

【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8月4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】	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
【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】	SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055 募集額 5,000億円を上限とします。 SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045 募集額 5,000億円を上限とします。 SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035 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2月4日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）につきまして、半期報告書の提出に伴い、訂正すべき事項がありましたので、これを訂正するものであります。

2【訂正の内容】

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

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

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

第一部【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>

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

<訂正後>

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

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

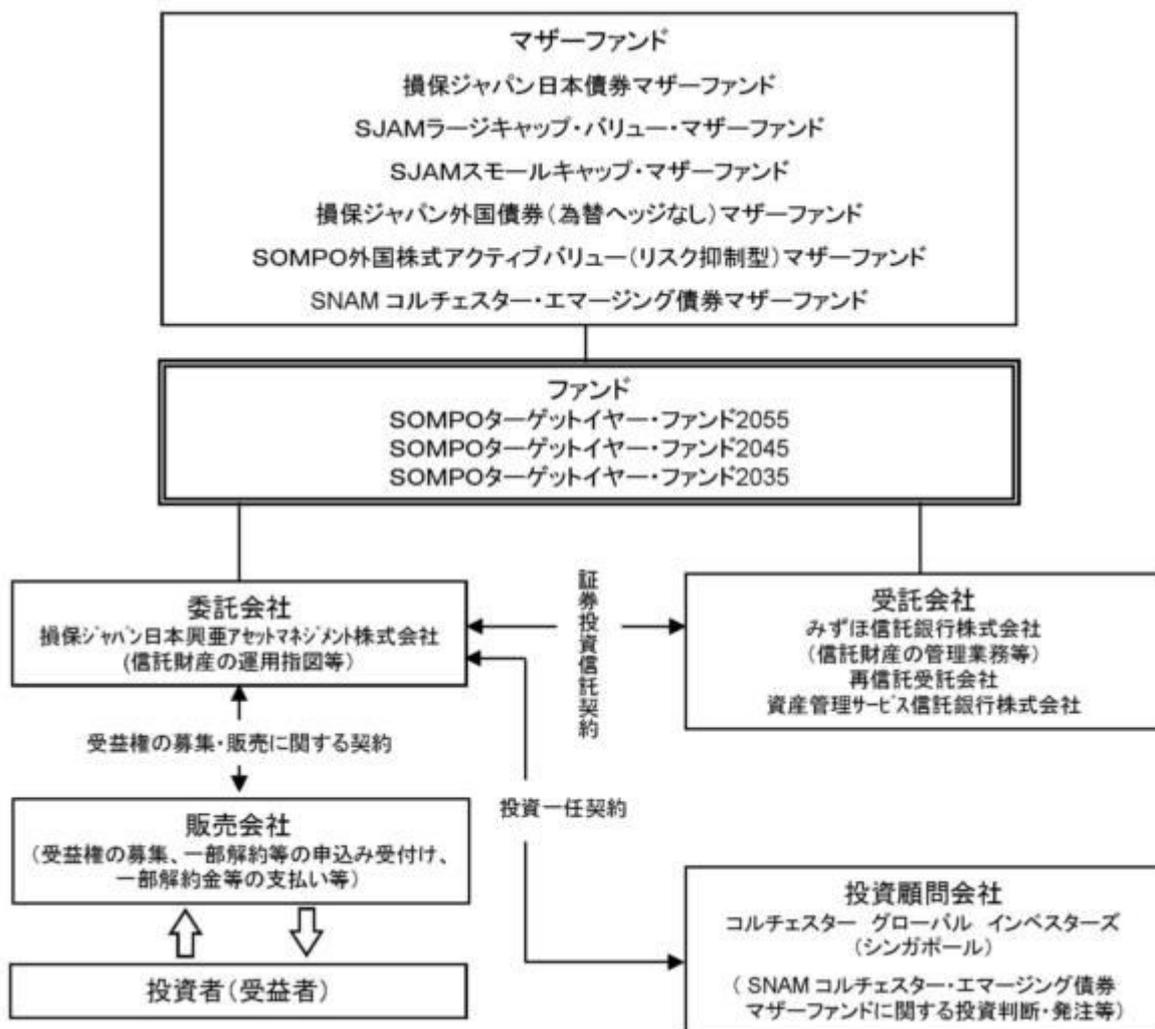
1【ファンドの性格】

(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。

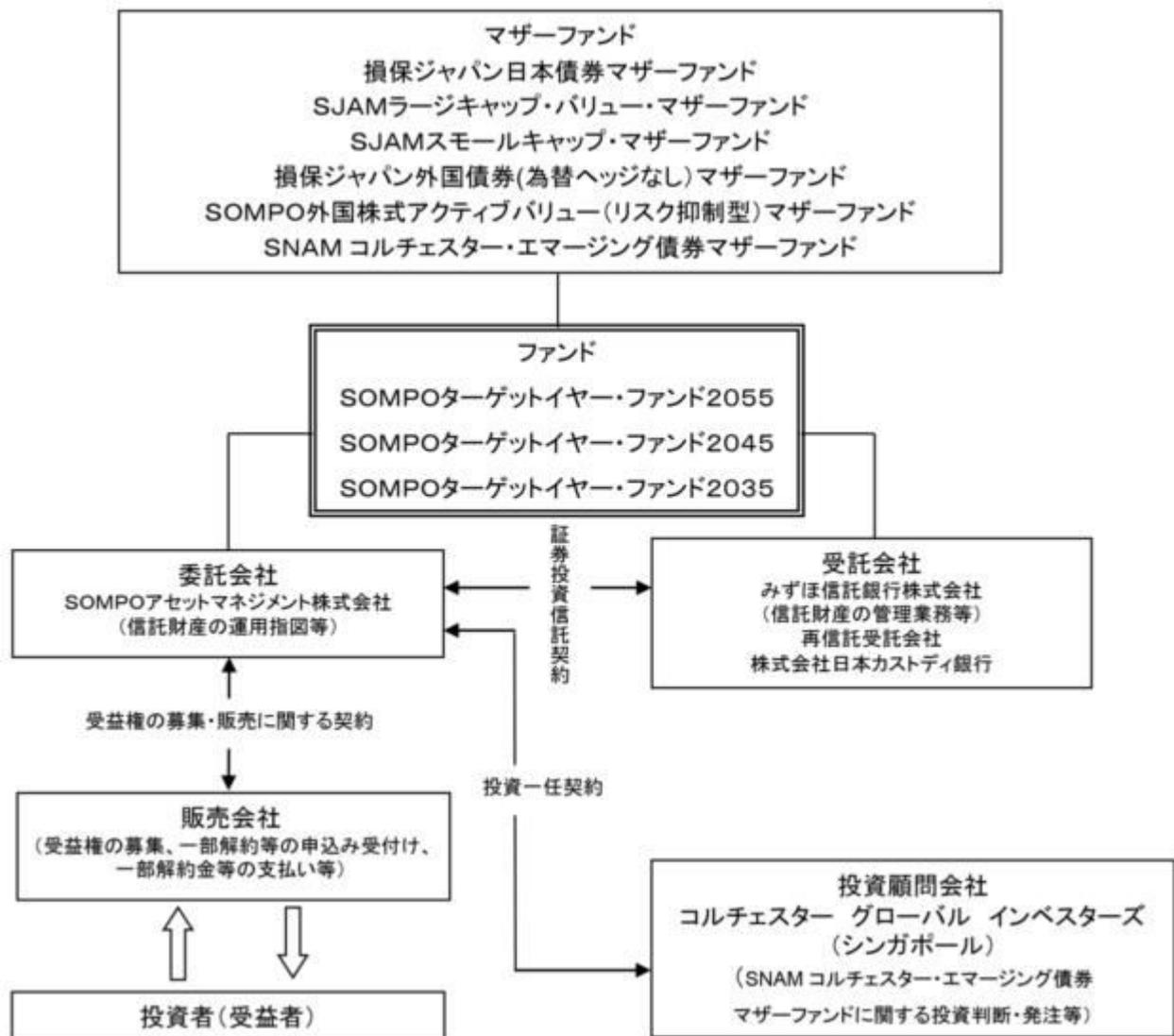
(略)

<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：株式会社日本カストディ銀行)

委託会社との証券投資信託契約に基づき、ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理業

務などを行い、収益分配金、一部解約金および償還金の交付、また信託財産に関する報告書を作成し委託会社への交付を行います。なお、信託事務の処理の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。

(略)

<訂正前>

委託会社等の概況

() 資本金の額 1,550百万円 (2019年11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11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5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5月末現在)

(略)

2【投資方針】

(2)【投資対象】

<訂正前>

(略)

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」、「SJAMラージキャップ・バリュウ・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ウ(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」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。

(略)

<訂正後>

(略)

委託会社は、信託金を、主としてSOMPOアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された「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・バリュウ・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ウ(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」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。

(略)

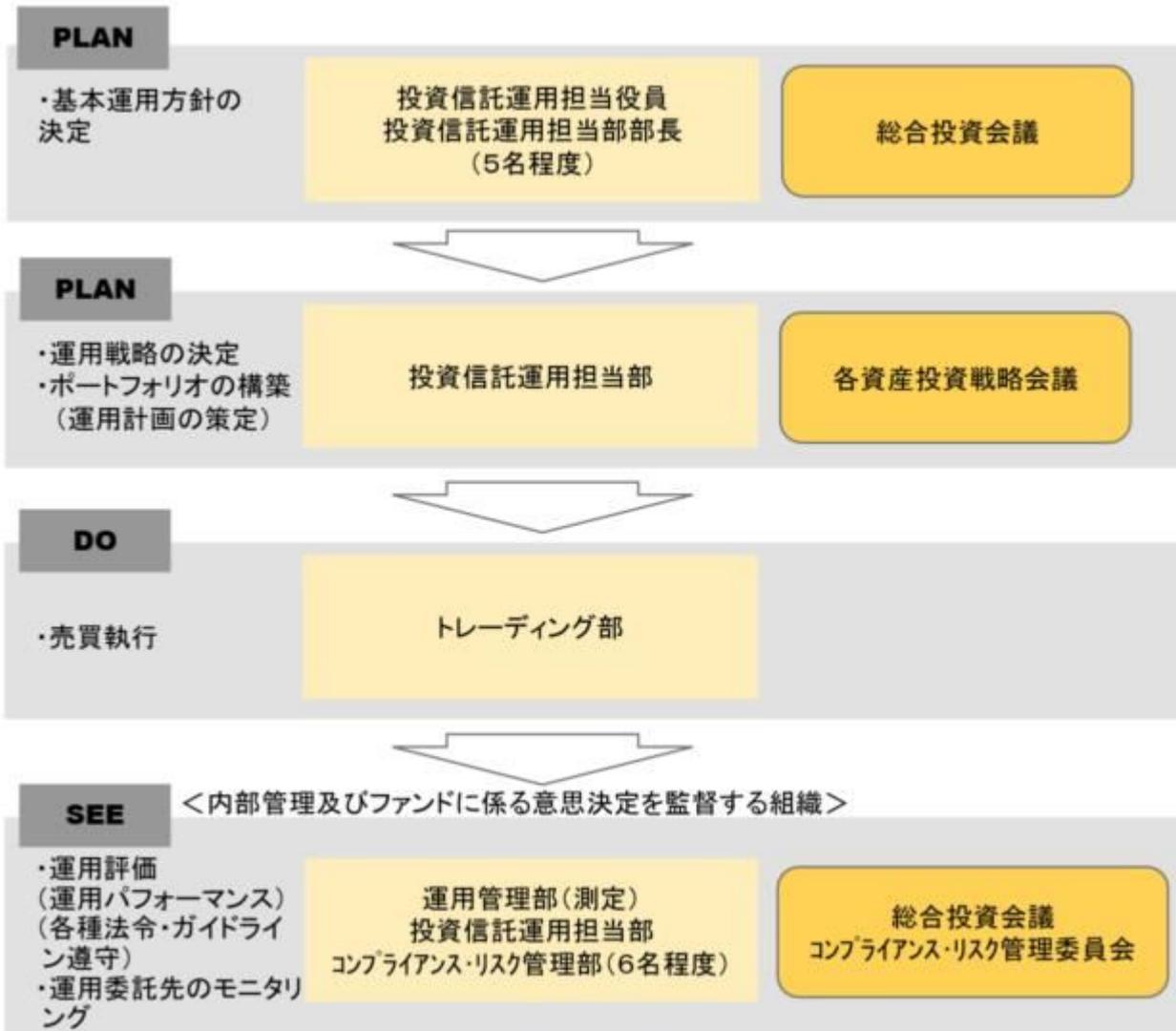
(3)【運用体制】

<訂正前>

a. 委託会社の運用体制と社内規程

(運用体制)

(略)



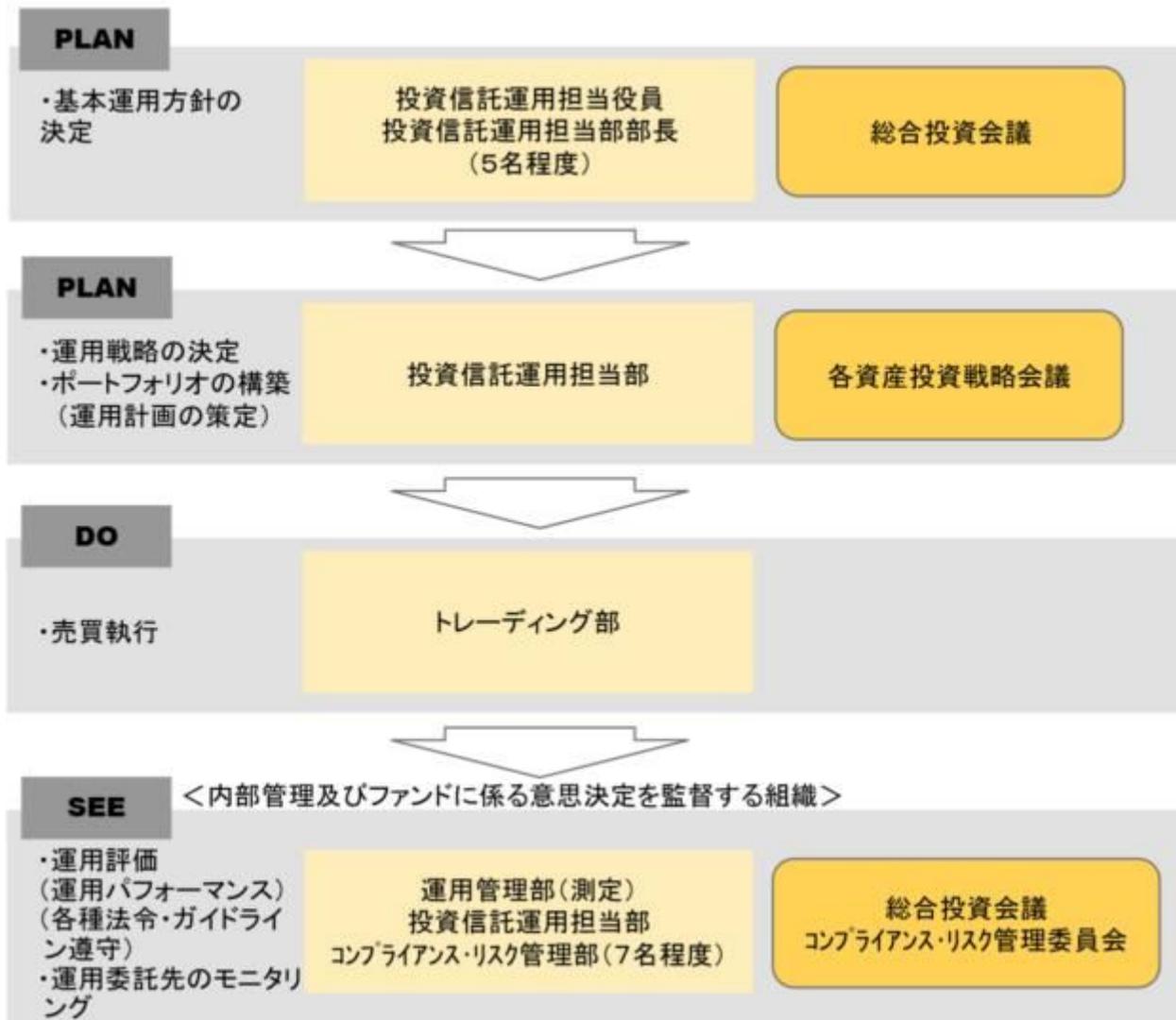
2019年11月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

b. 運用委託先の運用体制等
(略)

2019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。

< 訂正後 >

a. 委託会社の運用体制と社内規程
(運用体制)
(略)



2020年5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

(略)

2020年5月末現在のものであり、今後変更される場合もあります。

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。

(略)

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移

※データは、設定日より掲載しています。

2014年12月～2019年11月

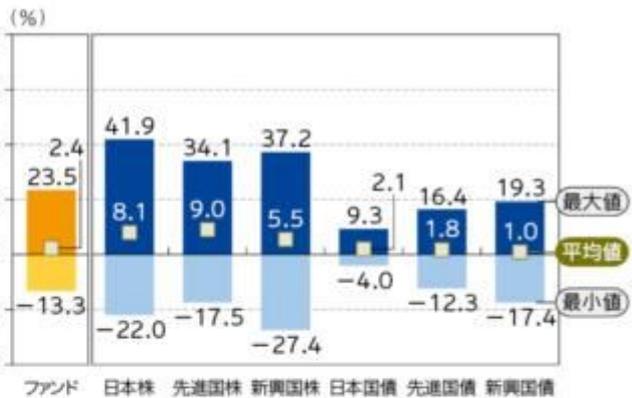
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055



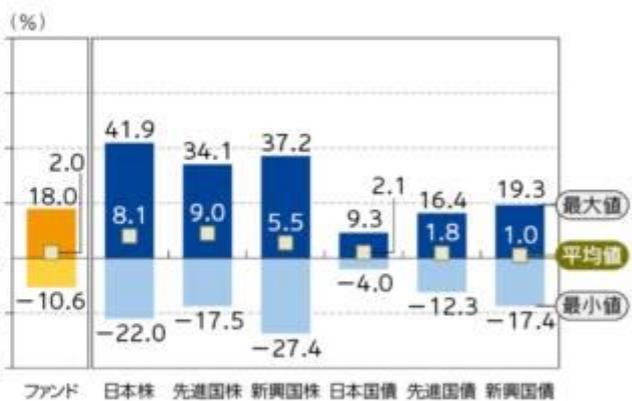
ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

※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。

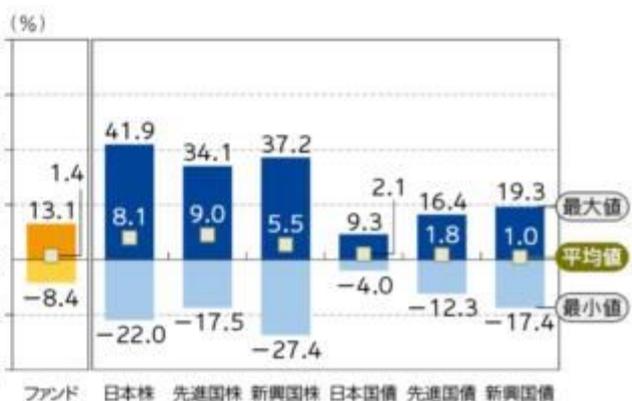
ファンド：2017年10月～2019年11月
代表的な資産クラス：2014年12月～2019年11月



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、同指数の内容を変え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、同指数の内容を変え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 - EM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。

<訂正後>

(略)

<リスクの管理体制>

(略)

(注)上図は、2020年5月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

(略)

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移

※データは、設定日より掲載しています。

2015年6月～2020年5月

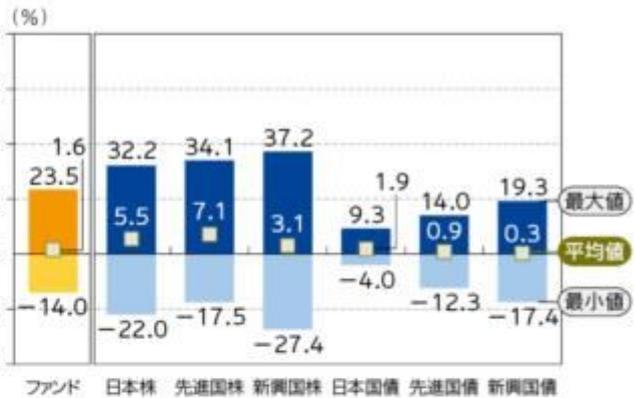
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055



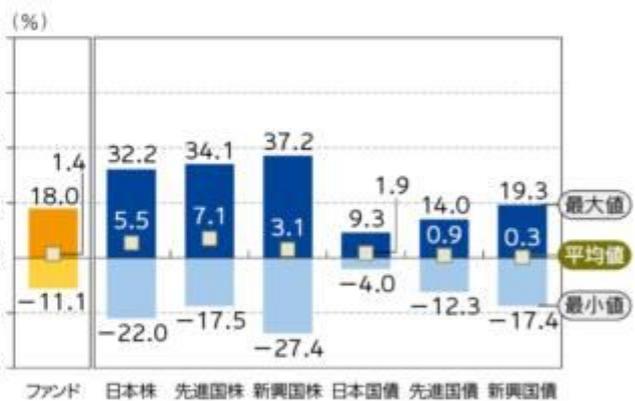
ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

※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～2020年5月
代表的な資産クラス：2015年6月～2020年5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、同指数の内容を変え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、同指数の内容を変え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GBI-EMグローバル・ディバースィファイド(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。

<訂正後>

(略)

上記は2020年5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

2020年5月29日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	32,231,313	15.30
親投資信託受益証券	日本	173,923,208	82.58
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		4,450,074	2.12

純資産総額	210,604,595	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。

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

2020年5月29日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	29,974,071	11.23
親投資信託受益証券	日本	233,059,464	87.35
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		3,788,336	1.42
純資産総額		266,821,871	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。

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

2020年5月29日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	27,430,498	6.30
親投資信託受益証券	日本	404,411,488	92.82
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		3,849,086	0.88
純資産総額		435,691,072	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5月29日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	12,577,211,500	72.51
地方債証券	日本	111,496,000	0.64
特殊債券	日本	630,476,010	3.63
社債券	日本	3,010,457,400	17.36
	フランス	203,225,000	1.17
		3,213,682,400	18.53
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		812,117,478	4.69
純資産総額		17,344,983,388	100.00

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

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

（参考）S J A M ラージキャップ・バリュー・マザーファンド

2020年5月29日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	32,832,501,390	97.59
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		811,092,448	2.41
純資産総額		33,643,593,838	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）S J A M スモールキャップ・マザーファンド

2020年5月29日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	8,885,447,000	98.31
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		152,834,364	1.69
純資産総額		9,038,281,364	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

2020年5月29日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	3,515,208,825	43.57
	ドイツ	880,451,869	10.91
	フランス	839,864,761	10.41
	イタリア	567,726,198	7.04
	イギリス	495,128,928	6.14
	スペイン	343,518,622	4.26
	ベルギー	179,063,850	2.22
	カナダ	162,459,929	2.01
	オーストラリア	157,524,803	1.95
	オランダ	78,896,112	0.98
	メキシコ	56,998,788	0.71
	アイルランド	55,108,573	0.68
	ポーランド	44,743,003	0.55
	デンマーク	35,255,328	0.44
	マレーシア	30,452,134	0.38
スウェーデン	26,467,398	0.33	

	ノルウェー	18,718,693	0.23
		7,487,587,814	92.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		580,340,464	7.19
純資産総額		8,067,928,278	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) 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

2020年5月29日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	406,498,674	58.37
	スイス	44,176,989	6.34
	ドイツ	29,897,043	4.29
	イギリス	27,573,394	3.96
	アイルランド	22,788,037	3.27
	フランス	18,079,329	2.60
	カナダ	12,104,593	1.74
	スペイン	10,969,063	1.58
	デンマーク	10,538,060	1.51
	香港	8,170,123	1.17
	ノルウェー	7,294,230	1.05
	ジャージー	6,834,394	0.98
	シンガポール	6,424,847	0.92
	バミューダ	5,742,053	0.82
	オーストラリア	5,720,231	0.82
	ケイマン	5,595,505	0.80
	オランダ	830,992	0.12
		629,237,557	90.36
投資証券	アメリカ	35,109,760	5.04
	シンガポール	6,355,863	0.91
		41,465,623	5.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		25,678,632	3.69
純資産総額		696,381,812	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) SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

2020年5月29日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	416,100,920	17.64

	インドネシア	403,731,524	17.11
	南アフリカ	333,827,562	14.15
	ロシア	323,107,969	13.70
	コロンビア	297,898,481	12.63
	ブラジル	274,536,963	11.64
	マレーシア	209,387,535	8.88
	ポーランド	27,298,948	1.16
		2,285,889,902	96.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		73,227,130	3.10
純資産総額		2,359,117,032	100.00

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

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

その他資産の投資状況

2020年5月29日現在

資産の種類	建別	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		803,916,515	34.08
	売建		805,180,750	34.13

(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。

2020年5月29日現在

資産の種類	建別	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
直物為替先渡取引	買建		372,512,727	15.79
	売建		419,122,101	17.77

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

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

(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

2020年5月29日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	SOMPO外国株式アクティブバリュウ(リスク抑制型)マザーファンド	56,191,289	1.3494	75,828,076	1.2624	70,935,883	33.68
2	日本	親投資信託受益証券	SJAMスモールキャップ・マザーファンド	15,575,098	2.3329	36,335,948	2.1879	34,076,756	16.18

3	日本	親投資信託 受益証券	S J A M ラージキャップ・バ リュウ・マザーファンド	21,150,660	1.7894	37,848,540	1.6097	34,046,217	16.17
4	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	6,754	5,224.92	35,289,166	4,772.18	32,231,313	15.30
5	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファ ンド	15,194,946	1.4639	22,244,205	1.4518	22,060,022	10.47
6	日本	親投資信託 受益証券	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	5,638,346	1.1989	6,759,893	1.1625	6,554,577	3.11
7	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券(為替ヘッ ジなし)マザーファンド	3,767,408	1.6247	6,121,143	1.6589	6,249,753	2.97

(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5月29日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	15.30
親投資信託受益証券	82.58
合計	97.89

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

S O M P O ターゲットイヤー・ファンド2045

2020年5月29日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファ ンド	45,461,785	1.4644	66,575,474	1.4518	66,001,419	24.74
2	日本	親投資信託 受益証券	S O M P O 外国株式アクティブバ リュウ(リスク抑制型)マザー ファンド	50,152,252	1.3456	67,485,182	1.2624	63,312,202	23.73
3	日本	親投資信託 受益証券	S J A M スモールキャップ・マ ザーファンド	16,802,942	2.3033	38,702,217	2.1879	36,763,156	13.78
4	日本	親投資信託 受益証券	S J A M ラージキャップ・バ リュウ・マザーファンド	22,720,580	1.7768	40,369,927	1.6097	36,573,317	13.71
5	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	6,281	5,239.46	32,909,058	4,772.18	29,974,071	11.23
6	日本	親投資信託 受益証券	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	18,486,300	1.2043	22,263,052	1.1625	21,490,323	8.05
7	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券(為替ヘッ ジなし)マザーファンド	5,376,483	1.6228	8,725,249	1.6589	8,919,047	3.34

(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5月29日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	11.23
親投資信託受益証券	87.35
合計	98.58

（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。

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

2020年5月29日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファン ド	110,440,213	1.4646	161,758,370	1.4518	160,337,101	36.80
2	日本	親投資信託 受益証券	SOMPO外国株式アクティブバ リュウ（リスク抑制型）マザー ファンド	43,745,152	1.3193	57,716,468	1.2624	55,223,879	12.68
3	日本	親投資信託 受益証券	SJAMスモールキャップ・マ ザーファンド	24,114,527	2.2589	54,472,306	2.1879	52,760,173	12.11
4	日本	親投資信託 受益証券	SJAMラージキャップ・バ リュウ・マザーファンド	32,614,335	1.7661	57,600,178	1.6097	52,499,295	12.05
5	日本	親投資信託 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	38,388,141	1.1980	45,988,993	1.1625	44,626,213	10.24
6	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	23,488,352	1.6211	38,078,605	1.6589	38,964,827	8.94
7	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	5,748	5,214.53	29,973,153	4,772.18	27,430,498	6.30

（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5月29日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	6.30
親投資信託受益証券	92.82
合計	99.12

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

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5月29日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率(%)	償還日	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	2,290,000,000	101.06	2,314,499,600	101.07	2,314,640,400	0.1000000	2024/12/20	13.34
2	日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	1,490,000,000	101.37	1,510,551,400	101.05	1,505,659,900	0.1000000	2029/12/20	8.68
3	日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	660,000,000	102.16	674,256,000	100.99	666,586,800	0.1000000	2024/6/20	3.84
4	日本	国債証券	第38回利付国債(30年)	510,000,000	134.23	684,606,500	130.47	665,442,900	1.8000000	2043/3/20	3.84
5	日本	国債証券	第410回利付国債(2年)	600,000,000	100.46	602,785,600	100.46	602,784,000	0.1000000	2022/3/1	3.48
6	日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	420,000,000	117.13	491,958,600	114.42	480,580,800	1.2000000	2035/9/20	2.77
7	日本	国債証券	第162回利付国債(20年)	450,000,000	107.10	481,954,400	105.02	472,594,500	0.6000000	2037/9/20	2.72
8	日本	国債証券	第408回利付国債(2年)	400,000,000	100.46	401,876,000	100.42	401,684,000	0.1000000	2022/1/1	2.32
9	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	99.67	398,692,000	0.0010000	2027/1/29	2.30
10	日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	340,000,000	116.07	394,640,400	114.14	388,079,400	1.2000000	2034/12/20	2.24
11	日本	国債証券	第171回利付国債(20年)	380,000,000	98.97	376,086,000	99.17	376,865,000	0.3000000	2039/12/20	2.17
12	日本	国債証券	第158回利付国債(20年)	360,000,000	105.68	380,448,000	103.59	372,927,600	0.5000000	2036/9/20	2.15
13	日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	320,000,000	102.58	328,256,000	101.22	323,920,000	0.1000000	2029/6/20	1.87
14	日本	国債証券	第152回利付国債(20年)	270,000,000	113.90	307,530,000	114.21	308,367,000	1.2000000	2035/3/20	1.78
15	日本	国債証券	第35回利付国債(30年)	210,000,000	136.77	287,221,200	133.24	279,804,000	2.0000000	2041/9/20	1.61
16	日本	国債証券	第146回利付国債(20年)	210,000,000	123.31	258,961,500	120.21	252,455,700	1.7000000	2033/9/20	1.46
17	日本	国債証券	第43回利付国債(30年)	190,000,000	133.19	253,066,300	129.23	245,540,800	1.7000000	2044/6/20	1.42
18	日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	240,000,000	101.06	242,544,000	101.11	242,683,200	0.1000000	2029/9/20	1.40
19	日本	国債証券	第57回利付国債(30年)	210,000,000	111.77	234,735,900	108.31	227,459,400	0.8000000	2047/12/20	1.31
20	日本	国債証券	第130回利付国債(20年)	190,000,000	122.36	232,497,300	119.40	226,863,800	1.8000000	2031/9/20	1.31
21	日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	180,000,000	122.68	220,833,000	119.76	215,569,800	2.1000000	2029/9/20	1.24
22	日本	社債券	第1回武田薬品工業株式会社無担保社債(劣後特付)FR	200,000,000	102.54	205,098,000	101.87	203,758,000	1.7200000	2079/6/6	1.17

23	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	101.36	202,722,000	0.7500000	2025/4/23	1.17
24	日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	200,000,000	100.97	201,940,000	100.91	201,822,000	0.1000000	2023/12/20	1.16
25	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	100.24	200,484,000	1.1550000	2020/9/8	1.16
26	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	99.47	198,946,000	1.1100000	2047/11/6	1.15
27	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	98.29	196,580,000	1.0200000	9999/99/99	1.13
28	日本	国債証券	第60回利付国債(30年)	160,000,000	114.23	182,774,000	111.01	177,630,400	0.9000000	2048/9/20	1.02
29	日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	170,000,000	100.95	171,620,000	100.95	171,623,500	0.1000000	2024/3/20	0.99
30	日本	国債証券	第53回利付国債(30年)	160,000,000	105.66	169,067,800	103.43	165,496,000	0.6000000	2046/12/20	0.95

(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。

(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5月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	72.51
地方債証券	0.64
特殊債券	3.63
社債券	18.53
合計	95.32

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考) S J A M ラージキャップ・バリュース・マザーファンド

2020年5月29日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,479,200	549.84	2,462,843,328	444.20	1,989,660,640	5.91
2	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	581,900	3,671.52	2,136,457,488	3,119.00	1,814,946,100	5.39
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	634,500	2,746.51	1,742,660,595	2,444.00	1,550,718,000	4.61

4	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	521,600	3,003.41	1,566,578,656	2,784.00	1,452,134,400	4.32
5	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	321,800	3,696.13	1,189,414,634	4,191.00	1,348,663,800	4.01
6	日本	株式	三菱電機	電気機器	855,600	1,536.95	1,315,014,420	1,418.50	1,213,668,600	3.61
7	日本	株式	鹿島建設	建設業	957,600	1,259.41	1,206,011,016	1,222.00	1,170,187,200	3.48
8	日本	株式	日本製鉄	鉄鋼	1,117,900	1,336.59	1,494,173,961	992.60	1,109,627,540	3.30
9	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	510,200	2,242.70	1,144,225,540	2,137.50	1,090,552,500	3.24
10	日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	852,700	1,423.30	1,213,647,910	1,254.50	1,069,712,150	3.18
11	日本	株式	日揮ホールディングス	建設業	901,900	1,496.61	1,349,792,559	1,159.00	1,045,302,100	3.11
12	日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	742,700	1,595.42	1,184,918,434	1,403.00	1,042,008,100	3.10
13	日本	株式	ヤマダ電機	小売業	1,884,000	582.34	1,097,128,560	524.00	987,216,000	2.93
14	日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	1,968,600	548.86	1,080,485,796	462.90	911,264,940	2.71
15	日本	株式	日本テレビホールディングス	情報・通信業	671,900	1,433.74	963,329,906	1,244.00	835,843,600	2.48
16	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	94,100	8,923.85	839,734,285	8,450.00	795,145,000	2.36
17	日本	株式	小松製作所	機械	361,000	2,184.28	788,525,080	2,180.00	786,980,000	2.34
18	日本	株式	セイコーエプソン	電気機器	648,100	1,632.02	1,057,712,162	1,214.00	786,793,400	2.34
19	日本	株式	クラレ	化学	690,800	1,244.14	859,451,912	1,132.00	781,985,600	2.32
20	日本	株式	ヤマトホールディングス	陸運業	313,900	1,912.43	600,311,777	2,384.00	748,337,600	2.22
21	日本	株式	クレディセゾン	その他金融業	537,800	1,771.37	952,642,786	1,283.00	689,997,400	2.05
22	日本	株式	三井住友トラスト・ホールディングス	銀行業	208,000	3,906.81	812,616,480	3,171.00	659,568,000	1.96
23	日本	株式	東京瓦斯	電気・ガス業	251,200	2,375.08	596,620,096	2,570.50	645,709,600	1.92
24	日本	株式	電源開発	電気・ガス業	313,900	2,475.81	777,156,759	2,033.00	638,158,700	1.90
25	日本	株式	大和ハウス工業	建設業	226,000	2,581.70	583,464,200	2,674.50	604,437,000	1.80
26	日本	株式	三井不動産	不動産業	290,400	2,834.13	823,031,352	2,073.50	602,144,400	1.79
27	日本	株式	三菱地所	不動産業	345,300	1,968.86	679,847,358	1,713.00	591,498,900	1.76
28	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,444,300	492.57	711,418,851	400.90	579,019,870	1.72
29	日本	株式	日本郵船	海運業	337,700	1,709.83	577,409,591	1,553.00	524,448,100	1.56
30	日本	株式	ケーズホールディングス	小売業	363,400	1,294.14	470,290,476	1,380.00	501,492,000	1.49

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別及び業種別投資比率

2020年5月29日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	8.38
		食料品	3.24
		繊維製品	1.34
		化学	2.32
		医薬品	4.01
		石油・石炭製品	0.87

ガラス・土石製品	1.10
鉄鋼	4.42
非鉄金属	3.18
機械	5.98
電気機器	5.95
輸送用機器	8.73
電気・ガス業	4.82
陸運業	5.49
海運業	1.56
情報・通信業	7.09
小売業	4.42
銀行業	13.27
証券、商品先物取引業	2.71
保険業	3.10
その他金融業	2.05
不動産業	3.55
合計	97.59

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

（参考）S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

2020年5月29日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （%）
1	日本	株式	E I Z O	電気機器	70,000	3,577.69	250,438,300	4,020.00	281,400,000	3.11
2	日本	株式	八十二銀行	銀行業	665,000	390.86	259,926,610	398.00	264,670,000	2.93
3	日本	株式	シチズン時計	精密機器	682,000	488.04	332,847,518	385.00	262,570,000	2.91
4	日本	株式	伊予銀行	銀行業	420,000	494.52	207,698,400	609.00	255,780,000	2.83
5	日本	株式	N O K	輸送用機器	180,000	1,509.17	271,650,600	1,379.00	248,220,000	2.75
6	日本	株式	日本ライフライン	卸売業	170,000	1,606.73	273,145,516	1,452.00	246,840,000	2.73
7	日本	株式	東邦ホールディングス	卸売業	114,200	2,459.65	280,892,169	2,151.00	245,644,200	2.72
8	日本	株式	七十七銀行	銀行業	148,000	1,364.72	201,978,560	1,537.00	227,476,000	2.52
9	日本	株式	日鉄ソリューションズ	情報・通信業	77,000	2,768.45	213,171,378	2,952.00	227,304,000	2.51
10	日本	株式	ノーリツ鋼機	精密機器	150,000	1,632.46	244,869,088	1,445.00	216,750,000	2.40
11	日本	株式	広島銀行	銀行業	370,000	476.39	176,264,300	505.00	186,850,000	2.07
12	日本	株式	ほくほくフィナンシャルグループ	銀行業	203,000	930.20	188,832,214	908.00	184,324,000	2.04
13	日本	株式	コメリ	小売業	69,000	2,113.83	145,854,270	2,658.00	183,402,000	2.03
14	日本	株式	山口フィナンシャルグループ	銀行業	280,000	691.83	193,712,400	644.00	180,320,000	2.00
15	日本	株式	みらかホールディングス	サービス業	69,000	2,380.00	164,220,000	2,506.00	172,914,000	1.91
16	日本	株式	群馬銀行	銀行業	511,000	347.14	177,389,201	337.00	172,207,000	1.91
17	日本	株式	北洋銀行	銀行業	832,000	208.41	173,397,251	203.00	168,896,000	1.87
18	日本	株式	ツクイ	サービス業	316,000	444.77	140,548,901	503.00	158,948,000	1.76

19	日本	株式	キョーリン製薬ホールディングス	医薬品	68,000	1,798.48	122,296,640	2,331.00	158,508,000	1.75
20	日本	株式	A O K I ホールディングス	小売業	223,000	998.61	222,690,485	688.00	153,424,000	1.70
21	日本	株式	メイテック	サービス業	28,000	5,283.34	147,933,520	5,200.00	145,600,000	1.61
22	日本	株式	A D E K A	化学	97,000	1,286.82	124,821,540	1,499.00	145,403,000	1.61
23	日本	株式	ダイビル	不動産業	135,000	1,009.68	136,306,800	1,050.00	141,750,000	1.57
24	日本	株式	西日本フィナンシャルホールディングス	銀行業	190,000	649.79	123,461,979	742.00	140,980,000	1.56
25	日本	株式	P A L T A C	卸売業	25,000	5,157.50	128,937,500	5,280.00	132,000,000	1.46
26	日本	株式	第四北越フィナンシャルグループ	銀行業	58,000	2,427.53	140,796,861	2,262.00	131,196,000	1.45
27	日本	株式	エクセディ	輸送用機器	75,000	2,012.03	150,902,250	1,733.00	129,975,000	1.44
28	日本	株式	大同特殊鋼	鉄鋼	35,000	3,991.56	139,704,600	3,695.00	129,325,000	1.43
29	日本	株式	トッパン・フォームズ	その他製品	110,000	956.71	105,238,100	1,121.00	123,310,000	1.36
30	日本	株式	シークス	卸売業	116,000	1,076.94	124,926,134	1,060.00	122,960,000	1.36

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別及び業種別投資比率

2020年5月29日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	1.41
		食料品	0.48
		繊維製品	1.34
		パルプ・紙	0.76
		化学	4.14
		医薬品	3.31
		ゴム製品	0.21
		ガラス・土石製品	0.25
		鉄鋼	2.56
		非鉄金属	0.81
		金属製品	1.12
		機械	1.69
		電気機器	6.64
		輸送用機器	5.94
		精密機器	7.23
		その他製品	2.64
		電気・ガス業	0.94
		陸運業	0.31
		倉庫・運輸関連業	0.50
		情報・通信業	2.51
卸売業	9.85		
小売業	9.80		

	銀行業	22.51
	その他金融業	1.67
	不動産業	2.25
	サービス業	7.43
合計		98.31

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

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

2020年5月29日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	利率(%)	償還日	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	Treasury 2.125 240229	4,470,000	10,929.34	488,541,909	11,494.78	513,817,067	2.1250000	2024/2/29	6.37
2	アメリカ	国債証券	Treasury 1.75 291115	3,650,000	11,906.10	434,572,833	11,824.93	431,610,298	1.7500000	2029/11/15	5.35
3	アメリカ	国債証券	Treasury 2.25 270215	3,240,000	12,045.16	390,263,296	11,986.23	388,354,004	2.2500000	2027/2/15	4.81
4	アメリカ	国債証券	Treasury 2.875 490515	1,910,000	14,050.66	268,367,608	14,412.38	275,276,463	2.8750000	2049/5/15	3.41
5	アメリカ	国債証券	Treasury 2.125 250515	2,170,000	10,875.58	236,000,177	11,682.96	253,520,372	2.1250000	2025/5/15	3.14
6	アメリカ	国債証券	Treasury 1.875 260630	1,940,000	10,852.52	210,539,052	11,662.80	226,258,409	1.8750000	2026/6/30	2.80
7	アメリカ	国債証券	Treasury 2.125 210815	1,860,000	11,005.48	204,701,984	11,003.76	204,669,996	2.1250000	2021/8/15	2.54
8	アメリカ	国債証券	Treasury 3.0 480215	1,340,000	11,586.35	155,257,191	14,597.19	195,602,447	3.0000000	2048/2/15	2.42
9	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 250228	1,540,000	11,235.16	173,021,534	11,971.95	184,368,081	2.7500000	2025/2/28	2.29
10	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 280215	1,470,000	11,349.79	166,841,935	12,522.20	184,076,406	2.7500000	2028/2/15	2.28
11	ドイツ	国債証券	GERMANY 0 300215	1,450,000	12,551.65	181,999,011	12,408.22	179,919,239	0.0000000	2030/2/15	2.23
12	ドイツ	国債証券	GERMANY 0.25 290215	1,350,000	12,717.12	171,681,221	12,689.84	171,312,931	0.2500000	2029/2/15	2.12
13	ドイツ	国債証券	GERMANY 0.5 280215	1,250,000	12,964.77	162,059,687	12,877.35	160,966,967	0.5000000	2028/2/15	2.00
14	フランス	国債証券	FRA 0.00 240325	1,290,000	12,250.07	158,025,945	12,139.58	156,600,650	0.0000000	2024/3/25	1.94
15	アメリカ	国債証券	Treasury 2.875 430515	1,120,000	11,337.96	126,985,188	13,933.53	156,055,601	2.8750000	2043/5/15	1.93
16	フランス	国債証券	FRANCE 0.25 261125	1,250,000	12,287.90	153,598,777	12,324.35	154,054,449	0.2500000	2026/11/25	1.91
17	ドイツ	国債証券	GERMANY 2.5 460815	720,000	19,307.10	139,011,129	19,816.44	142,678,379	2.5000000	2046/8/15	1.77
18	イタリア	国債証券	ITALY 2.8 281201	1,060,000	13,923.91	147,593,493	13,316.35	141,153,325	2.8000000	2028/12/1	1.75
19	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA 4.75 270421	1,530,000	8,936.09	136,722,197	9,128.66	139,668,524	4.7500000	2027/4/21	1.73
20	フランス	国債証券	FRANCE 4.0 381025	690,000	19,696.58	135,906,423	19,566.98	135,012,185	4.0000000	2038/10/25	1.67
21	フランス	国債証券	FRANCE 0.0 220525	1,030,000	12,108.67	124,719,389	12,039.63	124,008,242	0.0000000	2022/5/25	1.54
22	スペイン	国債証券	SPAIN 1.5 270430	850,000	12,856.50	109,280,331	12,975.75	110,293,949	1.5000000	2027/4/30	1.37

23	スペイン	国債証券	SPAIN 0.25 240730	850,000	12,036.40	102,309,440	12,112.54	102,956,614	0.2500000	2024/7/30	1.28
24	イギリス	国債証券	UK GILT 4.0 600122	340,000	25,318.40	86,082,583	29,746.62	101,138,520	4.0000000	2060/1/22	1.25
25	ドイツ	国債証券	GERMANY 4.0 370104	490,000	20,845.36	102,142,300	20,339.89	99,665,504	4.0000000	2037/1/4	1.24
26	カナダ	国債証券	CANADA 5.75 290601	860,000	10,677.99	91,830,758	11,373.46	97,811,824	5.7500000	2029/6/1	1.21
27	イタリア	国債証券	ITALY 1.75 240701	780,000	12,245.67	95,516,289	12,384.63	96,600,158	1.7500000	2024/7/1	1.20
28	イタリア	国債証券	ITALY 1.45 250515	760,000	12,070.86	91,738,559	12,216.42	92,844,823	1.4500000	2025/5/15	1.15
29	アメリカ	国債証券	Treasury 1.625 230531	760,000	10,668.05	81,077,190	11,200.76	85,125,788	1.6250000	2023/5/31	1.06
30	フランス	国債証券	FRANCE 1.25 340525	550,000	13,540.19	74,471,082	13,611.79	74,864,866	1.2500000	2034/5/25	0.93

（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5月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	92.81
合計	92.81

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）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

2020年5月29日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,343	14,650.58	19,675,740	15,803.68	21,224,348	3.05
2	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	462	33,755.10	15,594,858	38,056.19	17,581,964	2.52
3	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	2,740	6,279.93	17,207,021	5,991.57	16,416,906	2.36
4	アメリカ	株式	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,140	6,126.74	13,111,242	6,431.36	13,763,130	1.98
5	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	507	24,037.29	12,186,908	26,359.90	13,364,471	1.92
6	アイルランド	株式	AON CORP	保険	620	20,835.14	12,917,788	21,365.13	13,246,384	1.90

7	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	510	21,034.99	10,727,848	24,243.71	12,364,294	1.78
8	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	610	16,287.57	9,935,418	19,505.94	11,898,625	1.71
9	アメリカ	株式	ADOBE SYSTEMS INC	ソフトウェア・サービス	290	37,053.79	10,745,600	40,843.12	11,844,505	1.70
10	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE		540	23,025.78	12,433,923	21,633.96	11,682,339	1.68
11	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	556	20,024.23	11,133,475	20,888.77	11,614,160	1.67
12	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	814	14,696.40	11,962,873	14,225.14	11,579,267	1.66
13	スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED-B	食品・飲料・タバコ	975	11,739.26	11,445,779	11,468.71	11,181,999	1.61
14	アメリカ	株式	MARSH&MCLENNAN COS	保険	940	11,110.35	10,443,735	11,461.62	10,773,925	1.55
15	アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小売り	810	12,909.44	10,456,647	13,300.38	10,773,312	1.55
16	デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,502	6,650.57	9,989,170	7,016.01	10,538,060	1.51
17	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	300	29,308.37	8,792,513	34,221.42	10,266,427	1.47
18	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	806	12,990.69	10,470,504	12,479.93	10,058,825	1.44
19	アメリカ	株式	NIKE INC -CL B	耐久消費財・アパレル	950	9,486.63	9,012,307	10,587.40	10,058,034	1.44
20	アメリカ	株式	S&P GLOBAL INC	各種金融	290	30,220.36	8,763,905	34,280.56	9,941,364	1.43
21	アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	440	19,728.97	8,680,747	21,685.57	9,541,653	1.37
22	アメリカ	株式	COLGATE-PALMOLIVE CO	家庭用品・パーソナル用品	1,160	7,616.69	8,835,361	7,751.83	8,992,132	1.29
23	アメリカ	株式	ALLSTATE CORP	保険	850	11,210.64	9,529,049	10,565.89	8,981,013	1.29
24	アメリカ	株式	INTUIT INC	ソフトウェア・サービス	290	29,644.65	8,596,949	30,524.54	8,852,117	1.27
25	アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CO	ソフトウェア・サービス	650	14,785.37	9,610,494	13,390.71	8,703,962	1.25
26	アメリカ	株式	ROCKWELL AUTOMATION INC	資本財	370	18,832.82	6,968,144	23,269.49	8,609,712	1.24
27	アメリカ	株式	TEXAS INSTRUMENTS INCORPORATED	半導体・半導体製造装置	690	12,363.66	8,530,928	12,459.50	8,597,056	1.23
28	アメリカ	株式	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	ソフトウェア・サービス	1,457	6,305.53	9,187,158	5,774.36	8,413,244	1.21
29	アメリカ	株式	TJX COMPANIES INC	小売	1,430	5,691.81	8,139,297	5,815.22	8,315,768	1.19
30	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC		1,450	7,953.02	11,531,883	5,520.59	8,004,856	1.15

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別及び業種別投資比率

2020年5月29日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	2.72
		素材	2.31
		資本財	5.08
		商業・専門サービス	0.39
		運輸	0.54
		自動車・自動車部品	0.38
		耐久消費財・アパレル	2.14
		消費者サービス	0.87
		メディア・娯楽	4.04
		小売	5.85
		食品・生活必需品小売り	3.22
		食品・飲料・タバコ	3.49
		家庭用品・パーソナル用品	4.84
		ヘルスケア機器・サービス	2.12
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	11.97
		銀行	3.74
		各種金融	2.67
		保険	8.79
		不動産	0.61
		ソフトウェア・サービス	12.19
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.05		
電気通信サービス	6.01		
公益事業	2.12		
半導体・半導体製造装置	1.23		
投資証券			5.95
合計			96.31

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

(参考) SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

2020年5月29日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率(%)	償還日	投資 比率 (%)
1	南アフリカ	国債証券	S-AFRICA 10.5 261221	17,177,000	692.42	118,937,845	703.32	120,809,991	10.5000000	2026/12/21	5.12
2	インドネシア	国債証券	INDONESIA 8.25 290515	10,698,000,000	0.81	86,768,930	0.77	83,187,584	8.2500000	2029/5/15	3.53
3	メキシコ	国債証券	MEXICO 10.0 241205	14,273,000	553.54	79,006,910	572.42	81,702,477	10.0000000	2024/12/5	3.46
4	コロンビア	国債証券	COLOMBIA 7.5 260826	2,417,000,000	3.18	76,975,007	3.34	80,902,488	7.5000000	2026/8/26	3.43
5	インドネシア	国債証券	INDONESIA 8.125 240515	9,859,000,000	0.79	78,855,109	0.77	76,171,797	8.1250000	2024/5/15	3.23

6	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10.0 290101	3,100,000	2,332.38	72,304,083	2,422.61	75,100,911	0.0000000	2029/1/1	3.18
7	メキシコ	国債証券	MEXICO 7.5 270603	14,012,000	511.45	71,665,399	527.91	73,971,214	7.5000000	2027/6/3	3.14
8	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10.0 270101	2,755,000	2,355.08	64,882,591	2,396.22	66,015,933	10.0000000	2027/1/1	2.80
9	ロシア	国債証券	RUSSIA 8.15 270203	36,236,000	171.88	62,282,449	177.75	64,411,258	8.1500000	2027/2/3	2.73
10	ロシア	国債証券	RUSSIA 6.9 290523	37,241,000	160.82	59,892,159	167.83	62,503,001	6.9000000	2029/5/23	2.65
11	コロンビア	国債証券	COLOMBIA 7.0 220504	1,972,400,000	3.04	60,060,053	3.09	61,047,853	7.0000000	2022/5/4	2.59
12	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10.0 230101	2,496,000	2,254.03	56,260,624	2,328.76	58,125,949	10.0000000	2023/1/1	2.46
13	インドネシア	国債証券	INDONESIA 8.375 340315	6,619,000,000	0.81	53,868,728	0.76	50,417,691	8.3750000	2034/3/15	2.14
14	ロシア	国債証券	RUSSIA 7.05 280119	29,675,000	163.63	48,557,511	169.03	50,160,578	7.0500000	2028/1/19	2.13
15	ロシア	国債証券	RUSSIA 7.7 330323	27,969,000	172.51	48,249,854	179.24	50,133,739	7.7000000	2033/3/23	2.13
16	南アフリカ	国債証券	S-AFRICA 8.75 480228	9,442,000	498.75	47,092,503	503.39	47,530,575	8.7500000	2048/2/28	2.01
17	メキシコ	国債証券	MEXICO 7.75 310529	8,713,000	522.39	45,516,258	535.11	46,624,591	7.7500000	2031/5/29	1.98
18	南アフリカ	国債証券	S-AFRICA 8.75 440131	9,127,000	494.50	45,133,773	505.21	46,111,298	8.7500000	2044/1/31	1.95
19	南アフリカ	国債証券	S-AFRICA 7.0 310228	8,515,000	522.36	44,479,069	516.96	44,019,628	7.0000000	2031/2/28	1.87
20	コロンビア	国債証券	COLOMBIA 6.0 280428	1,398,600,000	2.96	41,402,518	3.01	42,102,164	6.0000000	2028/4/28	1.78
21	マレーシア	国債証券	MALAYSIA 4.059 240930	1,599,000	2,606.85	41,683,562	2,630.77	42,066,117	4.0590000	2024/9/30	1.78
22	コロンビア	国債証券	COLOMBIA 10.0 240724	1,114,900,000	3.45	38,515,383	3.57	39,895,881	10.0000000	2024/7/24	1.69
23	メキシコ	国債証券	MEXICO 8.5 290531	6,872,000	544.00	37,383,946	561.06	38,556,214	8.5000000	2029/5/31	1.63
24	インドネシア	国債証券	INDONESIA 7.5 320815	5,351,000,000	0.75	40,481,168	0.71	38,211,491	7.5000000	2032/8/15	1.62
25	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10.0 210101	1,759,000	2,106.71	37,057,091	2,151.64	37,847,397	10.0000000	2021/1/1	1.60
26	マレーシア	国債証券	MALAYSIA 3.882 220310	1,443,000	2,530.17	36,510,458	2,544.75	36,720,756	3.8820000	2022/3/10	1.56
27	メキシコ	国債証券	MEXICO 8.0 471107	6,805,000	522.11	35,529,968	532.89	36,263,744	8.0000000	2047/11/7	1.54
28	インドネシア	国債証券	INDONESIA 8.375 390415	4,683,000,000	0.79	37,104,424	0.76	35,799,868	8.3750000	2039/4/15	1.52
29	メキシコ	国債証券	MEXICO 8.5 381118	6,328,000	566.30	35,835,979	562.95	35,624,094	8.5000000	2038/11/18	1.51
30	南アフリカ	国債証券	S-AFRICA 6.25 360331	8,384,000	431.82	36,204,570	422.16	35,394,169	6.2500000	2036/3/31	1.50

(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5月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	96.90

合計	96.90
----	-------

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

【投資不動産物件】

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) 損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) SJAMラージキャップ・バリュウ・マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 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。

(参考) 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) SOMPO外国株式アクティブバリュウ(リスク抑制型)マザーファンド

該当事項はありません。

(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

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）損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）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。

（参考）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。

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）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。

（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

2020年5月29日現在

種類	通貨	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	ドル	買建	3,612,816.97	387,223,953	388,415,230	16.46
	メキシコペソ	買建	2,292,800.00	10,435,459	11,074,224	0.47
	チェココルナ	買建	688,400.00	2,960,120	3,035,844	0.13
	ハンガリーフォリント	買建	359,043,000.00	120,279,405	122,272,093	5.18
	ポーランドズロチ	買建	4,020,200.00	104,070,758	107,402,148	4.55
	ルーマニアレイ	買建	1,352,200.00	32,547,454	33,237,076	1.41
	タイバーツ	買建	18,248,000.00	60,728,036	61,678,239	2.61
	ランド	買建	12,488,075.00	75,054,555	76,801,661	3.26
	ドル	売建	3,784,085.22	406,075,787	406,814,160	17.24
	メキシコペソ	売建	3,088,100.00	13,660,574	14,891,664	0.63

チェココルナ	売建	344,200.00	1,483,502	1,517,922	0.06
ハンガリーフォリント	売建	231,870,300.00	78,835,902	78,998,211	3.35
ポーランドズロチ	売建	2,924,900.00	76,530,371	78,146,685	3.31
ルーマニアレイ	売建	1,352,200.00	32,765,210	33,237,076	1.41
タイバーツ	売建	18,248,000.00	60,295,640	61,678,240	2.61
ランド	売建	21,163,750.00	123,652,754	129,896,792	5.51

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当銘柄の時価の比率です。

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

2020年5月29日現在

種類	買建/ 売建	通貨	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
直物為替先渡取引	買建	ブラジルリアル/ドル	1,207,469.31	129,839,174	130,083,762	5.51
		チリアンペソ/ドル	1,037,868.07	111,601,953	114,242,265	4.84
		コロンビアペソ/ドル	514,701.50	55,345,852	55,710,198	2.36
		ペルーヌエボソル/ドル	30,815.93	3,313,636	3,318,682	0.14
		インドネシアルピア/ドル	625,751.98	67,287,110	69,157,818	2.93
	売建	ブラジルリアル/ドル	343,965.76	36,986,638	36,908,543	1.56
		コロンビアペソ/ドル	988,678.92	106,312,644	111,259,525	4.72
		ペルーヌエボソル/ドル	15,373.35	1,653,096	1,643,953	0.07
		ロシアルーブル/ドル	318,685.59	34,268,261	34,542,527	1.46
		インドネシアルピア/ドル	2,175,461.84	233,927,411	234,767,552	9.95

(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。

(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(2020年5月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末 (2017年11月2日)	7,542,403	7,542,403	1.2498	1.2498
第2計算期間末 (2018年11月2日)	38,138,506	38,138,506	1.1983	1.1983
第3計算期間末 (2019年11月5日)	142,291,013	142,291,013	1.2301	1.2301
2019年5月末日	87,728,860		1.1367	
6月末日	95,388,452		1.1717	
7月末日	101,934,298		1.1763	
8月末日	106,891,541		1.1205	
9月末日	126,894,836		1.1710	
10月末日	140,779,969		1.2166	

11月末日	151,698,711		1.2395
12月末日	159,635,899		1.2669
2020年 1月末日	180,057,744		1.2360
2月末日	175,075,748		1.1463
3月末日	167,859,917		1.0204
4月末日	190,269,996		1.0715
5月末日	210,604,595		1.1054

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

直近日（2020年5月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末（2017年11月 2日）	6,662,973	6,662,973	1.1900	1.1900
第2計算期間末（2018年11月 2日）	59,236,329	59,236,329	1.1473	1.1473
第3計算期間末（2019年11月 5日）	177,171,646	177,171,646	1.1839	1.1839
2019年 5月末日	115,765,978		1.1066	
6月末日	127,881,295		1.1364	
7月末日	138,385,841		1.1404	
8月末日	142,811,274		1.0988	
9月末日	155,601,863		1.1373	
10月末日	175,578,503		1.1735	
11月末日	176,126,747		1.1887	
12月末日	180,953,348		1.2102	
2020年 1月末日	221,234,887		1.1883	
2月末日	223,621,220		1.1218	
3月末日	216,643,851		1.0187	
4月末日	248,098,177		1.0582	
5月末日	266,821,871		1.0897	

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

直近日（2020年5月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末（2017年11月 2日）	20,568,205	20,568,205	1.1398	1.1398
第2計算期間末（2018年11月 2日）	90,394,214	90,394,214	1.1030	1.1030
第3計算期間末（2019年11月 5日）	279,508,613	279,508,613	1.1374	1.1374
2019年 5月末日	223,098,987		1.0747	
6月末日	238,694,067		1.0999	
7月末日	251,842,954		1.1021	

8月末日	250,472,254		1.0747
9月末日	262,739,656		1.1029
10月末日	277,639,823		1.1298
11月末日	292,232,104		1.1383
12月末日	287,001,786		1.1528
2020年 1月末日	369,707,513		1.1385
2月末日	368,051,806		1.0939
3月末日	391,431,710		1.0143
4月末日	414,162,141		1.0397
5月末日	435,691,072		1.0672

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

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

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

【収益率の推移】

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
第2計算期間	4.1
第3計算期間	2.7
第4中間計算期間末	14.1

（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
第2計算期間	3.6
第3計算期間	3.2
第4中間計算期間末	11.6

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

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
第2計算期間	3.2
第3計算期間	3.1
第4中間計算期間末	9.2

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

（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
第2計算期間	38,087,004	12,294,962
第3計算期間	96,963,950	13,116,584
第4中間計算期間末	88,740,944	26,912,082

（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
第2計算期間	53,773,312	7,739,646
第3計算期間	108,529,173	10,515,921
第4中間計算期間末	107,445,498	22,625,687

（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
第2計算期間	72,348,741	8,438,546
第3計算期間	202,869,686	39,078,259
第4中間計算期間末	213,848,927	61,482,890

（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

基準価額・純資産の推移 2016/10/25 ~ 2020/05/29

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
2018年11月	0円
2019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
2018年11月	0円
2019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
2018年11月	0円
2019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。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

● 主要な資産の状況

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	10.47%	24.74%	36.80%
SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	16.17%	13.71%	12.05%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	16.18%	13.78%	12.11%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	2.97%	3.34%	8.94%
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	33.68%	23.73%	12.68%
SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド	3.11%	8.05%	10.24%
ISHARES CORE MSCI EMERGING	15.30%	11.23%	6.30%
コール・ローン等	2.12%	1.42%	0.88%
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	純資産比
1	第142回利付国債(5年)	国債証券	2024/12/20	13.3%
2	第357回利付国債(10年)	国債証券	2029/12/20	8.7%
3	第140回利付国債(5年)	国債証券	2024/06/20	3.8%
4	第38回利付国債(30年)	国債証券	2043/03/20	3.8%
5	第410回利付国債(2年)	国債証券	2022/03/01	3.5%
組入銘柄数			78銘柄	

● SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド

組入上位5銘柄			
	銘柄名	業種	純資産比
1	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5.9%
2	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	5.4%
3	日本電信電話	情報・通信業	4.6%
4	本田技研工業	輸送用機器	4.3%
5	武田薬品工業	医薬品	4.0%
組入銘柄数			42銘柄

● SJAMスモールキャップ・マザーファンド

組入上位5銘柄			
	銘柄名	業種	純資産比
1	EIZO	電気機器	3.1%
2	八十二銀行	銀行業	2.9%
3	シチズン時計	精密機器	2.9%
4	伊予銀行	銀行業	2.8%
5	NOK	輸送用機器	2.8%
組入銘柄数			100銘柄

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

● 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

組入上位5銘柄						
	銘柄名	発行国	種類	通貨	償還日	純資産比
1	Treasury 2.125 240229	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2024/02/29	6.4%
2	Treasury 1.75 291115	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2029/11/15	5.3%
3	Treasury 2.25 270215	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2027/02/15	4.8%
4	Treasury 2.875 490515	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2049/05/15	3.4%
5	Treasury 2.125 250515	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2025/05/15	3.1%
組入銘柄数					123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	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ・ドル	アメリカ	ヘルスケア	3.0%
2	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス・フラン	スイス	ヘルスケア	2.5%
3	VERIZON COMMUNICATIONS	アメリカ・ドル	アメリカ	コミュニケーション・サービス	2.4%
4	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	アメリカ・ドル	アメリカ	ヘルスケア	2.0%
5	HOME DEPOT INC	アメリカ・ドル	アメリカ	一般消費財・サービス	1.9%
組入銘柄数			120銘柄		

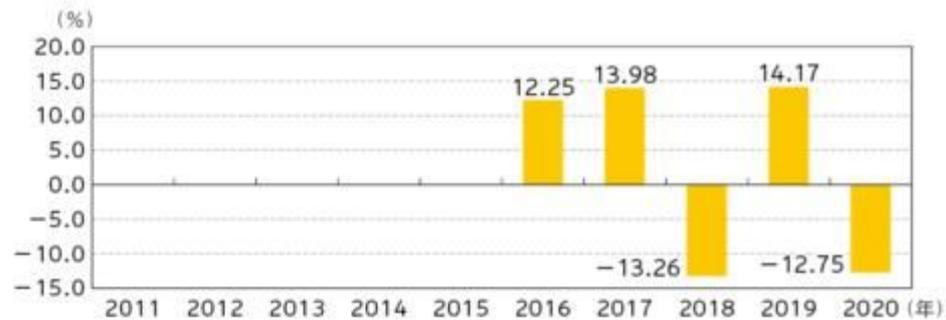
● SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

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	S-AFRICA 10.5 261221	南アフリカ	国債証券	南アフリカ・ランド	2026/12/21	5.1%
2	INDONESIA 8.25 290515	インドネシア	国債証券	インドネシア・ルピア	2029/05/15	3.5%
3	MEXICO 10.0 241205	メキシコ	国債証券	メキシコ・ペソ	2024/12/05	3.5%
4	COLOMBIA 7.5 260826	コロンビア	国債証券	コロンビア・ペソ	2026/08/26	3.4%
5	INDONESIA 8.125 240515	インドネシア	国債証券	インドネシア・ルピア	2024/05/15	3.2%
組入銘柄数					75銘柄	

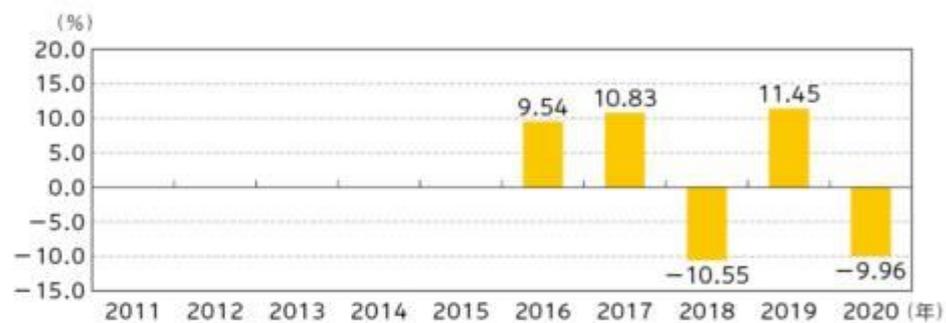
- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

年間収益率の推移 (暦年ベース)

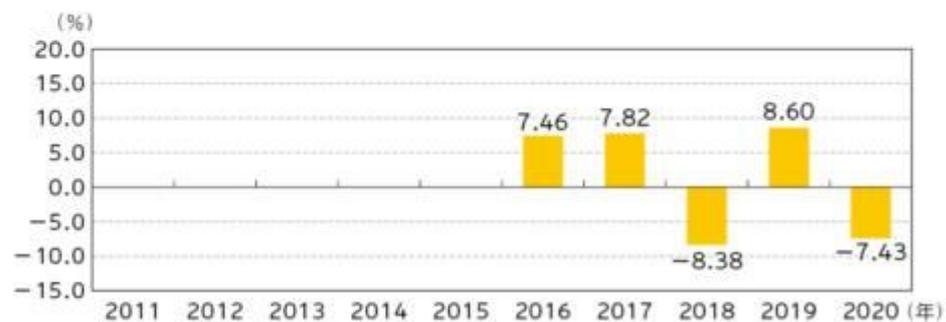
● SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055



● 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、2020年は年初から基準日までの収益率です。
- 各ファンドはベンチマークを設定していません。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

<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せん。

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

(略)

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。

<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）

信託事務処理の再信託

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）（以下「中間財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。
- なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2019年11月6日から2020年5月5日までの中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055】

(1) 【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年11月5日現在	第4期中間計算期間末 2020年5月5日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,034,139	2,914,630
投資信託受益証券	23,842,133	31,634,687
親投資信託受益証券	117,351,738	154,601,505
流動資産合計	143,228,010	189,150,822
資産合計	143,228,010	189,150,822
負債の部		
流動負債		
未払解約金	303,958	586,655
未払受託者報酬	16,744	26,377
未払委託者報酬	613,908	967,330
未払利息	3	8
その他未払費用	2,384	9,288
流動負債合計	936,997	1,589,658
負債合計	936,997	1,589,658
純資産の部		
元本等		
元本	115,674,202	177,503,064
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	26,616,811	10,058,100
元本等合計	142,291,013	187,561,164
純資産合計	142,291,013	187,561,164
負債純資産合計	143,228,010	189,150,822

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2018年11月3日 至 2019年5月2日	第4期中間計算期間 自 2019年11月6日 至 2020年5月5日
営業収益		
受取配当金	142,213	536,383
有価証券売買等損益	2,035,628	25,750,311
為替差損益	33,330	485,349
営業収益合計	2,144,511	25,699,277
営業費用		

	第3期中間計算期間 自 2018年11月3日 至 2019年5月2日	第4期中間計算期間 自 2019年11月6日 至 2020年5月5日
支払利息	203	628
受託者報酬	9,488	26,377
委託者報酬	347,536	967,330
その他費用	21,927	19,224
営業費用合計	379,154	1,013,559
営業利益又は営業損失()	1,765,357	26,712,836
経常利益又は経常損失()	1,765,357	26,712,836
中間純利益又は中間純損失()	1,765,357	26,712,836
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	52,564	2,901,500
期首剰余金又は期首欠損金()	6,311,670	26,616,811
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,204,353	13,316,705
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,204,353	13,316,705
剰余金減少額又は欠損金増加額	921,397	6,064,080
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	921,397	6,064,080
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	14,412,547	10,058,100

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。 計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年11月2日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2019年11月5日、当中間計算期間末日を2020年5月5日としております。

（中間貸借対照表に関する注記）

期別	第3期 2019年11月5日現在	第4期中間計算期間末 2020年5月5日現在
1. 受益権の総数	115,674,202口	177,503,064口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2301円 (1万円当たり純資産額) (12,301円)	1口当たり純資産額 1.0567円 (1万円当たり純資産額) (10,567円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第3期中間計算期間 自 2018年11月3日 至 2019年5月2日	第4期中間計算期間 自 2019年11月6日 至 2020年5月5日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	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財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の49の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2019年11月5日現在	第4期中間計算期間末 2020年5月5日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 （2）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

項目	第3期 2019年11月5日現在	第4期中間計算期間末 2020年5月5日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(その他の注記)

項目	第3期 自 2018年11月3日 至 2019年11月5日	第4期中間計算期間 自 2019年11月6日 至 2020年5月5日
期首元本額	31,826,836円	115,674,202円
期中追加設定元本額	96,963,950円	88,740,944円
期中一部解約元本額	13,116,584円	26,912,082円

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

【SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2019年11月5日現在	第4期中間計算期間末 2020年5月5日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,199,300	3,596,637
投資信託受益証券	20,921,757	29,419,229
親投資信託受益証券	154,887,676	214,170,304
流動資産合計	178,008,733	247,186,170
資産合計	178,008,733	247,186,170
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	475,775
未払受託者報酬	22,145	32,658
未払委託者報酬	811,753	1,197,523
未払利息	3	10
その他未払費用	3,186	11,660
流動負債合計	837,087	1,717,626
負債合計	837,087	1,717,626
純資産の部		

	第3期 2019年11月5日現在	第4期中間計算期間末 2020年5月5日現在
元本等		
元本	149,645,912	234,465,723
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	27,525,734	11,002,821
元本等合計	177,171,646	245,468,544
純資産合計	177,171,646	245,468,544
負債純資産合計	178,008,733	247,186,170

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期中間計算期間 自 2018年11月3日 至 2019年5月2日	第4期中間計算期間 自 2019年11月6日 至 2020年5月5日
営業収益		
受取配当金	133,578	425,570
有価証券売買等損益	2,323,782	25,981,002
為替差損益	24,309	383,338
営業収益合計	2,433,051	25,938,770
営業費用		
支払利息	260	738
受託者報酬	12,707	32,658
委託者報酬	465,807	1,197,523
その他費用	19,067	18,151
営業費用合計	497,841	1,249,070
営業利益又は営業損失()	1,935,210	27,187,840
経常利益又は経常損失()	1,935,210	27,187,840
中間純利益又は中間純損失()	1,935,210	27,187,840
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	16,254	1,159,110
期首剰余金又は期首欠損金()	7,603,669	27,525,734
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,849,278	13,596,006
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,849,278	13,596,006
剰余金減少額又は欠損金増加額	610,925	4,090,189
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	610,925	4,090,189
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	15,793,486	11,002,821

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>約定日基準で計上しております。</p> <p>外貨建取引等の処理基準</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> <p>計算期間末日の取扱い</p> <p>当ファンドは、原則として毎年11月2日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2019年11月5日、当中間計算期間末日を2020年5月5日としております。</p>
------------------------------	--

(中間貸借対照表に関する注記)

期別	第3期 2019年11月5日現在	第4期中間計算期間末 2020年5月5日現在
1. 受益権の総数	149,645,912口	234,465,723口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.1839円 (1万口当たり純資産額) (11,839円)	1口当たり純資産額 1.0469円 (1万口当たり純資産額) (10,469円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期中間計算期間 自 2018年11月3日 至 2019年5月2日	第4期中間計算期間 自 2019年11月6日 至 2020年5月5日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	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信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の49の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2019年11月5日現在	第4期中間計算期間末 2020年5月5日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(その他の注記)

項目	第3期	第4期中間計算期間
	自 2018年11月3日 至 2019年11月5日	自 2019年11月6日 至 2020年5月5日
期首元本額	51,632,660円	149,645,912円
期中追加設定元本額	108,529,173円	107,445,498円
期中一部解約元本額	10,515,921円	22,625,687円

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

【SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035】

(1)【中間貸借対照表】

	第3期 2019年11月5日現在	第4期中間計算期間末 2020年5月5日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,221,682	5,532,637
投資信託受益証券	17,636,334	26,922,739
親投資信託受益証券	259,152,640	380,816,441
流動資産合計	281,010,656	413,271,817
資産合計	281,010,656	413,271,817
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,042	266,408
未払受託者報酬	39,572	54,839
未払委託者報酬	1,450,683	2,010,565
未払利息	7	15
その他未払費用	5,739	19,892
流動負債合計	1,502,043	2,351,719
負債合計	1,502,043	2,351,719
純資産の部		
元本等		
元本	245,746,948	398,112,985
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	33,761,665	12,807,113
元本等合計	279,508,613	410,920,098
純資産合計	279,508,613	410,920,098
負債純資産合計	281,010,656	413,271,817

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期中間計算期間 自 2018年11月3日 至 2019年5月2日	第4期中間計算期間 自 2019年11月6日 至 2020年5月5日
営業収益		
受取配当金	123,558	373,495
有価証券売買等損益	3,381,259	32,809,806
為替差損益	558	325,626
営業収益合計	3,504,259	32,761,937
営業費用		
支払利息	528	1,284
受託者報酬	22,977	54,839
委託者報酬	842,327	2,010,565
その他費用	17,306	28,602
営業費用合計	883,138	2,095,290
営業利益又は営業損失（ ）	2,621,121	34,857,227
経常利益又は経常損失（ ）	2,621,121	34,857,227
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,621,121	34,857,227
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,572	2,003,189
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	8,438,693	33,761,665
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,417,024	20,073,498
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,417,024	20,073,498
剰余金減少額又は欠損金増加額	553,929	8,174,012
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	553,929	8,174,012
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	21,919,337	12,807,113

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。</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、わが国における中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</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. その他中間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。 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>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年11月2日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2019年11月5日、当中間計算期間末日を2020年5月5日としております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

期別	第3期 2019年11月5日現在	第4期中間計算期間末 2020年5月5日現在
1. 受益権の総数	245,746,948口	398,112,985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 1.1374円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (11,374円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.0322円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (10,322円)</p>

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期中間計算期間 自 2018年11月3日 至 2019年5月2日	第4期中間計算期間 自 2019年11月6日 至 2020年5月5日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	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財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の49の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 2019年11月5日現在	第4期中間計算期間末 2020年5月5日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(その他の注記)

項目	第3期 自 2018年11月3日 至 2019年11月5日	第4期中間計算期間 自 2019年11月6日 至 2020年5月5日
期首元本額	81,955,521円	245,746,948円
期中追加設定元本額	202,869,686円	213,848,927円
期中一部解約元本額	39,078,259円	61,482,890円

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035 / 2045 / 2055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11月5日現在	2020年5月5日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	383,238,628	302,049,710
国債証券	12,879,214,900	12,226,848,800
地方債証券	114,229,000	112,113,000
特殊債券	344,596,962	632,517,942
社債券	4,068,587,000	3,617,992,200
未収利息	20,543,075	17,438,630
前払費用	2,868,735	1,584,064
流動資産合計	17,813,278,300	16,910,544,346
資産合計	17,813,278,300	16,910,544,346
負債の部		
流動負債		
未払金	230,830,200	-
未払利息	661	868
その他未払費用	-	12,212
流動負債合計	230,830,861	13,080
負債合計	230,830,861	13,080
純資産の部		
元本等		
元本	11,963,987,873	11,612,572,410
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,618,459,566	5,297,958,856
元本等合計	17,582,447,439	16,910,531,266
純資産合計	17,582,447,439	16,910,531,266
負債純資産合計	17,813,278,300	16,910,544,346

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券
--------------------	----------------------

2. 費用・収益の計上基準	<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> <p>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。</p>
---------------	--

(貸借対照表に関する注記)

期別	2019年11月5日現在		2020年5月5日現在	
1. 受益権の総数	11,963,987,873口		11,612,572,410口	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4696円 (14,696円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4562円 (14,562円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年11月5日現在	2020年5月5日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	自 2018年11月3日 至 2019年11月5日	自 2019年11月6日 至 2020年5月5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	11,207,005,092円	11,963,987,873円
同期中追加設定元本額	2,263,791,245円	1,301,314,994円
同期中一部解約元本額	1,506,808,464円	1,652,730,457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）	944,710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）（FofS用）（適格機関投資家専用）	- 円	29,246,106円
SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド（4%コース）（FofS用）（適格機関投資家専用）	- 円	36,303,922円
損保ジャパン日本債券ファンド	1,086,271,327円	1,081,594,181円
ハッピーエイジング20	147,547,577円	126,271,112円
ハッピーエイジング30	725,186,161円	648,714,075円
ハッピーエイジング40	3,822,000,791円	3,534,416,197円
ハッピーエイジング50	3,067,877,609円	2,942,594,107円
ハッピーエイジング60	2,330,105,485円	2,398,778,915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	128,149,831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2035	70,010,959円	104,061,566円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	29,828,502円	41,918,060円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	9,993,339円	13,412,667円
ターゲット・リターン戦略ファンド	120,995,306円	146,462,625円

項目	自 2018年11月3日 至 2019年11月5日	自 2019年11月6日 至 2020年5月5日
計	11,963,987,873円	11,612,572,410円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

S J A Mラージキャップ・バリュース・マザーファンド

貸借対照表

科 目	2019年11月5日現在	2020年5月5日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	122,342,898	331,662,178
株式	34,913,316,720	29,699,013,690
未収配当金	500,223,800	514,437,850
流動資産合計	35,535,883,418	30,545,113,718
資産合計	35,535,883,418	30,545,113,718
負債の部		
流動負債		
未払利息	211	954
その他未払費用	-	31,150
流動負債合計	211	32,104
負債合計	211	32,104
純資産の部		
元本等		
元本	18,896,159,116	20,745,201,868
剰余金		
剰余金又は欠損金()	16,639,724,091	9,799,879,746
元本等合計	35,535,883,207	30,545,081,614
純資産合計	35,535,883,207	30,545,081,614
負債純資産合計	35,535,883,418	30,545,113,718

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

2. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
---------------	---

(貸借対照表に関する注記)

期別	2019年11月5日現在	2020年5月5日現在
1. 受益権の総数	18,896,159,116口	20,745,201,868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 1.8806円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (18,806円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.4724円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,724円)</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年11月5日現在	2020年5月5日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(その他の注記)

項目	自 2018年11月3日 至 2019年11月5日	自 2019年11月6日 至 2020年5月5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	15,243,777,503円	18,896,159,116円
同期中追加設定元本額	11,213,234,601円	2,803,833,636円
同期中一部解約元本額	7,560,852,988円	954,790,884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）	778,066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）	606,191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）	197,764円	- 円
損保ジャパン日本興亜ラージキャップ・バリュウ・ファンド（F o F s用）（適格機関投資家専用）	13,561,815,918円	14,826,454,919円
ラージキャップ・バリュウ・オープン（適格機関投資家専用）	257,379,941円	256,426,451円
ハッピーエイジング20	1,517,679,612円	1,602,830,199円
ハッピーエイジング30	1,577,857,148円	1,741,864,858円
ハッピーエイジング40	1,420,313,416円	1,620,939,286円
ハッピーエイジング50	404,533,396円	478,857,338円
ハッピーエイジング60	102,411,701円	130,120,114円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	18,171,946円	33,265,187円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	13,101,310円	22,676,887円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	12,400,865円	20,489,583円
SOMPO日本株バリュウ・プラスファンド	8,911,842円	11,277,046円
計	18,896,159,116円	20,745,201,868円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

貸借対照表

科 目	2019年11月5日現在	2020年5月5日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,692,617	48,706,678
株式	9,448,567,100	8,289,765,200
未収入金	-	537,010,096
未収配当金	118,861,300	139,702,000
流動資産合計	9,574,121,017	9,015,183,974
資産合計	9,574,121,017	9,015,183,974
負債の部		
流動負債		
未払金	-	516,369,477
未払利息	11	140
その他未払費用	-	3,410
流動負債合計	11	516,373,027
負債合計	11	516,373,027
純資産の部		
元本等		
元本	3,938,673,687	4,219,911,311
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,635,447,319	4,278,899,636
元本等合計	9,574,121,006	8,498,810,947
純資産合計	9,574,121,006	8,498,810,947
負債純資産合計	9,574,121,017	9,015,183,974

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

期別	2019年11月5日現在	2020年5月5日現在
1．受益権の総数	3,938,673,687口	4,219,911,311口
2．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.4308円 (24,308円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.0140円 (20,140円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年11月5日現在	2020年5月5日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	自 2018年11月3日 至 2019年11月5日	自 2019年11月6日 至 2020年5月5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	3,521,089,248円	3,938,673,687円
同期中追加設定元本額	890,815,890円	699,313,561円
同期中一部解約元本額	473,231,451円	418,075,937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）	601,132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）	464,793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）	152,613円	- 円
ハッピーエイジング20	1,177,423,243円	1,194,469,631円
ハッピーエイジング30	1,224,074,301円	1,298,153,921円
ハッピーエイジング40	1,101,789,957円	1,208,066,361円
ハッピーエイジング50	313,812,115円	356,915,402円

項目	自 2018年11月3日 至 2019年11月5日	自 2019年11月6日 至 2020年5月5日
ハッピーエイジング60	79,444,759円	96,976,009円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	14,151,252円	24,714,816円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	10,203,999円	16,848,075円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	9,654,088円	15,223,064円
SOMPO日本株バリュー・プラスファンド	6,901,435円	8,544,032円
計	3,938,673,687円	4,219,911,311円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

貸借対照表

科 目	2019年11月5日現在	2020年5月5日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	45,934,888	60,821,171
コール・ローン	537,309,004	135,439,791
国債証券	7,388,952,231	7,474,168,175
特殊債券	26,730,894	-
未収入金	193,478,584	-
未収利息	34,644,554	36,120,209
前払費用	10,423,496	10,935,125
流動資産合計	8,237,473,651	7,717,484,471
資産合計	8,237,473,651	7,717,484,471
負債の部		
流動負債		
未払金	198,704,301	-
未払利息	927	389
その他未払費用	-	11,542
流動負債合計	198,705,228	11,931
負債合計	198,705,228	11,931
純資産の部		
元本等		
元本	4,981,490,779	4,664,486,009
剰余金		
剰余金又は欠損金()	3,057,277,644	3,052,986,531
元本等合計	8,038,768,423	7,717,472,540
純資産合計	8,038,768,423	7,717,472,540
負債純資産合計	8,237,473,651	7,717,484,471

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．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>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</p> <p>但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

期別	2019年11月5日現在	2020年5月5日現在
1．受益権の総数	4,981,490,779口	4,664,486,009口
2．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6137円 (16,137円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6545円 (16,545円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年11月5日現在	2020年5月5日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	同左

項目	2019年11月5日現在	2020年5月5日現在
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(その他の注記)

項目	自 2018年11月3日 至 2019年11月5日	自 2019年11月6日 至 2020年5月5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	4,804,457,447円	4,981,490,779円
同期中追加設定元本額	888,071,912円	508,160,767円
同期中一部解約元本額	711,038,580円	825,165,537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)	48,195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)	62,590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)	353,789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)	26,896,771円	150,970,765円
ハッピーエイジング20	402,536,108円	335,640,299円
ハッピーエイジング30	1,648,648,562円	1,436,911,322円
ハッピーエイジング40	1,579,799,335円	1,423,380,690円
ハッピーエイジング50	538,377,641円	503,110,649円
ハッピーエイジング60	470,855,529円	472,284,159円
損保ジャパン外国債券ファンド(為替ヘッジなし)	292,294,704円	312,428,912円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	15,377,900円	21,715,005円

項目	自 2018年11月3日 至 2019年11月5日	自 2019年11月6日 至 2020年5月5日
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	3,645,873円	4,823,454円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	2,593,782円	3,220,754円
計	4,981,490,779円	4,664,486,009円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

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

貸借対照表

科 目	2019年11月5日現在 金額(円)	2020年5月5日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,725,638	5,122,107
コール・ローン	12,755,675	11,957,532
株式	430,452,601	591,036,787
投資証券	31,331,664	40,820,226
未収配当金	324,439	1,021,948
流動資産合計	477,590,017	649,958,600
資産合計	477,590,017	649,958,600
負債の部		
流動負債		
未払利息	22	34
その他未払費用	-	2,133
流動負債合計	22	2,167
負債合計	22	2,167
純資産の部		
元本等		
元本	341,146,206	534,453,020
剰余金		
剰余金又は欠損金()	136,443,789	115,503,413
元本等合計	477,589,995	649,956,433
純資産合計	477,589,995	649,956,433
負債純資産合計	477,590,017	649,958,600

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

期別	2019年11月5日現在	2020年5月5日現在
1. 受益権の総数	341,146,206口	534,453,020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 1.4000円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,000円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.2161円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (12,161円)</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年11月5日現在	2020年5月5日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	自 2018年11月3日 至 2019年11月5日	自 2019年11月6日 至 2020年5月5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	273,111,328円	341,146,206円
同期中追加設定元本額	110,868,888円	236,539,574円
同期中一部解約元本額	42,834,010円	43,232,760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）	794,837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）	299,460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）	53,507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）	119,334,184円	256,950,804円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	24,976,016円	42,041,089円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	29,642,148円	47,755,345円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	33,773,599円	51,941,553円

項目	自 2018年11月3日 至 2019年11月5日	自 2019年11月6日 至 2020年5月5日
SOMPO外国株式アクティブバリューファンド（リスク抑制型）	132,272,455円	135,764,229円
計	341,146,206円	534,453,020円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

貸借対照表

科 目	2019年11月5日現在	2020年5月5日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	25,516,760	2,817,533
コール・ローン	9,643,911	15,175,286
国債証券	2,253,318,078	2,115,543,032
派生商品評価勘定	4,535,623	7,645,514
未収利息	36,335,691	40,707,647
前払費用	5,943,624	8,007,810
差入保証金	-	5,000,000
流動資産合計	2,335,293,687	2,194,896,822
資産合計	2,335,293,687	2,194,896,822
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,512,076	10,210,750
未払利息	16	43
その他未払費用	-	2,567
流動負債合計	3,512,092	10,213,360
負債合計	3,512,092	10,213,360
純資産の部		
元本等		
元本	1,872,369,685	2,032,883,398
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	459,411,910	151,800,064
元本等合計	2,331,781,595	2,184,683,462
純資産合計	2,331,781,595	2,184,683,462
負債純資産合計	2,335,293,687	2,194,896,822

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

(貸借対照表に関する注記)

期別	2019年11月5日現在		2020年5月5日現在	
1. 受益権の総数	1,872,369,685口		2,032,883,398口	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2454円 (12,454円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0747円 (10,747円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年11月5日現在	2020年5月5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	2019年11月5日現在	2020年5月5日現在
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

(その他の注記)

項目	自 2018年11月3日 至 2019年11月5日	自 2019年11月6日 至 2020年5月5日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,802,441,218円	1,872,369,685円
同期中追加設定元本額	449,766,955円	269,895,729円
同期中一部解約元本額	379,838,488円	109,382,016円
元本の内訳*		
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)	976,836,570円	969,050,833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)	247,078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)	317,573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)	163,073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)	232,763,141円	241,015,013円
エマージング債券ファンド(為替戦略型)(Fof用)(適格機関投資家専用)	624,668,226円	758,639,518円

項目	自 2018年11月3日 至 2019年11月5日	自 2019年11月6日 至 2020年5月5日
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	22,410,288円	40,451,332円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	11,423,764円	18,379,154円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	3,539,972円	5,347,548円
計	1,872,369,685円	2,032,883,398円

*当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2019年11月5日 現在				2020年5月5日 現在			
	契約額等 （円）	うち1年 超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち1年 超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引 為替予約取引								
買建	469,977,142	-	468,894,843	1,082,299	294,017,148	-	294,479,091	461,943
ドル	172,260,355	-	171,597,987	662,368	106,109,193	-	105,787,635	321,558
チェココルナ	40,803,818	-	40,803,818	-	1,476,618	-	1,490,386	13,768
ハンガリーフォリント	32,451,997	-	32,223,955	228,042	59,242,095	-	59,672,946	430,851
ポーランドズロチ	153,831,900	-	153,723,300	108,600	58,074,814	-	58,346,086	271,272
ルーマニアレイ	70,629,072	-	70,545,783	83,289	32,547,454	-	32,615,064	67,610
タイバーツ	-	-	-	-	36,566,974	-	36,566,974	-
売建	469,977,142	-	467,201,579	2,775,563	294,017,148	-	294,578,280	561,132
ドル	297,716,787	-	296,517,044	1,199,743	187,907,955	-	187,180,641	727,314
メキシコペソ	52,045,292	-	51,587,952	457,340	9,859,040	-	10,088,320	229,280
ポーランドズロチ	-	-	-	-	12,870,690	-	12,930,810	60,120
タイバーツ	44,666,823	-	44,666,823	-	12,821,840	-	12,821,840	-
ランド	75,548,240	-	74,429,760	1,118,480	70,557,623	-	71,556,669	999,046
合計	939,954,284	-	936,096,422	1,693,264	588,034,296	-	589,057,371	99,189

（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	2019年11月5日 現在				2020年5月5日 現在			
	契約額等 (円)	うち1年 超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年 超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
直物為替先渡取引								
買建	131,205,899	-	132,588,082	1,382,183	185,447,745	-	191,508,928	6,061,183
ブラジルレアル	-	-	-	-	4,867,499	-	4,813,981	53,518
チリアンペソ	15,999,695	-	15,630,131	369,564	107,816,283	-	110,563,818	2,747,535
コロンビアペソ	3,856,489	-	3,975,571	119,082	-	-	-	-
ペルーヌエボソル	1,592,064	-	1,598,316	6,252	1,660,534	-	1,676,992	16,458
フィリピンペソ	6,265,692	-	6,346,747	81,055	-	-	-	-
インドネシアルピア	18,489,387	-	18,481,074	8,313	64,129,288	-	67,454,728	3,325,440
ウォン	85,002,572	-	86,556,243	1,553,671	6,974,141	-	6,999,409	25,268
売建	238,203,312	-	240,255,212	2,051,900	283,766,205	-	292,293,436	8,527,231
ブラジルレアル	79,092,199	-	80,401,420	1,309,221	-	-	-	-
コロンビアペソ	-	-	-	-	50,985,074	-	51,793,255	808,181
ロシアルーブル	71,006,692	-	71,532,830	526,138	33,523,283	-	33,607,099	83,816
インドネシアルピア	85,890,503	-	86,065,678	175,175	196,246,153	-	203,845,273	7,599,120
ウォン	2,213,918	-	2,255,284	41,366	3,011,695	-	3,047,809	36,114
合計	369,409,211	-	372,843,294	669,717	469,213,950	-	483,802,364	2,466,048

(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。

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

2020年5月29日現在

資産総額	210,882,548円
負債総額	277,953円
純資産総額(-)	210,604,595円
発行済数量	190,530,174口
1単位当りの純資産額(/)	1.1054円

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

2020年5月29日現在

資産総額	267,039,762円
負債総額	217,891円
純資産総額（ - ）	266,821,871円
発行済数量	244,847,159口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.0897円

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

2020年5月29日現在

資産総額	436,004,494円
負債総額	313,422円
純資産総額（ - ）	435,691,072円
発行済数量	408,245,904口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.0672円

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2020年5月29日現在

資産総額	17,344,983,388円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	17,344,983,388円
発行済数量	11,947,318,812口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.4518円

（参考）SJAMラージキャップ・バリュース・マザーファンド

2020年5月29日現在

資産総額	33,643,593,838円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	33,643,593,838円
発行済数量	20,900,544,089口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.6097円

（参考）SJAMスモールキャップ・マザーファンド

2020年5月29日現在

資産総額	9,136,524,938円
負債総額	98,243,574円
純資産総額（ - ）	9,038,281,364円
発行済数量	4,131,043,587口

1単位当りの純資産額(/)	2.1879円
-----------------	---------

(参考) 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

2020年5月29日現在

資産総額	8,067,928,278円
負債総額	円
純資産総額(-)	8,067,928,278円
発行済数量	4,863,559,205口
1単位当りの純資産額(/)	1.6589円

(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

2020年5月29日現在

資産総額	696,381,812円
負債総額	円
純資産総額(-)	696,381,812円
発行済数量	551,612,612口
1単位当りの純資産額(/)	1.2624円

(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

2020年5月29日現在

資産総額	2,411,120,174円
負債総額	52,003,142円
純資産総額(-)	2,359,117,032円
発行済数量	2,029,300,015口
1単位当りの純資産額(/)	1.1625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11月末現在）
（略）
- (2) 会社の機構（2019年11月末現在）
（略）

<訂正後>

- (1) 資本金の額（2020年5月末現在）
（略）
- (2) 会社の機構（2020年5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5月末現在、計214本（追加型株式投資信託135本、単位型株式投資信託27本、単位型公社債投資信託52本）であり、その純資産総額の合計は935,852百万円です。

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）

- 採用している退職給付制度の概要（出向受入者に対する出向元への退職金負担額を除く。）
 当社は、従業員の退職給付に充てるため、非積立型の確定給付制度及び確定拠出制度を採用しております。
 退職一時金制度（非積立型制度であります。）では、退職給付として、給与と勤務期間に基づいた一時金を支給しております。
 なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

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

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：千円）

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

（3）退職給付費用

（単位：千円）

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

3. 確定拠出制度

（単位：千円）

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

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

（単位：千円）

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

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

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

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

本社事務所の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3. 当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

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

（セグメント情報等）

セグメント情報

当社は、投資運用事業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

（単位：千円）

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

（注）営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

（単位：千円）

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

（注）営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

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

（2）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
該当事項はありません。

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

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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

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

注2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

(注2) 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

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

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

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

注2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

(注2) 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

- (1) 親会社情報
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

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（2019年3月末現在）

事業の内容

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

<再信託受託会社の概要>

名称：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）

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	
松井証券株式会社	11,945	
楽天証券株式会社	7,495	

資本金の額は、2019年3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（2019年11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。

<訂正後>

(1) 受託会社

名称

みずほ信託銀行株式会社（再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行）

資本金の額

247,369百万円（2020年3月末現在）

事業の内容

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

< 再信託受託会社の概要 >

名称 : 株式会社日本カストディ銀行
 資本金の額 : 51,000百万円（2020年3月末現在）
 事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。
 再信託の目的 : 原信託契約に係る信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
株式会社 S B I 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 D C 証券株式会社	3,000	
松井証券株式会社	11,945	
楽天証券株式会社	7,495	

資本金の額は、2020年3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（2020年5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。

第3【その他】

< 訂正前 >

(略)

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

<訂正後>

(略)

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。

SOMPOアセットマネジメント

独立監査人の中間監査報告書

2020年7月2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

指定有限責任社員 公認会計士 蒲 谷 剛
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志
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、「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2019年11月6日から2020年5月5日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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、SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055の2020年5月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年11月6日から2020年5月5日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2020年7月2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

指定有限責任社員 公認会計士 蒲 谷 剛
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志
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、「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2019年11月6日から2020年5月5日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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、SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045の2020年5月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年11月6日から2020年5月5日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2020年7月2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

指定有限責任社員 公認会計士 蒲 谷 剛
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志
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、「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2019年11月6日から2020年5月5日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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、SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035の2020年5月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年11月6日から2020年5月5日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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。