

## 【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】	2022年4月14日提出
【発行者名】	SOMPOアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 小嶋 信弘
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋二丁目2番16号
【事務連絡者氏名】	津田 浩平
【電話番号】	03-5290-3432
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	ハッピーエイジング20 ハッピーエイジング30 ハッピーエイジング40 ハッピーエイジング50 ハッピーエイジング60
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	ハッピーエイジング20 募集額 2,000億円を上限とします。 ハッピーエイジング30 募集額 2,000億円を上限とします。 ハッピーエイジング40 募集額 2,000億円を上限とします。 ハッピーエイジング50 募集額 2,000億円を上限とします。 ハッピーエイジング60 募集額 2,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2021年10月14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。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

(略)

#### <ファンドの特色>

(略)

#### TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY[略称:TCW]について

1971年設立。ロサンゼルスを拠点とするTCWグループ傘下の運用会社です。  
2021年6月末現在の同グループの運用資産は、約2,658億米ドル(約29兆3,921億円\*)です。  
※2021年6月末時点の為替レートで換算。

(略)

5

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

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

●東証株価指数(TOPIX)とは、東京証券取引所第一部<sup>※</sup>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。  
※2022年4月に東京証券取引所は新市場区分に移行されます。

●「NOMURA-BPI総合指数」とは、野村證券が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づき構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。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、一切責任ありません。

●FTSE 世界国債インデックスとは、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。

●MSCIコクサイ インデックスとは、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界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。MSCIコクサイ インデックス(円換算ベース)は、MSCIコクサイ インデックス(米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。

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。

●MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。

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。

<訂正後>

(略)

<ファンドの特色>

(略)

### TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY[略称:TCW]について

1971年設立。ロサンゼルスを拠点とするTCWグループ傘下の運用会社です。

2021年12月末現在の同グループの運用資産は、約2,644億米ドル(約30兆4,112億円\*)です。

\*2021年12月末時点の為替レートで換算。

(略)

5

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

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

- 東証株価指数(TOPIX)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。
- NOMURA-BPI総合指数とは、野村證券が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づき構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。なお、NOMURA-BPI総合指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。
- FTSE 世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)とは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE 世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- MSCIコクサイ インデックスとは、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数です。MSCIコクサイ インデックス(円換算ベース)は、MSCIコクサイ インデックス(米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。
- MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数です。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

### (3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

委託会社等の概況

( )資本金の額 1,550百万円 (2021年7月末現在)

(略)

( )大株主の状況(2021年7月末現在)

(略)

<訂正後>

(略)

委託会社等の概況

( )資本金の額 1,550百万円 (2022年1月末現在)

(略)

( )大株主の状況(2022年1月末現在)

(略)

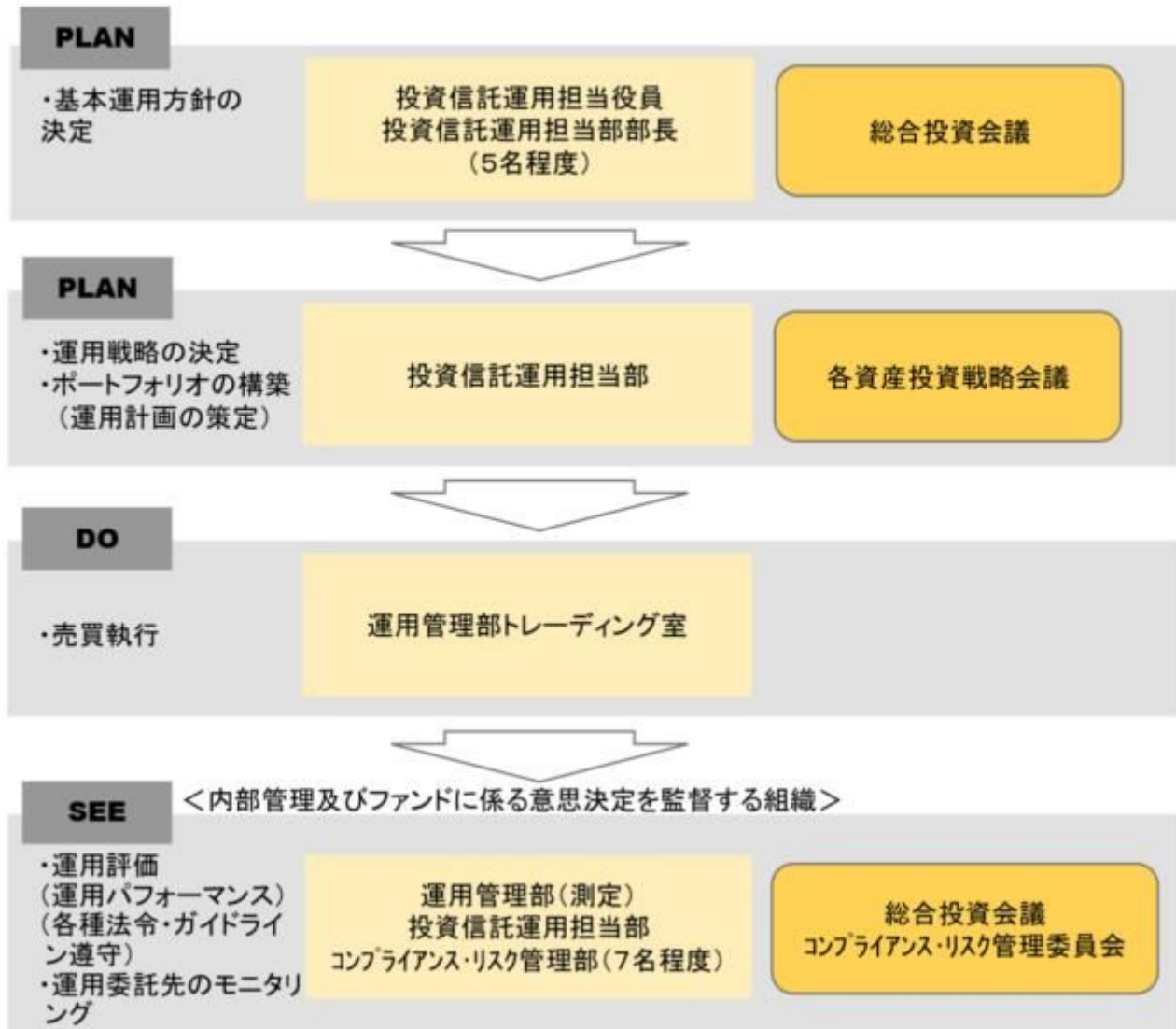
## 2【投資方針】

## (3)【運用体制】

&lt;訂正前&gt;

a. 委託会社の運用体制と社内規程

(略)

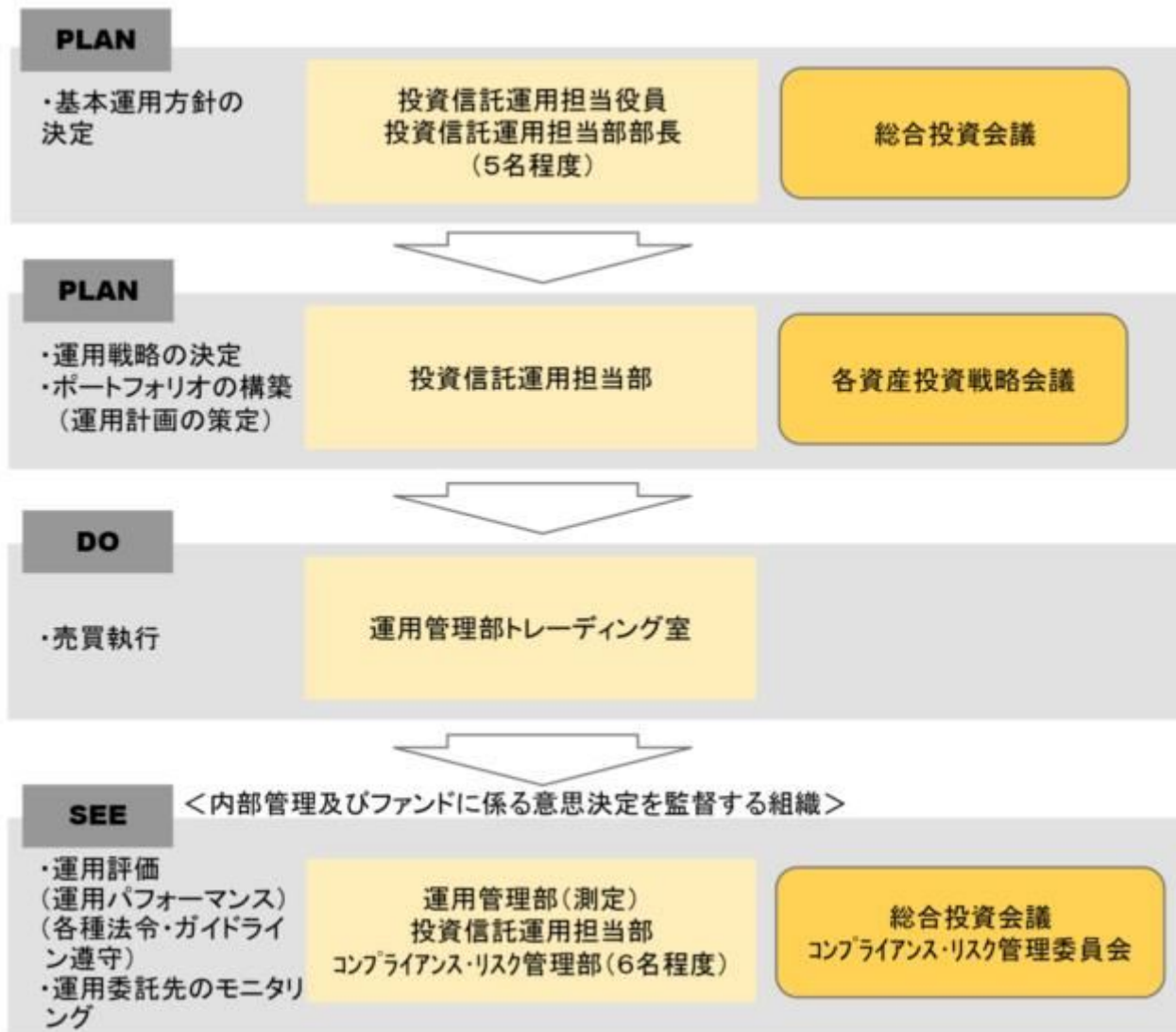


2021年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

&lt;訂正後&gt;

a. 委託会社の運用体制と社内規程

(略)



2022年1月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

<訂正前>

b. 運用委託先の運用体制等

(略)

(本組織図は、2021年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。)

<訂正後>

b. 運用委託先の運用体制等

(略)

(本組織図は、2022年1月末現在のものであり、今後変更されることもあります。)

### 3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

<その他の留意点>

(略)

— (略)

— (略)

— (略)

—（略）

—（略）

—（略）

## <リスクの管理体制>

### a. 委託会社のリスク管理体制

（略）

（注）上図は、2021年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

（略）

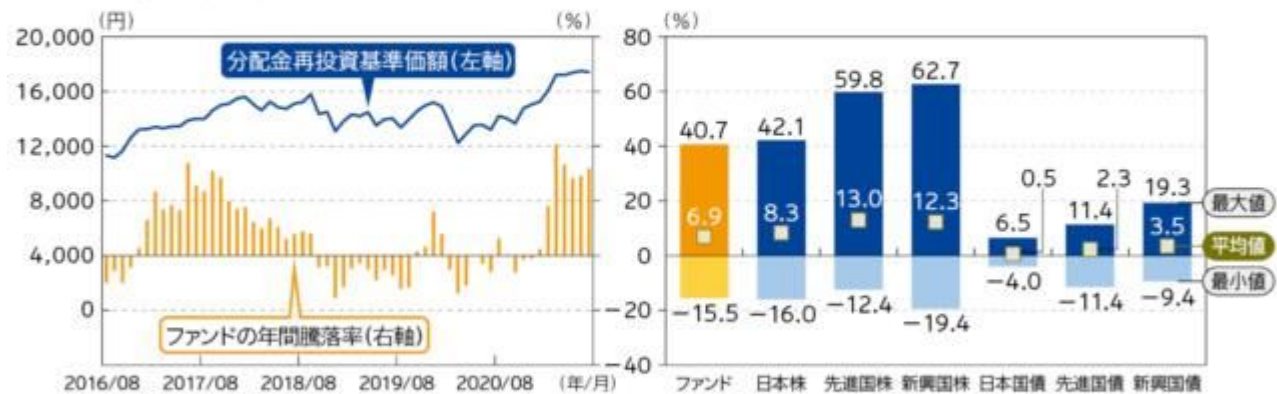
ファンドの年間騰落率及び  
分配金再投資基準価額の推移

2016年8月～2021年7月

ファンドと他の代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

2016年8月～2021年7月

#### ハッピーエイジング20



#### ハッピーエイジング30



#### ハッピーエイジング40

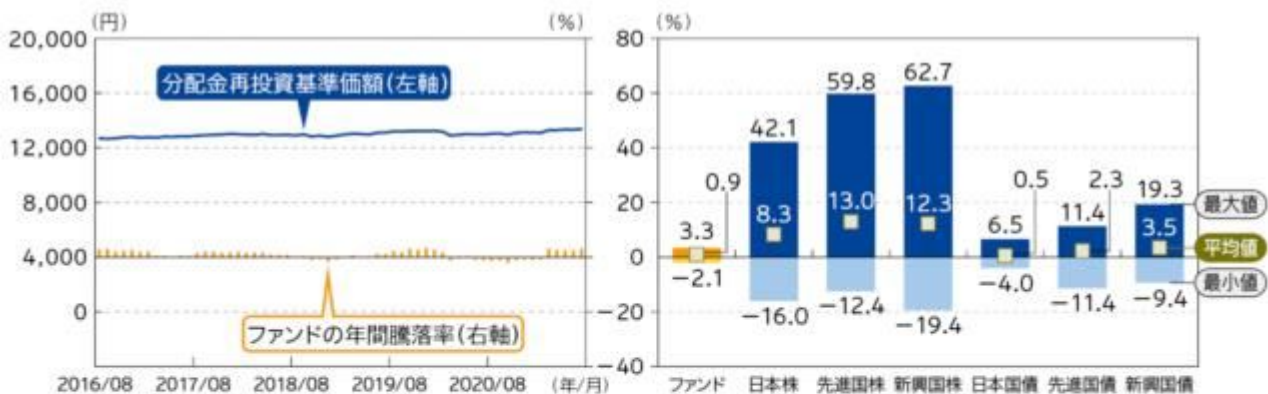




## ハッピーエイジング50



## ハッピーエイジング60



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

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

## 代表的な資産クラスの指数

## 日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

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。

## 新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

## 先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし、円ベース)

FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総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。

## 先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

## 日本国債:NOMURA-BPI 国債

野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

## 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)

J.P. Morgan Securities LLCが算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。同指数の著作権はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

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

<訂正後>

(略)

<その他の留意点>

(略)

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

- (略)
- (略)
- (略)
- (略)
- (略)
- (略)

#### <リスクの管理体制>

##### a. 委託会社のリスク管理体制

(略)

(注) 上図は、2022年1月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

#### 流動性リスクに対する管理体制

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

(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

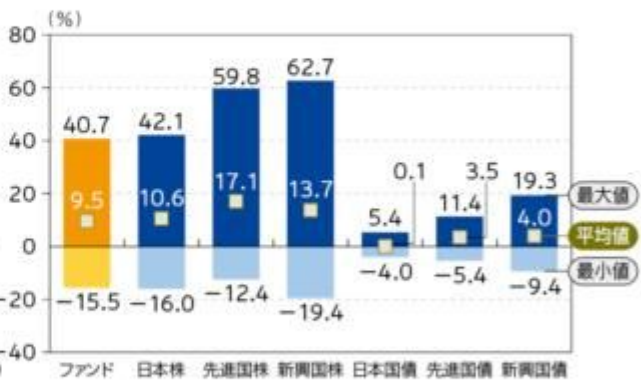
2017年2月～2022年1月

#### ハッピーエイジング20

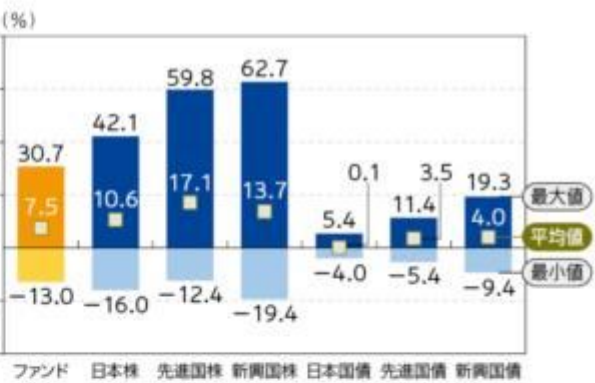


### ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

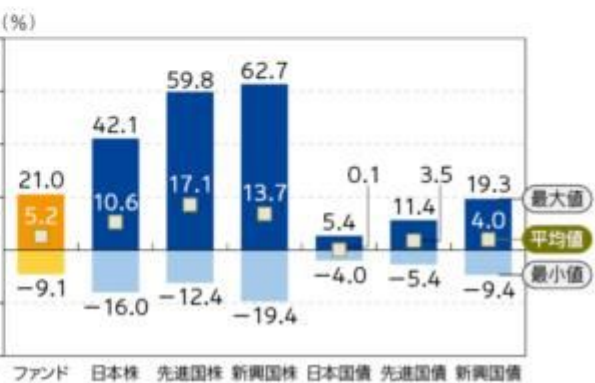
2017年2月～2022年1月



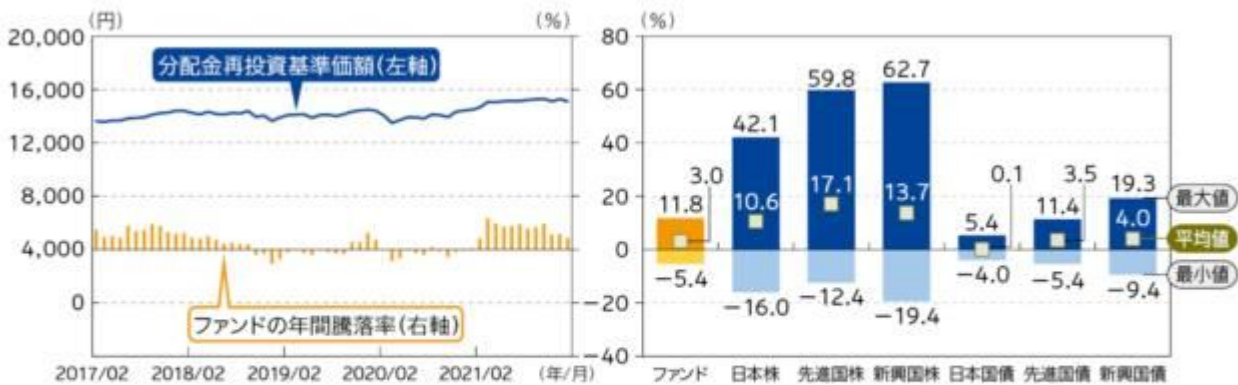
#### ハッピーエイジング30



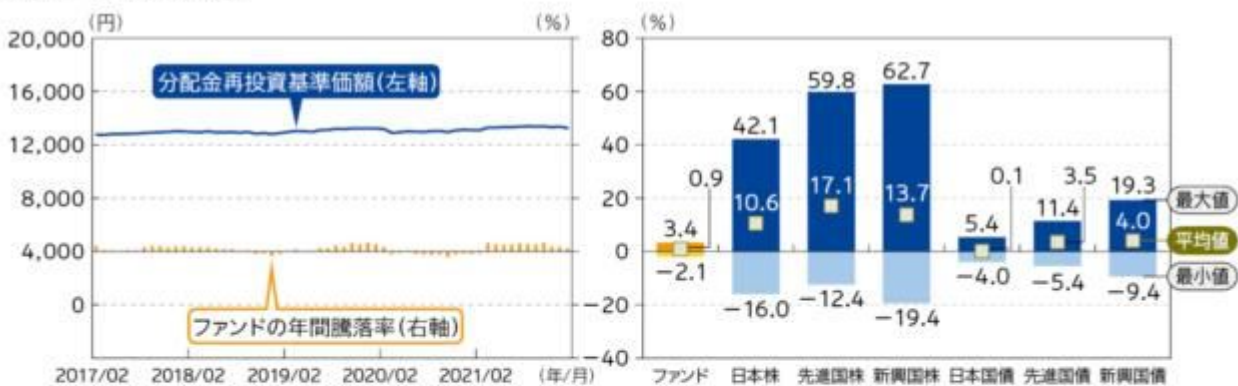
#### ハッピーエイジング40



## ハッピーエイジング50



## ハッピーエイジング60



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

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

## 代表的な資産クラスの指数

<p>日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）</p> <p>日本の株式市場を広くに網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。</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、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。</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、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、米ドルベース）をもとに委託会社が独自に円換算しています。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。</p>	<p>日本国債：NOMURA-BPI 国債</p> <p>野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。</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、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE 世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p>	<p>新興国債：J Pモルガン G B I - E Mグローバル・ディバーシファイド（円ベース）</p> <p>J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、J Pモルガン G B I - E Mグローバル・ディバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。</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2021年7月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

<訂正後>

（略）

上記は2022年1月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### （1）【投資状況】

#### ハッピーエイジング20

2022年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	628,336,249	4.49
親投資信託受益証券	日本	13,044,894,194	93.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		335,360,267	2.39
純資産総額		14,008,590,710	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

#### ハッピーエイジング30

2022年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	787,060,061	4.86
親投資信託受益証券	日本	15,103,880,712	93.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		314,149,335	1.94
純資産総額		16,205,090,108	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

#### ハッピーエイジング40

2022年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	1,011,020,241	4.90
親投資信託受益証券	日本	19,183,353,686	93.01

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		429,646,682	2.09
純資産総額		20,624,020,609	100.00

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

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

### ハッピーエイジング50

2022年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	238,866,393	2.54
親投資信託受益証券	日本	8,931,432,892	95.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		228,887,003	2.44
純資産総額		9,399,186,288	100.00

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

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

### ハッピーエイジング60

2022年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	5,356,548,497	97.92
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		113,574,569	2.08
純資産総額		5,470,123,066	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・バリュアー・マザーファンド

2022年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	25,519,865,500	98.50
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		387,887,549	1.50
純資産総額		25,907,753,049	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

2022年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	----	---------	---------

株式	日本	12,056,753,800	98.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		226,566,807	1.84
純資産総額		12,283,320,607	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

2022年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	16,534,434,400	69.01
地方債証券	日本	1,011,358,000	4.22
特殊債証券	日本	924,828,740	3.86
社債券	日本	5,131,406,000	21.42
	フランス	102,605,000	0.43
		5,234,011,000	21.84
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		255,883,823	1.07
純資産総額		23,960,515,963	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

2022年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	5,010,057,096	48.44
	イタリア	1,113,719,879	10.77
	スペイン	831,346,234	8.04
	フランス	771,952,937	7.46
	イギリス	591,354,007	5.72
	ドイツ	553,448,779	5.35
	ベルギー	209,608,289	2.03
	カナダ	193,098,050	1.87
	オーストラリア	188,671,087	1.82
	オランダ	152,213,730	1.47
	オーストリア	124,925,223	1.21
	中国	73,686,916	0.71
	メキシコ	72,379,204	0.70
	アイルランド	71,042,619	0.69
	マレーシア	53,831,871	0.52
	ポーランド	48,964,163	0.47
	フィンランド	48,861,085	0.47

	デンマーク	36,664,945	0.35
	シンガポール	36,631,530	0.35
	スウェーデン	28,368,292	0.27
	ノルウェー	25,437,040	0.25
		10,236,262,976	98.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		105,837,307	1.02
純資産総額		10,342,100,283	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 - TCW外国株式マザーファンド

2022年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	11,358,657,557	66.76
	ドイツ	454,856,266	2.67
	バミューダ	437,290,788	2.57
	アイルランド	387,265,042	2.28
	イギリス	385,816,035	2.27
	カナダ	347,651,552	2.04
	フランス	343,791,975	2.02
	スイス	243,163,387	1.43
	シンガポール	200,642,625	1.18
	オランダ	172,665,140	1.01
	オーストラリア	103,015,833	0.61
	スペイン	54,121,632	0.32
	デンマーク	47,599,717	0.28
	ジャージー	34,579,276	0.20
	スウェーデン	32,109,697	0.19
	ベルギー	30,941,940	0.18
	プエルトリコ	28,950,822	0.17
	ケイマン	14,779,586	0.09
香港	13,307,896	0.08	
		14,691,206,766	86.34
投資証券	アメリカ	793,863,034	4.67
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,529,478,463	8.99
純資産総額		17,014,548,263	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（2）【投資資産】



## 【投資有価証券の主要銘柄】

## ハッピーエイジング20

2022年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - T C W外国株式マ ザーファンド	1,401,568,039	3.2156	4,506,901,724	3.3096	4,638,629,581	33.11
2	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	1,386,990,662	2.5831	3,582,735,580	2.6474	3,671,919,078	26.21
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	1,679,700,168	2.0558	3,453,127,606	2.1615	3,630,671,913	25.92
4	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	476,497,211	1.7455	831,725,882	1.7422	830,153,441	5.93
5	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	94,169	7,560.58	711,973,113	6,672.43	628,336,249	4.49
6	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファ ンド	189,365,952	1.4593	276,341,734	1.4444	273,520,181	1.95

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

2022年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	4.49
親投資信託受益証券	93.12
合計	97.61

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率  
該当事項はありません。

## ハッピーエイジング30

2022年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド	1,364,137,346	2.5821	3,522,339,042	2.6474	3,611,417,209	22.29
2	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	1,651,981,581	2.0534	3,392,178,979	2.1615	3,570,758,187	22.03
3	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - T C W外国株式マ ザーファンド	1,036,851,507	3.2094	3,327,688,982	3.3096	3,431,563,747	21.18
4	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	1,847,200,473	1.7454	3,224,103,706	1.7422	3,218,192,664	19.86
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	880,607,107	1.4594	1,285,158,012	1.4444	1,271,948,905	7.85

6	アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	117,957	7,527.46	887,916,802	6,672.43	787,060,061	4.86
---	------	----------	----------------------------	---------	----------	-------------	----------	-------------	------

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2022年1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	4.86
親投資信託受益証券	93.20
合計	98.06

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### ハッピーエイジング40

2022年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファンド	4,648,070,758	1.4594	6,783,394,465	1.4444	6,713,673,402	32.55
2	日本	親投資信託受益証券	SJAMスモールキャップ・マザーファンド	1,229,534,184	2.5817	3,174,343,822	2.6474	3,255,068,798	15.78
3	日本	親投資信託受益証券	SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	1,489,041,586	2.0534	3,057,597,993	2.1615	3,218,563,388	15.61
4	日本	親投資信託受益証券	損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	1,761,517,215	1.7448	3,073,583,940	1.7422	3,068,915,291	14.88
5	日本	親投資信託受益証券	損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド	884,437,034	3.2113	2,840,212,090	3.3096	2,927,132,807	14.19
6	アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	151,522	7,517.26	1,139,030,884	6,672.43	1,011,020,241	4.90

(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

2022年1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	4.90
親投資信託受益証券	93.01
合計	97.92

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率  
該当事項はありません。

## ハッピーエイジング50

2022年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファンド	3,679,454,338	1.4593	5,369,427,716	1.4444	5,314,603,845	56.54
2	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド	592,404,106	1.7454	1,034,027,777	1.7422	1,032,086,433	10.98
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	345,304,873	2.5818	891,510,217	2.6474	914,160,120	9.73
4	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mラージキャップ・バリュー・マザーファンド	418,233,181	2.0533	858,758,191	2.1615	904,011,020	9.62
5	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド	231,620,581	3.2187	745,533,778	3.3096	766,571,474	8.16
6	アメリカ	投資信託 受益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	35,799	7,585.56	271,555,548	6,672.43	238,866,393	2.54

（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

2022年1月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	2.54
親投資信託受益証券	95.02
合計	97.56

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率  
該当事項はありません。

## ハッピーエイジング60

2022年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファンド	2,715,846,327	1.4594	3,963,506,130	1.4444	3,922,768,434	71.71
2	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド	502,074,026	1.7447	875,993,508	1.7422	874,713,368	15.99
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	84,953,915	2.5836	219,487,275	2.6474	224,906,994	4.11
4	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mラージキャップ・バリュー・マザーファンド	102,791,286	2.0577	211,523,203	2.1615	222,183,364	4.06
5	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド	33,833,798	3.2167	108,836,449	3.3096	111,976,337	2.05

（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

2022年1月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.92
合計	97.92

（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

2022年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2,671,800	572.59	1,529,845,962	691.10	1,846,480,980	7.13
2	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	347,100	3,794.14	1,316,945,994	4,113.00	1,427,622,300	5.51
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	353,000	2,834.61	1,000,617,330	3,267.00	1,153,251,000	4.45
4	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	325,200	3,094.07	1,006,191,564	3,354.00	1,090,720,800	4.21
5	日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	410,200	1,949.23	799,574,146	2,571.50	1,054,829,300	4.07
6	日本	株式	日本製鉄	鉄鋼	495,900	1,648.11	817,297,749	1,855.50	920,142,450	3.55
7	日本	株式	東レ	繊維製品	1,200,500	701.58	842,246,790	725.10	870,482,550	3.36
8	日本	株式	キリンホールディングス	食料品	463,800	2,089.33	969,031,254	1,837.00	852,000,600	3.29
9	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	246,700	3,652.01	900,950,867	3,328.00	821,017,600	3.17
10	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	344,100	2,006.46	690,422,886	2,294.00	789,365,400	3.05
11	日本	株式	鹿島建設	建設業	571,200	1,439.54	822,265,248	1,380.00	788,256,000	3.04
12	日本	株式	THK	機械	269,200	2,601.87	700,423,404	2,823.00	759,951,600	2.93
13	日本	株式	東京瓦斯	電気・ガス業	320,300	2,221.73	711,620,119	2,315.00	741,494,500	2.86
14	日本	株式	住友重機械工業	機械	232,200	3,046.83	707,473,926	2,985.00	693,117,000	2.68
15	日本	株式	日揮ホールディングス	建設業	603,500	1,311.01	791,194,535	1,121.00	676,523,500	2.61
16	日本	株式	三菱商事	卸売業	167,600	3,032.14	508,186,664	3,877.00	649,785,200	2.51
17	日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	377,500	1,577.21	595,396,775	1,512.50	570,968,750	2.20
18	日本	株式	スズケン	卸売業	167,100	3,773.73	630,590,283	3,405.00	568,975,500	2.20
19	日本	株式	アルプスアルバイン	電気機器	432,100	1,170.40	505,729,840	1,244.00	537,532,400	2.07
20	日本	株式	三井住友トラスト・ホールディングス	銀行業	124,000	3,646.57	452,174,680	3,965.00	491,660,000	1.90
21	日本	株式	日本テレビホールディングス	情報・通信業	400,800	1,403.25	562,422,600	1,194.00	478,555,200	1.85
22	日本	株式	サワイグループホールディングス	医薬品	108,700	5,000.88	543,595,656	4,335.00	471,214,500	1.82

23	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	70,200	7,600.49	533,554,398	6,544.00	459,388,800	1.77
24	日本	株式	三井不動産	不動産業	187,200	2,423.22	453,626,784	2,448.50	458,359,200	1.77
25	日本	株式	王子ホールディングス	パルプ・紙	683,600	573.09	391,764,324	607.00	414,945,200	1.60
26	日本	株式	スタンレー電気	電気機器	155,600	2,804.41	436,366,196	2,664.00	414,518,400	1.60
27	日本	株式	クレディセゾン	その他金融業	320,800	1,318.51	422,978,008	1,278.00	409,982,400	1.58
28	日本	株式	MS & ADインシュアランスグループホール	保険業	103,000	3,171.40	326,654,200	3,926.00	404,378,000	1.56
29	日本	株式	積水化学工業	化学	201,500	1,856.33	374,050,495	1,995.00	401,992,500	1.55
30	日本	株式	セイコーエプソン	電気機器	225,000	1,801.30	405,292,500	1,774.00	399,150,000	1.54

(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

2022年1月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	7.09
		食料品	7.81
		繊維製品	3.36
		パルプ・紙	1.60
		化学	1.55
		医薬品	4.99
		ガラス・土石製品	1.30
		鉄鋼	5.02
		非鉄金属	2.20
		機械	6.32
		電気機器	6.28
		輸送用機器	9.38
		電気・ガス業	2.86
		陸運業	1.77
		情報・通信業	6.30
		卸売業	4.70
		銀行業	14.54
		証券、商品先物取引業	0.92
保険業	5.63		
その他金融業	1.58		
不動産業	3.30		
合計			98.50

(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

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	シチズン時計	精密機器	966,400	501.03	484,198,527	488.00	471,603,200	3.84
2	日本	株式	E I Z O	電気機器	97,900	4,363.30	427,167,860	3,930.00	384,747,000	3.13
3	日本	株式	日本テレビホールディングス	情報・通信業	304,000	1,225.72	372,618,880	1,194.00	362,976,000	2.96
4	日本	株式	H . U . グループホールディングス	サービス業	123,000	3,193.75	392,831,250	2,908.00	357,684,000	2.91
5	日本	株式	伊予銀行	銀行業	490,400	586.10	287,423,440	593.00	290,807,200	2.37
6	日本	株式	めぶきフィナンシャルグループ	銀行業	1,103,200	247.93	273,523,791	255.00	281,316,000	2.29
7	日本	株式	パーク24	不動産業	162,000	1,855.79	300,639,178	1,725.00	279,450,000	2.28
8	日本	株式	八十二銀行	銀行業	653,100	383.29	250,326,699	422.00	275,608,200	2.24
9	日本	株式	東邦ホールディングス	卸売業	149,900	1,938.98	290,653,102	1,791.00	268,470,900	2.19
10	日本	株式	第四北越フィナンシャルグループ	銀行業	99,400	2,731.84	271,545,746	2,646.00	263,012,400	2.14
11	日本	株式	クレディセゾン	その他金融業	203,000	1,292.09	262,294,270	1,278.00	259,434,000	2.11
12	日本	株式	メイテック	サービス業	38,000	6,660.02	253,080,760	6,680.00	253,840,000	2.07
13	日本	株式	ほくほくフィナンシャルグループ	銀行業	272,600	856.13	233,383,347	900.00	245,340,000	2.00
14	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	302,500	716.85	216,847,476	810.00	245,025,000	1.99
15	日本	株式	日本ライフライン	卸売業	227,000	1,319.80	299,595,582	1,002.00	227,454,000	1.85
16	日本	株式	東亜合成	化学	198,300	1,262.80	250,414,433	1,125.00	223,087,500	1.82
17	日本	株式	七十七銀行	銀行業	147,400	1,254.95	184,980,620	1,511.00	222,721,400	1.81
18	日本	株式	群馬銀行	銀行業	592,000	353.42	209,228,284	376.00	222,592,000	1.81
19	日本	株式	山口フィナンシャルグループ	銀行業	295,000	658.37	194,219,150	709.00	209,155,000	1.70
20	日本	株式	北洋銀行	銀行業	820,600	257.51	211,315,207	249.00	204,329,400	1.66
21	日本	株式	キョーリン製薬ホールディングス	医薬品	108,000	1,856.52	200,504,160	1,822.00	196,776,000	1.60
22	日本	株式	コメリ	小売業	73,000	2,587.81	188,910,130	2,670.00	194,910,000	1.59
23	日本	株式	マブチモーター	電気機器	46,000	3,929.02	180,735,143	3,600.00	165,600,000	1.35
24	日本	株式	オーエスジー	機械	78,000	2,070.60	161,506,800	2,000.00	156,000,000	1.27
25	日本	株式	十六フィナンシャルグループ	銀行業	65,000	2,221.00	144,365,000	2,277.00	148,005,000	1.20
26	日本	株式	A O K I ホールディングス	小売業	254,000	662.50	168,276,288	582.00	147,828,000	1.20
27	日本	株式	ゼビオホールディングス	小売業	152,000	1,102.97	167,651,881	897.00	136,344,000	1.11
28	日本	株式	ジェイテクト	機械	137,000	985.35	134,994,075	991.00	135,767,000	1.11
29	日本	株式	東洋インキSCホールディングス	化学	71,400	2,071.91	147,934,374	1,899.00	135,588,600	1.10
30	日本	株式	ゴールドクレスト	不動産業	74,000	1,741.65	128,882,434	1,792.00	132,608,000	1.08

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別及び業種別投資比率

2022年1月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	2.21
		食料品	0.36
		繊維製品	1.52
		パルプ・紙	2.08
		化学	7.66
		医薬品	2.06
		ゴム製品	0.19
		ガラス・土石製品	0.68
		鉄鋼	1.58
		非鉄金属	0.26
		金属製品	1.70
		機械	3.21
		電気機器	7.58
		輸送用機器	4.05
		精密機器	4.89
		電気・ガス業	1.70
		陸運業	0.46
		情報・通信業	4.19
		卸売業	6.37
		小売業	7.93
銀行業	24.65		
その他金融業	2.11		
不動産業	3.35		
サービス業	7.35		
合計			98.16

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

(参考) 損保ジャパン日本債券マザーファンド

2022年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率(%)	償還日	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	1,220,000,000	119.14	1,453,520,200	116.30	1,418,896,600	1.7000000	2033/6/20	5.92
2	日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	1,150,000,000	100.35	1,154,126,500	100.17	1,152,012,500	0.0050000	2026/6/20	4.81
3	日本	国債証券	第426回利付国債(2年)	1,000,000,000	100.27	1,002,740,000	100.10	1,001,050,000	0.0050000	2023/7/1	4.18
4	日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	810,000,000	100.59	814,789,400	100.34	812,762,100	0.1000000	2024/3/20	3.39
5	日本	国債証券	第421回利付国債(2年)	730,000,000	100.36	732,657,200	100.18	731,314,000	0.1000000	2023/2/1	3.05

6	日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	700,000,000	100.83	705,812,000	99.77	698,418,000	0.1000000	2031/3/20	2.91
7	日本	国債証券	第174回利付国債(20年)	700,000,000	100.45	703,219,600	97.79	684,565,000	0.4000000	2040/9/20	2.86
8	日本	国債証券	第159回利付国債(20年)	640,000,000	105.74	676,793,600	103.02	659,366,400	0.6000000	2036/12/20	2.75
9	日本	国債証券	第143回利付国債(5年)	650,000,000	100.62	654,069,000	100.48	653,152,500	0.1000000	2025/3/20	2.73
10	日本	国債証券	第424回利付国債(2年)	650,000,000	100.21	651,401,000	100.09	650,643,500	0.0050000	2023/5/1	2.72
11	日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	450,000,000	100.95	454,293,000	100.61	452,776,500	0.1000000	2027/12/20	1.89
12	日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	450,000,000	100.94	454,257,000	100.35	451,588,500	0.1000000	2029/12/20	1.88
13	日本	社債券	第3回三井住友海上火災保険株式会社利払繰延条項・期限前償還条	400,000,000	100.59	402,392,000	100.37	401,492,000	0.8500000	2077/12/10	1.68
14	日本	国債証券	第422回利付国債(2年)	400,000,000	100.38	401,520,000	100.18	400,752,000	0.1000000	2023/3/1	1.67
15	日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	360,000,000	114.04	410,572,800	111.23	400,431,600	1.2000000	2034/12/20	1.67
16	日本	特殊債券	第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	400,000,000	99.97	399,896,000	100.02	400,104,000	0.0010000	2024/8/28	1.67
17	日本	地方債証券	第807回東京都公募公債	400,000,000	100.35	401,420,000	99.37	397,516,000	0.1000000	2030/6/20	1.66
18	日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	340,000,000	114.42	389,028,000	111.42	378,834,800	1.2000000	2035/9/20	1.58
19	日本	国債証券	第170回利付国債(20年)	370,000,000	99.48	368,094,500	96.68	357,716,000	0.3000000	2039/9/20	1.49
20	日本	国債証券	第43回利付国債(30年)	270,000,000	126.35	341,145,000	122.55	330,885,000	1.7000000	2044/6/20	1.38
21	日本	国債証券	第144回利付国債(20年)	290,000,000	115.91	336,143,500	113.90	330,321,600	1.5000000	2033/3/20	1.38
22	日本	国債証券	第173回利付国債(20年)	330,000,000	100.88	332,927,100	97.90	323,083,200	0.4000000	2040/6/20	1.35
23	日本	特殊債券	第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	300,000,000	108.24	324,741,000	107.13	321,393,000	1.1760000	2029/1/26	1.34
24	日本	国債証券	第148回利付国債(20年)	280,000,000	117.45	328,862,800	114.57	320,821,200	1.5000000	2034/3/20	1.34
25	日本	国債証券	第58回利付国債(30年)	300,000,000	106.26	318,780,000	102.09	306,288,000	0.8000000	2048/3/20	1.28
26	日本	地方債証券	第135回共同発行市場公募地方債	300,000,000	101.92	305,778,000	101.56	304,701,000	0.6590000	2024/6/25	1.27
27	日本	社債券	第1回明治安田生命劣後ローン流動化	300,000,000	100.00	300,000,000	99.72	299,160,000	0.8800000	2051/8/2	1.25
28	日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	260,000,000	101.09	262,834,000	99.91	259,771,200	0.1000000	2030/12/20	1.08



29	日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	250,000,000	101.00	252,505,000	100.54	251,372,500	0.1000000	2028/12/20	1.05
30	日本	国債証券	第67回利付国債(30年)	220,000,000	99.50	218,919,800	95.70	210,553,200	0.6000000	2050/6/20	0.88

(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

2022年1月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	69.01
地方債証券	4.22
特殊債券	3.86
社債券	21.84
合計	98.93

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

### (参考) 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

2022年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還日	投資比率(%)
1	アメリカ	国債証券	Treasury 0.125 230228	10,890,000	11,517.48	1,254,254,430	11,460.57	1,248,056,788	0.1250000	2023/2/28	12.07
2	アメリカ	国債証券	Treasury 2.25 270815	7,550,000	12,201.09	921,182,341	11,900.24	898,468,170	0.2500000	2027/8/15	8.69
3	アメリカ	国債証券	Treasury 0.75 260331	4,870,000	11,415.64	555,942,054	11,161.15	543,548,203	0.7500000	2026/3/31	5.26
4	スペイン	国債証券	SPAIN 0.0 280131	3,960,000	12,813.36	507,409,167	12,661.55	501,397,747	0.0000000	2028/1/31	4.85
5	イタリア	国債証券	ITALY 2.2 270601	3,450,000	14,103.40	486,567,315	13,958.45	481,566,596	0.2000000	2027/6/1	4.66
6	アメリカ	国債証券	Treasury 1.875 260630	2,940,000	12,147.80	357,145,476	11,688.75	343,649,276	1.8750000	2026/6/30	3.32
7	イタリア	国債証券	ITALY 2.8 281201	2,240,000	15,154.19	339,454,027	14,559.01	326,121,851	0.8000000	2028/12/1	3.15
8	フランス	国債証券	FRA 0.00 240325	2,360,000	13,027.95	307,459,767	13,011.38	307,068,705	0.0000000	2024/3/25	2.97
9	ドイツ	国債証券	GERMANY 0.0 230414	2,000,000	12,921.19	258,423,903	12,971.70	259,434,141	0.0000000	2023/4/14	2.51
10	アメリカ	国債証券	Treasury 1.25 310815	2,310,000	11,184.63	258,365,182	11,011.89	254,374,745	1.2500000	2031/8/15	2.46
11	アメリカ	国債証券	Treasury 3.0 480215	1,340,000	13,975.00	187,265,054	13,595.76	182,183,259	3.0000000	2048/2/15	1.76
12	アメリカ	国債証券	Treasury 2.875 490515	1,350,000	13,736.20	185,438,775	13,418.54	181,150,386	2.8750000	2049/5/15	1.75

13	アメリカ	国債証券	Treasury 1.625 310515	1,450,000	11,830.29	171,539,222	11,401.50	165,321,804	1.6250000	2031/5/15	1.60
14	アメリカ	国債証券	Treasury 2.0 510815	1,330,000	11,705.59	155,684,462	11,331.15	150,704,394	2.0000000	2051/8/15	1.46
15	ドイツ	国債証券	GERMANY 2.5 460815	680,000	20,563.72	139,833,349	20,328.69	138,235,104	2.5000000	2046/8/15	1.34
16	イタリア	国債証券	ITALY 4.0 370201	810,000	17,996.96	145,775,383	16,899.64	136,887,128	4.0000000	2037/2/1	1.32
17	フランス	国債証券	FRANCE 1.25 340525	910,000	14,601.62	132,874,773	14,047.71	127,834,219	1.2500000	2034/5/25	1.24
18	スペイン	国債証券	SPAIN 5.75 320730	640,000	20,327.30	130,094,734	19,460.59	124,547,821	5.7500000	2032/7/30	1.20
19	アメリカ	国債証券	Treasury 2.125 250515	1,040,000	12,207.78	126,960,912	11,796.07	122,679,170	2.1250000	2025/5/15	1.19
20	アメリカ	国債証券	Treasury 1.75 410815	1,120,000	11,145.53	124,829,962	10,797.24	120,929,172	1.7500000	2041/8/15	1.17
21	アメリカ	国債証券	Treasury 1.625 230531	910,000	11,845.29	107,792,215	11,649.51	106,010,625	1.6250000	2023/5/31	1.03
22	カナダ	国債証券	CANADA 5.75 290601	860,000	12,149.25	104,483,570	11,601.93	99,776,631	5.7500000	2029/6/1	0.96
23	イギリス	国債証券	UK GILT 4.0 600122	340,000	30,029.14	102,099,078	28,244.44	96,031,114	4.0000000	2060/1/22	0.93
24	アメリカ	国債証券	Treasury 2.125 240229	810,000	12,080.79	97,854,447	11,765.86	95,303,475	2.1250000	2024/2/29	0.92
25	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA 4.75 270421	1,010,000	9,883.46	99,822,990	9,318.25	94,114,341	4.7500000	2027/4/21	0.91
26	ドイツ	国債証券	GERMANY 0.0 500815	740,000	12,169.69	90,055,773	12,124.14	89,718,684	0.0000000	2050/8/15	0.87
27	スペイン	国債証券	SPAIN 4.7 410730	425,000	21,604.17	91,817,746	20,767.85	88,263,404	4.7000000	2041/7/30	0.85
28	イギリス	国債証券	UK GILT 4.25 390907	380,000	23,788.52	90,396,383	22,355.49	84,950,873	4.2500000	2039/9/7	0.82
29	アメリカ	国債証券	Treasury 2.875 430515	620,000	13,449.66	83,387,903	12,957.68	80,337,672	2.8750000	2043/5/15	0.78
30	イタリア	国債証券	ITALY 2.45 330901	550,000	15,141.37	83,277,578	14,300.55	78,653,074	2.4500000	2033/9/1	0.76

(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

2022年1月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.98
合計	98.98

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考) 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド

2022年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア・ サービス	16,725	32,629.17	545,723,015	35,585.53	595,168,063	3.50
2	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフト ウェア・ サービス	17,643	28,380.92	500,724,642	26,320.32	464,369,406	2.73
3	バミュー ダ	株式	IHS MARKIT LTD	商業・専 門サービ ス	30,972	12,966.22	401,589,790	13,219.03	409,419,933	2.41
4	カナダ	株式	WASTE CONNECTIONS INC	商業・専 門サービ ス	24,377	14,091.76	343,514,853	14,261.45	347,651,552	2.04
5	アメリカ	株式	DANAHER CORP	ヘルスケ ア機器・ サービス	10,155	31,875.29	323,693,598	32,451.33	329,543,341	1.94
6	アメリカ	株式	TRADE DESK INC/THE - CLASS A	ソフト ウェア・ サービス	44,660	8,498.69	379,551,620	7,341.98	327,893,005	1.93
7	アメリカ	株式	MSCI INC	各種金融	5,360	64,091.13	343,528,476	58,658.52	314,409,706	1.85
8	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフト ウェア・ サービス	6,138	44,966.94	276,007,114	44,156.95	271,035,386	1.59
9	アメリカ	株式	ALPHABET, INC	メディ ア・娯楽	879	305,334.18	268,388,746	307,738.79	270,502,403	1.59
10	アメリカ	株式	S&P GLOBAL INC	各種金融	5,759	47,406.59	273,014,555	46,940.21	270,328,686	1.59
11	アメリカ	株式	FISERV INC	ソフト ウェア・ サービス	20,712	12,651.06	262,028,953	12,108.50	250,791,285	1.47
12	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	662	424,450.94	280,986,526	332,416.40	220,059,661	1.29
13	アメリカ	株式	ADOBE SYSTEMS INC	ソフト ウェア・ サービス	3,617	70,158.65	253,763,873	59,816.39	216,355,884	1.27
14	アメリカ	株式	COSTAR GROUP INC	商業・専 門サービ ス	27,600	9,912.83	273,594,185	7,777.19	214,650,521	1.26
15	アメリカ	株式	SERVICENOW INC	ソフト ウェア・ サービス	3,290	64,985.79	213,803,261	64,771.07	213,096,837	1.25
16	アメリカ	株式	METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	1,230	165,721.04	203,836,887	165,140.38	203,122,671	1.19
17	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	7,528	22,933.31	172,641,961	26,366.49	198,486,982	1.17
18	アイルラ ンド	株式	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	資本財	22,318	8,063.48	179,960,836	8,330.15	185,912,297	1.09
19	アメリカ	株式	LENNAR CORP-CL A	耐久消費 財・アパ レル	16,542	11,120.33	183,952,585	10,784.40	178,395,624	1.05
20	アメリカ	株式	CENTENE CORP	ヘルスケ ア機器・ サービス	19,964	8,357.85	166,856,237	8,920.04	178,079,854	1.05
21	アメリカ	株式	MOLINA HEALTHCARE INC	ヘルスケ ア機器・ サービス	5,366	29,549.17	158,560,883	32,913.09	176,611,686	1.04
22	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディ ア・娯楽	5,017	40,021.89	200,789,840	34,829.40	174,739,112	1.03
23	アメリカ	株式	JP MORGAN CHASE & CO	銀行	9,706	17,907.05	173,805,854	16,924.65	164,270,734	0.97
24	アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORP		5,627	32,481.35	182,772,572	28,487.12	160,297,074	0.94
25	アメリカ	株式	ON SEMICONDUCTOR CORP	半導体・ 半導体製 造装置	25,666	4,408.77	113,155,692	6,206.05	159,284,592	0.94

26	アメリカ	株式	TRANSUNION	商業・専門サービス	12,874	13,018.16	167,595,905	11,504.75	148,112,157	0.87
27	アメリカ	株式	UNITED PARCEL SERVICE-CLB	運輸	6,305	24,254.32	152,923,534	22,885.98	144,296,104	0.85
28	アメリカ	株式	MCKESSON HBOC INC	ヘルスケア機器・サービス	4,830	21,829.70	105,437,470	29,807.76	143,971,492	0.85
29	アメリカ	株式	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	各種金融	9,938	13,642.69	135,581,144	14,354.96	142,659,632	0.84
30	アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	5,504	28,130.41	154,829,827	25,642.68	141,137,350	0.83

(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

2022年1月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国		0.08
		エネルギー	1.67
			0.55
		銀行	3.62
			0.72
		素材	3.03
		資本財	5.13
		商業・専門サービス	7.12
		運輸	0.93
		自動車・自動車部品	0.73
		耐久消費財・アパレル	2.04
		消費者サービス	0.86
		メディア・娯楽	5.48
		小売	3.74
		食品・生活必需品小売り	0.60
		食品・飲料・タバコ	2.40
		家庭用品・パーソナル用品	0.39
		ヘルスケア機器・サービス	6.96
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.01
		各種金融	6.97
		保険	2.06
		不動産	0.72
		ソフトウェア・サービス	16.82
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.07		
電気通信サービス	0.86		
公益事業	1.07		
半導体・半導体製造装置	3.71		

投資証券		4.67
合計		91.01

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

#### 【投資不動産物件】

ハッピーエイジング20

該当事項はありません。

ハッピーエイジング30

該当事項はありません。

ハッピーエイジング40

該当事項はありません。

ハッピーエイジング50

該当事項はありません。

ハッピーエイジング60

該当事項はありません。

(参考) S J A M ラージキャップ・バリュー・マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) S J A M スモールキャップ・マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 損保ジャパン - T C W 外国株式マザーファンド

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

ハッピーエイジング20

該当事項はありません。

ハッピーエイジング30

該当事項はありません。

#### ハッピーエイジング40

該当事項はありません。

#### ハッピーエイジング50

該当事項はありません。

#### ハッピーエイジング60

該当事項はありません。

（参考）S J A Mラージキャップ・バリュー・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

#### ハッピーエイジング20

直近日（2022年1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12計算期間末（2012年7月17日）	4,034,512,435	4,034,512,435	0.6395	0.6395
第13計算期間末（2013年7月16日）	6,375,079,876	6,375,079,876	0.9828	0.9828
第14計算期間末（2014年7月15日）	7,212,476,370	7,212,476,370	1.0930	1.0930
第15計算期間末（2015年7月15日）	8,801,004,620	8,801,004,620	1.3543	1.3543
第16計算期間末（2016年7月15日）	7,416,738,892	7,416,738,892	1.1099	1.1099
第17計算期間末（2017年7月18日）	9,271,419,094	9,271,419,094	1.4045	1.4045
第18計算期間末（2018年7月17日）	10,439,689,943	10,439,689,943	1.5015	1.5015
第19計算期間末（2019年7月16日）	10,453,350,603	10,453,350,603	1.4179	1.4179
第20計算期間末（2020年7月15日）	10,189,146,231	10,189,146,231	1.3797	1.3797
第21計算期間末（2021年7月15日）	13,007,644,754	13,007,644,754	1.7449	1.7449
2021年1月末日	11,264,545,417		1.5266	
2月末日	11,730,655,959		1.6063	
3月末日	12,615,161,596		1.7219	
4月末日	12,634,335,689		1.7206	
5月末日	12,842,501,972		1.7378	
6月末日	13,014,034,162		1.7496	
7月末日	13,059,312,348		1.7408	
8月末日	13,396,568,388		1.7780	
9月末日	13,687,083,603		1.8012	
10月末日	14,036,493,976		1.8169	
11月末日	13,717,426,564		1.7620	
12月末日	14,227,994,074		1.8222	
2022年1月末日	14,008,590,710		1.7841	

### ハッピーエイジング30

直近日（2022年1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12計算期間末（2012年7月17日）	5,099,609,632	5,099,609,632	0.7258	0.7258
第13計算期間末（2013年7月16日）	7,661,401,181	7,661,401,181	1.0552	1.0552
第14計算期間末（2014年7月15日）	8,543,771,190	8,543,771,190	1.1614	1.1614
第15計算期間末（2015年7月15日）	10,450,600,803	10,450,600,803	1.3944	1.3944
第16計算期間末（2016年7月15日）	9,226,785,122	9,226,785,122	1.1894	1.1894
第17計算期間末（2017年7月18日）	11,485,239,619	11,485,239,619	1.4397	1.4397
第18計算期間末（2018年7月17日）	12,738,786,784	12,738,786,784	1.5148	1.5148
第19計算期間末（2019年7月16日）	12,699,403,491	12,699,403,491	1.4446	1.4446
第20計算期間末（2020年7月15日）	12,817,876,592	12,817,876,592	1.4293	1.4293

第21計算期間末	(2021年 7月15日)	15,539,022,049	15,539,022,049	1.7142	1.7142
	2021年 1月末日	13,941,106,542		1.5457	
	2月末日	14,362,709,294		1.6063	
	3月末日	15,315,951,587		1.7028	
	4月末日	15,288,165,082		1.6957	
	5月末日	15,491,085,866		1.7125	
	6月末日	15,578,590,976		1.7178	
	7月末日	15,559,471,259		1.7094	
	8月末日	15,894,122,268		1.7368	
	9月末日	16,135,770,989		1.7565	
	10月末日	16,320,307,471		1.7686	
	11月末日	15,962,679,811		1.7190	
	12月末日	16,388,324,804		1.7660	
	2022年 1月末日	16,205,090,108		1.7391	

## ハッピーエイジング40

直近日（2022年1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12計算期間末	(2012年 7月17日)	7,397,925,868	7,397,925,868	0.8565	0.8565
第13計算期間末	(2013年 7月16日)	9,756,993,303	9,756,993,303	1.1196	1.1196
第14計算期間末	(2014年 7月15日)	10,651,044,828	10,651,044,828	1.2075	1.2075
第15計算期間末	(2015年 7月15日)	12,378,839,543	12,378,839,543	1.3816	1.3816
第16計算期間末	(2016年 7月15日)	11,857,174,350	11,857,174,350	1.2636	1.2636
第17計算期間末	(2017年 7月18日)	13,906,785,392	13,906,785,392	1.4368	1.4368
第18計算期間末	(2018年 7月17日)	15,282,979,036	15,282,979,036	1.4924	1.4924
第19計算期間末	(2019年 7月16日)	16,189,690,869	16,189,690,869	1.4537	1.4537
第20計算期間末	(2020年 7月15日)	16,815,567,800	16,815,567,800	1.4410	1.4410
第21計算期間末	(2021年 7月15日)	19,994,471,155	19,994,471,155	1.6425	1.6425
	2021年 1月末日	18,241,877,079		1.5256	
	2月末日	18,635,539,697		1.5640	
	3月末日	19,610,662,309		1.6324	
	4月末日	19,679,146,229		1.6281	
	5月末日	19,902,955,169		1.6398	
	6月末日	20,044,144,540		1.6437	
	7月末日	20,035,274,352		1.6382	
	8月末日	20,300,920,286		1.6555	
	9月末日	20,530,257,684		1.6670	
	10月末日	20,718,028,231		1.6746	
	11月末日	20,361,025,127		1.6410	
	12月末日	20,776,307,621		1.6716	



2022年 1月末日	20,624,020,609		1.6507	
------------	----------------	--	--------	--

## ハッピーエイジング50

直近日(2022年1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12計算期間末 (2012年 7月17日)	3,809,563,912	3,809,563,912	0.9795	0.9795
第13計算期間末 (2013年 7月16日)	4,480,882,597	4,480,882,597	1.1555	1.1555
第14計算期間末 (2014年 7月15日)	4,908,333,421	4,908,333,421	1.2215	1.2215
第15計算期間末 (2015年 7月15日)	5,534,439,620	5,534,439,620	1.3347	1.3347
第16計算期間末 (2016年 7月15日)	5,689,949,958	5,689,949,958	1.3007	1.3007
第17計算期間末 (2017年 7月18日)	6,297,794,959	6,297,794,959	1.3890	1.3890
第18計算期間末 (2018年 7月17日)	6,875,070,157	6,875,070,157	1.4262	1.4262
第19計算期間末 (2019年 7月16日)	7,592,282,029	7,592,282,029	1.4137	1.4137
第20計算期間末 (2020年 7月15日)	7,791,444,020	7,791,444,020	1.4019	1.4019
第21計算期間末 (2021年 7月15日)	8,938,896,753	8,938,896,753	1.5168	1.5168
2021年 1月末日	8,333,298,635		1.4488	
2月末日	8,437,750,699		1.4662	
3月末日	8,734,644,350		1.5082	
4月末日	8,832,170,328		1.5058	
5月末日	8,891,401,314		1.5127	
6月末日	8,946,416,783		1.5147	
7月末日	8,993,344,226		1.5143	
8月末日	9,093,743,543		1.5231	
9月末日	9,151,614,568		1.5275	
10月末日	9,300,868,436		1.5305	
11月末日	9,257,411,363		1.5124	
12月末日	9,440,783,777		1.5280	
2022年 1月末日	9,399,186,288		1.5126	

## ハッピーエイジング60

直近日(2022年1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12計算期間末 (2012年 7月17日)	2,434,101,752	2,434,101,752	1.0812	1.0812
第13計算期間末 (2013年 7月16日)	2,695,707,446	2,695,707,446	1.1485	1.1485
第14計算期間末 (2014年 7月15日)	3,031,298,200	3,031,298,200	1.1883	1.1883
第15計算期間末 (2015年 7月15日)	3,292,018,524	3,292,018,524	1.2399	1.2399
第16計算期間末 (2016年 7月15日)	3,737,464,193	3,737,464,193	1.2843	1.2843

第17計算期間末	(2017年 7月18日)	3,967,051,489	3,967,051,489	1.2846	1.2846
第18計算期間末	(2018年 7月17日)	4,186,192,577	4,186,192,577	1.3015	1.3015
第19計算期間末	(2019年 7月16日)	4,551,251,809	4,551,251,809	1.3089	1.3089
第20計算期間末	(2020年 7月15日)	4,870,043,859	4,870,043,859	1.3009	1.3009
第21計算期間末	(2021年 7月15日)	5,345,944,070	5,345,944,070	1.3367	1.3367
	2021年 1月末日	5,198,644,823		1.3106	
	2月末日	5,196,585,775		1.3092	
	3月末日	5,256,823,258		1.3298	
	4月末日	5,254,464,273		1.3287	
	5月末日	5,248,831,402		1.3329	
	6月末日	5,313,723,360		1.3323	
	7月末日	5,362,858,320		1.3365	
	8月末日	5,376,368,703		1.3385	
	9月末日	5,402,769,425		1.3374	
	10月末日	5,493,707,196		1.3384	
	11月末日	5,480,043,265		1.3320	
	12月末日	5,512,987,844		1.3359	
	2022年 1月末日	5,470,123,066		1.3250	

## 【分配の推移】

## ハッピーエイジング20

	1口当たりの分配金(円)
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22中間計算期間末	

## ハッピーエイジング30

	1口当たりの分配金(円)
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000

第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22中間計算期間末	

## ハッピーエイジング40

	1口当たりの分配金（円）
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22中間計算期間末	

## ハッピーエイジング50

	1口当たりの分配金（円）
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22中間計算期間末	

## ハッピーエイジング60

	1口当たりの分配金（円）
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22中間計算期間末	

## 【収益率の推移】

## ハッピーエイジング20

	収益率（％）
第12計算期間	11.6
第13計算期間	53.7
第14計算期間	11.2
第15計算期間	23.9
第16計算期間	18.0
第17計算期間	26.5
第18計算期間	6.9
第19計算期間	5.6
第20計算期間	2.7
第21計算期間	26.5
第22中間計算期間末	5.3

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## ハッピーエイジング30

	収益率（％）
第12計算期間	9.1
第13計算期間	45.4
第14計算期間	10.1
第15計算期間	20.1

第16計算期間	14.7
第17計算期間	21.0
第18計算期間	5.2
第19計算期間	4.6
第20計算期間	1.1
第21計算期間	19.9
第22中間計算期間末	3.9

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

#### ハッピーエイジング40

	収益率(%)
第12計算期間	5.8
第13計算期間	30.7
第14計算期間	7.9
第15計算期間	14.4
第16計算期間	8.5
第17計算期間	13.7
第18計算期間	3.9
第19計算期間	2.6
第20計算期間	0.9
第21計算期間	14.0
第22中間計算期間末	2.3

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

#### ハッピーエイジング50

	収益率(%)
第12計算期間	2.6
第13計算期間	18.0
第14計算期間	5.7
第15計算期間	9.3
第16計算期間	2.5
第17計算期間	6.8
第18計算期間	2.7
第19計算期間	0.9
第20計算期間	0.8
第21計算期間	8.2

第22中間計算期間末	0.9
------------	-----

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

#### ハッピーエイジング60

	収益率(%)
第12計算期間	0.7
第13計算期間	6.2
第14計算期間	3.5
第15計算期間	4.3
第16計算期間	3.6
第17計算期間	0.0
第18計算期間	1.3
第19計算期間	0.6
第20計算期間	0.6
第21計算期間	2.8
第22中間計算期間末	0.3

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

#### (4) 【設定及び解約の実績】

#### ハッピーエイジング20

	設定口数	解約口数
第12計算期間	1,229,841,291	735,754,993
第13計算期間	1,412,715,175	1,234,496,719
第14計算期間	1,198,615,866	1,086,750,393
第15計算期間	1,446,470,764	1,546,505,235
第16計算期間	1,316,566,721	1,133,015,060
第17計算期間	1,187,415,933	1,268,396,839
第18計算期間	1,489,193,062	1,137,446,811
第19計算期間	1,441,075,609	1,021,272,801
第20計算期間	1,610,603,019	1,598,232,575
第21計算期間	1,531,705,313	1,462,004,315
第22中間計算期間末	911,812,907	579,431,223

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

## ハッピーエイジング30

	設定口数	解約口数
第12計算期間	1,095,836,730	572,539,792
第13計算期間	1,142,944,756	908,933,490
第14計算期間	925,289,956	829,222,130
第15計算期間	1,083,572,839	945,383,122
第16計算期間	963,924,983	701,088,669
第17計算期間	1,000,840,370	780,753,459
第18計算期間	1,190,076,724	757,714,913
第19計算期間	1,151,257,690	770,237,275
第20計算期間	1,336,572,558	1,159,232,504
第21計算期間	1,265,453,871	1,168,570,454
第22中間計算期間末	676,396,329	454,638,153

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

## ハッピーエイジング40

	設定口数	解約口数
第12計算期間	1,339,462,020	792,859,126
第13計算期間	1,210,013,963	1,132,548,340
第14計算期間	1,187,155,993	1,081,548,442
第15計算期間	1,360,175,410	1,220,689,774
第16計算期間	1,288,216,954	864,776,270
第17計算期間	1,431,202,031	1,135,435,456
第18計算期間	1,676,258,878	1,115,070,892
第19計算期間	1,884,821,803	988,431,478
第20計算期間	2,098,383,366	1,565,929,863
第21計算期間	1,997,361,636	1,493,623,313
第22中間計算期間末	986,365,900	737,198,141

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

## ハッピーエイジング50

	設定口数	解約口数
第12計算期間	686,143,489	478,493,200
第13計算期間	619,762,253	631,166,681
第14計算期間	718,206,328	577,818,984

第15計算期間	849,878,441	721,397,173
第16計算期間	730,303,162	502,519,916
第17計算期間	828,831,999	669,291,626
第18計算期間	971,431,975	684,746,630
第19計算期間	1,121,171,260	571,339,838
第20計算期間	1,179,541,160	992,253,306
第21計算期間	1,148,879,543	813,439,718
第22中間計算期間末	647,713,642	356,741,398

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

## ハッピーエイジング60

	設定口数	解約口数
第12計算期間	406,833,203	190,166,524
第13計算期間	479,744,662	383,926,075
第14計算期間	553,877,726	350,037,487
第15計算期間	649,247,886	545,147,386
第16計算期間	720,837,714	465,830,338
第17計算期間	748,382,900	570,133,617
第18計算期間	671,022,511	542,867,692
第19計算期間	829,372,301	568,524,688
第20計算期間	1,060,346,963	793,901,262
第21計算期間	925,573,626	669,909,997
第22中間計算期間末	405,219,155	299,501,535

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

## 参考情報



基準日:2022年1月31日

## ● 基準価額・純資産の推移 2012/01/31～2022/01/31

## ● ハッピーエイジング20



## ● ハッピーエイジング30



## ● ハッピーエイジング40



## ● ハッピーエイジング50



## ● 分配の推移

## ● ハッピーエイジング20

2017年07月	0円
2018年07月	0円
2019年07月	0円
2020年07月	0円
2021年07月	0円
設定来累計	0円

## ● ハッピーエイジング30

2017年07月	0円
2018年07月	0円
2019年07月	0円
2020年07月	0円
2021年07月	0円
設定来累計	0円

## ● ハッピーエイジング40

2017年07月	0円
2018年07月	0円
2019年07月	0円
2020年07月	0円
2021年07月	0円
設定来累計	0円

## ● ハッピーエイジング50

2017年07月	0円
2018年07月	0円
2019年07月	0円
2020年07月	0円
2021年07月	0円
設定来累計	0円

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

## ●ハッピーエイジング60



- 基準価額(税引前分配金再投資)は、税引前の分配金を再投資したものと計算しています。
- 基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

## ●ハッピーエイジング60

2017年07月	0円
2018年07月	0円
2019年07月	0円
2020年07月	0円
2021年07月	0円
設定来累計	0円

- 1万円当たり、税引前

## ● 主要な資産の状況

資産別構成	ハッピーエイジング		
	20	30	40
資産の種類	純資産比	純資産比	純資産比
SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	25.92%	22.03%	15.61%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	26.21%	22.29%	15.78%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	1.95%	7.85%	32.55%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	5.93%	19.86%	14.88%
損保ジャパンTCW外国株式マザーファンド	33.11%	21.18%	14.19%
ISHARES CORE MSCI EMERGING	4.49%	4.86%	4.90%
コール・ローン等	2.39%	1.94%	2.09%
合計	100.00%	100.00%	100.00%

資産別構成	ハッピーエイジング	
	50	60
資産の種類	純資産比	純資産比
SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	9.62%	4.06%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	9.73%	4.11%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	56.54%	71.71%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	10.98%	15.99%
損保ジャパンTCW外国株式マザーファンド	8.16%	2.05%
ISHARES CORE MSCI EMERGING	2.54%	—
コール・ローン等	2.44%	2.08%
合計	100.00%	100.00%

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

## ● SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド

## 組入上位5銘柄

	銘柄名	業種	純資産比
1	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7.1%
2	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	5.5%
3	日本電信電話	情報・通信業	4.5%
4	本田技研工業	輸送用機器	4.2%
5	第一生命ホールディングス	保険業	4.1%
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	シチズン時計	精密機器	3.8%
2	EIZO	電気機器	3.1%
3	日本テレビホールディングス	情報・通信業	3.0%
4	H.U.グループホールディングス	サービス業	2.9%
5	伊予銀行	銀行業	2.4%
組入銘柄数			105銘柄

## ● 損保ジャパン日本債券マザーファンド

## 組入上位5銘柄

	銘柄名	種類	償還日	純資産比
1	第145回利付国債(20年)	国債証券	2033/6/20	5.9%
2	第148回利付国債(5年)	国債証券	2026/6/20	4.8%
3	第426回利付国債(2年)	国債証券	2023/7/1	4.2%
4	第139回利付国債(5年)	国債証券	2024/3/20	3.4%
5	第421回利付国債(2年)	国債証券	2023/2/1	3.1%
組入銘柄数			100銘柄	

## ● 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

## 組入上位5銘柄

	銘柄名	発行国	種類	通貨	償還日	純資産比
1	Treasury 0.125 230228	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2023/02/28	12.1%
2	Treasury 2.25 270815	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2027/08/15	8.7%
3	Treasury 0.75 260331	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2026/03/31	5.3%
4	SPAIN 0.0 280131	スペイン	国債証券	ユーロ	2028/01/31	4.8%
5	ITALY 2.2 270601	イタリア	国債証券	ユーロ	2027/06/01	4.7%
組入銘柄数					130銘柄	

## ● 損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド

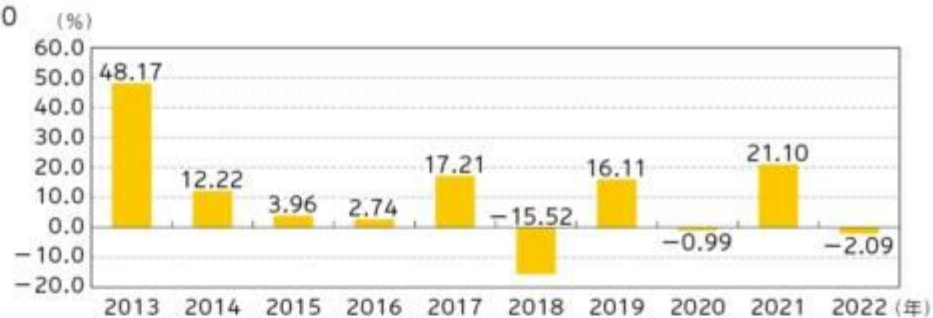
## 組入上位5銘柄

	銘柄名	通貨	発行国/地域	業種	純資産比
1	MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	3.5%
2	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	2.7%
3	IHS MARKIT LTD	アメリカ・ドル	アメリカ	資本財・サービス	2.4%
4	WASTE CONNECTIONS INC	アメリカ・ドル	アメリカ	資本財・サービス	2.0%
5	DANAHER CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	ヘルスケア	1.9%
組入銘柄数				227銘柄	

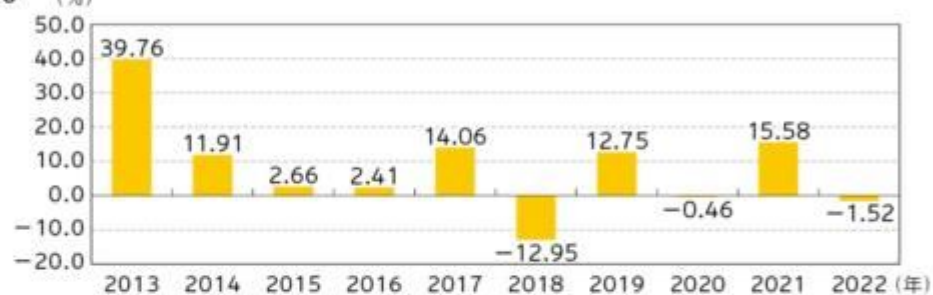
- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

## 年間収益率の推移（暦年ベース）

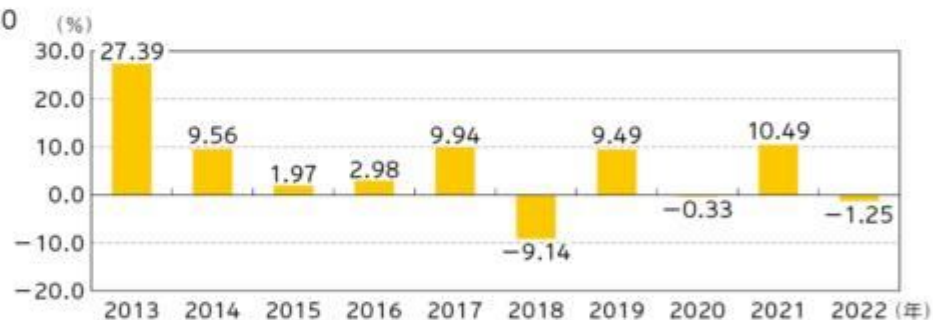
### ●ハッピーエイジング20 (%)



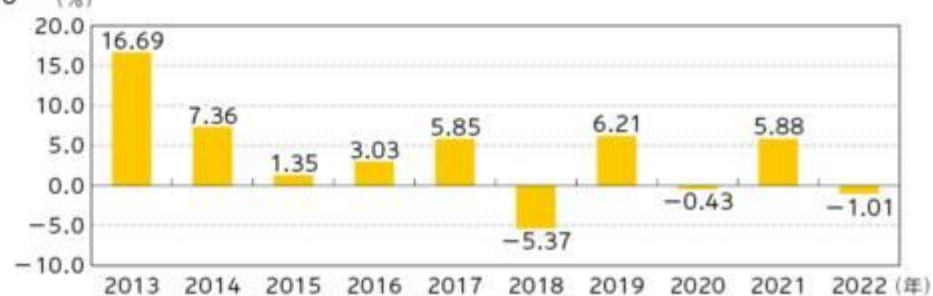
### ●ハッピーエイジング30 (%)



### ●ハッピーエイジング40 (%)

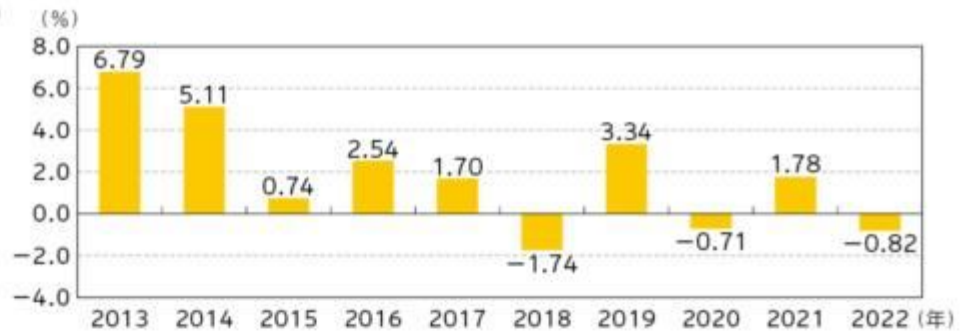


### ●ハッピーエイジング50 (%)



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

## ● ハッピーエイジング60



- ファンドの年間収益率は基準価額(税引前分配金再投資)を使用して計算しています。
- 2022年は年初から基準日までの収益率です。

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

## 第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、2021年7月16日から2022年1月15日までの中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【ハッピーエイジング20】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	434,330,329	390,038,171
投資信託受益証券	602,938,346	657,524,768
親投資信託受益証券	12,088,273,576	13,386,627,391
流動資産合計	13,125,542,251	14,434,190,330
<b>資産合計</b>		
	13,125,542,251	14,434,190,330
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	17,747,577	14,580,663
未払受託者報酬	3,391,469	3,788,236
未払委託者報酬	96,317,464	107,585,891
未払利息	987	854
その他未払費用	440,000	440,000
流動負債合計	117,897,497	126,395,644
<b>負債合計</b>		
	117,897,497	126,395,644
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	7,454,732,418	7,787,114,102
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	5,552,912,336	6,520,680,584
元本等合計	13,007,644,754	14,307,794,686
<b>純資産合計</b>		
	13,007,644,754	14,307,794,686
<b>負債純資産合計</b>		
	13,125,542,251	14,434,190,330

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	6,137,614	13,165,571
有価証券売買等損益	1,303,413,508	775,978,210
為替差損益	17,764,163	26,049,011
営業収益合計	1,291,786,959	815,192,792
<b>営業費用</b>		

	第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
支払利息	106,386	166,072
受託者報酬	2,960,635	3,788,236
委託者報酬	84,081,895	107,585,891
その他費用	494,841	494,357
営業費用合計	87,643,757	112,034,556
営業利益又は営業損失（ ）	1,204,143,202	703,158,236
経常利益又は経常損失（ ）	1,204,143,202	703,158,236
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,204,143,202	703,158,236
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（ ）	48,770,697	27,370,212
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,804,114,811	5,552,912,336
剰余金増加額又は欠損金減少額	306,793,355	725,069,554
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	306,793,355	725,069,554
剰余金減少額又は欠損金増加額	272,736,871	433,089,330
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	272,736,871	433,089,330
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,993,543,800	6,520,680,584

### （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。

（中間貸借対照表に関する注記）

期別	第21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
1. 受益権の総数	7,454,732,418口	7,787,114,102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 1.7449円 (1万口当たり純資産額) (17,449円)	1口当たり純資産額 1.8374円 (1万口当たり純資産額) (18,374円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左

## (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21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価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。



（その他の注記）

項目	第21期	第22期中間計算期間
	自 2020年7月16日 至 2021年7月15日	自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
期首元本額	7,385,031,420円	7,454,732,418円
期中追加設定元本額	1,531,705,313円	911,812,907円
期中一部解約元本額	1,462,004,315円	579,431,223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。

## 【ハッピーエイジング30】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	475,422,959	408,359,802
投資信託受益証券	747,408,352	823,621,883
親投資信託受益証券	14,436,230,351	15,444,903,713
流動資産合計	15,659,061,662	16,676,885,398
資産合計	15,659,061,662	16,676,885,398
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	8,542,122	17,863,903
未払受託者報酬	4,113,202	4,435,580
未払委託者報酬	106,943,208	115,324,987
未払利息	1,081	895
その他未払費用	440,000	440,000
流動負債合計	120,039,613	138,065,365
負債合計	120,039,613	138,065,365
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	9,065,064,951	9,286,823,127
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,473,957,098	7,251,996,906
元本等合計	15,539,022,049	16,538,820,033
純資産合計	15,539,022,049	16,538,820,033
負債純資産合計	15,659,061,662	16,676,885,398

## （2）【中間損益及び剰余金計算書】

	第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	7,737,120	16,491,323
有価証券売買等損益	1,279,393,610	685,258,254
為替差損益	23,202,911	30,417,577
<b>営業収益合計</b>	<b>1,263,927,819</b>	<b>732,167,154</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	121,626	180,358
受託者報酬	3,682,536	4,435,580
委託者報酬	95,745,777	115,324,987
その他費用	508,770	504,342
<b>営業費用合計</b>	<b>100,058,709</b>	<b>120,445,267</b>
営業利益又は営業損失（ ）	1,163,869,110	611,721,887
経常利益又は経常損失（ ）	1,163,869,110	611,721,887
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,163,869,110	611,721,887
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（ ）	30,753,262	17,051,182
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,849,695,058	6,473,957,098
剰余金増加額又は欠損金減少額	272,220,050	508,589,045
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	272,220,050	508,589,045
剰余金減少額又は欠損金増加額	241,960,249	325,219,942
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	241,960,249	325,219,942
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,013,070,707	7,251,996,906

### （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。

## （中間貸借対照表に関する注記）

期別	第21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
1. 受益権の総数	9,065,064,951口	9,286,823,127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 1.7142円 (1万口当たり純資産額) (17,142円)	1口当たり純資産額 1.7809円 (1万口当たり純資産額) (17,809円)

## （中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左

## （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21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

項目	第21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15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。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (その他の注記)

項目	第21期 自 2020年7月16日 至 2021年7月15日	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
期首元本額	8,968,181,534円	9,065,064,951円
期中追加設定元本額	1,265,453,871円	676,396,329円
期中一部解約元本額	1,168,570,454円	454,638,153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。

## 【ハッピーエイジング40】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	574,352,392	549,672,910
投資信託受益証券	976,826,722	1,057,985,833
親投資信託受益証券	18,604,523,501	19,425,163,703
流動資産合計	20,155,702,615	21,032,822,446
資産合計	20,155,702,615	21,032,822,446
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	33,664,539	20,111,517
未払受託者報酬	5,296,903	5,646,300
未払委託者報酬	121,828,712	129,864,968
未払利息	1,306	1,204
その他未払費用	440,000	440,000
流動負債合計	161,231,460	156,063,989
負債合計	161,231,460	156,063,989
純資産の部		

	第21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
元本等		
元本	12,172,844,263	12,422,012,022
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,821,626,892	8,454,746,435
元本等合計	19,994,471,155	20,876,758,457
純資産合計	19,994,471,155	20,876,758,457
負債純資産合計	20,155,702,615	21,032,822,446

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
営業収益		
受取配当金	10,220,798	21,183,974
有価証券売買等損益	1,252,531,613	546,878,082
為替差損益	31,224,530	37,426,493
営業収益合計	1,231,527,881	605,488,549
営業費用		
支払利息	163,628	235,469
受託者報酬	4,817,927	5,646,300
委託者報酬	110,812,146	129,864,968
その他費用	529,872	518,316
営業費用合計	116,323,573	136,265,053
営業利益又は営業損失（ ）	1,115,204,308	469,223,496
経常利益又は経常損失（ ）	1,115,204,308	469,223,496
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,115,204,308	469,223,496
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（ ）	22,567,086	15,081,677
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,146,461,860	7,821,626,892
剰余金増加額又は欠損金減少額	444,876,042	653,124,341
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	444,876,042	653,124,341
剰余金減少額又は欠損金増加額	309,930,067	474,146,617
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	309,930,067	474,146,617
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,374,045,057	8,454,746,435

## (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>
------------------------------	---

## (中間貸借対照表に関する注記)

期別	第21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
1. 受益権の総数	12,172,844,263口	12,422,012,022口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.6425円 (1万円当たり純資産額) (16,425円)	1.6806円 (1万円当たり純資産額) (16,806円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	損保ジャパン・TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左

## (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21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

項目	第21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
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。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (その他の注記)

項目	第21期	第22期中間計算期間
	自 2020年7月16日 至 2021年7月15日	自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
期首元本額	11,669,105,940円	12,172,844,263円
期中追加設定元本額	1,997,361,636円	986,365,900円
期中一部解約元本額	1,493,623,313円	737,198,141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。

## 【ハッピーエイジング50】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	243,354,122	217,095,646
投資信託受益証券	258,594,087	249,962,611
親投資信託受益証券	8,492,085,922	9,057,376,509

	第21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
流動資産合計	8,994,034,131	9,524,434,766
資産合計	8,994,034,131	9,524,434,766
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,779,919	6,103,842
未払受託者報酬	2,374,611	2,538,132
未払委託者報酬	46,542,295	49,747,259
未払利息	553	475
その他未払費用	440,000	440,000
流動負債合計	55,137,378	58,829,708
負債合計	55,137,378	58,829,708
純資産の部		
元本等		
元本	5,893,235,049	6,184,207,293
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,045,661,704	3,281,397,765
元本等合計	8,938,896,753	9,465,605,058
純資産合計	8,938,896,753	9,465,605,058
負債純資産合計	8,994,034,131	9,524,434,766

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
営業収益		
受取配当金	2,856,425	5,004,983
有価証券売買等損益	358,930,135	120,946,279
為替差損益	9,213,988	9,832,772
営業収益合計	352,572,572	135,784,034
営業費用		
支払利息	77,742	106,068
受託者報酬	2,231,364	2,538,132
委託者報酬	43,734,586	49,747,259
その他費用	469,518	462,338
営業費用合計	46,513,210	52,853,797
営業利益又は営業損失（ ）	306,059,362	82,930,237
経常利益又は経常損失（ ）	306,059,362	82,930,237
中間純利益又は中間純損失（ ）	306,059,362	82,930,237
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（ ）	7,332,014	2,928,858
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,233,648,796	3,045,661,704
剰余金増加額又は欠損金減少額	227,123,413	340,226,699
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	227,123,413	340,226,699
剰余金減少額又は欠損金増加額	150,015,850	184,492,017
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	150,015,850	184,492,017
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,609,483,707	3,281,397,765

## ( 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。

## (中間貸借対照表に関する注記)

期別	第21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
1. 受益権の総数	5,893,235,049口	6,184,207,293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 1.5168円 (1万口当たり純資産額) (15,168円)	1口当たり純資産額 1.5306円 (1万口当たり純資産額) (15,306円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	損保ジャパン・TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左

## (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21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価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。

## （その他の注記）

項目	第21期	第22期中間計算期間
	自 2020年7月16日 至 2021年7月15日	自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
期首元本額	5,557,795,224円	5,893,235,049円
期中追加設定元本額	1,148,879,543円	647,713,642円
期中一部解約元本額	813,439,718円	356,741,398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。

## 【ハッピーエイジング60】

## （1）【中間貸借対照表】

	第21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	134,420,732	137,145,538
親投資信託受益証券	5,238,994,791	5,364,930,863
流動資産合計	5,373,415,523	5,502,076,401
資産合計	5,373,415,523	5,502,076,401
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,476,824	2,975,622
未払受託者報酬	1,430,711	1,498,470
未払委託者報酬	23,177,380	24,275,135
未払利息	305	300
その他未払費用	386,233	404,528
流動負債合計	27,471,453	29,154,055
負債合計	27,471,453	29,154,055
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,999,382,011	4,105,099,631
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,346,562,059	1,367,822,715
元本等合計	5,345,944,070	5,472,922,346
純資産合計	5,345,944,070	5,472,922,346
負債純資産合計	5,373,415,523	5,502,076,401

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	76,040,260	11,746,072
営業収益合計	76,040,260	11,746,072
<b>営業費用</b>		
支払利息	51,231	57,904
受託者報酬	1,393,273	1,498,470
委託者報酬	22,570,901	24,275,135
その他費用	376,121	404,528
営業費用合計	24,391,526	26,236,037
営業利益又は営業損失( )	51,648,734	14,489,965
経常利益又は経常損失( )	51,648,734	14,489,965
中間純利益又は中間純損失( )	51,648,734	14,489,965
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( )	1,385,393	140,294
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,126,325,477	1,346,562,059
剰余金増加額又は欠損金減少額	143,279,643	136,745,168
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	143,279,643	136,745,168
剰余金減少額又は欠損金増加額	83,905,360	100,854,253
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	83,905,360	100,854,253
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,235,963,101	1,367,822,715

## (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	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. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

## (中間貸借対照表に関する注記)

期別	第21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
1. 受益権の総数	3,999,382,011口	4,105,099,631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) 1.3367円 (13,367円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3332円 (13,332円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第21期中間計算期間 自 2020年7月16日 至 2021年1月15日	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	損保ジャパン・TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左

## (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21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

項目	第21期 2021年7月15日現在	第22期中間計算期間末 2022年1月15日現在
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
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。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (その他の注記)

項目	第21期	第22期中間計算期間
	自 2020年7月16日 至 2021年7月15日	自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
期首元本額	3,743,718,382円	3,999,382,011円
期中追加設定元本額	925,573,626円	405,219,155円
期中一部解約元本額	669,909,997円	299,501,535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)

ハッピーエイジング・ファンド ハッピーエイジング20 / ハッピーエイジング30 / ハッピーエイジング40 / ハッピーエイジング50 / ハッピーエイジング60の主要投資対象の状況は以下のとおりです。

\*なお、以下は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

SJAMラージキャップ・バリュース・マザーファンド

貸借対照表

科 目	2021年7月15日現在	2022年1月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	362,693,747	323,872,913
株式	44,454,845,930	26,768,825,630
未収配当金	66,227,000	43,782,500
流動資産合計	44,883,766,677	27,136,481,043
資産合計	44,883,766,677	27,136,481,043
負債の部		
流動負債		
未払利息	824	709
流動負債合計	824	709
負債合計	824	709
純資産の部		
元本等		
元本	21,880,170,683	12,214,799,933
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	23,003,595,170	14,921,680,401
元本等合計	44,883,765,853	27,136,480,334
純資産合計	44,883,765,853	27,136,480,334
負債純資産合計	44,883,766,677	27,136,481,043

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

期別	2021年7月15日現在	2022年1月15日現在
1. 受益権の総数	21,880,170,683口	12,214,799,933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) 2.0513円 (20,513円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.2216円 (22,216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	2021年7月15日現在	2022年1月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価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。

## （その他の注記）

項目	自 2020年7月16日 至 2021年7月15日	自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	21,381,109,390円	21,880,170,683円
同期中追加設定元本額	7,429,456,200円	1,124,828,201円
同期中一部解約元本額	6,930,394,907円	10,790,198,951円
元本の内訳*		
損保ジャパン日本興亜ラージキャップ・バリュー・ファンド（F o F s 用）（適格機関投資家専用）	16,199,759,078円	6,368,631,169円
ラージキャップ・バリュー・オープン（適格機関投資家専用）	249,146,343円	- 円
ハッピーエイジング20	1,629,957,899円	1,778,267,358円
ハッピーエイジング30	1,630,759,652円	1,726,209,533円
ハッピーエイジング40	1,474,750,583円	1,542,092,685円
ハッピーエイジング50	402,363,827円	431,374,237円
ハッピーエイジング60	103,318,480円	99,378,506円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド2035	86,975,177円	130,076,576円

項目	自 2020年7月16日 至 2021年7月15日	自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	49,394,099円	70,606,966円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	40,384,394円	53,121,433円
SOMPO日本株バリュー・プラスファンド	13,361,151円	15,041,470円
計	21,880,170,683円	12,214,799,933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。

## SJAMスモールキャップ・マザーファンド

### 貸借対照表

科 目	2021年7月15日現在	2022年1月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	483,291,530	33,457,200
株式	10,805,880,300	12,486,799,000
未収配当金	12,296,900	20,071,300
流動資産合計	11,301,468,730	12,540,327,500
資産合計	11,301,468,730	12,540,327,500
負債の部		
流動負債		
未払利息	1,098	73
流動負債合計	1,098	73
負債合計	1,098	73
純資産の部		
元本等		
元本	4,378,241,610	4,646,313,459
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,923,226,022	7,894,013,968
元本等合計	11,301,467,632	12,540,327,427
純資産合計	11,301,467,632	12,540,327,427
負債純資産合計	11,301,468,730	12,540,327,500

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法 株式



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

## (貸借対照表に関する注記)

期別	2021年7月15日現在	2022年1月15日現在
1. 受益権の総数	4,378,241,610口	4,646,313,459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) 2.5813円 (25,813円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.6990円 (26,990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	2021年7月15日現在	2022年1月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<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。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（その他の注記）

項目	自 2020年7月16日 至 2021年7月15日	自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,180,721,532円	4,378,241,610円
同期中追加設定元本額	814,818,421円	470,849,984円
同期中一部解約元本額	617,298,343円	202,778,135円
元本の内訳*		
ハッピーエイジング20	1,305,507,928円	1,406,840,579円
ハッピーエイジング30	1,319,991,843円	1,371,664,392円
ハッピーエイジング40	1,193,721,057円	1,225,443,067円
ハッピーエイジング50	325,686,971円	341,324,223円
ハッピーエイジング60	81,906,549円	83,936,849円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	68,953,502円	105,730,857円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	39,365,980円	55,871,151円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	32,055,349円	43,212,069円
SOMPO日本株バリュー・プラスファンド	11,052,431円	12,290,272円
計	4,378,241,610円	4,646,313,459円

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

損保ジャパン日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2021年7月15日現在	2022年1月15日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	314,441,416	280,082,985
国債証券	16,386,654,900	16,744,786,600
地方債証券	1,021,231,000	1,012,807,000
特殊債証券	1,041,292,091	925,445,910
社債証券	4,864,509,000	5,241,758,000
未収入金	20,303,600	-
未収利息	29,551,557	29,420,438

科 目	2021年7月15日現在	2022年1月15日現在
	金額（円）	金額（円）
前払費用	3,666,750	561,835
流動資産合計	23,681,650,314	24,234,862,768
資産合計	23,681,650,314	24,234,862,768
負債の部		
流動負債		
未払金	100,000,000	-
未払利息	715	613
流動負債合計	100,000,715	613
負債合計	100,000,715	613
純資産の部		
元本等		
元本	16,154,207,306	16,735,068,369
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,427,442,293	7,499,793,786
元本等合計	23,581,649,599	24,234,862,155
純資産合計	23,581,649,599	24,234,862,155
負債純資産合計	23,681,650,314	24,234,862,768

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

期別	2021年7月15日現在	2022年1月15日現在
1．受益権の総数	16,154,207,306口	16,735,068,369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 1.4598円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,598円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.4481円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,481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	2021年7月15日現在	2022年1月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価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。

## （その他の注記）

項目	自 2020年7月16日 至 2021年7月15日	自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	12,082,014,010円	16,154,207,306円
同期中追加設定元本額	4,894,780,068円	1,901,545,339円
同期中一部解約元本額	822,586,772円	1,320,684,276円
元本の内訳*		
S N A M絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用）	356,726,351円	352,320,439円
S O M P Oターゲット・リターン戦略ファンド（2%コース）（F o F s用）（適格機関投資家専用）	35,350,602円	17,363,051円
S O M P Oターゲット・リターン戦略ファンド（4%コース）（F o F s用）（適格機関投資家専用）	87,345,920円	48,023,113円
損保ジャパン国内債券ファンド（適格機関投資家専用）	1,869,061,574円	1,394,026,178円
マルチアセット戦略ファンド（4%型）（非課税適格機関投資家専用）	63,256,326円	387,214,863円
損保ジャパン日本債券ファンド	1,051,324,459円	1,041,005,789円
ハッピーエイジング20	180,342,824円	196,343,822円
ハッピーエイジング30	862,119,920円	914,217,066円

項目	自 2020年7月16日 至 2021年7月15日	自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
ハッピーエイジング40	4,564,899,142円	4,714,758,172円
ハッピーエイジング50	3,510,183,074円	3,735,595,417円
ハッピーエイジング60	2,641,465,301円	2,720,631,943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	1,014,937円	1,055,992円
好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 円ヘッジなしコース	7,978,789円	8,253,771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	157,154,309円	139,813,796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	6,848,315円	6,731,266円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	404,668,975円	682,894,368円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	135,226,990円	208,498,438円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	43,668,027円	70,008,480円
ターゲット・リターン戦略ファンド	175,571,471円	96,312,405円
計	16,154,207,306円	16,735,068,369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	2021年7月15日現在 金額（円）	2022年1月15日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	583,574,687	38,405,408
コール・ローン	26,750,284	90,305,213
国債証券	9,756,162,588	10,257,480,525
派生商品評価勘定	-	1,263,442
未収入金	-	350,105,114
未収利息	41,024,610	44,653,751
前払費用	12,376,190	11,752,068
流動資産合計	10,419,888,359	10,793,965,521
資産合計	10,419,888,359	10,793,965,521
負債の部		
流動負債		

科 目	2021年7月15日現在	2022年1月15日現在
	金額（円）	金額（円）
派生商品評価勘定	-	1,516,365
未払金	535,092,220	353,132,420
未払利息	60	197
流動負債合計	535,092,280	354,648,982
負債合計	535,092,280	354,648,982
純資産の部		
元本等		
元本	5,665,562,447	5,945,922,212
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,219,233,632	4,493,394,327
元本等合計	9,884,796,079	10,439,316,539
純資産合計	9,884,796,079	10,439,316,539
負債純資産合計	10,419,888,359	10,793,965,521

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

期別	2021年7月15日現在	2022年1月15日現在
1. 受益権の総数	5,665,562,447口	5,945,922,212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) 1.7447円 (17,447円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7557円 (17,557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	2021年7月15日現在	2022年1月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。
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。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (その他の注記)

項目	自 2020年7月16日 至 2021年7月15日	自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,833,266,923円	5,665,562,447円
同期中追加設定元本額	1,003,753,320円	405,839,643円
同期中一部解約元本額	171,457,796円	125,479,878円
元本の内訳*		
SNAM絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用）	141,703,980円	138,707,452円

項目	自 2020年7月16日 至 2021年7月15日	自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
	ハッピーエイジング20	451,013,244円
ハッピーエイジング30	1,796,676,497円	1,874,269,696円
ハッピーエイジング40	1,729,702,003円	1,754,594,932円
ハッピーエイジング50	564,694,757円	591,204,473円
ハッピーエイジング60	489,142,222円	496,839,265円
損保ジャパン外国債券ファンド（為替ヘッジなし）	376,292,589円	399,240,076円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	92,950,086円	173,879,712円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	14,628,656円	21,886,143円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	8,758,413円	12,317,199円
計	5,665,562,447円	5,945,922,212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	2021年7月15日 現在			2022年1月15日 現在			
	契約額等 （円）	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	時価 （円）	評価損益 （円）	
							うち1年 超
市場取引以外の取引 為替予約取引							
買建	-	-	-	572,750,130	-	574,013,572	1,263,442
ユーロ	-	-	-	572,750,130	-	574,013,572	1,263,442
売建	-	-	-	529,072,815	-	530,589,180	1,516,365
ドル	-	-	-	529,072,815	-	530,589,180	1,516,365
合計	-	-	-	1,101,822,945	-	1,104,602,752	252,923

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。



上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド

### 貸借対照表

科 目	2021年7月15日現在	2022年1月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	192,216,483	283,424,120
コール・ローン	120,297,727	292,988,455
株式	15,296,276,437	15,362,813,832
投資証券	830,572,875	826,565,252
未収配当金	11,965,619	12,915,512
流動資産合計	16,451,329,141	16,778,707,171
資産合計	16,451,329,141	16,778,707,171
負債の部		
流動負債		
未払利息	273	642
流動負債合計	273	642
負債合計	273	642
純資産の部		
元本等		
元本	5,135,837,985	4,851,815,520
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	11,315,490,883	11,926,891,009
元本等合計	16,451,328,868	16,778,706,529
純資産合計	16,451,328,868	16,778,706,529
負債純資産合計	16,451,329,141	16,778,707,171

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>原則として取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券等の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。計算期間末日に当該取引所の最終相場がない場合には当該取引所における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>原則として取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券等の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。計算期間末日に当該取引所の最終相場がない場合には当該取引所における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p>
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	2021年7月15日現在		2022年1月15日現在	
1. 受益権の総数	5,135,837,985口		4,851,815,520口	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.2032円 (32,032円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.4582円 (34,582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	2021年7月15日現在	2022年1月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<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

項目	2021年7月15日現在	2022年1月15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。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（その他の注記）

項目	自 2020年7月16日 至 2021年7月15日	自 2021年7月16日 至 2022年1月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	5,793,095,817円	5,135,837,985円
同期中追加設定元本額	336,443,134円	259,167,430円
同期中一部解約元本額	993,700,966円	543,189,895円
元本の内訳*		
損保ジャパン - TCW外国株式ファンド A コース（為替ヘッジあり）	733,034,277円	799,945,649円
損保ジャパン - TCW外国株式ファンド B コース（為替ヘッジなし）	889,294,578円	749,680,745円
ハッピーエイジング20	1,350,114,281円	1,303,182,784円
ハッピーエイジング30	1,027,277,095円	952,316,634円
ハッピーエイジング40	879,234,708円	804,984,133円
ハッピーエイジング50	223,724,099円	211,181,543円
ハッピーエイジング60	33,158,947円	30,524,032円
計	5,135,837,985円	4,851,815,520円

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

ハッピーエイジング20

2022年1月31日現在

資産総額	14,029,249,175円
負債総額	20,658,465円
純資産総額（ - ）	14,008,590,710円
発行済数量	7,851,825,045口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.7841円

### ハッピーエイジング30

2022年1月31日現在

資産総額	16,231,729,105円
負債総額	26,638,997円
純資産総額（ - ）	16,205,090,108円
発行済数量	9,317,963,381口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.7391円

### ハッピーエイジング40

2022年1月31日現在

資産総額	20,642,652,179円
負債総額	18,631,570円
純資産総額（ - ）	20,624,020,609円
発行済数量	12,493,993,403口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.6507円

### ハッピーエイジング50

2022年1月31日現在

資産総額	9,410,548,417円
負債総額	11,362,129円
純資産総額（ - ）	9,399,186,288円
発行済数量	6,213,924,425口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.5126円

### ハッピーエイジング60

2022年1月31日現在

資産総額	5,476,290,170円
負債総額	6,167,104円
純資産総額（ - ）	5,470,123,066円
発行済数量	4,128,464,881口

1単位当りの純資産額（ / ）	1.3250円
-----------------	---------

## （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

2022年1月31日現在

資産総額	25,907,753,803円
負債総額	754円
純資産総額（ - ）	25,907,753,049円
発行済数量	11,986,085,030口
1単位当りの純資産額（ / ）	2.1615円

## （参考）S J A M スモールキャップ・マザーファンド

2022年1月31日現在

資産総額	12,283,321,064円
負債総額	457円
純資産総額（ - ）	12,283,320,607円
発行済数量	4,639,848,145口
1単位当りの純資産額（ / ）	2.6474円

## （参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2022年1月31日現在

資産総額	23,960,516,449円
負債総額	486円
純資産総額（ - ）	23,960,515,963円
発行済数量	16,588,901,721口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.4444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

2022年1月31日現在

資産総額	10,342,100,295円
負債総額	12円
純資産総額（ - ）	10,342,100,283円
発行済数量	5,936,216,506口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.7422円

## （参考）損保ジャパン - T C W 外国株式マザーファンド

2022年1月31日現在

資産総額	17,014,550,955円
負債総額	2,692円
純資産総額( - )	17,014,548,263円
発行済数量	5,141,036,635口
1単位当りの純資産額( / )	3.3096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（2021年7月末現在）  
（略）
- (2) 会社の機構（2021年7月末現在）  
（略）

<訂正後>

- (1) 資本金の額（2022年1月末現在）  
（略）
- (2) 会社の機構（2022年1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2022年1月末現在、計253本（追加型株式投資信託149本、単位型株式投資信託45本、単位型公社債投資信託59本）であり、その純資産総額の合計は1,804,661百万円です。

##### 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。

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

2. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2020年4月1日から2021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。

また、委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第37期中間会計期間（2021年4月

1日から2021年9月30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。

(1) 【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
<b>(資産の部)</b>					
流動資産					
1 現金・預金			5,030,360		2,945,148
2 前払費用			88,889		127,883
3 未収委託者報酬			1,062,114		1,163,524
4 未収運用受託報酬			958,520		698,718
5 未収収益			44		-
6 その他			1,347		108,949
流動資産合計			7,141,276		5,044,225
固定資産					
1 有形固定資産					
(1) 建物	1		19,412		16,555
(2) 器具備品	1		102,336		113,426
有形固定資産合計			121,748		129,982
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			378,390		371,688
(2) 長期差入保証金			161,598		173,961
(3) 繰延税金資産			402,032		368,045
(4) その他			32		32
投資その他の資産合計			942,053		913,728
固定資産合計			1,068,337		1,048,245
資産合計			8,209,613		6,092,470

区分	注記 番号	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
<b>(負債の部)</b>					
流動負債					
1 預り金			6,729		6,525
2 未払金					
(1) 未払配当金	2	3,000,000		640,000	
(2) 未払手数料		351,384		449,942	
(3) その他未払金		180,135	3,531,520	138,332	1,228,275
3 未払費用			973,410		725,437
4 未払消費税等			47,391		74,945
5 未払法人税等			152,972		259,089



6 賞与引当金			115,230		130,032
7 役員賞与引当金			5,400		6,300
流動負債合計			4,832,655		2,430,606
固定負債					
1 退職給付引当金			150,881		177,918
2 資産除去債務			8,475		9,111
固定負債合計			159,356		187,029
負債合計			4,992,011		2,617,636
(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			1,257,468		1,469,821
利益剰余金合計			1,257,468		1,469,821
株主資本合計			3,220,749		3,433,101
評価・換算差額等					
1 その他有価証券評価差額金			3,147		41,732
評価・換算差額等合計			3,147		41,732
純資産合計			3,217,602		3,474,834
負債・純資産合計			8,209,613		6,092,470

## (2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1 委託者報酬		4,761,002		5,130,232	
2 運用受託報酬		3,408,951	8,169,953	3,361,929	8,492,161
営業費用					
1 支払手数料		2,057,148		2,224,426	
2 広告宣伝費		16,106		14,138	
3 公告費		200		470	
4 調査費		2,381,706		2,203,386	
(1) 調査費		1,067,053		881,821	
(2) 委託調査費		1,311,310		1,318,730	
(3) 図書費		3,342		2,835	
5 営業雑経費		184,920		144,775	
(1) 通信費		6,023		13,988	
(2) 印刷費		163,235		114,745	
(3) 諸会費		15,660	4,640,082	16,041	4,587,196
一般管理費					
1 給料		1,567,354		1,581,885	

(1) 役員報酬		83,506		62,931	
(2) 給料・手当		1,286,043		1,326,451	
(3) 賞与		197,805		192,502	
2 福利厚生費		188,710		199,204	
3 交際費		13,169		4,247	
4 寄付金		300		300	
5 旅費交通費		45,892		2,820	
6 法人事業税		50,010		45,366	
7 租税公課		26,124		31,417	
8 不動産賃借料		211,714		211,971	
9 退職給付費用		67,288		76,373	
10 賞与引当金繰入		115,230		130,032	
11 役員賞与引当金繰入		5,400		6,300	
12 固定資産減価償却費		13,153		26,025	
13 諸経費		349,338	2,653,688	344,942	2,660,886
営業利益			876,182		1,244,078
営業外収益					
1 受取配当金		191		326	
2 受取利息		272		-	
3 有価証券売却益		-		3,436	
4 有価証券償還益		1,358		-	
5 為替差益		-		360	
6 保険配当金		448		567	
7 雑益		1,033	3,305	742	5,432
営業外費用					
1 有価証券売却損		2		-	
2 為替差損		2,620		-	
3 雑損		266	2,889	627	627
経常利益			876,598		1,248,883
特別損失					
1 固定資産除却損	1	409		0	
2 商号変更費用		13,256	13,666	4,975	4,975
税引前当期純利益			862,932		1,243,908
法人税・住民税及び事業税			309,915		375,986
法人税等調整額			29,339		15,569
当期純利益			582,355		852,352

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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	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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	1,257,468	1,257,468	3,220,749
当期変動額						
剰余金の配当				640,000	640,000	640,000
当期純利益				852,352	852,352	852,352
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	212,353	212,353	212,353
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	1,469,821	1,469,821	3,433,101

	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	3,147	3,147	3,217,602
当期変動額			
剰余金の配当			640,000
当期純利益			852,352

株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	44,879	44,879	44,879
当期変動額合計	44,879	44,879	257,232
当期末残高	41,732	41,732	3,474,834

## 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。

## (未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日 企業会計基準委員会）

### (1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を認識する。

ステップ2：契約における履行義務を認別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響はありません。

注記事項

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額は、次のとおりであります。

(単位：千円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
建物	91,036	95,327
器具備品	59,912	77,801

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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
未払金		
未払配当金	3,000,000	640,000

(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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
器具備品	409	0

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度 (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。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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
2021年3月30日 取締役会	普通株式	640,000千円	26,572円	-	2021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（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	-

当事業年度（2021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	2,945,148	2,945,148	-
(2) 未収委託者報酬	1,163,524	1,163,524	-
(3) 未収運用受託報酬	698,718	698,718	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	370,938	370,938	-
資産計	5,178,330	5,178,330	-
(1) 未払金	1,228,275	1,228,275	-
(2) 未払費用	725,437	725,437	-
負債計	1,953,712	1,953,712	-

## 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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021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 其他有価証券」には含めておりません。

## 注3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（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

当事業年度（2021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	2,945,017	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,163,524	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	698,718	-	-	-
(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	-	238,334	19,373	113,231
合計	4,807,260	238,334	19,373	113,231

## 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（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	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-



取得原価を超えるもの	(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

当事業年度（2021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	351,565	290,787	60,777
	小計	351,565	290,787	60,777
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	19,373	20,000	627
	小計	19,373	20,000	627
合計		370,938	310,787	60,150

## 5. 売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	93,436	3,436	-
合計	93,436	3,436	-

## （退職給付関係）

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

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

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

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

## 2. 簡便法を適用した確定給付制度

## （1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

	前事業年度 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）	当事業年度 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）
退職給付引当金の期首残高	134,243	150,881
退職給付費用	27,786	32,311

退職給付の支払額	11,148	5,274
退職給付引当金の期末残高	150,881	177,918

## (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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	150,881	177,918
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	150,881	177,918
退職給付引当金	150,881	177,918
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	150,881	177,918

## (3) 退職給付費用

(単位:千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	27,786	32,311

## 3. 確定拠出制度

(単位:千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当社の確定拠出制度への要拠出額	30,681	33,790

## (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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021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	301,391	263,558
退職給付引当金	46,199	54,478
賞与引当金	35,283	39,815
未払事業税	11,335	16,148
繰延資産損金算入限度超過額	4,021	8,210
未払金否認	4,762	5,163
その他	6,059	5,409
繰延税金資産 小計	409,054	392,785
将来減算一時差異等の合計に係る評価性引当額	3,648	2,886
評価性引当額 小計	3,648	2,886
繰延税金資産 合計	405,406	389,899
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	18,418
株式譲渡損益	3,031	3,031
固定資産除去価額	343	405
繰延税金負債 合計	3,374	21,854
繰延税金資産の純額	402,032	368,045

## 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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
法定実効税率 (調整)	30.6%	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。
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

本社事務所及び事業継続用事務所の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

## 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から15年と見積り、割引率は0.2%~1.8%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

## 3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
期首残高	8,327	8,475
取得	-	485
時の経過による調整額	147	151
期末残高	8,475	9,111

## (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 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。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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
7,335,140	473,576	379,864	256,439	47,139	8,492,161

(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 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	SOM PO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。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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D.C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)	519,262	未払手数料	134,523
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)	169,160	未収運用受託報酬	93,872

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

注2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

(注2) 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

SOMPOホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）

### (2) 重要な関連会社の要約財務情報

関連会社はありません。

### (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額(円)	133,593.60	144,273.79
1株当たり当期純利益金額(円)	24,179.19	35,389.35

(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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益(千円)	582,355	852,352
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)	582,355	852,352
期中平均株式数(株)	24,085	24,085

## 中間財務諸表

### (1) 中間貸借対照表

		第37期中間会計期間 (2021年9月30日)
区分	注記 番号	金額(千円)
(資産の部)		
流動資産		
1	現金・預金	2,314,887
2	前払費用	77,744
3	未収委託者報酬	1,286,149
4	未収運用受託報酬	979,839
5	立替金	108,798
流動資産合計		4,767,418
固定資産		
1	有形固定資産	113,911
2	無形固定資産	4,535
3	投資その他の資産	
	(1)投資有価証券	373,713
	(2)長期差入保証金	173,961
	(3)繰延税金資産	346,057
	(4)その他	32
投資その他の資産合計		893,765
固定資産合計		1,012,212
資産合計		5,779,630

		第37期中間会計期間 (2021年9月30日)
区分	注記 番号	金額(千円)
(負債の部)		
流動負債		
1	預り金	6,684
2	未払金	
	(1)未払手数料	463,385
	(2)その他未払金	326,082
未払金合計		789,467
3	未払費用	547,290
4	未払法人税等	67,785
5	賞与引当金	100,544
6	役員賞与引当金	2,550
7	その他	62,451
流動負債合計		1,576,774
固定負債		
1	退職給付引当金	192,894
2	資産除去債務	9,188
固定負債合計		202,083
負債合計		1,778,857
(純資産の部)		
株主資本		
1	資本金	1,550,000
2	資本剰余金	
	(1)資本準備金	413,280
資本剰余金合計		413,280
3	利益剰余金	
	(1)その他利益剰余金	
	繰越利益剰余金	1,994,355
利益剰余金合計		1,994,355
株主資本合計		3,957,635
評価・換算差額等		
1	その他有価証券評価差額金	43,137
評価・換算差額等合計		43,137
純資産合計		4,000,773
負債・純資産合計		5,779,630

## (2) 中間損益計算書

		第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
区分	注記 番号	金額(千円)	
営業収益			
1 委託者報酬		3,140,523	
2 運用受託報酬		1,753,064	4,893,588
営業費用			
1 支払手数料		1,343,597	
2 広告宣伝費		6,734	
3 公告費		200	
4 調査費		1,299,834	
(1) 調査費		504,954	
(2) 委託調査費		792,768	
(3) 図書費		2,111	
5 営業雑経費		72,668	
(1) 通信費		7,037	
(2) 印刷費		51,697	
(3) 諸会費		13,933	2,723,034
一般管理費			
1 給料		787,356	
(1) 役員報酬		33,075	
(2) 給料・手当		683,946	
(3) 賞与		70,334	
2 福利厚生費		103,891	
3 交際費		1,387	
4 旅費交通費		1,592	
5 法人事業税		24,587	
6 租税公課		4,974	
7 不動産賃借料		110,136	
8 退職給付費用		39,801	
9 賞与引当金繰入		101,550	
10 役員賞与引当金繰入		2,550	
11 固定資産減価償却費	1	18,503	
12 諸経費		214,346	1,410,678
営業利益			759,875
営業外収益			
1 受取配当金		481	
2 有価証券売却益		2,429	
3 雑益		626	3,536
営業外費用			
1 為替差損		84	
2 雑損		177	262
経常利益			763,149
特別損失			
1 固定資産除却損		0	0
税引前中間純利益			763,149
法人税、住民税及び事業税			217,247
法人税等調整額			21,368
中間純利益			524,533

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位:千円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本 準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		

当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	1,469,821	1,469,821	3,433,101
当中間期変動額						
中間純利益				524,533	524,533	524,533
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)						
当中間期変動 額合計	-	-	-	524,533	524,533	524,533
当中間期末残高	1,550,000	413,280	413,280	1,994,355	1,994,355	3,957,635

	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	41,732	41,732	3,474,834
当中間期変動額			
中間純利益			524,533
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)	1,405	1,405	1,405
当中間期変動 額合計	1,405	1,405	525,938
当中間期末残高	43,137	43,137	4,000,773

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

##### 市場価格のない株式等以外のもの

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

##### 市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### 有形固定資産

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	15年
器具備品	2～20年

### 3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 4. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

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

#### (2) 役員賞与引当金

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



## (3) 退職給付引当金

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

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

## 5. 収益及び費用の処理方法

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

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

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

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

## 6. 消費税等の会計処理方法

税抜方式を採用しております。

## 7. 連結納税制度の適用

当中間会計期間から連結納税制度を採用しております。

なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計に適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

## 会計方針の変更

## (収益認識に関する会計基準等の適用)

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。これによる、中間財務諸表に与える影響はありません。

## (時価の算定に関する会計基準等の適用)

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19号及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる、中間財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

	第37期中間会計期間 (2021年9月30日)
1 有形固定資産の減価償却累計額	189,538千円

2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。
------------	--

## (中間損益計算書関係)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
1 減価償却実施額 有形固定資産	18,503千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

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

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

## (金融商品関係)

第37期中間会計期間 (2021年9月30日)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

(単位:千円)

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 未収委託者報酬	1,286,149	1,286,149	-
(2) 未収運用受託報酬	979,839	979,839	-
(3) 投資有価証券(2)	372,963	372,963	-
資産計	2,638,952	2,638,952	-
(1) 未払金	789,467	789,467	-
(2) 未払費用	547,290	547,290	-
負債計	1,336,758	1,336,758	-

(1) 「現金・預金」については、現金であること、及び預金は短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(2) 市場価格のない株式等は、(3) 投資有価証券には含まれておりません。当該金融商品の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:千円)

区分	中間貸借対照表計上額
----	------------

非上場株式	750
-------	-----

## 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

### (1) 時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

第37期中間会計期間（2021年9月30日）

（単位：千円）

区分	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券（1）	-	-	-	-
資産計	-	-	-	-

（1）時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、投資有価証券のうち投資信託372,963千円は上記の表に含めておりません。

### (有価証券関係)

第37期中間会計期間（2021年9月30日）

#### 1. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

#### 2. 子会社株式及び関連会社株式

該当事項はありません。

#### 3. その他有価証券

（単位：千円）

	種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	293,160	230,787	62,372
	小計	293,160	230,787	62,372
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	79,803	80,000	197
	小計	79,803	80,000	197
合計		372,963	310,787	62,175

### (デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

### (ストック・オプション等関係)

該当事項はありません。

## （資産除去債務関係）

第37期中間会計期間（2021年9月30日）

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減	
期首残高	9,111千円
時の経過による調整額	77千円
中間期末残高	9,188千円

## （セグメント情報等）

## セグメント情報

第37期中間会計期間（自2021年4月1日至2021年9月30日）

当社は、投資運用事業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 関連情報

第37期中間会計期間（自2021年4月1日至2021年9月30日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## （1）営業収益

（単位：千円）

日本	欧州	北米	中東	アジア	合計
4,275,926	287,303	194,890	113,051	22,415	4,893,588

（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中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えているため、記載を省略しております。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

## （1株当たり情報）

	第37期中間会計期間 （自2021年4月1日 至2021年9月30日）
1株当たり純資産額	166,110.57円
1株当たり中間純利益金額	21,778.43円
	なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第37期中間会計期間 （自2021年4月1日 至2021年9月30日）
中間純利益	524,533千円
普通株主に帰属しない金額	-千円
普通株式に係る中間純利益	524,533千円
普通株式の期中平均株式数	24,085株

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

## 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】

&lt;訂正前&gt;

(略)

(2)販売会社

名称	資本金の額 <sup>1</sup> (単位：百万円)	事業の内容	
エース証券株式会社	8,831		
auカブコム証券株式会社	7,196		
SMB C日興証券株式会社	10,000		
株式会社SBI証券	48,323		
岡三にいがた証券株式会社	852		
静岡東海証券株式会社 2	600		
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000		
松井証券株式会社	11,945		
マネックス証券株式会社	12,200		
みずほ証券株式会社	125,167		
楽天証券株式会社	7,495		
株式会社イオン銀行 3	51,250		銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社新生銀行 3	512,204		
株式会社大東銀行 4	14,743		
株式会社みずほ銀行	1,404,065		
損害保険ジャパン株式会社	70,000	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。	

1 資本金の額は、2021年3月末現在

2 ハッピーエイジング30、40のみの取扱いとなります。

3 ハッピーエイジング20、30、40のみの取扱いとなります。

4 ハッピーエイジング40のみの取扱いとなります。

(略)

&lt;訂正後&gt;

(略)

(2)販売会社

名称	資本金の額 <sup>1</sup> (単位：百万円)	事業の内容
auカブコム証券株式会社	7,196	「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。
SMB C日興証券株式会社	10,000	
株式会社SBI証券	48,323	
岡三にいがた証券株式会社	852	
静岡東海証券株式会社 2	600	
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	
松井証券株式会社	11,945	

マネックス証券株式会社	12,200	
みずほ証券株式会社	125,167	
楽天証券株式会社	7,495	
株式会社イオン銀行 3	51,250	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社大東銀行 4	14,743	
株式会社みずほ銀行	1,404,065	
損害保険ジャパン株式会社	70,000	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

1 資本金の額は、2021年3月末現在

2 ハッピーエイジング30、40のみの取扱いとなります。

3 ハッピーエイジング20、30、40のみの取扱いとなります。

4 ハッピーエイジング40のみの取扱いとなります。

(略)

# 独立監査人の中間監査報告書

2022年3月15日

SOMPOアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 森 重 俊 寛  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志 保  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング20の2021年7月16日から2022年1月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング20の2022年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年7月16日から2022年1月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽

表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. 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

2022年3月15日

SOMPOアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 森 重 俊 寛  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志 保  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング30の2021年7月16日から2022年1月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング30の2022年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年7月16日から2022年1月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽

表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. 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

2022年3月15日

SOMPOアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 森 重 俊 寛  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志 保  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング40の2021年7月16日から2022年1月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング40の2022年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年7月16日から2022年1月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽

表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. 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

2022年3月15日

SOMPOアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 森 重 俊 寛  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志 保  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング50の2021年7月16日から2022年1月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング50の2022年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年7月16日から2022年1月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽

表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

2022年3月15日

SOMPOアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 森 重 俊 寛  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志 保  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング60の2021年7月16日から2022年1月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング60の2022年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年7月16日から2022年1月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽

表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBR L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)



# 独立監査人の監査報告書

2021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SOMPOアセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SOMPOアセットマネジメント株式会社の2021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。

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記は、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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2021年11月26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 伊藤 志保  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 弘幸  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているSOMPOアセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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アセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間財務諸表に対する経営者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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。