

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年8月1日提出
【計算期間】	第7期中(自 2022年11月3日至 2023年5月2日)
【ファンド名】	SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055 SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045 SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035
【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
【連絡場所】	東京都中央区日本橋二丁目2番16号
【電話番号】	03-5290-3432
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【ファンドの運用状況】

(1)【投資状況】

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

2023年5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	197,911,309	15.04
親投資信託受益証券	日本	1,106,338,001	84.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		11,553,179	0.88
純資産総額		1,315,802,489	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

2023年5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	190,991,989	9.70
親投資信託受益証券	日本	1,764,334,982	89.65
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		12,675,452	0.65
純資産総額		1,968,002,423	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

2023年5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	204,508,799	4.87
親投資信託受益証券	日本	3,967,118,119	94.39
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		31,336,329	0.74
純資産総額		4,202,963,247	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5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	21,193,346,900	77.35
地方債証券	日本	993,955,000	3.63
特殊債券	日本	857,624,537	3.13
社債券	日本	3,265,267,000	11.92
	フランス	100,201,000	0.37
	イギリス	99,774,000	0.36
		3,465,242,000	12.65
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		888,302,877	3.24
純資産総額		27,398,471,314	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・バリュール・マザーファンド

2023年5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	31,060,490,000	96.69
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,063,193,458	3.31
純資産総額		32,123,683,458	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5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	14,294,163,900	96.74
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		482,407,853	3.26
純資産総額		14,776,571,753	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5月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	5,462,744,670	44.41
	フランス	1,033,565,061	8.40
	イタリア	905,590,294	7.36

ドイツ	877,022,823	7.13
スペイン	610,987,908	4.97
中国	552,659,750	4.49
イギリス	544,339,733	4.43
メキシコ	287,268,636	2.34
ポーランド	235,863,487	1.92
カナダ	223,353,863	1.82
ベルギー	216,324,133	1.76
オーストラリア	193,988,198	1.58
ノルウェー	181,843,455	1.48
オランダ	175,557,531	1.43
オーストリア	114,490,903	0.93
アイルランド	69,345,013	0.56
マレーシア	58,615,656	0.48
フィンランド	45,982,027	0.37
シンガポール	41,234,400	0.34
デンマーク	36,162,649	0.29
スウェーデン	26,329,893	0.21
	11,893,270,083	96.68
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	408,107,455	3.32
純資産総額	12,301,377,538	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）SOMPO外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）マザーファンド

2023年5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	909,331,948	65.31
	ドイツ	73,566,924	5.28
	アイルランド	71,757,708	5.15
	フランス	57,316,455	4.12
	イギリス	46,666,563	3.35
	デンマーク	44,345,152	3.19
	スイス	32,717,685	2.35
	スウェーデン	15,777,937	1.13
	シンガポール	14,268,303	1.02
	オーストラリア	14,232,687	1.02
	ノルウェー	13,279,037	0.95
	オランダ	12,207,340	0.88
	カナダ	11,393,250	0.82
	スペイン	6,776,136	0.49

	ジャージー	4,492,487	0.32
	ベルギー	3,016,068	0.22
	フィンランド	2,561,948	0.18
		1,333,707,628	95.79
投資証券	アメリカ	20,720,846	1.49
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		37,863,402	2.72
純資産総額		1,392,291,876	100.00

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

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

(参考) S N A M コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

2023年5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	メキシコ	561,204,657	17.58
	ブラジル	515,026,815	16.13
	インドネシア	440,624,311	13.80
	マレーシア	406,862,916	12.75
	コロンビア	346,011,726	10.84
	南アフリカ	297,996,779	9.34
	ポーランド	150,669,264	4.72
	ペルー	115,827,150	3.63
	ハンガリー	104,544,397	3.28
	チリ	77,088,171	2.42
	タイ	31,828,603	1.00
		3,047,684,789	95.48
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		144,355,799	4.52
純資産総額		3,192,040,588	100.00

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

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

その他資産の投資状況

2023年5月31日現在

資産の種類	建別	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,328,663,692	41.62
	売建		1,320,445,677	41.37

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

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

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

資産の種類	建別	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
直物為替先渡取引	買建		514,244,568	16.11
	売建		627,400,033	19.66

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（2）【運用実績】

【純資産の推移】

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

直近日（2023年5月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末（2017年11月2日）	7,542,403	7,542,403	1.2498	1.2498
第2計算期間末（2018年11月2日）	38,138,506	38,138,506	1.1983	1.1983
第3計算期間末（2019年11月5日）	142,291,013	142,291,013	1.2301	1.2301
第4計算期間末（2020年11月2日）	279,360,353	279,360,353	1.1237	1.1237
第5計算期間末（2021年11月2日）	659,315,599	659,315,599	1.4470	1.4470
第6計算期間末（2022年11月2日）	1,063,581,692	1,063,581,692	1.5103	1.5103
2022年5月末日	880,163,460		1.4684	
6月末日	931,033,348		1.4814	
7月末日	963,568,666		1.4920	
8月末日	987,798,054		1.5043	
9月末日	989,872,617		1.4515	
10月末日	1,061,007,892		1.5140	
11月末日	1,089,891,626		1.5249	
12月末日	1,084,618,607		1.4876	
2023年1月末日	1,141,148,789		1.5311	
2月末日	1,162,403,880		1.5570	
3月末日	1,225,089,260		1.5589	
4月末日	1,269,472,313		1.5990	
5月末日	1,315,802,489		1.6301	

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

直近日（2023年5月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）	1口当たりの純資産額（円）

		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末	(2017年11月 2日)	6,662,973	6,662,973	1.1900	1.1900
第2計算期間末	(2018年11月 2日)	59,236,329	59,236,329	1.1473	1.1473
第3計算期間末	(2019年11月 5日)	177,171,646	177,171,646	1.1839	1.1839
第4計算期間末	(2020年11月 2日)	375,674,057	375,674,057	1.0999	1.0999
第5計算期間末	(2021年11月 2日)	1,000,684,354	1,000,684,354	1.3328	1.3328
第6計算期間末	(2022年11月 2日)	1,604,846,542	1,604,846,542	1.3754	1.3754
	2022年 5月末日	1,327,143,399		1.3444	
	6月末日	1,382,993,122		1.3534	
	7月末日	1,436,824,175		1.3601	
	8月末日	1,484,367,905		1.3718	
	9月末日	1,502,422,322		1.3325	
	10月末日	1,602,819,401		1.3784	
	11月末日	1,661,135,978		1.3858	
	12月末日	1,661,565,152		1.3566	
	2023年 1月末日	1,740,268,025		1.3886	
	2月末日	1,778,456,221		1.4116	
	3月末日	1,849,893,653		1.4167	
	4月末日	1,920,834,475		1.4479	
	5月末日	1,968,002,423		1.4721	

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

直近日（2023年5月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末	(2017年11月 2日)	20,568,205	20,568,205	1.1398	1.1398
第2計算期間末	(2018年11月 2日)	90,394,214	90,394,214	1.1030	1.1030
第3計算期間末	(2019年11月 5日)	279,508,613	279,508,613	1.1374	1.1374
第4計算期間末	(2020年11月 2日)	674,661,353	674,661,353	1.0688	1.0688
第5計算期間末	(2021年11月 2日)	2,126,166,325	2,126,166,325	1.2186	1.2186
第6計算期間末	(2022年11月 2日)	3,426,284,306	3,426,284,306	1.2381	1.2381
	2022年 5月末日	2,936,097,340		1.2197	
	6月末日	3,105,104,207		1.2267	
	7月末日	3,198,651,755		1.2325	
	8月末日	3,271,971,324		1.2389	
	9月末日	3,265,782,561		1.2121	
	10月末日	3,421,243,471		1.2418	
	11月末日	3,508,070,763		1.2412	
	12月末日	3,522,270,210		1.2151	
	2023年 1月末日	3,587,523,370		1.2350	

2月末日	3,688,919,782		1.2540
3月末日	3,851,308,489		1.2609
4月末日	4,023,279,260		1.2824
5月末日	4,202,963,247		1.2989

【分配の推移】

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7中間計算期間末	

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7中間計算期間末	

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7中間計算期間末	

【収益率の推移】

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

	収益率（％）
第1計算期間	25.0
第2計算期間	4.1
第3計算期間	2.7
第4計算期間	8.6
第5計算期間	28.8
第6計算期間	4.4
第7中間計算期間末	7.5

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

	収益率（％）
第1計算期間	19.0
第2計算期間	3.6
第3計算期間	3.2
第4計算期間	7.1
第5計算期間	21.2
第6計算期間	3.2
第7中間計算期間末	6.5

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

	収益率（％）
第1計算期間	14.0
第2計算期間	3.2
第3計算期間	3.1
第4計算期間	6.0
第5計算期間	14.0
第6計算期間	1.6
第7中間計算期間末	4.5

- (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。

2【設定及び解約の実績】

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055

	設定口数	解約口数
第1計算期間	6,104,082	69,288
第2計算期間	38,087,004	12,294,962
第3計算期間	96,963,950	13,116,584
第4計算期間	190,171,341	57,234,835
第5計算期間	277,519,510	70,501,778
第6計算期間	383,921,744	135,346,924
第7中間計算期間末	154,552,543	64,330,881

（注1）本邦外における設定及び解約はございません。

（注2）設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045

	設定口数	解約口数
第1計算期間	20,589,294	14,990,300
第2計算期間	53,773,312	7,739,646
第3計算期間	108,529,173	10,515,921
第4計算期間	226,957,501	35,046,939
第5計算期間	510,627,530	101,373,156
第6計算期間	549,802,823	133,785,492
第7中間計算期間末	223,616,044	67,241,687

（注1）本邦外における設定及び解約はございません。

（注2）設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035

	設定口数	解約口数
第1計算期間	18,121,057	75,731
第2計算期間	72,348,741	8,438,546
第3計算期間	202,869,686	39,078,259
第4計算期間	477,279,551	91,765,059
第5計算期間	1,402,074,934	288,609,654
第6計算期間	1,412,640,032	390,074,766
第7中間計算期間末	491,116,391	119,169,344

（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。

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11月3日から2023年5月2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。

【SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 2022年11月2日現在	第7期中間計算期間末 2023年5月2日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	17,995,783
コール・ローン	15,357,204	-
投資信託受益証券	160,214,117	196,766,438
親投資信託受益証券	894,700,423	1,082,586,905
流動資産合計	1,070,271,744	1,297,349,126
資産合計	1,070,271,744	1,297,349,126
負債の部		
流動負債		
未払解約金	686,456	448,310
未払受託者報酬	157,501	185,380
未払委託者報酬	5,774,835	6,797,229
未払利息	45	-
その他未払費用	71,215	84,986
流動負債合計	6,690,052	7,515,905
負債合計	6,690,052	7,515,905
純資産の部		
元本等		
元本	704,203,260	794,424,922
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	359,378,432	495,408,299
元本等合計	1,063,581,692	1,289,833,221
純資産合計	1,063,581,692	1,289,833,221
負債純資産合計	1,070,271,744	1,297,349,126

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期中間計算期間 自 2021年11月3日 至 2022年5月2日	第7期中間計算期間 自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
営業収益		
受取配当金	2,483,324	2,048,568
有価証券売買等損益	4,330,858	104,004,903
為替差損益	18,617,967	10,400,999
営業収益合計	25,432,149	95,652,472
営業費用		
支払利息	4,498	3,070
受託者報酬	123,965	185,380
委託者報酬	4,545,462	6,797,229
その他費用	71,818	114,290
営業費用合計	4,745,743	7,099,969
営業利益又は営業損失()	20,686,406	88,552,503
経常利益又は経常損失()	20,686,406	88,552,503
中間純利益又は中間純損失()	20,686,406	88,552,503
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()	688,673	1,433,530
期首剰余金又は期首欠損金()	203,687,159	359,378,432
剰余金増加額又は欠損金減少額	87,309,029	81,787,426
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	87,309,029	81,787,426
剰余金減少額又は欠損金増加額	30,206,662	32,876,532
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	30,206,662	32,876,532
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	282,164,605	495,408,299

（ 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6期 2022年11月2日現在	第7期中間計算期間末 2023年5月2日現在
1．受益権の総数	704,203,260口	794,424,922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 1.5103円 (1万口当たり純資産額) (15,103円)	1口当たり純資産額 1.6236円 (1万口当たり純資産額) (16,236円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第6期中間計算期間	第7期中間計算期間
	自 2021年11月3日 至 2022年5月2日	自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の49の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期	第7期中間計算期間末
	2022年11月2日現在	2023年5月2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6期	第7期中間計算期間
	自 2021年11月3日 至 2022年11月2日	自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
期首元本額	455,628,440円	704,203,260円
期中追加設定元本額	383,921,744円	154,552,543円
期中一部解約元本額	135,346,924円	64,330,881円

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

【SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 2022年11月2日現在	第7期中間計算期間末 2023年5月2日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	30,378,300
コール・ローン	24,825,123	-
投資信託受益証券	152,519,159	189,887,146
親投資信託受益証券	1,436,641,431	1,735,154,602
流動資産合計	1,613,985,713	1,955,420,048
資産合計	1,613,985,713	1,955,420,048
負債の部		
流動負債		
未払解約金	112,556	6,635,938
未払受託者報酬	236,800	282,907
未払委託者報酬	8,682,697	10,372,953
未払利息	73	-
その他未払費用	107,045	129,354
流動負債合計	9,139,171	17,421,152
負債合計	9,139,171	17,421,152
純資産の部		
元本等		
元本	1,166,828,179	1,323,202,536
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	438,018,363	614,796,360
元本等合計	1,604,846,542	1,937,998,896
純資産合計	1,604,846,542	1,937,998,896
負債純資産合計	1,613,985,713	1,955,420,048

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期中間計算期間 自 2021年11月3日 至 2022年5月2日	第7期中間計算期間 自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
営業収益		
受取配当金	2,429,245	1,965,700
有価証券売買等損益	6,125,299	134,220,626
為替差損益	18,190,316	9,593,008
営業収益合計	26,744,860	126,593,318
営業費用		
支払利息	6,463	4,972
受託者報酬	184,155	282,907
委託者報酬	6,752,332	10,372,953
その他費用	97,680	155,503
営業費用合計	7,040,630	10,816,335
営業利益又は営業損失()	19,704,230	115,776,983
経常利益又は経常損失()	19,704,230	115,776,983
中間純利益又は中間純損失()	19,704,230	115,776,983
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()	345,653	1,411,542
期首剰余金又は期首欠損金()	249,873,506	438,018,363
剰余金増加額又は欠損金減少額	91,813,168	87,708,798
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	91,813,168	87,708,798
剰余金減少額又は欠損金増加額	22,917,439	25,296,242
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	22,917,439	25,296,242
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	338,819,118	614,796,360

（ 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6期 2022年11月2日現在	第7期中間計算期間末 2023年5月2日現在
1．受益権の総数	1,166,828,179口	1,323,202,536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) 1.3754円 (13,754円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4646円 (14,646円)

（ 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項目	第6期中間計算期間 自 2021年11月3日 至 2022年5月2日	第7期中間計算期間 自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の49の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期 2022年11月2日現在	第7期中間計算期間末 2023年5月2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6期 自 2021年11月3日 至 2022年11月2日	第7期中間計算期間 自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
期首元本額	750,810,848円	1,166,828,179円
期中追加設定元本額	549,802,823円	223,616,044円
期中一部解約元本額	133,785,492円	67,241,687円

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

【SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 2022年11月2日現在	第7期中間計算期間末 2023年5月2日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	58,521,074
コール・ローン	47,484,955	-
投資信託受益証券	162,808,781	203,325,764
親投資信託受益証券	3,236,914,811	3,823,045,089
流動資産合計	3,447,208,547	4,084,891,927
資産合計	3,447,208,547	4,084,891,927
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,030,210	813,975
未払受託者報酬	521,885	593,638
未払委託者報酬	19,135,815	21,766,598
未払利息	140	-
その他未払費用	236,191	271,742
流動負債合計	20,924,241	23,445,953
負債合計	20,924,241	23,445,953
純資産の部		
元本等		
元本	2,767,291,986	3,139,239,033
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	658,992,320	922,206,941
元本等合計	3,426,284,306	4,061,445,974
純資産合計	3,426,284,306	4,061,445,974
負債純資産合計	3,447,208,547	4,084,891,927

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期中間計算期間 自 2021年11月3日 至 2022年5月2日	第7期中間計算期間 自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
営業収益		
受取配当金	2,867,033	2,078,477
有価証券売買等損益	11,523,645	203,022,659
為替差損益	21,552,019	10,533,193
営業収益合計	35,942,697	194,567,943
営業費用		
支払利息	14,872	10,562
受託者報酬	420,328	593,638
委託者報酬	15,411,798	21,766,598
その他費用	203,467	303,909
営業費用合計	16,050,465	22,674,707
営業利益又は営業損失()	19,892,232	171,893,236
経常利益又は経常損失()	19,892,232	171,893,236
中間純利益又は中間純損失()	19,892,232	171,893,236
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	1,882,505	397,314
期首剰余金又は期首欠損金()	381,439,605	658,992,320
剰余金増加額又は欠損金減少額	164,227,503	119,269,829
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	164,227,503	119,269,829
剰余金減少額又は欠損金増加額	36,606,815	28,345,758
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	36,606,815	28,345,758
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	530,835,030	922,206,941

（ 3 ）【中間注記表】

（ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

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

（ 中間貸借対照表に関する注記 ）

期別	第6期 2022年11月2日現在	第7期中間計算期間末 2023年5月2日現在
1．受益権の総数	2,767,291,986口	3,139,239,033口
2．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.2381円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (12,381円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.2938円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (12,938円)</p>

（ 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項目	第6期中間計算期間 自 2021年11月3日 至 2022年5月2日	第7期中間計算期間 自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の49の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期 2022年11月2日現在	第7期中間計算期間末 2023年5月2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6期 自 2021年11月3日 至 2022年11月2日	第7期中間計算期間 自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
期首元本額	1,744,726,720円	2,767,291,986円
期中追加設定元本額	1,412,640,032円	491,116,391円
期中一部解約元本額	390,074,766円	119,169,344円

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035 / 2045 / 2055の主要投資対象の状況は以下のとおりです。

*なお、以下は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

損保ジャパン日本債券マザーファンド

貸借対照表

科 目	2022年11月2日現在	2023年5月2日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	232,688,551
コール・ローン	353,649,377	-
国債証券	18,971,821,800	21,161,972,400
地方債証券	997,705,000	993,190,000
特殊債券	862,106,206	857,334,608
社債券	3,469,820,000	3,453,888,000
未収入金	-	88,561,800
未収利息	25,435,797	27,223,703
前払費用	1,150,720	3,874,126
流動資産合計	24,681,688,900	26,818,733,188
資産合計	24,681,688,900	26,818,733,188
負債の部		
流動負債		
未払利息	1,046	-
その他未払費用	10,292	32,272
流動負債合計	11,338	32,272
負債合計	11,338	32,272
純資産の部		
元本等		
元本	17,654,578,293	19,070,673,769
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,027,099,269	7,748,027,147
元本等合計	24,681,677,562	26,818,700,916
純資産合計	24,681,677,562	26,818,700,916
負債純資産合計	24,681,688,900	26,818,733,188

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

期別	2022年11月2日現在		2023年5月2日現在	
1. 受益権の総数	17,654,578,293口		19,070,673,769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)	1.3980円 (13,980円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4063円 (14,063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11月2日現在	2023年5月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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11月3日 至 2022年11月2日	自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,366,163,637円	17,654,578,293円
同期中追加設定元本額	3,634,577,117円	1,964,467,835円
同期中一部解約元本額	2,346,162,461円	548,372,359円
元本の内訳*		
SNAM絶対収益ターゲットファンド(適格機関投資家専用)	181,181,817円	175,340,370円
SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド(2%コース)(FofS用)(適格機関投資家専用)	16,896,596円	31,760,871円
SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド(4%コース)(FofS用)(適格機関投資家専用)	45,456,546円	69,874,205円
損保ジャパン国内債券ファンド(適格機関投資家専用)	1,414,318,702円	1,999,074,440円
マルチアセット戦略ファンド(4%型)(非課税適格機関投資家専用)	149,928,014円	252,669,065円
損保ジャパン日本債券ファンド	1,026,321,252円	994,443,980円
ハッピーエイジング20	224,129,753円	250,128,706円
ハッピーエイジング30	1,012,999,186円	1,085,282,394円
ハッピーエイジング40	5,163,322,514円	5,399,388,150円
ハッピーエイジング50	3,958,811,263円	4,071,098,873円
ハッピーエイジング60	2,782,904,097円	2,767,975,625円
好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 円ヘッジありコース	788,659円	- 円
好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 円ヘッジなしコース	6,454,771円	- 円
好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 通貨セレクトコース	116,568,642円	117,377,373円
好配当米国株式プレミアム・ファンド 通貨セレクト・プレミアムコース	9,944,046円	9,861,581円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	1,000,028,736円	1,160,201,857円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	331,765,658円	394,642,389円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	118,907,496円	139,482,592円
ターゲット・リターン戦略ファンド	92,028,064円	146,634,021円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	1,822,481円	3,219,102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	315,091円

項目	自 2021年11月3日 至 2022年11月2日	自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
SOMPO世界分散ファンド(成長型) < DC 年金 >	- 円	150,329円
計	17,654,578,293円	19,070,673,769円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

SJAMラージキャップ・バリュース・マザーファンド

貸借対照表

科 目	2022年11月2日現在	2023年5月2日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	180,450,987
コール・ローン	369,015,933	-
株式	36,532,713,910	30,964,196,610
未収配当金	531,906,300	569,290,500
流動資産合計	37,433,636,143	31,713,938,097
資産合計	37,433,636,143	31,713,938,097
負債の部		
流動負債		
未払利息	1,091	-
その他未払費用	10,169	26,833
流動負債合計	11,260	26,833
負債合計	11,260	26,833
純資産の部		
元本等		
元本	15,638,114,272	11,670,197,617
剰余金		
剰余金又は欠損金()	21,795,510,611	20,043,713,647
元本等合計	37,433,624,883	31,713,911,264
純資産合計	37,433,624,883	31,713,911,264
負債純資産合計	37,433,636,143	31,713,938,097

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法 株式

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

(貸借対照表に関する注記)

期別	2022年11月2日現在	2023年5月2日現在
1. 受益権の総数	15,638,114,272口	11,670,197,617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 2.3937円 (1万口当たり純資産額) (23,937円)	1口当たり純資産額 2.7175円 (1万口当たり純資産額) (27,175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11月2日現在	2023年5月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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11月3日 至 2022年11月2日	自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	12,144,206,002円	15,638,114,272円
同期中追加設定元本額	6,608,566,886円	554,458,089円
同期中一部解約元本額	3,114,658,616円	4,522,374,744円
元本の内訳*		
損保ジャパン日本興亜ラージキャップ・バリュー・ファンド（F o F s用）（適格機関投資家専用）	9,933,774,783円	6,216,816,229円
ハッピーエイジング20	1,748,466,476円	1,732,210,539円
ハッピーエイジング30	1,674,121,539円	1,589,839,802円
ハッピーエイジング40	1,455,171,550円	1,351,111,545円
ハッピーエイジング50	395,887,530円	361,506,941円
ハッピーエイジング60	92,764,604円	81,931,303円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	157,657,853円	162,440,352円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	92,500,158円	96,820,237円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	68,016,057円	71,640,983円
SOMPO日本株バリュー・プラスファンド	16,187,490円	- 円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	3,566,232円	5,573,728円
SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞	- 円	110,503円
SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞	- 円	81,573円
SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞	- 円	113,882円
計	15,638,114,272円	11,670,197,617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11月2日現在	2023年5月2日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	98,324,675
コール・ローン	210,481,643	-
株式	13,085,616,300	14,354,013,700
未収入金	-	9,739,311
未収配当金	147,646,860	227,911,870
流動資産合計	13,443,744,803	14,689,989,556
資産合計	13,443,744,803	14,689,989,556
負債の部		
流動負債		
未払金	-	16,069,070
未払利息	622	-
その他未払費用	135	10,514
流動負債合計	757	16,079,584
負債合計	757	16,079,584
純資産の部		
元本等		
元本	4,606,394,361	4,330,919,558
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,837,349,685	10,342,990,414
元本等合計	13,443,744,046	14,673,909,972
純資産合計	13,443,744,046	14,673,909,972
負債純資産合計	13,443,744,803	14,689,989,556

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

期別	2022年11月2日現在	2023年5月2日現在
1．受益権の総数	4,606,394,361口	4,330,919,558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 2.9185円 (1万口当たり純資産額) (29,185円)	1口当たり純資産額 3.3882円 (1万口当たり純資産額) (33,882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11月2日現在	2023年5月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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11月3日 至 2022年11月2日	自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,556,773,218円	4,606,394,361円
同期中追加設定元本額	572,151,207円	191,773,335円
同期中一部解約元本額	522,530,064円	467,248,138円
元本の内訳*		
ハッピーエイジング20	1,409,431,081円	1,375,679,598円
ハッピーエイジング30	1,355,984,854円	1,262,566,957円
ハッピーエイジング40	1,172,910,141円	1,072,952,449円
ハッピーエイジング50	319,084,524円	287,078,975円
ハッピーエイジング60	74,764,829円	65,064,465円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	127,699,325円	129,007,918円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	74,920,369円	76,888,823円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	55,584,661円	56,990,169円
SOMPO日本株バリュー・プラスファンド	13,099,976円	- 円

項目	自 2021年11月3日 至 2022年11月2日	自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	2,914,601円	4,436,816円
SOMPO世界分散ファンド(安定型) < DC年金 >	- 円	92,762円
SOMPO世界分散ファンド(安定成長型) < DC年金 >	- 円	65,248円
SOMPO世界分散ファンド(成長型) < DC年金 >	- 円	95,378円
計	4,606,394,361円	4,330,919,558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11月2日現在	2023年5月2日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	56,266,039	56,420,983
金銭信託	-	43,900,498
コール・ローン	1,938,973	-
国債証券	11,062,141,004	11,887,101,170
派生商品評価勘定	6,798,360	-
未収入金	846,264,278	-
未収利息	65,783,037	62,719,065
前払費用	10,177,901	48,376,044
流動資産合計	12,049,369,592	12,098,517,760
資産合計	12,049,369,592	12,098,517,760
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,334,329	-
未払金	844,169,432	-
未払利息	5	-
その他未払費用	3,598	6,677
流動負債合計	847,507,364	6,677
負債合計	847,507,364	6,677
純資産の部		
元本等		
元本	6,155,526,827	6,694,038,020
剰余金		
剰余金又は欠損金()	5,046,335,401	5,404,473,063
元本等合計	11,201,862,228	12,098,511,083

	2022年11月2日現在	2023年5月2日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
純資産合計	11,201,862,228	12,098,511,083
負債純資産合計	12,049,369,592	12,098,517,760

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11月2日現在	2023年5月2日現在
1. 受益権の総数	6,155,526,827口	6,694,038,020口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.8198円 (1万円当たり純資産額) (18,198円)	1.8074円 (1万円当たり純資産額) (18,074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11月2日現在	2023年5月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	(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。
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。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（その他の注記）

項目	自 2021年11月3日 至 2022年11月2日	自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	5,855,306,068円	6,155,526,827円
同期中追加設定元本額	705,582,761円	645,941,220円
同期中一部解約元本額	405,362,002円	107,430,027円
元本の内訳*		
S N A M 絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用）	67,622,314円	66,767,518円
ハッピーエイジング20	516,453,777円	596,124,214円
ハッピーエイジング30	1,949,955,054円	2,155,430,751円
ハッピーエイジング40	1,810,684,067円	1,949,745,528円
ハッピーエイジング50	590,743,781円	624,152,149円
ハッピーエイジング60	478,771,827円	488,658,967円
損保ジャパン外国債券ファンド（為替ヘッジなし）	435,380,433円	442,552,157円
S O M P O ターゲットイヤー・ファンド2035	255,576,428円	308,275,542円

項目	自 2021年11月3日 至 2022年11月2日	自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	32,200,359円	39,528,381円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	17,350,341円	20,772,502円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	788,446円	1,425,550円
SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞	- 円	159,457円
SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞	- 円	116,338円
SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞	- 円	328,966円
計	6,155,526,827円	6,694,038,020円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年11月2日 現在				2023年5月2日 現在			
	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引 為替予約取引								
買建	781,119,400	-	777,785,071	3,334,329	-	-	-	-
ドル	781,119,400	-	777,785,071	3,334,329	-	-	-	-
売建	798,590,100	-	791,791,740	6,798,360	-	-	-	-
ユーロ	798,590,100	-	791,791,740	6,798,360	-	-	-	-
合計	1,579,709,500	-	1,569,576,811	3,464,031	-	-	-	-

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

SOMPO外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）マザーファンド

貸借対照表

科 目	2022年11月2日現在	2023年5月2日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	7,567,704	12,553,395
金銭信託	-	34,817,166
コール・ローン	45,410,165	-
株式	1,198,247,345	1,319,050,094
投資証券	18,987,622	20,857,528
未収配当金	1,218,639	2,046,471
流動資産合計	1,271,431,475	1,389,324,654
資産合計	1,271,431,475	1,389,324,654
負債の部		
流動負債		
未払利息	134	-
その他未払費用	643	3,167
流動負債合計	777	3,167
負債合計	777	3,167
純資産の部		
元本等		
元本	609,289,867	619,139,842
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	662,140,831	770,181,645
元本等合計	1,271,430,698	1,389,321,487
純資産合計	1,271,430,698	1,389,321,487
負債純資産合計	1,271,431,475	1,389,324,654

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11月2日現在		2023年5月2日現在	
1. 受益権の総数	609,289,867口		619,139,842口	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0867円 (20,867円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2440円 (22,440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11月2日現在	2023年5月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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11月3日 至 2022年11月2日	自 2022年11月3日 至 2023年5月2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	560,519,306円	609,289,867円
同期中追加設定元本額	250,320,257円	109,427,159円
同期中一部解約元本額	201,549,696円	99,577,184円
元本の内訳*		
SNAM絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用）	75,494,900円	67,295,720円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	162,445,791円	183,727,756円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	149,339,235円	172,315,270円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	154,961,759円	179,204,809円
SOMPO外国株式アクティブバリューファンド（リスク抑制型）	58,694,112円	- 円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	8,354,070円	14,403,135円
SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞	- 円	702,130円
SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞	- 円	619,773円
SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞	- 円	871,249円
計	609,289,867円	619,139,842円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

SNAM コルチェスター・エマージング債券マザーファンド

貸借対照表

	2022年11月2日現在	2023年5月2日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	52,893,492	30,938,109

科 目	2022年11月2日現在	2023年5月2日現在
	金額（円）	金額（円）
金銭信託	-	31,043,146
コール・ローン	43,202,072	-
国債証券	1,479,905,887	3,003,852,556
派生商品評価勘定	27,952,495	56,949,334
未収入金	3,743,958	-
未収利息	21,771,346	33,751,338
前払費用	2,295,145	25,422,181
差入保証金	5,000,000	5,000,000
流動資産合計	1,636,764,395	3,186,956,664
資産合計	1,636,764,395	3,186,956,664
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	31,461,763	60,178,595
未払金	33,934,549	-
未払解約金	30,000,000	-
未払利息	127	-
その他未払費用	370	20,021
流動負債合計	95,396,809	60,198,616
負債合計	95,396,809	60,198,616
純資産の部		
元本等		
元本	1,090,864,825	2,024,881,484
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	450,502,761	1,101,876,564
元本等合計	1,541,367,586	3,126,758,048
純資産合計	1,541,367,586	3,126,758,048
負債純資産合計	1,636,764,395	3,186,956,664

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> <p>直物為替先渡取引</p> <p>個別法による時価法によっております。時価評価にあたっては、原則として、価格提供会社の提供する価額で評価しております。</p>
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、為替差損益及び派生商品取引等損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

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11月2日現在	2023年5月2日現在
1. 受益権の総数	1,090,864,825口	2,024,881,484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 1.4130円 (1万口当たり純資産額) (14,130円)	1口当たり純資産額 1.5442円 (1万口当たり純資産額) (15,442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11月2日現在	2023年5月2日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	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。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

インディアンル ビー	-	-	-	-	15,032,740	-	15,096,527	63,787
合計	649,413,082	-	634,998,171	4,440,545	1,669,898,974	-	1,665,131,008	13,422,460

(注) 時価の算定方法

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

4【委託会社等の概況】

（１）【資本金の額】

（2023年5月末現在）

資本金の額	1,550百万円
会社が発行する株式の総数	50,000株
発行済株式総数	24,085株

最近5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

（２）【事業の内容及び営業の状況】

「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5月末現在、計273本（追加型株式投資信託159本、単位型株式投資信託69本、単位型公社債投資信託45本）であり、その純資産総額の合計は1,665,205百万円です。

（３）【その他】

（１） 定款の変更

該当事項はありません。

（２） 訴訟事件その他の重要事項

該当事項はありません。

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額(円)	171,844.33	188,213.85
1株当たり当期純利益金額(円)	56,457.70	49,191.55

(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おりません。

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

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益(千円)	1,359,783	1,184,778
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)	1,359,783	1,184,778
期中平均株式数(株)	24,085	24,085

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．XBRL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

2023年7月7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
業務執行社員 公認会計士 森 重 俊 寛指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊 藤 雅 人

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SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055の2022年11月3日から2023年5月2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、SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055の2023年5月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年11月3日から2023年5月2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．XBRL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

2023年7月7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SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045の2022年11月3日から2023年5月2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、SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045の2023年5月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年11月3日から2023年5月2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、分析的な手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性

及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年7月7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SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035の2022年11月3日から2023年5月2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、SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035の2023年5月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年11月3日から2023年5月2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かどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性

及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。