

## 【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】	2023年2月1日提出
【発行者名】	SOMPOアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 小嶋 信弘
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋二丁目2番16号
【事務連絡者氏名】	津田 浩平
【電話番号】	03-5290-3432
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	募集額 5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2022年3月2日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）につきまして、有価証券報告書の提出に伴い、訂正すべき事項がありましたので、これを訂正するものであります。

## 2【訂正の内容】

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

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

## 第一部【証券情報】

## (3)【発行(売出)価額の総額】

&lt;訂正前&gt;

当初自己設定 500万円を上限とします。継続申込期間 5,000億円を上限とします。

(略)

&lt;訂正後&gt;

5,000億円を上限とします。

(略)

## (4)【発行(売出)価格】

&lt;訂正前&gt;

当初自己設定 1口当たり1円とします。継続申込期間 取得申込受付日<sup>1</sup>の翌営業日の基準価額<sup>2</sup>とします。

(略)

&lt;訂正後&gt;

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

(略)

## (5)【申込手数料】

&lt;訂正前&gt;

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額(当初自己設定は1口当たり1円)に、2.2%(税抜2.0%)を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額です。

(略)

&lt;訂正後&gt;

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.2%(税抜2.0%)を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額です。

(略)

## (7)【申込期間】

&lt;訂正前&gt;

当初自己設定 2022年3月18日継続申込期間 2022年3月18日から2023年2月16日までです。

(略)

<訂正後>

継続申込期間 2022年3月18日から2023年2月16日までです。

(略)

(9)【払込期日】

<訂正前>

当初自己設定

委託会社は、設定日（2022年3月18日）に、当初自己設定に係る発行価額の総額を、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込みます。

継続申込期間

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

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

<訂正後>

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

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

## 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】

##### (2)【ファンドの沿革】

<訂正前>

2022年3月18日 信託契約締結、設定、運用開始（予定）

<訂正後>

2022年3月18日 信託契約締結、設定、運用開始

##### (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12月末現在)

(略)

( )大株主の状況 (2021年12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11月末現在)

(略)

( )大株主の状況 (2022年11月末現在)

(略)

#### 2【投資方針】

##### (3)【運用体制】

<訂正前>

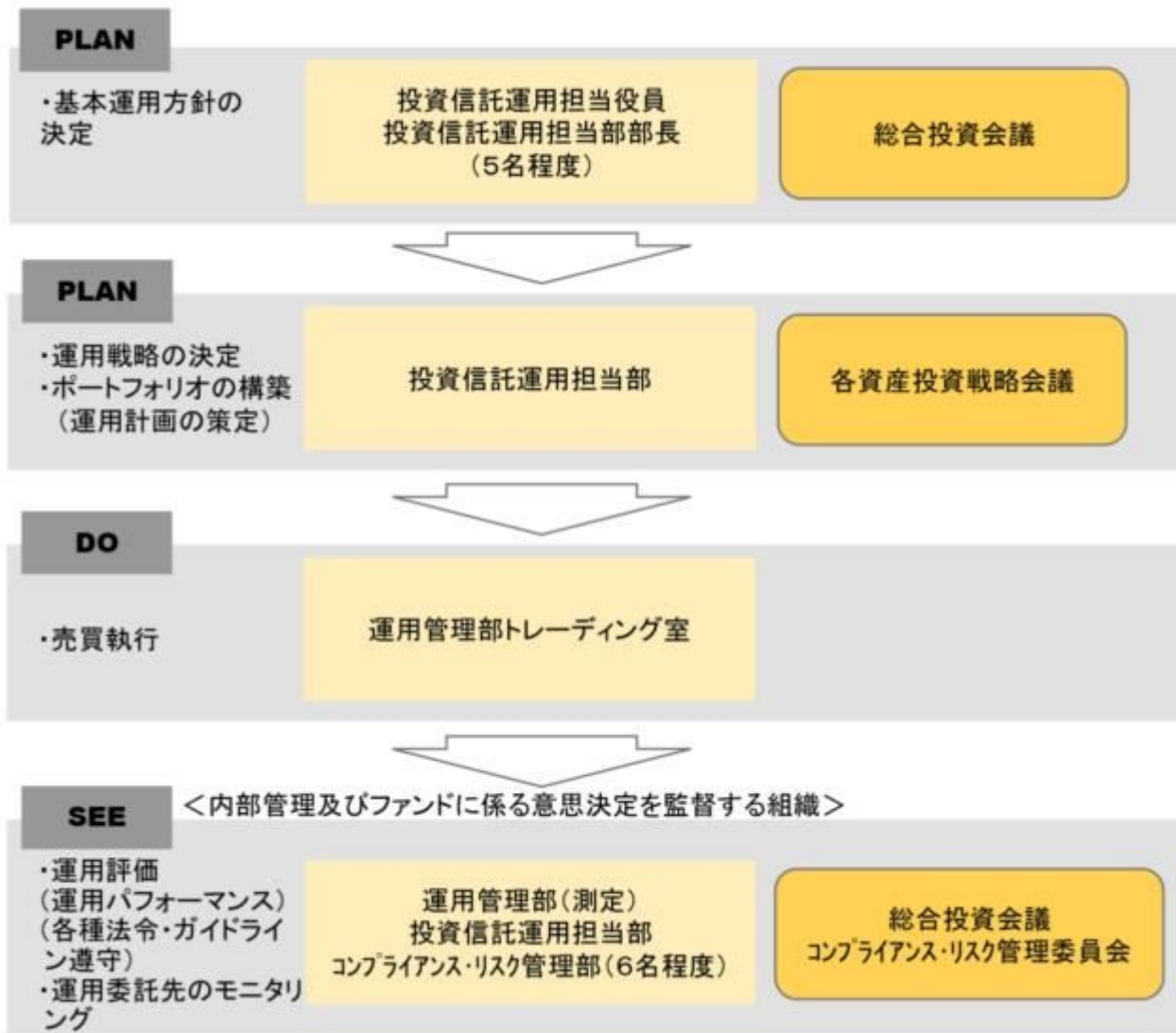
a. 委託会社の運用体制と社内規程

(運用体制)

(略)

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

(略)



2021年12月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

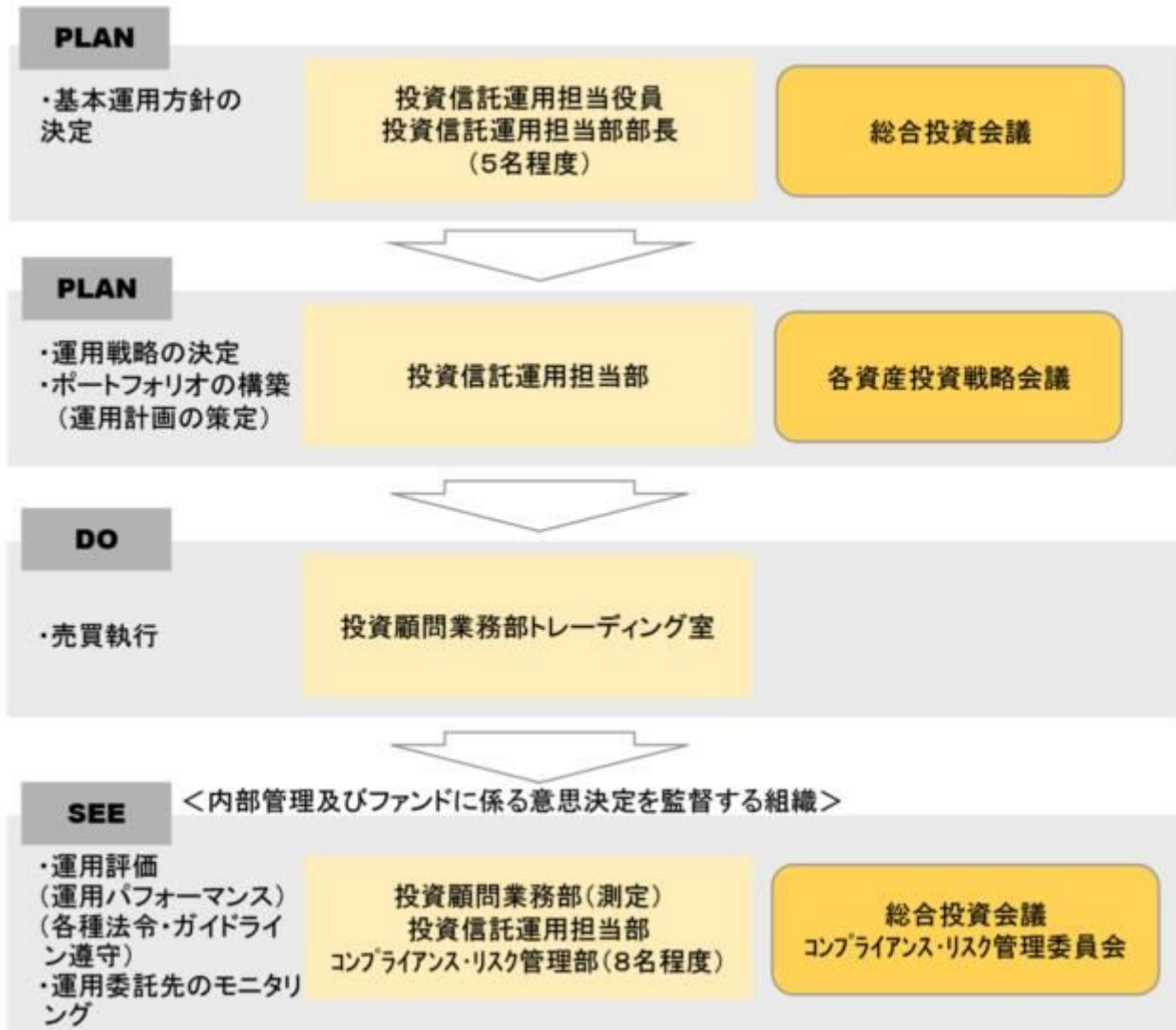
<訂正後>

- a. 委託会社の運用体制と社内規程  
(運用体制)

(略)

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

(略)



2022年11月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

<訂正前>

b. 運用委託先の運用体制等

(略)

2021年11月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

<訂正後>

b. 運用委託先の運用体制等

(略)

2022年11月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

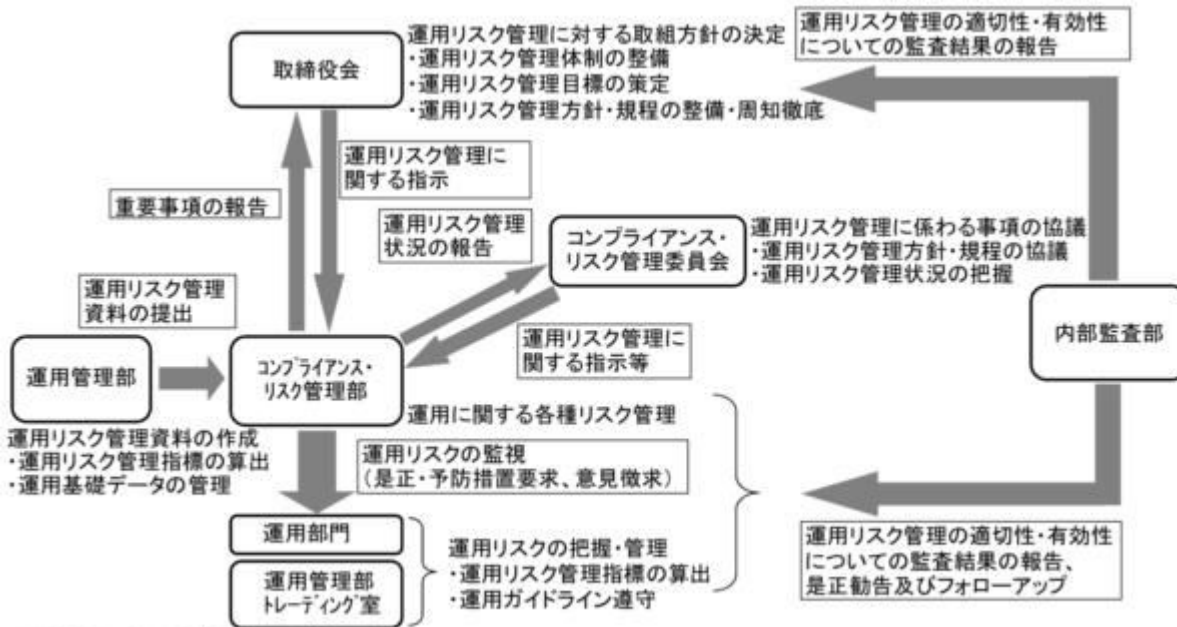
### 3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

<リスクの管理体制>

a. 委託会社のリスク管理体制



※運用リスクには流動性リスクを含みます。

(注) 上図は、2021年12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

当ファンドは、2022年3月18日から運用を開始する予定であり、記載すべき該当事項はありません。

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較



ファンド : 2022年3月18日から運用を開始する予定であり、記載すべき該当事項はありません。  
代表的な資産クラス: 2017年1月～2021年12月

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

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

#### 代表的な資産クラスの指数

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

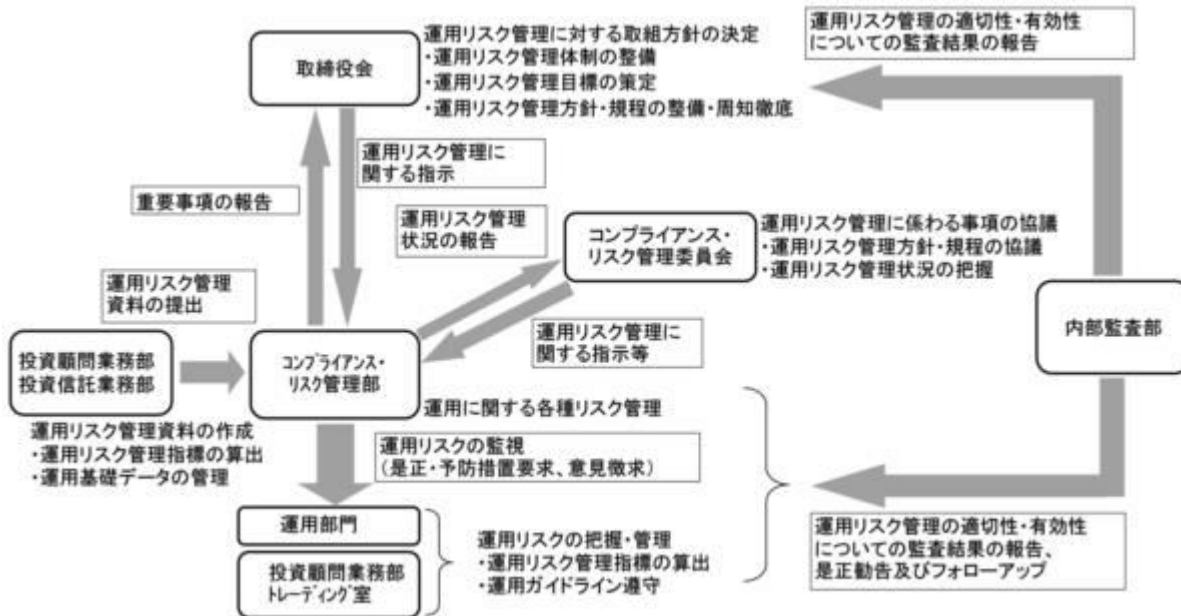
(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

< 訂正後 >

(略)

< リスクの管理体制 >

a . 委託会社のリスク管理体制



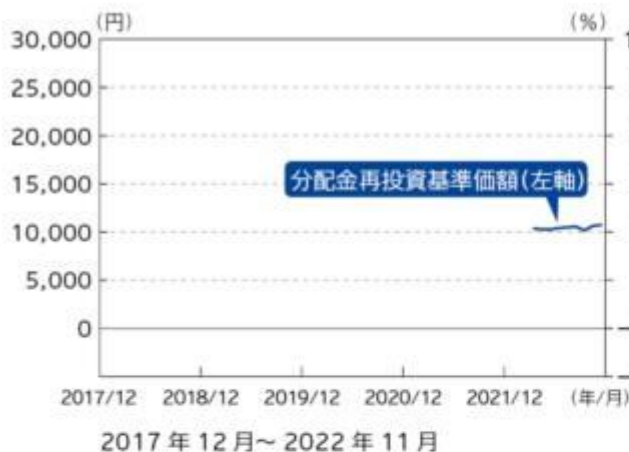
※運用リスクには流動性リスクを含みます。

(注) 上図は、2022年11月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

(略)

### ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移

※データは、設定日より掲載しています。



### ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較



- 資料作成時において、ファンドの運用期間が1年未満のため、ファンドの年間騰落率を記載しておりません。
- 上記は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額および年間騰落率が記載されており、実際の基準価額および基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

- 上記は、期間5年の各月末におけるグラフになります。
- 「ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較」は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

#### 代表的な資産クラスの指数

日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

日本の株式市場を広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、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社J P X 総研又は株式会社J P X 総研の関連会社に帰属します。

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

MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に円換算しています。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE 世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

日本国債:NOMURA-BPI 国債

野村フィデューシャリー・リサーチ & コンサルティング株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村フィデューシャリー・リサーチ & コンサルティング株式会社に帰属します。

新興国債:J P モルガン G B I - E M グローバル・ディバースファイド(円ベース)

J.P. Morgan Securities LLCが算出、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・ディバースファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

< 訂正前 >

< 申込み時に受益者が負担する費用・税金 >

時期	項目	費用・税金
申込み時	申込手数料および消費税等相当額	<p>申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額（当初自己設定は1口当たり1円）に2.2%（税抜2.0%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。</p> <p>申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。</p>
		販売会社によるファンドの商品説明・投資環境の説明・事務処理等の対価

(略)

&lt;訂正後&gt;

&lt;申込み時に受益者が負担する費用・税金&gt;

時期	項目	費用・税金	
申込み時	申込手数料および消費税等相当額	申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に2.2%（税抜 2.0%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。 申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。	販売会社によるファンドの商品説明・投資環境の説明・事務処理等の対価

(略)

## (5) 【課税上の取扱い】

&lt;訂正前&gt;

(略)

上記は2021年12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。

&lt;訂正後&gt;

(略)

上記は2022年11月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065

2022年11月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	アメリカ	9,139,556	18.30
親投資信託受益証券	日本	40,329,376	80.75
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		475,931	0.95
純資産総額		49,944,863	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

その他資産の投資状況

2022年11月30日現在

資産の種類	建別	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		295,782	0.59

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

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

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

(参考) 損保ジャパン日本債券マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	18,979,179,600	76.49
地方債証券	日本	994,493,000	4.01
特殊債券	日本	859,374,643	3.46
社債券	日本	3,250,058,000	13.10
	フランス	100,284,000	0.40
	イギリス	98,475,000	0.40
		3,448,817,000	13.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		530,931,978	2.14
純資産総額		24,812,796,221	100.00

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

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

(参考) S J A M ラージキャップ・バリュース・マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	37,886,425,530	98.27
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		666,493,617	1.73
純資産総額		38,552,919,147	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11月30日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	13,224,176,700	98.57
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		192,034,179	1.43
純資産総額		13,416,210,879	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11月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	5,578,858,067	49.40
	フランス	915,760,215	8.11
	イタリア	820,710,749	7.27
	ドイツ	716,709,200	6.35
	スペイン	562,476,407	4.98
	イギリス	520,841,696	4.61
	中国	327,010,349	2.90
	カナダ	226,440,128	2.00
	ベルギー	216,618,412	1.92
	オランダ	176,038,385	1.56
	オーストラリア	171,445,741	1.52
	オーストリア	114,393,287	1.01
	メキシコ	90,106,550	0.80
	アイルランド	69,802,192	0.62
	マレーシア	58,433,859	0.52
	フィンランド	45,138,932	0.40
	ポーランド	44,554,121	0.39
	シンガポール	39,918,883	0.35
	デンマーク	36,481,295	0.32
	スウェーデン	27,695,075	0.25
ノルウェー	23,237,102	0.21	
		10,782,670,645	95.47
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		511,252,690	4.53
純資産総額		11,293,923,335	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）SOMPO外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	845,884,353	65.67
	ドイツ	69,803,843	5.42
	アイルランド	56,670,125	4.40
	イギリス	45,065,526	3.50
	フランス	44,464,658	3.45

	デンマーク	40,302,341	3.13
	スイス	20,767,334	1.61
	オーストラリア	15,793,592	1.23
	スウェーデン	15,286,970	1.19
	シンガポール	14,781,848	1.15
	カナダ	12,523,998	0.97
	ノルウェー	12,392,706	0.96
	スペイン	8,071,999	0.63
	オランダ	7,727,612	0.60
	バミューダ	6,008,072	0.47
	ベルギー	3,163,125	0.25
		1,218,708,102	94.61
投資証券	アメリカ	19,548,452	1.52
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		49,915,485	3.87
純資産総額		1,288,172,039	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 N A M コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	メキシコ	268,019,056	17.13
	ブラジル	229,218,665	14.65
	インドネシア	205,706,165	13.14
	南アフリカ	189,034,236	12.08
	マレーシア	183,238,454	11.71
	コロンビア	144,294,574	9.22
	ポーランド	99,623,650	6.37
	ペルー	55,233,257	3.53
	ハンガリー	44,743,956	2.86
	チリ	38,290,328	2.45
	タイ	10,521,738	0.67
			1,467,924,079
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		97,096,117	6.20
純資産総額		1,565,020,196	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

その他資産の投資状況

2022年11月30日現在

資産の種類	建別	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		872,719,115	55.76
	売建		866,889,226	55.39

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

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

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

2022年11月30日現在

資産の種類	建別	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
直物為替先渡取引	買建		186,896,774	11.94
	売建		238,756,369	15.26

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

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

(注3) 直物為替先渡取引の時価は、原則として、価格提供会社の提供する価額で評価しています。

## (2) 【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065

2022年11月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	SOMPO外国株式アクティブバリュウ(リスク抑制型)マザーファンド	8,745,633	2.0857	18,241,539	2.0718	18,119,202	36.28
2	アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	1,392	6,001.63	8,354,275	6,565.77	9,139,556	18.30
3	日本	親投資信託受益証券	SJAMラージキャップ・バリュウ・マザーファンド	3,517,595	2.3937	8,420,068	2.4626	8,662,429	17.34
4	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	2,868,336	2.9185	8,371,239	3.0028	8,613,039	17.25
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	1,872,496	1.3980	2,617,828	1.3947	2,611,570	5.23
6	日本	親投資信託受益証券	損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	827,477	1.8185	1,504,814	1.7790	1,472,081	2.95
7	日本	親投資信託受益証券	SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド	600,265	1.4126	847,964	1.4178	851,055	1.70

(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11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	18.30



親投資信託受益証券	80.75
合計	99.05

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2022年11月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率(%)	償還日	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第441回利付国債(2年)	1,350,000,000	100.11	1,351,512,000	100.08	1,351,107,000	0.0050000	2024/10/1	5.45
2	日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	1,240,000,000	109.70	1,360,304,400	107.00	1,326,874,400	1.2000000	2035/9/20	5.35
3	日本	国債証券	第152回利付国債(5年)	1,000,000,000	100.48	1,004,840,000	100.12	1,001,280,000	0.1000000	2027/3/20	4.04
4	日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	870,000,000	100.14	871,268,000	100.13	871,191,900	0.2000000	2032/3/20	3.51
5	日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	800,000,000	100.04	800,352,000	99.81	798,544,000	0.0050000	2026/12/20	3.22
6	日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	700,000,000	100.44	703,101,000	100.12	700,896,000	0.1000000	2027/3/20	2.82
7	日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	640,000,000	100.18	641,152,000	100.00	640,000,000	0.0050000	2026/3/20	2.58
8	日本	国債証券	第159回利付国債(20年)	640,000,000	100.66	644,275,200	98.15	628,192,000	0.6000000	2036/12/20	2.53
9	日本	国債証券	第174回利付国債(20年)	700,000,000	93.20	652,463,000	89.71	627,984,000	0.4000000	2040/9/20	2.53
10	日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	610,000,000	100.29	611,769,000	100.20	611,262,700	0.1000000	2024/3/20	2.46
11	日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	600,000,000	100.48	602,892,000	100.29	601,758,000	0.1000000	2025/6/20	2.43
12	日本	国債証券	第43回利付国債(30年)	540,000,000	114.01	615,681,400	109.40	590,781,600	1.7000000	2044/6/20	2.38
13	日本	国債証券	第439回利付国債(2年)	550,000,000	100.14	550,793,000	100.07	550,412,500	0.0050000	2024/8/1	2.22
14	日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	370,000,000	114.86	424,982,000	113.21	418,902,900	1.7000000	2033/6/20	1.69
15	日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	410,000,000	99.78	409,123,100	99.61	408,417,400	0.0050000	2027/6/20	1.65
16	日本	国債証券	第143回利付国債(5年)	400,000,000	100.45	401,800,000	100.26	401,056,000	0.1000000	2025/3/20	1.62
17	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	100.02	400,092,000	99.92	399,688,000	0.0010000	2024/8/28	1.61

18	日本	国債証券	第357回利付国債（10年）	400,000,000	99.45	397,800,000	99.20	396,804,000	0.1000000	2029/12/20	1.60
19	日本	地方債証券	第807回東京都公募公債	400,000,000	98.52	394,108,000	97.69	390,764,000	0.1000000	2030/6/20	1.57
20	日本	国債証券	第151回利付国債（20年）	360,000,000	109.40	393,847,200	107.34	386,445,600	1.2000000	2034/12/20	1.56
21	日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	390,000,000	99.94	389,766,000	98.62	384,621,900	0.1000000	2030/12/20	1.55
22	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	106.08	318,255,000	104.87	314,610,000	1.1760000	2029/1/26	1.27
23	日本	国債証券	第148回利付国債（20年）	280,000,000	112.89	316,097,600	111.05	310,940,000	1.5000000	2034/3/20	1.25
24	日本	地方債証券	第135回共同発行市場公募地方債	300,000,000	101.22	303,672,000	100.90	302,718,000	0.6590000	2024/6/25	1.22
25	日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	300,000,000	100.19	300,591,000	99.84	299,526,000	0.1000000	2028/3/20	1.21
26	日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	300,000,000	98.91	296,748,000	98.73	296,214,000	0.1000000	2030/9/20	1.19
27	日本	国債証券	第179回利付国債（20年）	300,000,000	92.29	276,870,000	89.91	269,736,000	0.5000000	2041/12/20	1.09
28	日本	国債証券	第58回利付国債（30年）	300,000,000	93.06	279,189,000	88.05	264,150,000	0.8000000	2048/3/20	1.06
29	日本	国債証券	第67回利付国債（30年）	300,000,000	85.00	255,014,000	80.80	242,403,000	0.6000000	2050/6/20	0.98
30	日本	国債証券	第148回利付国債（5年）	220,000,000	100.15	220,345,400	99.96	219,920,800	0.0050000	2026/6/20	0.89

（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11月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	76.49
地方債証券	4.01
特殊債券	3.46
社債券	13.90
合計	97.86

（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・バリュアー・マザーファンド

2022年11月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	3,582,700	734.71	2,632,247,598	755.10	2,705,296,770	7.02
2	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	512,600	4,196.16	2,150,952,440	4,673.00	2,395,379,800	6.21
3	日本	株式	キリンホールディングス	食料品	1,013,300	2,036.81	2,063,908,748	2,165.00	2,193,794,500	5.69
4	日本	株式	三井住友トラスト・ホールディングス	銀行業	396,100	4,128.16	1,635,165,767	4,407.00	1,745,612,700	4.53
5	日本	株式	東レ	繊維製品	2,234,600	675.70	1,509,923,059	738.60	1,650,475,560	4.28
6	日本	株式	東京瓦斯	電気・ガス業	607,800	2,387.32	1,451,013,340	2,526.00	1,535,302,800	3.98
7	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	436,000	3,531.66	1,539,805,406	3,356.00	1,463,216,000	3.80
8	日本	株式	日本精工	機械	1,915,000	743.48	1,423,779,158	760.00	1,455,400,000	3.78
9	日本	株式	鹿島建設	建設業	891,600	1,527.43	1,361,859,557	1,550.00	1,381,980,000	3.58
10	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	339,000	3,649.00	1,237,013,568	4,050.00	1,372,950,000	3.56
11	日本	株式	マキタ	機械	409,300	3,128.96	1,280,685,091	3,130.00	1,281,109,000	3.32
12	日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	468,500	2,537.44	1,188,791,244	2,543.50	1,191,629,750	3.09
13	日本	株式	日揮ホールディングス	建設業	600,200	1,305.51	783,567,102	1,893.00	1,136,178,600	2.95
14	日本	株式	スタンレー電気	電気機器	402,300	2,467.29	992,591,397	2,793.00	1,123,623,900	2.91
15	日本	株式	T H K	機械	383,800	2,660.03	1,020,920,973	2,669.00	1,024,362,200	2.66
16	日本	株式	日本製鉄	鉄鋼	434,900	2,030.07	882,878,443	2,192.50	953,518,250	2.47
17	日本	株式	王子ホールディングス	パルプ・紙	1,802,000	576.31	1,038,528,001	528.00	951,456,000	2.47
18	日本	株式	住友重機械工業	機械	311,400	2,809.38	874,841,130	2,912.00	906,796,800	2.35
19	日本	株式	ヤマトホールディングス	陸運業	384,400	2,194.70	843,644,138	2,293.00	881,429,200	2.29
20	日本	株式	総合警備保障	サービス業	235,400	3,704.53	872,046,378	3,725.00	876,865,000	2.27
21	日本	株式	三菱地所	不動産業	435,400	1,852.09	806,402,645	1,940.00	844,676,000	2.19
22	日本	株式	スズケン	卸売業	224,100	3,679.67	824,614,554	3,695.00	828,049,500	2.15
23	日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	501,600	1,542.75	773,846,029	1,600.50	802,810,800	2.08
24	日本	株式	コンコルディア・フィナンシャルグループ	銀行業	1,657,600	466.41	773,132,480	477.00	790,675,200	2.05
25	日本	株式	クレディセゾン	その他金融業	430,200	1,435.54	617,572,357	1,757.00	755,861,400	1.96
26	日本	株式	アルプスアルパイン	電気機器	516,700	1,238.07	639,713,287	1,302.00	672,743,400	1.74
27	日本	株式	サワイグループホールディングス	医薬品	145,700	4,373.29	637,189,506	4,240.00	617,768,000	1.60
28	日本	株式	アイシン	輸送用機器	154,400	4,172.17	644,183,896	3,765.00	581,316,000	1.51
29	日本	株式	日本テレビホールディングス	情報・通信業	537,400	1,294.06	695,427,986	1,059.00	569,106,600	1.48
30	日本	株式	S U B A R U	輸送用機器	230,100	2,102.58	483,805,675	2,351.50	541,080,150	1.40

(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11月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	7.76
		食料品	6.71
		繊維製品	4.28
		パルプ・紙	2.47
		化学	1.35
		医薬品	5.16
		鉄鋼	3.85
		非鉄金属	2.08
		機械	12.11
		電気機器	4.66
		輸送用機器	6.71
		電気・ガス業	3.98
		陸運業	2.29
		情報・通信業	1.48
		卸売業	2.15
		銀行業	19.81
		保険業	4.43
		その他金融業	1.96
		不動産業	2.77
サービス業	2.27		
合計			98.27

(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

2022年11月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	シチズン時計	精密機器	846,200	602.42	509,767,804	600.00	507,720,000	3.78
2	日本	株式	めぶきフィナンシャルグループ	銀行業	1,402,200	265.31	372,017,682	312.00	437,486,400	3.26
3	日本	株式	八十二銀行	銀行業	813,100	473.27	384,815,837	519.00	421,998,900	3.15
4	日本	株式	森永乳業	食料品	94,600	4,023.31	380,605,126	4,445.00	420,497,000	3.13
5	日本	株式	クレディセゾン	その他金融業	231,700	1,718.29	398,127,793	1,757.00	407,096,900	3.03
6	日本	株式	いよぎんホールディングス	銀行業	515,100	631.42	325,244,442	729.00	375,507,900	2.80
7	日本	株式	エン・ジャパン	サービス業	151,900	2,355.97	357,871,843	2,448.00	371,851,200	2.77
8	日本	株式	E I Z O	電気機器	101,600	3,780.84	384,133,344	3,595.00	365,252,000	2.72
9	日本	株式	日本テレビホールディングス	情報・通信業	304,700	1,168.29	355,977,963	1,059.00	322,677,300	2.41
10	日本	株式	群馬銀行	銀行業	662,100	383.29	253,776,309	451.00	298,607,100	2.23
11	日本	株式	東邦ホールディングス	卸売業	139,200	1,841.92	256,395,264	2,130.00	296,496,000	2.21
12	日本	株式	ジェイテクト	機械	292,100	1,002.38	292,795,198	1,010.00	295,021,000	2.20

13	日本	株式	ほくほくフィナンシャルグループ	銀行業	297,000	815.23	242,123,310	929.00	275,913,000	2.06
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	315,500	729.97	230,305,535	874.00	275,747,000	2.06
15	日本	株式	豊田合成	輸送用機器	120,700	2,361.92	285,083,744	2,282.00	275,437,400	2.05
16	日本	株式	マブチモーター	電気機器	66,200	3,927.61	260,007,782	4,130.00	273,406,000	2.04
17	日本	株式	第四北越フィナンシャルグループ	銀行業	102,200	2,588.04	264,497,688	2,618.00	267,559,600	1.99
18	日本	株式	トラスコ中山	卸売業	124,600	1,938.02	241,477,292	2,087.00	260,040,200	1.94
19	日本	株式	日本ライフライン	卸売業	272,600	984.58	268,396,508	947.00	258,152,200	1.92
20	日本	株式	セイノーホールディングス	陸運業	214,200	1,115.40	238,918,680	1,204.00	257,896,800	1.92
21	日本	株式	フコールホールディングス	繊維製品	108,300	2,218.66	240,280,878	2,329.00	252,230,700	1.88
22	日本	株式	北洋銀行	銀行業	999,000	223.45	223,226,550	245.00	244,755,000	1.82
23	日本	株式	東亜合成	化学	195,400	1,087.21	212,440,834	1,177.00	229,985,800	1.71
24	日本	株式	青山商事	小売業	184,000	940.90	173,125,600	999.00	183,816,000	1.37
25	日本	株式	住友精化	化学	42,800	3,126.60	133,818,480	4,240.00	181,472,000	1.35
26	日本	株式	キョーリン製薬ホールディングス	医薬品	94,400	1,763.31	166,456,464	1,770.00	167,088,000	1.25
27	日本	株式	東洋インキS Cホールディングス	化学	86,400	1,888.46	163,162,944	1,880.00	162,432,000	1.21
28	日本	株式	ソラスト	サービス業	197,200	861.06	169,801,032	821.00	161,901,200	1.21
29	日本	株式	コメリ	小売業	60,300	2,578.47	155,481,741	2,590.00	156,177,000	1.16
30	日本	株式	七十七銀行	銀行業	79,800	1,748.25	139,510,350	1,948.00	155,450,400	1.16

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別及び業種別投資比率

2022年11月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	1.49
		食料品	3.13
		繊維製品	2.23
		パルプ・紙	1.18
		化学	6.86
		医薬品	2.26
		ガラス・土石製品	0.96
		鉄鋼	0.84
		非鉄金属	0.50
		金属製品	1.07
		機械	2.31
		電気機器	8.29
		輸送用機器	4.19
		精密機器	3.78
電気・ガス業	2.07		

	陸運業	1.92
	情報・通信業	2.92
	卸売業	6.92
	小売業	7.75
	銀行業	25.90
	その他金融業	3.03
	不動産業	1.09
	サービス業	7.86
合計		98.57

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

(参考) 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

2022年11月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率(%)	償還日	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	Treasury 2.125 240229	6,460,000	13,638.50	881,047,515	13,442.18	868,364,959	2.1250000	2024/2/29	7.69
2	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 280215	4,660,000	13,637.46	635,506,007	13,084.15	609,721,754	2.7500000	2028/2/15	5.40
3	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 250228	4,190,000	13,735.63	575,522,968	13,395.53	561,272,726	2.7500000	2025/2/28	4.97
4	アメリカ	国債証券	Treasury 2.125 250515	2,580,000	13,491.22	348,073,489	13,164.98	339,656,598	2.1250000	2025/5/15	3.01
5	アメリカ	国債証券	Treasury 0.75 260331	2,520,000	12,726.58	320,709,958	12,419.64	312,975,007	0.7500000	2026/3/31	2.77
6	スペイン	国債証券	SPAIN 0.5 311031	2,460,000	11,695.35	287,705,748	11,796.84	290,202,478	0.5000000	2031/10/31	2.57
7	アメリカ	国債証券	Treasury 1.25 310815	2,400,000	12,215.00	293,160,124	11,336.34	272,072,365	1.2500000	2031/8/15	2.41
8	アメリカ	国債証券	Treasury 1.75 410815	2,730,000	10,657.18	290,941,221	9,609.69	262,344,687	1.7500000	2041/8/15	2.32
9	アメリカ	国債証券	Treasury 0.875 240131	1,970,000	13,266.25	261,345,146	13,275.10	261,519,549	0.8750000	2024/1/31	2.32
10	アメリカ	国債証券	Treasury 2.25 270815	2,000,000	12,874.22	257,484,509	12,854.15	257,083,088	2.2500000	2027/8/15	2.28
11	ドイツ	国債証券	GERMANY 1.5 240515	1,800,000	14,233.51	256,203,291	14,250.53	256,509,547	1.5000000	2024/5/15	2.27
12	アメリカ	国債証券	Treasury 1.5 270131	1,800,000	12,974.42	233,539,740	12,526.50	225,477,142	1.5000000	2027/1/31	2.00
13	フランス	国債証券	FRA 0.00 240325	1,400,000	13,925.41	194,955,795	13,954.97	195,369,593	0.0000000	2024/3/25	1.73
14	アメリカ	国債証券	Treasury 2.25 270215	1,460,000	13,377.34	195,309,267	12,913.28	188,533,925	2.2500000	2027/2/15	1.67
15	イタリア	国債証券	ITALY 1.45 250515	1,220,000	13,793.73	168,283,513	13,916.06	169,775,941	1.4500000	2025/5/15	1.50
16	アメリカ	国債証券	Treasury 2.375 290515	1,310,000	13,605.09	178,226,730	12,676.76	166,065,681	2.3750000	2029/5/15	1.47
17	アメリカ	国債証券	Treasury 3.0 480215	1,340,000	13,208.38	176,992,309	11,630.90	155,854,126	3.0000000	2048/2/15	1.38
18	フランス	国債証券	FRANCE 1.0 270525	1,140,000	13,888.31	158,326,843	13,651.67	155,629,067	1.0000000	2027/5/25	1.38
19	アメリカ	国債証券	Treasury 3.125 290831	1,100,000	13,231.16	145,542,812	13,260.45	145,865,033	3.1250000	2029/8/31	1.29

20	ベルギー	国債証券	BELGIUM 3.0 340622	970,000	16,158.36	156,736,141	14,903.46	144,563,566	3.0000000	2034/6/22	1.28
21	フランス	国債証券	FRANCE 0.0 291125	1,110,000	13,035.83	144,697,741	12,320.22	136,754,514	0.0000000	2029/11/25	1.21
22	中国	国債証券	CGB 2.6 320901	7,000,000	1,920.31	134,421,758	1,895.15	132,660,740	2.6000000	2032/9/1	1.17
23	アメリカ	国債証券	Treasury 1.625 310515	1,090,000	12,454.36	135,752,530	11,774.65	128,343,761	1.6250000	2031/5/15	1.14
24	イタリア	国債証券	ITALY 2.8 281201	900,000	13,624.59	122,621,340	13,968.32	125,714,915	2.8000000	2028/12/1	1.11
25	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 320815	950,000	12,747.17	121,098,166	12,752.17	121,145,630	2.7500000	2032/8/15	1.07
26	アメリカ	国債証券	Treasury 2.875 490515	1,040,000	13,089.58	136,131,656	11,449.18	119,071,476	2.8750000	2049/5/15	1.05
27	イタリア	国債証券	ITALY 4.0 370201	810,000	15,311.05	124,019,512	14,586.29	118,148,967	4.0000000	2037/2/1	1.05
28	中国	国債証券	CGB 2.8 290324	6,000,000	1,945.67	116,740,759	1,935.35	116,121,109	2.8000000	2029/3/24	1.03
29	スペイン	国債証券	SPAIN 5.75 320730	640,000	18,814.29	120,411,471	18,000.62	115,203,997	5.7500000	2032/7/30	1.02
30	イタリア	国債証券	ITALY 2.2 270601	800,000	13,564.61	108,516,903	13,829.62	110,637,005	2.2000000	2027/6/1	0.98

(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11月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	95.47
合計	95.47

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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

2022年11月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3,230	19,261.62	62,215,055	19,604.27	63,321,818	4.92
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1,400	30,810.09	43,134,126	33,374.62	46,724,478	3.63
3	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,773	23,815.72	42,225,284	24,453.61	43,356,265	3.37

4	デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,372	16,253.22	38,552,654	16,990.86	40,302,341	3.13
5	アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,020	13,778.29	27,832,162	15,114.61	30,531,514	2.37
6	アメリカ	株式	MARSH&MCLENNAN COS	保険	1,300	22,291.14	28,978,486	23,424.59	30,451,969	2.36
7	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	677	39,608.77	26,815,143	43,877.36	29,704,976	2.31
8	アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小売り	1,370	19,613.85	26,870,988	21,242.94	29,102,833	2.26
9	アメリカ	株式	S&P GLOBAL INC	各種金融	600	43,938.46	26,363,081	48,207.33	28,924,399	2.25
10	アメリカ	株式	VMWARE INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	1,720	15,406.89	26,499,862	16,390.82	28,192,221	2.19
11	アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	700	36,396.39	25,477,479	39,991.78	27,994,248	2.17
12	アメリカ	株式	ADOBE SYSTEMS INC	ソフトウェア・サービス	610	40,659.74	24,802,445	45,379.93	27,681,763	2.15
13	アメリカ	株式	COLGATE-PALMOLIVE CO	家庭用品・パーソナル用品	2,200	10,173.91	22,382,609	10,549.95	23,209,899	1.80
14	ドイツ	株式	MUENCHENER RUECKVERAG-RE	保険	535	39,175.52	20,958,905	43,289.37	23,159,813	1.80
15	アメリカ	株式	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	素材	660	30,132.78	19,887,635	33,546.82	22,140,905	1.72
16	アメリカ	株式	NIKE INC -CL B	耐久消費財・アパレル	1,480	13,302.35	19,687,489	14,754.93	21,837,308	1.70
17	アメリカ	株式	TJX COMPANIES INC	小売	1,900	9,904.06	18,817,720	11,131.81	21,150,456	1.64
18	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	461	47,467.36	21,882,457	45,048.44	20,767,334	1.61
19	アメリカ	株式	ROCKWELL AUTOMATION INC	資本財	570	34,415.76	19,616,984	36,054.81	20,551,246	1.60
20	アイルランド	株式	AON CORP	保険	480	38,919.48	18,681,355	42,040.11	20,179,255	1.57
21	アメリカ	株式	SYSCO CORP	食品・生活必需品小売り	1,700	11,428.52	19,428,497	11,816.44	20,087,962	1.56
22	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	3,700	5,171.51	19,134,619	5,324.27	19,699,820	1.53
23	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	636	27,415.78	17,436,439	29,032.16	18,464,455	1.43
24	アメリカ	株式	ROSS STORES INC	小売	1,120	13,055.44	14,622,096	16,218.62	18,164,863	1.41
25	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1,300	12,683.83	16,488,984	12,834.36	16,684,675	1.30
26	イギリス	株式	GSK PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,033	2,374.73	16,701,534	2,356.80	16,575,437	1.29
27	アメリカ	株式	ALLSTATE CORP	保険	890	17,942.15	15,968,520	18,522.48	16,485,008	1.28
28	アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CO	ソフトウェア・サービス	780	19,045.79	14,855,723	20,343.06	15,867,592	1.23
29	アメリカ	株式	LOCKHEED MARTIN CORPORAT	資本財	230	66,889.51	15,384,588	67,226.96	15,462,202	1.20
30	スウェーデン	株式	ASSA ABLOY AB-B	資本財	4,880	3,082.16	15,040,988	3,132.57	15,286,970	1.19



（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11月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.17
		素材	5.58
		資本財	6.47
		運輸	0.30
		自動車・自動車部品	0.57
		耐久消費財・アパレル	3.00
		消費者サービス	0.41
		メディア・娯楽	1.76
		小売	7.28
		食品・生活必需品小売り	4.42
		食品・飲料・タバコ	1.72
		家庭用品・パーソナル用品	2.60
		ヘルスケア機器・サービス	1.58
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	14.46
		銀行	3.54
		各種金融	2.25
		保険	8.18
		ソフトウェア・サービス	15.74
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.92
		電気通信サービス	3.04
公益事業	2.04		
半導体・半導体製造装置	1.58		
投資証券			1.52
合計			96.13

（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 N A M コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

2022年11月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率(%)	償還日	投資 比率 (%)
1	メキシコ	国債証券	MEXICO 10.0 241205	10,494,000	760.85	79,844,519	719.32	75,485,850	10.0000000	2024/12/5	4.82
2	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10.0 310101	2,884,000	2,423.36	69,889,733	2,371.09	68,382,355	10.0000000	2031/1/1	4.37
3	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10.0 290101	2,834,000	2,461.14	69,748,883	2,412.39	68,367,234	10.0000000	2029/1/1	4.37

4	南アフリカ	国債証券	S-AFRICA 8.75 480228	10,573,000	695.55	73,541,390	643.25	68,011,119	8.7500000	2048/2/28	4.35
5	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10.0 270101	2,161,000	2,520.90	54,476,669	2,493.57	53,886,186	10.0000000	2027/1/1	3.44
6	インドネシア	国債証券	INDONESIA 6.5 250615	5,309,000,000	0.90	48,034,148	0.89	47,277,736	6.5000000	2025/6/15	3.02
7	インドネシア	国債証券	INDONESIA 7.5 400415	5,006,000,000	0.93	46,709,785	0.90	45,392,844	7.5000000	2040/4/15	2.90
8	マレーシア	国債証券	MALAYSIA 2.632 310415	1,661,000	2,817.56	46,799,762	2,729.18	45,331,830	2.6320000	2031/4/15	2.90
9	ポーランド	国債証券	POLAND 1.25 301025	2,067,000	2,019.49	41,742,995	2,060.76	42,596,084	1.2500000	2030/10/25	2.72
10	南アフリカ	国債証券	S-AFRICA 8.5 370131	6,436,000	707.79	45,553,905	652.39	41,987,949	8.5000000	2037/1/31	2.68
11	マレーシア	国債証券	MALAYSIA 3.955 250915	1,360,000	3,168.26	43,088,338	3,084.06	41,943,285	3.9550000	2025/9/15	2.68
12	メキシコ	国債証券	MEXICO 5.0 250306	6,371,000	652.83	41,592,215	648.32	41,304,623	5.0000000	2025/3/6	2.64
13	南アフリカ	国債証券	S-AFRICA 8.75 440131	6,132,000	696.71	42,722,770	645.57	39,586,867	8.7500000	2044/1/31	2.53
14	インドネシア	国債証券	INDONESIA 7.5 350615	4,309,000,000	0.93	40,190,905	0.91	39,443,078	7.5000000	2035/6/15	2.52
15	インドネシア	国債証券	INDONESIA 6.25 360615	4,536,000,000	0.88	40,007,066	0.81	36,823,688	6.2500000	2036/6/15	2.35
16	メキシコ	国債証券	MEXICO 8.5 290531	4,991,000	744.53	37,159,822	696.34	34,754,472	8.5000000	2029/5/31	2.22
17	メキシコ	国債証券	MEXICO 7.75 310529	5,118,000	700.69	35,861,716	660.43	33,801,016	7.7500000	2031/5/29	2.16
18	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10.0 250101	1,263,000	2,548.83	32,191,808	2,581.28	32,601,596	10.0000000	2025/1/1	2.08
19	マレーシア	国債証券	MALAYSIA 3.899 271116	1,004,000	3,136.85	31,494,020	3,063.69	30,759,531	3.8990000	2027/11/16	1.97
20	南アフリカ	国債証券	S-AFRICA 6.25 360331	5,244,000	581.80	30,510,011	539.94	28,314,831	6.2500000	2036/3/31	1.81
21	インドネシア	国債証券	INDONESIA 8.375 390415	2,676,000,000	1.00	26,900,623	0.97	26,221,856	8.3750000	2039/4/15	1.68
22	コロンビア	国債証券	COLOMBIA 7.25 341018	1,210,100,000	2.39	28,940,533	1.89	22,931,853	7.2500000	2034/10/18	1.47
23	コロンビア	国債証券	COLOMBIA 7.0 320630	1,170,100,000	2.35	27,526,344	1.95	22,877,002	7.0000000	2032/6/30	1.46
24	コロンビア	国債証券	COLOMBIA 7.5 260826	915,200,000	2.74	25,085,083	2.45	22,444,461	7.5000000	2026/8/26	1.43
25	メキシコ	国債証券	MEXICO 8.5 381118	3,219,000	752.04	24,208,415	675.44	21,742,472	8.5000000	2038/11/18	1.39
26	マレーシア	国債証券	MALAYSIA 4.059 240930	681,000	3,165.48	21,556,980	3,105.28	21,146,995	4.0590000	2024/9/30	1.35
27	コロンビア	国債証券	COLOMBIA 6.0 280428	969,300,000	2.48	24,062,436	2.13	20,681,154	6.0000000	2028/4/28	1.32
28	コロンビア	国債証券	COLOMBIA 7.75 300918	957,100,000	2.51	24,032,681	2.15	20,631,875	7.7500000	2030/9/18	1.32
29	ポーランド	国債証券	POLAND 2.75 291025	841,000	2,342.32	19,698,950	2,385.54	20,062,449	2.7500000	2029/10/25	1.28
30	ハンガリー	国債証券	HUNGARY 4.75 321124	70,530,000	22.88	16,141,354	27.32	19,272,364	4.7500000	2032/11/24	1.23

（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11月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	93.80
合計	93.80

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率  
該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）SJAMスモールキャップ・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）SOMPO外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065

2022年11月30日現在

種類	通貨	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資比率 （％）
為替予約取引	ドル	買建	2,130.21	295,748	295,782	0.59

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当銘柄の時価の比率です。

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

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

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

該当事項はありません。

（参考）S N A M コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

2022年11月30日現在

種類	通貨	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	ドル	買建	2,877,899.43	413,814,230	398,949,475	25.49
	メキシコペソ	買建	2,273,700.00	16,388,763	16,343,582	1.04
	ハンガリーフォリント	買建	393,765,300.00	137,777,291	138,445,515	8.85
	ポーランドズロチ	買建	3,081,100.00	91,151,138	94,151,327	6.02
	タイバーツ	買建	4,420,964.13	17,059,873	17,355,377	1.11
	ランド	買建	4,122,900.00	33,664,604	33,543,912	2.14
	オフショア人民元	買建	8,976,700.00	180,274,900	173,929,927	11.11
	ドル	売建	3,313,967.23	476,316,569	458,893,945	29.32
	メキシコペソ	売建	7,663,100.00	54,181,113	55,083,127	3.52
	ハンガリーフォリント	売建	145,984,500.00	51,962,210	51,327,269	3.28
	ポーランドズロチ	売建	632,700.00	19,055,582	19,333,854	1.24
	タイバーツ	売建	426,500.00	1,643,285	1,674,310	0.11
	ランド	売建	13,249,225.00	107,594,296	107,795,692	6.89
	オフショア人民元	売建	8,907,000.00	179,377,744	172,781,029	11.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当銘柄の時価の比率です。

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

2022年11月30日現在

種類	買建/ 売建	通貨	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
直物為替先渡取引	買建	チリアンペソ/ドル	295,613.90	41,051,902	41,103,725	2.63
		フィリピンペソ/ドル	350,725.98	48,705,316	51,201,006	3.27
		ウォン/ドル	678,491.67	94,222,138	94,592,042	6.04
	売建	ブラジルリアル/ドル	197,377.70	27,409,841	27,769,892	1.77
		コロンビアペソ/ドル	66,399.83	9,220,944	9,652,348	0.62
		ペルーヌエボソル/ドル	240,559.27	33,406,465	34,335,039	2.19
		フィリピンペソ/ドル	26,121.19	3,627,449	3,777,941	0.24
		インドネシアルピア/ドル	1,181,014.62	164,007,500	163,221,147	10.43

(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) 直物為替先渡取引の時価は、原則として、価格提供会社の提供する価額で評価しています。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

#### SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065

直近日（2022年11月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末（2022年11月2日）	48,450,656	48,450,656	1.0610	1.0610
2022年3月末日	7,240,578		1.0363	
4月末日	8,420,036		1.0281	
5月末日	8,456,218		1.0270	
6月末日	13,200,809		1.0406	
7月末日	16,530,296		1.0490	
8月末日	25,884,676		1.0568	
9月末日	34,421,948		1.0161	
10月末日	47,607,059		1.0635	
11月末日	49,944,863		1.0732	

#### 【分配の推移】

#### SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065

	収益率（％）
第1計算期間	6.1

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## （4）【設定及び解約の実績】

## SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065

	設定口数	解約口数
第1計算期間	47,919,958	2,256,681

（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11月30日

## ● 基準価額・純資産の推移 2022/03/18～2022/11/30

## ● 分配の推移



2022年11月	0円
—	—
—	—
—	—
—	—
設定来累計	0円

● 1万口当たり、税引前

- 基準価額(税引前分配金再投資)は、税引前の分配金を再投資したも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。

## ● 主要な資産の状況

## ● SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065

資産別構成	
資産の種類	純資産比
損保ジャパン日本債券マザーファンド	5.23%
SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	17.34%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	17.25%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	2.95%
SOMPO外国株式アクティブバリュー(リスク抑制型)マザーファンド	36.28%
SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド	1.70%
ISHARES CORE MSCI EMERGING	18.30%
コール・ローン等	0.95%
合計	100.00%

## ● 損保ジャパン日本債券マザーファンド

組入上位5銘柄				
	銘柄名	種類	償還日	純資産比
1	第441回利付国債(2年)	国債証券	2024/10/01	5.4%
2	第154回利付国債(20年)	国債証券	2035/09/20	5.3%
3	第152回利付国債(5年)	国債証券	2027/03/20	4.0%
4	第366回利付国債(10年)	国債証券	2032/03/20	3.5%
5	第150回利付国債(5年)	国債証券	2026/12/20	3.2%
組入銘柄数			98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。

## ● S J A M ラージキャップ・バリュー・マザーファンド

組入上位5銘柄			
	銘柄名	業種	純資産比
1	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7.0%
2	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	6.2%
3	麒麟ホールディングス	食料品	5.7%
4	三井住友トラスト・ホールディングス	銀行業	4.5%
5	東レ	繊維製品	4.3%
組入銘柄数			36銘柄

## ● S J A M スモールキャップ・マザーファンド

組入上位5銘柄			
	銘柄名	業種	純資産比
1	シチズン時計	精密機器	3.8%
2	めぶきフィナンシャルグループ	銀行業	3.3%
3	八十二銀行	銀行業	3.2%
4	森永乳業	食料品	3.1%
5	クレディセゾン	その他金融業	3.0%
組入銘柄数			89銘柄

## ● 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

組入上位5銘柄						
	銘柄名	発行国	種類	通貨	償還日	純資産比
1	Treasury 2.125 240229	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2024/02/29	7.7%
2	Treasury 2.75 280215	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2028/02/15	5.4%
3	Treasury 2.75 250228	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2025/02/28	5.0%
4	Treasury 2.125 250515	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2025/05/15	3.0%
5	Treasury 0.75 260331	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2026/03/31	2.8%
組入銘柄数					137銘柄	

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

組入上位5銘柄					
	銘柄名	通貨	発行国/地域	業種	純資産比
1	APPLE INC	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	4.9%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	3.6%
3	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ・ドル	アメリカ	ヘルスケア	3.4%
4	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク・クローネ	デンマーク	ヘルスケア	3.1%
5	MERCK & CO.INC.	アメリカ・ドル	アメリカ	ヘルスケア	2.4%
組入銘柄数				91銘柄	

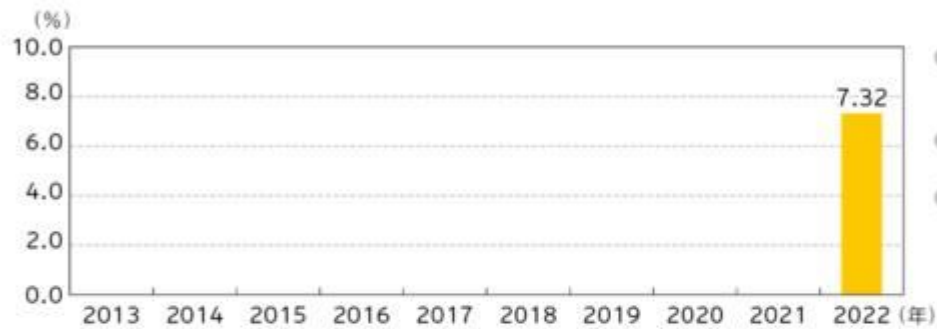
- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。



## ● SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

組入上位5銘柄						
	銘柄名	発行国	種類	通貨	償還日	純資産比
1	MEXICO 10.0 241205	メキシコ	国債証券	メキシコ・ペソ	2024/12/05	4.8%
2	BRAZIL 10.0 310101	ブラジル	国債証券	ブラジルレアル	2031/01/01	4.4%
3	BRAZIL 10.0 290101	ブラジル	国債証券	ブラジルレアル	2029/01/01	4.4%
4	S-AFRICA 8.75 480228	南アフリカ	国債証券	南アフリカ・ランド	2048/02/28	4.3%
5	BRAZIL 10.0 270101	ブラジル	国債証券	ブラジルレアル	2027/01/01	3.4%
組入銘柄数					68銘柄	

## ● 年間収益率の推移（暦年ベース）



- ファンドの年間収益率は基準価額(税引前分配金再投資)を使用して計算しています。
- 2022年は設定日(3月18日)から基準日までの収益率です。
- 当ファンドはベンチマークを設定していません。

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

### <訂正前>

(1) 申込期間内における毎営業日において、いつでも申込みいただくことができます。ただし、継続申込期間中であっても、下記の取得申込不可日にあたる日は取得のお申込みの受付はできません。

(略)

(3) 当該受益権の申込価額は、当初自己設定は1口当たり1円です。継続申込期間は取得申込受付日の翌営業日における基準価額とします。

(略)

(4) お申込みには申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額を要します。申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額（当初自己設定は1口当たり1円）に、2.2%（税抜2.0%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。

(略)

### <訂正後>

(1) 申込期間内における毎営業日において、いつでも申込みいただくことができます。ただし、下記の取得申込不可日にあたる日は取得のお申込みの受付はできません。

(略)

(3) 当該受益権の申込価額は、取得申込受付日の翌営業日における基準価額とします。

(略)

(4) お申込みには申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額を要します。申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.2%（税抜2.0%）を上限として販売会社が定めた申込手数料率を乗じて得た額です。

(略)

## 3【資産管理等の概要】

### (4)【計算期間】

#### <訂正前>

当ファンドの計算期間は、原則として毎年11月3日から翌年11月2日までとします。なお、前記の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のときは、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、第1期計算期間は、2022年3月18日から2022年11月2日までとし、最終計算期間の終了日は、信託約款第4条に定める信託期間の終了日とします。

#### <訂正後>

当ファンドの計算期間は、原則として毎年11月3日から翌年11月2日までとします。なお、前記の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のときは、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託約款第4条に定める信託期間の終了日とします。

## 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）（以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2022年3月18日から2022年11月2日までの財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

第1期 2022年11月2日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	677,659
投資信託受益証券	8,566,205
親投資信託受益証券	39,265,795
流動資産合計	48,509,659
資産合計	48,509,659
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	1,548
未払委託者報酬	56,756
未払利息	2
その他未払費用	697
流動負債合計	59,003
負債合計	59,003
純資産の部	
元本等	
元本	45,663,277
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,787,379
元本等合計	48,450,656
純資産合計	48,450,656
負債純資産合計	48,509,659

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

第1期 自 2022年3月18日 至 2022年11月2日	
営業収益	
受取配当金	18,456
有価証券売買等損益	521,517
為替差損益	708,567
営業収益合計	1,248,540
営業費用	
支払利息	129

	第1期 自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
受託者報酬	3,915
委託者報酬	143,424
その他費用	36,385
営業費用合計	183,853
営業利益又は営業損失（ ）	1,064,687
経常利益又は経常損失（ ）	1,064,687
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,064,687
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	51,095
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,829,252
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,829,252
剰余金減少額又は欠損金増加額	55,465
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	55,465
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,787,379

### （ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。</p>
2．外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3．費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> <p>第1期計算期間の取扱い 当ファンドは2022年3月18日に設定されたため、当計算期間は2022年3月18日から2022年11月2日までとなっております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

期別	第1期 2022年11月2日現在	
1. 受益権の総数		45,663,277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)	1.0610円 (10,610円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第1期 自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	S N A M コルチェスター・エマージング債券マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の49の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。
2. その他費用	その他費用の内訳は、監査費用（1,687円）、カストディフィー（34,673円）、その他（25円）となっております。
3. 分配金の計算過程	計算期間末における経費控除後の配当等収益（303,833円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（709,759円）、信託約款に規定される収益調整金（1,773,787円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は2,787,379円（1万口当たり610.40円）であります。分配を行っておりません。

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>( 1 ) 金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>( 2 ) 金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>

3．金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2022年11月2日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	<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>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

第1期 2022年11月2日現在
該当事項はありません。

( その他の注記 )

項目	第1期
	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
期首元本額	5,000,000円
期中追加設定元本額	42,919,958円
期中一部解約元本額	2,256,681円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第1期 2022年11月2日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	1,004,278
親投資信託受益証券	1,495,403
合計	491,125

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## （１）株式

該当事項はありません。

## （２）株式以外の有価証券

2022年11月2日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ドル	ISHARES CORE MSCI EMERGING	1,347	58,028.76	
	ドル	小計	1,347	58,028.76 (8,566,205)	
投資信託受益証券 合計			1,347	8,566,205 (8,566,205)	
親投資信託受益証券	日本円	損保ジャパン日本債券マザーファンド	1,822,481	2,547,828	
		損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド	788,446	1,434,814	

	S J A M ラージキャップ・パ リュウ・マザーファンド	3,566,232	8,536,489	
	S J A M スモールキャップ・マ ザーファンド	2,914,601	8,506,263	
	S N A M コルチェスター・エ マージング債券マザーファンド	571,808	807,964	
	S O M P O 外国株式アクティブパ リュウ（リスク抑制型）マザー ファンド	8,354,070	17,432,437	
親投資信託受益証券 合計		18,017,638	39,265,795	
合計			47,832,000 (8,566,205)	

（注）投資信託受益証券及び親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

（注）1．通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額です。

2．合計欄における（ ）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	有価証券の合計金額に対する比 率
ドル	投資信託受益証券 1銘柄	17.68%	17.91%

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065の主要投資対象の状況は以下のとおりです。

\*なお、以下は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

## 損保ジャパン日本債券マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年11月2日現在
科 目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	353,649,377
国債証券	18,971,821,800
地方債証券	997,705,000
特殊債券	862,106,206
社債券	3,469,820,000



	2022年11月2日現在
科 目	金額（円）
未収利息	25,435,797
前払費用	1,150,720
流動資産合計	24,681,688,900
資産合計	24,681,688,900
負債の部	
流動負債	
未払利息	1,046
その他未払費用	10,292
流動負債合計	11,338
負債合計	11,338
純資産の部	
元本等	
元本	17,654,578,293
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,027,099,269
元本等合計	24,681,677,562
純資産合計	24,681,677,562
負債純資産合計	24,681,688,900

## 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	2022年11月2日現在
1．受益権の総数	17,654,578,293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	<p>1口当たり純資産額 1.3980円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,980円)</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

2022年11月2日現在

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	17,136,187,412円
同期中追加設定元本額	2,482,626,660円
同期中一部解約元本額	1,964,235,779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）	181,181,817円
SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド（2%コース）（FofS用）（適格機関投資家専用）	16,896,596円
SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド（4%コース）（FofS用）（適格機関投資家専用）	45,456,546円
損保ジャパン国内債券ファンド（適格機関投資家専用）	1,414,318,702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）	149,928,014円
損保ジャパン日本債券ファンド	1,026,321,252円
ハッピーエイジング20	224,129,753円
ハッピーエイジング30	1,012,999,186円
ハッピーエイジング40	5,163,322,514円
ハッピーエイジング50	3,958,811,263円
ハッピーエイジング60	2,782,904,097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	788,659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	6,454,771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	116,568,642円
好配当米国株式プレミアム・ファンド 通貨セレクト・プレミアムコース	9,944,046円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	1,000,028,736円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	331,765,658円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	118,907,496円
ターゲット・リターン戦略ファンド	92,028,064円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	1,822,481円
計	17,654,578,293円

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年11月2日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	284,926,000

地方債証券	5,781,000
特殊債券	6,400,812
社債券	20,267,000
合計	317,374,812

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

2022年11月2日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	第433回利付国債(2年)	160,000,000	160,158,400	
	第436回利付国債(2年)	200,000,000	200,178,000	
	第439回利付国債(2年)	550,000,000	550,522,500	
	第441回利付国債(2年)	1,350,000,000	1,351,539,000	
	第139回利付国債(5年)	810,000,000	811,773,900	
	第143回利付国債(5年)	400,000,000	401,376,000	
	第144回利付国債(5年)	600,000,000	602,286,000	
	第145回利付国債(5年)	100,000,000	100,403,000	
	第147回利付国債(5年)	640,000,000	640,966,400	
	第148回利付国債(5年)	220,000,000	220,237,600	
	第150回利付国債(5年)	800,000,000	799,664,000	
	第152回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,003,050,000	
	第153回利付国債(5年)	410,000,000	409,052,900	
	第10回利付国債(40年)	100,000,000	82,913,000	
	第13回利付国債(40年)	240,000,000	169,344,000	
	第14回利付国債(40年)	80,000,000	60,300,800	
	第346回利付国債(10年)	700,000,000	702,135,000	
	第349回利付国債(10年)	120,000,000	120,091,200	
	第350回利付国債(10年)	300,000,000	300,078,000	
	第355回利付国債(10年)	200,000,000	199,278,000	
第356回利付国債(10年)	100,000,000	99,490,000		

第357回利付国債(10年)	400,000,000	397,328,000	
第360回利付国債(10年)	300,000,000	296,751,000	
第361回利付国債(10年)	390,000,000	385,339,500	
第362回利付国債(10年)	100,000,000	98,729,000	
第366回利付国債(10年)	970,000,000	971,338,600	
第38回利付国債(30年)	100,000,000	112,116,000	
第43回利付国債(30年)	440,000,000	483,164,000	
第53回利付国債(30年)	160,000,000	137,161,600	
第55回利付国債(30年)	50,000,000	44,588,000	
第57回利付国債(30年)	120,000,000	106,221,600	
第58回利付国債(30年)	300,000,000	264,564,000	
第60回利付国債(30年)	100,000,000	89,650,000	
第61回利付国債(30年)	100,000,000	84,904,000	
第63回利付国債(30年)	50,000,000	38,797,000	
第66回利付国債(30年)	120,000,000	92,324,400	
第67回利付国債(30年)	200,000,000	161,376,000	
第68回利付国債(30年)	190,000,000	152,929,100	
第69回利付国債(30年)	50,000,000	41,311,000	
第70回利付国債(30年)	100,000,000	82,276,000	
第71回利付国債(30年)	40,000,000	32,835,200	
第72回利付国債(30年)	100,000,000	81,900,000	
第73回利付国債(30年)	140,000,000	114,511,600	
第74回利付国債(30年)	110,000,000	97,395,100	
第75回利付国債(30年)	50,000,000	47,655,500	
第113回利付国債(20年)	180,000,000	203,682,600	
第130回利付国債(20年)	10,000,000	11,346,000	
第131回利付国債(20年)	30,000,000	33,777,300	
第145回利付国債(20年)	370,000,000	420,949,000	
第148回利付国債(20年)	280,000,000	312,312,000	
第149回利付国債(20年)	40,000,000	44,590,000	
第150回利付国債(20年)	120,000,000	132,255,600	
第151回利付国債(20年)	360,000,000	388,144,800	
第152回利付国債(20年)	170,000,000	183,011,800	
第154回利付国債(20年)	1,240,000,000	1,332,913,200	
第159回利付国債(20年)	640,000,000	632,582,400	
第166回利付国債(20年)	40,000,000	39,105,600	
第167回利付国債(20年)	150,000,000	141,550,500	
第170回利付国債(20年)	240,000,000	216,052,800	
第171回利付国債(20年)	200,000,000	179,136,000	
第174回利付国債(20年)	700,000,000	630,091,000	
第176回利付国債(20年)	200,000,000	181,798,000	
第179回利付国債(20年)	300,000,000	270,063,000	
第180回利付国債(20年)	230,000,000	218,456,300	

国債証券 合計		19,260,000,000	18,971,821,800	
地方債証券	第807回東京都公募公債	400,000,000	392,272,000	
	令和2年度第10回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	196,780,000	
	第15回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	105,752,000	
	第135回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,901,000	
地方債証券 合計		1,000,000,000	997,705,000	
特殊債券	第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	300,000,000	315,594,000	
	第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	400,000,000	399,752,000	
	第78回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	87,318,000	
	第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,913,000	20,751,138	
	第65回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,421,000	38,691,068	
特殊債券 合計		857,334,000	862,106,206	
社債券	第1回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債(劣後特約付)	100,000,000	100,802,000	
	第10回ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー期限前償還	100,000,000	99,444,000	
	第1回アサヒホールディングス株式会社利払繰延条項・期限前	200,000,000	200,716,000	
	第1回帝人株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債	100,000,000	98,210,000	
	第1回大陽日酸株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	100,000,000	100,483,000	
	第1回武田薬品工業株式会社無担保社債(劣後特約付)FR	200,000,000	203,250,000	
	E N E O Sホールディングス株式会社第1回利払繰延条項・期限前	200,000,000	198,002,000	
	日本製鉄株式会社第1回無担保社債(劣後特約付)FR	100,000,000	100,354,000	
	第1回ジェイエフイーホールディングス無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	197,528,000	
	第2回パナソニック株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担	100,000,000	94,786,000	
	第1回ドンキホーテホールディングス無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	100,759,000	
	第1回ニプロ利払繰延条項・期限前償還条項付無担	100,000,000	99,807,000	
	第27回SBIホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定)	200,000,000	199,640,000	
	第64回アイフル株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約)	100,000,000	99,922,000	
	第2回株式会社T&Dホールディングス無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	99,573,000	
	第1回株式会社商船三井利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	100,000,000	101,141,000	
	第1回関西電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	200,000,000	197,200,000	
	第1回中国電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	100,000,000	94,712,000	
	第1回東北電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	200,000,000	199,622,000	

第1回九州電力株式会社利払繰延条項・期限前	200,000,000	198,766,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債 (一般担保付)	100,000,000	99,424,000	
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債 (一般担保付)	100,000,000	98,895,000	
第3回第一生命ホールディングス永久社債(劣 後特約付)	200,000,000	190,256,000	
第3回A号富国生命劣後FR	200,000,000	198,392,000	
大樹生命保険株式会社第1回利払繰延条項・期 限前	100,000,000	98,136,000	
社債券 合計	3,500,000,000	3,469,820,000	
合計		24,301,453,006	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 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	2022年11月2日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		369,015,933
株式		36,532,713,910
未収配当金		531,906,300
流動資産合計		37,433,636,143
資産合計		37,433,636,143
負債の部		
流動負債		
未払利息		1,091
その他未払費用		10,169
流動負債合計		11,260
負債合計		11,260
純資産の部		
元本等		
元本		15,638,114,272
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		21,795,510,611
元本等合計		37,433,624,883
純資産合計		37,433,624,883
負債純資産合計		37,433,636,143

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

期別	2022年11月2日現在	
1. 受益権の総数	15,638,114,272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)	2.3937円 (23,937円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>	



項目	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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>

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

2022年11月2日現在
該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

項目	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	11,957,618,624円

項目	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
同期中追加設定元本額	6,166,128,821円
同期中一部解約元本額	2,485,633,173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)	9,933,774,783円
ハッピーエイジング20	1,748,466,476円
ハッピーエイジング30	1,674,121,539円
ハッピーエイジング40	1,455,171,550円
ハッピーエイジング50	395,887,530円
ハッピーエイジング60	92,764,604円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	157,657,853円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	92,500,158円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	68,016,057円
SOMPO日本株バリュー・プラスファンド	16,187,490円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	3,566,232円
計	15,638,114,272円

\*当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年11月2日現在	
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		454,652,924
合計		454,652,924

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

2022年11月2日現在

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
鹿島建設	883,400	1,414.00	1,249,127,600	
大和ハウス工業	148,000	3,008.00	445,184,000	

日揮ホールディングス	656,900	1,878.00	1,233,658,200
麒麟ホールディングス	1,004,000	2,190.00	2,198,760,000
東レ	2,214,100	721.00	1,596,366,100
王子ホールディングス	1,785,500	523.00	933,816,500
旭化成	506,100	960.20	485,957,220
積水化学工業	224,200	1,883.00	422,168,600
武田薬品工業	339,000	3,914.00	1,326,846,000
サワイグループホールディングス	144,400	4,320.00	623,808,000
日本製鉄	434,900	2,132.50	927,424,250
J F E ホールディングス	345,700	1,387.00	479,485,900
住友電気工業	501,600	1,595.00	800,052,000
住友重機械工業	308,500	2,867.00	884,469,500
日本精工	1,897,500	792.00	1,502,820,000
T H K	383,800	2,589.00	993,658,200
マキタ	250,100	2,726.00	681,772,600
アルプスアルパイン	512,000	1,283.00	656,896,000
スタンレー電気	402,300	2,732.00	1,099,083,600
アイシン	153,000	3,930.00	601,290,000
本田技研工業	432,000	3,435.00	1,483,920,000
S U B A R U	230,100	2,517.50	579,276,750
東京瓦斯	602,200	2,637.00	1,588,001,400
ヤマトホールディングス	384,400	2,253.00	866,053,200
日本テレビホールディングス	532,500	1,127.00	600,127,500
スズケン	222,000	3,245.00	720,390,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,642,400	453.00	744,007,200
三菱U F J フィナンシャル・グループ	3,549,900	702.30	2,493,094,770
三井住友トラスト・ホールディングス	392,500	4,316.00	1,694,030,000
三井住友フィナンシャルグループ	507,900	4,237.00	2,151,972,300
野村ホールディングス	626,900	483.30	302,980,770
M S & A D インシュアランスグループホール	124,400	3,989.00	496,231,600
第一生命ホールディングス	464,200	2,361.00	1,095,976,200
クレディセゾン	426,200	1,604.00	683,624,800
三井不動産	79,900	2,845.50	227,355,450
三菱地所	435,400	1,840.50	801,353,700
総合警備保障	233,200	3,695.00	861,674,000
合計	23,981,100		36,532,713,910

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

#### 貸借対照表

	2022年11月2日現在
科 目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	210,481,643
株式	13,085,616,300
未収配当金	147,646,860
流動資産合計	13,443,744,803
資産合計	13,443,744,803
負債の部	
流動負債	
未払利息	622
その他未払費用	135
流動負債合計	757
負債合計	757
純資産の部	
元本等	
元本	4,606,394,361
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,837,349,685
元本等合計	13,443,744,046
純資産合計	13,443,744,046
負債純資産合計	13,443,744,803

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

期別	2022年11月2日現在	
1. 受益権の総数		4,606,394,361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)	2.9185円 (29,185円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>（1）金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>（2）金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

2022年11月2日現在
該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

項目	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,497,040,029円
同期中追加設定元本額	357,685,707円
同期中一部解約元本額	248,331,375円
元本の内訳*	
ハッピーエイジング20	1,409,431,081円
ハッピーエイジング30	1,355,984,854円
ハッピーエイジング40	1,172,910,141円
ハッピーエイジング50	319,084,524円
ハッピーエイジング60	74,764,829円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	127,699,325円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	74,920,369円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	55,584,661円
SOMPO日本株バリュー・プラスファンド	13,099,976円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	2,914,601円
計	4,606,394,361円

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## ( 有価証券に関する注記 )

売買目的有価証券

種類	2022年11月2日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)

株式	307,336,073
合計	307,336,073

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### （1）株式

2022年11月2日現在

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
東鉄工業	22,000	2,473.00	54,406,000	
エクシオグループ	60,000	2,136.00	128,160,000	
森永乳業	96,300	4,270.00	411,201,000	
東洋紡	33,000	1,043.00	34,419,000	
日本毛織	14,000	985.00	13,790,000	
ワコールホールディングス	110,200	2,415.00	266,133,000	
レンゴー	18,000	837.00	15,066,000	
ザ・バック	57,900	2,323.00	134,501,700	
住友精化	43,600	2,958.00	128,968,800	
東亜合成	198,800	1,144.00	227,427,200	
日本触媒	3,000	5,320.00	15,960,000	
カネカ	4,000	3,735.00	14,940,000	
ダイキョーニシカワ	36,600	611.00	22,362,600	
日本化薬	113,900	1,171.00	133,376,900	
三洋化成工業	5,000	4,250.00	21,250,000	
太陽ホールディングス	10,900	2,640.00	28,776,000	
D I C	27,700	2,501.00	69,277,700	
東洋インキSCホールディングス	87,900	1,898.00	166,834,200	
キョーリン製薬ホールディングス	96,100	1,815.00	174,421,500	
サイグループホールディングス	22,700	4,320.00	98,064,000	
太平洋セメント	60,600	2,056.00	124,593,600	
共英製鋼	77,000	1,291.00	99,407,000	
大同特殊鋼	11,000	4,215.00	46,365,000	
東プレ	115,900	1,199.00	138,964,100	
オーエスジー	20,000	1,911.00	38,220,000	
ジェイテクト	218,000	1,054.00	229,772,000	
不二越	4,000	3,970.00	15,880,000	

マブチモーター	67,300	4,135.00	278,285,500
E I Z O	103,400	3,740.00	386,716,000
アンリツ	22,000	1,490.00	32,780,000
コーセル	151,600	846.00	128,253,600
イリソ電子工業	49,000	4,270.00	209,230,000
市光工業	337,900	414.00	139,890,600
タチエス	51,200	1,097.00	56,166,400
N O K	18,000	1,238.00	22,284,000
太平洋工業	100,000	1,042.00	104,200,000
豊田合成	122,800	2,441.00	299,754,800
エフ・シー・シー	57,400	1,487.00	85,353,800
テイ・エス テック	15,000	1,577.00	23,655,000
ノーリツ銅機	16,000	2,734.00	43,744,000
シチズン時計	822,700	639.00	525,705,300
四国電力	173,100	712.00	123,247,200
沖縄電力	111,900	1,017.00	113,802,300
セイノーホールディングス	218,000	1,160.00	252,880,000
フジ・メディア・ホールディングス	44,500	1,040.00	46,280,000
日本テレビホールディングス	310,100	1,127.00	349,482,700
テレビ朝日ホールディングス	16,500	1,380.00	22,770,000
日本ライフライン	277,400	969.00	268,800,600
シークス	57,800	1,154.00	66,701,200
東邦ホールディングス	141,700	1,994.00	282,549,800
トラスコ中山	119,900	1,991.00	238,720,900
スズケン	21,000	3,245.00	68,145,000
ドトール・日レスホールディングス	35,400	1,650.00	58,410,000
ユナイテッドアローズ	67,300	2,036.00	137,022,800
A O K Iホールディングス	175,900	706.00	124,185,400
コメリ	61,400	2,584.00	158,657,600
青山商事	187,200	1,050.00	196,560,000
イズミ	13,000	3,020.00	39,260,000
ゼビオホールディングス	153,500	1,011.00	155,188,500
ケースホールディングス	111,900	1,186.00	132,713,400
アークス	10,000	1,993.00	19,930,000
パローホールディングス	29,700	1,723.00	51,173,100
いよぎんホールディングス	529,000	683.00	361,307,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	51,500	882.00	45,423,000
めぶきフィナンシャルグループ	1,426,900	289.00	412,374,100
九州フィナンシャルグループ	344,000	377.00	129,688,000
西日本フィナンシャルホールディングス	324,000	752.00	243,648,000
第四北越フィナンシャルグループ	104,000	2,605.00	270,920,000
ひろぎんホールディングス	39,600	612.00	24,235,200
十六フィナンシャルグループ	53,000	2,467.00	130,751,000



群馬銀行	673,800	402.00	270,867,600
七十七銀行	81,200	1,776.00	144,211,200
八十二銀行	798,000	478.00	381,444,000
滋賀銀行	23,700	2,431.00	57,614,700
百五銀行	405,500	325.00	131,787,500
ほくほくフィナンシャルグループ	305,000	880.00	268,400,000
山陰合同銀行	179,600	703.00	126,258,800
山口フィナンシャルグループ	33,600	783.00	26,308,800
北洋銀行	1,026,000	235.00	241,110,000
クレディセゾン	235,800	1,604.00	378,223,200
パーク24	12,700	2,004.00	25,450,800
ゴールドクレスト	70,300	1,719.00	120,845,700
UTグループ	98,500	2,447.00	241,029,500
H.U.グループホールディングス	43,900	2,777.00	121,910,300
りらいあコミュニケーションズ	106,100	985.00	104,508,500
エン・ジャパン	154,500	2,545.00	393,202,500
ソラスト	200,700	871.00	174,809,700
カナモト	60,400	2,206.00	133,242,400
メイテック	12,000	2,584.00	31,008,000
合計	13,232,900		13,085,616,300

## （２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年11月2日現在
科 目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	56,266,039
コール・ローン	1,938,973
国債証券	11,062,141,004
派生商品評価勘定	6,798,360

2022年11月2日現在	
科 目	金額（円）
未収入金	846,264,278
未収利息	65,783,037
前払費用	10,177,901
流動資産合計	12,049,369,592
資産合計	12,049,369,592
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,334,329
未払金	844,169,432
未払利息	5
その他未払費用	3,598
流動負債合計	847,507,364
負債合計	847,507,364
純資産の部	
元本等	
元本	6,155,526,827
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,046,335,401
元本等合計	11,201,862,228
純資産合計	11,201,862,228
負債純資産合計	12,049,369,592

## 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> <p>外貨建取引等の処理基準</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	2022年11月2日現在	
1. 受益権の総数		6,155,526,827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)	1.8198円 (18,198円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は(有価証券に関する注記)に記載しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>

項目	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
3．金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月2日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額 2．時価の算定方法	<p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

2022年11月2日現在
該当事項はありません。

( その他の注記 )

項目	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	6,051,210,592円
同期中追加設定元本額	436,542,459円
同期中一部解約元本額	332,226,224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)	67,622,314円
ハッピーエイジング20	516,453,777円
ハッピーエイジング30	1,949,955,054円
ハッピーエイジング40	1,810,684,067円
ハッピーエイジング50	590,743,781円
ハッピーエイジング60	478,771,827円
損保ジャパン外国債券ファンド(為替ヘッジなし)	435,380,433円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	255,576,428円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	32,200,359円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	17,350,341円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	788,446円
計	6,155,526,827円

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年11月2日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	647,528,142
合計	647,528,142

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年11月2日 現在			
	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	781,119,400	-	777,785,071	3,334,329
ドル	781,119,400	-	777,785,071	3,334,329
売建	798,590,100	-	791,791,740	6,798,360
ユーロ	798,590,100	-	791,791,740	6,798,360
合計	1,579,709,500	-	1,569,576,811	3,464,031

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### （1）株式

該当事項はありません。

#### （2）株式以外の有価証券

2022年11月2日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	ドル	Treasury 0.75 260331	2,520,000	2,227,739.06	
		Treasury 0.875 240131	6,270,000	5,978,542.93	
		Treasury 1.25 310815	2,400,000	1,907,531.25	
		Treasury 1.5 270131	1,800,000	1,602,351.54	
		Treasury 1.5 300215	30,000	25,123.82	
		Treasury 1.625 310515	1,090,000	901,080.86	
		Treasury 1.75 291115	10,000	8,582.81	
		Treasury 1.75 410815	2,730,000	1,795,081.63	
		Treasury 1.875 260630	540,000	494,289.84	
		Treasury 2.0 261115	150,000	136,845.70	
		Treasury 2.0 510815	1,160,000	741,040.61	
		Treasury 2.125 240229	7,660,000	7,406,561.69	
		Treasury 2.125 250515	5,040,000	4,750,790.63	
		Treasury 2.25 270215	2,640,000	2,422,818.76	
		Treasury 2.25 270815	2,000,000	1,822,890.61	

	Treasury 2.375 290515	1,310,000	1,171,835.93
	Treasury 2.75 250228	4,190,000	4,026,164.46
	Treasury 2.75 280215	4,660,000	4,321,421.87
	Treasury 2.75 320815	100,000	89,562.50
	Treasury 2.75 421115	485,000	376,500.19
	Treasury 2.75 470815	440,000	333,557.81
	Treasury 2.875 430515	620,000	489,896.87
	Treasury 2.875 490515	1,040,000	819,040.62
	Treasury 3.0 441115	500,000	398,730.47
	Treasury 3.0 450515	75,000	59,736.32
	Treasury 3.0 480215	1,340,000	1,069,173.43
	Treasury 3.5 390215	195,000	177,579.49
	Treasury 4.625 400215	220,000	229,478.90
	Treasury 6.125 271115	60,000	64,778.90
	ドル 合計	51,275,000	45,848,729.50 (6,768,189,448)
カナダドル	CANADA 0.5 301201	1,170,000	940,682.34
	CANADA 3.5 451201	90,000	91,808.73
	CANADA 5.0 370601	130,000	153,972.52
	CANADA 5.75 290601	860,000	983,509.76
	カナダドル 合計	2,250,000	2,169,973.35 (235,181,711)
ユーロ	AUSTRIA 0.75 261020	460,000	432,823.20
	AUSTRIA 3.8 620126	50,000	59,176.40
	AUSTRIA 4.15 370315	250,000	283,852.00
	BELGIUM 0.8 270622	150,000	140,520.00
	BELGIUM 3.0 340622	970,000	982,028.00
	BELGIUM 4.25 410328	155,000	177,647.05
	BELGIUM 5.0 350328	45,000	54,334.67
	BELGIUM 5.5 280328	100,000	116,269.00
	FINLAND 0.75 310415	360,000	309,299.04
	FRA 0.00 240325	900,000	874,428.30
	FRANCE 0.0 291125	1,110,000	940,973.64
	FRANCE 0.0 320525	100,000	78,297.00
	FRANCE 0.75 520525	350,000	197,960.00

FRANCE 1.0 270525	1,140,000	1,079,557.20
FRANCE 1.25 340525	90,000	76,104.00
FRANCE 2.75 271025	10,000	10,229.14
FRANCE 3.25 450525	60,000	61,516.44
FRANCE 4.0 381025	110,000	123,367.48
FRANCE 4.0 550425	70,000	82,936.14
FRANCE 4.0 600425	280,000	335,557.81
FRANCE 4.5 410425	400,000	478,302.40
FRANCE 5.5 290425	35,000	41,407.10
FRANCE 5.75 321025	265,000	335,874.78
GERMANY 0 310215	430,000	363,789.46
GERMANY 0.0 261009	750,000	694,765.50
GERMANY 0.0 310815	430,000	359,592.66
GERMANY 0.0 500815	280,000	155,310.40
GERMANY 0.25 290215	100,000	89,940.00
GERMANY 1.5 240515	750,000	745,587.00
GERMANY 1.7 320815	400,000	385,143.20
GERMANY 2.5 460815	260,000	273,105.04
GERMANY 4.0 370104	50,000	60,327.50
IRELAND 1.0 260515	310,000	298,778.00
IRELAND 2.0 450218	210,000	173,586.00
ITALY 0.95 320601	710,000	534,010.88
ITALY 1.45 250515	460,000	442,807.04
ITALY 1.75 240701	600,000	591,153.60
ITALY 2.0 251201	18,000	17,428.32
ITALY 2.2 270601	800,000	760,884.80
ITALY 2.45 330901	150,000	126,190.20
ITALY 2.7 470301	60,000	45,727.80
ITALY 2.8 670301	160,000	112,432.32
ITALY 3.25 460901	40,000	33,700.80
ITALY 4.0 370201	810,000	785,448.90
ITALY 4.75 440901	30,000	31,419.30
ITALY 5.0 400901	125,000	133,662.50
ITALY 7.25 261101	115,000	132,685.16
NETHERLANDS 0.5 260715	310,000	293,157.70



	NETHERLANDS 2.5 330115	530,000	531,354.68
	NETHERLANDS 2.75 470115	150,000	156,487.80
	NETHERLANDS 4.0 370115	60,000	69,807.60
	NETHERLANDS 5.5 280115	125,000	145,319.75
	SPAIN 0.0 260131	10,000	9,256.68
	SPAIN 0.0 280131	10,000	8,693.96
	SPAIN 0.5 311031	2,460,000	1,971,198.00
	SPAIN 1.5 270430	220,000	210,492.92
	SPAIN 2.15 251031	10,000	9,956.18
	SPAIN 3.45 660730	120,000	112,195.44
	SPAIN 4.2 370131	120,000	130,672.80
	SPAIN 4.4 231031	15,000	15,313.41
	SPAIN 4.7 410730	425,000	493,329.80
	SPAIN 5.15 281031	55,000	62,131.52
	SPAIN 5.75 320730	640,000	786,255.36
ユーロ 合計		20,768,000	19,625,560.77 (2,861,995,527)
ポンド	UK GILT 1.5 260722	580,000	542,456.60
	UK GILT 3.5 450122	190,000	182,192.90
	UK GILT 4.0 600122	340,000	384,492.40
	UK GILT 4.25 271207	90,000	92,776.30
	UK GILT 4.25 320607	280,000	297,948.00
	UK GILT 4.25 360307	269,000	283,864.94
	UK GILT 4.25 390907	380,000	399,786.60
	UK GILT 4.25 401207	100,000	105,610.00
	UK GILT 4.25 461207	71,000	76,508.18
	UK GILT 4.25 491207	160,000	175,955.20
	UK GILT 4.25 551207	70,000	80,459.40
	UK GILT 4.5 340907	125,000	135,868.75
	UK GILT 4.5 421207	70,000	77,128.10
	UK GILT 6.0 281207	60,000	67,831.04
	UK GILT 0.25 310731	90,000	68,123.70
	UK GILT 1.625 711022	100,000	62,701.00
ポンド 合計		2,975,000	3,033,703.11 (515,001,439)

スウェーデンクローナ	SWEDEN 1.5 231113	210,000	208,387.62	
	SWEDEN 2.5 250512	1,400,000	1,403,292.80	
	SWEDEN 3.5 390330	400,000	477,376.00	
スウェーデンクローナ 合計		2,010,000	2,089,056.42	(27,993,356)
デンマーククローネ	DENMARK 1.5 231115	1,350,000	1,342,977.84	
	DENMARK 4.5 391115	410,000	512,170.48	
デンマーククローネ 合計		1,760,000	1,855,148.32	(36,342,355)
オーストラリアドル	AUSTRALIA 2.75 240421	10,000	9,943.94	
	AUSTRALIA 3.25 250421	360,000	360,268.23	
	AUSTRALIA 3.75 370421	650,000	631,403.44	
	AUSTRALIA 4.75 270421	790,000	834,859.04	
オーストラリアドル 合計		1,810,000	1,836,474.65	(173,234,653)
シンガポールドル	SINGAPORE 2.875 290701	400,000	387,600.00	
シンガポールドル 合計		400,000	387,600.00	(40,449,936)
マレーシアリングgit	MALAYSIA 3.48 230315	10,000	10,032.67	
	MALAYSIA 3.733 280615	1,900,000	1,843,007.22	
	MALAYSIA 4.059 240930	10,000	10,088.61	
	MALAYSIA 5.248 280915	11,000	11,511.19	
マレーシアリングgit 合計		1,931,000	1,874,639.69	(58,365,781)
オフショア人民元	CGB 2.6 320901	7,000,000	6,959,656.55	
	CGB 2.8 290324	6,000,000	6,056,100.00	
	CGB 2.91 281014	4,000,000	4,076,000.00	
オフショア人民元 合計		17,000,000	17,091,756.55	(345,386,798)
合計			11,062,141,004	(11,062,141,004)

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額です。

2. 合計欄における( )内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額に対する比 率
ドル	国債証券 29銘柄	60.42%	61.17%
カナダドル	国債証券 4銘柄	2.10%	2.13%
ユーロ	国債証券 63銘柄	25.55%	25.87%
ポンド	国債証券 16銘柄	4.60%	4.66%
スウェーデンクローナ	国債証券 3銘柄	0.25%	0.25%
デンマーククローネ	国債証券 2銘柄	0.32%	0.33%
オーストラリアドル	国債証券 4銘柄	1.55%	1.57%
シンガポールドル	国債証券 1銘柄	0.36%	0.37%
マレーシアリングgit	国債証券 4銘柄	0.52%	0.53%
オフショア人民元	国債証券 3銘柄	3.08%	3.12%

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引等に関する注記）において表示した表は、「投資信託財産計算規則」附属明細表別紙様式第1号第3デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表に求められている項目（記載上の注意を含む。）を満たしているため、省略いたします。

## SOMPO外国株式アクティブパリュウ（リスク抑制型）マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年11月2日現在
科 目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	7,567,704
コール・ローン	45,410,165
株式	1,198,247,345
投資証券	18,987,622
未収配当金	1,218,639
流動資産合計	1,271,431,475
資産合計	1,271,431,475
負債の部	
流動負債	

2022年11月2日現在	
科 目	金額（円）
未払利息	134
その他未払費用	643
流動負債合計	777
負債合計	777
純資産の部	
元本等	
元本	609,289,867
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	662,140,831
元本等合計	1,271,430,698
純資産合計	1,271,430,698
負債純資産合計	1,271,431,475

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<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	2022年11月2日現在	
1. 受益権の総数		609,289,867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)	2.0867円 (20,867円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>（1）金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>（2）金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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>

## （関連当事者との取引に関する注記）

2022年11月2日現在
該当事項はありません。

## （その他の注記）

項目	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	645,494,552円
同期中追加設定元本額	138,119,937円
同期中一部解約元本額	174,324,622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）	75,494,900円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	162,445,791円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	149,339,235円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	154,961,759円
SOMPO外国株式アクティブバリューフンド（リスク抑制型）	58,694,112円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	8,354,070円
計	609,289,867円

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

2022年11月2日現在
--------------

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	156,291,243
投資証券	4,754,344
合計	161,045,587

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

2022年11月2日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ドル	CHEVRON CORP	350	182.22	63,777.00	
	PHILLIPS 66	415	107.38	44,562.70	
	AVERY DENNISON CORPORATION	380	168.78	64,136.40	
	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	520	78.47	40,804.40	
	PPG INDUSTRIES INC	140	114.00	15,960.00	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	640	224.78	143,859.20	
	3M CO	400	125.30	50,120.00	
	BOEING COMPANY	460	143.38	65,954.80	
	LOCKHEED MARTIN CORPORAT	310	485.63	150,545.30	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	560	255.65	143,164.00	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	300	76.59	22,977.00	
	NIKE INC -CL B	1,480	93.77	138,779.60	
	BOOKING HOLDINGS INC	19	1,889.52	35,900.88	
	ALPHABET INC-CL A	930	90.47	84,137.10	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	640	95.20	60,928.00	
	AMAZON.COM INC	1,250	96.79	120,987.50	
	HOME DEPOT INC	647	296.06	191,550.82	
	ROSS STORES INC	1,080	94.68	102,254.40	
	TJX COMPANIES INC	1,840	71.76	132,038.40	
	SYSCO CORP	1,650	84.11	138,781.50	
WAL-MART STORES INC	1,320	141.69	187,030.80		
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,350	36.26	48,951.00		
COCA-COLA COMPANY	1,510	59.64	90,056.40		
Philip Morris International	210	91.72	19,261.20		

COLGATE-PALMOLIVE CO		2,130	73.74	157,066.20
ESTEE LAUDER COMPANIES INC		270	206.76	55,825.20
CARDINAL HEALTH INC		1,320	75.39	99,514.80
MEDTRONIC INC		800	87.74	70,192.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO		670	77.70	52,059.00
GILEAD SCIENCES INC		1,370	79.34	108,695.80
JOHNSON & JOHNSON		1,723	173.09	298,234.07
MERCK & CO. INC.		1,960	99.76	195,529.60
JP MORGAN CHASE & CO		560	128.15	71,764.00
TRUIST FINANCIAL CORP		460	44.82	20,617.20
US BANCORP		1,380	42.88	59,174.40
S&P GLOBAL INC		600	316.13	189,678.00
ALLSTATE CORP		860	125.75	108,145.00
AON CORP		460	284.49	130,865.40
EVEREST RE GROUP LTD		180	316.03	56,885.40
MARSH&MCLENNAN COS		1,250	162.24	202,800.00
METLIFE INC		450	73.94	33,273.00
ACCENTURE PLC-CL A		680	281.47	191,399.60
ADOBE SYSTEMS INC		540	316.02	170,650.80
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC		280	150.93	42,260.40
INTL BUSINESS MACHINES CO		760	138.20	105,032.00
INTUIT INC		110	394.77	43,424.70
MICROSOFT CORP		1,370	228.17	312,592.90
SALESFORCE INC		480	159.82	76,713.60
VISA INC-CLASS A SHARES		616	206.93	127,468.88
VMWARE INC-CLASS A		1,660	112.62	186,949.20
APPLE INC		3,150	150.65	474,547.50
AT&T INC		1,261	18.35	23,139.35
VERIZON COMMUNICATIONS		3,700	37.37	138,269.00
DOMINION RESOURCE INC/VA		1,230	69.72	85,755.60
PPL CORPORATION		3,380	26.57	89,806.60
INTEL CORP		1,010	28.30	28,583.00
QUALCOMM INCORPORATED		310	117.33	36,372.30
TEXAS INSTRUMENTS INCORPORATED		370	162.90	60,273.00
ドル 小計		55,751		6,260,075.90 (924,112,404)
カナダドル	TC ENERGY CORP	600	59.62	35,772.00
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	600	57.38	34,428.00
カナダドル 小計		1,200		70,200.00 (7,608,276)
ユーロ	TOTAL SA	907	56.50	51,245.50
	BASF AG	1,100	45.49	50,044.50



	VINCI S.A.	670	94.23	63,134.10	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE	600	80.28	48,168.00	
	ADIDAS-SALOMON AG	530	98.97	52,454.10	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	76	650.80	49,460.80	
	INDITEX	2,256	23.44	52,880.64	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	392	51.59	20,223.28	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	792	13.18	10,444.89	
	SANOFI	820	86.85	71,217.00	
	ALLIANZ AG-REG	40	184.32	7,372.80	
	AXA	815	25.35	20,660.25	
	MUENCHENER RUECKVER AG-RE	515	270.50	139,307.50	
	SAP SE	860	96.91	83,342.60	
	RWE AG	320	39.29	12,572.80	
	ユーロ 小計	10,693		732,528.76 (106,824,669)	
ボンド	SHELL PLC-NEW	1,717	24.54	42,135.18	
	RIO TINTO PLC	1,460	47.35	69,131.00	
	FERGUSON PLC	615	95.26	58,584.90	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	781	34.65	27,061.65	
	DIAGEO PLC	880	36.11	31,776.80	
	UNILEVER PLC	289	39.47	11,408.27	
	GSK PLC	5,533	14.46	80,007.18	
	ボンド 小計	11,275		320,104.98 (54,341,021)	
スイスフラン	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	441	329.50	145,309.50	
	スイスフラン 小計	441		145,309.50 (21,469,478)	
スウェーデンクローナ	ASSA ABLOY AB-B	2,480	222.70	552,296.00	
	スウェーデンクローナ 小計	2,480		552,296.00 (7,400,766)	
ノルウェークローネ	TELENOR ASA	8,805	95.04	836,827.20	
	ノルウェークローネ 小計	8,805		836,827.20 (11,949,892)	
デンマーククローネ	NOVO NORDISK A/S-B	2,452	801.00	1,964,052.00	
	デンマーククローネ 小計	2,452		1,964,052.00 (38,475,778)	
オーストラリアドル	BHP BILLITON LTD	690	38.42	26,509.80	
	WESTPAC BANKING CORP	3,964	24.32	96,404.48	
	オーストラリアドル 小計	4,654		122,914.28 (11,594,504)	
	OVERSEA-CHINESE BANKING	6,100	12.17	74,237.00	

シンガポールドル	UNITED OVERSEAS BANK LTD	2,300	28.01	64,423.00	
シンガポールドル 小計		8,400		138,660.00 (14,470,557)	
合計		106,151		1,198,247,345 (1,198,247,345)	

## (2) 株式以外の有価証券

2022年11月2日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	ドル	DIGITAL REALTY TRUST INC	200	19,374.00	
		PUBLIC STORAGE	150	46,146.00	
		WELLTOWER INC	1,050	63,105.00	
	ドル 合計		1,400	128,625.00 (18,987,622)	
合計			1,400	18,987,622 (18,987,622)	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額です。

2. 合計欄における( )内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
ドル	株式 58銘柄	72.68%		77.48%
	投資証券 3銘柄		1.49%	
カナダドル	株式 2銘柄	0.60%		0.63%
ユーロ	株式 15銘柄	8.40%		8.78%
ポンド	株式 7銘柄	4.27%		4.46%
スイスフラン	株式 1銘柄	1.69%		1.76%
スウェーデンクローナ	株式 1銘柄	0.58%		0.61%
ノルウェークローネ	株式 1銘柄	0.94%		0.98%
デンマーククローネ	株式 1銘柄	3.03%		3.16%
オーストラリアドル	株式 2銘柄	0.91%		0.95%
シンガポールドル	株式 2銘柄	1.14%		1.19%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## S N A M コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年11月2日現在
科 目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	52,893,492
コール・ローン	43,202,072
国債証券	1,479,905,887
派生商品評価勘定	27,952,495
未収入金	3,743,958
未収利息	21,771,346
前払費用	2,295,145
差入保証金	5,000,000
流動資産合計	1,636,764,395
資産合計	1,636,764,395
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	31,461,763
未払金	33,934,549
未払解約金	30,000,000
未払利息	127
その他未払費用	370
流動負債合計	95,396,809
負債合計	95,396,809
純資産の部	
元本等	
元本	1,090,864,825
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	450,502,761
元本等合計	1,541,367,586
純資産合計	1,541,367,586
負債純資産合計	1,636,764,395

## 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>直物為替先渡取引</p> <p>個別法による時価法によっております。時価評価にあたっては、原則として、価格提供会社の提供する価額で評価しております。</p>
4. 費用・収益の計上基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>有価証券売買等損益、為替差損益及び派生商品取引等損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</p> <p>但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

期別	2022年11月2日現在	
1. 受益権の総数		1,090,864,825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)	1.4130円 (14,130円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。

項目	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引及び直物為替先渡取引であります。</p> <p>為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>直物為替先渡取引は信託財産に属する資産の効率的な運用または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> <p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

項目	2022年11月2日現在
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

2022年11月2日現在
該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	自 2022年3月18日 至 2022年11月2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,724,427,739円
同期中追加設定元本額	80,130,811円
同期中一部解約元本額	713,693,725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）	89,558,536円
エマージング債券ファンド（為替戦略型）（FoFs用）（適格機関投資家専用）	649,876,808円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	201,503,852円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	115,028,963円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	34,324,858円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	571,808円
計	1,090,864,825円

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年11月2日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	104,993,302
合計	104,993,302

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	2022年11月2日 現在			
	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	789,535,293	-	798,922,552	9,387,259
ドル	363,567,544	-	369,602,044	6,034,500
メキシコペソ	16,388,763	-	16,781,269	392,506
ハンガリーフォリント	137,777,291	-	138,757,772	980,481
ポーランドズロチ	91,151,138	-	94,365,772	3,214,634
タイバーツ	17,059,873	-	17,315,590	255,717
ランド	33,664,604	-	33,237,993	426,611
オフショア人民元	129,926,080	-	128,862,112	1,063,968
売建	789,535,293	-	797,991,275	8,455,982
ドル	425,967,749	-	434,744,525	8,776,776
メキシコペソ	54,181,113	-	56,558,273	2,377,160
ハンガリーフォリント	51,962,210	-	51,443,035	519,175
ポーランドズロチ	19,055,582	-	19,377,891	322,309
タイバーツ	1,643,285	-	1,670,471	27,186
ランド	107,594,296	-	106,812,598	781,698
オフショア人民元	129,131,058	-	127,384,482	1,746,576
合計	1,579,070,586	-	1,596,913,827	931,277

## (注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

種類	2022年11月2日 現在			
	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 直物為替先渡取引				
買建	294,116,283	-	284,688,555	9,427,728
ブラジルリアル	28,451,628	-	29,149,902	698,274
チリアンペソ	52,149,896	-	50,775,322	1,374,574
コロンビアペソ	29,640,483	-	28,855,669	784,814
ペルーヌエボソル	13,426,353	-	13,378,865	47,488
フィリピンペソ	51,774,169	-	52,762,452	988,283

インドネシアルピア ウォン	6,425,180 112,248,574	- -	6,405,738 103,360,607	19,442 8,887,967
売建	355,296,799	-	350,309,616	4,987,183
ブラジルリアル	58,780,649	-	60,009,342	1,228,693
チリアンペソ	8,572,505	-	8,644,981	72,476
コロンビアペソ	42,345,988	-	38,722,138	3,623,850
ペルーヌエボソル	48,651,523	-	48,609,744	41,779
フィリピンペソ	3,856,009	-	3,893,757	37,748
インドネシアルピア ウォン	183,435,480 9,654,645	- -	180,769,101 9,660,553	2,666,379 5,908
合計	649,413,082	-	634,998,171	4,440,545

## (注) 時価の算定方法

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

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2022年11月2日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MEXICO 10.0 241205	10,494,000	10,435,023.72	
		MEXICO 4.5 351122	337,000	2,503,210.33	
		MEXICO 5.0 250306	6,371,000	5,684,078.78	
		MEXICO 7.5 270603	2,318,000	2,118,582.46	
		MEXICO 7.75 310529	5,118,000	4,498,517.28	
		MEXICO 7.75 421113	1,514,000	1,218,921.40	
		MEXICO 8.0 471107	2,747,000	2,247,979.98	
		MEXICO 8.5 290531	4,991,000	4,667,183.92	
		MEXICO 8.5 381118	3,219,000	2,829,114.72	
		メキシコペソ 合計		37,109,000	36,202,612.59 (270,969,314)
	ブラジルリアル	BRAZIL 6.0 350515	15,000	62,585.15	
		BRAZIL 10.0 250101	1,263,000	1,263,271.54	



	BRAZIL 10.0 270101	2,161,000	2,120,881.02	
	BRAZIL 10.0 290101	2,834,000	2,725,443.62	
	BRAZIL 10.0 310101	2,884,000	2,725,616.48	
	BRAZIL 6.0 500815	42,000	173,625.15	
ブラジルリアル 合計		9,199,000	9,071,422.96	(260,033,246)
チリアンペソ	CHILE 4.5 260301	25,000,000	23,432,646.00	
	CHILE 4.7 300901	100,000,000	89,704,028.00	
	CHILE 5 281001	70,000,000	64,670,575.90	
	CHILE 5 350301	15,000,000	13,378,830.30	
	CHILE 6 430101	40,000,000	39,175,246.80	
チリアンペソ 合計		250,000,000	230,361,327.00	(36,012,386)
コロンビアペソ	COLOMBIA 10.0 240724	22,600,000	21,661,332.05	
	COLOMBIA 5.75 271103	168,600,000	121,412,616.40	
	COLOMBIA 6.0 280428	969,300,000	686,025,137.98	
	COLOMBIA 6.25 251126	575,600,000	476,043,884.39	
	COLOMBIA 6.25 360709	602,100,000	321,260,317.39	
	COLOMBIA 7.0 310326	181,100,000	119,830,950.66	
	COLOMBIA 7.0 320630	1,170,100,000	742,282,854.45	
	COLOMBIA 7.25 341018	1,210,100,000	741,455,122.11	
	COLOMBIA 7.25 501026	162,500,000	85,825,952.87	
	COLOMBIA 7.5 260826	915,200,000	752,970,595.52	
	COLOMBIA 7.75 300918	957,100,000	675,586,128.80	
コロンビアペソ 合計		6,934,300,000	4,744,354,892.62	(139,896,792)
ペルーヌエボソル	PERU 5.35 400812	129,000	91,236.72	
	PERU 5.4 340812	400,000	308,566.91	
	PERU 5.94 290212	499,000	447,407.22	
	PERU 6.15 320812	351,000	298,790.89	
	PERU 6.35 280812	96,000	89,193.24	
	PERU 6.9 370812	106,000	90,909.97	
	PERU 6.95 310812	148,000	135,955.38	
ペルーヌエボソル 合計		1,729,000	1,462,060.33	(54,106,028)
ハンガリーフォリント	HUNGARY 3.0 381027	30,820,000	14,756,616.00	

	HUNGARY 4.5 280323	47,620,000	34,523,831.84
	HUNGARY 4.5 320527	20,090,000	13,286,459.79
	HUNGARY 4.75 321124	70,530,000	47,050,563.00
ハンガリーフォリント 合計		169,060,000	109,617,470.63 (39,339,737)
ポーランドズロチ	POLAND 1.25 301025	2,067,000	1,232,634.78
	POLAND 1.75 320425	880,000	508,376.00
	POLAND 2.75 280425	579,000	438,604.08
	POLAND 2.75 291025	841,000	594,452.44
	POLAND 3.75 270525	171,000	140,315.76
ポーランドズロチ 合計		4,538,000	2,914,383.06 (90,383,178)
マレーシアリングット	MALAYSIA 2.632 310415	1,661,000	1,441,720.31
	MALAYSIA 3.502 270531	394,000	382,814.23
	MALAYSIA 3.733 280615	441,000	427,771.67
	MALAYSIA 3.885 290815	204,000	197,420.76
	MALAYSIA 3.899 271116	1,004,000	990,837.56
	MALAYSIA 3.9 261130	413,000	411,035.90
	MALAYSIA 3.955 250915	1,360,000	1,362,323.42
	MALAYSIA 4.059 240930	681,000	687,034.40
マレーシアリングット 合計		6,158,000	5,900,958.25 (183,722,794)
タイバーツ	THAILAND 2 311217	2,800,000	2,555,535.50
タイバーツ 合計		2,800,000	2,555,535.50 (10,017,699)
インドネシアルピア	INDONESIA 6.25 360615	4,536,000,000	4,046,565,600.00
	INDONESIA 6.5 250615	5,309,000,000	5,254,070,962.40
	INDONESIA 7.0 270515	1,171,000,000	1,160,220,254.11
	INDONESIA 7.5 350615	4,309,000,000	4,286,849,930.22
	INDONESIA 7.5 400415	5,006,000,000	4,956,002,725.18
	INDONESIA 8.375 390415	2,676,000,000	2,845,358,688.00
インドネシアルピア 合計		23,007,000,000	22,549,068,159.91 (214,216,147)
ランド	S-AFRICA 6.25 360331	5,244,000	3,336,232.80
	S-AFRICA 6.5 410228	1,085,000	659,897.00
	S-AFRICA 7.0 310228	843,000	655,685.40

		S-AFRICA 8.5 370131	6,436,000	4,967,948.40	
		S-AFRICA 8.75 440131	6,132,000	4,673,810.40	
		S-AFRICA 8.75 480228	10,573,000	7,995,302.60	
	ランド	合計	30,313,000	22,288,876.60	(181,208,566)
合計				1,479,905,887	(1,479,905,887)

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額です。

2. 合計欄における( )内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額に対する比 率
メキシコペソ	国債証券 9銘柄	17.58%	18.32%
ブラジルレアル	国債証券 6銘柄	16.87%	17.57%
チリアンペソ	国債証券 5銘柄	2.34%	2.43%
コロンビアペソ	国債証券 11銘柄	9.08%	9.45%
ペルーヌエボソル	国債証券 7銘柄	3.51%	3.66%
ハンガリーフォリント	国債証券 4銘柄	2.55%	2.66%
ポーランドズロチ	国債証券 5銘柄	5.86%	6.11%
マレーシアリンギット	国債証券 8銘柄	11.92%	12.41%
タイバーツ	国債証券 1銘柄	0.65%	0.68%
インドネシアルピア	国債証券 6銘柄	13.90%	14.47%
ランド	国債証券 6銘柄	11.76%	12.24%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引等に関する注記)において表示した表は、「投資信託財産計算規則」附属明細表別紙様式第1号第3デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表に求められている項目(記載上の注意を含む。)を満たしているため、省略いたします。

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

#### SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065

2022年11月30日現在

資産総額	51,443,102円
負債総額	1,498,239円
純資産総額( - )	49,944,863円
発行済数量	46,539,388口
1単位当りの純資産額( / )	1.0732円

#### (参考) 損保ジャパン日本債券マザーファンド

2022年11月30日現在

資産総額	25,082,589,448円
負債総額	269,793,227円
純資産総額( - )	24,812,796,221円
発行済数量	17,790,700,094口
1単位当りの純資産額( / )	1.3947円

#### (参考) SJAMラージキャップ・バリュース・マザーファンド

2022年11月30日現在

資産総額	38,552,925,071円
負債総額	5,924円
純資産総額( - )	38,552,919,147円
発行済数量	15,655,066,618口
1単位当りの純資産額( / )	2.4626円

#### (参考) SJAMスモールキャップ・マザーファンド

2022年11月30日現在

資産総額	13,416,212,330円
負債総額	1,451円

純資産総額（ - ）	13,416,210,879円
発行済数量	4,467,927,827口
1単位当りの純資産額（ / ）	3.0028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11月30日現在

資産総額	11,293,924,819円
負債総額	1,484円
純資産総額（ - ）	11,293,923,335円
発行済数量	6,348,388,845口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.7790円

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

2022年11月30日現在

資産総額	1,288,172,403円
負債総額	364円
純資産総額（ - ）	1,288,172,039円
発行済数量	621,751,091口
1単位当りの純資産額（ / ）	2.0718円

（参考）S N A M コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

2022年11月30日現在

資産総額	1,591,520,230円
負債総額	26,500,034円
純資産総額（ - ）	1,565,020,196円
発行済数量	1,103,850,884口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.4178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12月末現在）

(略)

(2) 会社の機構（2021年12月末現在）

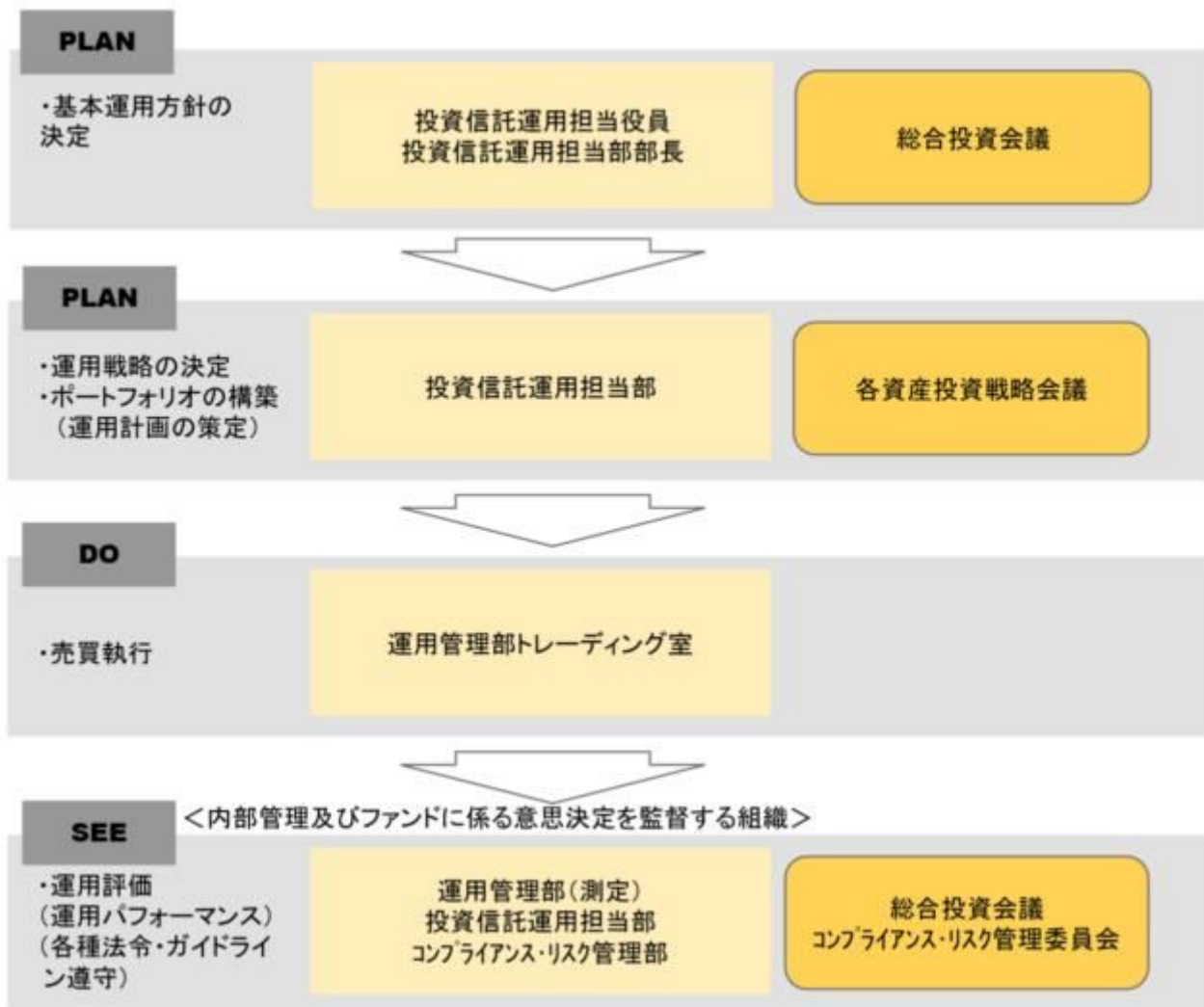
(略)

投資運用の意思決定機構

(略)

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

(略)



<訂正後>

(1) 資本金の額（2022年11月末現在）

(略)

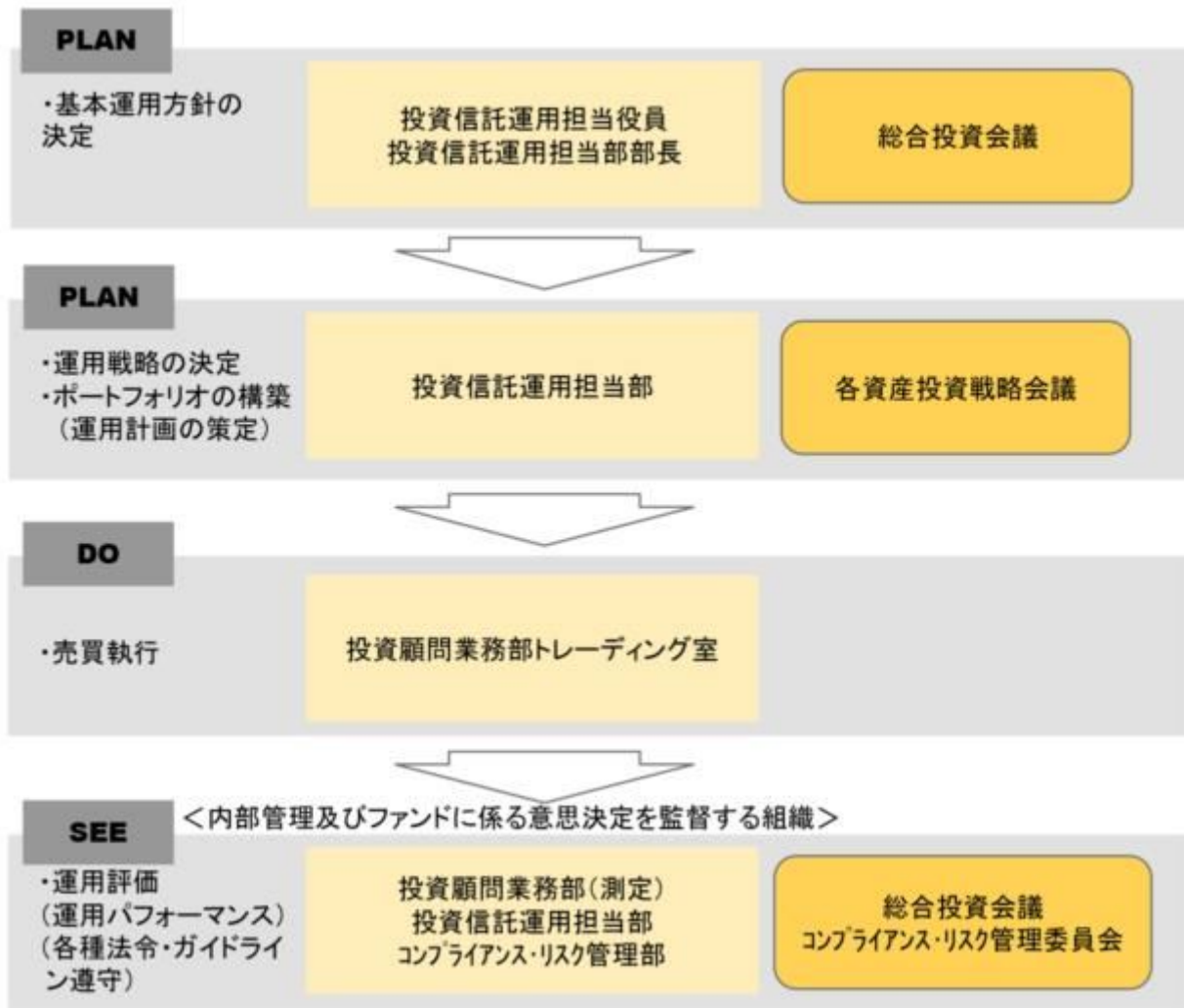
(2) 会社の機構（2022年11月末現在）

(略)

投資運用の意思決定機構

(略)

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



## 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11月末現在、計257本（追加型株式投資信託150本、単位型株式投資信託57本、単位型公社債投資信託50本）であり、その純資産総額の合計は1,523,343百万円です。

## 3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

- 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(2021年4月1日から2022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38期中間会計期間(2022年4月1日から2022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 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
(資産の部)					
流動資産					
1 現金・預金			2,945,148		3,870,549
2 前払費用			127,883		102,011
3 未収委託者報酬			1,163,524		1,137,463
4 未収運用受託報酬			698,718		1,220,102
5 その他			108,949		6,676
流動資産合計			5,044,225		6,336,803
固定資産					
1 有形固定資産					
(1) 建物	1		16,555		12,438
(2) 器具備品	1		113,426		97,847
有形固定資産合計			129,982		110,285
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			371,688		551,730
(2) 長期差入保証金			173,961		173,961
(3) 繰延税金資産			368,045		369,976
(4) その他			32		32
投資その他の資産合計			913,728		1,095,700
固定資産合計			1,048,245		1,210,521
資産合計			6,092,470		7,547,325

区分	注記 番号	前事業年度 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022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			6,525		6,032
2 未払金					
(1) 未払配当金	2	640,000		700,000	
(2) 未払手数料		449,942		421,565	
(3) その他未払金	2	138,332	1,228,275	526,525	1,648,091
3 未払費用			725,437		1,048,260
4 未払消費税等			74,945		191,700
5 未払法人税等			259,089		118,353
6 賞与引当金			130,032		171,866
7 役員賞与引当金			6,300		6,600
流動負債合計			2,430,606		3,190,904
固定負債					
1 退職給付引当金			177,918		208,284
2 資産除去債務			9,111		9,265
固定負債合計			187,029		217,549
負債合計			2,617,636		3,408,454
<b>(純資産の部)</b>					
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			1,469,821		2,129,605
利益剰余金合計			1,469,821		2,129,605
株主資本合計			3,433,101		4,092,885
評価・換算差額等					
1 その他有価証券評価差額金			41,732		45,985
評価・換算差額等合計			41,732		45,985
純資産合計			3,474,834		4,138,870
負債・純資産合計			6,092,470		7,547,325

**(2) 【損益計算書】**

区分	注記番号	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1 委託者報酬		5,130,232		6,276,724	
2 運用受託報酬		3,361,929	8,492,161	4,403,451	10,680,175
営業費用					
1 支払手数料		2,224,426		2,660,547	
2 広告宣伝費		14,138		27,018	
3 公告費		470		200	

4	調査費		2,203,386		2,998,033	
(1)	調査費		881,821		982,738	
(2)	委託調査費		1,318,730		2,012,478	
(3)	図書費		2,835		2,815	
5	営業雑経費		144,775		128,682	
(1)	通信費		13,988		13,042	
(2)	印刷費		114,745		97,704	
(3)	諸会費		16,041	4,587,196	17,935	5,814,481
	一般管理費					
1	給料		1,581,885		1,654,831	
(1)	役員報酬		62,931		57,475	
(2)	給料・手当		1,326,451		1,373,956	
(3)	賞与		192,502		223,399	
2	福利厚生費		199,204		207,945	
3	交際費		4,247		7,538	
4	寄付金		300		300	
5	旅費交通費		2,820		6,738	
6	法人事業税		45,366		56,077	
7	租税公課		31,417		30,211	
8	不動産賃借料		211,971		220,595	
9	退職給付費用		76,373		79,199	
10	賞与引当金繰入		130,032		171,866	
11	役員賞与引当金繰入		6,300		6,600	
12	固定資産減価償却費		26,025		37,983	
13	諸経費		344,942	2,660,886	428,184	2,908,072
営業利益				1,244,078		1,957,622
営業外収益						
1	受取配当金		326		626	
2	受取利息		-		0	
3	有価証券売却益		3,436		7,179	
4	有価証券償還益		-		1,198	
5	為替差益		360		10,426	
6	保険配当金		567		467	
7	雑益		742	5,432	1,537	21,434
営業外費用						
1	債権回収損		143		5,471	
2	雑損		484	627	363	5,835
経常利益				1,248,883		1,973,220
特別損失						
1	固定資産除却損	1	0		0	
2	商号変更費用		4,975	4,975	-	0
税引前当期純利益				1,243,908		1,973,220
法人税・住民税及び事業税				375,986		617,244
法人税等調整額				15,569		3,808
当期純利益				852,352		1,359,783

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	1,469,821	1,469,821	3,433,101
当期変動額						
剰余金の配当				700,000	700,000	700,000
当期純利益				1,359,783	1,359,783	1,359,783
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）						
当期変動額合 計	-	-	-	659,783	659,783	659,783

当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	2,129,605	2,129,605	4,092,885
-------	-----------	---------	---------	-----------	-----------	-----------

	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
当期変動額			
剰余金の配当			700,000
当期純利益			1,359,783
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	4,252	4,252	4,252
当期変動額合計	4,252	4,252	664,036
当期末残高	45,985	45,985	4,138,870

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### 有形固定資産

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	15年
器具備品	2～20年

### 3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 4. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

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

#### (2) 役員賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金

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

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

### 5. 収益及び費用の計上基準

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

- (1) 投資信託事業においては、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おります。
- (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おります。  
また、成功報酬型の収益は、投資顧問契約に基づき契約ごとに取り決めている運用パフォーマンスの結果に応じ、報酬を受領する権利が確定した時点で収益を認識しております。

## 6. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

### (1) 消費税等の会計処理

税抜方式を採用しております。

### (2) 連結納税制度の適用

当事業年度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。)等を当事業年度の期首から適用し、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、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。)等を当事業年度の期首から適用し、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、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。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日)第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

## 未適用の会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日 企業会計基準委員会)

### (1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

### (2) 適用予定日

2023年3月期の期首から適用します。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

- ・「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月12日 企業会計基準委員会)

## (1) 概要

2020年3月27日に成立した「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、連結納税制度を見直しグループ通算制度へ移行することとされたことを受け、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを明らかにすることを目的として企業会計基準委員会から公表されたものです。

## (2) 適用予定日

2023年3月期の期首から適用します。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

## 表示方法の変更

## (損益計算書)

前事業年度において、「営業外費用」の「雑損」に含めていた「債権回収損」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「雑損」に表示していた627千円は、「債権回収損」143千円及び「雑損」484千円として組み替えております。

## 注記事項

## (貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額は、次のとおりであります。

(単位：千円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
建物	95,327	99,675
器具備品	77,801	108,702

## 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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
未払金		
未払配当金	640,000	700,000
その他未払金	-	345,346

## (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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
器具備品	0	0

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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
2022年3月30日 取締役会	普通株式	700,000千円	29,063円	-	2022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

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

前事業年度(2021年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 未収委託者報酬	1,163,524	1,163,524	-
(2) 未収運用受託報酬	698,718	698,718	-
(3) 投資有価証券(2)	370,938	370,938	-
資産計	2,233,181	2,233,181	-
(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	-

当事業年度(2022年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 未収委託者報酬	1,137,463	1,137,463	-
(2) 未収運用受託報酬	1,220,102	1,220,102	-
(3) 投資有価証券(2)	550,980	550,980	-
資産計	2,908,546	2,908,546	-
(1) 未払金	1,226,525	1,226,525	-
(2) 未払費用	1,048,260	1,048,260	-
負債計	2,274,786	2,274,786	-

(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) 以下の市場価格のない株式等は、(4)投資有価証券には含まれておりません。当該金融商品の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:千円)

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
非上場株式	750	750

注1. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(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



当事業年度（2022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	3,870,414	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,137,463	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	1,220,102	-	-	-
(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	44,728	201,061	32,679	272,511
合計	6,272,708	201,061	32,679	272,511

注2. 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

## 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

(1) 時価で貸借対照表に計上している金融商品

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

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

(1) 投資有価証券のうち投資信託550,980千円は上記の表に含めておりません。

(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(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

当事業年度(2022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	473,762	404,700	69,062
	小計	473,762	404,700	69,062
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	77,218	80,000	2,782
	小計	77,218	80,000	2,782
合計		550,980	484,700	66,280

## 5. 売却したその他有価証券

前事業年度(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	-

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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	117,179	7,179	-
合計	117,179	7,179	-

## (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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	150,881	177,918
退職給付費用	32,311	34,032
退職給付の支払額	5,274	3,666
退職給付引当金の期末残高	177,918	208,284

## (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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	177,918	208,284
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	177,918	208,284
退職給付引当金	177,918	208,284
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	177,918	208,284

## (3) 退職給付費用

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	32,311	34,032

## 3. 確定拠出制度

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当社の確定拠出制度への要拠出額	33,790	37,490

## (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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022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	263,558	221,681
退職給付引当金	54,478	63,776
賞与引当金	39,815	52,625
未払事業税	16,148	25,882
繰延資産損金算入限度超過額	8,210	20,401
未払金否認	5,163	6,551
その他	5,409	5,629
繰延税金資産 小計	392,785	396,548
将来減算一時差異等の合計に係る評価性引当額	2,886	2,933
評価性引当額 小計	2,886	2,933
繰延税金資産 合計	389,899	393,615
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	18,418	20,295
株式譲渡損益	3,031	3,031

固定資産除去価額	405	313
繰延税金負債 合計	21,854	23,639
繰延税金資産の純額	368,045	369,976

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳  
 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要  
 本社事務所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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
期首残高	8,475	9,111
取得	485	-
時の経過による調整額	151	154
期末残高	9,111	9,265

(収益認識関係)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
投資信託事業	5,130,232	6,276,724
投資顧問事業(基本報酬)	3,361,929	3,421,061
投資顧問事業(成功報酬)	-	982,389
合計	8,492,161	10,680,175

(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 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	北米	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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	北米	中東	アジア	合計
9,517,226	543,068	371,551	203,473	44,855	10,680,175

(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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 (億円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当 事者との 関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	SOMPOホールディングス株式会社	東京都新宿区	1,000	経営管理	直接100%	連結納税	連結納税に伴う支払い	493,587	未払金(注1)	345,346

注1. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度による連結法人税等の支払予定額であります。

(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 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 (億円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当 事者との 関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパンDC証券株式会社	東京都新宿区	30	確定拠出年金業	-	投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託代行手数料の支払(注1)	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	172	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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 (億円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当 事者との 関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパンDCC証券株式会社	東京都新宿区	30	確定拠出年金業	-	投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託代行手数料の支払(注1)	625,470	未払手数料	147,871
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	172	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)	178,392	未収運用受託報酬	97,841

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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額(円)	144,273.79	171,844.33
1株当たり当期純利益金額(円)	35,389.35	56,457.70

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額は、潜在株式が存在しないため記載していません。

(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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益(千円)	852,352	1,359,783
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)	852,352	1,359,783
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38期中間会計期間 (2022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		2,701,381
2 前払費用		89,158
3 未収委託者報酬		1,251,986
4 未収運用受託報酬		846,335
5 立替金		2,492
流動資産合計		4,891,355
固定資産		
1 有形固定資産	1	96,656
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		494,492
(2) 長期差入保証金		173,961
(3) 繰延税金資産		335,169
(4) その他		32
投資その他の資産合計		1,003,656
固定資産合計		1,104,847
資産合計		5,996,202

第38期中間会計期間 (2022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		7,993
2 未払金		
(1) 未払手数料		448,093
(2) その他未払金		146,359
未払金合計		594,452
3 未払費用		539,231
4 未払法人税等		103,042
5 賞与引当金		114,828
6 役員賞与引当金		2,400
7 その他	2	5,807
流動負債合計		1,367,755
固定負債		
1 退職給付引当金		227,091
2 資産除去債務		9,344
固定負債合計		236,436
負債合計		1,604,191
(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		2,422,456
利益剰余金合計		2,422,456
株主資本合計		4,385,736
評価・換算差額等		
1 その他有価証券評価差額金		6,273
評価・換算差額等合計		6,273
純資産合計		4,392,010
負債・純資産合計		5,996,202

## (2) 中間損益計算書

		第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022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		3,085,206	
2 運用受託報酬		1,557,063	4,642,269
営業費用			
1 支払手数料		1,290,236	
2 広告宣伝費		6,778	
3 公告費		200	
4 調査費		1,365,758	
(1) 調査費		544,610	
(2) 委託調査費		818,905	
(3) 図書費		2,242	
5 営業雑経費		80,818	
(1) 通信費		7,044	
(2) 印刷費		57,397	
(3) 諸会費		16,376	
一般管理費			2,743,791
1 給料		820,216	
(1) 役員報酬		33,940	
(2) 給料・手当		723,290	
(3) 賞与		62,985	
2 福利厚生費		114,462	
3 交際費		3,518	
4 旅費交通費		11,123	
5 法人事業税		20,027	
6 租税公課		4,465	
7 不動産賃借料		111,720	
8 退職給付費用		43,778	
9 賞与引当金繰入		114,828	
10 役員賞与引当金繰入		2,400	
11 固定資産減価償却費	1	19,281	
12 諸経費		225,537	1,491,361
営業利益			407,116
営業外収益			
1 受取配当金		4,671	
2 受取利息		0	
3 有価証券償還益		5,371	
4 為替差益		19,156	
5 雑益		2,041	31,239
営業外費用			
1 雑損		8,154	8,154
経常利益			430,201
税引前中間純利益			430,201
法人税、住民税及び事業税			85,017
法人税等調整額			52,333
中間純利益			292,851

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022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	2,129,605	2,129,605	4,092,885



当中間期変動額						
中間純利益				292,851	292,851	292,851
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	-	-	-	292,851	292,851	292,851
当中間期末残高	1,550,000	413,280	413,280	2,422,456	2,422,456	4,385,736

	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	45,985	45,985	4,138,870
当中間期変動額			
中間純利益			292,851
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	39,711	39,711	39,711
当中間期変動 額合計	39,711	39,711	253,140
当中間期末残高	6,273	6,273	4,392,010

## 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おります。

#### (2) 役員賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金

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

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

#### 5. 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おります。

また、成功報酬型の収益は、信託約款に基づきファンドごとに取り決めている運用パフォーマンスの結果に応じ、報酬を受領する権利が確定した時点で収益を認識しております。

（2）投資顧問事業においては、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おります。

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

#### 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. グループ通算制度の適用

当中間会計期間からグループ通算制度を採用しております。

#### 会計方針の変更

（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の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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。

#### 追加情報

（グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱いの適用）

当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税ならびに税効果会計の会計処理及び開示については、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日。以下「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(1)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はありません。

#### 注記事項

（中間貸借対照表関係）

	第38期中間会計期間 (2022年9月30日)
1 有形固定資産の減価償却累計額	227,658千円
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38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
1 減価償却実施額 有形固定資産	19,281千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022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38期中間会計期間 (2022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
投資有価証券(2)	493,742	493,742	-
資産計	493,742	493,742	-

(1) 「現金・預金」、「未収委託者報酬」、「未収運用受託報酬」、「未払金」及び「未払費用」は短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(2) 市場価格のない株式等は、投資有価証券には含まれておりません。当該金融商品の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38期中間会計期間 (2022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	-	310,872	182,870	493,742
資産計	-	310,872	182,870	493,742

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

投資有価証券

投資信託は、基準価額によっておりレベル2又はレベル3の時価に分類しております。

(2) 期首残高から中間期末残高への調整表、中間会計期間の損益に記載した評価損益

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

(単位:千円)

	投資有価証券	合計
期首残高	180,730	180,730
中間会計期間の損益又は評価・換算差額等		
損益の計上	-	-
其他有価証券評価差額金	2,140	2,140
購入、売却、発行及び決済		
購入	-	-
売却	-	-
発行	-	-
決済	-	-
レベル3の時価への振替	-	-
レベル3の時価からの振替	-	-
中間期末残高	182,870	182,870
中間会計期間の損益に計上した額のうち中間貸借対照表において保有する金融資産又は金融負債の評価損益	-	-

(3) 時価の評価プロセスの説明

時価の算定にあたっては、投資信託の基準価額を用いております。

(有価証券関係)

第38期中間会計期間 (2022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	309,722	254,700	55,022
	小計	309,722	254,700	55,022
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	184,020	230,000	45,979
	小計	184,020	230,000	45,979
合計		493,742	484,700	9,042

## (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38期中間会計期間（2022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	9,265千円
時の経過による調整額	78千円
中間期末残高	9,344千円

## (収益認識関係)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

(単位：千円)

	第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
投資信託事業（基本報酬）	3,082,177
投資信託事業（成功報酬）	3,029
投資顧問事業（基本報酬）	1,557,063
合計	4,642,269

## (セグメント情報等)

セグメント情報

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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
4,177,359	232,244	161,501	46,781	24,382	4,642,269

(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38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
1株当たり純資産額	182,354.61 円
1株当たり中間純利益金額	12,159.08 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38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
中間純利益	292,851 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	292,851 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;

## (1) 受託会社

(略)

資本金の額

247,369百万円(2021年3月末現在)

(略)

&lt;再信託受託会社の概要&gt;

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

資本金の額 : 51,000百万円(2021年3月末現在)

(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
株式会社SBI証券 <sup>2</sup>	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社 <sup>3</sup>	7,495	

<sup>1</sup> 資本金の額は、2021年3月末現在

<sup>2</sup> 株式会社SBI証券は、2022年3月23日より取扱いを開始します。

<sup>3</sup> 楽天証券株式会社は、2022年3月18日より取扱いを開始します。

## (3) 投資顧問会社

(略)

資本金の額

1百万シンガポール・ドル（2021年11月末現在）

(略)

&lt;訂正後&gt;

## (1) 受託会社

(略)

資本金の額

247,369百万円（2022年3月末現在）

(略)

<再信託受託会社の概要>

名称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2022年3月末現在）

(略)

## (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
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。
株式会社SBI証券	48,323	
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	
楽天証券株式会社	17,495	

資本金の額は、2022年3月末現在

## (3) 投資顧問会社

(略)

資本金の額

1百万シンガポール・ドル（2022年11月末現在）

(略)





## 独立監査人の監査報告書

2023年1月5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 伊藤雅人  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSOMPOターゲットイヤー・ファンド2065の2022年3月18日から2022年11月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065の2022年11月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記の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

2022年6月10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

## 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2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

## 財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸

表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去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. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2022年11月25日

SOMPOアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 森重俊寛  
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2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022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2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年4月1日から2022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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。