

【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9月13日提出
【発行者名】	SOMPOアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 小嶋 信弘
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋二丁目2番16号
【事務連絡者氏名】	津田 浩平
【電話番号】	03-5290-3432
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞ SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞ SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞ 募集額 2,000億円を上限とします。 SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞ 募集額 2,000億円を上限とします。 SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞ 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11月29日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）につきまして、半期報告書の提出に伴い、訂正すべき事項がありましたので、これを訂正するものであります。

2【訂正の内容】

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

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

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

第一部【証券情報】

(3) 【発行（売出）価額の総額】

<訂正前>

当初自己設定

安定型	1,000万円を上限とします。
安定成長型	500万円を上限とします。
成長型	500万円を上限とします。

継続申込期間 各ファンドについて2,000億円を上限とします。

<訂正後>

各ファンドについて2,000億円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

<訂正前>

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

(略)

<訂正後>

取得申込受付日¹の翌営業日の基準価額²とします。

(略)

(7) 【申込期間】

<訂正前>

当初自己設定 2022年12月15日継続申込期間 2022年12月15日から2024年3月14日までです。

(略)

<訂正後>

継続申込期間 2022年12月15日から2024年3月14日までです。

(略)

(9) 【払込期日】

<訂正前>

当初自己設定委託会社は、設定日（2022年12月15日）に、当初自己設定に係る発行価額の総額を、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込みます。

継続申込期間

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

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

<訂正後>

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(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>

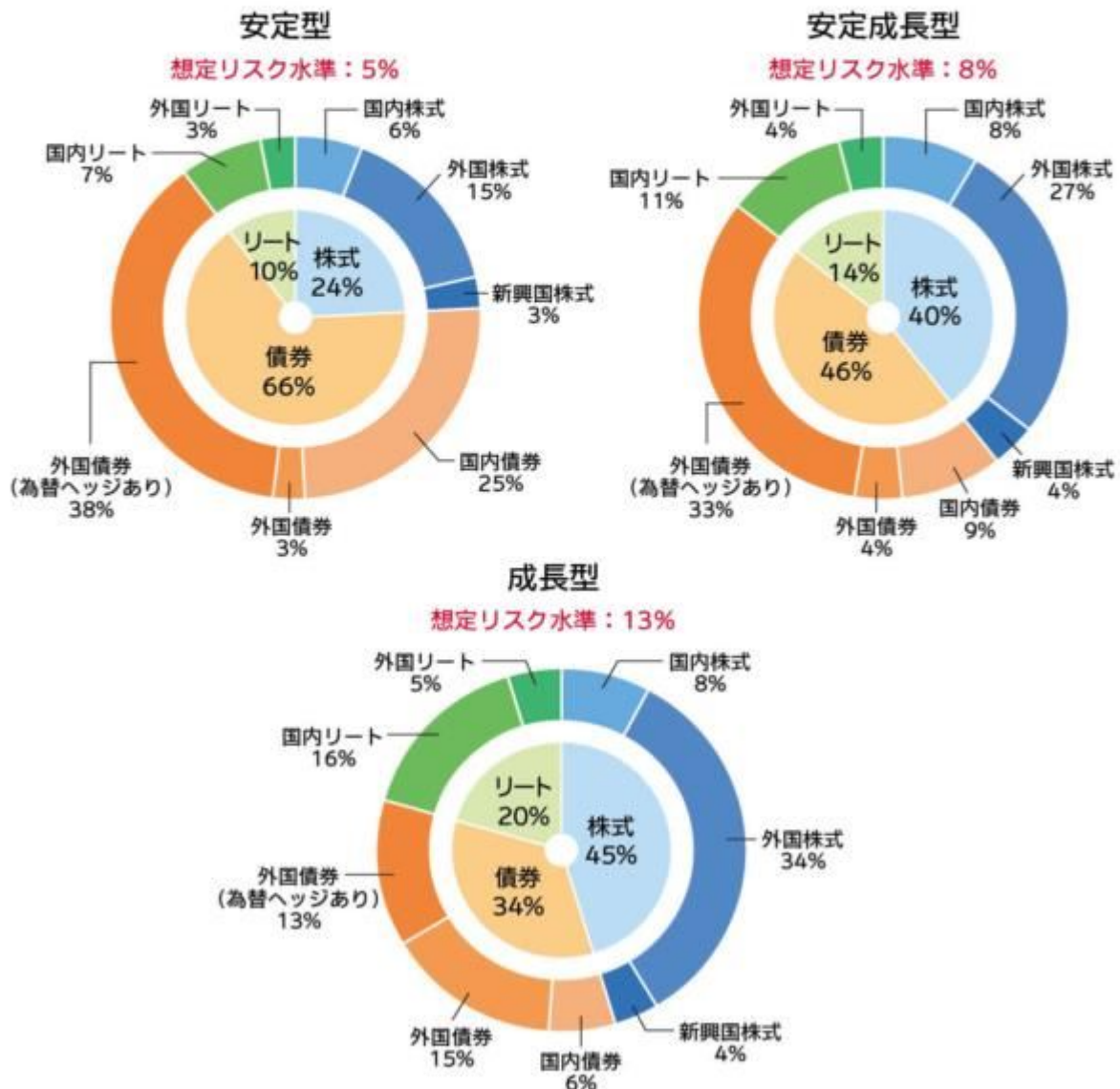
(略)

2

「安定型」「安定成長型」「成長型」の3つのファンドがあります。

- 3つのファンドは各資産への投資配分比率が異なります。
- 投資配分比率は、ポートフォリオの想定リスク水準を踏まえて長期的な視点のほか短期的な視点も考慮して、決定します。投資配分比率の見直しは原則として年4回行います。
 - ・想定リスク水準とは、各ファンドの基準価額の振れ幅の目安であり、月次リターン標準偏差を年率換算した値で計測します。

<想定リスク水準と投資配分比率>



※上記数値は2022年10月現在のものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。
 ※上記グラフの各数値は四捨五入して算出した値のため合計が100%とならないことがあります。
 ※想定リスク水準は、市場環境等により見直しを行う場合があります。
 また、実際の基準価額の振れ幅が、想定リスク水準を上回る場合や下回る場合があります。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

<訂正後>

(略)

<ファンドの特色>

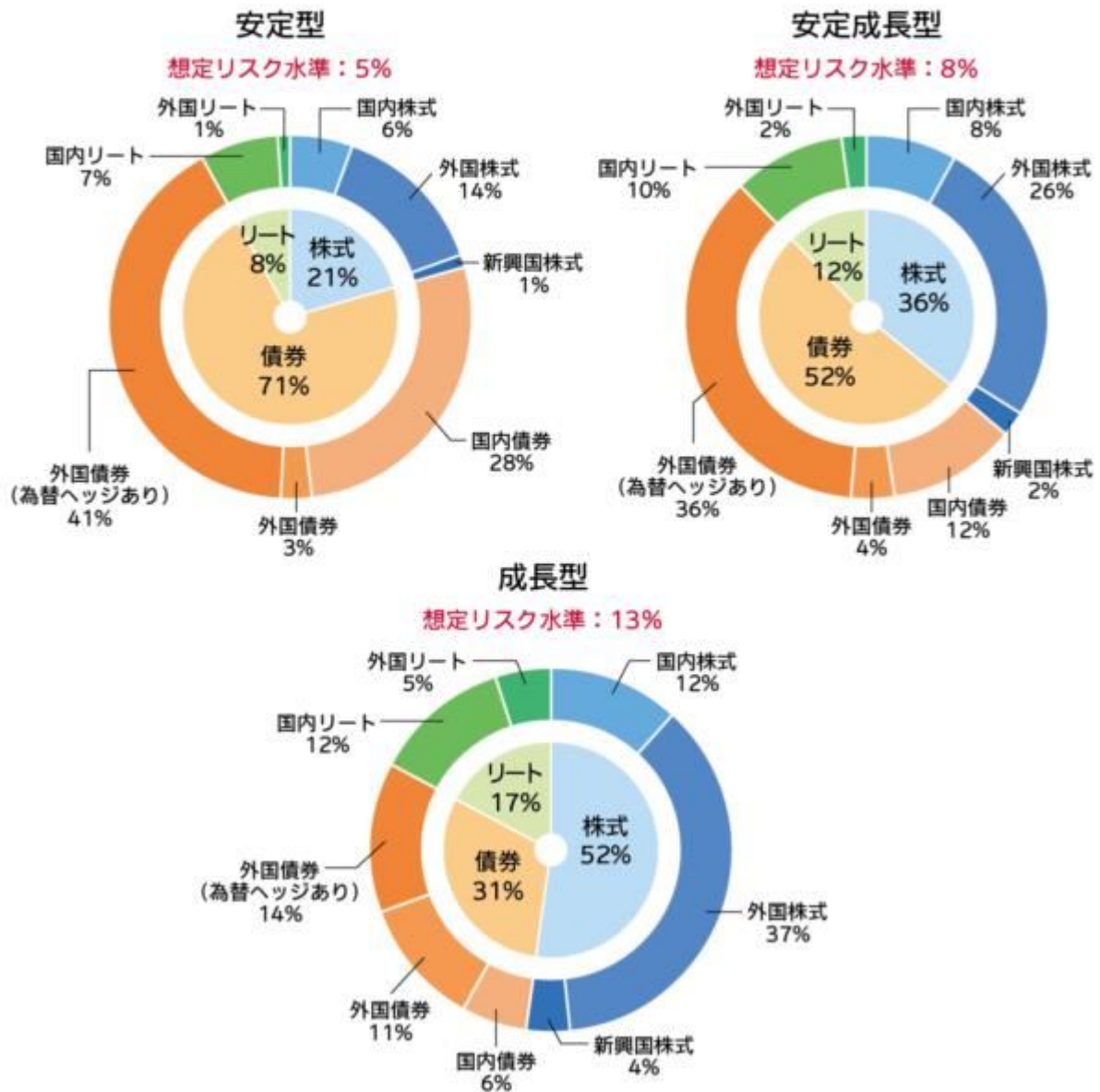
(略)

2

「安定型」「安定成長型」「成長型」の3つのファンドがあります。

- 3つのファンドは各資産への投資配分比率が異なります。
- 投資配分比率は、ポートフォリオの想定リスク水準を踏まえて長期的な視点のほか短期的な視点も考慮して、決定します。投資配分比率の見直しは原則として年4回行います。
 - ・想定リスク水準とは、各ファンドの基準価額の振れ幅の目安であり、月次リターンの標準偏差を年率換算した値で計測します。

<想定リスク水準と投資配分比率>



※上記数値は2023年6月現在のものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。
 ※上記グラフの各数値は四捨五入して算出した値のため合計が100%とならないことがあります。
 ※想定リスク水準は、市場環境等により見直しを行う場合があります。
 また、実際の基準価額の振れ幅が、想定リスク水準を上回る場合や下回る場合があります。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【ファンドの沿革】

<訂正前>

2022年12月15日 信託契約締結、設定、運用開始（予定）

<訂正後>

2022年12月15日 信託契約締結、設定、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

（略）

委託会社等の概況

（ ）資本金の額 1,550百万円 （2022年8月末現在）

（略）

（ ）大株主の状況（2022年8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6月末現在）

（略）

（ ）大株主の状況（2023年6月末現在）

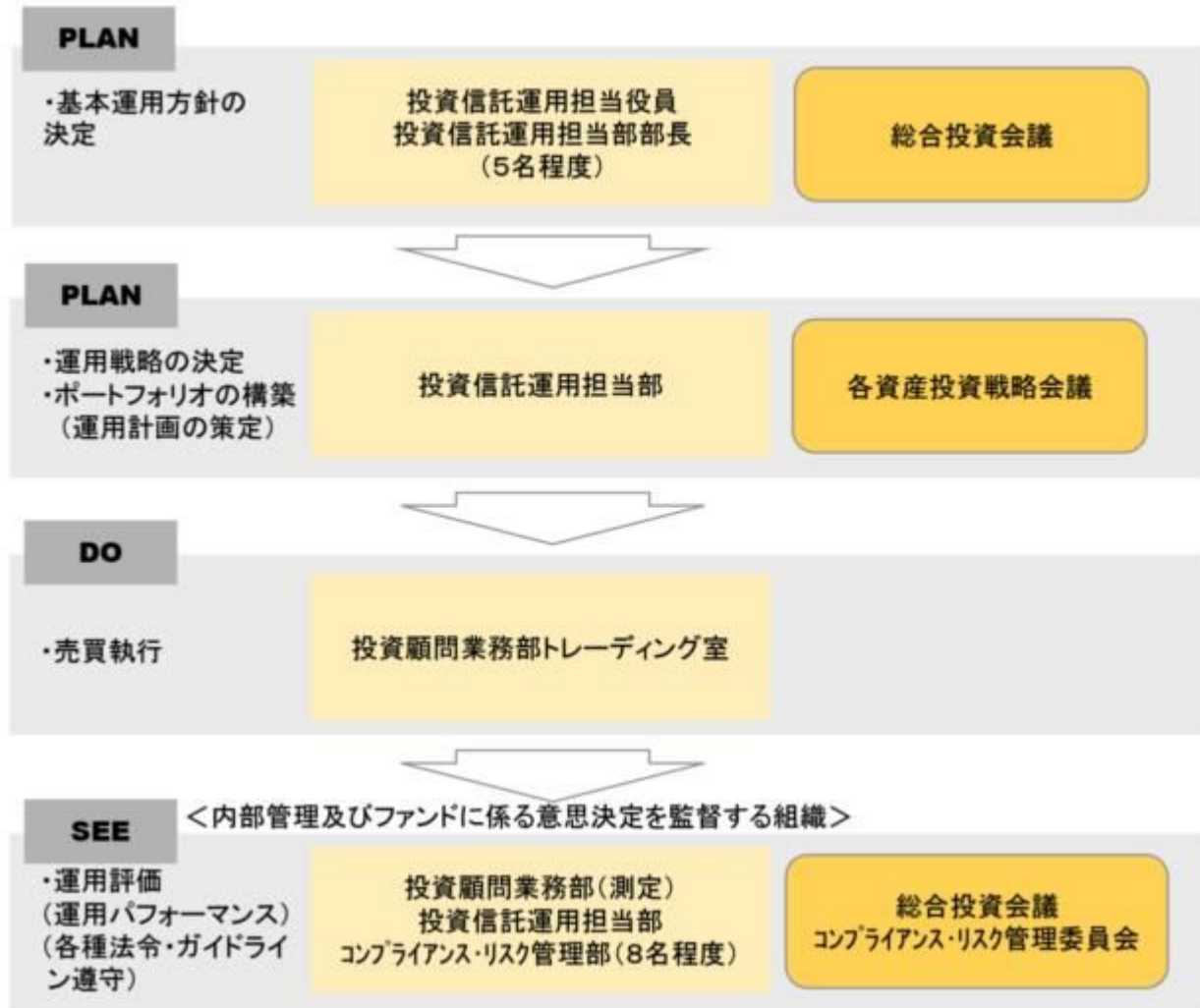
（略）

2【投資方針】

（3）【運用体制】

<訂正前>

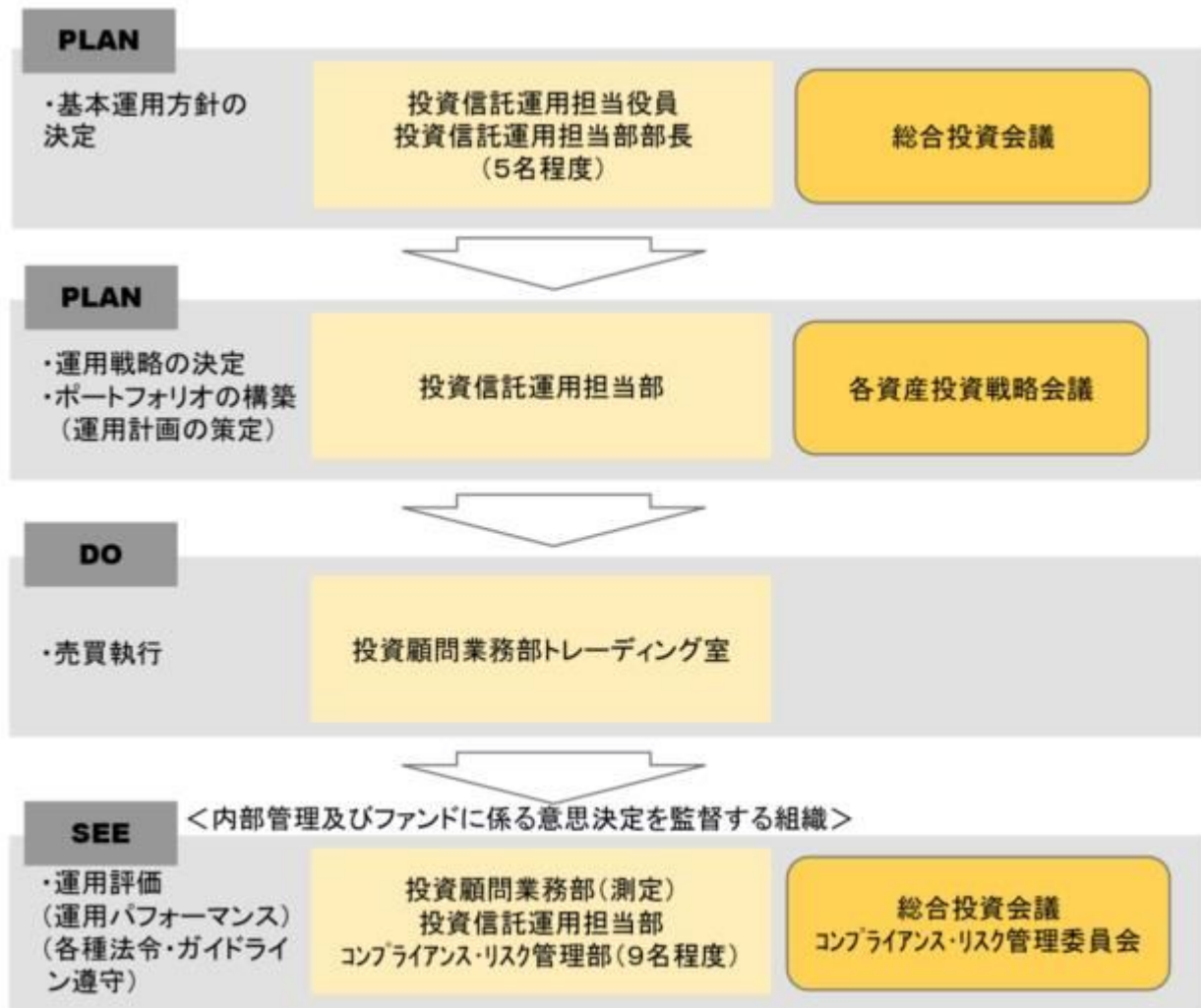
（略）



2022年8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>

(略)



2023年6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>

(略)

(注) 上図は、2022年8月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

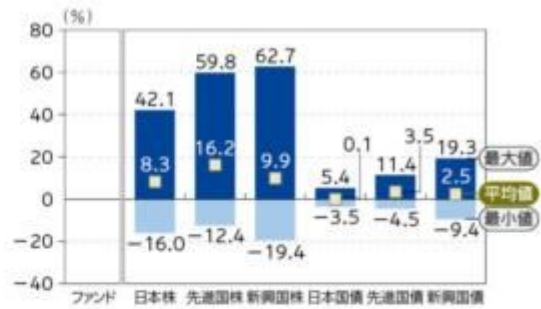
(略)

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

安定型

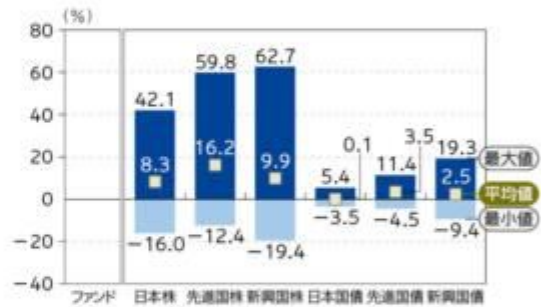
当ファンドは、2022年12月15日から運用を開始する予定であり、記載すべき該当事項はありません。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較



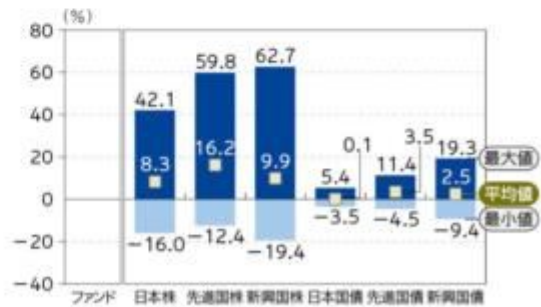
安定成長型

当ファンドは、2022年12月15日から運用を開始する予定であり、記載すべき該当事項はありません。



成長型

当ファンドは、2022年12月15日から運用を開始する予定であり、記載すべき該当事項はありません。



ファンド : 2022年12月15日から運用を開始する予定であり、記載すべき該当事項はありません。
代表的な資産クラス: 2017年9月～2022年8月

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

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

代表的な資産クラスの指数

日本株: 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社に帰属します。

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

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

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

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

先進国株: MSCI コクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

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

日本国債: NOMURA-BPI 国債

野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI 国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

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

J.P. Morgan Securities LLC が算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象とした指数です。なお、J P モルガン G B I - E M グローバル・ダイバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLC に帰属します。

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

<訂正後>

(略)

<リスクの管理体制>

(略)

(注) 上図は、2023年6月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

(略)

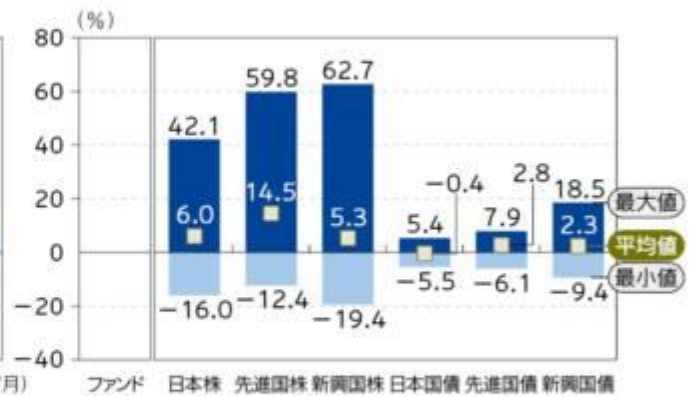
ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

※データは設定日より掲載しています。

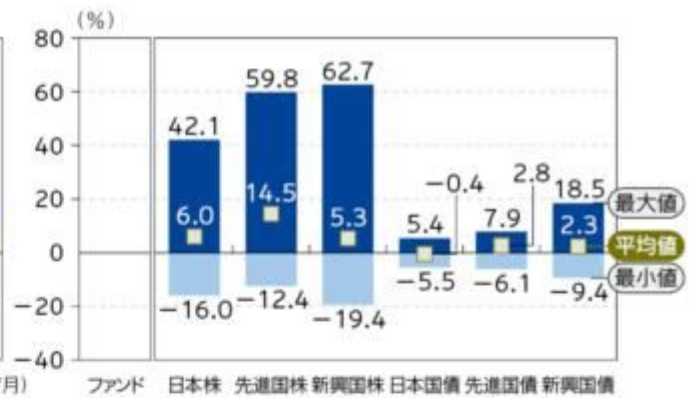
安定型



ファンドと他の代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



安定成長型



成長型



2018年7月～2023年6月

代表的な資産クラス:2018年7月～2023年6月

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

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

代表的な資産クラスの指数

<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・ディバースィファイド(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・ディバースィ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。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

S O M P O 世界分散ファンド(安定型) < D C 年金 >

2023年6月30日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	236,845	2.33
親投資信託受益証券	日本	9,886,259	97.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		45,383	0.45
純資産総額		10,168,487	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。

S O M P O 世界分散ファンド(安定成長型) < D C 年金 >

2023年6月30日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	236,845	4.55
親投資信託受益証券	日本	4,947,414	95.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		23,740	0.45
純資産総額		5,207,999	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世界分散ファンド(成長型) <DC年金>

2023年6月30日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	524,408	9.68
親投資信託受益証券	日本	4,866,124	89.85
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		25,288	0.47
純資産総額		5,415,820	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) SJAMラージキャップ・バリュース・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	33,574,902,880	98.97
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		350,753,155	1.03
純資産総額		33,925,656,035	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) SJAMスモールキャップ・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	15,282,998,810	96.64
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		531,374,508	3.36
純資産総額		15,814,373,318	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6月30日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	996,460,180	65.50
	アイルランド	80,287,733	5.28
	ドイツ	79,311,664	5.21

	フランス	60,563,081	3.98
	イギリス	52,775,476	3.47
	デンマーク	39,323,016	2.58
	スイス	35,677,343	2.35
	スウェーデン	17,027,907	1.12
	オランダ	16,526,420	1.09
	オーストラリア	15,316,800	1.01
	シンガポール	14,678,156	0.96
	ノルウェー	13,671,494	0.90
	カナダ	12,057,796	0.79
	フィンランド	6,480,985	0.43
	ジャージー	4,736,823	0.31
	ベルギー	3,155,064	0.21
		1,448,049,938	95.19
投資証券	アメリカ	19,963,064	1.31
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		53,266,303	3.50
純資産総額		1,521,279,305	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6月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	22,601,952,800	79.83
地方債証券	日本	996,400,000	3.52
特殊債券	日本	858,578,818	3.03
社債券	日本	3,173,922,000	11.21
	フランス	100,379,000	0.35
	イギリス	99,890,000	0.35
		3,374,191,000	11.92
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		481,560,629	1.70
純資産総額		28,312,683,247	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）損保ジャパン外国債券マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	949,393,188	50.65
	フランス	161,139,483	8.60

イタリア	147,775,320	7.88
ドイツ	111,916,520	5.97
スペイン	94,492,202	5.04
イギリス	90,721,932	4.84
中国	80,193,348	4.28
カナダ	38,282,241	2.04
オランダ	35,983,154	1.92
ベルギー	34,079,544	1.82
オーストラリア	29,784,378	1.59
オーストリア	26,970,498	1.44
シンガポール	18,608,288	0.99
メキシコ	16,146,345	0.86
フィンランド	16,086,547	0.86
ポーランド	12,917,257	0.69
アイルランド	11,493,043	0.61
デンマーク	7,541,169	0.40
スウェーデン	5,846,100	0.31
ノルウェー	2,871,999	0.15
	1,892,242,556	100.94
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	17,700,529	0.94
純資産総額	1,874,542,027	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6月30日現在

資産の種類	建別	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		1,917,903,840	102.31

（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。

（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6月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	6,403,968,460	49.76
	フランス	1,035,399,112	8.04
	イタリア	957,652,412	7.44
	ドイツ	877,095,693	6.81
	スペイン	641,391,093	4.98

イギリス	575,866,822	4.47
中国	560,327,233	4.35
カナダ	235,309,605	1.83
ベルギー	226,764,563	1.76
オーストラリア	201,021,799	1.56
オランダ	184,121,550	1.43
メキシコ	134,789,829	1.05
オーストリア	120,236,734	0.93
アイルランド	73,027,790	0.57
ポーランド	67,815,599	0.53
マレーシア	59,706,345	0.46
フィンランド	48,259,642	0.37
シンガポール	42,301,150	0.33
デンマーク	37,965,886	0.29
スウェーデン	27,063,288	0.21
ノルウェー	24,124,795	0.19
	12,534,209,400	97.39
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	336,354,694	2.61
純資産総額	12,870,564,094	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J-REITマザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	1,176,199,800	98.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		22,545,507	1.88
純資産総額		1,198,745,307	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】

SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞

2023年6月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
1	日本	親投資信託受益証券	損保ジャパン外国債券マザーファンド	2,786,240	1.4894	4,150,000	1.4334	3,993,796	39.28

2	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	1,937,127	1.3989	2,710,000	1.4133	2,737,741	26.92
3	日本	親投資信託 受益証券	SOMPO外国株式アクティブパ リリュ（リスク抑制型）マザー ファンド	642,679	2.0659	1,327,711	2.4239	1,557,789	15.32
4	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパンJ-REITマザー ファンド	245,606	2.9285	719,258	2.8747	706,043	6.94
5	日本	親投資信託 受益証券	SJAMラージキャップ・パ リリュ・マザーファンド	103,287	2.4586	253,942	2.9834	308,146	3.03
6	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	81,269	2.9356	238,574	3.6224	294,388	2.90
7	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	153,864	1.7803	273,925	1.8741	288,356	2.84
8	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	18	6,998.66	125,976	7,084.22	127,516	1.25
9	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES GLOBAL REIT ETF	33	3,481.18	114,879	3,313.00	109,329	1.08

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	2.33
親投資信託受益証券	97.22
合計	99.55

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞

2023年6月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （%）
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券マザーファン ド	1,249,864	1.4881	1,860,000	1.4334	1,791,555	34.40
2	日本	親投資信託 受益証券	SOMPO外国株式アクティブパ リリュ（リスク抑制型）マザー ファンド	592,334	2.0659	1,223,703	2.4239	1,435,758	27.57
3	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	407,277	1.3995	570,000	1.4133	575,604	11.05
4	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパンJ-REITマザー ファンド	177,430	2.9285	519,604	2.8747	510,058	9.79
5	日本	親投資信託 受益証券	SJAMラージキャップ・パ リリュ・マザーファンド	74,357	2.4586	182,815	2.9834	221,836	4.26
6	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	59,501	2.9356	174,672	3.6224	215,536	4.14
7	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	105,153	1.7803	187,204	1.8741	197,067	3.78
8	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	18	6,963.88	125,350	7,084.22	127,516	2.45

9	アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GLOBAL REIT ETF	33	3,462.33	114,257	3,313.00	109,329	2.10
---	------	----------	-------------------------	----	----------	---------	----------	---------	------

（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6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	4.55
親投資信託受益証券	95.00
合計	99.54

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞

2023年6月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	親投資信託 受益証券	SOMPO外国株式アクティブバ リュウ（リスク抑制型）マザー ファンド	852,956	2.0659	1,762,122	2.4239	2,067,480	38.17
2	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券マザーファ ンド	465,725	1.4815	690,000	1.4334	667,570	12.33
3	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパンJ-REITマザー ファンド	215,976	2.9285	632,486	2.8747	620,866	11.46
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	312,189	1.7803	555,791	1.8741	585,073	10.80
5	日本	親投資信託 受益証券	SJAMラージキャップ・バ リュウ・マザーファンド	106,666	2.4586	262,250	2.9834	318,227	5.88
6	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	86,758	2.9356	254,687	3.6224	314,272	5.80
7	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES GLOBAL REIT ETF	92	3,424.66	315,069	3,313.02	304,798	5.63
8	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	207,059	1.4005	290,000	1.4133	292,636	5.40
9	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	31	6,894.25	213,722	7,084.19	219,610	4.05

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	9.68
親投資信託受益証券	89.85

合計	99.53
----	-------

（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・マザーファンド

2023年6月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （%）
1	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2,397,900	996.39	2,389,257,195	1,065.00	2,553,763,500	7.53
2	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	363,100	5,990.59	2,175,185,526	6,159.00	2,236,332,900	6.59
3	日本	株式	アイシン	輸送用機器	500,800	3,719.69	1,862,820,807	4,427.00	2,217,041,600	6.53
4	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	374,200	3,479.06	1,301,864,773	4,341.00	1,624,402,200	4.79
5	日本	株式	キリンホールディングス	食料品	756,500	2,008.95	1,519,774,504	2,101.50	1,589,784,750	4.69
6	日本	株式	三井住友トラスト・ホールディングス	銀行業	292,400	4,957.37	1,449,535,970	5,113.00	1,495,041,200	4.41
7	日本	株式	マキタ	機械	347,200	3,468.27	1,204,183,344	4,036.00	1,401,299,200	4.13
8	日本	株式	鹿島建設	建設業	635,600	1,610.80	1,023,827,390	2,170.00	1,379,252,000	4.07
9	日本	株式	日本精工	機械	1,478,100	746.36	1,103,198,249	917.40	1,356,008,940	4.00
10	日本	株式	東レ	繊維製品	1,640,800	801.72	1,315,475,251	800.40	1,313,296,320	3.87
11	日本	株式	三菱地所	不動産業	701,500	1,627.93	1,141,996,811	1,710.00	1,199,565,000	3.54
12	日本	株式	旭化成	化学	1,199,900	962.96	1,155,458,415	972.00	1,166,302,800	3.44
13	日本	株式	京セラ	電気機器	138,500	6,733.89	932,643,890	7,791.00	1,079,053,500	3.18
14	日本	株式	住友重機械工業	機械	272,800	2,999.77	818,338,085	3,438.00	937,886,400	2.76
15	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	1,520,900	542.83	825,593,864	562.60	855,658,340	2.52
16	日本	株式	日揮ホールディングス	建設業	446,200	1,759.46	785,074,705	1,865.00	832,163,000	2.45
17	日本	株式	ヤマトホールディングス	陸運業	287,600	2,333.80	671,203,729	2,603.00	748,622,800	2.21
18	日本	株式	王子ホールディングス	パルプ・紙	1,367,100	537.98	735,478,758	537.60	734,952,960	2.17
19	日本	株式	日本ハム	食料品	184,700	3,812.08	704,091,600	3,901.00	720,514,700	2.12
20	日本	株式	クレディセゾン	その他金融業	319,400	1,826.97	583,536,725	2,204.50	704,117,300	2.08
21	日本	株式	総合警備保障	サービス業	863,500	702.15	606,309,979	814.20	703,061,700	2.07
22	日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	380,600	1,671.54	636,188,653	1,757.00	668,714,200	1.97
23	日本	株式	パナソニックホールディングス	電気機器	375,600	1,191.43	447,502,925	1,753.50	658,614,600	1.94
24	日本	株式	スズケン	卸売業	165,100	3,484.82	575,344,586	3,913.00	646,036,300	1.90
25	日本	株式	日本テレビホールディングス	情報・通信業	396,900	1,082.66	429,711,298	1,369.00	543,356,100	1.60
26	日本	株式	J F Eホールディングス	鉄鋼	257,500	1,746.81	449,804,590	2,050.00	527,875,000	1.56
27	日本	株式	E N E O Sホールディングス	石油・石炭製品	1,019,800	483.10	492,672,577	494.40	504,189,120	1.49
28	日本	株式	大阪瓦斯	電気・ガス業	222,200	2,250.51	500,063,818	2,207.50	490,506,500	1.45

29	日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	177,700	2,886.50	512,932,564	2,738.00	486,542,600	1.43
30	日本	株式	アルプスアルパイン	電気機器	382,300	1,421.60	543,479,647	1,257.00	480,551,100	1.42

(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6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	7.61
		食料品	6.81
		繊維製品	3.87
		パルプ・紙	2.17
		化学	3.44
		医薬品	1.16
		石油・石炭製品	1.49
		鉄鋼	1.56
		非鉄金属	1.97
		機械	10.89
		電気機器	7.47
		輸送用機器	12.70
		電気・ガス業	1.45
		陸運業	2.21
		情報・通信業	1.60
		卸売業	1.90
		銀行業	21.05
保険業	1.43		
その他金融業	2.08		
不動産業	4.05		
サービス業	2.07		
合計			98.97

(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6月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	めぶきフィナンシャルグループ	銀行業	1,625,000	276.95	450,049,866	341.60	555,100,000	3.51
2	日本	株式	ジェイテクト	機械	413,000	993.59	410,352,670	1,305.00	538,965,000	3.41
3	日本	株式	豊田合成	輸送用機器	192,600	2,269.09	437,026,734	2,722.00	524,257,200	3.32

4	日本	株式	八十二銀行	銀行業	770,000	475.87	366,419,900	624.40	480,788,000	3.04
5	日本	株式	E I Z O	電気機器	100,300	3,788.14	379,950,469	4,730.00	474,419,000	3.00
6	日本	株式	日本テレビホールディングス	情報・通信業	340,300	1,160.38	394,877,314	1,369.00	465,870,700	2.95
7	日本	株式	森永乳業	食料品	89,600	4,052.04	363,062,784	4,718.00	422,732,800	2.67
8	日本	株式	いよぎんホールディングス	銀行業	508,400	634.64	322,653,058	808.40	410,990,560	2.60
9	日本	株式	マブチモーター	電気機器	95,000	3,886.15	369,184,266	4,008.00	380,760,000	2.41
10	日本	株式	エン・ジャパン	サービス業	149,900	2,356.52	353,242,973	2,478.00	371,452,200	2.35
11	日本	株式	東邦ホールディングス	卸売業	139,900	1,862.50	260,563,750	2,647.00	370,315,300	2.34
12	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	280,000	774.35	216,820,370	1,275.00	357,000,000	2.26
13	日本	株式	九州フィナンシャルグループ	銀行業	577,000	411.34	237,348,549	606.60	350,008,200	2.21
14	日本	株式	群馬銀行	銀行業	653,500	385.07	251,645,195	528.40	345,309,400	2.18
15	日本	株式	ほくほくフィナンシャルグループ	銀行業	293,100	818.85	240,005,177	1,149.50	336,918,450	2.13
16	日本	株式	第四北越フィナンシャルグループ	銀行業	100,900	2,598.89	262,228,126	3,105.00	313,294,500	1.98
17	日本	株式	日本ライフライン	卸売業	296,900	980.56	291,128,806	1,030.00	305,807,000	1.93
18	日本	株式	北洋銀行	銀行業	1,050,000	228.03	239,440,452	284.00	298,200,000	1.89
19	日本	株式	トラスコ中山	卸売業	127,000	1,954.42	248,211,340	2,274.00	288,798,000	1.83
20	日本	株式	東洋インキＳＣホールディングス	化学	122,900	1,879.78	231,024,962	2,175.00	267,307,500	1.69
21	日本	株式	ケーズホールディングス	小売業	205,000	1,199.64	245,928,155	1,255.50	257,377,500	1.63
22	日本	株式	総合警備保障	サービス業	300,000	708.44	212,532,000	814.20	244,260,000	1.54
23	日本	株式	東亞合成	化学	188,000	1,094.44	205,754,720	1,288.00	242,144,000	1.53
24	日本	株式	青山商事	小売業	181,600	941.45	170,967,754	1,317.00	239,167,200	1.51
25	日本	株式	ひろぎんホールディングス	銀行業	288,300	645.06	185,971,805	816.00	235,252,800	1.49
26	日本	株式	サワイグループホールディングス	医薬品	61,000	3,910.35	238,531,745	3,625.00	221,125,000	1.40
27	日本	株式	シチズン時計	精密機器	250,000	604.98	151,245,000	866.00	216,500,000	1.37
28	日本	株式	セイノーホールディングス	陸運業	100,000	1,122.90	112,290,000	2,045.00	204,500,000	1.29
29	日本	株式	七十七銀行	銀行業	78,800	1,760.40	138,719,768	2,560.00	201,728,000	1.28
30	日本	株式	市光工業	電気機器	366,000	388.79	142,297,305	544.00	199,104,000	1.26

（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6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	1.17
		食料品	2.67
		繊維製品	0.70
		パルプ・紙	1.14
		化学	7.30
		医薬品	2.51

	ガラス・土石製品	0.45
	鉄鋼	1.15
	金属製品	1.20
	機械	4.44
	電気機器	9.58
	輸送用機器	4.66
	精密機器	1.37
	その他製品	1.38
	電気・ガス業	1.59
	陸運業	1.29
	情報・通信業	3.32
	卸売業	6.94
	小売業	6.22
	銀行業	29.22
	その他金融業	0.25
	不動産業	0.73
	サービス業	7.34
合計		96.64

（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）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6月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （%）
1	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3,310	20,277.63	67,118,984	27,488.65	90,987,445	5.98
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1,430	32,683.66	46,737,639	48,578.89	69,467,826	4.57
3	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,933	24,645.70	47,640,144	23,792.85	45,991,596	3.02
4	アメリカ	株式	ADOBE SYSTEMS INC	ソフトウェア・サービス	620	42,809.89	26,542,137	70,141.81	43,487,924	2.86
5	アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	990	16,059.09	15,898,501	40,819.03	40,410,844	2.66
6	デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,742	17,944.52	31,259,365	22,573.48	39,323,016	2.58
7	アメリカ	株式	VMWARE INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	1,760	16,190.75	28,495,733	20,866.96	36,725,851	2.41
8	アメリカ	株式	S&P GLOBAL INC	金融サービス	610	46,094.89	28,117,886	57,392.84	35,009,633	2.30

9	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	1,770	14,225.12	25,178,477	18,544.22	32,823,271	2.16
10	アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	710	37,990.83	26,973,496	44,704.76	31,740,384	2.09
11	アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	生活必需品流通・小売り	1,400	20,498.47	28,697,871	22,369.05	31,316,680	2.06
12	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	687	41,374.53	28,424,308	44,630.82	30,661,375	2.02
13	アイルランド	株式	MEDTRONIC INC	ヘルスケア機器・サービス	2,400	12,150.58	29,161,396	12,580.78	30,193,877	1.98
14	アメリカ	株式	MARSH&MCLENNAN COS	保険	1,110	23,240.44	25,796,897	26,957.99	29,923,370	1.97
15	アメリカ	株式	QUALCOMM INCORPORATED	半導体・半導体製造装置	1,710	17,362.36	29,689,648	17,117.51	29,270,958	1.92
16	フランス	株式	SANOFI	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,650	13,899.06	22,933,449	15,410.12	25,426,711	1.67
17	アメリカ	株式	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	素材	670	31,485.37	21,095,198	37,884.43	25,382,573	1.67
18	アメリカ	株式	COLGATE-PALMOLIVE CO	家庭用品・パーソナル用品	2,250	10,647.76	23,957,467	11,100.43	24,975,977	1.64
19	アメリカ	株式	NIKE INC -CL B	耐久消費財・アパレル	1,510	14,065.81	21,239,375	16,437.51	24,820,650	1.63
20	アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,450	14,487.40	21,006,731	16,462.16	23,870,139	1.57
21	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	521	51,651.89	26,910,638	44,037.10	22,943,333	1.51
22	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	646	28,809.51	18,610,946	33,974.05	21,947,241	1.44
23	ドイツ	株式	MUENCHENER RUECKVER AG-RE	保険	405	43,541.80	17,634,430	53,379.12	21,618,544	1.42
24	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	3,760	5,396.01	20,289,029	5,363.18	20,165,557	1.33
25	アメリカ	株式	ROCKWELL AUTOMATION INC	資本財	420	35,957.51	15,102,158	47,011.55	19,744,854	1.30
26	イギリス	株式	RIO TINTO PLC	素材	2,120	9,469.34	20,075,012	9,143.84	19,384,943	1.27
27	アメリカ	株式	TJX COMPANIES INC	一般消費財・サービス流通・小売り	1,590	10,394.69	16,527,570	12,141.46	19,304,926	1.27
28	イギリス	株式	GSK PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,343	2,610.49	19,168,833	2,550.32	18,727,022	1.23
29	アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	610	21,270.75	12,975,158	30,510.24	18,611,250	1.22
30	アメリカ	株式	SYSCO CORP	生活必需品流通・小売り	1,740	11,852.62	20,623,567	10,603.11	18,449,427	1.21

(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6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.09
		素材	6.17
		資本財	5.73
		運輸	2.01
		耐久消費財・アパレル	3.75
		メディア・娯楽	3.77
		一般消費財・サービス流通・小売り	6.20
		生活必需品流通・小売り	3.64
		食品・飲料・タバコ	1.94
		家庭用品・パーソナル用品	2.34
		ヘルスケア機器・サービス	2.69
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	12.01
		銀行	2.97
		金融サービス	2.30
		保険	6.02
		ソフトウェア・サービス	17.46
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.98
		電気通信サービス	2.67
		公益事業	1.38
半導体・半導体製造装置	3.06		
投資証券			1.31
合計			96.50

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

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2023年6月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率(%)	償還日	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	1,240,000,000	109.70	1,360,304,400	107.31	1,330,730,800	1.2000000	2035/9/20	4.70
2	日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	1,200,000,000	97.33	1,167,960,000	98.51	1,182,168,000	0.1000000	2031/9/20	4.18
3	日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	1,160,000,000	98.96	1,148,044,800	99.25	1,151,334,800	0.1000000	2030/9/20	4.07
4	日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	1,010,000,000	98.80	997,880,000	100.10	1,011,040,300	0.1000000	2028/9/20	3.57

5	日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	950,000,000	99.23	942,752,500	100.17	951,643,500	1.1000000	2028/6/20	3.36
6	日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	860,000,000	107.74	926,612,200	107.41	923,777,600	1.2000000	2034/12/20	3.26
7	日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	840,000,000	99.32	834,333,600	99.02	831,801,600	0.2000000	2032/3/20	2.94
8	日本	国債証券	第182回利付国債(20年)	790,000,000	99.63	787,148,000	102.10	806,629,500	1.1000000	2042/9/20	2.85
9	日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	800,000,000	100.04	800,352,000	100.19	801,520,000	0.0050000	2026/12/20	2.83
10	日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	800,000,000	98.33	786,650,000	99.08	792,656,000	0.1000000	2030/12/20	2.80
11	日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	700,000,000	101.10	707,735,000	101.23	708,645,000	0.5000000	2032/12/20	2.50
12	日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	700,000,000	98.52	689,648,000	98.70	690,928,000	0.2000000	2032/9/20	2.44
13	日本	国債証券	第174回利付国債(20年)	700,000,000	93.20	652,463,000	92.13	644,938,000	0.4000000	2040/9/20	2.28
14	日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	620,000,000	100.08	620,553,400	100.22	621,376,400	0.0050000	2026/6/20	2.19
15	日本	国債証券	第158回利付国債(20年)	600,000,000	98.07	588,474,000	98.17	589,044,000	0.5000000	2036/9/20	2.08
16	日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	510,000,000	100.17	510,867,000	100.23	511,178,100	0.0050000	2026/3/20	1.81
17	日本	国債証券	第154回利付国債(5年)	450,000,000	99.62	448,321,500	100.44	451,989,000	0.1000000	2027/9/20	1.60
18	日本	国債証券	第159回利付国債(20年)	450,000,000	100.66	452,970,000	99.19	446,382,000	0.6000000	2036/12/20	1.58
19	日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	450,000,000	99.02	445,612,500	98.86	444,906,000	0.2000000	2032/6/20	1.57
20	日本	国債証券	第171回利付国債(20年)	450,000,000	90.74	408,337,000	91.52	411,867,000	0.3000000	2039/12/20	1.45
21	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	99.99	399,984,000	0.0010000	2024/8/28	1.41
22	日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	400,000,000	99.45	397,800,000	99.71	398,844,000	0.1000000	2029/12/20	1.41
23	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	98.26	393,052,000	0.1000000	2030/6/20	1.39
24	日本	国債証券	第150回利付国債(20年)	320,000,000	109.21	349,472,000	109.61	350,771,200	1.4000000	2034/9/20	1.24
25	日本	特殊債券	第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	300,000,000	106.08	318,255,000	104.91	314,757,000	1.1760000	2029/1/26	1.11
26	日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	270,000,000	114.86	310,122,000	112.45	303,633,900	1.7000000	2033/6/20	1.07
27	日本	国債証券	第156回利付国債(5年)	300,000,000	100.51	301,533,000	100.78	302,340,000	0.2000000	2027/12/20	1.07

28	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	100.63	301,914,000	0.6590000	2024/6/25	1.07
29	日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	300,000,000	100.19	300,591,000	100.23	300,705,000	0.1000000	2028/3/20	1.06
30	日本	国債証券	第76回利付国債(30年)	290,000,000	100.05	290,147,700	103.43	299,949,900	1.4000000	2052/9/20	1.06

(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6月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	79.83
地方債証券	3.52
特殊債券	3.03
社債券	11.92
合計	98.30

(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マザーファンド

2023年6月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還日	投資比率(%)
1	アメリカ	国債証券	Treasury 4.125 250131	800,000	14,308.58	114,468,699	14,271.32	114,170,563	4.1250000	2025/1/31	6.09
2	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 250228	810,000	14,127.24	114,430,725	13,966.04	113,124,991	2.7500000	2025/2/28	6.03
3	アメリカ	国債証券	Treasury 4.125 321115	480,000	15,261.83	73,256,831	14,779.91	70,943,607	4.1250000	2032/11/15	3.78
4	アメリカ	国債証券	Treasury 1.75 291115	550,000	13,020.18	71,611,018	12,702.48	69,863,658	1.7500000	2029/11/15	3.73
5	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 280215	410,000	14,211.82	58,268,492	13,619.43	55,839,668	2.7500000	2028/2/15	2.98
6	アメリカ	国債証券	Treasury 3.75 300531	290,000	14,449.97	41,904,941	14,281.51	41,416,393	3.7500000	2030/5/31	2.21
7	アメリカ	国債証券	Treasury 2.25 270815	300,000	13,818.41	41,455,245	13,399.68	40,199,043	2.2500000	2027/8/15	2.14
8	イタリア	国債証券	ITALY 1.45 250515	260,000	15,225.03	39,585,101	15,119.89	39,311,719	1.4500000	2025/5/15	2.10
9	アメリカ	国債証券	Treasury 4.0 521115	260,000	15,407.00	40,058,223	14,734.60	38,309,983	4.0000000	2052/11/15	2.04
10	ドイツ	国債証券	GERMANY 0.25 290215	260,000	13,997.24	36,392,834	13,934.99	36,230,979	0.2500000	2029/2/15	1.93
11	イタリア	国債証券	ITALY 2.8 281201	240,000	15,002.81	36,006,745	15,070.81	36,169,956	2.8000000	2028/12/1	1.93

12	アメリカ	国債証券	Treasury 1.75 410815	350,000	11,126.53	38,942,864	10,097.76	35,342,161	1.7500000	2041/8/15	1.89
13	スペイン	国債証券	SPAIN 0.5 311031	270,000	12,554.78	33,897,931	12,589.34	33,991,218	0.5000000	2031/10/31	1.81
14	アメリカ	国債証券	Treasury 0.75 260331	250,000	13,291.23	33,228,083	13,103.47	32,758,678	0.7500000	2026/3/31	1.75
15	アメリカ	国債証券	Treasury 2.25 270215	240,000	13,788.54	33,092,518	13,480.67	32,353,611	2.2500000	2027/2/15	1.73
16	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 320815	240,000	13,337.63	32,010,312	13,255.82	31,813,977	2.7500000	2032/8/15	1.70
17	フランス	国債証券	FRANCE 0.0 250225	210,000	14,868.41	31,223,664	14,924.48	31,341,408	0.0000000	2025/2/25	1.67
18	フランス	国債証券	FRANCE 0.0 291125	230,000	13,214.76	30,393,948	13,180.08	30,314,202	0.0000000	2029/11/25	1.62
19	アメリカ	国債証券	Treasury 3.125 290831	210,000	13,905.99	29,202,581	13,759.32	28,894,580	3.1250000	2029/8/31	1.54
20	フランス	国債証券	FRANCE 2.0 321125	190,000	14,779.77	28,081,578	14,597.29	27,734,851	2.0000000	2032/11/25	1.48
21	アメリカ	国債証券	Treasury 1.875 260630	200,000	13,836.91	27,673,833	13,454.61	26,909,238	1.8750000	2026/6/30	1.44
22	イタリア	国債証券	ITALY 2.45 330901	190,000	13,590.16	25,821,311	13,739.72	26,105,479	2.4500000	2033/9/1	1.39
23	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 421115	200,000	13,085.34	26,170,695	11,828.01	23,656,025	2.7500000	2042/11/15	1.26
24	スペイン	国債証券	SPAIN 2.15 251031	150,000	15,766.47	23,649,708	15,351.02	23,026,542	2.1500000	2025/10/31	1.23
25	アメリカ	国債証券	Treasury 3.0 480215	180,000	13,790.47	24,822,853	12,104.39	21,787,918	3.0000000	2048/2/15	1.16
26	中国	国債証券	CGB 2.91 281014	1,000,000	2,012.93	20,129,346	2,031.94	20,319,411	2.9100000	2028/10/14	1.08
27	カナダ	国債証券	CANADA 0.5 301201	230,000	8,899.08	20,467,890	8,832.55	20,314,871	0.5000000	2030/12/1	1.08
28	中国	国債証券	CGB 2.8 290324	1,000,000	1,998.40	19,984,020	2,016.81	20,168,184	2.8000000	2029/3/24	1.08
29	中国	国債証券	CGB 2.8 321115	1,000,000	1,977.17	19,771,759	2,002.50	20,025,053	2.8000000	2032/11/15	1.07
30	アメリカ	国債証券	Treasury 2.375 290515	150,000	14,204.67	21,307,005	13,206.54	19,809,824	2.3750000	2029/5/15	1.06

(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6月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	100.94
合計	100.94

(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6月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率(%)	償還日	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	Treasury 4.125 250131	8,920,000	14,391.82	1,283,751,197	14,271.32	1,273,001,783	4.1250000	2025/1/31	9.89
2	アメリカ	国債証券	Treasury 1.75 291115	4,950,000	12,975.92	642,308,417	12,702.48	628,772,922	1.7500000	2029/11/15	4.89
3	アメリカ	国債証券	Treasury 4.125 321115	4,170,000	15,259.53	636,322,575	14,779.91	616,322,586	4.1250000	2032/11/15	4.79
4	アメリカ	国債証券	Treasury 3.125 290831	4,400,000	13,922.15	612,574,821	13,759.32	605,410,278	3.1250000	2029/8/31	4.70
5	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 280215	3,760,000	14,238.01	535,349,477	13,619.43	512,090,635	2.7500000	2028/2/15	3.98
6	ドイツ	国債証券	GERMANY 0.0 261009	2,570,000	14,428.71	370,817,954	14,393.60	369,915,726	0.0000000	2026/10/9	2.87
7	アメリカ	国債証券	Treasury 0.75 260331	2,520,000	13,287.44	334,843,643	13,103.47	330,207,475	0.7500000	2026/3/31	2.57
8	フランス	国債証券	FRANCE 0.0 250225	2,000,000	14,939.53	298,790,688	14,924.48	298,489,607	0.0000000	2025/2/25	2.32
9	アメリカ	国債証券	Treasury 1.75 410815	2,730,000	11,126.84	303,762,999	10,097.76	275,668,862	1.7500000	2041/8/15	2.14
10	イタリア	国債証券	ITALY 0.95 320601	2,080,000	12,020.78	250,032,416	12,303.83	255,919,706	0.9500000	2032/6/1	1.99
11	スペイン	国債証券	SPAIN 0.0 280131	1,860,000	13,656.15	254,004,550	13,607.18	253,093,622	0.0000000	2028/1/31	1.97
12	アメリカ	国債証券	Treasury 4.0 521115	1,670,000	15,468.32	258,321,071	14,734.60	246,067,966	4.0000000	2052/11/15	1.91
13	アメリカ	国債証券	Treasury 1.5 270131	1,800,000	13,546.21	243,831,835	13,130.09	236,341,630	1.5000000	2027/1/31	1.84
14	中国	国債証券	CGB 2.8 321115	11,000,000	1,977.17	217,489,350	2,002.50	220,275,588	2.8000000	2032/11/15	1.71
15	イタリア	国債証券	ITALY 1.45 250515	1,390,000	15,152.32	210,617,380	15,119.89	210,166,496	1.4500000	2025/5/15	1.63
16	アメリカ	国債証券	Treasury 2.25 270215	1,460,000	13,966.88	203,916,545	13,480.67	196,817,806	2.2500000	2027/2/15	1.53
17	アメリカ	国債証券	Treasury 2.375 290515	1,310,000	14,204.67	186,081,181	13,206.55	173,005,806	2.3750000	2029/5/15	1.34
18	スペイン	国債証券	SPAIN 0.5 311031	1,290,000	12,624.31	162,853,690	12,589.34	162,402,488	0.5000000	2031/10/31	1.26
19	アメリカ	国債証券	Treasury 3.0 480215	1,340,000	13,790.47	184,792,359	12,104.39	162,198,953	3.0000000	2048/2/15	1.26
20	中国	国債証券	CGB 2.6 320901	7,000,000	1,972.34	138,064,228	1,968.06	137,764,896	2.6000000	2032/9/1	1.07
21	ベルギー	国債証券	BELGIUM 3.0 340622	880,000	17,768.61	156,363,785	15,593.35	137,221,513	3.0000000	2034/6/22	1.07
22	メキシコ	国債証券	MEXICO 8.5 290531	16,000,000	835.23	133,638,127	842.43	134,789,829	8.5000000	2029/5/31	1.05
23	アメリカ	国債証券	Treasury 1.625 310515	1,090,000	13,003.22	141,735,142	12,300.36	134,073,952	1.6250000	2031/5/15	1.04
24	フランス	国債証券	FRANCE 2.0 321125	880,000	14,768.03	129,958,678	14,597.29	128,456,154	2.0000000	2032/11/25	1.00
25	アメリカ	国債証券	Treasury 2.875 490515	1,040,000	13,666.44	142,130,977	11,853.49	123,276,387	2.8750000	2049/5/15	0.96
26	中国	国債証券	CGB 2.8 290324	6,000,000	1,998.40	119,904,121	2,016.81	121,009,105	2.8000000	2029/3/24	0.94
27	アメリカ	国債証券	Treasury 2.0 510815	1,160,000	11,431.01	132,599,734	9,762.47	113,244,664	2.0000000	2051/8/15	0.88
28	フランス	国債証券	FRA 0.75 281125	800,000	14,543.32	116,346,624	14,116.38	112,931,117	0.7500000	2028/11/25	0.88
29	アメリカ	国債証券	Treasury 1.25 310815	900,000	12,753.32	114,779,884	11,873.88	106,864,991	1.2500000	2031/8/15	0.83
30	カナダ	国債証券	CANADA 5.75 290601	860,000	12,703.63	109,251,261	12,207.13	104,981,391	5.7500000	2029/6/1	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。

（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6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.39
合計	97.39

（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J - R E I Tマザーファンド

2023年6月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	216	550,169	118,836,515	566,000	122,256,000	10.20
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	208	535,941	111,475,735	548,000	113,984,000	9.51
3	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	600	163,337	98,002,380	166,100	99,660,000	8.31
4	日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	185	404,966	74,918,861	402,500	74,462,500	6.21
5	日本	投資証券	森トラストリート投資法人	933	69,504	64,847,435	72,000	67,176,000	5.60
6	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	793	80,611	63,924,618	83,900	66,532,700	5.55
7	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	786	78,147	61,424,310	73,500	57,771,000	4.82
8	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	431	119,307	51,421,415	125,300	54,004,300	4.51
9	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	334	156,851	52,388,468	161,000	53,774,000	4.49
10	日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	521	99,378	51,775,996	96,300	50,172,300	4.19
11	日本	投資証券	日本リート投資法人	138	334,520	46,163,762	341,500	47,127,000	3.93
12	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	302	148,696	44,906,446	147,400	44,514,800	3.71
13	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	116	347,758	40,339,964	348,500	40,426,000	3.37
14	日本	投資証券	グローバル・ワン不動産投資法人	347	106,296	36,885,051	114,000	39,558,000	3.30
15	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	99	305,001	30,195,169	346,500	34,303,500	2.86
16	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	225	155,280	34,938,002	145,400	32,715,000	2.73
17	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	83	311,841	25,882,826	289,300	24,011,900	2.00
18	日本	投資証券	ザイマックス・リート投資法人	207	110,204	22,812,261	115,700	23,949,900	2.00
19	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	38	584,000	22,192,000	626,000	23,788,000	1.98
20	日本	投資証券	G L P 投資法人	160	148,960	23,833,712	142,100	22,736,000	1.90
21	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	82	295,042	24,193,509	276,200	22,648,400	1.89
22	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	16	651,000	10,416,000	649,000	10,384,000	0.87
23	日本	投資証券	産業ファンド投資法人	64	155,700	9,964,800	151,600	9,702,400	0.81
24	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル	23	338,000	7,774,000	345,000	7,935,000	0.66
25	日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	18	427,000	7,686,000	413,000	7,434,000	0.62
26	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	22	317,000	6,974,000	312,500	6,875,000	0.57

27	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	17	351,500	5,975,500	344,000	5,848,000	0.49
28	日本	投資証券	阪急阪神リート投資法人	37	147,200	5,446,400	144,700	5,353,900	0.45
29	日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	7	504,000	3,528,000	500,000	3,500,000	0.29
30	日本	投資証券	S O S I L A 物流リート投資法人	18	136,000	2,448,000	130,800	2,354,400	0.20

(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投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.12
合計	98.12

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

SOMPO世界分散ファンド(安定型) < DC年金 >

該当事項はありません。

SOMPO世界分散ファンド(安定成長型) < DC年金 >

該当事項はありません。

SOMPO世界分散ファンド(成長型) < DC年金 >

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) SOMPO 外国株式アクティブバリュー(リスク抑制型)マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 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J-REITマザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞

該当事項はありません。

SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞

該当事項はありません。

SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞

該当事項はありません。

（参考）SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）SJAMスモールキャップ・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）SOMPO外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）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マザーファンド

2023年6月30日現在

種類	通貨	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
----	----	-----------	----	-------------	-------------	-------------

為替予約取引	ドル	売建	6,601,000.00	912,528,266	956,065,736	51.00
	カナダドル	売建	364,000.00	37,476,784	39,761,940	2.12
	メキシコペソ	売建	2,105,000.00	16,476,887	17,776,725	0.95
	ユーロ	売建	4,084,000.00	608,767,836	643,177,315	34.31
	ポンド	売建	506,000.00	87,710,158	92,478,988	4.93
	スウェーデンクローナ	売建	595,000.00	7,637,896	7,942,476	0.42
	ノルウェークローネ	売建	220,000.00	2,762,034	2,952,114	0.16
	デンマーククローネ	売建	493,000.00	9,866,014	10,425,224	0.56
	ポーランドズロチ	売建	368,000.00	12,105,728	13,025,396	0.69
	オーストラリアドル	売建	330,000.00	30,183,318	31,576,545	1.68
	シンガポールドル	売建	183,000.00	18,825,905	19,553,074	1.04
	オフショア人民元	売建	4,173,000.00	81,537,916	83,168,307	4.44

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当銘柄の時価の比率です。

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

（参考）損保ジャパン外国債券（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 J - R E I T 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】

SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞

直近日（2023年6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）
2022年12月末日	9,741,936		0.9742	
2023年 1月末日	9,834,289		0.9834	
2月末日	9,815,893		0.9816	
3月末日	9,866,858		0.9867	
4月末日	9,969,056		0.9969	
5月末日	9,999,188		0.9999	
6月末日	10,168,487		1.0168	

SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞

直近日（2023年6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）
2022年12月末日	4,855,477		0.9711	
2023年 1月末日	4,916,648		0.9833	
2月末日	4,921,529		0.9843	
3月末日	4,929,439		0.9859	
4月末日	5,012,401		1.0025	
5月末日	5,053,434		1.0107	
6月末日	5,207,999		1.0416	

SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞

直近日（2023年6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）
2022年12月末日	4,838,310		0.9677	
2023年 1月末日	4,917,415		0.9835	
2月末日	4,969,176		0.9938	
3月末日	4,952,597		0.9905	
4月末日	5,076,414		1.0153	
5月末日	5,159,189		1.0318	
6月末日	5,415,820		1.0832	

【分配の推移】

SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞

	1口当たりの分配金（円）
第1中間計算期間末	

SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞

	1口当たりの分配金（円）
第1中間計算期間末	

SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞

	1口当たりの分配金（円）
第1中間計算期間末	

【収益率の推移】

SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞

	収益率（％）
第1中間計算期間末	0.7

（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世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞

	収益率（％）
第1中間計算期間末	2.4

（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。

SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞

	収益率（％）
第1中間計算期間末	5.5

（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。

（4）【設定及び解約の実績】

SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞

	設定口数	解約口数
第1中間計算期間末	10,000,000	

（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世界分散ファンド(安定成長型) <DC年金>

	設定口数	解約口数
第1中間計算期間末	5,000,000	

(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世界分散ファンド(成長型) <DC年金>

	設定口数	解約口数
第1中間計算期間末	5,000,000	

(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。

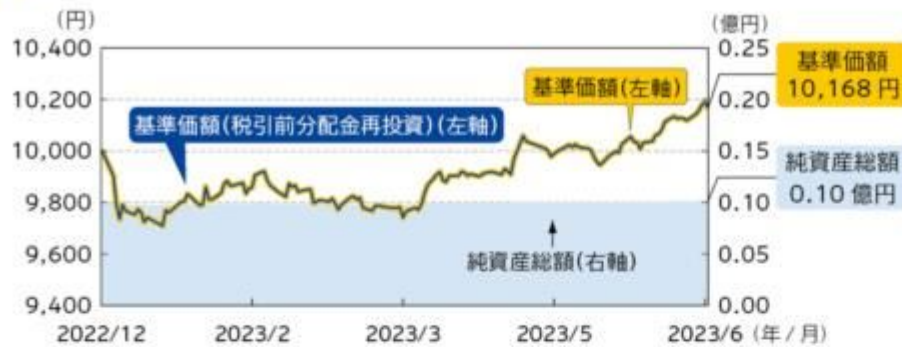
参考情報

基準日:2023年6月30日

● 基準価額・純資産の推移 2022/12/15 ~ 2023/06/30

● 分配の推移

● 安定型



● 安定型

ファンドの初回決算日は、2023年12月15日のため、記載すべき該当事項はありません。

● 安定成長型



● 安定成長型

ファンドの初回決算日は、2023年12月15日のため、記載すべき該当事項はありません。

● 成長型



● 成長型

ファンドの初回決算日は、2023年12月15日のため、記載すべき該当事項はありません。

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

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

● 主要な資産の状況

	安定型	安定成長型	成長型
資産別構成			
資産の種類	純資産比	純資産比	純資産比
損保ジャパン外国債券マザーファンド	39.28%	34.40%	12.33%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	26.92%	11.05%	5.40%
SOMPO外国株式アクティブバリュー(リスク抑制)マザー	15.32%	27.57%	38.17%
損保ジャパンJ-REITマザーファンド	6.94%	9.79%	11.46%
SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	3.03%	4.26%	5.88%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	2.90%	4.14%	5.80%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	2.84%	3.78%	10.80%
ISHARES CORE MSCI EMERGING	1.25%	2.45%	4.05%
ISHARES GLOBAL REIT ETF	1.08%	2.10%	5.63%
コール・ローン等	0.44%	0.46%	0.48%
合計	100.00%	100.00%	100.00%

● 損保ジャパン外国債券マザーファンド

組入上位5銘柄						
	銘柄名	発行国	種類	通貨	償還日	純資産比
1	Treasury 4.125 250131	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2025/01/31	6.1%
2	Treasury 2.75 250228	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2025/02/28	6.0%
3	Treasury 4.125 321115	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2032/11/15	3.8%
4	Treasury 1.75 291115	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2029/11/15	3.7%
5	Treasury 2.75 280215	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2028/02/15	3.0%
組入銘柄数					137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154回利付国債(20年)	国債証券	2035/09/20	4.7%
2	第364回利付国債(10年)	国債証券	2031/09/20	4.2%
3	第360回利付国債(10年)	国債証券	2030/09/20	4.1%
4	第352回利付国債(10年)	国債証券	2028/09/20	3.6%
5	第351回利付国債(10年)	国債証券	2028/06/20	3.4%
組入銘柄数			101銘柄	

● SOMPO外国株式アクティブバリュー(リスク抑制)マザーファンド

組入上位5銘柄					
	銘柄名	通貨	発行国/地域	業種	純資産比
1	APPLE INC	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	6.0%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	4.6%
3	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ・ドル	アメリカ	ヘルスケア	3.0%
4	ADOBE SYSTEMS INC	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	2.9%
5	META PLATFORMS INC-CLASS A	アメリカ・ドル	アメリカ	コミュニケーション・サービス	2.7%
組入銘柄数			90銘柄		

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

● 損保ジャパンJ-REITマザーファンド

組入上位5銘柄

	銘柄名	業種	純資産比
1	日本ビルファンド投資法人	オフィスREIT	10.2%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	オフィスREIT	9.5%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	各種REIT	8.3%
4	アクティビア・プロパティーズ投資法人	各種REIT	6.2%
5	森トラストリート投資法人	各種REIT	5.6%
組入銘柄数			31銘柄

● S J A M ラージキャップ・バリュー・マザーファンド

組入上位5銘柄

	銘柄名	業種	純資産比
1	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7.5%
2	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	6.6%
3	アイシン	輸送用機器	6.5%
4	本田技研工業	輸送用機器	4.8%
5	キリンホールディングス	食料品	4.7%
組入銘柄数			35銘柄

● S J A M スモールキャップ・マザーファンド

組入上位5銘柄

	銘柄名	業種	純資産比
1	めぶきフィナンシャルグループ	銀行業	3.5%
2	ジェイテクト	機械	3.4%
3	豊田合成	輸送用機器	3.3%
4	八十二銀行	銀行業	3.0%
5	E I Z O	電気機器	3.0%
組入銘柄数			77銘柄

● 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

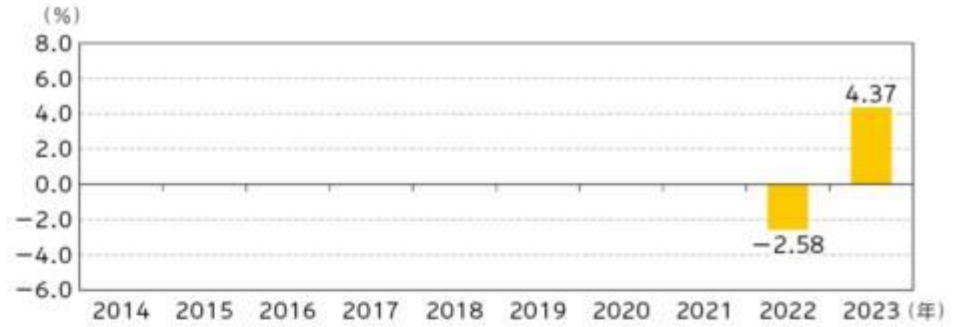
組入上位5銘柄

	銘柄名	発行国	種類	通貨	償還日	純資産比
1	Treasury 4.125 250131	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2025/01/31	9.9%
2	Treasury 1.75 291115	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2029/11/15	4.9%
3	Treasury 4.125 321115	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2032/11/15	4.8%
4	Treasury 3.125 290831	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2029/08/31	4.7%
5	Treasury 2.75 280215	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2028/02/15	4.0%
組入銘柄数					139銘柄	

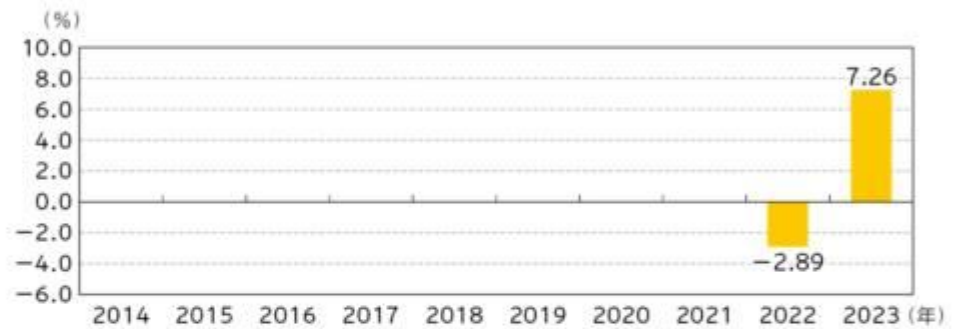
- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

年間収益率の推移（暦年ベース）

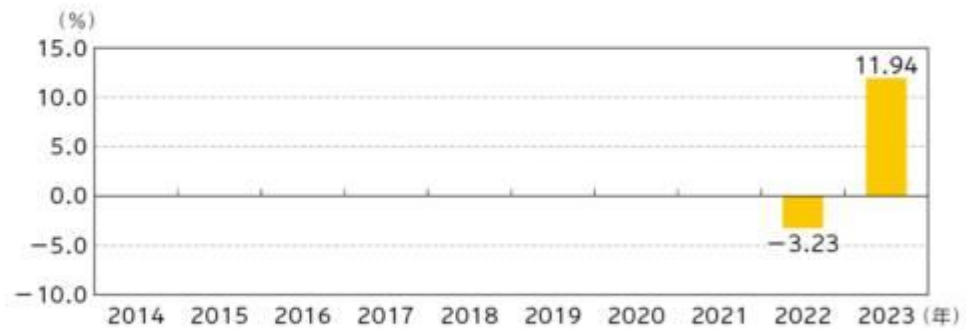
● 安定型



● 安定成長型



● 成長型



- ファンドの年間収益率は基準価額（税引前分配金再投資）を使用して計算しています。
- 2022年は設定日（12月15日）から年末、2023年は年初から基準日までの収益率です。
- 各ファンドはベンチマークを設定していません。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

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

(略)

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

(略)

<訂正後>

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

(略)

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

(略)

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12月15日から2023年6月14日までの中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)	
第1期中間計算期間末 2023年6月14日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	1,765
金銭信託	91,321
投資信託受益証券	232,254
親投資信託受益証券	9,783,424
未収配当金	1,638
流動資産合計	10,110,402
資産合計	
10,110,402	
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	1,625
未払委託者報酬	43,045
その他未払費用	680
流動負債合計	45,350
負債合計	
45,350	
純資産の部	
元本等	
元本	10,000,000
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	65,052
元本等合計	10,065,052
純資産合計	
10,065,052	
負債純資産合計	
10,110,402	

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)	
第1期中間計算期間 自 2022年12月15日 至 2023年6月14日	
営業収益	
受取配当金	3,366
有価証券売買等損益	105,545
為替差損益	8,861
営業収益合計	117,772
営業費用	

第1期中間計算期間
自 2022年12月15日
至 2023年6月14日

支払利息	2
受託者報酬	1,625
委託者報酬	43,045
その他費用	8,048
営業費用合計	52,720
営業利益又は営業損失（ ）	65,052
経常利益又は経常損失（ ）	65,052
中間純利益又は中間純損失（ ）	65,052
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（ ）	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	65,052

（ 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。 第1期計算期間の取扱い 当ファンドは2022年12月15日に設定されたため、当計算期間は2022年12月15日から2023年6月14日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

期別	第1期中間計算期間末 2023年6月14日現在
----	----------------------------

1. 受益権の総数		10,000,000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)	1.0065円 (10,065円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期中間計算期間 自 2022年12月15日 至 2023年6月14日
1. その他費用	その他費用の内訳は、監査費用(680円)、カストディフィー(7,368円)となっております。

(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1期中間計算期間末 2023年6月14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、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。
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。

(その他の注記)

項目	第1期中間計算期間 自 2022年12月15日 至 2023年6月14日
期首元本額	10,000,000円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	- 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世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期中間計算期間末 2023年6月14日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,221
金銭信託	45,540
投資信託受益証券	232,254
親投資信託受益証券	4,862,118
未収配当金	1,639
流動資産合計	5,142,772
資産合計	
5,142,772	
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	795
未払委託者報酬	21,550
その他未払費用	323
流動負債合計	22,668
負債合計	
22,668	
純資産の部	
元本等	
元本	5,000,000
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	120,104
元本等合計	5,120,104
純資産合計	
5,120,104	
負債純資産合計	
5,142,772	

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2022年12月15日 至 2023年6月14日
営業収益	
受取配当金	2,790
有価証券売買等損益	140,127
為替差損益	7,218
営業収益合計	150,135
営業費用	
支払利息	1
受託者報酬	795
委託者報酬	21,550
その他費用	7,685
営業費用合計	30,031
営業利益又は営業損失（ ）	120,104
経常利益又は経常損失（ ）	120,104
中間純利益又は中間純損失（ ）	120,104
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（ ）	-

第1期中間計算期間
自 2022年12月15日
至 2023年6月14日

期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	120,104

（ 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。 第1期計算期間の取扱い 当ファンドは2022年12月15日に設定されたため、当計算期間は2022年12月15日から2023年6月14日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

期別	第1期中間計算期間末 2023年6月14日現在
1．受益権の総数	5,000,000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 1.0240円 (1万口当たり純資産額) (10,240円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期中間計算期間
	自 2022年12月15日 至 2023年6月14日
1. その他費用	その他費用の内訳は、監査費用（323円）、カストディフィー（7,362円）となっております。

（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1期中間計算期間末
	2023年6月14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、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。
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。

（その他の注記）

項目	第1期中間計算期間
	自 2022年12月15日 至 2023年6月14日
期首元本額	5,000,000円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	- 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世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞】

（1）【中間貸借対照表】

(単位：円)

第1期中間計算期間末
2023年6月14日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,167
金銭信託	44,504
投資信託受益証券	512,941
親投資信託受益証券	4,734,296
未収配当金	3,407
流動資産合計	5,297,315
資産合計	5,297,315
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	815
未払委託者報酬	21,678
その他未払費用	326
流動負債合計	22,819
負債合計	22,819
純資産の部	
元本等	
元本	5,000,000
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	274,496
元本等合計	5,274,496
純資産合計	5,274,496
負債純資産合計	5,297,315

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

第1期中間計算期間
自 2022年12月15日
至 2023年6月14日

営業収益	
受取配当金	5,404
有価証券売買等損益	286,903
為替差損益	12,385
営業収益合計	304,692
営業費用	
支払利息	4
受託者報酬	815
委託者報酬	21,678
その他費用	7,699
営業費用合計	30,196
営業利益又は営業損失（ ）	274,496
経常利益又は経常損失（ ）	274,496
中間純利益又は中間純損失（ ）	274,496
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	274,496

(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。 第1期計算期間の取扱い 当ファンドは2022年12月15日に設定されたため、当計算期間は2022年12月15日から2023年6月14日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

期別	第1期中間計算期間末 2023年6月14日現在	
1. 受益権の総数		5,000,000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)	1.0549円 (10,549円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期中間計算期間 自 2022年12月15日 至 2023年6月14日
1. その他費用	その他費用の内訳は、監査費用（326円）、カスタディフィー（7,373円）となっております。

(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1期中間計算期間末 2023年6月14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、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。
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。

（その他の注記）

項目	第1期中間計算期間 自 2022年12月15日 至 2023年6月14日
期首元本額	5,000,000円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	- 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世界分散ファンド（安定型） / （安定成長型） / （成長型） < DC年金 > の主要投資対象の状況は以下のとおりです。

* なお、以下は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド

貸借対照表

	2023年6月14日現在
科 目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	347,800,424
株式	32,794,585,060

		2023年6月14日現在
科 目	金額（円）	
未収配当金	383,395,100	
流動資産合計	33,525,780,584	
資産合計	33,525,780,584	
負債の部		
流動負債		
その他未払費用	22,976	
流動負債合計	22,976	
負債合計	22,976	
純資産の部		
元本等		
元本	11,404,458,597	
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	22,121,299,011	
元本等合計	33,525,757,608	
純資産合計	33,525,757,608	
負債純資産合計	33,525,780,584	

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	2023年6月14日現在	
1. 受益権の総数	11,404,458,597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)	2.9397円 (29,397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	2023年6月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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ぬ。 (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つた場合、当該価額が異なることもあります。

(その他の注記)

項目	自 2022年12月15日 至 2023年6月14日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	15,532,528,426円
同期中追加設定元本額	296,856,198円
同期中一部解約元本額	4,424,926,027円
元本の内訳*	
損保ジャパン日本興亜ラージキャップ・バリュウ・ファンド(F o F s用)(適格機関投資家専用)	6,035,535,732円
ハッピーエイジング20	1,717,526,849円
ハッピーエイジング30	1,568,804,862円
ハッピーエイジング40	1,318,060,727円
ハッピーエイジング50	348,607,752円
ハッピーエイジング60	77,940,314円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	161,785,895円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	96,324,496円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	71,266,534円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	8,321,126円
SOMPO世界分散ファンド(安定型)<DC年金>	103,287円
SOMPO世界分散ファンド(安定成長型)<DC年金>	74,357円
SOMPO世界分散ファンド(成長型)<DC年金>	106,666円
計	11,404,458,597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ぬ。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありませぬ。

S J A M スモールキャップ・マザーファンド

貸借対照表

	2023年6月14日現在
科 目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	327,161,011
株式	15,086,098,660
未収配当金	161,911,170
流動資産合計	15,575,170,841
資産合計	15,575,170,841
負債の部	
流動負債	
その他未払費用	16,163
流動負債合計	16,163
負債合計	16,163
純資産の部	
元本等	
元本	4,352,475,283
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	11,222,679,395
元本等合計	15,575,154,678
純資産合計	15,575,154,678
負債純資産合計	15,575,170,841

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	2023年6月14日現在
1. 受益権の総数	4,352,475,283口
2.	1口当たり純資産額 3.5785円

期別	2023年6月14日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額)	(35,785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	2023年6月14日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	
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。	

(その他の注記)

項目	自 2022年12月15日 至 2023年6月14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	4,481,268,774円
同期中追加設定元本額	198,843,119円
同期中一部解約元本額	327,636,610円
元本の内訳*	
ハッピーエイジング20	1,391,320,855円
ハッピーエイジング30	1,270,826,424円
ハッピーエイジング40	1,067,671,853円
ハッピーエイジング50	282,370,904円
ハッピーエイジング60	63,128,924円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	132,262,881円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	79,078,104円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	58,800,551円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	6,787,259円
SOMPO世界分散ファンド(安定型) <DC年金>	81,269円
SOMPO世界分散ファンド(安定成長型) <DC年金>	59,501円
SOMPO世界分散ファンド(成長型) <DC年金>	86,758円
計	4,352,475,283円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

SOMPO外国株式アクティブバリュー（リスク抑制型）マザーファンド

貸借対照表

		2023年6月14日現在
科 目		金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金		18,917,985
金銭信託		23,725,813
株式		1,382,481,563
投資証券		22,184,734
未収配当金		1,912,413
流動資産合計		1,449,222,508
資産合計		1,449,222,508
負債の部		
流動負債		
その他未払費用		2,259
流動負債合計		2,259
負債合計		2,259
純資産の部		
元本等		
元本		624,387,268
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		824,832,981
元本等合計		1,449,220,249
純資産合計		1,449,220,249
負債純資産合計		1,449,222,508

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認められた場合は、当該取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>投資証券</p>
-------------------	---

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

（貸借対照表に関する注記）

期別	2023年6月14日現在	
1. 受益権の総数		624,387,268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)	2.3210円 (23,210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	2023年6月14日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	
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>	

項目	2023年6月14日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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 2022年12月15日 至 2023年6月14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	621,534,200円
同期中追加設定元本額	102,023,574円
同期中一部解約元本額	99,170,506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）	66,410,804円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	183,772,239円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	170,716,601円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	179,584,759円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	21,814,896円
SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞	642,679円
SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞	592,334円
SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞	852,956円
計	624,387,268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

2023年6月14日現在	
科 目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	202,884,316
国債証券	21,936,460,900
地方債証券	994,880,000
特殊債券	857,408,734
社債券	3,469,545,000
未収利息	40,537,629
前払費用	6,408,219
流動資産合計	27,508,124,798

2023年6月14日現在	
科 目	金額（円）
資産合計	27,508,124,798
負債の部	
流動負債	
その他未払費用	21,516
流動負債合計	21,516
負債合計	21,516
純資産の部	
元本等	
元本	19,502,822,968
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,005,280,314
元本等合計	27,508,103,282
純資産合計	27,508,103,282
負債純資産合計	27,508,124,798

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	2023年6月14日現在	
1. 受益権の総数		19,502,822,968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)	1.4105円 (14,105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	2023年6月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

項目	2023年6月14日現在
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。
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。

(その他の注記)

項目	自 2022年12月15日 至 2023年6月14日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	17,765,912,524円
同期中追加設定元本額	2,309,897,980円
同期中一部解約元本額	572,987,536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）	175,312,091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）	29,255,668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）	72,139,249円
損保ジャパン国内債券ファンド（適格機関投資家専用）	1,999,074,440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）	255,120,264円
損保ジャパン日本債券ファンド	989,496,564円
ハッピーエイジング20	262,579,903円
ハッピーエイジング30	1,133,823,603円
ハッピーエイジング40	5,577,438,836円
ハッピーエイジング50	4,157,313,114円
ハッピーエイジング60	2,768,606,501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	123,634,912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	11,504,362円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	1,229,496,739円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	415,669,588円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	147,049,853円
ターゲット・リターン戦略ファンド	147,650,347円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	5,105,471円
SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞	1,937,127円
SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞	407,277円
SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞	207,059円
計	19,502,822,968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マザーファンド

貸借対照表

	2023年6月14日現在
科 目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	19,866,475
金銭信託	34,776,218
国債証券	1,825,193,497
派生商品評価勘定	321,240
未収利息	10,813,552
前払費用	1,760,420
流動資産合計	1,892,731,402
資産合計	1,892,731,402
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,250,520
その他未払費用	5,808
流動負債合計	20,256,328
負債合計	20,256,328
純資産の部	
元本等	
元本	1,305,174,782
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	567,300,292
元本等合計	1,872,475,074
純資産合計	1,872,475,074
負債純資産合計	1,892,731,402

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	為替予約取引 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。
3. 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。
4. 費用・収益の計上基準	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。
5. その他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。

(貸借対照表に関する注記)

期別	2023年6月14日現在	
1. 受益権の総数		1,305,174,782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)	1.4347円 (14,347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	2023年6月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(その他の注記)

項目	自 2022年12月15日 至 2023年6月14日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,230,514,262円
同期中追加設定元本額	369,074,058円
同期中一部解約元本額	294,413,538円
元本の内訳*	
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)	28,652,482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)	70,594,582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)	248,837,834円
損保ジャパン外国債券ファンド	808,579,739円
ターゲット・リターン戦略ファンド	144,008,316円
SOMPO世界分散ファンド(安定型)<DC年金>	2,786,240円
SOMPO世界分散ファンド(安定成長型)<DC年金>	1,249,864円
SOMPO世界分散ファンド(成長型)<DC年金>	465,725円
計	1,305,174,782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	2023年6月14日 現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引 為替予約取引			
売建	1,825,878,742	-	1,845,808,022
ドル	912,528,266	-	921,362,958
カナダドル	37,476,784	-	38,172,789
メキシコペソ	16,476,887	-	16,957,669
ユーロ	608,767,836	-	615,765,100
債券	87,710,158	-	89,084,183
スウェーデンクローナ	7,637,896	-	7,776,233
ノルウェークローネ	2,762,034	-	2,884,046
デンマーククローネ	9,866,014	-	9,975,362
ポーランドズロチ	12,105,728	-	12,328,147
オーストラリアドル	30,183,318	-	31,195,461
シンガポールドル	18,825,905	-	19,042,742
オフショア人民元	81,537,916	-	81,263,332
合計	1,825,878,742	-	1,845,808,022

(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。

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	2023年6月14日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	61,507,356
金銭信託	74,527,293
国債証券	12,083,202,998
未収利息	58,181,667
前払費用	36,257,566
流動資産合計	12,313,676,880
資産合計	12,313,676,880
負債の部	
流動負債	
その他未払費用	7,633
流動負債合計	7,633
負債合計	7,633
純資産の部	
元本等	
元本	6,817,987,277
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,495,681,970
元本等合計	12,313,669,247
純資産合計	12,313,669,247
負債純資産合計	12,313,676,880

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

	<p>個別法に基づき、以下のとおり、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>ただし、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 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	2023年6月14日現在	
1. 受益権の総数		6,817,987,277口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8061円 (18,061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	2023年6月14日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	
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。	

（その他の注記）

項目	自 2022年12月15日 至 2023年6月14日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	6,349,879,959円
同期中追加設定元本額	581,540,544円
同期中一部解約元本額	113,433,226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）	66,141,014円
ハッピーエイジング20	615,421,680円
ハッピーエイジング30	2,214,456,985円
ハッピーエイジング40	1,980,531,433円
ハッピーエイジング50	626,742,190円
ハッピーエイジング60	484,068,037円
損保ジャパン外国債券ファンド（為替ヘッジなし）	442,333,793円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	322,579,521円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	40,945,678円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	21,934,130円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	2,261,610円
SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞	153,864円
SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞	105,153円
SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞	312,189円
計	6,817,987,277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J-REITマザーファンド

貸借対照表

	2023年6月14日現在
科 目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	5,120,313
投資証券	1,154,450,400
未収配当金	9,119,724
流動資産合計	1,168,690,437
資産合計	1,168,690,437

2023年6月14日現在	
科 目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
その他未払費用	846
流動負債合計	846
負債合計	846
純資産の部	
元本等	
元本	416,185,035
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	752,504,556
元本等合計	1,168,689,591
純資産合計	1,168,689,591
負債純資産合計	1,168,690,437

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

(貸借対照表に関する注記)

期別	2023年6月14日現在	
1. 受益権の総数		416,185,035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)	2.8081円 (28,081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	2023年6月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

項目	2023年6月14日現在
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。
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。

（その他の注記）

項目	自 2022年12月15日 至 2023年6月14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	405,952,846円
同期中追加設定元本額	31,472,986円
同期中一部解約元本額	21,240,797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）	95,364,978円
損保ジャパン・グローバルREITファンド（毎月分配型）	320,181,045円
SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞	245,606円
SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞	177,430円
SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞	215,976円
計	416,185,035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】

SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞

2023年6月30日現在

資産総額	10,172,598円
負債総額	4,111円

純資産総額（ - ）	10,168,487円
発行済数量	10,000,000口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.0168円

SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞

2023年6月30日現在

資産総額	5,210,094円
負債総額	2,095円
純資産総額（ - ）	5,207,999円
発行済数量	5,000,000口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.0416円

SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞

2023年6月30日現在

資産総額	5,417,983円
負債総額	2,163円
純資産総額（ - ）	5,415,820円
発行済数量	5,000,000口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.0832円

（参考）SJAMラージキャップ・バリュース・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	34,229,692,046円
負債総額	304,036,011円
純資産総額（ - ）	33,925,656,035円
発行済数量	11,371,316,866口
1単位当りの純資産額（ / ）	2.9834円

（参考）SJAMスモールキャップ・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	15,814,397,796円
負債総額	24,478円
純資産総額（ - ）	15,814,373,318円
発行済数量	4,365,727,755口
1単位当りの純資産額（ / ）	3.6224円

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

2023年6月30日現在

資産総額	1,521,280,855円
負債総額	1,550円
純資産総額（ - ）	1,521,279,305円
発行済数量	627,622,328口
1単位当りの純資産額（ / ）	2.4239円

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	28,312,702,521円
負債総額	19,274円
純資産総額（ - ）	28,312,683,247円
発行済数量	20,032,981,182口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.4133円

（参考）損保ジャパン外国債券マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	1,966,570,445円
負債総額	92,028,418円
純資産総額（ - ）	1,874,542,027円
発行済数量	1,307,796,660口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.4334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6月30日現在

資産総額	12,870,572,941円
負債総額	8,847円
純資産総額（ - ）	12,870,564,094円
発行済数量	6,867,422,898口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.8741円

（参考）損保ジャパンJ - R E I Tマザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	1,198,745,836円
負債総額	529円
純資産総額（ - ）	1,198,745,307円
発行済数量	417,004,389口
1単位当りの純資産額（ / ）	2.8747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8月末現在）

（略）

(2) 会社の機構（2022年8月末現在）

（略）

<訂正後>

(1) 資本金の額（2023年6月末現在）

（略）

(2) 会社の機構（2023年6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6月末現在、計281本（追加型株式投資信託161本、単位型株式投資信託76本、単位型公社債投資信託44本）であり、その純資産総額の合計は1,773,763百万円です。

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

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

2. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2022年4月1日から2023年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)

区分	注記 番号	金額（千円）		金額（千円）	
（資産の部）					
流動資産					
1 現金・預金			3,870,549		3,546,171
2 前払費用			102,011		101,203
3 未収委託者報酬			1,137,463		1,194,368
4 未収運用受託報酬			1,220,102		2,618,849
5 その他			6,676		3,043
流動資産合計			6,336,803		7,463,635
固定資産					
1 有形固定資産					
（1）建物	1		12,438		8,078
（2）器具備品	1		97,847		73,225
有形固定資産合計			110,285		81,304
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			551,730		658,124
（2）長期差入保証金			173,961		173,961
（3）繰延税金資産			369,976		348,349
（4）その他			32		32
投資その他の資産合計			1,095,700		1,180,467
固定資産合計			1,210,521		1,266,307
資産合計			7,547,325		8,729,943

区分	注記 番号	前事業年度 （2022年3月31日）		当事業年度 （2023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			6,032		7,771
2 未払金					
（1）未払配当金	2	700,000		770,000	
（2）未払手数料		421,565		460,087	
（3）その他未払金	2	526,525	1,648,091	141,725	1,371,812
3 未払費用			1,048,260		1,873,823
4 未払消費税等			191,700		214,504
5 未払法人税等			118,353		262,245
6 賞与引当金			171,866		205,460
7 役員賞与引当金			6,600		6,600
流動負債合計			3,190,904		3,942,217
固定負債					
1 退職給付引当金			208,284		245,172
2 資産除去債務			9,265		9,422
固定負債合計			217,549		254,594
負債合計			3,408,454		4,196,812
（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			2,129,605	2,544,383
利益剰余金合計			2,129,605	2,544,383
株主資本合計			4,092,885	4,507,664
評価・換算差額等				
1 その他有価証券評価差額金			45,985	25,466
評価・換算差額等合計			45,985	25,466
純資産合計			4,138,870	4,533,130
負債・純資産合計			7,547,325	8,729,943

(2) 【損益計算書】

区分	注記番号	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)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1 委託者報酬		6,276,724		6,268,013	
2 運用受託報酬		4,403,451	10,680,175	5,283,477	11,551,491
営業費用					
1 支払手数料		2,660,547		2,600,324	
2 広告宣伝費		27,018		25,984	
3 公告費		200		200	
4 調査費		2,998,033		3,945,034	
(1) 調査費		982,738		1,032,243	
(2) 委託調査費		2,012,478		2,909,783	
(3) 図書費		2,815		3,007	
5 営業雑経費		128,682		149,447	
(1) 通信費		13,042		13,489	
(2) 印刷費		97,704		115,724	
(3) 諸会費		17,935	5,814,481	20,233	6,720,990
一般管理費					
1 給料		1,654,831		1,754,897	
(1) 役員報酬		57,475		59,540	
(2) 給料・手当		1,373,956		1,460,378	
(3) 賞与		223,399		234,978	
2 福利厚生費		207,945		231,703	
3 交際費		7,538		10,365	
4 寄付金		300		1,300	
5 旅費交通費		6,738		29,102	
6 法人事業税		56,077		53,595	
7 租税公課		30,211		26,705	

8	不動産賃借料		220,595		221,573	
9	退職給付費用		79,199		87,487	
10	賞与引当金繰入		171,866		205,460	
11	役員賞与引当金繰入		6,600		6,600	
12	固定資産減価償却費		37,983		39,296	
13	諸経費		428,184	2,908,072	437,986	3,106,075
営業利益				1,957,622		1,724,425
営業外収益						
1	受取配当金		626		8,687	
2	受取利息		0		0	
3	有価証券売却益		7,179		-	
4	有価証券償還益		1,198		3,726	
5	為替差益		10,426		11,910	
6	保険配当金		467		621	
7	雑益		1,537	21,434	2,493	27,439
営業外費用						
1	事務過誤費		-		9,164	
2	雑損		363		394	
3	債権回収損		5,471	5,835	-	9,558
経常利益				1,973,220		1,742,306
特別損失						
1	有価証券評価損		-		4,032	
2	固定資産除却損	1	0	0	-	4,032
税引前当期純利益				1,973,220		1,738,274
法人税・住民税及び事業税				617,244		522,813
法人税等調整額				3,808		30,682
当期純利益				1,359,783		1,184,778

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 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

	その他有価 証券評価差 額金	評価・換 算差額等 合計	純資産 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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	2,129,605	2,129,605	4,092,885
当期変動額						
剰余金の配当				770,000	770,000	770,000
当期純利益				1,184,778	1,184,778	1,184,778
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）						
当期変動額合 計	-	-	-	414,778	414,778	414,778
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	2,544,383	2,544,383	4,507,664

	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
当期変動額			
剰余金の配当			770,000
当期純利益			1,184,778
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）	20,518	20,518	20,518
当期変動額合 計	20,518	20,518	394,259
当期末残高	25,466	25,466	4,533,130

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

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

(2) 投資顧問事業は、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。

会計方針の変更

（時価の算定に関する会計基準の適用指針）

「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。）を当事業年度の期首から適用し、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、当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。

注記事項

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産の減価償却累計額は、次のとおりであります。

（単位：千円）

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
建物	99,675	104,035
器具備品	108,702	143,638

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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
未払金		
未払配当金	700,000	770,000
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 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)
器具備品	0	-

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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. 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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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. 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
2023年3月30日 取締役会	普通株式	770,000千円	31,970円	-	2023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（2022年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
投資有価証券（２）	550,980	550,980	-
資産計	550,980	550,980	-

当事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
投資有価証券（２）	657,374	657,374	-
資産計	657,374	657,374	-

- （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）以下の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 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023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（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

当事業年度（2023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	3,546,149	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,194,368	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,618,849	-	-	-
(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	147,960	90,026	150,462	268,926
合計	7,507,327	90,026	150,462	268,926

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

前事業年度（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	-	370,250	180,730	550,980
資産計	-	370,250	180,730	550,980

当事業年度（2023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	-	462,624	194,750	657,374
資産計	-	462,624	194,750	657,374

(2) 期首残高から当事業年度末残高への調整表、当事業年度の損益に記載した評価損益

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(単位：千円)

	投資有価証券	合計
期首残高	240,805	240,805
当事業年度の損益又は評価・換算差額等		
損益の計上	-	-
その他有価証券評価差額金	1,012	1,012
購入、売却、発行及び決済		
購入	-	-
売却	61,087	61,087
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	-	-
当事業年度末残高	180,730	180,730
当事業年度の損益に計上した額のうち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	-	-

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

(単位：千円)

	投資有価証券	合計
期首残高	180,730	180,730
当事業年度の損益又は評価・換算差額等		
損益の計上	-	-
その他有価証券評価差額金	14,020	14,020
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	-	-
当事業年度末残高	194,750	194,750
当事業年度の損益に計上した額のうち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)

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(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

当事業年度(2023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	371,165	294,700	76,465
	小計	371,165	294,700	76,465
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	286,209	330,000	43,790
	小計	286,209	330,000	43,790
合計		657,374	624,700	32,674

5. 売却したその他有価証券

前事業年度(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	-

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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	-	-	-
合計	-	-	-

（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 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)
退職給付引当金の期首残高	177,918	208,284
退職給付費用	34,032	37,940
退職給付の支払額	3,666	1,052
退職給付引当金の期末残高	208,284	245,172

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：千円）

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	208,284	245,172
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	208,284	245,172
退職給付引当金	208,284	245,172
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	208,284	245,172

（3）退職給付費用

（単位：千円）

	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)
簡便法で計算した退職給付費用	34,032	37,940

3. 確定拠出制度

（単位：千円）

	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)
当社の確定拠出制度への要拠出額	37,490	41,080

（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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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	221,681	176,793
退職給付引当金	63,776	75,071
賞与引当金	52,625	62,912

繰延資産損金算入限度超過額	20,401	21,910
未払事業税	25,882	15,571
未払金否認	6,551	7,604
その他	5,629	7,100
繰延税金資産 小計	396,548	366,961
将来減算一時差異等の合計に係る 評価性引当額	2,933	4,119
評価性引当額 小計	2,933	4,119
繰延税金資産 合計	393,615	362,842
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	20,295	11,240
株式譲渡損益	3,031	3,031
固定資産除去価額	313	222
繰延税金負債 合計	23,639	14,493
繰延税金資産の純額	369,976	348,349

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。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「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）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（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 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）
期首残高	9,111	9,265
取得	-	-
時の経過による調整額	154	157
期末残高	9,265	9,422

（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 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）
投資信託事業（基本報酬）	6,264,774	6,264,984
投資信託事業（成功報酬）	11,950	3,029
投資顧問事業（基本報酬）	3,421,061	2,834,396
投資顧問事業（成功報酬）	982,389	2,449,080
合計	10,680,175	11,551,491

（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 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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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

本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えているため、記載を省略しております。

（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

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益
年金積立金管理運用独立行政法人	2,064,709

（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

前事業年度（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 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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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)	677,364	未払手数料	168,088
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)	176,500	未収運用受託報酬	96,493

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 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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

（１）受託会社

（略）

資本金の額

247,369百万円（2022年3月末現在）

（略）

事業の内容

（略）

<再信託受託会社の概要>

名称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2022年3月末現在）

（略）

（２）販売会社

該当事項はありません。ただし、ファンドの委託会社であるSOMPOアセットマネジメント株式会社が、自己の発行したファンドの受益権を自ら募集し、販売会社としての役割を担う場合があります。

名 称	資本金の額 （単位：百万円）	事業の内容
SOMPOアセットマネジメント株式会社	1,550	「金融商品取引法」に基づき、投資運用業、投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を営んでいます。

資本金の額は、2022年3月末現在

<訂正後>

(1)受託会社

(略)

資本金の額

247,369百万円(2023年3月末現在)

(略)

事業の内容

(略)

<再信託受託会社の概要>

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

資本金の額 : 51,000百万円(2023年3月末現在)

(略)

(2)販売会社

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事業の内容
損保ジャパンDC証券株式会 社	3,000	「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。

資本金の額は、2023年3月末現在

独立監査人の中間監査報告書

2023年8月21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世界分散ファンド（安定型）<DC年金>の2022年12月15日から2023年6月14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世界分散ファンド（安定型）<DC年金>の2023年6月14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12月15日から2023年6月14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. 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8月21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世界分散ファンド（安定成長型）<DC年金>の2022年12月15日から2023年6月14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世界分散ファンド（安定成長型）<DC年金>の2023年6月14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12月15日から2023年6月14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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年8月21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世界分散ファンド（成長型）<DC年金>の2022年12月15日から2023年6月14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世界分散ファンド（成長型）<DC年金>の2023年6月14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12月15日から2023年6月14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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年6月12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

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2023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。