

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

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2022年10月14日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）につきまして、半期報告書の提出に伴い、訂正すべき事項がありましたので、これを訂正するものであります。

2【訂正の内容】

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

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

(略)

<ファンドの特色>

(略)

TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY〔略称:TCW〕について

1971年設立。ロサンゼルスを拠点とするTCWグループ傘下の運用会社です。
2022年6月末現在の同グループの運用資産は、約2,203億米ドル(約30兆1,106億円[※])です。
※2022年6月末時点の為替レートで換算。

(略)

5

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

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

●東証株価指数(TOPIX)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社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。

●NOMURA-BPI総合指数とは、野村證券が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づき構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。なお、NOMURA-BPI総合指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

●FTSE 世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)とは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE 世界

国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

●MSCIコクサイ インデックスとは、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数です。MSCIコクサイ インデックス(円換算ベース)は、MSCIコクサイ インデックス(米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

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

<訂正後>

(略)

<ファンドの特色>

(略)

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

1971年設立。ロサンゼルスを拠点とするTCWグループ傘下の運用会社です。

2022年12月末現在の同グループの運用資産は、約2,051億米ドル(約27兆2,167億円[※])です。

※2022年12月末時点の為替レートで換算。

(略)

5

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

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

●東証株価指数(TOPIX)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社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。

●NOMURA-BPI総合指数とは、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が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づき構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。なお、NOMURA-BPI総合指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村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。

●FTSE 世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)とは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE 世界

国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

●MSCIコクサイ インデックスとは、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数です。MSCIコクサイ インデックス(円換算ベース)は、MSCIコクサイ インデックス(米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

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

(3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

(略)

委託会社等の概況

() 資本金の額 1,550百万円 (2022年7月末現在)

(略)

() 大株主の状況 (2022年7月末現在)

(略)

< 訂正後 >

(略)

委託会社等の概況

() 資本金の額 1,550百万円 (2023年1月末現在)

(略)

() 大株主の状況 (2023年1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

(略)

2022年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

<訂正後>

a．委託会社の運用体制と社内規程

(略)

2023年1月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

<訂正前>

b．運用委託先の運用体制等

(略)

(本組織図は、2022年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。)

<訂正後>

b．運用委託先の運用体制等

(略)

(本組織図は、2023年1月末現在のものであり、今後変更されることもあります。)

3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

<リスクの管理体制>

a．委託会社のリスク管理体制

(略)

(注)上図は、2022年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

(略)

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移

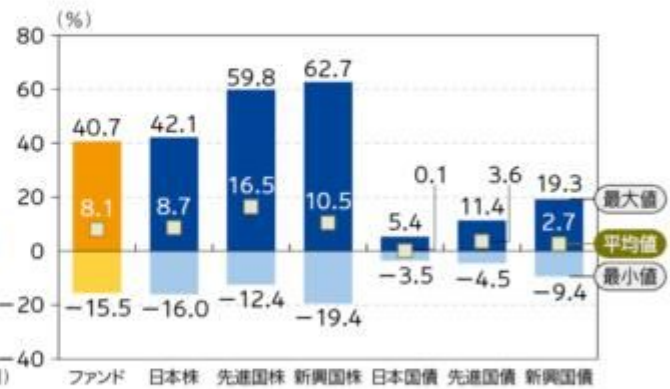
2017年8月～2022年7月

ハッピーエイジング20

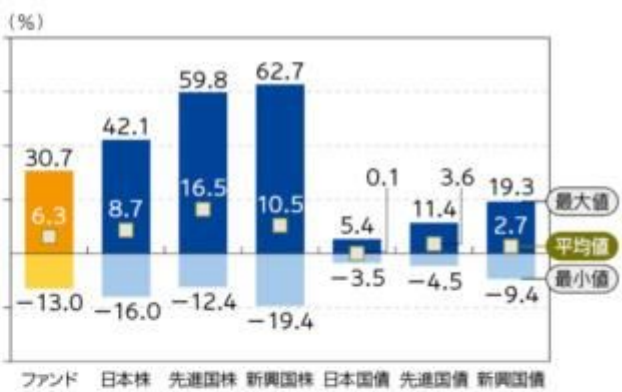


ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

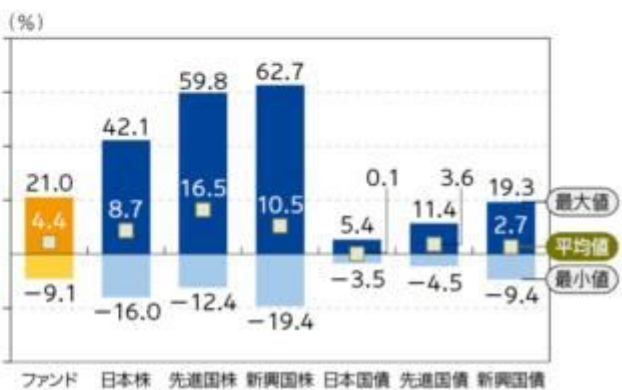
2017年8月～2022年7月



ハッピーエイジング30



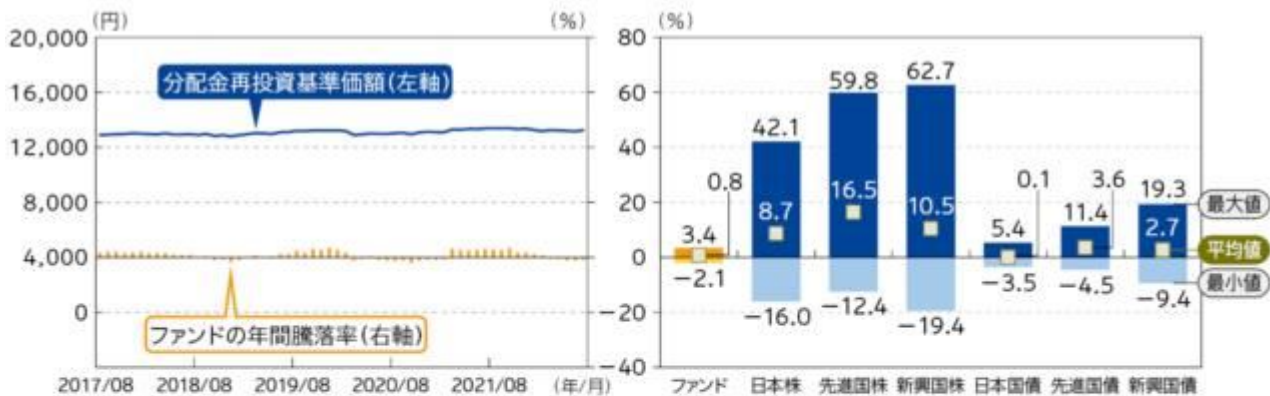
ハッピーエイジング40



ハッピーエイジング50



ハッピーエイジング60



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

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

代表的な資産クラスの指数

<p>日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)</p> <p>日本の株式市場を広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。</p>	<p>先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)</p> <p>MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。</p>
<p>新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)</p> <p>MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に円換算しています。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。</p>	<p>日本国債:NOMURA-BPI 国債</p> <p>野村証券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村証券株式会社に帰属します。</p>
<p>先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)</p> <p>FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE 世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p>	<p>新興国債:J PモルガンG B I - E Mグローバル・ディバースファイド(円ベース)</p> <p>J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、J PモルガンG B I - E Mグローバル・ディバー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。</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

(略)

（注）上図は、2023年1月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

（略）

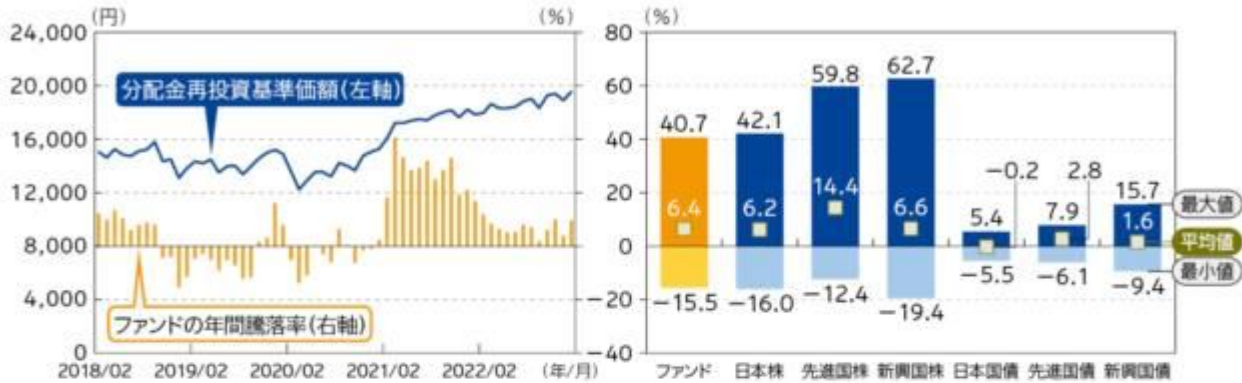
ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

2018年2月～2023年1月

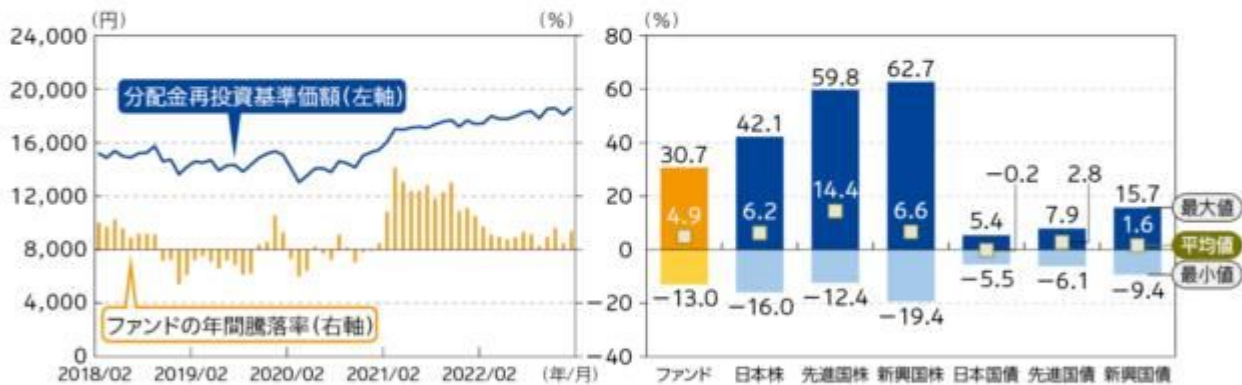
ファンドと他の代表的な資産クラスとの
騰落率の比較

2018年2月～2023年1月

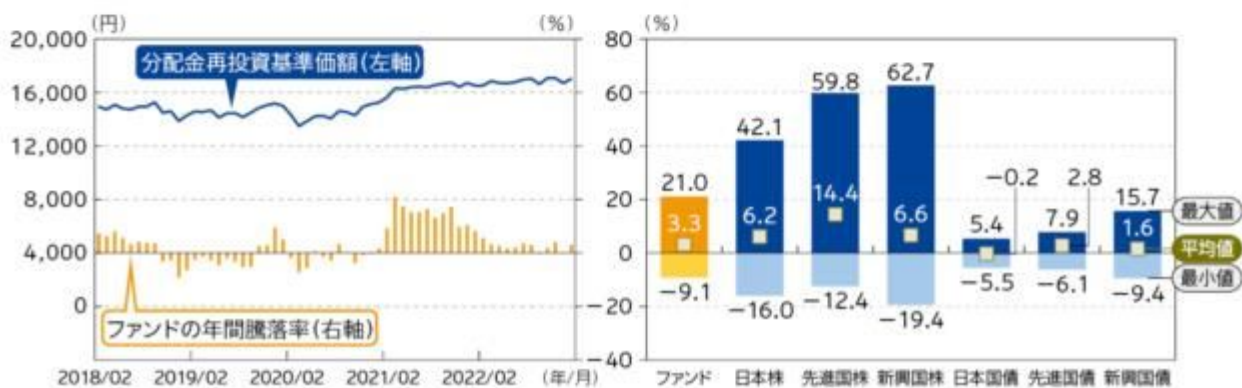
ハッピーエイジング20



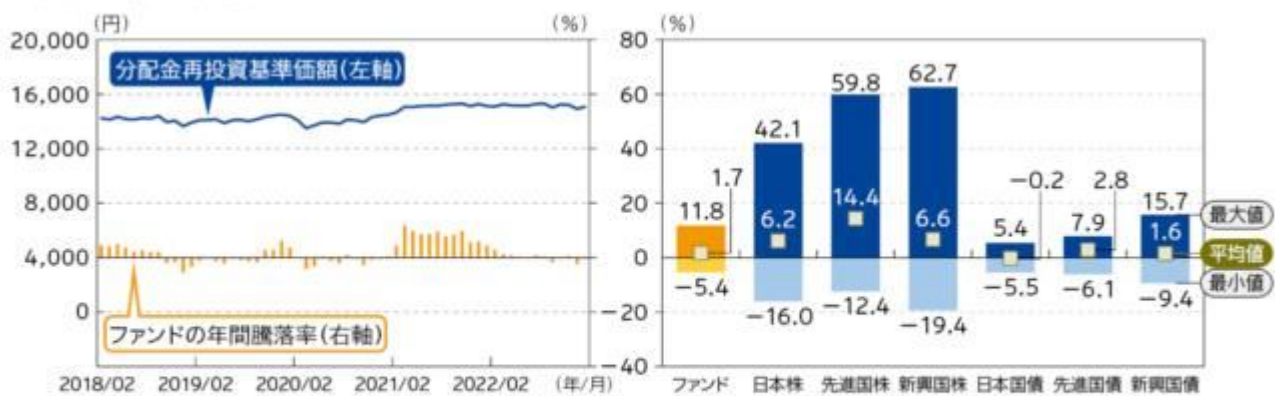
ハッピーエイジング30



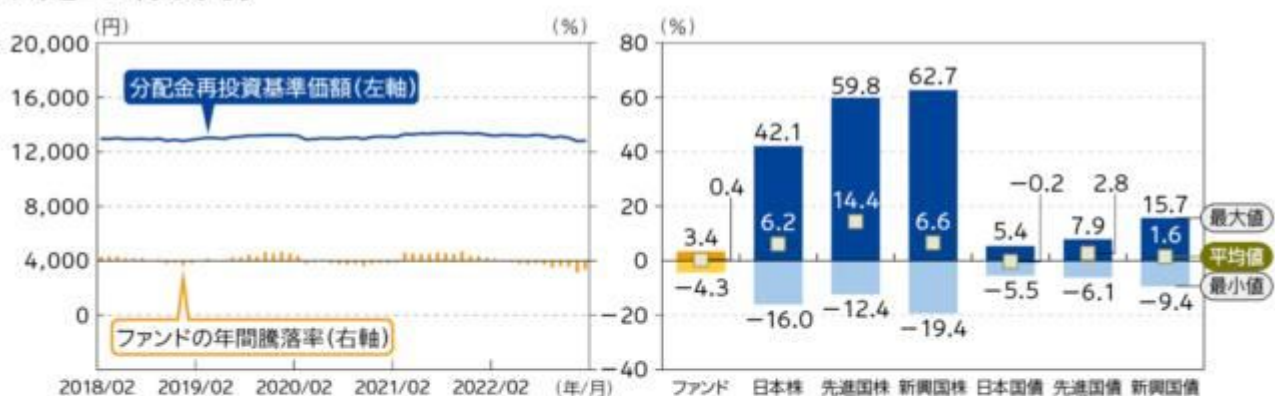
ハッピーエイジング40



ハッピーエイジング50



ハッピーエイジング60



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

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

代表的な資産クラスの指数

<p>日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)</p> <p>日本の株式市場を広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。</p>	<p>先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)</p> <p>MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。</p>
<p>新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)</p> <p>MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に円換算しています。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。</p>	<p>日本国債:NOMURA-BPI 国債</p> <p>野村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。</p>
<p>先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)</p> <p>FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE 世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p>	<p>新興国債:J P モルガン G B I - E M グローバル・ディバースファイド(円ベース)</p> <p>J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、J P モルガン G B I - E M グローバル・ディバー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。</p>

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

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

（略）

上記は2022年7月末現在のもので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

<訂正後>

（略）

上記は2023年1月末現在のもので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

（1）【投資状況】

ハッピーエイジング20

2023年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	790,240,382	4.79
親投資信託受益証券	日本	15,366,822,251	93.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		346,752,502	2.10
純資産総額		16,503,815,135	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ハッピーエイジング30

2023年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	852,067,458	4.69
親投資信託受益証券	日本	16,900,793,015	93.09
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		402,837,045	2.22
純資産総額		18,155,697,518	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ハッピーエイジング40

2023年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	1,038,225,264	4.68
親投資信託受益証券	日本	20,639,998,964	93.04

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		506,544,197	2.28
純資産総額		22,184,768,425	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ハッピーエイジング50

2023年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	252,594,883	2.60
親投資信託受益証券	日本	9,238,329,406	95.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		230,593,575	2.37
純資産総額		9,721,517,864	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ハッピーエイジング60

2023年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	5,177,391,487	97.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		106,134,492	2.01
純資産総額		5,283,525,979	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

2023年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	39,418,327,630	99.52
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		190,502,480	0.48
純資産総額		39,608,830,110	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

2023年1月31日現在

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

株式	日本	13,670,317,300	98.84
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		160,088,506	1.16
純資産総額		13,830,405,806	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2023年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	19,215,492,100	77.69
地方債証券	日本	981,001,000	3.97
特殊債券	日本	851,190,117	3.44
社債券	日本	3,226,531,000	13.05
	フランス	99,874,000	0.40
	イギリス	98,047,000	0.40
		3,424,452,000	13.85
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		259,839,083	1.05
純資産総額		24,731,974,300	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

2023年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	4,860,806,332	42.91
	フランス	1,351,980,095	11.94
	ドイツ	1,174,523,994	10.37
	イタリア	853,586,372	7.54
	スペイン	560,438,695	4.95
	イギリス	519,094,984	4.58
	中国	324,536,442	2.87
	カナダ	217,396,405	1.92
	ベルギー	205,686,283	1.82
	オーストラリア	170,561,686	1.51
	オランダ	167,319,694	1.48
	オーストリア	109,457,453	0.97
	メキシコ	96,287,815	0.85
	アイルランド	66,283,747	0.59
	マレーシア	59,589,115	0.53
	ポーランド	53,659,541	0.47

	フィンランド	43,379,261	0.38
	シンガポール	39,477,704	0.35
	デンマーク	35,247,971	0.31
	スウェーデン	26,184,076	0.23
	ノルウェー	24,528,944	0.22
		10,960,026,609	96.76
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		367,097,000	3.24
純資産総額		11,327,123,609	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

2023年1月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	12,812,227,065	70.58
	ドイツ	539,460,042	2.97
	アイルランド	441,678,359	2.43
	カナダ	417,085,583	2.30
	フランス	399,878,541	2.20
	イギリス	386,152,941	2.13
	スイス	254,548,048	1.40
	シンガポール	231,186,376	1.27
	オーストラリア	184,756,690	1.02
	オランダ	184,591,724	1.02
	スペイン	71,985,964	0.40
	スウェーデン	60,068,780	0.33
	デンマーク	41,974,109	0.23
	ベルギー	39,554,449	0.22
	パミュエダ	38,932,600	0.21
	プエルトリコ	23,602,211	0.13
	ケイマン	15,363,208	0.08
	ノルウェー	13,581,338	0.07
香港	13,268,385	0.07	
		16,169,896,413	89.07
投資証券	アメリカ	844,998,578	4.65
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,139,029,232	6.28
純資産総額		18,153,924,223	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

ハッピーエイジング20

2023年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - T C W外国株式マ ザーファンド	1,551,979,123	3.3240	5,158,862,625	3.4946	5,423,546,243	32.86
2	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド	1,394,952,238	2.7686	3,862,168,852	3.1050	4,331,326,698	26.24
3	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mラージキャップ・バ リユー・マザーファンド	1,664,944,065	2.3295	3,878,487,200	2.5790	4,293,890,743	26.02
4	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	577,152,533	1.8244	1,053,001,362	1.7135	988,950,865	5.99
5	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	119,136	6,139.31	731,413,843	6,633.09	790,240,382	4.79
6	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファ ンド	239,926,881	1.4132	339,078,183	1.3717	329,107,702	1.99

（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

2023年1月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	4.79
親投資信託受益証券	93.11
合計	97.90

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

ハッピーエイジング30

2023年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド	1,298,545,484	2.7663	3,592,166,373	3.1050	4,031,983,727	22.21
2	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mラージキャップ・バ リユー・マザーファンド	1,549,826,605	2.3293	3,610,011,112	2.5790	3,997,002,814	22.02
3	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - T C W外国株式マ ザーファンド	1,086,561,150	3.3213	3,608,795,548	3.4946	3,797,096,594	20.91
4	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	2,116,431,649	1.8273	3,867,483,949	1.7135	3,626,505,630	19.97
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	1,055,773,311	1.4140	1,492,894,911	1.3717	1,448,204,250	7.98

6	アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	128,457	6,111.58	785,075,754	6,633.09	852,067,458	4.69
---	------	----------	----------------------------	---------	----------	-------------	----------	-------------	------

（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

2023年1月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	4.69
親投資信託受益証券	93.09
合計	97.78

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

ハッピーエイジング40

2023年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファンド	5,324,519,765	1.4145	7,531,884,140	1.3717	7,303,643,761	32.92
2	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド	1,118,500,105	2.7623	3,089,701,701	3.1050	3,472,942,826	15.65
3	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mラージキャップ・バ リュウ・マザーファンド	1,335,004,579	2.3292	3,109,492,666	2.5790	3,442,976,809	15.52
4	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	1,940,699,354	1.8278	3,547,343,127	1.7135	3,325,388,343	14.99
5	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - T C W外国株式マ ザーファンド	885,665,663	3.3187	2,939,258,636	3.4946	3,095,047,225	13.95
6	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	156,522	6,125.29	958,743,882	6,633.09	1,038,225,264	4.68

（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

2023年1月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	4.68
親投資信託受益証券	93.04
合計	97.72

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

ハッピーエイジング50

2023年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファンド	4,034,060,921	1.4151	5,708,858,809	1.3717	5,533,521,365	56.92
2	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド	624,259,731	1.8289	1,141,748,541	1.7135	1,069,669,049	11.00
3	日本	親投資信託 受益証券	SJAMスモールキャップ・マザーファンド	300,717,182	2.7663	831,873,941	3.1050	933,726,850	9.60
4	日本	親投資信託 受益証券	SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	358,906,064	2.3288	835,820,442	2.5790	925,618,739	9.52
5	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド	221,997,769	3.3217	737,409,990	3.4946	775,793,403	7.98
6	アメリカ	投資信託 受益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	38,081	6,127.41	233,337,995	6,633.09	252,594,883	2.60

（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

2023年1月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	2.60
親投資信託受益証券	95.03
合計	97.63

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

ハッピーエイジング60

2023年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファンド	2,770,523,272	1.4157	3,922,308,356	1.3717	3,800,326,772	71.93
2	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド	493,694,355	1.8309	903,904,995	1.7135	845,945,277	16.01
3	日本	親投資信託 受益証券	SJAMスモールキャップ・マザーファンド	68,846,768	2.7619	190,147,889	3.1050	213,769,214	4.05
4	日本	親投資信託 受益証券	SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	82,161,633	2.3280	191,272,282	2.5790	211,894,851	4.01
5	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド	30,176,665	3.3220	100,246,882	3.4946	105,455,373	2.00

（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

2023年1月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.99
合計	97.99

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）S J A Mラージキャップ・バリュース・マザーファンド

2023年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	3,246,200	734.71	2,385,015,602	952.70	3,092,654,740	7.81
2	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	490,300	4,196.16	2,057,377,248	5,652.00	2,771,175,600	7.00
3	日本	株式	アイシン	輸送用機器	534,200	3,808.03	2,034,251,710	3,780.00	2,019,276,000	5.10
4	日本	株式	キリンホールディングス	食料品	1,002,700	2,036.81	2,042,309,387	1,999.00	2,004,397,300	5.06
5	日本	株式	三井住友トラスト・ホールディングス	銀行業	392,100	4,128.16	1,618,651,536	4,735.00	1,856,593,500	4.69
6	日本	株式	東レ	繊維製品	2,210,700	675.70	1,493,769,990	795.80	1,759,275,060	4.44
7	日本	株式	東京瓦斯	電気・ガス業	601,300	2,387.32	1,435,495,516	2,719.00	1,634,934,700	4.13
8	日本	株式	鹿島建設	建設業	998,700	1,530.62	1,528,634,474	1,594.00	1,591,927,800	4.02
9	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	495,900	3,481.14	1,726,298,165	3,207.00	1,590,351,300	4.02
10	日本	株式	マキタ	機械	455,800	3,171.86	1,445,736,366	3,440.00	1,567,952,000	3.96
11	日本	株式	日本精工	機械	2,067,700	741.53	1,533,278,942	728.00	1,505,285,600	3.80
12	日本	株式	スタンレー電気	電気機器	402,300	2,467.29	992,591,397	2,778.00	1,117,589,400	2.82
13	日本	株式	T H K	機械	382,900	2,660.03	1,018,525,487	2,736.00	1,047,614,400	2.64
14	日本	株式	日揮ホールディングス	建設業	593,300	1,305.51	774,559,083	1,691.00	1,003,270,300	2.53
15	日本	株式	旭化成	化学	983,700	978.46	962,516,710	982.40	966,386,880	2.44
16	日本	株式	王子ホールディングス	パルプ・紙	1,781,200	576.31	1,026,523,372	536.00	954,723,200	2.41
17	日本	株式	住友重機械工業	機械	308,400	2,809.38	866,412,792	2,877.00	887,266,800	2.24
18	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	2,264.00	870,281,600	2.20
19	日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	278,300	2,537.44	706,169,552	3,041.00	846,310,300	2.14
20	日本	株式	総合警備保障	サービス業	232,600	3,704.53	861,673,678	3,570.00	830,382,000	2.10
21	日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	501,600	1,542.75	773,846,029	1,554.50	779,737,200	1.97

22	日本	株式	スズケン	卸売業	221,400	3,679.67	814,678,938	3,415.00	756,081,000	1.91
23	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	1,294,300	471.42	610,158,906	570.00	737,751,000	1.86
24	日本	株式	三菱地所	不動産業	435,400	1,852.09	806,402,645	1,671.50	727,771,100	1.84
25	日本	株式	クレディセゾン	その他金 融業	425,000	1,435.54	610,104,500	1,698.00	721,650,000	1.82
26	日本	株式	アルプスアルバイ	電気機器	510,100	1,238.07	631,539,507	1,323.00	674,862,300	1.70
27	日本	株式	日本ハム	食料品	169,500	3,717.58	630,130,096	3,900.00	661,050,000	1.67
28	日本	株式	パナソニック ホー ルディングス	電気機器	502,000	1,154.80	579,711,179	1,200.00	602,400,000	1.52
29	日本	株式	J F E ホールディ ングス	鉄鋼	344,200	1,621.60	558,154,720	1,707.00	587,549,400	1.48
30	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	4,015.00	584,985,500	1.48

(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

2023年1月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	7.71
		食料品	6.73
		繊維製品	4.44
		パルプ・紙	2.41
		化学	2.44
		医薬品	2.60
		鉄鋼	1.48
		非鉄金属	1.97
		機械	12.64
		電気機器	6.05
		輸送用機器	10.35
		電気・ガス業	4.13
		陸運業	2.20
		情報・通信業	1.42
		卸売業	1.91
		銀行業	21.35
		保険業	3.44
		その他金融業	1.82
不動産業	2.33		
サービス業	2.10		
合計			99.52

(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

2023年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （%）
1	日本	株式	シチズン時計	精密機器	846,200	602.42	509,767,804	616.00	521,259,200	3.77
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	338.00	473,943,600	3.43
3	日本	株式	八十二銀行	銀行業	813,100	473.27	384,815,837	563.00	457,775,300	3.31
4	日本	株式	森永乳業	食料品	94,600	4,023.31	380,605,126	4,805.00	454,553,000	3.29
5	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	731.00	376,538,100	2.72
6	日本	株式	エン・ジャパン	サービス業	151,900	2,355.97	357,871,843	2,460.00	373,674,000	2.70
7	日本	株式	E I Z O	電気機器	101,600	3,780.84	384,133,344	3,625.00	368,300,000	2.66
8	日本	株式	豊田合成	輸送用機器	165,700	2,297.62	380,716,776	2,149.00	356,089,300	2.57
9	日本	株式	ジェイテクト	機械	370,400	991.22	367,149,936	959.00	355,213,600	2.57
10	日本	株式	日本テレビホールディングス	情報・通信業	326,500	1,160.23	378,816,692	1,048.00	342,172,000	2.47
11	日本	株式	群馬銀行	銀行業	662,100	383.29	253,776,309	506.00	335,022,600	2.42
12	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	3,090.00	315,798,000	2.28
13	日本	株式	東邦ホールディングス	卸売業	144,200	1,850.54	266,848,396	2,119.00	305,559,800	2.21
14	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	1,025.00	304,425,000	2.20
15	日本	株式	北洋銀行	銀行業	999,000	223.45	223,226,550	281.00	280,719,000	2.03
16	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	1,294.00	277,174,800	2.00
17	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	254,900	729.97	186,069,353	1,078.00	274,782,200	1.99
18	日本	株式	トラスコ中山	卸売業	128,900	1,942.18	250,347,267	2,120.00	273,268,000	1.98
19	日本	株式	日本ライフライン	卸売業	272,600	984.58	268,396,508	950.00	258,970,000	1.87
20	日本	株式	マブチモーター	電気機器	66,200	3,927.61	260,007,782	3,705.00	245,271,000	1.77
21	日本	株式	東洋インキS Cホールディングス	化学	126,700	1,876.01	237,691,631	1,862.00	235,915,400	1.71
22	日本	株式	東亜合成	化学	195,400	1,087.21	212,440,834	1,175.00	229,595,000	1.66
23	日本	株式	クレディセゾン	その他金融業	115,000	1,718.29	197,603,350	1,698.00	195,270,000	1.41
24	日本	株式	九州フィナンシャルグループ	銀行業	404,500	376.47	152,284,906	476.00	192,542,000	1.39
25	日本	株式	ワコールホールディングス	繊維製品	76,000	2,218.66	168,618,160	2,437.00	185,212,000	1.34
26	日本	株式	七十七銀行	銀行業	79,800	1,748.25	139,510,350	2,314.00	184,657,200	1.34
27	日本	株式	住友精化	化学	42,800	3,126.60	133,818,480	4,145.00	177,406,000	1.28
28	日本	株式	ケーズホールディングス	小売業	145,200	1,190.54	172,867,121	1,147.00	166,544,400	1.20
29	日本	株式	青山商事	小売業	184,000	940.90	173,125,600	905.00	166,520,000	1.20
30	日本	株式	百五銀行	銀行業	394,800	316.32	124,883,136	419.00	165,421,200	1.20

（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

2023年1月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	1.16
		食料品	3.29
		繊維製品	2.16
		パルプ・紙	1.18
		化学	7.54
		医薬品	2.30
		ガラス・土石製品	0.96
		鉄鋼	0.98
		金属製品	1.04
		機械	2.92
		電気機器	7.73
		輸送用機器	4.69
		精密機器	3.77
		その他製品	0.29
		電気・ガス業	1.98
		陸運業	2.00
		情報・通信業	3.18
		卸売業	6.56
		小売業	7.49
		銀行業	27.50
その他金融業	1.41		
不動産業	0.81		
サービス業	7.89		
合計			98.84

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

(参考) 損保ジャパン日本債券マザーファンド

2023年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率(%)	償還日	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	1,610,000,000	98.79	1,590,576,200	99.08	1,595,252,400	0.1000000	2028/9/20	6.45
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	103.22	1,280,014,800	1.2000000	2035/9/20	5.18
3	日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	1,000,000,000	97.39	973,930,000	96.25	962,510,000	0.1000000	2031/9/20	3.89
4	日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	990,000,000	98.64	976,536,000	96.85	958,874,400	0.1000000	2030/12/20	3.88
5	日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	800,000,000	100.04	800,352,000	99.69	797,520,000	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	99.95	699,706,000	0.1000000	2027/3/20	2.83
7	日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	660,000,000	100.09	660,594,000	97.12	641,031,600	0.2000000	2032/3/20	2.59
8	日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	640,000,000	100.18	641,152,000	99.93	639,596,800	0.0050000	2026/3/20	2.59
9	日本	国債証券	第159回利付国債(20年)	640,000,000	100.66	644,275,200	94.49	604,736,000	0.6000000	2036/12/20	2.45
10	日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	600,000,000	100.48	602,892,000	100.22	601,356,000	0.1000000	2025/6/20	2.43
11	日本	国債証券	第174回利付国債(20年)	700,000,000	93.20	652,463,000	85.85	601,006,000	0.4000000	2040/9/20	2.43
12	日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	600,000,000	98.22	589,330,000	98.25	589,512,000	0.1000000	2029/9/20	2.38
13	日本	国債証券	第180回利付国債(20年)	480,000,000	95.53	458,580,500	90.74	435,556,800	0.8000000	2042/3/20	1.76
14	日本	国債証券	第166回利付国債(20年)	440,000,000	94.50	415,823,200	93.35	410,766,400	0.7000000	2038/9/20	1.66
15	日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	410,000,000	99.78	409,123,100	99.43	407,675,300	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	100.23	400,936,000	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	1.62
18	日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	400,000,000	99.45	397,800,000	98.02	392,092,000	0.1000000	2029/12/20	1.59
19	日本	国債証券	第171回利付国債(20年)	450,000,000	90.74	408,337,000	85.56	385,033,500	0.3000000	2039/12/20	1.56
20	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	96.18	384,748,000	0.1000000	2030/6/20	1.56
21	日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	360,000,000	109.40	393,847,200	103.77	373,597,200	1.2000000	2034/12/20	1.51
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	103.83	311,517,000	1.1760000	2029/1/26	1.26
23	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	100.79	302,397,000	0.6590000	2024/6/25	1.22
24	日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	300,000,000	100.19	300,591,000	99.41	298,248,000	0.1000000	2028/3/20	1.21
25	日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	270,000,000	114.86	310,122,000	109.89	296,703,000	1.7000000	2033/6/20	1.20
26	日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	300,000,000	98.91	296,748,000	97.13	291,390,000	0.1000000	2030/9/20	1.18
27	日本	国債証券	第181回利付国債(20年)	280,000,000	95.79	268,224,000	92.23	258,263,600	0.9000000	2042/6/20	1.04
28	日本	国債証券	第58回利付国債(30年)	300,000,000	93.06	279,189,000	84.67	254,025,000	0.8000000	2048/3/20	1.03

29	日本	国債証券	第43回利付 国債(30 年)	240,000,000	114.01	273,624,000	104.85	251,640,000	1.7000000	2044/6/20	1.02
30	日本	国債証券	第439回利 付国債(2 年)	250,000,000	100.13	250,325,000	100.05	250,147,500	0.0050000	2024/8/1	1.01

(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

2023年1月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	77.69
地方債証券	3.97
特殊債券	3.44
社債券	13.85
合計	98.95

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考) 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

2023年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率(%)	償還日	投資 比率 (%)
1	ドイツ	国債証券	GERMANY 1.5 240515	4,600,000	14,049.38	646,271,511	13,951.80	641,783,227	1.5000000	2024/5/15	5.67
2	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 280215	4,660,000	12,812.56	597,065,376	12,475.68	581,366,881	2.7500000	2028/2/15	5.13
3	フランス	国債証券	FRA 0.00 240325	4,100,000	13,756.46	564,015,101	13,718.76	562,469,309	0.0000000	2024/3/25	4.97
4	アメリカ	国債証券	Treasury 2.125 240229	3,490,000	12,799.17	446,691,045	12,683.62	442,658,362	2.1250000	2024/2/29	3.91
5	アメリカ	国債証券	Treasury 2.125 250515	2,580,000	12,675.16	327,019,141	12,471.09	321,754,311	2.1250000	2025/5/15	2.84
6	イタリア	国債証券	ITALY 2.8 281201	2,350,000	13,437.89	315,790,492	13,528.88	317,928,897	2.8000000	2028/12/1	2.81
7	アメリカ	国債証券	Treasury 0.75 260331	2,520,000	11,956.77	301,310,782	11,832.50	298,179,195	0.7500000	2026/3/31	2.63
8	スペイン	国債証券	SPAIN 0.0 280131	2,410,000	12,234.15	294,843,150	12,228.26	294,701,168	0.0000000	2028/1/31	2.60
9	アメリカ	国債証券	Treasury 1.25 310815	2,400,000	11,476.14	275,427,389	10,899.34	261,584,193	1.2500000	2031/8/15	2.31
10	アメリカ	国債証券	Treasury 1.75 410815	2,730,000	10,012.55	273,342,703	9,463.66	258,357,966	1.7500000	2041/8/15	2.28
11	アメリカ	国債証券	Treasury 2.25 270815	2,000,000	12,095.48	241,909,726	12,246.85	244,937,040	2.2500000	2027/8/15	2.16
12	アメリカ	国債証券	Treasury 1.5 270131	1,800,000	12,189.62	219,413,334	11,942.08	214,957,479	1.5000000	2027/1/31	1.90

13	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 250228	1,690,000	12,904.78	218,090,912	12,664.25	214,025,892	2.7500000	2025/2/28	1.89
14	アメリカ	国債証券	Treasury 4.125 321115	1,400,000	13,501.82	189,025,548	13,662.65	191,277,175	4.1250000	2032/11/15	1.69
15	アメリカ	国債証券	Treasury 2.25 270215	1,460,000	12,568.17	183,495,356	12,305.97	179,667,177	2.2500000	2027/2/15	1.59
16	アメリカ	国債証券	Treasury 2.375 290515	1,310,000	12,782.14	167,446,111	12,109.24	158,631,134	2.3750000	2029/5/15	1.40
17	アメリカ	国債証券	Treasury 3.0 480215	1,340,000	12,409.42	166,286,359	11,404.91	152,825,830	3.0000000	2048/2/15	1.35
18	アメリカ	国債証券	Treasury 1.75 291115	1,310,000	11,510.04	150,781,630	11,643.93	152,535,585	1.7500000	2029/11/15	1.35
19	フランス	国債証券	FRANCE 1.0 270525	1,140,000	13,692.92	156,099,373	13,236.48	150,895,904	1.0000000	2027/5/25	1.33
20	アメリカ	国債証券	Treasury 3.125 290831	1,100,000	12,430.83	136,739,185	12,648.45	139,133,003	3.1250000	2029/8/31	1.23
21	ベルギー	国債証券	BELGIUM 3.0 340622	970,000	15,931.03	154,531,049	14,138.82	137,146,571	3.0000000	2034/6/22	1.21
22	ドイツ	国債証券	GERMANY 1.7 320815	1,000,000	14,084.79	140,847,954	13,472.12	134,721,237	1.7000000	2032/8/15	1.19
23	フランス	国債証券	FRANCE 0.0 291125	1,110,000	12,852.43	142,662,016	11,872.09	131,780,302	0.0000000	2029/11/25	1.16
24	中国	国債証券	CGB 2.6 320901	7,000,000	1,908.34	133,584,011	1,876.59	131,361,426	2.6000000	2032/9/1	1.16
25	アメリカ	国債証券	Treasury 1.625 310515	1,090,000	11,701.01	127,541,099	11,298.90	123,158,072	1.6250000	2031/5/15	1.09
26	アメリカ	国債証券	Treasury 2.875 490515	1,040,000	12,297.81	127,897,293	11,176.08	116,231,237	2.8750000	2049/5/15	1.03
27	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 320815	950,000	11,976.12	113,773,153	12,217.29	116,064,277	2.7500000	2032/8/15	1.02
28	中国	国債証券	CGB 2.8 290324	6,000,000	1,933.55	116,013,204	1,925.45	115,527,438	2.8000000	2029/3/24	1.02
29	イタリア	国債証券	ITALY 1.45 250515	820,000	13,599.66	111,517,287	13,625.23	111,726,926	1.4500000	2025/5/15	0.99
30	イタリア	国債証券	ITALY 4.0 370201	810,000	15,095.64	122,274,705	13,743.72	111,324,137	4.0000000	2037/2/1	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

2023年1月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	96.76
合計	96.76

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド

2023年1月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	18,048	32,737.38	590,844,261	31,666.37	571,514,713	3.15
2	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	18,373	26,848.11	493,280,447	29,890.67	549,181,409	3.03
3	カナダ	株式	WASTE CONNECTIONS INC	商業・専門サービス	24,403	16,220.03	395,817,402	17,091.57	417,085,583	2.30
4	アメリカ	株式	FISERV INC	ソフトウェア・サービス	28,720	12,350.29	354,700,335	13,797.20	396,255,656	2.18
5	アメリカ	株式	MSCI INC	各種金融	5,155	53,507.05	275,828,852	66,090.88	340,698,503	1.88
6	アメリカ	株式	DANAHER CORP	ヘルスケア機器・サービス	9,766	32,364.38	316,070,615	34,280.99	334,788,173	1.84
7	アメリカ	株式	S&P GLOBAL INC	各種金融	6,755	45,027.80	304,162,833	47,770.28	322,688,281	1.78
8	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	6,348	42,405.35	269,189,222	48,420.02	307,370,328	1.69
9	アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア・サービス	26,885	9,469.70	254,593,027	11,396.55	306,396,368	1.69
10	アメリカ	株式	TRADE DESK INC/THE - CLASS A	ソフトウェア・サービス	43,736	5,392.32	235,838,731	6,421.73	280,860,932	1.55
11	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	12,682	22,307.76	282,907,020	22,112.05	280,425,089	1.54
12	アイルランド	株式	LINDE PUBLIC LIMITED	素材	6,368	35,170.26	223,964,275	42,406.66	270,045,637	1.49
13	アメリカ	株式	ALPHABET, INC	メディア・娯楽	19,191	14,495.99	278,192,609	12,779.53	245,252,085	1.35
14	アメリカ	株式	METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,183	148,503.56	175,679,716	196,671.78	232,662,719	1.28
15	アメリカ	株式	SERVICENOW INC	ソフトウェア・サービス	3,917	54,854.80	214,866,279	57,742.10	226,175,837	1.25
16	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	8,854	19,989.30	176,985,339	25,000.66	221,355,856	1.22
17	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	15,809	14,439.11	228,267,967	13,118.75	207,394,453	1.14
18	アメリカ	株式	LENNAR CORP-CL A	耐久消費財・アパレル	14,797	10,206.85	151,030,800	12,945.23	191,550,619	1.06
19	アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORP		6,596	33,264.63	219,413,507	28,450.28	187,658,101	1.03
20	アメリカ	株式	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	各種金融	3,407	51,726.13	176,230,946	54,878.29	186,970,339	1.03
21	アメリカ	株式	MCKESSON HBOC INC	ヘルスケア機器・サービス	3,512	42,653.25	149,798,222	49,407.68	173,519,787	0.96
22	アメリカ	株式	JP MORGAN CHASE & CO	銀行	9,545	14,167.84	135,232,101	18,152.29	173,263,619	0.95
23	アメリカ	株式	CENTENE CORP	ヘルスケア機器・サービス	17,651	11,166.92	197,107,434	9,746.10	172,028,570	0.95
24	アメリカ	株式	HEICO CORP	資本財	7,655	17,352.50	132,833,464	22,089.87	169,097,998	0.93
25	アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	7,733	20,942.28	161,946,666	21,494.93	166,220,313	0.92
26	アメリカ	株式	AGILENT TECHNOLOGIES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8,303	15,118.86	125,531,924	19,797.51	164,378,790	0.91

27	アメリカ	株式	MOTOROLA SOLUTIONS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4,732	27,368.69	129,508,650	32,909.75	155,728,950	0.86
28	アメリカ	株式	DARDEN RESTAURANTS	消費者サービス	8,024	15,674.26	125,770,288	19,168.65	153,809,267	0.85
29	アメリカ	株式	ON SEMICONDUCTOR CORP	半導体・半導体製造装置	16,541	7,051.90	116,645,536	9,265.97	153,268,565	0.84
30	アイルランド	株式	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	資本財	16,726	6,056.41	101,299,638	8,905.88	148,959,786	0.82

（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

2023年1月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国		0.04
		エネルギー	1.55
			0.82
		素材	4.07
		資本財	4.67
		商業・専門サービス	3.88
		運輸	1.06
		自動車・自動車部品	0.80
		耐久消費財・アパレル	2.43
		消費者サービス	1.09
		メディア・娯楽	3.94
		小売	3.93
		食品・生活必需品小売り	0.80
		食品・飲料・タバコ	3.38
		家庭用品・パーソナル用品	0.46
		ヘルスケア機器・サービス	6.42
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.14
		銀行	2.92
		各種金融	9.63
		保険	2.25
不動産	0.94		
ソフトウェア・サービス	18.32		
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.67		
電気通信サービス	0.70		
公益事業	1.09		
半導体・半導体製造装置	4.06		
投資証券			4.65
合計			93.73

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

【投資不動産物件】

ハッピーエイジング20

該当事項はありません。

ハッピーエイジング30

該当事項はありません。

ハッピーエイジング40

該当事項はありません。

ハッピーエイジング50

該当事項はありません。

ハッピーエイジング60

該当事項はありません。

（参考）S J A M ラージキャップ・バリュース・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）S J A M スモールキャップ・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン - T C W 外国株式マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

ハッピーエイジング20

該当事項はありません。

ハッピーエイジング30

該当事項はありません。

ハッピーエイジング40

該当事項はありません。

ハッピーエイジング50

該当事項はありません。

ハッピーエイジング60

該当事項はありません。

（参考）S J A Mラージキャップ・バリュー・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

ハッピーエイジング20

直近日（2023年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）	1口当たりの純資産額（円）
--	----------	---------------

		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第13計算期間末	(2013年 7月16日)	6,375,079,876	6,375,079,876	0.9828	0.9828
第14計算期間末	(2014年 7月15日)	7,212,476,370	7,212,476,370	1.0930	1.0930
第15計算期間末	(2015年 7月15日)	8,801,004,620	8,801,004,620	1.3543	1.3543
第16計算期間末	(2016年 7月15日)	7,416,738,892	7,416,738,892	1.1099	1.1099
第17計算期間末	(2017年 7月18日)	9,271,419,094	9,271,419,094	1.4045	1.4045
第18計算期間末	(2018年 7月17日)	10,439,689,943	10,439,689,943	1.5015	1.5015
第19計算期間末	(2019年 7月16日)	10,453,350,603	10,453,350,603	1.4179	1.4179
第20計算期間末	(2020年 7月15日)	10,189,146,231	10,189,146,231	1.3797	1.3797
第21計算期間末	(2021年 7月15日)	13,007,644,754	13,007,644,754	1.7449	1.7449
第22計算期間末	(2022年 7月15日)	14,848,476,768	14,848,476,768	1.8338	1.8338
	2022年 1月末日	14,008,590,710		1.7841	
	2月末日	14,138,515,955		1.7957	
	3月末日	14,759,918,123		1.8647	
	4月末日	14,527,325,482		1.8303	
	5月末日	14,674,692,697		1.8302	
	6月末日	14,878,315,547		1.8421	
	7月末日	15,268,982,445		1.8810	
	8月末日	15,521,346,363		1.9024	
	9月末日	15,062,489,053		1.8340	
	10月末日	15,951,223,014		1.9272	
	11月末日	16,052,928,572		1.9391	
	12月末日	15,781,850,321		1.8903	
	2023年 1月末日	16,503,815,135		1.9555	

ハッピーエイジング30

直近日（2023年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第13計算期間末	(2013年 7月16日)	7,661,401,181	7,661,401,181	1.0552	1.0552
第14計算期間末	(2014年 7月15日)	8,543,771,190	8,543,771,190	1.1614	1.1614
第15計算期間末	(2015年 7月15日)	10,450,600,803	10,450,600,803	1.3944	1.3944
第16計算期間末	(2016年 7月15日)	9,226,785,122	9,226,785,122	1.1894	1.1894
第17計算期間末	(2017年 7月18日)	11,485,239,619	11,485,239,619	1.4397	1.4397
第18計算期間末	(2018年 7月17日)	12,738,786,784	12,738,786,784	1.5148	1.5148
第19計算期間末	(2019年 7月16日)	12,699,403,491	12,699,403,491	1.4446	1.4446
第20計算期間末	(2020年 7月15日)	12,817,876,592	12,817,876,592	1.4293	1.4293
第21計算期間末	(2021年 7月15日)	15,539,022,049	15,539,022,049	1.7142	1.7142
第22計算期間末	(2022年 7月15日)	17,096,530,694	17,096,530,694	1.7915	1.7915
	2022年 1月末日	16,205,090,108		1.7391	
	2月末日	16,299,039,665		1.7438	

3月末日	16,914,318,120		1.7987
4月末日	16,781,108,129		1.7784
5月末日	16,844,057,758		1.7768
6月末日	17,157,305,974		1.7949
7月末日	17,497,509,785		1.8237
8月末日	17,657,624,295		1.8357
9月末日	17,214,201,741		1.7815
10月末日	17,981,824,448		1.8528
11月末日	17,945,519,433		1.8572
12月末日	17,566,732,810		1.8095
2023年 1月末日	18,155,697,518		1.8612

ハッピーエイジング40

直近日（2023年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第13計算期間末 (2013年 7月16日)	9,756,993,303	9,756,993,303	1.1196	1.1196
第14計算期間末 (2014年 7月15日)	10,651,044,828	10,651,044,828	1.2075	1.2075
第15計算期間末 (2015年 7月15日)	12,378,839,543	12,378,839,543	1.3816	1.3816
第16計算期間末 (2016年 7月15日)	11,857,174,350	11,857,174,350	1.2636	1.2636
第17計算期間末 (2017年 7月18日)	13,906,785,392	13,906,785,392	1.4368	1.4368
第18計算期間末 (2018年 7月17日)	15,282,979,036	15,282,979,036	1.4924	1.4924
第19計算期間末 (2019年 7月16日)	16,189,690,869	16,189,690,869	1.4537	1.4537
第20計算期間末 (2020年 7月15日)	16,815,567,800	16,815,567,800	1.4410	1.4410
第21計算期間末 (2021年 7月15日)	19,994,471,155	19,994,471,155	1.6425	1.6425
第22計算期間末 (2022年 7月15日)	21,277,799,746	21,277,799,746	1.6752	1.6752
2022年 1月末日	20,624,020,609		1.6507	
2月末日	20,695,491,109		1.6512	
3月末日	21,263,964,411		1.6857	
4月末日	21,140,272,538		1.6710	
5月末日	21,132,016,822		1.6690	
6月末日	21,309,434,874		1.6776	
7月末日	21,650,140,843		1.6974	
8月末日	21,859,842,857		1.7039	
9月末日	21,421,502,790		1.6623	
10月末日	22,143,548,916		1.7071	
11月末日	22,024,375,116		1.7077	
12月末日	21,660,395,420		1.6698	
2023年 1月末日	22,184,768,425		1.7024	

ハッピーエイジング50

直近日（2023年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第13計算期間末（2013年7月16日）	4,480,882,597	4,480,882,597	1.1555	1.1555
第14計算期間末（2014年7月15日）	4,908,333,421	4,908,333,421	1.2215	1.2215
第15計算期間末（2015年7月15日）	5,534,439,620	5,534,439,620	1.3347	1.3347
第16計算期間末（2016年7月15日）	5,689,949,958	5,689,949,958	1.3007	1.3007
第17計算期間末（2017年7月18日）	6,297,794,959	6,297,794,959	1.3890	1.3890
第18計算期間末（2018年7月17日）	6,875,070,157	6,875,070,157	1.4262	1.4262
第19計算期間末（2019年7月16日）	7,592,282,029	7,592,282,029	1.4137	1.4137
第20計算期間末（2020年7月15日）	7,791,444,020	7,791,444,020	1.4019	1.4019
第21計算期間末（2021年7月15日）	8,938,896,753	8,938,896,753	1.5168	1.5168
第22計算期間末（2022年7月15日）	9,555,136,567	9,555,136,567	1.5150	1.5150
2022年1月末日	9,399,186,288		1.5126	
2月末日	9,380,126,959		1.5091	
3月末日	9,577,021,969		1.5262	
4月末日	9,526,012,285		1.5176	
5月末日	9,578,231,381		1.5155	
6月末日	9,578,464,642		1.5154	
7月末日	9,705,200,527		1.5288	
8月末日	9,740,010,037		1.5303	
9月末日	9,592,633,992		1.5019	
10月末日	9,793,084,896		1.5251	
11月末日	9,702,887,861		1.5212	
12月末日	9,566,338,736		1.4921	
2023年1月末日	9,721,517,864		1.5075	

ハッピーエイジング60

直近日（2023年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第13計算期間末（2013年7月16日）	2,695,707,446	2,695,707,446	1.1485	1.1485
第14計算期間末（2014年7月15日）	3,031,298,200	3,031,298,200	1.1883	1.1883
第15計算期間末（2015年7月15日）	3,292,018,524	3,292,018,524	1.2399	1.2399
第16計算期間末（2016年7月15日）	3,737,464,193	3,737,464,193	1.2843	1.2843
第17計算期間末（2017年7月18日）	3,967,051,489	3,967,051,489	1.2846	1.2846
第18計算期間末（2018年7月17日）	4,186,192,577	4,186,192,577	1.3015	1.3015

第19計算期間末 (2019年 7月16日)	4,551,251,809	4,551,251,809	1.3089	1.3089
第20計算期間末 (2020年 7月15日)	4,870,043,859	4,870,043,859	1.3009	1.3009
第21計算期間末 (2021年 7月15日)	5,345,944,070	5,345,944,070	1.3367	1.3367
第22計算期間末 (2022年 7月15日)	5,430,316,764	5,430,316,764	1.3192	1.3192
2022年 1月末日	5,470,123,066		1.3250	
2月末日	5,405,832,591		1.3173	
3月末日	5,495,140,910		1.3243	
4月末日	5,475,407,445		1.3222	
5月末日	5,475,366,887		1.3191	
6月末日	5,441,163,649		1.3164	
7月末日	5,494,269,940		1.3246	
8月末日	5,491,248,815		1.3208	
9月末日	5,367,636,195		1.3042	
10月末日	5,435,522,344		1.3135	
11月末日	5,411,317,677		1.3031	
12月末日	5,293,529,356		1.2781	
2023年 1月末日	5,283,525,979		1.2814	

【分配の推移】

ハッピーエイジング20

	1口当たりの分配金（円）
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23中間計算期間末	

ハッピーエイジング30

	1口当たりの分配金（円）
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000

第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23中間計算期間末	

ハッピーエイジング40

	1口当たりの分配金(円)
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23中間計算期間末	

ハッピーエイジング50

	1口当たりの分配金(円)
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23中間計算期間末	

ハッピーエイジング60

	1口当たりの分配金（円）
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23中間計算期間末	

【収益率の推移】

ハッピーエイジング20

	収益率（％）
第13計算期間	53.7
第14計算期間	11.2
第15計算期間	23.9
第16計算期間	18.0
第17計算期間	26.5
第18計算期間	6.9
第19計算期間	5.6
第20計算期間	2.7
第21計算期間	26.5
第22計算期間	5.1
第23中間計算期間末	4.1

（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。

ハッピーエイジング30

	収益率（％）
第13計算期間	45.4
第14計算期間	10.1
第15計算期間	20.1
第16計算期間	14.7
第17計算期間	21.0

第18計算期間	5.2
第19計算期間	4.6
第20計算期間	1.1
第21計算期間	19.9
第22計算期間	4.5
第23中間計算期間末	1.8

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

ハッピーエイジング40

	収益率（％）
第13計算期間	30.7
第14計算期間	7.9
第15計算期間	14.4
第16計算期間	8.5
第17計算期間	13.7
第18計算期間	3.9
第19計算期間	2.6
第20計算期間	0.9
第21計算期間	14.0
第22計算期間	2.0
第23中間計算期間末	0.1

（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。

ハッピーエイジング50

	収益率（％）
第13計算期間	18.0
第14計算期間	5.7
第15計算期間	9.3
第16計算期間	2.5
第17計算期間	6.8
第18計算期間	2.7
第19計算期間	0.9
第20計算期間	0.8
第21計算期間	8.2
第22計算期間	0.1
第23中間計算期間末	1.4

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

ハッピーエイジング60

	収益率（％）
第13計算期間	6.2
第14計算期間	3.5
第15計算期間	4.3
第16計算期間	3.6
第17計算期間	0.0
第18計算期間	1.3
第19計算期間	0.6
第20計算期間	0.6
第21計算期間	2.8
第22計算期間	1.3
第23中間計算期間末	3.3

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

（4）【設定及び解約の実績】

ハッピーエイジング20

	設定口数	解約口数
第13計算期間	1,412,715,175	1,234,496,719
第14計算期間	1,198,615,866	1,086,750,393
第15計算期間	1,446,470,764	1,546,505,235
第16計算期間	1,316,566,721	1,133,015,060
第17計算期間	1,187,415,933	1,268,396,839
第18計算期間	1,489,193,062	1,137,446,811
第19計算期間	1,441,075,609	1,021,272,801
第20計算期間	1,610,603,019	1,598,232,575
第21計算期間	1,531,705,313	1,462,004,315
第22計算期間	1,809,374,192	1,167,066,487
第23中間計算期間末	790,524,666	510,499,057

（注1）本邦外における設定及び解約はございません。

（注2）設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

ハッピーエイジング30

	設定口数	解約口数
第13計算期間	1,142,944,756	908,933,490
第14計算期間	925,289,956	829,222,130
第15計算期間	1,083,572,839	945,383,122
第16計算期間	963,924,983	701,088,669
第17計算期間	1,000,840,370	780,753,459
第18計算期間	1,190,076,724	757,714,913
第19計算期間	1,151,257,690	770,237,275
第20計算期間	1,336,572,558	1,159,232,504
第21計算期間	1,265,453,871	1,168,570,454
第22計算期間	1,339,833,107	861,811,651
第23中間計算期間末	601,301,691	442,398,572

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

ハッピーエイジング40

	設定口数	解約口数
第13計算期間	1,210,013,963	1,132,548,340
第14計算期間	1,187,155,993	1,081,548,442
第15計算期間	1,360,175,410	1,220,689,774
第16計算期間	1,288,216,954	864,776,270
第17計算期間	1,431,202,031	1,135,435,456
第18計算期間	1,676,258,878	1,115,070,892
第19計算期間	1,884,821,803	988,431,478
第20計算期間	2,098,383,366	1,565,929,863
第21計算期間	1,997,361,636	1,493,623,313
第22計算期間	1,936,260,527	1,407,258,165
第23中間計算期間末	890,711,944	630,741,628

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

ハッピーエイジング50

	設定口数	解約口数
第13計算期間	619,762,253	631,166,681
第14計算期間	718,206,328	577,818,984
第15計算期間	849,878,441	721,397,173

第16計算期間	730,303,162	502,519,916
第17計算期間	828,831,999	669,291,626
第18計算期間	971,431,975	684,746,630
第19計算期間	1,121,171,260	571,339,838
第20計算期間	1,179,541,160	992,253,306
第21計算期間	1,148,879,543	813,439,718
第22計算期間	1,182,086,451	768,455,642
第23中間計算期間末	477,205,105	377,827,178

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

ハッピーエイジング60

	設定口数	解約口数
第13計算期間	479,744,662	383,926,075
第14計算期間	553,877,726	350,037,487
第15計算期間	649,247,886	545,147,386
第16計算期間	720,837,714	465,830,338
第17計算期間	748,382,900	570,133,617
第18計算期間	671,022,511	542,867,692
第19計算期間	829,372,301	568,524,688
第20計算期間	1,060,346,963	793,901,262
第21計算期間	925,573,626	669,909,997
第22計算期間	765,693,880	648,752,129
第23中間計算期間末	338,092,831	334,753,033

(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:2023年1月31日

基準価額・純資産の推移 2013/01/31 ~ 2023/01/31

●ハッピーエイジング20



●ハッピーエイジング30



●ハッピーエイジング40



●ハッピーエイジング50



分配の推移

●ハッピーエイジング20

2018年07月	0円
2019年07月	0円
2020年07月	0円
2021年07月	0円
2022年07月	0円
設定来累計	0円

●ハッピーエイジング30

2018年07月	0円
2019年07月	0円
2020年07月	0円
2021年07月	0円
2022年07月	0円
設定来累計	0円

●ハッピーエイジング40

2018年07月	0円
2019年07月	0円
2020年07月	0円
2021年07月	0円
2022年07月	0円
設定来累計	0円

●ハッピーエイジング50

2018年07月	0円
2019年07月	0円
2020年07月	0円
2021年07月	0円
2022年07月	0円
設定来累計	0円

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

●ハッピーエイジング60



●ハッピーエイジング60

2018年07月	0円
2019年07月	0円
2020年07月	0円
2021年07月	0円
2022年07月	0円
設定来累計	0円

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

● 1万口当たり、税引前

● 主要な資産の状況

	ハッピー エイジング 20	ハッピー エイジング 30	ハッピー エイジング 40
資産別構成			
資産の種類	純資産比	純資産比	純資産比
SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	26.02%	22.02%	15.52%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	26.24%	22.21%	15.65%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	1.99%	7.98%	32.92%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	5.99%	19.97%	14.99%
損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド	32.86%	20.91%	13.95%
ISHARES CORE MSCI EMERGING	4.79%	4.69%	4.68%
コール・ローン等	2.10%	2.22%	2.28%
合 計	100.00%	100.00%	100.00%

	ハッピー エイジング 50	ハッピー エイジング 60
資産別構成		
資産の種類	純資産比	純資産比
SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	9.52%	4.01%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	9.60%	4.05%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	56.92%	71.93%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	11.00%	16.01%
損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド	7.98%	2.00%
ISHARES CORE MSCI EMERGING	2.60%	-
コール・ローン等	2.37%	2.01%
合 計	100.00%	100.00%

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

● SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド

組入上位5銘柄

	銘柄名	業種	純資産比
1	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7.8%
2	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	7.0%
3	アイシン	輸送用機器	5.1%
4	麒麟ホールディングス	食料品	5.1%
5	三井住友トラスト・ホールディングス	銀行業	4.7%
組入銘柄数			36銘柄

● SJAMスモールキャップ・マザーファンド

組入上位5銘柄

	銘柄名	業種	純資産比
1	シチズン時計	精密機器	3.8%
2	めぶきフィナンシャルグループ	銀行業	3.4%
3	八十二銀行	銀行業	3.3%
4	森永乳業	食料品	3.3%
5	いよぎんホールディングス	銀行業	2.7%
組入銘柄数			84銘柄

● 損保ジャパン日本債券マザーファンド

組入上位5銘柄

	銘柄名	種類	償還日	純資産比
1	第352回利付国債(10年)	国債証券	2028/9/20	6.5%
2	第154回利付国債(20年)	国債証券	2035/9/20	5.2%
3	第364回利付国債(10年)	国債証券	2031/9/20	3.9%
4	第361回利付国債(10年)	国債証券	2030/12/20	3.9%
5	第150回利付国債(5年)	国債証券	2026/12/20	3.2%
組入銘柄数			100銘柄	

● 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

組入上位5銘柄

	銘柄名	発行国	種類	通貨	償還日	純資産比
1	GERMANY 1.5 240515	ドイツ	国債証券	ユーロ	2024/05/15	5.7%
2	Treasury 2.75 280215	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2028/02/15	5.1%
3	FRA 0.00 240325	フランス	国債証券	ユーロ	2024/03/25	5.0%
4	Treasury 2.125 240229	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2024/02/29	3.9%
5	Treasury 2.125 250515	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2025/05/15	2.8%
組入銘柄数					138銘柄	

● 損保ジャパンTCW外国株式マザーファンド

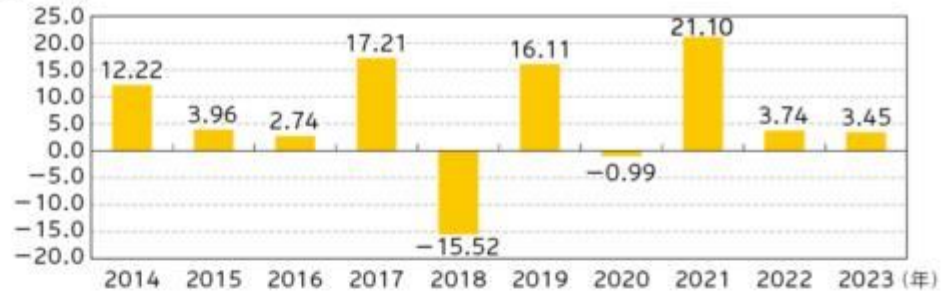
組入上位5銘柄

	銘柄名	通貨	発行国/地域	業種	純資産比
1	MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	3.1%
2	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	3.0%
3	WASTE CONNECTIONS INC	アメリカ・ドル	アメリカ	資本財・サービス	2.3%
4	FISERV INC	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	2.2%
5	MSCI INC	アメリカ・ドル	アメリカ	金融	1.9%
組入銘柄数				235銘柄	

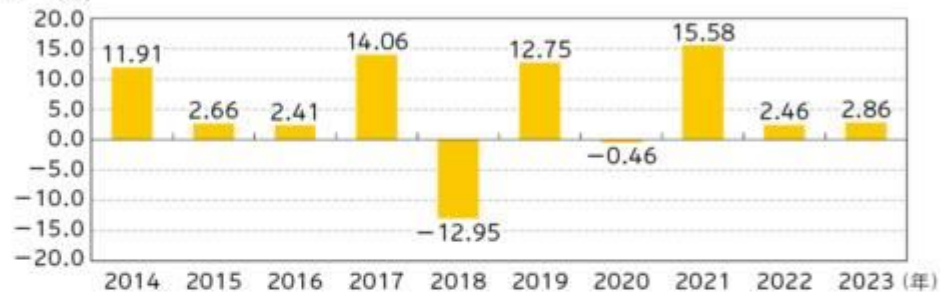
- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

年間収益率の推移（暦年ベース）

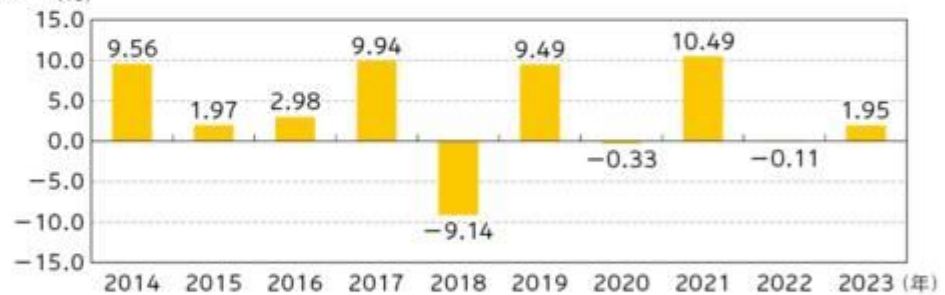
●ハッピーエイジング20 (%)



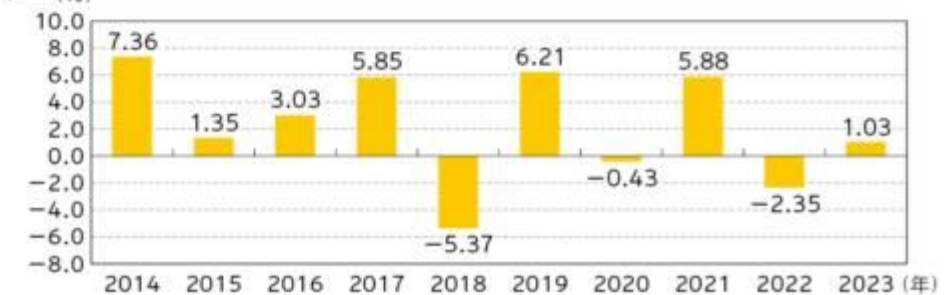
●ハッピーエイジング30 (%)



●ハッピーエイジング40 (%)

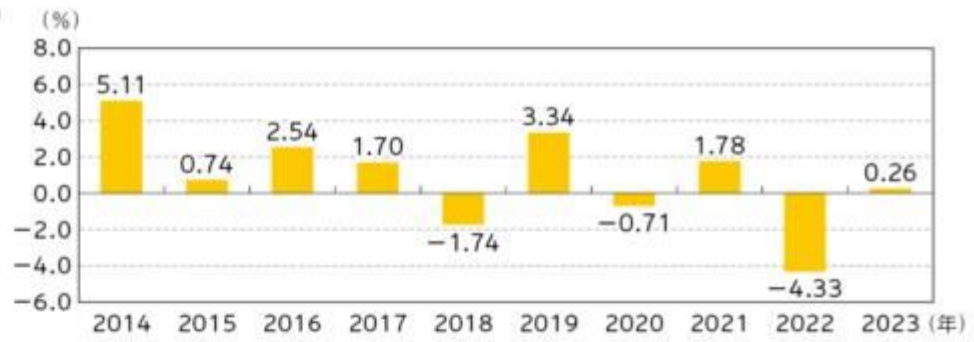


●ハッピーエイジング50 (%)



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

● ハッピーエイジング60



● ファンドの年間収益率は基準価額(税引前分配金再投資)を使用して計算しています。

● 2023年は年初から基準日までの収益率です。

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）（以下「中間財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。
- なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2022年7月16日から2023年1月15日までの中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【ハッピーエイジング20】

(1) 【中間貸借対照表】

	(単位：円)	
	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	460,864,380
コール・ローン	488,980,781	-
投資信託受益証券	656,187,388	776,717,921
親投資信託受益証券	13,828,449,093	14,891,036,022
流動資産合計	14,973,617,262	16,128,618,323
資産合計	14,973,617,262	16,128,618,323
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,481,255	4,616,021
未払受託者報酬	3,884,655	4,278,264
未払委託者報酬	110,324,238	121,502,566
未払利息	1,473	-
その他未払費用	448,873	442,694
流動負債合計	125,140,494	130,839,545
負債合計	125,140,494	130,839,545
純資産の部		
元本等		
元本	8,097,040,123	8,377,065,732
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,751,436,645	7,620,713,046
元本等合計	14,848,476,768	15,997,778,778
純資産合計	14,848,476,768	15,997,778,778
負債純資産合計	14,973,617,262	16,128,618,323

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

	(単位：円)	
	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日	第23期中間計算期間 自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
営業収益		
受取配当金	13,165,571	9,136,316
有価証券売買等損益	775,978,210	794,372,139
為替差損益	26,049,011	56,117,161
営業収益合計	815,192,792	747,391,294

	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日	第23期中間計算期間 自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
営業費用		
支払利息	166,072	185,782
受託者報酬	3,788,236	4,278,264
委託者報酬	107,585,891	121,502,566
その他費用	494,357	580,879
営業費用合計	112,034,556	126,547,491
営業利益又は営業損失（ ）	703,158,236	620,843,803
経常利益又は経常損失（ ）	703,158,236	620,843,803
中間純利益又は中間純損失（ ）	703,158,236	620,843,803
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	27,370,212	32,872,014
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,552,912,336	6,751,436,645
剰余金増加額又は欠損金減少額	725,069,554	708,232,024
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	725,069,554	708,232,024
剰余金減少額又は欠損金増加額	433,089,330	426,927,412
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	433,089,330	426,927,412
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,520,680,584	7,620,713,046

（ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

期別	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在
1. 受益権の総数	8,097,040,123口	8,377,065,732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) 1.8338円 (18,338円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.9097円 (19,097円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日	第23期中間計算期間 自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(その他の注記)

項目	第22期	第23期中間計算期間
	自 2021年7月16日 至 2022年7月15日	自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
期首元本額	7,454,732,418円	8,097,040,123円
期中追加設定元本額	1,809,374,192円	790,524,666円
期中一部解約元本額	1,167,066,487円	510,499,057円

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング30】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	542,518,146
コール・ローン	503,596,676	-
投資信託受益証券	771,919,336	837,487,024
親投資信託受益証券	15,948,558,219	16,459,471,817
流動資産合計	17,224,074,231	17,839,476,987
資産合計	17,224,074,231	17,839,476,987
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,069,256	6,141,709
未払受託者報酬	4,482,334	4,833,742
未払委託者報酬	116,540,768	125,677,180
未払利息	1,517	-
その他未払費用	449,662	443,299
流動負債合計	127,543,537	137,095,930
負債合計	127,543,537	137,095,930
純資産の部		
元本等		
元本	9,543,086,407	9,701,989,526
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,553,444,287	8,000,391,531
元本等合計	17,096,530,694	17,702,381,057
純資産合計	17,096,530,694	17,702,381,057
負債純資産合計	17,224,074,231	17,839,476,987

（2）【中間損益及び剰余金計算書】

	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日	第23期中間計算期間 自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
営業収益		
受取配当金	16,491,323	9,851,141
有価証券売買等損益	685,258,254	500,075,442
為替差損益	30,417,577	60,423,008
営業収益合計	732,167,154	449,503,575
営業費用		
支払利息	180,358	209,962
受託者報酬	4,435,580	4,833,742
委託者報酬	115,324,987	125,677,180
その他費用	504,342	582,467
営業費用合計	120,445,267	131,303,351
営業利益又は営業損失()	611,721,887	318,200,224
経常利益又は経常損失()	611,721,887	318,200,224
中間純利益又は中間純損失()	611,721,887	318,200,224
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	17,051,182	17,691,064
期首剰余金又は期首欠損金()	6,473,957,098	7,553,444,287
剰余金増加額又は欠損金減少額	508,589,045	497,100,000
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	508,589,045	497,100,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	325,219,942	350,661,916
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	325,219,942	350,661,916
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	7,251,996,906	8,000,391,531

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（中間貸借対照表に関する注記）

期別	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在
1. 受益権の総数	9,543,086,407口	9,701,989,526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) 1.7915円 (17,915円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8246円 (18,246円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日	第23期中間計算期間 自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	第22期	第23期中間計算期間
	自 2021年7月16日 至 2022年7月15日	自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
期首元本額	9,065,064,951円	9,543,086,407円
期中追加設定元本額	1,339,833,107円	601,301,691円
期中一部解約元本額	861,811,651円	442,398,572円

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング40】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	647,080,637
コール・ローン	613,486,511	-
投資信託受益証券	991,571,180	1,020,459,328
親投資信託受益証券	19,818,736,741	20,234,731,875
流動資産合計	21,423,794,432	21,902,271,840
資産合計	21,423,794,432	21,902,271,840
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,033,247	13,018,603
未払受託者報酬	5,646,190	5,969,030
未払委託者報酬	129,862,239	137,287,519
未払利息	1,848	-
その他未払費用	451,162	443,976
流動負債合計	145,994,686	156,719,128
負債合計	145,994,686	156,719,128
純資産の部		
元本等		
元本	12,701,846,625	12,961,816,941
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	8,575,953,121	8,783,735,771
元本等合計	21,277,799,746	21,745,552,712
純資産合計	21,277,799,746	21,745,552,712
負債純資産合計	21,423,794,432	21,902,271,840

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日	第23期中間計算期間 自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
営業収益		
受取配当金	21,183,974	12,003,389
有価証券売買等損益	546,878,082	234,275,159
為替差損益	37,426,493	72,642,697
営業収益合計	605,488,549	173,635,851
営業費用		
支払利息	235,469	263,044
受託者報酬	5,646,300	5,969,030
委託者報酬	129,864,968	137,287,519
その他費用	518,316	608,011
営業費用合計	136,265,053	144,127,604
営業利益又は営業損失 ()	469,223,496	29,508,247
経常利益又は経常損失 ()	469,223,496	29,508,247
中間純利益又は中間純損失 ()	469,223,496	29,508,247
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 ()	15,081,677	11,677,596
期首剰余金又は期首欠損金 ()	7,821,626,892	8,575,953,121
剰余金増加額又は欠損金減少額	653,124,341	616,241,476
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	653,124,341	616,241,476
剰余金減少額又は欠損金増加額	474,146,617	426,289,477
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	474,146,617	426,289,477
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 ()	8,454,746,435	8,783,735,771

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

基本となる重要な事項	外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。
------------	--

(中間貸借対照表に関する注記)

期別	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在
1. 受益権の総数	12,701,846,625口	12,961,816,941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) 1.6752円 (16,752円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6777円 (16,777円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日	第23期中間計算期間 自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(その他の注記)

項目	第22期 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日	第23期中間計算期間 自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
期首元本額	12,172,844,263円	12,701,846,625円
期中追加設定元本額	1,936,260,527円	890,711,944円
期中一部解約元本額	1,407,258,165円	630,741,628円

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング50】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	285,128,315
コール・ローン	268,854,042	-
投資信託受益証券	240,697,585	248,272,522
親投資信託受益証券	9,103,146,891	9,098,824,235
流動資産合計	9,612,698,518	9,632,225,072
資産合計	9,612,698,518	9,632,225,072
負債の部		

	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在
流動負債		
未払解約金	4,515,715	11,856,106
未払受託者報酬	2,553,414	2,652,012
未払委託者報酬	50,046,874	51,979,333
未払利息	810	-
その他未払費用	445,138	441,727
流動負債合計	57,561,951	66,929,178
負債合計	57,561,951	66,929,178
純資産の部		
元本等		
元本	6,306,865,858	6,406,243,785
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,248,270,709	3,159,052,109
元本等合計	9,555,136,567	9,565,295,894
純資産合計	9,555,136,567	9,565,295,894
負債純資産合計	9,612,698,518	9,632,225,072

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日	第23期中間計算期間 自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
営業収益		
受取配当金	5,004,983	2,920,362
有価証券売買等損益	120,946,279	70,559,883
為替差損益	9,832,772	17,510,381
営業収益合計	135,784,034	85,149,902
営業費用		
支払利息	106,068	114,792
受託者報酬	2,538,132	2,652,012
委託者報酬	49,747,259	51,979,333
その他費用	462,338	504,307
営業費用合計	52,853,797	55,250,444
営業利益又は営業損失（ ）	82,930,237	140,400,346
経常利益又は経常損失（ ）	82,930,237	140,400,346
中間純利益又は中間純損失（ ）	82,930,237	140,400,346
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,928,858	705,869
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,045,661,704	3,248,270,709
剰余金増加額又は欠損金減少額	340,226,699	246,575,792
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	340,226,699	246,575,792
剰余金減少額又は欠損金増加額	184,492,017	194,688,177
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	184,492,017	194,688,177
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,281,397,765	3,159,052,109

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券
--------------------	---

2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。
3. 費用・収益の計上基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
	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。
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。
	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。
	但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

期別	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在
1. 受益権の総数	6,306,865,858口	6,406,243,785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) 1.5150円 (15,150円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4931円 (14,931円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日	第23期中間計算期間 自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在

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

(その他の注記)

項目	第22期	第23期中間計算期間
	自 2021年7月16日 至 2022年7月15日	自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
期首元本額	5,893,235,049円	6,306,865,858円
期中追加設定元本額	1,182,086,451円	477,205,105円
期中一部解約元本額	768,455,642円	377,827,178円

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング60】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	129,719,002
コール・ローン	118,368,167	-
親投資信託受益証券	5,346,222,267	5,154,154,295

	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在
流動資産合計	5,464,590,434	5,283,873,297
資産合計	5,464,590,434	5,283,873,297
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,640,841	4,865,575
未払受託者報酬	1,467,093	1,482,581
未払委託者報酬	23,766,898	24,017,674
未払利息	356	-
その他未払費用	398,482	401,131
流動負債合計	34,273,670	30,766,961
負債合計	34,273,670	30,766,961
純資産の部		
元本等		
元本	4,116,323,762	4,119,663,560
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,313,993,002	1,133,442,776
元本等合計	5,430,316,764	5,253,106,336
純資産合計	5,430,316,764	5,253,106,336
負債純資産合計	5,464,590,434	5,283,873,297

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日	第23期中間計算期間 自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
営業収益		
有価証券売買等損益	11,746,072	156,427,972
営業収益合計	11,746,072	156,427,972
営業費用		
支払利息	57,904	57,467
受託者報酬	1,498,470	1,482,581
委託者報酬	24,275,135	24,017,674
その他費用	404,528	416,969
営業費用合計	26,236,037	25,974,691
営業利益又は営業損失（ ）	14,489,965	182,402,663
経常利益又は経常損失（ ）	14,489,965	182,402,663
中間純利益又は中間純損失（ ）	14,489,965	182,402,663
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	140,294	4,203,059
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,346,562,059	1,313,993,002
剰余金増加額又は欠損金減少額	136,745,168	104,459,249
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	136,745,168	104,459,249
剰余金減少額又は欠損金増加額	100,854,253	106,809,871
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	100,854,253	106,809,871
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,367,822,715	1,133,442,776

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。
--------------------	---

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

(中間貸借対照表に関する注記)

期別	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在
1. 受益権の総数	4,116,323,762口	4,119,663,560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) 1.3192円 (13,192円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2751円 (12,751円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第22期中間計算期間 自 2021年7月16日 至 2022年1月15日	第23期中間計算期間 自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	損保ジャパン・TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第22期 2022年7月15日現在	第23期中間計算期間末 2023年1月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	--	----

(その他の注記)

項目	第22期	第23期中間計算期間
	自 2021年7月16日 至 2022年7月15日	自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
期首元本額	3,999,382,011円	4,116,323,762円
期中追加設定元本額	765,693,880円	338,092,831円
期中一部解約元本額	648,752,129円	334,753,033円

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

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

*なお、以下は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

S J A Mラージキャップ・バリュース・マザーファンド

貸借対照表

科 目	2022年7月15日現在	2023年1月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	441,006,173
コール・ローン	374,774,641	-
株式	39,820,774,580	37,983,552,070
未収配当金	33,438,000	61,590,300
流動資産合計	40,228,987,221	38,486,148,543
資産合計	40,228,987,221	38,486,148,543
負債の部		
流動負債		
未払金	64,590,126	-
未払利息	1,129	-
その他未払費用	48,457	2,683
流動負債合計	64,639,712	2,683
負債合計	64,639,712	2,683

科 目	2022年7月15日現在	2023年1月15日現在
	金額（円）	金額（円）
純資産の部		
元本等		
元本	17,267,476,729	15,445,365,172
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	22,896,870,780	23,040,780,688
元本等合計	40,164,347,509	38,486,145,860
純資産合計	40,164,347,509	38,486,145,860
負債純資産合計	40,228,987,221	38,486,148,543

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7月15日現在	2023年1月15日現在
1. 受益権の総数	17,267,476,729口	15,445,365,172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 2.3260円 (1万口当たり純資産額) (23,260円)	1口当たり純資産額 2.4918円 (1万口当たり純資産額) (24,918円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年7月15日現在	2023年1月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

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

(その他の注記)

項目	自 2021年7月16日 至 2022年7月15日	自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	21,880,170,683円	17,267,476,729円
同期中追加設定元本額	6,876,575,486円	832,202,956円
同期中一部解約元本額	11,489,269,440円	2,654,314,513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）	11,879,495,307円	10,044,548,739円
ハッピーエイジング20	1,643,900,535円	1,680,249,911円
ハッピーエイジング30	1,582,508,315円	1,570,314,799円
ハッピーエイジング40	1,381,043,630円	1,364,289,712円
ハッピーエイジング50	379,440,798円	369,293,559円
ハッピーエイジング60	90,558,169円	85,190,996円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	150,331,327円	155,183,142円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	81,700,902円	92,008,073円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	62,049,545円	66,856,227円
SOMPO日本株バリュー・プラスファンド	15,339,602円	13,211,290円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	1,108,599円	3,897,415円
SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞	- 円	122,016円
SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞	- 円	85,411円
SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞	- 円	113,882円
計	17,267,476,729円	15,445,365,172円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

貸借対照表

科 目	2022年7月15日現在	2023年1月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	48,485,705
コール・ローン	131,224,417	-
株式	12,649,865,400	13,183,423,300
未収配当金	22,725,500	24,524,300
流動資産合計	12,803,815,317	13,256,433,305
資産合計	12,803,815,317	13,256,433,305
負債の部		
流動負債		
未払利息	395	-
その他未払費用	2,386	315
流動負債合計	2,781	315
負債合計	2,781	315
純資産の部		
元本等		
元本	4,638,855,031	4,427,670,699
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,164,957,505	8,828,762,291
元本等合計	12,803,812,536	13,256,432,990
純資産合計	12,803,812,536	13,256,432,990
負債純資産合計	12,803,815,317	13,256,433,305

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7月15日現在	2023年1月15日現在
1. 受益権の総数	4,638,855,031口	4,427,670,699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) 2.7601円 (27,601円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.9940円 (29,940円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年7月15日現在	2023年1月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	自 2021年7月16日 至 2022年7月15日	自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,378,241,610円	4,638,855,031円
同期中追加設定元本額	751,139,276円	157,451,960円
同期中一部解約元本額	490,525,855円	368,636,292円

元本の内訳*		
ハッピーエイジング20	1,407,370,236円	1,375,398,724円
ハッピーエイジング30	1,368,270,928円	1,289,862,421円
ハッピーエイジング40	1,194,131,905円	1,117,277,951円
ハッピーエイジング50	328,102,611円	303,494,511円
ハッピーエイジング60	78,311,465円	70,408,410円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	126,662,418円	126,321,613円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	68,874,559円	75,536,017円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	52,791,250円	54,908,354円
SOMPO日本株バリュー・プラスファンド	13,405,190円	10,995,168円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	934,469円	3,198,427円
SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞	-円	102,191円
SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞	-円	71,534円
SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞	-円	95,378円
計	4,638,855,031円	4,427,670,699円

*当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

損保ジャパン日本債券マザーファンド

貸借対照表

科 目	2022年7月15日現在	2023年1月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	162,610,966
コール・ローン	250,204,706	-
国債証券	17,492,390,700	18,800,371,200
地方債証券	1,003,486,000	976,359,000
特殊債券	900,669,059	848,321,919
社債券	4,570,645,000	3,419,905,000
未収利息	26,744,596	28,462,186
前払費用	795,030	2,073,813
流動資産合計	24,244,935,091	24,238,104,084

科 目	2022年7月15日現在	2023年1月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産合計	24,244,935,091	24,238,104,084
負債の部		
流動負債		
未払利息	754	-
その他未払費用	5,396	998
流動負債合計	6,150	998
負債合計	6,150	998
純資産の部		
元本等		
元本	17,116,439,892	17,708,071,632
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,128,489,049	6,530,031,454
元本等合計	24,244,928,941	24,238,103,086
純資産合計	24,244,928,941	24,238,103,086
負債純資産合計	24,244,935,091	24,238,104,084

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7月15日現在	2023年1月15日現在
1. 受益権の総数	17,116,439,892口	17,708,071,632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 1.4165円 (1万口当たり純資産額) (14,165円)	1口当たり純資産額 1.3688円 (1万口当たり純資産額) (13,688円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年7月15日現在	2023年1月15日現在
----	--------------	--------------

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

（その他の注記）

項目	自 2021年7月16日 至 2022年7月15日	自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,154,207,306円	17,116,439,892円
同期中追加設定元本額	3,893,291,405円	1,362,498,837円
同期中一部解約元本額	2,931,058,819円	770,867,097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）	183,953,697円	179,615,113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）	16,935,801円	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）	46,694,043円	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）	1,402,216,872円	1,418,907,978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）	151,492,862円	132,487,486円
損保ジャパン日本債券ファンド	1,028,082,252円	1,014,859,842円
ハッピーエイジング20	212,761,297円	228,858,867円
ハッピーエイジング30	977,861,146円	1,017,679,202円
ハッピーエイジング40	4,996,790,493円	5,195,430,444円
ハッピーエイジング50	3,869,293,417円	3,963,243,905円
ハッピーエイジング60	2,770,527,646円	2,759,254,436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	853,167円	- 円

好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 円ヘッジなしコース	7,134,805円	- 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	119,066,941円	117,860,021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	8,453,357円	9,731,788円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	865,223,283円	1,035,521,852円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	272,099,329円	352,181,879円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	91,939,162円	123,031,530円
ターゲット・リターン戦略ファンド	94,491,593円	92,767,529円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	568,729円	2,097,452円
SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞	- 円	1,752,755円
SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞	- 円	293,329円
SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞	- 円	143,082円
計	17,116,439,892円	17,708,071,632円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

科 目	2022年7月15日現在	2023年1月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	45,887,725	22,491,247
金銭信託	-	46,898,951
コール・ローン	32,937,604	-
国債証券	10,881,883,617	10,928,709,116
未収利息	73,800,500	70,564,386
前払費用	12,504,589	17,148,132
流動資産合計	11,047,014,035	11,085,811,832
資産合計	11,047,014,035	11,085,811,832
負債の部		
流動負債		

科 目	2022年7月15日現在	2023年1月15日現在
	金額（円）	金額（円）
未払利息	99	-
その他未払費用	2,774	284
流動負債合計	2,873	284
負債合計	2,873	284
純資産の部		
元本等		
元本	6,017,631,324	6,495,515,108
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,029,379,838	4,590,296,440
元本等合計	11,047,011,162	11,085,811,548
純資産合計	11,047,011,162	11,085,811,548
負債純資産合計	11,047,014,035	11,085,811,832

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

期別	2022年7月15日現在	2023年1月15日現在
1．受益権の総数	6,017,631,324口	6,495,515,108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)	1.8358円 (18,358円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7067円 (17,067円)
----------------------------	---------------------------	----------------------	---------------------------	----------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年7月15日現在	2023年1月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(その他の注記)

項目	自 2021年7月16日 至 2022年7月15日	自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	5,665,562,447円	6,017,631,324円
同期中追加設定元本額	749,547,449円	590,531,794円
同期中一部解約元本額	397,478,572円	112,648,010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）	68,189,678円	67,701,358円
ハッピーエイジング20	501,318,508円	555,537,821円
ハッピーエイジング30	1,920,027,492円	2,058,643,057円
ハッピーエイジング40	1,783,789,953円	1,917,453,433円
ハッピーエイジング50	586,425,430円	621,777,213円
ハッピーエイジング60	483,521,354円	496,130,253円
損保ジャパン外国債券ファンド（為替ヘッジなし）	420,490,039円	439,070,658円

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	210,369,272円	281,683,022円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	27,753,497円	36,637,608円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	15,495,840円	19,097,497円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	250,261円	963,147円
SOMPO世界分散ファンド(安定型)<DC年金>	-円	258,369円
SOMPO世界分散ファンド(安定成長型)<DC年金>	-円	162,885円
SOMPO世界分散ファンド(成長型)<DC年金>	-円	398,787円
計	6,017,631,324円	6,495,515,108円

*当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド

貸借対照表

科 目	2022年7月15日現在 金額(円)	2023年1月15日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	372,730,333	455,546,293
金銭信託	-	761,875,262
コール・ローン	556,715,278	-
株式	15,288,259,122	15,914,879,694
投資証券	877,005,672	834,670,691
未収配当金	15,772,444	17,630,811
流動資産合計	17,110,482,849	17,984,602,751
資産合計	17,110,482,849	17,984,602,751
負債の部		
流動負債		
未払利息	1,677	-
その他未払費用	10,068	4,592
流動負債合計	11,745	4,592
負債合計	11,745	4,592
純資産の部		
元本等		
元本	5,164,892,145	5,222,840,120
剰余金		

科 目	2022年7月15日現在	2023年1月15日現在
	金額（円）	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	11,945,578,959	12,761,758,039
元本等合計	17,110,471,104	17,984,598,159
純資産合計	17,110,471,104	17,984,598,159
負債純資産合計	17,110,482,849	17,984,602,751

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	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</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7月15日現在	2023年1月15日現在
1. 受益権の総数	5,164,892,145口	5,222,840,120口

2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.3128円 (33,128円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.4435円 (34,435円)
----------------------------	---------------------------	----------------------	---------------------------	----------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年7月15日現在	2023年1月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(その他の注記)

項目	自 2021年7月16日 至 2022年7月15日	自 2022年7月16日 至 2023年1月15日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	5,135,837,985円	5,164,892,145円
同期中追加設定元本額	934,300,922円	388,758,126円
同期中一部解約元本額	905,246,762円	330,810,151円
元本の内訳*		
損保ジャパン - TCW外国株式ファンド A コース（為替ヘッジあり）	707,274,529円	665,489,155円
損保ジャパン - TCW外国株式ファンド B コース（為替ヘッジなし）	743,999,779円	752,949,393円
ハッピーエイジング20	1,478,675,733円	1,546,347,350円
ハッピーエイジング30	1,081,004,742円	1,097,205,726円
ハッピーエイジング40	892,861,163円	902,001,342円
ハッピーエイジング50	228,675,939円	227,640,643円
ハッピーエイジング60	32,400,260円	31,206,511円
計	5,164,892,145円	5,222,840,120円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ハッピーエイジング20

2023年1月31日現在

資産総額	16,528,952,311円
負債総額	25,137,176円
純資産総額（ - ）	16,503,815,135円
発行済数量	8,439,764,642口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.9555円

ハッピーエイジング30

2023年1月31日現在

資産総額	18,175,385,237円
負債総額	19,687,719円
純資産総額（ - ）	18,155,697,518円
発行済数量	9,754,598,699口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.8612円

ハッピーエイジング40

2023年1月31日現在

資産総額	22,200,525,225円
負債総額	15,756,800円
純資産総額（ - ）	22,184,768,425円
発行済数量	13,031,506,441口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.7024円

ハッピーエイジング50

2023年1月31日現在

資産総額	9,727,368,473円
負債総額	5,850,609円
純資産総額（ - ）	9,721,517,864円
発行済数量	6,448,936,785口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.5075円

ハッピーエイジング60

2023年1月31日現在

資産総額	5,285,986,361円
負債総額	2,460,382円
純資産総額（ - ）	5,283,525,979円
発行済数量	4,123,388,227口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.2814円

（参考）S J A Mラージキャップ・バリュー・マザーファンド

2023年1月31日現在

資産総額	39,608,842,044円
負債総額	11,934円
純資産総額（ - ）	39,608,830,110円
発行済数量	15,358,286,002口
1単位当りの純資産額（ / ）	2.5790円

（参考）S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

2023年1月31日現在

資産総額	13,965,401,558円
負債総額	134,995,752円
純資産総額（ - ）	13,830,405,806円
発行済数量	4,454,301,199口
1単位当りの純資産額（ / ）	3.1050円

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2023年1月31日現在

資産総額	25,129,348,366円
負債総額	397,374,066円
純資産総額（ - ）	24,731,974,300円
発行済数量	18,030,329,810口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.3717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

2023年1月31日現在

資産総額	11,327,125,128円
負債総額	1,519円
純資産総額（ - ）	11,327,123,609円
発行済数量	6,610,549,830口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.7135円

（参考）損保ジャパン - T C W 外国株式マザーファンド

2023年1月31日現在

資産総額	18,165,955,856円
負債総額	12,031,633円
純資産総額（ - ）	18,153,924,223円
発行済数量	5,194,818,918口
1単位当りの純資産額（ / ）	3.4946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（2022年7月末現在）
（略）
- (2) 会社の機構（2022年7月末現在）
（略）

<訂正後>

- (1) 資本金の額（2023年1月末現在）
（略）
- (2) 会社の機構（2023年1月末現在）
（略）

2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

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

委託会社の運用する投資信託（親投資信託を除きます。）は2023年1月末現在、計264本（追加型株式投資信託154本、単位型株式投資信託61本、単位型公社債投資信託49本）であり、その純資産総額の合計は1,645,419百万円です。

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

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

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

2. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(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)	
(負債の部)					
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
(純資産の部)					
株主資本					
1 資本金			1,550,000		1,550,000
2 資本剰余金					
(1) 資本準備金			413,280		413,280
資本剰余金合計			413,280		413,280
3 利益剰余金					
(1) その他利益剰余金					
繰越利益剰余金			1,469,821		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					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本 準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	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					株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	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	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-

取得原価を超えないもの	(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

	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）	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

区分	注記番号	第38期中間会計期間 （2022年9月30日） 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	2,743,791
	一般管理費			
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	
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います。

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います。

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

また、成功報酬型の収益は、投資顧問契約に基づき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います。

6. 消費税等の会計処理方法

税抜方式を採用しております。

7. 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			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	

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）

- 満期保有目的の債券
該当事項はありません。
- 子会社株式及び関連会社株式
該当事項はありません。
- 其他有価証券

（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	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-

取得原価を超えないもの	(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】

<訂正前>

（略）

（2）販売会社

名称	資本金の額 ¹ （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。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	
株式会社 S B I 証券	48,323	
岡三にいがた証券株式会社	852	
静岡東海証券株式会社 ²	600	
損保ジャパン D C 証券株式会社	3,000	
松井証券株式会社	11,945	
マネックス証券株式会社	12,200	
みずほ証券株式会社	125,167	
楽天証券株式会社	17,495	
株式会社イオン銀行 ³	51,250	
株式会社大東銀行 ⁴	14,743	
株式会社みずほ銀行	1,404,065	
損害保険ジャパン株式会社	70,000	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

- 1 資本金の額は、2022年3月末現在
- 2 ハッピーエイジング30、40のみの取扱いとなります。
- 3 ハッピーエイジング20、30、40のみの取扱いとなります。
- 4 ハッピーエイジング40のみの取扱いとなります。

(略)

<訂正後>

(略)

(2)販売会社

名称	資本金の額 ¹ (単位:百万円)	事業の内容
auカブコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
SMB C日興証券株式会社	10,000	
株式会社SBI証券	48,323	
岡三にいがた証券株式会社	852	
静岡東海証券株式会社 ²	600	
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	
松井証券株式会社	11,945	
マネックス証券株式会社	12,200	
みずほ証券株式会社	125,167	
楽天証券株式会社	17,495	
株式会社イオン銀行 ³	51,250	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社大東銀行 ⁴	14,743	
PayPay銀行株式会社	37,250	
株式会社みずほ銀行	1,404,065	
損害保険ジャパン株式会社	70,000	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

- 1 資本金の額は、2022年3月末現在
- 2 ハッピーエイジング30、40のみの取扱いとなります。
- 3 ハッピーエイジング20、30、40のみの取扱いとなります。
- 4 ハッピーエイジング40のみの取扱いとなります。

(略)

独立監査人の中間監査報告書

2023年3月20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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング20の2022年7月16日から2023年1月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング20の2023年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年7月16日から2023年1月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBR L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年3月20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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング30の2022年7月16日から2023年1月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング30の2023年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年7月16日から2023年1月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBR L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年3月20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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング40の2022年7月16日から2023年1月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング40の2023年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年7月16日から2023年1月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBR L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年3月20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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング50の2022年7月16日から2023年1月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング50の2023年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年7月16日から2023年1月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBR L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年3月20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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング60の2022年7月16日から2023年1月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ハッピーエイジング60の2023年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年7月16日から2023年1月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. 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。