用受託報酬	1,133,534	1,133,534	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	188,657	188,657	-
資産計	7,245,941	7,245,941	-
(1) 未払費用	985,047	985,047	-
負債計	985,047	985,047	-

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	5,030,360	5,030,360	-
(2) 未収委託者報酬	1,062,114	1,062,114	-
(3) 未収運用受託報酬	958,520	958,520	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	377,640	377,640	-

資産計	7,428,635	7,428,635	-
(1) 未払金	3,531,520	3,531,520	-
(2) 未払費用	973,410	973,410	-
負債計	4,504,931	4,504,931	-

注1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券取引に関する事項

資産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、及び(3) 未収運用受託報酬

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

(4) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払金及び(2) 未払費用

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

注2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
非上場株式	750	750

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

注3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2019年3月31日)

(単位：千円)

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

当事業年度(2020年3月31日)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
(1) 預金	5,030,197	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,062,114	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	958,520	-	-	-
(4) 投資有価証券				

その他有価証券のうち 満期があるもの				
株式	-	-	-	-
債券	-	-	-	-
その他	-	157,275	19,415	200,950
合計	7,050,832	157,275	19,415	200,950

注4. 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

(有価証券関係)

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

該当事項はありません。

4. その他有価証券で時価のあるもの

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

	種類	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	233,779	229,700	4,079
	小計	233,779	229,700	4,079
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	143,861	151,087	7,226
	小計	143,861	151,087	7,226
合計		377,640	380,787	3,147

5. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
(1) 株式	24,900	9,900	-

(2) 債券	-	-	-
(3) その他	13,229	2,130	0
合計	38,129	12,030	0

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	97	-	2
合計	97	-	2

（退職給付関係）

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

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

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

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

2．簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

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

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：千円）

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

（3）退職給付費用

（単位：千円）

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

3．確定拠出制度

（単位：千円）

	前事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）	当事業年度 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）
--	--	--

当社の確定拠出制度への要 拠出額	25,915	30,681
---------------------	--------	--------

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別の内訳

（単位：千円）

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

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

	前事業年度 （2019年3月31日）	当事業年度 （2020年3月31日）
法定実効税率 （調整）	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。	30.6%
交際費等永久に損金に算入されない項目		1.3
住民税均等割		0.3
評価性引当額の増減		0.1
その他		0.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率		32.5

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

本社事務所の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3．当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

当社は、投資運用事業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

(単位:千円)

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

(注) 営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

(単位:千円)

日本	欧州	米国	中東	アジア	合計
7,171,851	490,694	259,796	192,226	55,384	8,169,953

(注) 営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

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

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
該当事項はありません。

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

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

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

注2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

(注2) 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

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

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金 (千円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパンDC証券株式会社	東京都新宿区	3,000,000	確定拠出年金業	-	投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託代行手数料の支払(注1)	498,922	未払手数料	115,372
同一の親会社を持つ会社	SOMPOひまわり生命保険株式会社	東京都新宿区	17,250,000	生命保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用	運用受託報酬の受取り(注2)	169,211	未収運用受託報酬	94,179

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

注2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

(注2) 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

- (1) 親会社情報
S O M P Oホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）
- (2) 重要な関連会社の要約財務情報
関連会社はありません。

(1株当たり情報)

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

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

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

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益(千円)	529,156	582,355
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	529,156	582,355
期中平均株式数(株)	24,085	24,085

5【その他】

<訂正前>

- (1) 定款の変更
2019年6月27日付で取締役の数の上限を変更する定款の変更を行いました。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
2020年4月1日付で商号をS O M P Oアセットマネジメント株式会社に変更する予定です。

<訂正後>

- (1) 定款の変更
2020年4月1日付で商号をS O M P Oアセットマネジメント株式会社に変更する定款変更を行いました。
2020年6月26日付で監査役の補欠選任に関する条文を削除する定款変更を行いました。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
2020年4月1日付で商号をS O M P Oアセットマネジメント株式会社に変更しました。

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】

<訂正前>

(1) 受託会社

(略)

資本金の額

247,369百万円（2019年3月末現在）

(略)

<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（2019年3月末現在）

(略)

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 ¹ (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。
auカブコム証券株式会社	7,196	
立花証券株式会社	6,695	
フィデリティ証券株式会社	9,257 ²	
マネックス証券株式会社	12,200	
楽天証券株式会社	7,495	

¹資本金の額は、2019年3月末現在²フィデリティ証券株式会社の資本金の額は、2019年1月23日現在

<訂正後>

(1) 受託会社

(略)

資本金の額

247,369百万円（2020年3月末現在）

(略)

<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（2020年3月末現在）

(略)

(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。
auカブコム証券株式会社	7,196	
立花証券株式会社	6,695	
フィデリティ証券株式会社	10,007	

マネックス証券株式会社	12,200
楽天証券株式会社	7,495

資本金の額は、2020年3月末現在

第3【その他】

<訂正前>

(略)

ご投資家のみなさまへ

当ファンドは、米国の大手運用会社(TCW)が厳選する米国の株式等に投資するファンドです。

以下の収入を獲得する戦略により、信託財産の成長を目指します。

1. 好配当の米国株式等から得られる配当収入
2. 米国株式等を一定の値段で購入できる権利(コールオプション)を売却することによる収入
3. 高金利通貨との為替取引を行うことによる金利差収入
4. 高金利通貨を対米ドルで一定の値段で購入できる権利(コールオプション)を売却することによる収入

コールオプションの売却により収入を得ますが、米国株式等や高金利通貨の値上がり益の一部または全部を享受することはできなくなります。

なお、米国株式等や高金利通貨が値下がりする場合のリスクはご負担いただきます。

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント

<訂正後>

(略)

ご投資家のみなさまへ

当ファンドは、米国の大手運用会社(TCW)が厳選する米国の株式等に投資するファンドです。

以下の収入を獲得する戦略により、信託財産の成長を目指します。

1. 好配当の米国株式等から得られる配当収入
2. 米国株式等を一定の値段で購入できる権利(コールオプション)を売却することによる収入
3. 高金利通貨との為替取引を行うことによる金利差収入
4. 高金利通貨を対米ドルで一定の値段で購入できる権利(コールオプション)を売却することによる収入

コールオプションの売却により収入を得ますが、米国株式等や高金利通貨の値上がり益の一部または全部を享受することはできなくなります。

なお、米国株式等や高金利通貨が値下がりする場合のリスクはご負担いただきます。

SOMPOアセットマネジメント

独立監査人の監査報告書

2020年6月25日

SOMPOアセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている好配当米国株式プレミアム・ファンド 通貨セレクト・プレミアムコースの2019年10月25日から2020年4月24日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、好配当米国株式プレミアム・ファンド 通貨セレクト・プレミアムコースの2020年4月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、

監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年6月11日

SOMPOアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているS O M P Oアセットマネジメント株式会社（旧損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社）の2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、S O M P Oアセットマネジメント株式会社（旧損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社）の2020年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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