

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年10月15日提出
【計算期間】	第24期(自 2023年7月19日至 2024年7月16日)
【ファンド名】	ハッピーエイジング20 ハッピーエイジング30 ハッピーエイジング40 ハッピーエイジング50 ハッピーエイジング60
【発行者名】	SOMPOアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 小嶋 信弘
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋二丁目2番16号
【事務連絡者氏名】	津田 浩平
【連絡場所】	東京都中央区日本橋二丁目2番16号
【電話番号】	03-5290-3432
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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】

「ハッピーエイジング・ファンド」は、リスク水準の異なる5本のファンドから構成されており、中長期的に信託財産の着実な成長を図ることを目的に、「S」AMラージキャップ・バリュー・マザーファンド」、「S」AMスモールキャップ・マザーファンド」、「損保ジャパン日本債券マザーファンド」、「損保ジャパン-TCW外国株マザーファンド」、「損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド」の受益証券及びエマージング株式又はエマージング株式を主要投資対象とする証券投資信託の受益証券を主要投資対象として運用を行うことを基本とします。

委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンド金2,000億円を限度として信託金を追加できます。また、委託会社は、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

一般社団法人投資信託協会が定める各ファンドの商品分類および属性区分は以下の通りです。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式
追加型	海外	債券
	内外	不動産投信
		その他資産()
		資産複合

(注)各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

<各ファンドの商品分類の定義>

項目	該当する 商品分類	内容
単位型・追加型	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書又は信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	資産複合	目論見書又は信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリーファン ド	あり ()
一般	年2回	日本	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし
大型株 中小型株	年4回 年6回	北米 欧州		

債券 一般 公債	(隔月) 年12回 (毎月) 日々	アジア オセアニア 中南米 アフリカ	
社債	その他 ()	中近東 (中東) エマージング	
その他債券 クレジット属性 () 不動産投信			
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株 式、債券)))			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型			

(注1) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(注2) ファミリーファンドの場合、投資信託証券を通じて収益の源泉となる資産に投資をしますので、商品分類表と属性区分表の「投資対象資産」は異なります。

(注3) 属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

<当ファンドの属性区分の定義>

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）））	目論見書又は信託約款において、投資信託証券を通じて、株式および債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年1回	目論見書又は信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書又は信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書又は信託約款において、マザーファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書又は信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

各ファンドに該当しない商品分類、属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

<ファンドの特色>

ファンドの目的

日本及び世界各国の株式や公社債を実質的な主要投資対象とし、中長期的に信託財産の着実な成長を目標として運用を行います。

● ファンドの特色

- 1 国内株式・国内債券にとどまらず世界各国の株式及び債券に積極的に分散投資を行うことによって、リスクを軽減しつつ信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指します。

投資対象資産	投資対象とするマザーファンド ^{※1} 等
国内株式	SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド SJAMスモールキャップ・マザーファンド
国内債券	損保ジャパン日本債券マザーファンド
外国債券	損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド
外国株式	損保ジャパンーTCW外国株式マザーファンド ^{※2}
エマージング株式	エマージング株式または エマージング株式を主要投資対象とする証券投資信託

※1 マザーファンドについては、後掲「ファンドの仕組み」をご参照下さい。

※2 運用スタイル毎のアロケーションと北米株式の運用指図に関する権限を、TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANYに委託します。

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

1971年設立。ロサンゼルスを拠点とするTCWグループ傘下の運用会社です。
2024年6月末現在の同グループの運用資産は、約1,977億米ドル(約31兆8,435億円[※])です。
※2024年6月末時点の為替レートで換算。

- 2 長期的な視点から基準資産配分比率を決定し、当該比率をめどに投資を行います。基準資産配分比率は、次の手順で決定、見直しを行います。

1. 長期的視点から、国内外の長期的な過去データに基づく分析と将来に対する見通しに基づいて、各資産毎の長期的期待収益率、標準偏差、相関係数等を予測します。
2. 予測した各数値を基に、各ファンドの最適な資産配分比率を求め、基準資産配分比率とします。経済情勢の変化等により長期的に市場環境に大きな影響があると判断した場合には、基準資産配分比率の見直しを行います。

3

各ファンドの特徴は、以下のとおりです。

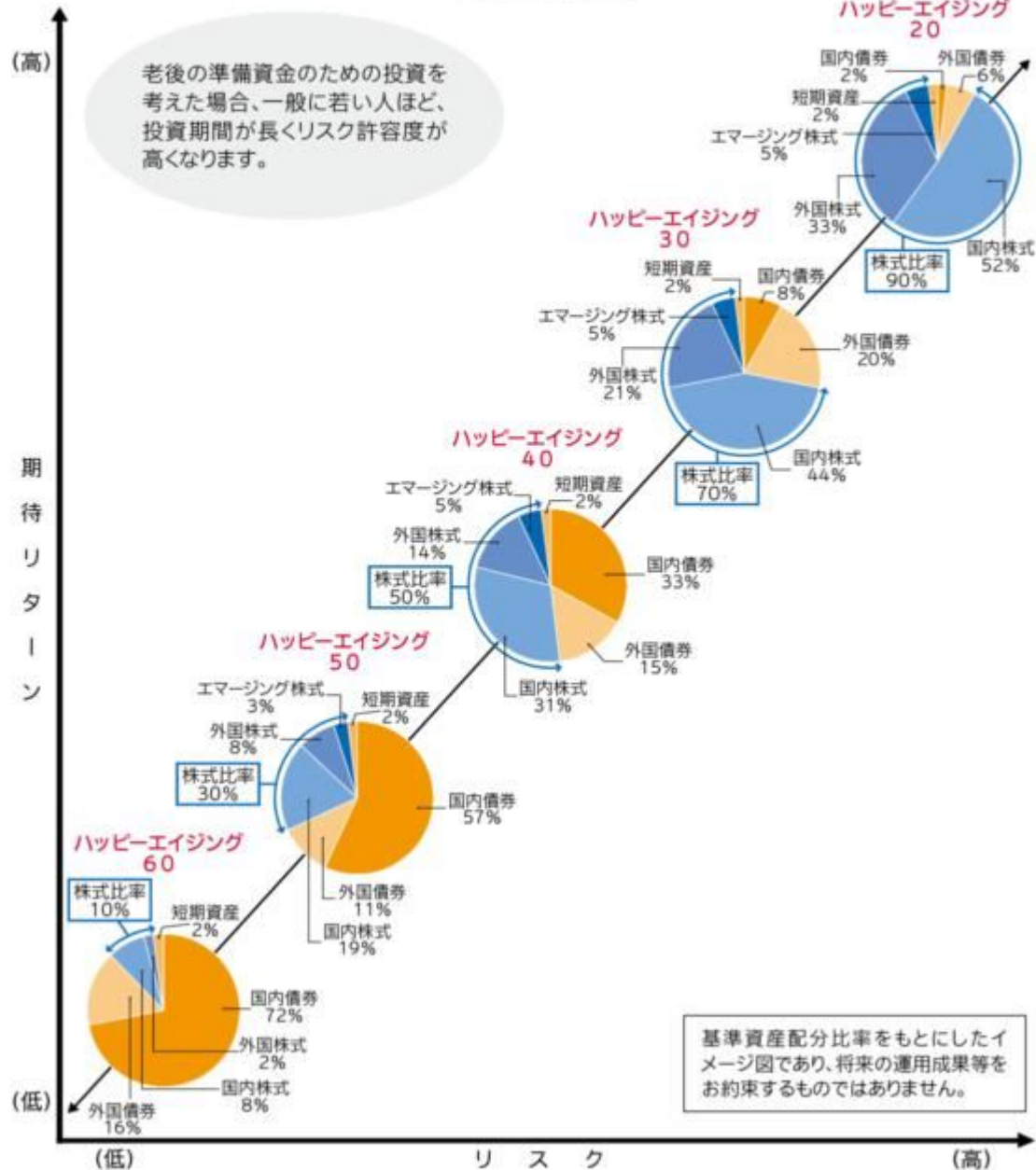
ハッピーエイジング20	国内外の株式の基準組入比率を90%とするファンドです。リスクを積極的にとりながら資産の大きな成長を目指します。5つのファンドの中では最もリスクが高く、投資期間が長く積極的運用をお考えの方に適したファンドです。
ハッピーエイジング30	国内外の株式の基準組入比率を70%とするファンドです。5つのファンドの中では比較的高いリスクをとり適度に高い収益を目指します。資産の成長性を重視した運用をお考えの方に適したファンドです。
ハッピーエイジング40	国内外の株式の基準組入比率を50%とするファンドです。5つのファンドの中では、リスクのレベルは中位に位置し、リスク・リターンのバランスを重視した運用を目指します。積極性と安定性とバランスのとれた運用をお考えの方に適したファンドです。
ハッピーエイジング50	国内外の株式の基準組入比率を30%とするファンドです。5つのファンドの中では比較的低位にリスクを設定し安定した運用を目指します。安定性に重点を置きつつ適度の収益性をも考慮した運用をお考えの方に適したファンドです。
ハッピーエイジング60	国内外の株式の基準組入比率を10%とするファンドです。5つのファンドの中では最もリスクを抑え、より安定した運用を目指します。投資期間が比較的短く安定性を重視した運用をお考えの方に適しています。

4

投資目的、投資期間、リスク許容度等に応じて、リスク水準の異なる5種類のファンドからご選択いただけます。

- ハッピーエイジング20が、最も積極的(高リスク)運用を行うファンドで、ハッピーエイジング60が、最も安定的(低リスク)運用を行うファンドです。

<基準資産配分比率>



※各マザーファンドの受益証券への投資を通じて、上記の基準資産配分比率を目標に投資を行います。ただし、各マザーファンドの組入比率は、0%を下限とし、基準資産配分比率の±5%程度の範囲とします。なお、市況動向によっては、内外の有価証券等への直接投資を行うことがあります。

5

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2000年7月31日

信託契約締結、設定、運用開始

2002年7月1日

ファンドの名称を下記の通り変更

<変更後>

ハッピーエイジング20

ハッピーエイジング30

ハッピーエイジング40

ハッピーエイジング50

ハッピーエイジング60

ハッピーエイジング・ファンド(総称)

<変更前>

ライフタイム20

ライフタイム30

ライフタイム40

ライフタイム50

ライフタイム60

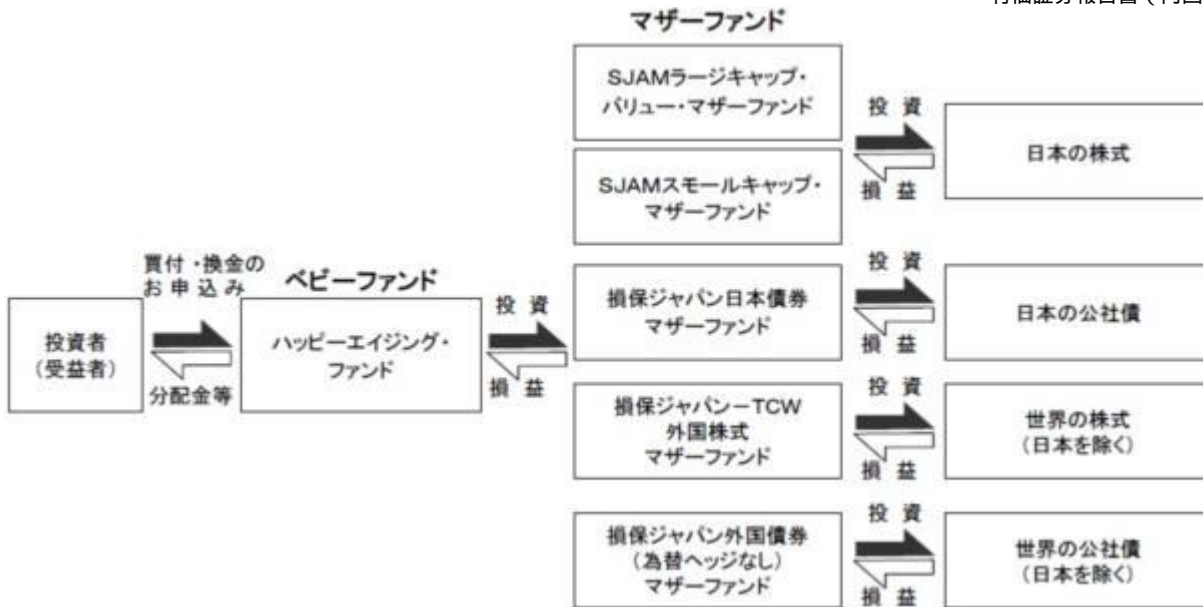
安田火災シグナ・ライフ
タイム・ファンド(総称)

2003年2月14日	<p>「シグナ日本株アクティブ・マザーファンド」の運用委託先を、シグナ・インターナショナル・インベストメント・アドバイザーズ株式会社から興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社に変更するとともにマザーファンドの名称を「シグナ日本株アクティブ・マザーファンド」から「損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド」に変更</p> <p>「シグナ日本債券マザーファンド」の運用委託先であるシグナ・インターナショナル・インベストメント・アドバイザーズ株式会社への委託を行わず、当社が運用する方法に変更するとともに、マザーファンドの名称を「シグナ日本債券マザーファンド」から「損保ジャパン日本債券マザーファンド」に変更</p>
2005年10月8日	<p>ファンドの基本資産配分比率及び投資配分について、損保ジャパンDC証券株式会社からの助言を受けて当社が策定する方法から、助言を受けずに策定する方法に変更</p> <p>主要投資対象とするマザーファンドのうち、「損保ジャパン外国債券マザーファンド」を「損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド」に変更</p> <p>主要投資対象ごとの基本資産配分比率を規定する方法から、株式の組入比率を規定する方法に変更</p>
2012年3月30日	マザーファンドの評価、入れ替えを行わないこととし、その助言に関する損保ジャパンDC証券株式会社との投資顧問契約を解約。
2015年4月14日	主要投資対象とするマザーファンドのうち、「損保ジャパン日本株マザーファンド」、「損保ジャパン - D I A M日本株アクティブ・マザーファンド」を「S J A Mラージキャップ・バリュース・マザーファンド」、「S J A Mスモールキャップ・マザーファンド」に変更

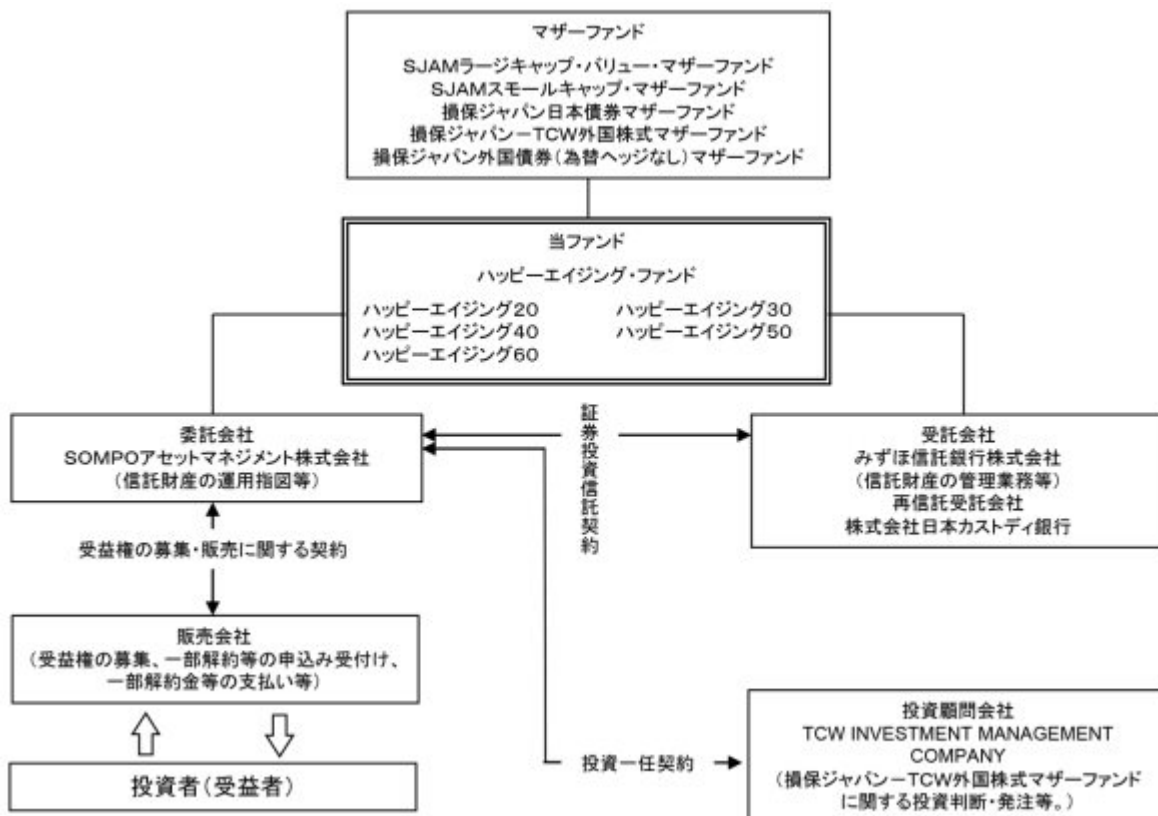
(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。当ファンドは「ベビーファンド」にあたりません。ただし、ベビーファンドから有価証券等に直接投資することもあります。



ファンドの関係法人図



ファンドの関係法人

() 委託会社または委託者：SOMPOアセットマネジメント株式会社

各ファンドの委託会社として、信託財産の運用指図、目論見書及び運用報告書の作成等を行います。

() 販売会社

委託会社との受益権の募集・販売に関する契約に基づき、各ファンドの販売会社として、受益権の募集・販売の取扱い、目論見書・運用報告書の交付、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金の再投資、一部解約金・収益分配金・償還金の支払い、取引報告書等の交付等を行います。

() 受託会社または受託者：みずほ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行)

委託会社との証券投資信託契約に基づき、各ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理業務などを行い、収益分配金、一部解約金及び償還金の交付、また信託財産に関する報告書を作成し委託会社への交付を行います。なお、信託事務の処理の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。

() 投資顧問会社：TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY〔略称：TCW〕

TCWは、委託会社との投資一任契約に基づき、「損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド」に関して、委託会社より、運用スタイル毎のアロケーションと北米株式の運用の指図に関する権限の委託を受けて投資判断、発注等を行います。

委託会社等の概況

() 資本金の額 1,550百万円 (2024年7月末現在)

() 委託会社の沿革

1986年	2月25日	安田火災投資顧問株式会社設立
1987年	2月20日	投資顧問業の登録
1987年	9月9日	投資一任業務の認可取得
1991年	6月1日	プリンソン・パートナーズ投資顧問株式会社と合併し、安田火災プリンソン投資顧問株式会社に商号変更
1998年	1月1日	安田火災グローバル・アセット・マネジメント株式会社に商号変更
1998年	3月3日	安田火災グローバル投信投資顧問株式会社に商号変更
1998年	3月31日	証券投資信託委託業の免許取得
2002年	7月1日	損保ジャパン・アセットマネジメント株式会社に商号変更
2007年	9月30日	金融商品取引業者として登録
2010年	10月1日	ゼスト・アセットマネジメント株式会社と合併し、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社に商号変更
2020年	4月1日	SOMPOアセットマネジメント株式会社に商号変更

() 大株主の状況 (2024年7月末現在)

名称	住所（所在地）	所有株式数 （株）	持株比率 （％）
SOMPOホールディングス株式会社	東京都新宿区西新宿一丁目26番1号	24,085	100.0

2【投資方針】

(1)【投資方針】

a. 基本方針

当ファンドは、中長期的に信託財産の着実な成長を目標として運用を行います。

b. 運用方針

投資対象

「SJAMラージキャップ・バリュース・マザーファンド」、「SJAMスモールキャップ・マザーファンド」、「損保ジャパン日本債券マザーファンド」、「損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド」、「損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド」の受益証券およびエマージング株式又はエマージング株式を主要投資対象とする証券投資信託を主要投資対象とします。この

ほか、内外の有価証券等に直接投資することがあります。

投資態度

- () 主として上記のマザーファンドの受益証券等への投資を通して、国内株式・国内債券にとどまらず世界各国の株式および債券に積極的に分散投資を行うことによって、リスクを軽減しつつ信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指します。
- () 各マザーファンドを通じて実質的に投資する株式（当ファンドが直接投資する株式を含みます。）への配分比率は、ハッピーエイジング20で信託財産の純資産総額の概ね90%程度、ハッピーエイジング30で信託財産の純資産総額の概ね70%程度、ハッピーエイジング40で信託財産の純資産総額の概ね50%程度、ハッピーエイジング50で信託財産の純資産総額の概ね30%程度、ハッピーエイジング60で信託財産の純資産総額の概ね10%程度となることを目処に投資を行います。
- () 資金動向、市況動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- () 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限りません。）
 - ハ．金銭債権
 - ニ．約束手形

- () 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として後記1.から5.までのSOMPOアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託の受益証券および後記6.から25.までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. S J A M ラージキャップ・バリュース・マザーファンド
2. S J A M スモールキャップ・マザーファンド
3. 損保ジャパン日本債券マザーファンド
4. 損保ジャパン - T C W 外国株式マザーファンド
5. 損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド
6. 株券または新株引受権証券
7. 国債証券
8. 地方債証券
9. 特別の法律により法人の発行する債券
10. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下、「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
11. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
12. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
13. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
14. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

15. コマーシャル・ペーパー
16. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
17. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前記1.から16.までの証券または証書の性質を有するもの
18. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
19. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
20. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
21. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
22. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
23. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
24. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
25. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
26. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
27. 外国の者に対する権利で前記26.の有価証券の性質を有するもの

なお、前記6.の証券ならびに証書、17.および22.の証券または証書のうち6.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、7.から11.までの証券ならびに17.および22.の証券または証書のうち7.から11.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、18.の証券および19.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前記5.の権利の性質を有するもの

前記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前記 1.から6.までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（3）【運用体制】

a. 委託会社の運用体制と社内規程

（運用体制）

総合投資会議は、ファンドの運用方針の分析と決定を行います。

各資産投資戦略会議は、総合投資会議の運用方針に基づき、ファンドの運用戦略を決定し、各運用担当部が運用計画を策定します。

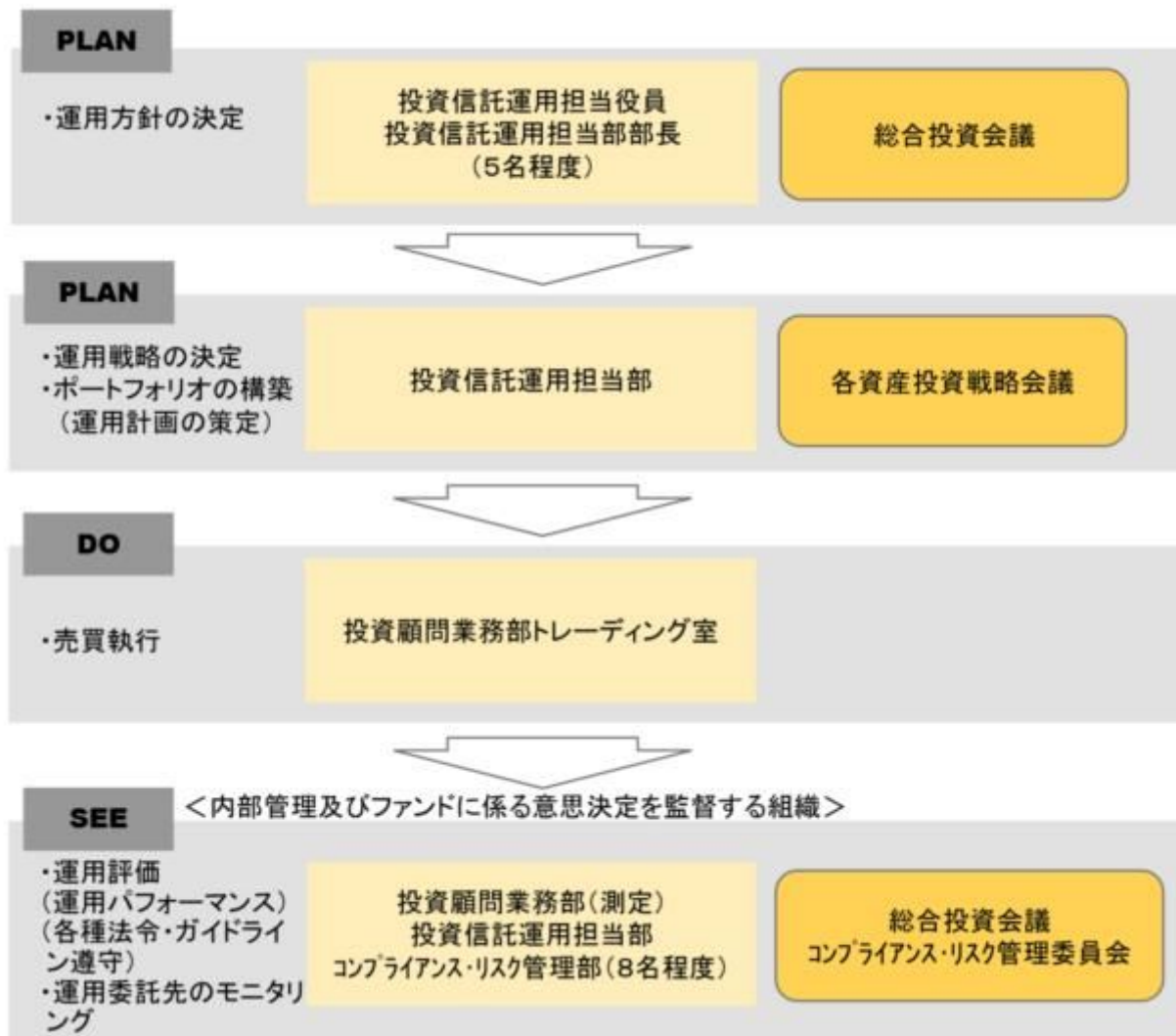
各運用担当部で策定された運用計画に基づき、投資顧問業務部トレーディング室が最良執行の観点から売買を執行します。

運用状況の分析・評価等は運用担当部で行い、総合投資会議に報告されます。また、売買チェック、リスク管理、各種法令、ガイドライン遵守の状況は、コンプライアンス・リスク管理部で確認を行い、コンプライアンス・リスク管理委員会に報告されます。

（社内規程）

社内規程でファンドの「業務マニュアル」を定めている他、有価証券売買の発注先に関する各種規程や「有価証券の自己取引制限に関する規程」、「行動規程」、「コンプライアンス・マニュアル」等の服務規程を定め、法令遵守の徹底、インサイダー取引の防止に努めています。

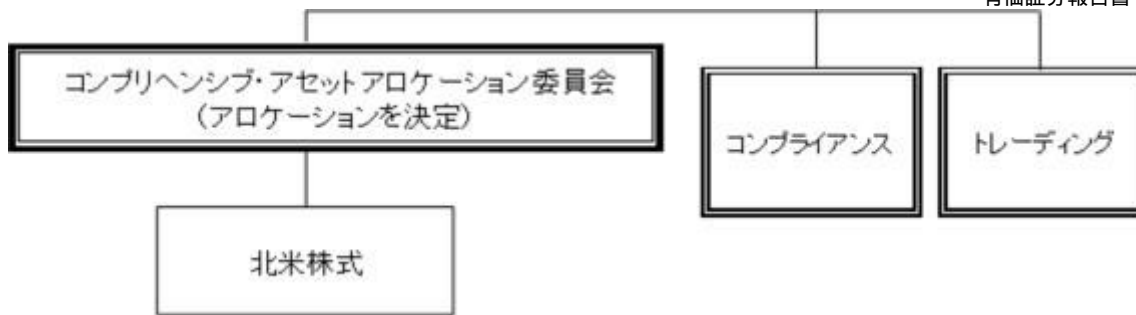
また、外部委託先の管理体制については、当社が当社以外の者に業務を委託するときの基本事項等を定めた「外部委託管理規程」に従い、定期モニタリング等を実施しています。



2024年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

b. 運用委託先の運用体制等

損保ジャパン・TCW外国株式マザーファンドの運用委託先であるTCWでは、主に資産配分を担当するコンプリヘンシブ・アセットアロケーション委員会ならびにプロダクト毎に編成されたチームが連携して運用を行っております。また、コンプライアンス部門によるチェック体制も保持しています。



(本組織図は、2024年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。)

(4) 【分配方針】

毎決算時(原則として7月15日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子、配当収入と売買益(評価損益を含みます。)等の全額とします。

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

中長期的な観点から、複利効果による資産の成長を目指すために分配を抑えるファンドです。

(5) 【投資制限】

a. 当ファンドの信託約款に基づく投資制限

株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。以下において同じ。)への投資制限
「ハッピーエイジング20」

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

実質投資割合とは、実質投資額(信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と親投資信託に属する当該株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額)を信託財産の純資産総額で除したものです。また、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する親投資信託の時価総額に親投資信託の信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。以下同じ。

「ハッピーエイジング30」

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

「ハッピーエイジング40」

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。

「ハッピーエイジング50」

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。

「ハッピーエイジング60」

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%未満とします。

デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

投資する株式等の範囲

- () 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- () 前記()の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

新株引受権証券等への投資制限

委託会社は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と親投資信託に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

投資信託証券への投資制限

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（親投資信託受益証券および上場投資信託証券（取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）なもの））ならびに信託財産に既に組み入れている株式等が転換等により投資信託証券に該当することとなった投資信託証券を除きます。）の時価総額と親投資信託に属する当該投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

信用取引の指図および範囲

- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- () 前記()の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額と親投資信託に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- () 信託財産の一部解約等の事由により、前記()の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

公社債の空売りの指図および範囲

- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うこ

との指図をすることができるものとします。

- () 前記()の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- () 信託財産の一部解約等の事由により、前記()の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

先物取引等の運用指図

- () 委託会社は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。
- () 委託会社は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- () 委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図

- () 委託会社は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下、「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- () スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- () スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- () 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

- () 委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- () 金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- () 金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- () 委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

同一銘柄の株式への投資制限

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額と親投資信託に属する当該同一銘柄の株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の5を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と親投資信託に属する当該同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の5を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

同一銘柄の転換社債等への投資制限

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額と親投資信託に属する当該同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の10を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

有価証券の貸付の指図および範囲

- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の1.および2.の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
 - 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- () 前記1.および2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- () 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の借入れの指図および範囲

- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- () 前記()の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- () 信託財産の一部解約等の事由により、前記()の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- () 前記()の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約の指図

- () 委託会社は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- () 前記()の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- () 前記()の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

信用リスク集中回避のための投資制限

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

21 デリバティブ取引等に係る投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

22 資金の借入れ

- () 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当(一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- () 一部解約に伴う支払資金の手当にかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- () 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- () 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

23 受託会社による資金の立替え

- () 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。
- () 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰入れることができます。
- () 前記()および()の立替え金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

b. 法令に基づく投資制限

同一の法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律)

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権(株主総会において決議することができ

る事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図してはならないとされています。

デリバティブ取引に係る投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令)

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券又はオプションを表示する証券若しくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。)を行い、又は継続することを指図してはならないとされています。

(参考)「S」AMラージキャップ・バリュー・マザーファンド」の運用の基本方針

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の中長期的成長を目指して、積極的な運用を行います。

2. 運用方針

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象といたします。

(2) 投資態度

原則としてRussell/Nomura Large Cap Value インデックス採用銘柄でかつ、当社の日本株式ユニバース構成銘柄より投資銘柄を選定します。

独自の調査分析に基づいて算出した理論株価と市場価格を比較し、割安となっている銘柄に投資することを基本にリスク管理を行いつつ最適なポートフォリオを構築し、「Russell/Nomura Large Cap Value インデックス(配当を含むトータルリターンインデックス)」を中長期的に上回る運用成果を目指します。

転換社債、ならびに新株予約権付社債や新株引受権証券および新株予約権証券(外貨建てを含みます。)等に投資する場合があります。

株式(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式を含む。)の組入比率は原則として信託財産総額の50%超(高位に維持)を基本とします。なお、株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含む。)への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。ただし、資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

有価証券先物取引等は、信託約款第21条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第22条の範囲で行います。

金利先渡取引及び為替先渡取引は、信託約款第23条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則と

して、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

(参考)「S J A Mスモールキャップ・マザーファンド」の運用の基本方針

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の中長期的成長を目指して、積極的な運用を行います。

2. 運用方針

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象といたします。

(2) 投資態度

原則として、Russell/Nomura Small Cap インデックス採用銘柄でかつ、当社の日本株式ユニバース構成銘柄より投資銘柄を選定します。

独自の調査分析に基づいて算出した理論株価と市場価格を比較し、割安となっている銘柄に投資することを基本にリスクを軽減しつつ、「Russell/Nomura Small Cap インデックス(配当を含むトータルリターンインデックス)」を中長期的に上回る運用成果を目指します。

株式(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式を含む。)の組入比率は原則として信託財産総額の50%超(高位に維持)を基本とします。なお、株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含む。)への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

投資環境によっては、防衛的な観点から運用者の判断で、主要投資対象への投資を大幅に縮小する場合があります。

資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

有価証券先物取引等は、信託約款第21条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第22条の範囲で行います。

金利先渡取引及び為替先渡取引は、信託約款第23条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

（参考）「損保ジャパン日本債券マザーファンド」の運用の基本方針

1．基本方針

この投資信託は、主に日本の公社債に投資を行い、中長期的に信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

2．運用方針

(1) 投資対象

日本の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として、日本の公社債を中心に分散投資を行い、インカムの確保を図るとともに金利低下や格付け上昇に伴うキャピタルゲインの獲得を狙い、NOMURA - B P I 総合指数を中長期的に上回る投資成果を目指します。

投資に際しては、内外いずれかの評価機関からBBB格あるいはBBB格相当以上の格付を得ている信用度の高い銘柄とします。格付を取得していない公社債については、客観的に同等の信用力があると判断した場合には投資を行うことがあります。

運用期間を通じて、ポートフォリオの見直しを随時行い、個別組入銘柄変更やデュレーション調整等を行います。

外貨建資産については、為替変動リスクを回避するため、対円で原則100%為替ヘッジを行います。

資金動向、市況動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 運用制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の株式等への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

有価証券先物取引等は、信託約款第18条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第19条の範囲で行います。

金利先渡取引および為替先渡取引は、信託約款第20条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

（参考）「損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド」の運用の基本方針

1．基本方針

この投資信託は、主に外国の株式に投資し、積極的に収益の獲得を目指して運用を行います。

2．運用方針

(1) 投資対象

日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主にモルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル・コクサイ指数(以下、「MSCIコクサイ指数」といいます。)に採用されている国の株式に積極的に投資を行い、同指数を上回る投資成果を目指します。

運用にあたっては、TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY(米国)に運用スタイル毎のアロケーションと北米株式の運用の指図に関する権限を委託します。

運用スタイル毎のアロケーションに関しては、TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANYが各市場の企業の過去及び予想業績成長率、市場間の相対的魅力度の分析、各国の金利・物価上昇率・為替レート・中央銀行の金融政策などのファンダメンタルズ分析などの情報を集約して市場間の相対的魅力度を順位付けし、リスクを考慮したうえで、決定します。

運用スタイル毎のアロケーションが決定されると、ボトム・アップ・アプローチにより銘柄を選択します。

株式への投資割合は、原則として高位とします。

資金動向、市況動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 運用制限

株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券等への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

投資信託証券(上場投資信託証券(取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。))なものをいいます。以下同じ。))ならびに信託財産に既に組入れていた株式等が転換等により投資信託証券に該当することとなった投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

有価証券先物取引等は、信託約款第20条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第21条の範囲で行います。

金利先渡取引および為替先渡取引は、信託約款第22条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

(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」の運用の基本方針

1. 基本方針

この投資信託は、主に日本を除く世界各国の公社債に投資を行い、中長期的に信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

2. 運用方針

(1) 投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として日本を除く先進各国の政府、政府機関等の発行する外国債券を中心に分散投資を行い、国内債より相対的に高いインカムの確保を図るとともに金利低下や格付け上昇に伴うキャピタルゲインの獲得を狙い、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)を中長期的に上回る

投資成果を目指します。

投資対象国は、原則としてA格相当以上の長期債格付が付与された国とし、FTSE世界国債インデックス採用国を中心とします。ポートフォリオの見直しは随時行い、各国の政治・経済動向の変化や市況動向、リスク分散等を勘案して、国別の投資比率の変更やデュレーション調整等を行います。また、債券の組入比率は高位に保つことを原則とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

資金動向、市況動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 運用制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

有価証券先物取引等は、信託約款第20条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第21条の範囲で行います。

金利先渡取引および為替先渡取引は、信託約款第22条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

3【投資リスク】

各ファンドの基準価額は、組入れられる有価証券等の値動き等による影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資者の皆様に帰属いたします。したがって、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金とは異なります。

各ファンドの主なリスクは以下のとおりです。

基準価額の変動要因は、以下に限定されるものではありません。

<当ファンドの投資にかかるリスク>

資産配分のリスク

各ファンドの基準資産配分比率が収益の源泉となる場合もありますが、配分比率が高い資産の価格が下落した場合等には株式、債券市場全体やベンチマークの収益率を下回ることがあります。

価格変動リスク

株式や公社債の価格は、国内外の政治・経済情勢、市況等の影響を受けて変動します。

また、一般に、金利が上昇すると、公社債の価格は下落します。組入れている株式や公社債の価格の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

信用リスク

株式や公社債の価格は、発行体の財務状態、経営、業績等の悪化及びそれらに関する外部評価の悪化等により下落することがあります。組入れている株式や公社債の価格の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また発行体の倒産や債務不履行等の場合は、株式や公社債の価値がなくなることもあり、ファンドの基準価額が大きく下落する場合があります。

流動性リスク

国内外の政治・経済情勢の急変、天災地変、発行体の財務状態の悪化等により、有価証券等の取引量が減少することがあります。この場合、ファンドにとって最適な時期や価格で、有価証券等を売買できないことがあり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

また、取引量の著しい減少や取引停止の場合には、有価証券等の売買ができなかったり、想定外に不利な価格での売買となり、ファンドの基準価額が大きく下落する場合があります。

為替変動リスク

外貨建資産の価格は、当該外貨と日本円との間の為替レートの変動の影響を受けて変動します。為替レートは、各国の政治・経済情勢、外国為替市場の需給、金利変動その他の要因により、短期間に大幅に変動することがあります。当該外貨の為替レートが、円高になった場合は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

カントリーリスク

一般的に、主要先進国以外の国では、主要先進国に比べて、経済が脆弱である可能性があり、国内外の政治・経済情勢、取引制度、税制の変化等の影響を受けやすく、また市場規模や取引量が小さいこと等から有価証券等の価格がより大きく変動することがあり、ファンドの基準価額が大きく下落することがあります。

コール・ローン等の短期金融商品の取引相手の債務不履行等により、当該金融商品等の取引ができなかった場合等は、ファンドが影響を受ける場合があります。

<その他の留意点>

クーリングオフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用はありません。

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

収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。収益分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。投資者のファンドの購入価額によっては、収益分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、収益分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

マザーファンドに投資する別のベビーファンドの追加設定・解約等により、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額が影響を受ける場合があります。

ファンドとベンチマークは組入銘柄や国別配分比率が異なることがあり、ファンドの運用成績はベ

ンチマークを下回る場合があります。

ファンドに関連する法令・税制・会計等は今後変更される可能性があります。これに伴い、ファンドの基準価額が影響を受ける場合があります。

販売会社より委託会社に対して申込金額の払込みが実際になされるまでは、ファンドも委託会社もいかなる責任も負いません。

委託会社は収益分配金、償還金および一部解約金を販売会社に対して支払った後は、受益者への支払いについての責任を負いません。

委託会社はファンドの設定・運用について、販売会社はお申込代金の預かり等を含む販売について、それぞれ責任を有し、互いに他について責任を負いません。

お申込み、ご換金に関わる留意点

<お申込時>

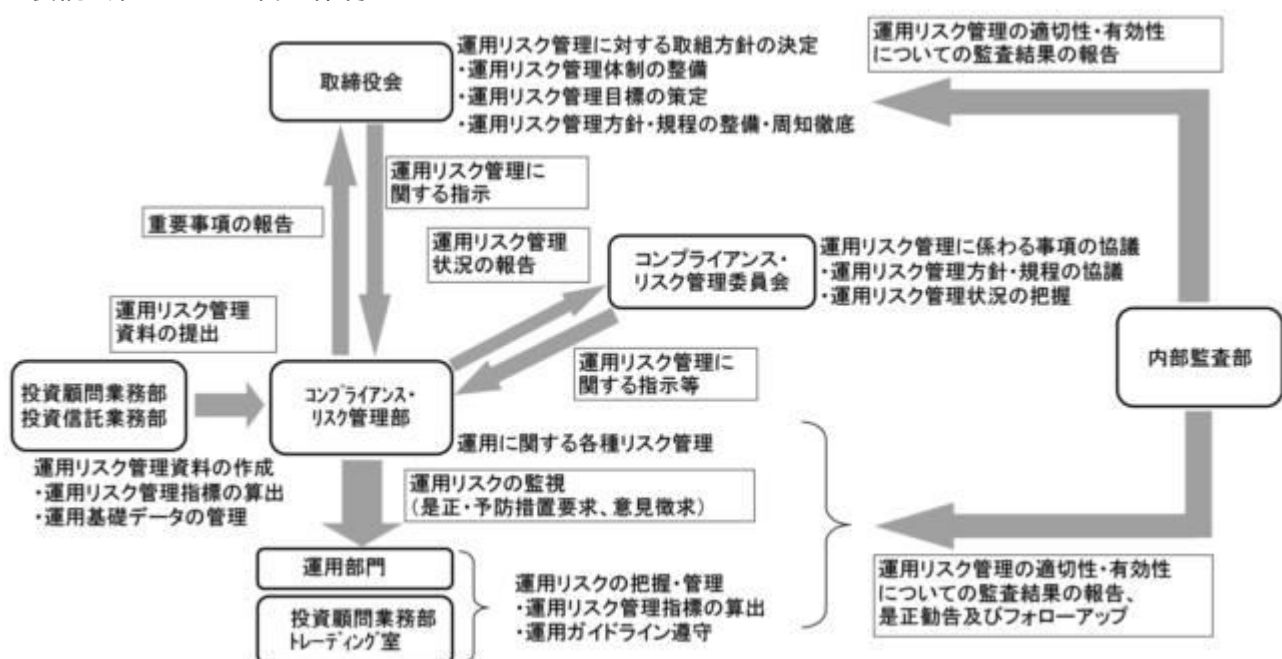
委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、取引市場における流動性が極端に減少した場合、取引市場の混乱、自然災害、テロ、大規模停電、システム障害等により基準価額の算出が困難となった場合、その他やむを得ない事情があると判断したとき（「緊急事態発生時」といいます。）は、取得申込みの受付を中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付を取り消すことができるものとします。

<ご換金時>

委託会社は、緊急事態発生時には、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、および既に受付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができるものとします。一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付け中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとし、信託約款の規定に準じて算出した価額とします。

<リスクの管理体制>

a. 委託会社のリスク管理体制



※運用リスクには流動性リスクを含みます。

（注）上図は、2024年7月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

流動性リスクに対する管理体制

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

b. 運用委託先のリスク管理体制等

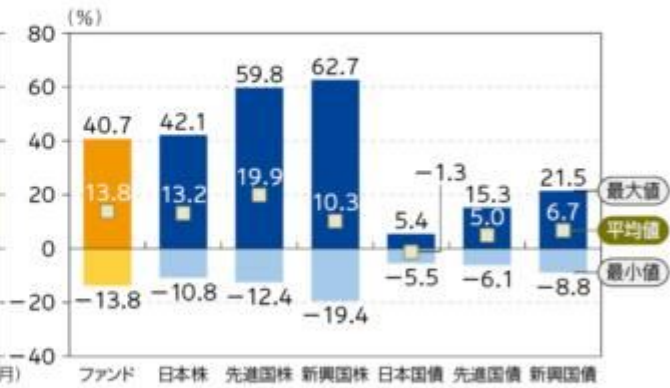
損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンドの運用委託先であるTCWにおいては、投資制限の遵守状況について、独立の組織であるコンプライアンス部門のチェックを常に受けております。また、TCWが行った取引については、TCW社内のトレーディング委員会においてレビューが行われま

す。

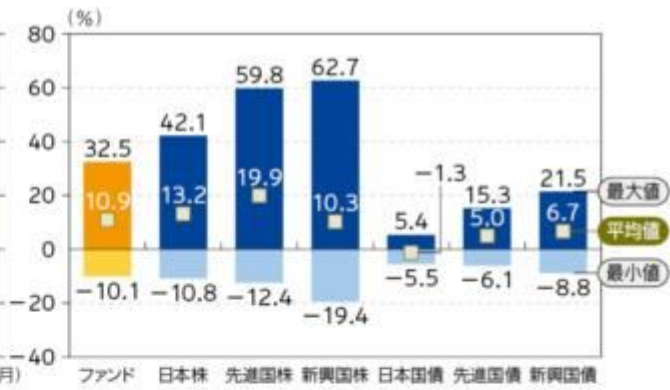
ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移

2019年8月～2024年7月

ハッピーエイジング20



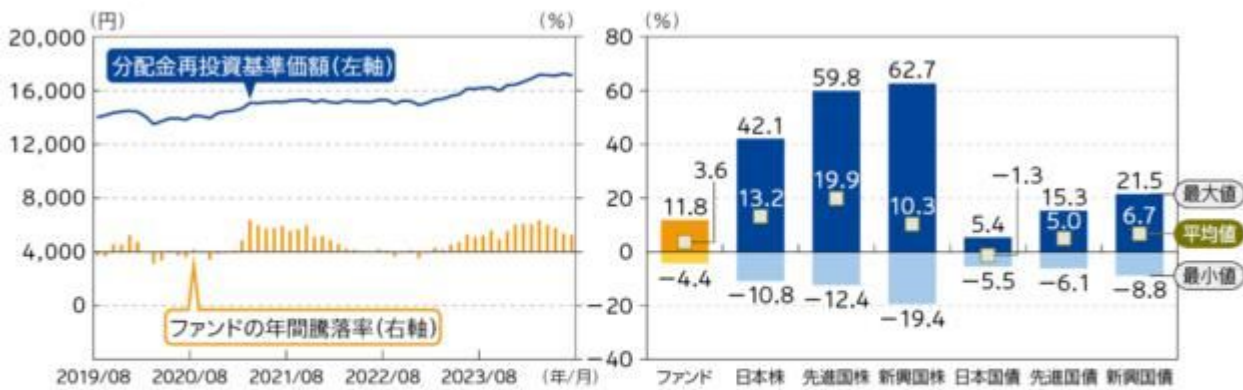
ハッピーエイジング30



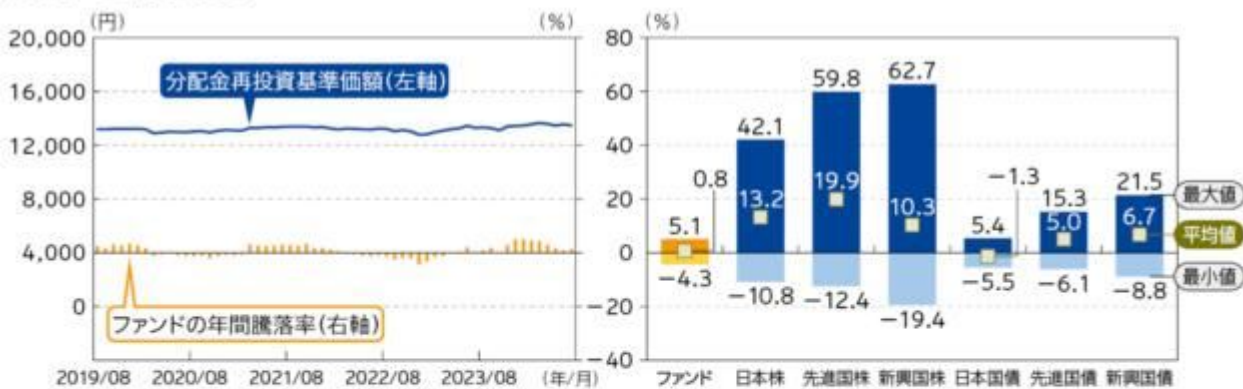
ハッピーエイジング40



ハッピーエイジング50



ハッピーエイジング60



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

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

代表的な資産クラスの指数

日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み) 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。	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。
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。	日本国債:NOMURA-BPI 国債 野村フィューチャリー・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、野村フィューチャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。
先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE 世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。	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) 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。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

< 申込み時に受益者が負担する費用・税金 >

時期	項目	費用・税金
----	----	-------

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

1 基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きま
す。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産
総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総
口数で除した価額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されることが
あります。

2 税法が改正された場合は、上記の内容が変更になることがあります。

3 定時定額購入サービス契約を結ばれた場合および確定拠出年金制度に基づく申込みの場合、お申
込手数料はありません。

（2）【換金（解約）手数料】

換金（解約）手数料はかかりません。信託財産留保額はありせん。

（3）【信託報酬等】

委託会社及び受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し
て以下の率を乗じて得た金額とし、委託会社と受託会社との間の配分も下表のとおりです（下記 のと
おり、委託会社は販売会社への配分を一旦収受します。 ）。

・運用管理費用（信託報酬）＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

ファンド名	信託報酬率 （年率）	内訳（税抜 年率）		
		委託会社	販売会社	受託会社
ハッピー エイジング 20	1.617% (税抜1.470%)	ファンドの 運用の対価 0.590%	購入後の情報提 供、運用報告書 等各種書類の送 付、口座内での ファンドの管理 等の対価 0.830%	運用財産の管 理、委託会社か らの指図の実行 等の対価 0.050%
ハッピー エイジング 30	1.485% (税抜1.350%)	0.530%	0.770%	0.050%
ハッピー エイジング 40	1.320% (税抜1.200%)	0.470%	0.680%	0.050%
ハッピー エイジング 50	1.133% (税抜1.030%)	0.410%	0.570%	0.050%
ハッピー エイジング 60	0.946% (税抜0.860%)	0.350%	0.460%	0.050%

信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。毎計算期間の最初の6ヵ月終了
日および毎計算期末、または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬に対する消費税等相当額を信託報酬支弁のときに信託財産の中から支弁します。（税額
は、税法改正時には変更となります。）

信託報酬の販売会社への配分は、販売会社の行う業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦

信託財産から収受した後、取扱残高に応じて支払います。委託会社は、信託報酬を収受したときは、販売会社に対して代行手数料を遅滞なく支払うものとします。なお、販売会社への配分には、消費税等相当額が含まれています。

委託会社の報酬には、損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託したTCWへの投資顧問報酬が含まれます。投資顧問報酬の額は、各ファンドの純資産総額に当該計算期間を通じて毎日、年0.082%以内の率を乗じて得た金額とします。〔ファンドの運用の対価〕

(4) 【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産に係る監査費用(消費税等相当額を含みます。)は、ファンドの計算期間を通じて日々計算し、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁することができます。支弁時期は信託報酬と同様です。

監査費用	監査法人に支払うファンド監査にかかる費用
------	----------------------

上記の費用等については、運用状況等により変動するものがあり、事前に料率、上限額等を表示することができないものがあります。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料に対する消費税等相当額及び先物取引・オプション取引等及びコール取引等に要する費用及び外国における資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担します。信託財産の証券取引等に伴う手数料や税金は信託財産が負担しますが、売買委託手数料や有価証券取引税等証券取引に伴う手数料や税金は国や市場によって異なります。また、売買金額によっても異なります。

売買委託手数料	有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
保管費用	有価証券等の保管等のために、海外の銀行等に支払う費用

(5) 【課税上の取扱い】

個人の受益者に対する課税

< 収益分配時 >

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315% (所得税15.315%および地方税5%)の税率が適用されます。

< 一部解約時および償還時 >

一部解約時および償還時の差益(譲渡益)については、譲渡所得等として課税対象となり、20.315% (所得税15.315%および地方税5%)の税率が適用されます。

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315% (所得税15.315%)の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。

(注1) 個別元本について

- ・追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。
- ・受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ・ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合等については個別元本の計算方法が異なる場合があります。受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。(「元本払戻金(特別分配金)」については、下記<収益分配金の課税について>をご参照ください。)

(注2) 収益分配金の課税について

- ・追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

配当控除、益金不算入制度の適用はありません。

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」の適用対象となります。

ハッピーエイジング20、30および40は、NISAの「成長投資枠(特定非課税管理勘定)」および「つみたて投資枠(特定累積投資勘定)」の対象です。ハッピーエイジング50および60は、NISAの「成長投資枠(特定非課税管理勘定)」の対象です。ただし、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

- ・少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」をご利用の場合

一定額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2024年7月末現在のもので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

（参考情報）ファンドの総経費率

●直近の運用報告書の作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下のとおりです。

ファンド名	総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
ハッピーエイジング20	1.64%	1.62%	0.02%
ハッピーエイジング30	1.50%	1.48%	0.02%
ハッピーエイジング40	1.35%	1.33%	0.02%
ハッピーエイジング50	1.16%	1.14%	0.02%
ハッピーエイジング60	0.96%	0.94%	0.02%

※対象期間は2023年7月19日から2024年7月16日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除きます。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

ハッピーエイジング20

2024年7月31日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	1,265,999,238	4.42
親投資信託受益証券	日本	26,688,866,355	93.10
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		711,381,095	2.48
純資産総額		28,666,246,688	100.00

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

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

ハッピーエイジング30

2024年7月31日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	1,308,859,573	4.73
親投資信託受益証券	日本	25,791,980,534	93.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		588,214,431	2.12
純資産総額		27,689,054,538	100.00

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

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

ハッピーエイジング40

2024年7月31日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	1,414,842,225	4.76
親投資信託受益証券	日本	27,700,382,279	93.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		634,962,399	2.13
純資産総額		29,750,186,903	100.00

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

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

ハッピーエイジング50

2024年7月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	373,682,505	3.14
親投資信託受益証券	日本	11,321,554,338	95.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		215,189,131	1.80
純資産総額		11,910,425,974	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ハッピーエイジング60

2024年7月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	5,482,996,119	97.76
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		125,520,283	2.24
純資産総額		5,608,516,402	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）S J A M ラージキャップ・バリュース・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	35,713,080,990	99.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		301,116,293	0.84
純資産総額		36,014,197,283	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）S J A M スモールキャップ・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	21,176,298,140	99.78
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		46,603,815	0.22
純資産総額		21,222,901,955	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

2024年7月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	22,420,561,900	70.11
地方債証券	日本	676,518,000	2.12
特殊債券	日本	434,876,102	1.36
社債券	日本	7,602,768,000	23.77

	フランス	498,387,000	1.56
	イギリス	100,125,000	0.31
		8,201,280,000	25.64
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		246,938,763	0.77
純資産総額		31,980,174,765	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	8,438,765,658	53.24
	中国	1,586,873,817	10.01
	イタリア	972,280,208	6.13
	イギリス	784,035,431	4.95
	スペイン	718,148,687	4.53
	フランス	619,511,120	3.91
	ドイツ	447,363,338	2.82
	カナダ	279,574,745	1.76
	ベルギー	274,359,156	1.73
	オーストラリア	205,592,582	1.30
	オランダ	194,678,084	1.23
	オーストリア	128,393,596	0.81
	メキシコ	113,031,685	0.71
	アイルランド	78,788,628	0.50
	ポーランド	73,292,172	0.46
	マレーシア	63,942,362	0.40
	フィンランド	52,402,233	0.33
	シンガポール	45,418,536	0.29
	デンマーク	40,316,960	0.25
	スウェーデン	29,367,442	0.19
ノルウェー	27,250,962	0.17	
		15,173,387,402	95.72
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		678,365,605	4.28
純資産総額		15,851,753,007	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	19,235,569,780	72.19
	カナダ	849,838,738	3.19
	アイルランド	727,719,274	2.73

	ドイツ	568,246,542	2.13
	イギリス	469,367,914	1.76
	フランス	467,480,219	1.75
	シンガポール	382,598,565	1.44
	オランダ	302,503,753	1.14
	スイス	237,605,203	0.89
	オーストラリア	222,608,494	0.84
	スウェーデン	85,867,117	0.32
	ベルギー	64,685,127	0.24
	スペイン	59,233,153	0.22
	デンマーク	46,277,187	0.17
	ジャージー	44,018,106	0.17
	バミューダ	43,239,936	0.16
	プエルトリコ	41,060,513	0.15
	ケイマン	34,330,233	0.13
	香港	28,615,707	0.11
	フィンランド	18,841,230	0.07
	ノルウェー	1,500,216	0.01
		23,931,207,007	89.82
投資証券	アメリカ	1,184,684,784	4.45
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,528,965,785	5.73
純資産総額		26,644,857,576	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

ハッピーエイジング20

2024年7月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - T C W外国株式マ ザーファンド	1,709,864,237	5.7243	9,787,885,631	5.4468	9,313,288,526	32.49
2	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mラージキャップ・パ リユー・マザーファンド	1,890,530,702	4.0043	7,570,252,091	4.0050	7,571,575,461	26.41
3	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド	1,463,713,521	5.1060	7,473,721,239	5.1467	7,533,294,378	26.28
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	834,882,606	2.1094	1,761,120,776	2.0382	1,701,657,727	5.94
5	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	157,141	8,423.83	1,323,729,761	8,056.45	1,265,999,238	4.42
6	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファ ンド	421,612,405	1.3523	570,150,387	1.3497	569,050,263	1.99

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	4.42
親投資信託受益証券	93.10
合計	97.52

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

ハッピーエイジング30

2024年7月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	親投資信託 受益証券	S J A M ラージキャップ・パ リユー・マザーファンド	1,547,189,623	4.0043	6,195,411,408	4.0050	6,196,494,440	22.38
2	日本	親投資信託 受益証券	S J A M スモールキャップ・マ ザーファンド	1,199,974,803	5.1060	6,127,071,345	5.1467	6,175,910,318	22.30
3	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - T C W 外国株式マ ザーファンド	1,052,381,094	5.7235	6,023,395,270	5.4468	5,732,109,342	20.70
4	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	2,691,529,510	2.1093	5,677,269,133	2.0382	5,485,875,447	19.81
5	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファ ンド	1,631,170,621	1.3523	2,205,832,031	1.3497	2,201,590,987	7.95
6	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	162,461	8,423.83	1,368,544,560	8,056.45	1,308,859,573	4.73

（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

2024年7月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	4.73
親投資信託受益証券	93.15
合計	97.88

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

ハッピーエイジング40

2024年7月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファ ンド	7,243,142,536	1.3523	9,794,901,652	1.3497	9,776,069,480	32.86
2	日本	親投資信託 受益証券	S J A M ラージキャップ・パ リユー・マザーファンド	1,173,433,536	4.0043	4,698,779,909	4.0050	4,699,601,311	15.80
3	日本	親投資信託 受益証券	S J A M スモールキャップ・マ ザーファンド	909,710,885	5.1060	4,644,983,779	5.1467	4,682,009,011	15.74
4	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン外国債券（為替ヘッ ジなし）マザーファンド	2,173,021,733	2.1092	4,583,438,013	2.0382	4,429,052,896	14.89
5	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン - T C W 外国株式マ ザーファンド	755,241,533	5.7233	4,322,510,150	5.4468	4,113,649,581	13.83

6	アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	175,616	8,423.83	1,479,360,101	8,056.45	1,414,842,225	4.76
---	------	----------	----------------------------	---------	----------	---------------	----------	---------------	------

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	4.76
親投資信託受益証券	93.11
合計	97.87

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

ハッピーエイジング50

2024年7月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファンド	5,016,780,647	1.3523	6,784,192,469	1.3497	6,771,148,839	56.85
2	日本	親投資信託受益証券	損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	638,998,933	2.1092	1,347,777,257	2.0382	1,302,407,625	10.94
3	日本	親投資信託受益証券	SJAMラージキャップ・バリュール・マザーファンド	288,394,657	4.0043	1,154,818,726	4.0050	1,155,020,601	9.70
4	日本	親投資信託受益証券	SJAMスモールキャップ・マザーファンド	223,518,526	5.1060	1,141,285,594	5.1467	1,150,382,797	9.66
5	日本	親投資信託受益証券	損保ジャパン-TCW外国株式マザーファンド	173,054,725	5.7231	990,422,195	5.4468	942,594,476	7.91
6	アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING	46,383	8,423.83	390,722,710	8,056.45	373,682,505	3.14

(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

2024年7月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	3.14
親投資信託受益証券	95.06
合計	98.19

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

ハッピーエイジング60

2024年7月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	損保ジャパン日本債券マザーファンド	2,980,997,249	1.3523	4,031,202,580	1.3497	4,023,451,986	71.74
2	日本	親投資信託受益証券	損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	437,229,698	2.1094	922,303,399	2.0382	891,161,570	15.89

3	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mスモールキャップ・マ ザーファンド	44,451,252	5.1060	226,968,093	5.1467	228,777,258	4.08
4	日本	親投資信託 受益証券	S J A Mラージキャップ・バ リュール・マザーファンド	57,117,759	4.0043	228,716,643	4.0050	228,756,624	4.08
5	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン・T C W外国株式マ ザーファンド	20,351,157	5.7260	116,531,018	5.4468	110,848,681	1.98

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.76
合計	97.76

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考) S J A Mラージキャップ・バリュール・マザーファンド

2024年7月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	三菱地所	不動産業	572,900	2,144.36	1,228,509,330	2,574.50	1,474,931,050	4.10
2	日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	9,116,800	161.32	1,470,764,026	160.40	1,462,334,720	4.06
3	日本	株式	旭化成	化学	1,307,600	1,049.54	1,372,390,131	1,094.00	1,430,514,400	3.97
4	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	802,400	1,490.57	1,196,040,874	1,750.00	1,404,200,000	3.90
5	日本	株式	東レ	繊維製品	1,728,000	695.63	1,202,058,102	785.30	1,356,998,400	3.77
6	日本	株式	本田技研工業	輸送用機 器	808,200	1,745.97	1,411,096,020	1,647.00	1,331,105,400	3.70
7	日本	株式	三井住友トラスト・ ホールディングス	銀行業	335,800	2,988.50	1,003,539,630	3,841.00	1,289,807,800	3.58
8	日本	株式	八十二銀行	銀行業	1,162,000	882.99	1,026,037,230	1,080.50	1,255,541,000	3.49
9	日本	株式	マキタ	機械	247,900	3,897.20	966,117,941	4,938.00	1,224,130,200	3.40
10	日本	株式	王子ホールディング ス	パルプ・ 紙	1,847,800	556.51	1,028,332,863	638.10	1,179,081,180	3.27
11	日本	株式	太陽誘電	電気機器	256,400	3,415.72	875,790,608	4,546.00	1,165,594,400	3.24
12	日本	株式	三井住友フィナン シャルグループ	銀行業	103,200	8,068.00	832,617,600	10,915.00	1,126,428,000	3.13
13	日本	株式	大林組	建設業	566,600	1,428.11	809,167,126	1,985.50	1,124,984,300	3.12
14	日本	株式	N I P P O N E X P R E S S ホール ディン	陸運業	145,200	7,773.99	1,128,783,627	7,460.00	1,083,192,000	3.01
15	日本	株式	京セラ	電気機器	550,000	2,112.09	1,161,653,545	1,901.00	1,045,550,000	2.90
16	日本	株式	めぶきフィナンシ ャルグループ	銀行業	1,637,300	455.65	746,043,309	635.00	1,039,685,500	2.89
17	日本	株式	日本精工	機械	1,241,600	805.44	1,000,036,484	795.70	987,941,120	2.74
18	日本	株式	キリンホールディ ングス	食料品	460,700	2,148.53	989,829,386	2,130.50	981,521,350	2.73
19	日本	株式	パナソニック ホ ールディン グス	電気機器	696,800	1,390.95	969,215,715	1,246.00	868,212,800	2.41
20	日本	株式	ヤマトホールディ ングス	陸運業	474,400	2,119.02	1,005,267,288	1,827.00	866,728,800	2.41
21	日本	株式	清水建設	建設業	880,300	879.55	774,273,300	950.70	836,901,210	2.32
22	日本	株式	住友重機械工業	機械	192,100	4,542.75	872,663,422	4,091.00	785,881,100	2.18

23	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	266,600	2,746.33	732,172,672	2,825.00	753,145,000	2.09
24	日本	株式	スタンレー電気	電気機器	245,700	2,579.23	633,718,287	2,982.50	732,800,250	2.03
25	日本	株式	ゆうちょ銀行	銀行業	452,700	1,506.42	681,959,295	1,575.50	713,228,850	1.98
26	日本	株式	総合警備保障	サービス業	704,700	816.70	575,530,035	968.80	682,713,360	1.90
27	日本	株式	日揮ホールディングス	建設業	520,700	1,387.38	722,411,473	1,286.00	669,620,200	1.86
28	日本	株式	大阪瓦斯	電気・ガス業	186,900	3,090.98	577,706,024	3,407.00	636,768,300	1.77
29	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	134,900	4,340.89	585,587,262	4,302.00	580,339,800	1.61
30	日本	株式	サワイグループホールディングス	医薬品	87,200	6,000.14	523,212,561	6,628.00	577,961,600	1.60

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別及び業種別投資比率

2024年7月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	7.31
		食料品	3.80
		繊維製品	3.77
		パルプ・紙	3.27
		化学	5.11
		医薬品	3.22
		ガラス・土石製品	1.25
		非鉄金属	2.16
		金属製品	1.23
		機械	10.20
		電気機器	11.47
		輸送用機器	5.18
		電気・ガス業	1.77
		陸運業	7.51
		情報・通信業	4.06
		卸売業	0.94
銀行業	19.94		
保険業	0.99		
不動産業	4.10		
サービス業	1.90		
合計			99.16

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

(参考) S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

2024年7月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
1	日本	株式	第四北越フィナンシャルグループ	銀行業	122,500	4,099.94	502,243,240	6,040.00	739,900,000	3.49

2	日本	株式	ほくほくフィナンシャルグループ	銀行業	338,100	1,448.90	489,873,652	2,134.50	721,674,450	3.40
3	日本	株式	ケーズホールディングス	小売業	434,000	1,347.59	584,854,414	1,621.50	703,731,000	3.32
4	日本	株式	森永乳業	食料品	187,200	2,976.42	557,187,620	3,612.00	676,166,400	3.19
5	日本	株式	セリア	小売業	189,800	2,339.42	444,023,682	3,405.00	646,269,000	3.05
6	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	311,800	1,605.45	500,580,667	2,065.00	643,867,000	3.03
7	日本	株式	サワイグループホールディングス	医薬品	96,000	4,564.29	438,172,520	6,628.00	636,288,000	3.00
8	日本	株式	ちゅうぎんフィナンシャルグループ	銀行業	372,700	1,113.69	415,074,036	1,689.50	629,676,650	2.97
9	日本	株式	テレビ朝日ホールディングス	情報・通信業	274,800	2,075.37	570,313,134	2,103.00	577,904,400	2.72
10	日本	株式	北洋銀行	銀行業	1,119,900	346.40	387,937,254	515.00	576,748,500	2.72
11	日本	株式	ジェイテクト	機械	513,900	1,345.52	691,465,045	1,097.00	563,748,300	2.66
12	日本	株式	E I Z O	電気機器	98,500	5,234.04	515,553,699	4,880.00	480,680,000	2.26
13	日本	株式	総合警備保障	サービス業	480,500	908.81	436,687,008	968.80	465,508,400	2.19
14	日本	株式	山陰合同銀行	銀行業	321,000	1,092.53	350,702,130	1,440.00	462,240,000	2.18
15	日本	株式	エン・ジャパン	サービス業	161,500	2,537.80	409,855,425	2,819.00	455,268,500	2.15
16	日本	株式	日本ライフライン	卸売業	379,800	1,195.81	454,169,179	1,164.00	442,087,200	2.08
17	日本	株式	マブチモーター	電気機器	187,700	2,282.92	428,504,366	2,321.50	435,745,550	2.05
18	日本	株式	富士通ゼネラル	電気機器	196,100	2,099.15	411,644,385	1,981.50	388,572,150	1.83
19	日本	株式	ひろぎんホールディングス	銀行業	314,200	944.90	296,890,542	1,233.00	387,408,600	1.83
20	日本	株式	滋賀銀行	銀行業	94,900	3,862.84	366,584,096	4,075.00	386,717,500	1.82
21	日本	株式	杏林製薬	医薬品	219,300	1,796.98	394,077,815	1,721.00	377,415,300	1.78
22	日本	株式	トラスコ中山	卸売業	150,700	2,588.70	390,117,586	2,445.00	368,461,500	1.74
23	日本	株式	日本触媒	化学	223,300	1,371.33	306,220,146	1,635.50	365,207,150	1.72
24	日本	株式	東亜合成	化学	214,400	1,385.82	297,121,598	1,618.50	347,006,400	1.64
25	日本	株式	豊田合成	輸送用機器	112,000	2,758.11	308,908,563	2,787.00	312,144,000	1.47
26	日本	株式	日本M & Aセンターホールディングス	サービス業	411,700	842.54	346,877,099	707.10	291,113,070	1.37
27	日本	株式	ゼビオホールディングス	小売業	216,400	1,019.38	220,594,906	1,210.00	261,844,000	1.23
28	日本	株式	日本新薬	医薬品	74,300	4,250.34	315,800,724	3,449.00	256,260,700	1.21
29	日本	株式	東プレ	金属製品	117,000	1,793.02	209,784,472	2,092.00	244,764,000	1.15
30	日本	株式	ユナイテッドアローズ	小売業	114,900	1,880.37	216,055,012	2,121.00	243,702,900	1.15

(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

2024年7月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	食料品	3.44
		繊維製品	1.00
		パルプ・紙	1.87
		化学	12.29
		医薬品	5.98
		鉄鋼	0.24

	金属製品	1.15
	機械	5.49
	電気機器	9.62
	輸送用機器	2.55
	精密機器	0.48
	陸運業	0.23
	情報・通信業	2.72
	卸売業	6.59
	小売業	13.22
	銀行業	22.54
	不動産業	0.58
	サービス業	9.77
合計		99.78

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類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

2024年7月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	利率（%）	償還日	投資 比率 （%）
1	日本	国債証券	第459回利付国債（2年）	1,050,000,000	99.88	1,048,834,500	99.68	1,046,692,500	0.2000000	2026/4/1	3.27
2	日本	国債証券	第373回利付国債（10年）	1,060,000,000	96.72	1,025,232,000	96.40	1,021,861,200	0.6000000	2033/12/20	3.20
3	日本	国債証券	第183回利付国債（20年）	1,000,000,000	94.20	942,040,000	94.34	943,430,000	1.4000000	2042/12/20	2.95
4	日本	国債証券	第367回利付国債（10年）	970,000,000	95.38	925,234,500	94.95	921,024,700	0.2000000	2032/6/20	2.88
5	日本	国債証券	第371回利付国債（10年）	950,000,000	95.67	908,874,500	95.29	905,331,000	0.4000000	2033/6/20	2.83
6	日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	900,000,000	95.63	860,733,000	95.17	856,593,000	0.1000000	2031/9/20	2.68
7	日本	国債証券	第165回利付国債（5年）	850,000,000	99.13	842,630,500	98.63	838,380,500	0.3000000	2028/12/20	2.62
8	日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	850,000,000	98.50	837,284,000	98.02	833,178,500	0.1000000	2028/9/20	2.61
9	日本	国債証券	第358回利付国債（10年）	740,000,000	97.28	719,894,200	96.77	716,127,600	0.1000000	2030/3/20	2.24
10	日本	国債証券	第167回利付国債（5年）	700,000,000	99.40	695,849,000	98.94	692,594,000	0.4000000	2029/3/20	2.17
11	日本	国債証券	第176回利付国債（20年）	800,000,000	83.27	666,192,000	83.35	666,872,000	0.5000000	2041/3/20	2.09
12	日本	国債証券	第76回利付国債（30年）	790,000,000	84.32	666,159,600	84.33	666,262,300	1.4000000	2052/9/20	2.08
13	日本	国債証券	第182回利付国債（20年）	730,000,000	89.85	655,963,400	89.99	656,985,400	1.1000000	2042/9/20	2.05

14	日本	国債証券	第147回利付国債（5年）	650,000,000	99.61	647,504,000	99.40	646,145,500	0.0050000	2026/3/20	2.02
15	日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	660,000,000	96.84	639,196,800	96.32	635,758,200	0.1000000	2030/9/20	1.99
16	日本	国債証券	第154回利付国債（20年）	580,000,000	100.39	582,291,000	100.14	580,852,600	1.2000000	2035/9/20	1.82
17	日本	国債証券	第366回利付国債（10年）	540,000,000	95.73	516,947,400	95.27	514,468,800	0.2000000	2032/3/20	1.61
18	日本	国債証券	第156回利付国債（5年）	500,000,000	99.32	496,615,000	98.91	494,590,000	0.2000000	2027/12/20	1.55
19	日本	国債証券	第166回利付国債（5年）	480,000,000	99.56	477,916,800	99.06	475,488,000	0.4000000	2028/12/20	1.49
20	日本	国債証券	第166回利付国債（20年）	510,000,000	90.38	460,948,200	90.40	461,065,500	0.7000000	2038/9/20	1.44
21	日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	450,000,000	98.64	443,920,500	98.21	441,958,500	0.1000000	2028/6/20	1.38
22	日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	450,000,000	98.26	442,201,500	97.80	440,100,000	0.1000000	2028/12/20	1.38
23	日本	国債証券	第168回利付国債（20年）	510,000,000	85.58	436,488,600	85.61	436,656,900	0.4000000	2039/3/20	1.37
24	日本	国債証券	第60回利付国債（30年）	510,000,000	78.61	400,926,300	78.76	401,676,000	0.9000000	2048/9/20	1.26
25	日本	国債証券	第451回利付国債（2年）	400,000,000	99.89	399,584,000	99.72	398,900,000	0.0050000	2025/8/1	1.25
26	日本	地方債証券	第807回東京都公募債	400,000,000	96.69	386,792,000	96.17	384,688,000	0.1000000	2030/6/20	1.20
27	日本	国債証券	第460回利付国債（2年）	350,000,000	100.03	350,122,500	99.81	349,359,500	0.3000000	2026/5/1	1.09
28	日本	国債証券	第150回利付国債（20年）	320,000,000	103.36	330,752,000	103.01	329,654,400	1.4000000	2034/9/20	1.03
29	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	102.44	307,338,000	101.90	305,724,000	1.1760000	2029/1/26	0.96
30	日本	社債券	第2回武田薬品工業株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担	300,000,000	99.99	299,994,000	99.80	299,415,000	1.9340000	2084/6/25	0.94

（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

2024年7月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	70.11
地方債証券	2.12
特殊債券	1.36
社債券	25.64
合計	99.23

（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

2024年7月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	利率（%）	償還日	投資 比率 （%）
1	アメリカ	国債証券	Treasury 2.75 280215	9,880,000	14,508.00	1,433,390,462	14,552.66	1,437,802,888	2.7500000	2028/2/15	9.07
2	アメリカ	国債証券	Treasury 4.875 260531	7,890,000	15,348.25	1,210,977,225	15,358.92	1,211,819,215	4.8750000	2026/5/31	7.64
3	アメリカ	国債証券	Treasury 0.75 260331	7,550,000	14,302.56	1,079,843,577	14,335.91	1,082,361,218	0.7500000	2026/3/31	6.83
4	アメリカ	国債証券	Treasury 2.125 250515	6,630,000	14,892.19	987,352,659	14,916.29	988,950,267	2.1250000	2025/5/15	6.24
5	アメリカ	国債証券	Treasury 4.625 310531	4,200,000	15,660.82	657,754,781	15,739.43	661,056,060	4.6250000	2031/5/31	4.17
6	アメリカ	国債証券	Treasury 4.0 340215	3,020,000	14,972.46	452,168,480	15,067.74	455,045,785	4.0000000	2034/2/15	2.87
7	アメリカ	国債証券	Treasury 4.5 290531	2,290,000	15,496.47	354,869,362	15,546.49	356,014,806	4.5000000	2029/5/31	2.25
8	スペイン	国債証券	SPAIN 0.5 311031	2,470,000	13,850.90	342,117,437	13,949.23	344,546,038	0.5000000	2031/10/31	2.17
9	イタリア	国債証券	ITALY 2.2 270601	1,830,000	16,102.49	294,675,710	16,165.74	295,833,218	2.2000000	2027/6/1	1.87
10	アメリカ	国債証券	Treasury 1.75 410815	2,730,000	10,228.96	279,250,665	10,320.06	281,737,881	1.7500000	2041/8/15	1.78
11	アメリカ	国債証券	Treasury 4.75 531115	1,700,000	15,968.09	271,457,530	16,115.76	273,968,025	4.7500000	2053/11/15	1.73
12	中国	国債証券	CGB 2.18 260815	12,000,000	2,124.96	254,995,439	2,128.34	255,400,932	2.1800000	2026/8/15	1.61
13	中国	国債証券	CGB 2.8 321115	11,000,000	2,191.05	241,016,019	2,215.21	243,673,831	2.8000000	2032/11/15	1.54
14	中国	国債証券	CGB 2.04 270225	10,000,000	2,116.67	211,667,300	2,122.66	212,266,720	2.0400000	2027/2/25	1.34
15	アメリカ	国債証券	Treasury 2.25 270215	1,460,000	14,485.96	211,495,137	14,517.52	211,955,910	2.2500000	2027/2/15	1.34
16	中国	国債証券	CGB 2.67 331125	9,500,000	2,164.46	205,624,527	2,194.78	208,504,144	2.6700000	2033/11/25	1.32
17	イタリア	国債証券	ITALY 2.45 330901	1,250,000	15,051.85	188,148,147	15,113.81	188,922,718	2.4500000	2033/9/1	1.19
18	中国	国債証券	CGB 2.8 300325	7,500,000	2,182.42	163,681,543	2,195.77	164,683,494	2.8000000	2030/3/25	1.04
19	アメリカ	国債証券	Treasury 3.0 480215	1,340,000	11,756.33	157,534,949	11,856.37	158,875,468	3.0000000	2048/2/15	1.00
20	アメリカ	国債証券	Treasury 3.75 300531	1,030,000	14,924.82	153,725,735	14,990.92	154,406,535	3.7500000	2030/5/31	0.97
21	中国	国債証券	CGB 2.6 320901	7,000,000	2,158.87	151,121,518	2,181.59	152,711,684	2.6000000	2032/9/1	0.96
22	フランス	国債証券	FRANCE 2.0 321125	980,000	15,304.18	149,980,993	15,392.81	150,849,551	2.0000000	2032/11/25	0.95
23	カナダ	国債証券	CANADA 0.5 301201	1,570,000	9,220.98	144,769,421	9,341.66	146,664,113	0.5000000	2030/12/1	0.93
24	ベルギー	国債証券	BELGIUM 3.0 340622	880,000	16,503.34	145,229,440	16,653.97	146,554,958	3.0000000	2034/6/22	0.92
25	ドイツ	国債証券	GERMANY 2.6 330815	810,000	16,721.31	135,442,640	16,914.31	137,005,970	2.6000000	2033/8/15	0.86
26	中国	国債証券	CGB 2.8 290324	6,000,000	2,176.96	130,617,789	2,189.23	131,353,937	2.8000000	2029/3/24	0.83
27	中国	国債証券	CGB 3.0 531015	5,500,000	2,325.77	127,917,730	2,373.22	130,527,464	3.0000000	2053/10/15	0.82
28	アメリカ	国債証券	Treasury 1.75 291115	950,000	13,544.53	128,673,054	13,605.27	129,250,065	1.7500000	2029/11/15	0.82

29	スペイン	国債証券	SPAIN 0.0 280131	860,000	14,915.94	128,277,165	14,998.39	128,986,192	0.000000	2028/1/31	0.81
30	アメリカ	国債証券	Treasury 1.25 310815	1,020,000	12,533.42	127,840,948	12,620.36	128,727,719	1.250000	2031/8/15	0.81

(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

2024年7月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	95.72
合計	95.72

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考) 損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド

2024年7月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア・ サービス	15,767	69,201.66	1,091,102,611	64,469.92	1,016,497,304	3.81
2	アメリカ	株式	FISERV INC	金融サー ビス	33,310	23,744.15	790,917,770	24,864.48	828,236,109	3.11
3	アメリカ	株式	HEICO CORP	資本財	21,078	34,289.03	722,744,328	36,381.33	766,845,682	2.88
4	カナダ	株式	WASTE CONNECTIONS INC	商業・専 門サー ビス	28,229	27,415.32	773,907,110	26,884.31	758,917,424	2.85
5	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	45,919	19,579.39	899,066,174	15,812.60	726,098,834	2.73
6	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サー ビス	17,566	40,945.71	719,252,347	40,106.96	704,518,930	2.64
7	アイルラ ンド	株式	LINDE PLC	素材	8,628	67,084.95	578,808,990	68,727.57	592,981,508	2.23
8	アメリカ	株式	TRADE DESK INC/THE - CLASS A	メディ ア・娯 楽	41,261	15,154.35	625,283,983	13,695.20	565,078,043	2.12
9	アメリカ	株式	S&P GLOBAL INC	金融サー ビス	7,152	73,639.63	526,670,681	74,468.46	532,598,457	2.00
10	アメリカ	株式	MSCI INC	金融サー ビス	5,437	76,345.76	415,091,914	83,271.87	452,749,181	1.70
11	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サー ビス	6,054	67,772.41	410,294,198	68,209.27	412,938,969	1.55
12	アメリカ	株式	TRANSNIGM GROUP INC	資本財	2,140	189,404.31	405,325,225	192,708.55	412,396,298	1.55
13	アメリカ	株式	ALPHABET, INC	メディ ア・娯 楽	15,733	28,687.68	451,343,326	26,198.33	412,178,458	1.55
14	アメリカ	株式	MOTOROLA SOLUTIONS INC	テクノ ロジー・ ハード ウェアお よび機器	6,594	60,104.77	396,330,855	60,264.10	397,381,510	1.49
15	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	14,088	29,378.23	413,880,600	27,699.87	390,235,802	1.46
16	アメリカ	株式	SERVICENOW INC	ソフト ウェア・ サービス	3,100	117,051.05	362,858,267	121,769.07	377,484,123	1.42

17	アメリカ	株式	LENNAR CORP-CL A	耐久消費財・アパレル	12,997	24,701.46	321,044,919	27,507.79	357,518,851	1.34
18	アメリカ	株式	OTIS WORLDWIDE CORP	資本財	24,630	15,159.83	373,386,853	14,301.92	352,256,309	1.32
19	アメリカ	株式	FAIR ISAAC CORP	ソフトウェア・サービス	1,437	242,274.27	348,148,138	242,150.94	347,970,901	1.31
20	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	12,769	24,330.94	310,681,880	25,530.65	326,000,885	1.22
21	アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CO	ソフトウェア・サービス	11,082	27,878.22	308,946,514	29,122.13	322,731,529	1.21
22	アメリカ	株式	JP MORGAN CHASE & CO	銀行	9,368	32,020.02	299,963,566	32,803.56	307,303,784	1.15
23	アメリカ	株式	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	金融サービス	15,588	18,673.89	291,088,753	18,695.24	291,421,426	1.09
24	アメリカ	株式	MCKESSON HBOC INC	ヘルスケア機器・サービス	3,061	88,149.95	269,827,010	92,945.71	284,506,839	1.07
25	アメリカ	株式	JONES LANG LASALLE INC	不動産管理・開発	7,429	34,550.52	256,675,858	37,843.23	281,137,356	1.06
26	アメリカ	株式	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	金融サービス	12,033	22,533.68	271,147,781	23,064.17	277,531,182	1.04
27	シンガポール	株式	FLEX LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	56,108	4,615.88	258,987,975	4,762.22	267,198,954	1.00
28	アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア・サービス	12,617	21,656.38	273,238,624	20,681.53	260,938,925	0.98
29	アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	11,600	26,131.26	303,122,672	21,878.18	253,786,990	0.95
30	アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	5,599	38,545.97	215,818,933	39,318.84	220,146,237	0.83

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別及び業種別投資比率

2024年7月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	1.55
			0.77
		素材	4.33
		資本財	9.22
		商業・専門サービス	2.88
		運輸	0.72
		自動車・自動車部品	1.22
		耐久消費財・アパレル	2.37
		消費者サービス	0.66
		メディア・娯楽	5.76
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.04
		生活必需品流通・小売り	1.32
		食品・飲料・タバコ	1.58
		家庭用品・パーソナル用品	0.42
ヘルスケア機器・サービス	4.12		

	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4.63
	銀行	2.69
	金融サービス	15.85
	保険	1.63
	ソフトウェア・サービス	13.55
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.25
	電気通信サービス	0.23
	公益事業	1.26
	半導体・半導体製造装置	4.42
	不動産管理・開発	1.34
投資証券		4.45
合計		94.26

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

【投資不動産物件】

ハッピーエイジング20

該当事項はありません。

ハッピーエイジング30

該当事項はありません。

ハッピーエイジング40

該当事項はありません。

ハッピーエイジング50

該当事項はありません。

ハッピーエイジング60

該当事項はありません。

(参考) S J A M ラージキャップ・バリュー・マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) S J A M スモールキャップ・マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 損保ジャパン - T C W 外国株式マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

ハッピーエイジング20

該当事項はありません。

ハッピーエイジング 3 0

該当事項はありません。

ハッピーエイジング 4 0

該当事項はありません。

ハッピーエイジング 5 0

該当事項はありません。

ハッピーエイジング 6 0

該当事項はありません。

（参考）S J A M ラージキャップ・バリュール・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）S J A M スモールキャップ・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン - T C W 外国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（ 3 ） 【運用実績】

【純資産の推移】

ハッピーエイジング 2 0

直近日（2024年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第15計算期間末（2015年 7月15日）	8,801,004,620	8,801,004,620	1.3543	1.3543
第16計算期間末（2016年 7月15日）	7,416,738,892	7,416,738,892	1.1099	1.1099
第17計算期間末（2017年 7月18日）	9,271,419,094	9,271,419,094	1.4045	1.4045
第18計算期間末（2018年 7月17日）	10,439,689,943	10,439,689,943	1.5015	1.5015
第19計算期間末（2019年 7月16日）	10,453,350,603	10,453,350,603	1.4179	1.4179
第20計算期間末（2020年 7月15日）	10,189,146,231	10,189,146,231	1.3797	1.3797
第21計算期間末（2021年 7月15日）	13,007,644,754	13,007,644,754	1.7449	1.7449
第22計算期間末（2022年 7月15日）	14,848,476,768	14,848,476,768	1.8338	1.8338
第23計算期間末（2023年 7月18日）	19,858,295,497	19,858,295,497	2.2346	2.2346
第24計算期間末（2024年 7月16日）	29,019,606,819	29,019,606,819	2.9576	2.9576
2023年 7月末日	20,618,087,299		2.3126	
8月末日	21,212,419,225		2.3600	

9月末日	21,752,724,528		2.3904
10月末日	21,541,887,915		2.3413
11月末日	22,526,208,413		2.4345
12月末日	22,826,915,146		2.4391
2024年 1月末日	24,272,591,483		2.5678
2月末日	25,431,173,525		2.6608
3月末日	26,843,023,883		2.7946
4月末日	27,144,192,977		2.8161
5月末日	27,899,692,812		2.8640
6月末日	28,613,866,215		2.9202
7月末日	28,666,246,688		2.8961

ハッピーエイジング30

直近日（2024年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第15計算期間末（2015年 7月15日）	10,450,600,803	10,450,600,803	1.3944	1.3944
第16計算期間末（2016年 7月15日）	9,226,785,122	9,226,785,122	1.1894	1.1894
第17計算期間末（2017年 7月18日）	11,485,239,619	11,485,239,619	1.4397	1.4397
第18計算期間末（2018年 7月17日）	12,738,786,784	12,738,786,784	1.5148	1.5148
第19計算期間末（2019年 7月16日）	12,699,403,491	12,699,403,491	1.4446	1.4446
第20計算期間末（2020年 7月15日）	12,817,876,592	12,817,876,592	1.4293	1.4293
第21計算期間末（2021年 7月15日）	15,539,022,049	15,539,022,049	1.7142	1.7142
第22計算期間末（2022年 7月15日）	17,096,530,694	17,096,530,694	1.7915	1.7915
第23計算期間末（2023年 7月18日）	21,009,810,852	21,009,810,852	2.0822	2.0822
第24計算期間末（2024年 7月16日）	28,106,573,110	28,106,573,110	2.6358	2.6358
2023年 7月末日	21,674,680,958		2.1417	
8月末日	22,193,124,995		2.1835	
9月末日	22,534,557,066		2.2063	
10月末日	22,266,936,899		2.1717	
11月末日	23,119,726,729		2.2456	
12月末日	23,322,673,988		2.2471	
2024年 1月末日	24,443,693,901		2.3403	
2月末日	25,328,243,536		2.4088	
3月末日	26,421,210,227		2.5092	
4月末日	26,697,941,295		2.5318	
5月末日	27,179,379,766		2.5633	
6月末日	27,838,048,534		2.6086	
7月末日	27,689,054,538		2.5824	

ハッピーエイジング40

直近日（2024年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

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

		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第15計算期間末	(2015年 7月15日)	12,378,839,543	12,378,839,543	1.3816	1.3816
第16計算期間末	(2016年 7月15日)	11,857,174,350	11,857,174,350	1.2636	1.2636
第17計算期間末	(2017年 7月18日)	13,906,785,392	13,906,785,392	1.4368	1.4368
第18計算期間末	(2018年 7月17日)	15,282,979,036	15,282,979,036	1.4924	1.4924
第19計算期間末	(2019年 7月16日)	16,189,690,869	16,189,690,869	1.4537	1.4537
第20計算期間末	(2020年 7月15日)	16,815,567,800	16,815,567,800	1.4410	1.4410
第21計算期間末	(2021年 7月15日)	19,994,471,155	19,994,471,155	1.6425	1.6425
第22計算期間末	(2022年 7月15日)	21,277,799,746	21,277,799,746	1.6752	1.6752
第23計算期間末	(2023年 7月18日)	24,582,794,992	24,582,794,992	1.8528	1.8528
第24計算期間末	(2024年 7月16日)	30,041,750,564	30,041,750,564	2.1676	2.1676
	2023年 7月末日	25,142,554,816		1.8877	
	8月末日	25,600,051,787		1.9102	
	9月末日	25,791,047,511		1.9204	
	10月末日	25,547,394,632		1.8909	
	11月末日	26,346,872,722		1.9471	
	12月末日	26,434,057,157		1.9498	
	2024年 1月末日	27,274,992,928		2.0016	
	2月末日	27,929,111,075		2.0453	
	3月末日	28,863,590,054		2.1046	
	4月末日	29,101,579,226		2.1127	
	5月末日	29,406,701,190		2.1225	
	6月末日	29,871,666,362		2.1509	
	7月末日	29,750,186,903		2.1327	

ハッピーエイジング50

直近日（2024年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第15計算期間末	(2015年 7月15日)	5,534,439,620	5,534,439,620	1.3347	1.3347
第16計算期間末	(2016年 7月15日)	5,689,949,958	5,689,949,958	1.3007	1.3007
第17計算期間末	(2017年 7月18日)	6,297,794,959	6,297,794,959	1.3890	1.3890
第18計算期間末	(2018年 7月17日)	6,875,070,157	6,875,070,157	1.4262	1.4262
第19計算期間末	(2019年 7月16日)	7,592,282,029	7,592,282,029	1.4137	1.4137
第20計算期間末	(2020年 7月15日)	7,791,444,020	7,791,444,020	1.4019	1.4019
第21計算期間末	(2021年 7月15日)	8,938,896,753	8,938,896,753	1.5168	1.5168
第22計算期間末	(2022年 7月15日)	9,555,136,567	9,555,136,567	1.5150	1.5150
第23計算期間末	(2023年 7月18日)	10,534,193,457	10,534,193,457	1.5977	1.5977
第24計算期間末	(2024年 7月16日)	11,996,103,167	11,996,103,167	1.7340	1.7340
	2023年 7月末日	10,604,191,756		1.6124	
	8月末日	10,760,600,478		1.6210	
	9月末日	10,798,637,800		1.6222	
	10月末日	10,696,842,822		1.5982	

11月末日	10,988,112,611		1.6395
12月末日	11,007,352,490		1.6430
2024年 1月末日	11,231,500,513		1.6647
2月末日	11,462,760,517		1.6885
3月末日	11,658,219,447		1.7175
4月末日	11,677,572,483		1.7145
5月末日	11,752,017,808		1.7097
6月末日	11,947,524,013		1.7252
7月末日	11,910,425,974		1.7144

ハッピーエイジング60

直近日（2024年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第15計算期間末 (2015年 7月15日)	3,292,018,524	3,292,018,524	1.2399	1.2399
第16計算期間末 (2016年 7月15日)	3,737,464,193	3,737,464,193	1.2843	1.2843
第17計算期間末 (2017年 7月18日)	3,967,051,489	3,967,051,489	1.2846	1.2846
第18計算期間末 (2018年 7月17日)	4,186,192,577	4,186,192,577	1.3015	1.3015
第19計算期間末 (2019年 7月16日)	4,551,251,809	4,551,251,809	1.3089	1.3089
第20計算期間末 (2020年 7月15日)	4,870,043,859	4,870,043,859	1.3009	1.3009
第21計算期間末 (2021年 7月15日)	5,345,944,070	5,345,944,070	1.3367	1.3367
第22計算期間末 (2022年 7月15日)	5,430,316,764	5,430,316,764	1.3192	1.3192
第23計算期間末 (2023年 7月18日)	5,407,525,651	5,407,525,651	1.3284	1.3284
第24計算期間末 (2024年 7月16日)	5,666,857,375	5,666,857,375	1.3584	1.3584
2023年 7月末日	5,419,646,517		1.3291	
8月末日	5,442,375,360		1.3321	
9月末日	5,447,635,972		1.3273	
10月末日	5,393,576,718		1.3106	
11月末日	5,525,965,266		1.3397	
12月末日	5,571,099,946		1.3433	
2024年 1月末日	5,587,770,440		1.3463	
2月末日	5,589,415,096		1.3560	
3月末日	5,701,261,955		1.3651	
4月末日	5,700,101,044		1.3584	
5月末日	5,624,478,396		1.3464	
6月末日	5,690,297,023		1.3556	
7月末日	5,608,516,402		1.3476	

【分配の推移】

ハッピーエイジング20

	1口当たりの分配金（円）
第15計算期間	0.0000

第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
第24計算期間	0.0000

ハッピーエイジング30

	1口当たりの分配金（円）
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
第24計算期間	0.0000

ハッピーエイジング40

	1口当たりの分配金（円）
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
第24計算期間	0.0000

ハッピーエイジング50

	1口当たりの分配金（円）
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000

第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
第24計算期間	0.0000

ハッピーエイジング60

	1口当たりの分配金（円）
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
第24計算期間	0.0000

【収益率の推移】

ハッピーエイジング20

	収益率（％）
第15計算期間	23.9
第16計算期間	18.0
第17計算期間	26.5
第18計算期間	6.9
第19計算期間	5.6
第20計算期間	2.7
第21計算期間	26.5
第22計算期間	5.1
第23計算期間	21.9
第24計算期間	32.4

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

ハッピーエイジング30

	収益率（％）
第15計算期間	20.1
第16計算期間	14.7
第17計算期間	21.0
第18計算期間	5.2
第19計算期間	4.6

第20計算期間	1.1
第21計算期間	19.9
第22計算期間	4.5
第23計算期間	16.2
第24計算期間	26.6

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

ハッピーエイジング40

	収益率（％）
第15計算期間	14.4
第16計算期間	8.5
第17計算期間	13.7
第18計算期間	3.9
第19計算期間	2.6
第20計算期間	0.9
第21計算期間	14.0
第22計算期間	2.0
第23計算期間	10.6
第24計算期間	17.0

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

ハッピーエイジング50

	収益率（％）
第15計算期間	9.3
第16計算期間	2.5
第17計算期間	6.8
第18計算期間	2.7
第19計算期間	0.9
第20計算期間	0.8
第21計算期間	8.2
第22計算期間	0.1
第23計算期間	5.5
第24計算期間	8.5

（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。

ハッピーエイジング60

	収益率（％）
第15計算期間	4.3
第16計算期間	3.6

第17計算期間	0.0
第18計算期間	1.3
第19計算期間	0.6
第20計算期間	0.6
第21計算期間	2.8
第22計算期間	1.3
第23計算期間	0.7
第24計算期間	2.3

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

(4) 【設定及び解約の実績】

ハッピーエイジング20

	設定口数	解約口数
第15計算期間	1,446,470,764	1,546,505,235
第16計算期間	1,316,566,721	1,133,015,060
第17計算期間	1,187,415,933	1,268,396,839
第18計算期間	1,489,193,062	1,137,446,811
第19計算期間	1,441,075,609	1,021,272,801
第20計算期間	1,610,603,019	1,598,232,575
第21計算期間	1,531,705,313	1,462,004,315
第22計算期間	1,809,374,192	1,167,066,487
第23計算期間	1,970,503,276	1,180,964,726
第24計算期間	2,341,971,835	1,416,808,615

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

ハッピーエイジング30

	設定口数	解約口数
第15計算期間	1,083,572,839	945,383,122
第16計算期間	963,924,983	701,088,669
第17計算期間	1,000,840,370	780,753,459
第18計算期間	1,190,076,724	757,714,913
第19計算期間	1,151,257,690	770,237,275
第20計算期間	1,336,572,558	1,159,232,504
第21計算期間	1,265,453,871	1,168,570,454
第22計算期間	1,339,833,107	861,811,651
第23計算期間	1,422,792,677	875,614,531
第24計算期間	1,642,553,667	1,069,429,067

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

ハッピーエイジング40

	設定口数	解約口数
第15計算期間	1,360,175,410	1,220,689,774
第16計算期間	1,288,216,954	864,776,270
第17計算期間	1,431,202,031	1,135,435,456
第18計算期間	1,676,258,878	1,115,070,892
第19計算期間	1,884,821,803	988,431,478
第20計算期間	2,098,383,366	1,565,929,863
第21計算期間	1,997,361,636	1,493,623,313
第22計算期間	1,936,260,527	1,407,258,165
第23計算期間	1,879,507,225	1,313,399,096
第24計算期間	2,071,515,632	1,480,139,964

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

ハッピーエイジング50

	設定口数	解約口数
第15計算期間	849,878,441	721,397,173
第16計算期間	730,303,162	502,519,916
第17計算期間	828,831,999	669,291,626
第18計算期間	971,431,975	684,746,630
第19計算期間	1,121,171,260	571,339,838
第20計算期間	1,179,541,160	992,253,306
第21計算期間	1,148,879,543	813,439,718
第22計算期間	1,182,086,451	768,455,642
第23計算期間	1,054,270,671	767,967,640
第24計算期間	1,247,809,424	922,796,363

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

ハッピーエイジング60

	設定口数	解約口数
第15計算期間	649,247,886	545,147,386
第16計算期間	720,837,714	465,830,338
第17計算期間	748,382,900	570,133,617
第18計算期間	671,022,511	542,867,692
第19計算期間	829,372,301	568,524,688
第20計算期間	1,060,346,963	793,901,262
第21計算期間	925,573,626	669,909,997
第22計算期間	765,693,880	648,752,129
第23計算期間	651,604,071	697,314,060
第24計算期間	755,947,672	654,933,568

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

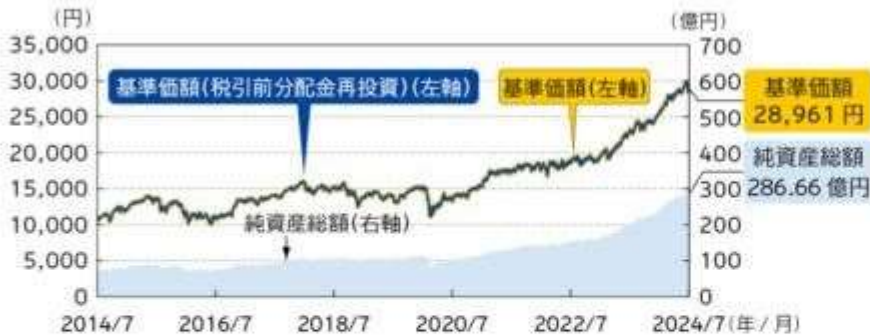
(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

参考情報

基準日:2024年7月31日

● 基準価額・純資産の推移 2014/07/31～2024/07/31

● ハッピーエイジング20



● ハッピーエイジング20

2020年07月	0円
2021年07月	0円
2022年07月	0円
2023年07月	0円
2024年07月	0円
設定来累計	0円

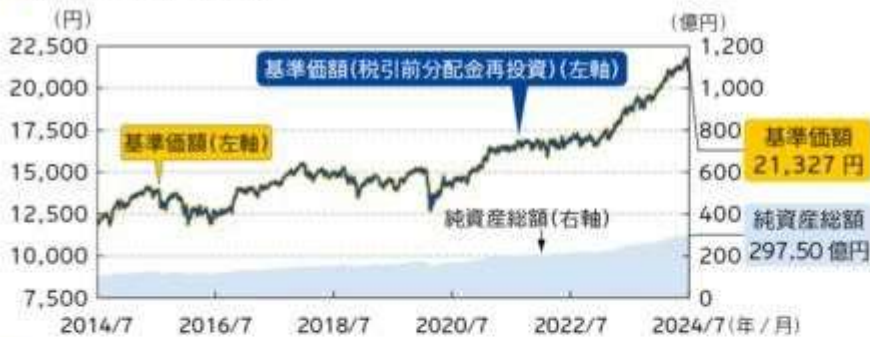
● ハッピーエイジング30



● ハッピーエイジング30

2020年07月	0円
2021年07月	0円
2022年07月	0円
2023年07月	0円
2024年07月	0円
設定来累計	0円

● ハッピーエイジング40



● ハッピーエイジング40

2020年07月	0円
2021年07月	0円
2022年07月	0円
2023年07月	0円
2024年07月	0円
設定来累計	0円

● ハッピーエイジング50



● ハッピーエイジング50

2020年07月	0円
2021年07月	0円
2022年07月	0円
2023年07月	0円
2024年07月	0円
設定来累計	0円

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

●ハッピーエイジング60



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

●ハッピーエイジング60

2020年07月	0円
2021年07月	0円
2022年07月	0円
2023年07月	0円
2024年07月	0円
設定来累計	0円

- 1万口当たり、税引前

● 主要な資産の状況

資産別構成	ハッピーエイジング		
	20	30	40
資産の種類	純資産比	純資産比	純資産比
SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	26.41%	22.38%	15.80%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	26.28%	22.30%	15.74%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	1.99%	7.95%	32.86%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	5.94%	19.81%	14.89%
損保ジャパン・TCW外国株式マザーファンド	32.49%	20.70%	13.83%
ISHARES CORE MSCI EMERGING	4.42%	4.73%	4.76%
コール・ローン等	2.48%	2.12%	2.13%
合計	100.00%	100.00%	100.00%

資産別構成	ハッピーエイジング	
	50	60
資産の種類	純資産比	純資産比
SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド	9.70%	4.08%
SJAMスモールキャップ・マザーファンド	9.66%	4.08%
損保ジャパン日本債券マザーファンド	56.85%	71.74%
損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド	10.94%	15.89%
損保ジャパン・TCW外国株式マザーファンド	7.91%	1.98%
ISHARES CORE MSCI EMERGING	3.14%	—
コール・ローン等	1.80%	2.24%
合計	100.00%	100.00%

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

● SJAMラージキャップ・バリュー・マザーファンド

組入上位5銘柄			
	銘柄名	業種	純資産比
1	三菱地所	不動産業	4.1%
2	日本電信電話	情報・通信業	4.1%
3	旭化成	化学	4.0%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	3.9%
5	東レ	繊維製品	3.8%
組入銘柄数			43銘柄

● SJAMスモールキャップ・マザーファンド

組入上位5銘柄			
	銘柄名	業種	純資産比
1	第四北越フィナンシャルグループ	銀行業	3.5%
2	ほくほくフィナンシャルグループ	銀行業	3.4%
3	ケーズホールディングス	小売業	3.3%
4	森永乳業	食料品	3.2%
5	セリア	小売業	3.1%
組入銘柄数			83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459回利付国債(2年)	国債証券	2026/04/01	3.3%
2	第373回利付国債(10年)	国債証券	2033/12/20	3.2%
3	第183回利付国債(20年)	国債証券	2042/12/20	3.0%
4	第367回利付国債(10年)	国債証券	2032/06/20	2.9%
5	第371回利付国債(10年)	国債証券	2033/06/20	2.8%
組入銘柄数			119銘柄	

● 損保ジャパン外国債券(為替ヘッジなし)マザーファンド

組入上位5銘柄						
	銘柄名	発行国	種類	通貨	償還日	純資産比
1	Treasury 2.75 280215	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2028/02/15	9.1%
2	Treasury 4.875 260531	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2026/05/31	7.6%
3	Treasury 0.75 260331	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2026/03/31	6.8%
4	Treasury 2.125 250515	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2025/05/15	6.2%
5	Treasury 4.625 310531	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2031/05/31	4.2%
組入銘柄数					152銘柄	

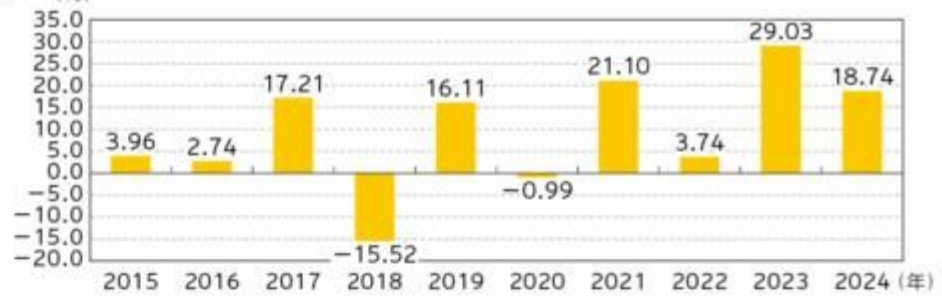
● 損保ジャパンTCW外国株式マザーファンド

組入上位5銘柄					
	銘柄名	通貨	発行国/地域	業種	純資産比
1	MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	3.8%
2	FISERV INC	アメリカ・ドル	アメリカ	金融	3.1%
3	HEICO CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	資本財・サービス	2.9%
4	WASTE CONNECTIONS INC	アメリカ・ドル	アメリカ	資本財・サービス	2.8%
5	NVIDIA CORP	アメリカ・ドル	アメリカ	情報技術	2.7%
組入銘柄数			215銘柄		

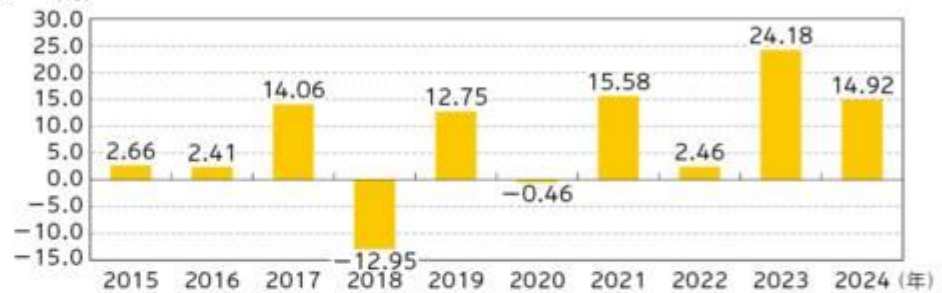
- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

年間収益率の推移（暦年ベース）

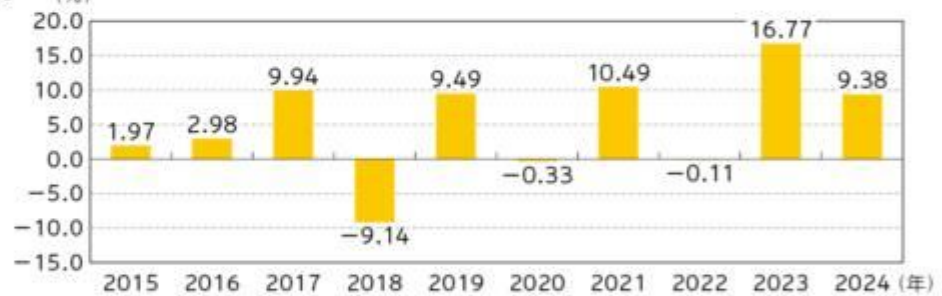
●ハッピーエイジング20 (%)



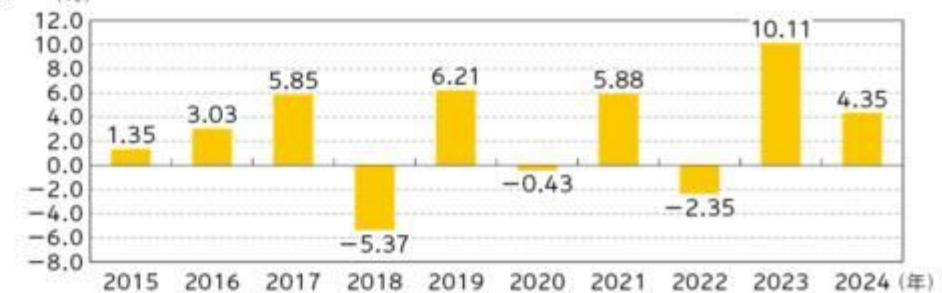
●ハッピーエイジング30 (%)



●ハッピーエイジング40 (%)

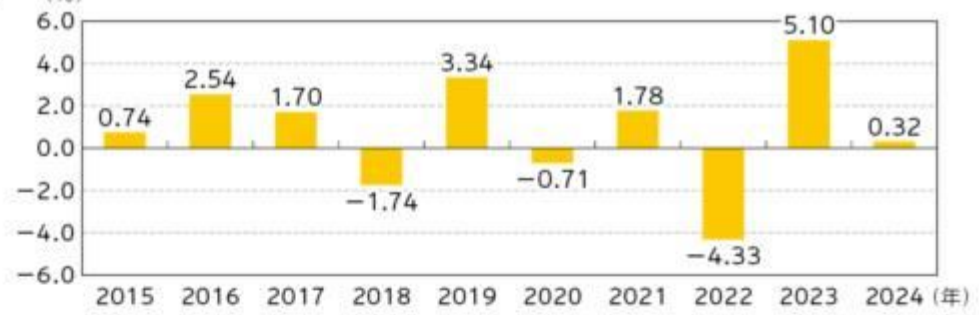


●ハッピーエイジング50 (%)



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

● ハッピーエイジング60 (%)



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

● 2024年は年初から基準日までの収益率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

- (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、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所、フランクフルト証券取引所、パリ証券取引所のいずれかの取引所あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、取得の申込みを受付けないものとし、

お申込みの受付は原則として午後3時までとし、それ以降のお申込みは、翌営業日の取扱いとなります。(受付時間については、販売会社により異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社にご確認ください。)

2024年11月5日以降は、原則として午後3時30分までとなる予定です。

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、取引市場における流動性が極端に減少した場合、取引市場の混乱、自然災害、テロ、大規模停電、システム障害等により基準価額の算出が困難となった場合、その他やむを得ない事情があると判断したとき(「緊急事態発生時」といいます。)は、取得申込みの受付を中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付を取り消すことができるものとし、

- (2) 受益権の取得申込者は、販売会社に取引口座を開設します。

- (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。

基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されることがあります。

当ファンドの基準価額については、委託会社または販売会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432 (受付時間: 営業日の午前9時~午後5時)

ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

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

定時定額購入サービスを申込まれた場合および確定拠出年金制度に基づき申込まれた場合には、申込手数料はありません。

定時定額購入サービスを申込まれた場合および確定拠出年金制度に基づき申込まれた場合で、「ハッピーエイジング・ファンド」の各ファンド間のスイッチングの場合にも、申込手数料はありません。

申込手数料率の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

- (5) お申込単位は販売会社が定める単位とします。

申込単位等の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

- (6) 取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増

加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

2【換金(解約)手続等】

- (1) 受益者は、日本における委託会社及び販売会社の各営業日に一部解約の実行を請求することができます。ただし、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所、フランクフルト証券取引所、パリ証券取引所のいずれかの取引所あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、解約請求を受付けないものとします。一部解約の受付は原則として午後3時までとし、それ以降のお申込みは翌営業日の取扱いとなります。(受付時間については、販売会社により異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社にご確認ください。)

2024年11月5日以降は、原則として午後3時30分までとなる予定です。

- (2) 受益者は、自己に帰属する受益権について販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

一部解約の単位の詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

- (3) 一部解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。解約代金は原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社の営業所等で支払われます。解約に係る手数料はありません。

ご換金時には税金が課せられます。詳しくは有価証券届出書「第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 4手数料等及び税金(5)課税上の取扱い」をご参照ください。

- (4) 委託会社は、緊急事態発生時には、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、および既に受付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができるものとします。一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付け中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとし、信託約款の規定に準じて算出した価額とします。

- (5) 換金の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

- (6) 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求を制限する場合があります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額は、原則として各営業日に委託会社が計算します。

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入有価証券を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。ただし、一般社団法人投資信託協会規則に別段の定めがある場合には同規則の定めるところによります。また外国為替の予約取引の評価は、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によって計算します。ただし、一般社団法人投資信託協会規則に別段の定めがある場合には同規則の定めるところによります。

基準価額は、毎営業日に委託会社及び販売会社に問い合わせることにより知ることができます。また基準価額は原則として、翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。なお基準価額は1万口単位で表示されたものが発表されます。

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、取引市場における流動性が極端に減少した場合、取引市場の混乱、自然災害、テロ、大規模停電、システム障害等により基準価額の公表を中止することがあります。

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。ただし、この信託期間中に信託約款第49条第8項、第50条第1項、第51条第1項、第52条第1項及び第54条第2項に規定する事由が生じた場合にはこの信託を終了させることができます。

（4）【計算期間】

原則として、毎年7月16日から翌年7月15日までとします。

なお、前記の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下、「該当日」といいます。）が休業日のときは各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託約款第4条に定める信託期間の終了日とします。

（5）【その他】

信託契約の解約

- （ ） 委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が1億口を下回ることとなった場合、またはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- （ ） 委託会社は、前記（ ）の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

ん。

- () 前記()の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- () 前記()の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前記()の信託契約の解約をしません。
- () 委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- () 前記()から()までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記()の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

信託契約に関する監督官庁の命令

- () 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- () 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、信託約款第55条(信託約款の変更)の規定にしたがいます。

委託会社の登録取消等に伴う取扱い

- () 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。
- () 前記()の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、信託約款第55条第4項に該当する場合(当該約款変更について異議を申し出た受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超える場合)を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

- () 委託会社は、事業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。
- () 委託会社は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- () 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款第55条の規定にしたがい、新受託会社を選任します。
- () 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

- () 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- () 委託会社は、前記()の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

- () 前記()の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- () 前記()の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前記()の信託約款の変更をしません。
- () 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

運用報告書に記載すべき事項の提供

- () 委託会社は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。
- () 前記()の規定にかかわらず、委託会社は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

公告

- () 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。
<https://www.sompo-am.co.jp/>
- () 前記()の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

関係法人との契約の更改等

委託会社と販売会社との間の募集・販売の取扱い等に関する契約は、当事者の別段の意思表示のない限り、1年毎に自動的に更新されます。募集・販売の取扱い等に関する契約は、当事者間の合意により変更することができます。

委託会社と運用委託先との間の投資一任契約は、原則として、ファンドの償還日に終了するものとします。ただし、運用委託先が契約に違反した場合等には、契約の中止または変更をすることができます。

信託事務処理の再信託

受託会社は、当ファンドに係る信託事務の処理の一部について株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することができます。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

4【受益者の権利等】

当ファンドの受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。この受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。受益者の有する主な権利は次のとおりです。なお、信託約款には受益者集会に関する規定はありません。また、ファンド資産に生じた利益及び損失は、全て受益者に帰属します。

(1) 収益分配金に対する請求権

当ファンドの収益分配金は、原則として自動的に当ファンドに再投資される性格を有します。分配金は税引き後再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。また委託会社の直接募集に係る受益者に対して委託会社は遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。

なお、収益分配金を再投資しない契約を別に締結した受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿

に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、毎計算期間の終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から販売会社を通じて受益者に支払います。ただし、委託会社自ら勧誘した受益者に対する支払いは委託会社において行うものとします。

なお、収益分配金の請求権は、支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

（2） 償還金に対する請求権

受益者は、償還金を持ち分に依りて委託会社に請求する権利を有します。償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として支払います。償還金は、償還日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から受益者に支払われます。償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。なお、委託会社自ら勧誘した受益者に対する支払いは、委託会社において行うものとします。

償還金の請求権は、支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

（3） 一部解約の実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について販売会社が定める単位をもって、受益権の一部解約の実行を請求することができます。なお、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所、フランクフルト証券取引所、パリ証券取引所のいずれかの取引所あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、解約請求を受付けないものとします。

受付は原則として午後3時までとし、それ以降の受付は翌営業日の取扱いになります（受付時間については、販売会社により異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社にご確認ください。）。一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。なお、委託会社自ら勧誘した受益者に対する支払いは、委託会社において行うものとします。

2024年11月5日以降は、原則として午後3時30分までとなる予定です。

（4） 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者に係る信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

（5） 反対者の買取請求権

信託契約の解約または重大な信託約款の変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、法令に基づき、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2023年7月19日から2024年7月16日までの財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ハッピーエイジング20】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第23期 2023年7月18日現在	第24期 2024年7月16日現在
資産の部		
流動資産		
預金	-	11,417,232
金銭信託	616,985,310	-
コール・ローン	-	926,214,357
投資信託受益証券	977,693,586	1,375,918,267
親投資信託受益証券	18,428,126,024	26,940,281,466
未収利息	-	253
流動資産合計	20,022,804,920	29,253,831,575
資産合計	20,022,804,920	29,253,831,575
負債の部		
流動負債		
未払解約金	19,762,550	22,552,222
未払受託者報酬	4,907,882	7,184,782
未払委託者報酬	139,383,749	204,047,752
その他未払費用	455,242	440,000
流動負債合計	164,509,423	234,224,756
負債合計	164,509,423	234,224,756
純資産の部		
元本等		
元本	8,886,578,673	9,811,741,893
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	10,971,716,824	19,207,864,926
元本等合計	19,858,295,497	29,019,606,819
純資産合計	19,858,295,497	29,019,606,819
負債純資産合計	20,022,804,920	29,253,831,575

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第23期		第24期	
	自	2022年7月16日 至 2023年7月18日	自	2023年7月19日 至 2024年7月16日
営業収益				
受取配当金		18,130,949		33,279,251
受取利息		-		20,515
有価証券売買等損益		3,692,164,410		7,014,833,215
為替差損益		1,677,316		144,099,279
営業収益合計		3,711,972,675		7,192,232,260
営業費用				
支払利息		267,080		111,293
受託者報酬		9,258,465		13,196,794
委託者報酬		262,940,166		374,788,879
その他費用		1,301,999		1,462,598
営業費用合計		273,767,710		389,559,564
営業利益又は営業損失（ ）		3,438,204,965		6,802,672,696
経常利益又は経常損失（ ）		3,438,204,965		6,802,672,696
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,438,204,965		6,802,672,696
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		180,158,597		468,752,386
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		6,751,436,645		10,971,716,824
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,959,474,491		3,692,230,885
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,959,474,491		3,692,230,885
剰余金減少額又は欠損金増加額		997,240,680		1,790,003,093
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		997,240,680		1,790,003,093
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		10,971,716,824		19,207,864,926

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	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。 計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年7月15日を計算期間の末日としておりますが、該日が休業日のため、前計算期間末日を2023年7月18日、当計算期間末日を2024年7月16日としております。

(貸借対照表に関する注記)

期別	第23期 2023年7月18日現在	第24期 2024年7月16日現在
1. 受益権の総数	8,886,578,673口	9,811,741,893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) 2.2346円 (22,346円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.9576円 (29,576円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第23期 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	第24期 自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	損保ジャパン・TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左
2. 分配金の計算過程	計算期間末における経費控除後の配当等収益(382,044,791円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(2,876,001,577円)、信託約款に規定される収益調整金(8,426,026,776円)及び分配準備積立金(3,105,494,611円)より分配対象収益は14,789,567,755円(1万口当たり16,642.57円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における経費控除後の配当等収益(529,222,482円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(5,804,697,828円)、信託約款に規定される収益調整金(10,865,718,970円)及び分配準備積立金(5,473,337,079円)より分配対象収益は22,672,976,359円(1万口当たり23,107.97円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第23期 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	第24期 自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左

項目	第23期		第24期	
	自	至	自	至
	2022年7月16日	2023年7月18日	2023年7月19日	2024年7月16日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。</p> <p>為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p>		同左	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>(2) 金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> <p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>		同左	
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>		同左	

金融商品の時価等に関する事項

項目	第23期		第24期	
	2023年7月18日現在		2024年7月16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>		同左	
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>		同左	

(関連当事者との取引に関する注記)

第23期 2023年7月18日現在	第24期 2024年7月16日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	第23期	第24期
	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
期首元本額	8,097,040,123円	8,886,578,673円
期中追加設定元本額	1,970,503,276円	2,341,971,835円
期中一部解約元本額	1,180,964,726円	1,416,808,615円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第23期	第24期
	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券	74,147,479	118,467,773
親投資信託受益証券	3,506,306,989	6,663,492,728
合計	3,580,454,468	6,781,960,501

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年7月16日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ドル	ISHARES CORE MSCI EMERGING	157,141	8,683,611.66	
	ドル	小計	157,141	8,683,611.66 (1,375,918,267)	
投資信託受益証券 合計			157,141	1,375,918,267 (1,375,918,267)	
親投資信託受益証券	日本円	損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド	1,659,586,222	9,507,105,631	
		損保ジャパン日本債券マザーファンド	420,343,406	568,430,387	
		損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド	810,471,324	1,710,580,776	
		S J A M ラージキャップ・バリュウ・マザーファンド	1,905,545,902	7,630,377,455	
		S J A M スモールキャップ・マザーファンド	1,473,518,844	7,523,787,217	
親投資信託受益証券 合計			6,269,465,698	26,940,281,466	
合計				28,316,199,733 (1,375,918,267)	

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

（注）１．通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額です。

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	有価証券の合計金額に対する比 率
ドル	投資信託受益証券 1銘柄	4.74%	4.86%

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング30】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第23期 2023年7月18日現在	第24期 2024年7月16日現在
資産の部		
流動資産		
預金	-	11,803,761
金銭信託	631,444,792	-
コール・ローン	-	765,546,315
投資信託受益証券	1,018,492,016	1,422,499,905
親投資信託受益証券	19,508,833,514	26,116,265,450
未収利息	-	209
流動資産合計	21,158,770,322	28,316,115,640
資産合計	21,158,770,322	28,316,115,640
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,104,507	17,943,840
未払受託者報酬	5,311,061	7,079,958
未払委託者報酬	138,087,512	184,078,732
その他未払費用	456,390	440,000
流動負債合計	148,959,470	209,542,530
負債合計	148,959,470	209,542,530
純資産の部		
元本等		
元本	10,090,264,553	10,663,389,153
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	10,919,546,299	17,443,183,957
元本等合計	21,009,810,852	28,106,573,110
純資産合計	21,009,810,852	28,106,573,110
負債純資産合計	21,158,770,322	28,316,115,640

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第23期		第24期	
	自	2022年7月16日 至 2023年7月18日	自	2023年7月19日 至 2024年7月16日
営業収益				
受取配当金		19,245,616		34,405,939
受取利息		-		18,507
有価証券売買等損益		3,131,552,714		5,935,329,483
為替差損益		1,354,969		149,603,977
営業収益合計		3,149,443,361		6,119,357,906
営業費用				
支払利息		298,800		110,588
受託者報酬		10,224,827		13,303,242
委託者報酬		265,845,328		345,884,217
その他費用		1,329,290		1,465,251
営業費用合計		277,698,245		360,763,298
営業利益又は営業損失()		2,871,745,116		5,758,594,608
経常利益又は経常損失()		2,871,745,116		5,758,594,608
当期純利益又は当期純損失()		2,871,745,116		5,758,594,608
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		87,161,927		286,807,613
期首剰余金又は期首欠損金()		7,553,444,287		10,919,546,299
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,278,012,575		2,224,753,489
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,278,012,575		2,224,753,489
剰余金減少額又は欠損金増加額		696,493,752		1,172,902,826
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		696,493,752		1,172,902,826
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		10,919,546,299		17,443,183,957

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	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。 計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年7月15日を計算期間の末日としておりますが、該日が休業日のため、前計算期間末日を2023年7月18日、当計算期間末日を2024年7月16日としております。

(貸借対照表に関する注記)

期別	第23期 2023年7月18日現在	第24期 2024年7月16日現在
1. 受益権の総数	10,090,264,553口	10,663,389,153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) 2.0822円 (20,822円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.6358円 (26,358円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第23期 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	第24期 自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	損保ジャパン・TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左
2. 分配金の計算過程	計算期間末における経費控除後の配当等収益(401,380,182円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(2,383,203,007円)、信託約款に規定される収益調整金(6,724,769,258円)及び分配準備積立金(4,163,699,011円)より分配対象収益は13,673,051,458円(1万口当たり13,550.71円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における経費控除後の配当等収益(526,902,687円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(4,944,884,308円)、信託約款に規定される収益調整金(8,186,574,706円)及び分配準備積立金(6,269,262,519円)より分配対象収益は19,927,624,220円(1万口当たり18,687.87円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第23期 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	第24期 自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左

項目	第23期		第24期	
	自	至	自	至
	2022年7月16日	2023年7月18日	2023年7月19日	2024年7月16日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。</p> <p>為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p>		同左	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>(2) 金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> <p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>		同左	
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>		同左	

金融商品の時価等に関する事項

項目	第23期		第24期	
	2023年7月18日現在		2024年7月16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>		同左	
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>		同左	

(関連当事者との取引に関する注記)

第23期 2023年7月18日現在	第24期 2024年7月16日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	第23期	第24期
	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
期首元本額	9,543,086,407円	10,090,264,553円
期中追加設定元本額	1,422,792,677円	1,642,553,667円
期中一部解約元本額	875,614,531円	1,069,429,067円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第23期	第24期
	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券	82,857,419	121,657,547
親投資信託受益証券	2,925,836,269	5,562,711,184
合計	3,008,693,688	5,684,368,731

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年7月16日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ドル	ISHARES CORE MSCI EMERGING	162,461	8,977,594.86	
	ドル	小計	162,461	8,977,594.86 (1,422,499,905)	
投資信託受益証券 合計			162,461	1,422,499,905 (1,422,499,905)	
親投資信託受益証券	日本円	損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド	1,027,309,512	5,885,045,270	
		損保ジャパン日本債券マザーファンド	1,635,553,092	2,211,758,446	
		損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド	2,627,920,560	5,546,489,133	
		S J A M ラージキャップ・バリュウ・マザーファンド	1,568,412,195	6,280,392,952	
		S J A M スモールキャップ・マザーファンド	1,212,804,475	6,192,579,649	
親投資信託受益証券 合計			8,071,999,834	26,116,265,450	
合計				27,538,765,355 (1,422,499,905)	

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

（注）1．通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額です。

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	有価証券の合計金額に対する比 率
ドル	投資信託受益証券 1銘柄	5.06%	5.17%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング40】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第23期 2023年7月18日現在	第24期 2024年7月16日現在
資産の部		
流動資産		
預金	-	12,759,549
金銭信託	635,168,280	-
コール・ローン	-	751,483,939
投資信託受益証券	1,246,062,113	1,537,684,388
親投資信託受益証券	22,865,458,239	27,948,878,723
未収利息	-	205
流動資産合計	24,746,688,632	30,250,806,804
資産合計	24,746,688,632	30,250,806,804
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,167,005	22,730,617
未払受託者報酬	6,386,225	7,745,233
未払委託者報酬	146,883,194	178,140,390
その他未払費用	457,216	440,000
流動負債合計	163,893,640	209,056,240
負債合計	163,893,640	209,056,240
純資産の部		
元本等		
元本	13,267,954,754	13,859,330,422
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	11,314,840,238	16,182,420,142
元本等合計	24,582,794,992	30,041,750,564
純資産合計	24,582,794,992	30,041,750,564
負債純資産合計	24,746,688,632	30,250,806,804

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第23期		第24期	
	自	2022年7月16日	自	2023年7月19日
	至	2023年7月18日	至	2024年7月16日
営業収益				
受取配当金		23,493,360		37,192,283
受取利息		-		19,728
有価証券売買等損益		2,603,171,148		4,429,726,385
為替差損益		2,487,296		173,520,575
営業収益合計		2,629,151,804		4,640,458,971
営業費用				
支払利息		363,216		119,026
受託者報酬		12,453,557		14,876,215
委託者報酬		286,431,654		342,152,856
その他費用		1,401,069		1,519,315
営業費用合計		300,649,496		358,667,412
営業利益又は営業損失()		2,328,502,308		4,281,791,559
経常利益又は経常損失()		2,328,502,308		4,281,791,559
当期純利益又は当期純損失()		2,328,502,308		4,281,791,559
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		74,846,221		231,739,158
期首剰余金又は期首欠損金()		8,575,953,121		11,314,840,238
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,374,702,371		2,092,054,202
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,374,702,371		2,092,054,202
剰余金減少額又は欠損金増加額		889,471,341		1,274,526,699
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		889,471,341		1,274,526,699
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		11,314,840,238		16,182,420,142

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	約定日基準で計上しております。 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。 計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年7月15日を計算期間の末日としておりますが、該日が休業日のため、前計算期間末日を2023年7月18日、当計算期間末日を2024年7月16日としております。

(貸借対照表に関する注記)

期別	第23期 2023年7月18日現在	第24期 2024年7月16日現在
1. 受益権の総数	13,267,954,754口	13,859,330,422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) 1.8528円 (18,528円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.1676円 (21,676円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第23期 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	第24期 自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	損保ジャパン・TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左
2. 分配金の計算過程	計算期間末における経費控除後の配当等収益(373,686,383円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(1,879,969,704円)、信託約款に規定される収益調整金(7,556,839,292円)及び分配準備積立金(3,671,141,807円)より分配対象収益は13,481,637,186円(1万口当たり10,161.02円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における経費控除後の配当等収益(458,767,043円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(3,591,285,358円)、信託約款に規定される収益調整金(8,773,718,643円)及び分配準備積立金(5,314,276,813円)より分配対象収益は18,138,047,857円(1万口当たり13,087.23円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第23期 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	第24期 自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左

項目	第23期		第24期	
	自	至	自	至
	2022年7月16日	2023年7月18日	2023年7月19日	2024年7月16日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。</p> <p>為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p>		同左	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>(2) 金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p> <p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>		同左	
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>		同左	

金融商品の時価等に関する事項

項目	第23期		第24期	
	2023年7月18日現在		2024年7月16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>		同左	
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>		同左	

(関連当事者との取引に関する注記)

第23期 2023年7月18日現在	第24期 2024年7月16日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	第23期	第24期
	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
期首元本額	12,701,846,625円	13,267,954,754円
期中追加設定元本額	1,879,507,225円	2,071,515,632円
期中一部解約元本額	1,313,399,096円	1,480,139,964円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第23期	第24期
	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券	95,929,650	116,035,901
親投資信託受益証券	2,320,749,314	3,973,232,860
合計	2,416,678,964	4,089,268,761

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年7月16日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ドル	ISHARES CORE MSCI EMERGING	175,616	9,704,540.16	
	ドル	小計	175,616	9,704,540.16 (1,537,684,388)	
投資信託受益証券 合計			175,616	1,537,684,388 (1,537,684,388)	
親投資信託受益証券	日本円	損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド	736,389,371	4,218,480,150	
		損保ジャパン日本債券マザーファンド	7,253,685,550	9,809,158,969	
		損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド	2,119,145,273	4,472,668,013	
		S J A M ラージキャップ・バリュウ・マザーファンド	1,188,101,327	4,757,514,143	
		S J A M スモールキャップ・マザーファンド	918,734,322	4,691,057,448	
親投資信託受益証券 合計			12,216,055,843	27,948,878,723	
合計				29,486,563,111 (1,537,684,388)	

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

（注）１．通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額です。

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	有価証券の合計金額に対する比 率
ドル	投資信託受益証券 1銘柄	5.12%	5.21%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング50】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第23期 2023年7月18日現在	第24期 2024年7月16日現在
資産の部		
流動資産		
預金	-	3,370,002
金銭信託	258,807,801	-
コール・ローン	-	272,024,125
投資信託受益証券	329,104,973	406,127,089
親投資信託受益証券	10,015,967,725	11,388,417,079
未収利息	-	74
流動資産合計	10,603,880,499	12,069,938,369
資産合計	10,603,880,499	12,069,938,369
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,994,352	8,802,411
未払受託者報酬	2,778,927	3,135,578
未払委託者報酬	54,466,887	61,457,213
その他未払費用	446,876	440,000
流動負債合計	69,687,042	73,835,202
負債合計	69,687,042	73,835,202
純資産の部		
元本等		
元本	6,593,168,889	6,918,181,950
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,941,024,568	5,077,921,217
元本等合計	10,534,193,457	11,996,103,167
純資産合計	10,534,193,457	11,996,103,167
負債純資産合計	10,603,880,499	12,069,938,369

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第23期		第24期	
	自	2022年7月16日	自	2023年7月19日
	至	2023年7月18日	至	2024年7月16日
営業収益				
受取配当金		5,936,672		9,823,078
受取利息		-		7,233
有価証券売買等損益		645,566,302		990,786,295
為替差損益		1,795,950		45,829,564
営業収益合計		653,298,924		1,046,446,170
営業費用				
支払利息		157,756		46,938
受託者報酬		5,474,179		6,121,535
委託者報酬		107,293,731		119,981,881
その他費用		1,082,864		1,105,706
営業費用合計		114,008,530		127,256,060
営業利益又は営業損失（ ）		539,290,394		919,190,110
経常利益又は経常損失（ ）		539,290,394		919,190,110
当期純利益又は当期純損失（ ）		539,290,394		919,190,110
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		17,768,146		60,527,052
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,248,270,709		3,941,024,568
剰余金増加額又は欠損金減少額		567,262,922		833,553,935
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		567,262,922		833,553,935
剰余金減少額又は欠損金増加額		396,031,311		555,320,344
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		396,031,311		555,320,344
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,941,024,568		5,077,921,217

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	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。 計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年7月15日を計算期間の末日としておりますが、該日が休業日のため、前計算期間末日を2023年7月18日、当計算期間末日を2024年7月16日としております。

(貸借対照表に関する注記)

期別	第23期 2023年7月18日現在	第24期 2024年7月16日現在
1. 受益権の総数	6,593,168,889口	6,918,181,950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) 1.5977円 (15,977円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7340円 (17,340円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第23期 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	第24期 自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	損保ジャパン・TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左
2. 分配金の計算過程	計算期間末における経費控除後の配当等収益(112,759,655円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(377,534,646円)、信託約款に規定される収益調整金(2,804,428,631円)及び分配準備積立金(943,546,551円)より分配対象収益は4,238,269,483円(1万口当たり6,428.25円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における経費控除後の配当等収益(135,702,568円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(722,960,490円)、信託約款に規定される収益調整金(3,198,664,622円)及び分配準備積立金(1,250,328,853円)より分配対象収益は5,307,656,533円(1万口当たり7,672.01円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第23期 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	第24期 自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左

項目	第23期		第24期	
	自	至	自	至
	2022年7月16日	2023年7月18日	2023年7月19日	2024年7月16日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。</p> <p>為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>		同左	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>		同左	
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>		同左	

金融商品の時価等に関する事項

項目	第23期		第24期	
	2023年7月18日現在		2024年7月16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>		同左	
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>		同左	

(関連当事者との取引に関する注記)

第23期 2023年7月18日現在	第24期 2024年7月16日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	第23期	第24期
	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
期首元本額	6,306,865,858円	6,593,168,889円
期中追加設定元本額	1,054,270,671円	1,247,809,424円
期中一部解約元本額	767,967,640円	922,796,363円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第23期	第24期
	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券	24,375,468	30,646,941
親投資信託受益証券	550,449,913	853,626,374
合計	574,825,381	884,273,315

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年7月16日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ドル	ISHARES CORE MSCI EMERGING	46,383	2,563,124.58	
	ドル	小計	46,383	2,563,124.58 (406,127,089)	
投資信託受益証券 合計			46,383	406,127,089 (406,127,089)	
親投資信託受益証券	日本円	損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド	168,591,313	965,792,195	
		損保ジャパン日本債券マザーファンド	5,019,827,718	6,788,313,023	
		損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド	622,627,337	1,314,117,257	
		S J A M ラージキャップ・バリュウ・マザーファンド	291,751,237	1,168,259,478	
		S J A M スモールキャップ・マザーファンド	225,604,216	1,151,935,126	
親投資信託受益証券 合計			6,328,401,821	11,388,417,079	
合計				11,794,544,168 (406,127,089)	

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

（注）１．通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額です。

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	有価証券の合計金額に対する比 率
ドル	投資信託受益証券 1銘柄	3.39%	3.44%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ハッピーエイジング60】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第23期 2023年7月18日現在	第24期 2024年7月16日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	153,935,839	-
コール・ローン	-	122,077,241
親投資信託受益証券	5,281,138,374	5,582,264,078
未収利息	-	33
流動資産合計	5,435,074,213	5,704,341,352
資産合計	5,435,074,213	5,704,341,352
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,627,093	10,927,350
未払受託者報酬	1,483,569	1,523,727
未払委託者報酬	24,033,741	24,684,358
その他未払費用	404,159	348,542
流動負債合計	27,548,562	37,483,977
負債合計	27,548,562	37,483,977
純資産の部		
元本等		
元本	4,070,613,773	4,171,627,877
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,336,911,878	1,495,229,498
元本等合計	5,407,525,651	5,666,857,375
純資産合計	5,407,525,651	5,666,857,375
負債純資産合計	5,435,074,213	5,704,341,352

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第23期		第24期	
	自	2022年7月16日	自	2023年7月19日
	至	2023年7月18日	至	2024年7月16日
営業収益				
受取利息		-		3,426
有価証券売買等損益		89,756,107		177,015,704
営業収益合計		89,756,107		177,019,130
営業費用				
支払利息		77,522		21,734
受託者報酬		2,989,897		3,033,317
委託者報酬		48,436,115		49,139,682
その他費用		871,161		830,616
営業費用合計		52,374,695		53,025,349
営業利益又は営業損失（ ）		37,381,412		123,993,781
経常利益又は経常損失（ ）		37,381,412		123,993,781
当期純利益又は当期純損失（ ）		37,381,412		123,993,781
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		4,558,540		10,422,194
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,313,993,002		1,336,911,878
剰余金増加額又は欠損金減少額		203,027,654		260,476,559
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		203,027,654		260,476,559
剰余金減少額又は欠損金増加額		222,048,730		215,730,526
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		222,048,730		215,730,526
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,336,911,878		1,495,229,498

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年7月15日を計算期間の末日としておりますが、該日が休業日のため、前計算期間末日を2023年7月18日、当計算期間末日を2024年7月16日としております。

(貸借対照表に関する注記)

期別	第23期 2023年7月18日現在	第24期 2024年7月16日現在
1. 受益権の総数	4,070,613,773口	4,171,627,877口
2. 計算期間の末日における1口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) 1.3284円 (13,284円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3584円 (13,584円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第23期 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	第24期 自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	損保ジャパン・TCW外国株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の8.2以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	同左
2. 分配金の計算過程	計算期間末における経費控除後の配当等収益(25,478,763円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,085,016,359円)及び分配準備積立金(226,416,756円)より分配対象収益は1,336,911,878円(1万口当たり3,284.28円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における経費控除後の配当等収益(42,362,304円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(35,646,702円)、信託約款に規定される収益調整金(1,202,213,521円)及び分配準備積立金(215,006,971円)より分配対象収益は1,495,229,498円(1万口当たり3,584.26円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第23期 自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	第24期 自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は(有価証券に関する注記)に記載しております。 (2) 金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左

項目	第23期		第24期	
	自	至	自	至
	2022年7月16日	2023年7月18日	2023年7月19日	2024年7月16日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。		同左	
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。		同左	

金融商品の時価等に関する事項

項目	第23期		第24期	
	2023年7月18日現在		2024年7月16日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		同左	
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。		同左	

(関連当事者との取引に関する注記)

第23期	第24期
2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

項目	第23期		第24期	
	自	至	自	至
	2022年7月16日	2023年7月18日	2023年7月19日	2024年7月16日
期首元本額	4,116,323,762円		4,070,613,773円	
期中追加設定元本額	651,604,071円		755,947,672円	
期中一部解約元本額	697,314,060円		654,933,568円	

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第23期		第24期	
	2023年7月18日現在		2024年7月16日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額（円）		当期の損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	73,028,236		145,056,987	

合計	73,028,236	145,056,987
----	------------	-------------

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年7月16日現在

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド	20,101,075	115,151,018	
	損保ジャパン日本債券マザーファンド	3,024,133,869	4,089,536,231	
	損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド	431,940,396	911,653,399	
	S J A Mラージキャップ・バリュース・マザーファンド	58,586,582	234,598,250	
	S J A Mスモールキャップ・マザーファンド	45,304,579	231,325,180	
合計		3,580,066,501	5,582,264,078	

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

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

*なお、以下は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

S J A Mラージキャップ・バリュース・マザーファンド

貸借対照表

科 目	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	357,412,727	-
コール・ローン	-	501,719,323
株式	32,929,236,960	35,563,150,100
未収配当金	41,828,400	62,289,900
未収利息	-	137
流動資産合計	33,328,478,087	36,127,159,460
資産合計	33,328,478,087	36,127,159,460
負債の部		
流動負債		
その他未払費用	11,074	-
流動負債合計	11,074	-

科 目	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
	金額（円）	金額（円）
負債合計	11,074	-
純資産の部		
元本等		
元本	11,254,715,997	9,022,046,761
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	22,073,751,016	27,105,112,699
元本等合計	33,328,467,013	36,127,159,460
純資産合計	33,328,467,013	36,127,159,460
負債純資産合計	33,328,478,087	36,127,159,460

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

期別	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
1. 受益権の総数	11,254,715,997口	9,022,046,761口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.9613円 (1万口当たり純資産額) (29,613円)	1口当たり純資産額 4.0043円 (1万口当たり純資産額) (40,043円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	（1）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。 （2）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16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	17,267,476,729円	11,254,715,997円
同期中追加設定元本額	1,099,872,896円	712,048,082円
同期中一部解約元本額	7,112,633,628円	2,944,717,318円
元本の内訳*		
損保ジャパン日本興亜ラージキャップ・バリュー・ファンド(F o F s 用)(適格機関投資家専用)	5,900,357,943円	3,647,753,455円
ハッピーエイジング20	1,746,410,960円	1,905,545,902円
ハッピーエイジング30	1,561,113,070円	1,568,412,195円
ハッピーエイジング40	1,291,251,930円	1,188,101,327円
ハッピーエイジング50	339,902,027円	291,751,237円
ハッピーエイジング60	72,457,936円	58,586,582円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	161,161,419円	155,356,374円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	98,385,486円	105,542,418円

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	72,945,879円	79,580,445円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	10,445,037円	21,020,447円
SOMPO世界分散ファンド(安定型)<DC年金>	103,287円	83,460円
SOMPO世界分散ファンド(安定成長型)<DC年金>	74,357円	117,275円
SOMPO世界分散ファンド(成長型)<DC年金>	106,666円	195,644円
計	11,254,715,997円	9,022,046,761円

*当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	2,842,680,198	3,059,402,203
合計	2,842,680,198	3,059,402,203

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

(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。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年7月16日現在

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
大林組	651,900	2,002.00	1,305,103,800	
清水建設	876,700	930.80	816,032,360	
日揮ホールディングス	518,500	1,268.50	657,717,250	
日本ハム	77,500	4,890.00	378,975,000	
麒麟ホールディングス	458,800	2,108.00	967,150,400	
東レ	1,720,900	757.00	1,302,721,300	
王子ホールディングス	1,840,200	616.50	1,134,483,300	
旭化成	965,600	1,044.00	1,008,086,400	
エア・ウォーター	117,000	2,174.00	254,358,000	
武田薬品工業	134,300	4,240.00	569,432,000	
サイグループホールディングス	86,900	6,640.00	577,016,000	
A G C	43,700	5,263.00	229,993,100	
住友金属鉱山	119,400	5,108.00	609,895,200	
住友電気工業	97,700	2,478.50	242,149,450	
リンナイ	119,600	3,689.00	441,204,400	
ナブテスコ	136,700	2,814.50	384,742,150	
住友重機械工業	191,300	4,262.00	815,320,600	
日本精工	1,236,500	818.40	1,011,951,600	

THK	92,600	3,060.00	283,356,000	
マキタ	246,800	4,788.00	1,181,678,400	
パナソニック ホールディングス	693,900	1,306.00	906,233,400	
スタンレー電気	244,700	2,858.00	699,352,600	
ローム	154,300	2,385.00	368,005,500	
京セラ	457,100	1,967.50	899,344,250	
太陽誘電	291,000	5,037.00	1,465,767,000	
アイシン	103,400	5,352.00	553,396,800	
本田技研工業	804,800	1,705.00	1,372,184,000	
大阪瓦斯	186,100	3,445.00	641,114,500	
東日本旅客鉄道	212,200	2,686.50	570,075,300	
ヤマトホールディングス	472,400	1,822.00	860,712,800	
NIPPON EXPRESSホールディン	144,600	7,215.00	1,043,289,000	
日本テレビホールディングス	85,800	2,474.00	212,269,200	
日本電信電話	9,079,300	157.20	1,427,265,960	
スズケン	61,500	5,148.00	316,602,000	
めぶきフィナンシャルグループ	1,630,500	605.90	987,919,950	
ゆうちょ銀行	450,800	1,552.50	699,867,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	364,700	929.70	339,061,590	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	799,100	1,777.00	1,420,000,700	
三井住友トラスト・ホールディングス	334,400	3,844.00	1,285,433,600	
三井住友フィナンシャルグループ	135,700	11,010.00	1,494,057,000	
八十二銀行	1,157,200	1,049.00	1,213,902,800	
第一生命ホールディングス	99,200	4,642.00	460,486,400	
三菱地所	570,600	2,613.00	1,490,977,800	
総合警備保障	701,800	946.80	664,464,240	
合計	28,967,700		35,563,150,100	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

貸借対照表

	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	148,633,105	-

科 目	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
	金額（円）	金額（円）
コール・ローン	-	196,320,582
株式	15,712,176,330	21,001,603,600
未収配当金	25,535,900	38,877,100
未収利息	-	53
流動資産合計	15,886,345,335	21,236,801,335
資産合計	15,886,345,335	21,236,801,335
負債の部		
流動負債		
その他未払費用	9,389	-
流動負債合計	9,389	-
負債合計	9,389	-
純資産の部		
元本等		
元本	4,365,939,040	4,159,185,410
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	11,520,396,906	17,077,615,925
元本等合計	15,886,335,946	21,236,801,335
純資産合計	15,886,335,946	21,236,801,335
負債純資産合計	15,886,345,335	21,236,801,335

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

期別	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
1．受益権の総数	4,365,939,040口	4,159,185,410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 3.6387円 (1万口当たり純資産額) (36,387円)	1口当たり純資産額 5.1060円 (1万口当たり純資産額) (51,060円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	（1）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。 （2）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役会に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16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	4,638,855,031円	4,365,939,040円
同期中追加設定元本額	383,098,782円	325,157,743円
同期中一部解約元本額	656,014,773円	531,911,373円
元本の内訳*		
ハッピーエイジング20	1,413,683,642円	1,473,518,844円
ハッピーエイジング30	1,276,967,744円	1,212,804,475円
ハッピーエイジング40	1,056,142,733円	918,734,322円
ハッピーエイジング50	278,007,117円	225,604,216円
ハッピーエイジング60	60,437,784円	45,304,579円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	131,824,018円	123,490,902円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	80,473,334円	81,501,076円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	59,662,074円	61,451,949円

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	8,513,066円	16,467,994円
SOMPO世界分散ファンド(安定型)<DC年金>	81,269円	65,543円
SOMPO世界分散ファンド(安定成長型)<DC年金>	59,501円	90,138円
SOMPO世界分散ファンド(成長型)<DC年金>	86,758円	151,372円
計	4,365,939,040円	4,159,185,410円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	2,642,040,417	1,993,101,693
合計	2,642,040,417	1,993,101,693

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年7月16日現在

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
森永乳業	187,200	3,451.00	646,027,200	
雪印メグミルク	18,800	2,684.00	50,459,200	
東洋紡	192,600	1,041.00	200,496,600	
大王製紙	94,600	891.50	84,335,900	
レンゴー	93,800	1,004.00	94,175,200	
ザ・パック	54,700	3,980.00	217,706,000	
住友精化	41,300	5,460.00	225,498,000	
クレハ	17,000	2,871.00	48,807,000	
東亜合成	214,400	1,536.00	329,318,400	
デンカ	28,100	2,149.50	60,400,950	
日本触媒	223,300	1,646.50	367,663,450	
カネカ	28,400	4,277.00	121,466,800	
KHネオケム	14,000	2,264.00	31,696,000	
日本ゼオン	124,300	1,360.00	169,048,000	
日本化薬	170,400	1,273.00	216,919,200	
三洋化成工業	46,600	4,105.00	191,293,000	
DIC	75,200	3,002.00	225,750,400	
artience	19,400	3,315.00	64,311,000	
マンダム	143,400	1,224.00	175,521,600	

タカラバイオ	185,200	1,174.00	217,424,800
エフピコ	38,100	2,443.00	93,078,300
日本新薬	74,300	3,489.00	259,232,700
東和薬品	9,300	3,035.00	28,225,500
杏林製薬	219,300	1,705.00	373,906,500
サワイグループホールディングス	96,000	6,640.00	637,440,000
共英製鋼	15,000	2,142.00	32,130,000
東プレ	117,000	2,236.00	261,612,000
オーエスジー	75,400	2,039.50	153,778,300
ジェイテクト	474,700	1,115.50	529,527,850
不二越	58,100	3,340.00	194,054,000
スター精密	111,000	2,150.00	238,650,000
マブチモーター	187,700	2,354.00	441,845,800
E I Z O	98,500	4,930.00	485,605,000
アンリツ	46,400	1,266.00	58,742,400
富士通ゼネラル	144,400	2,134.00	308,149,600
コーセル	142,900	1,279.00	182,769,100
イリソ電子工業	68,800	3,160.00	217,408,000
カシオ計算機	47,200	1,220.50	57,607,600
ニチコン	47,100	1,210.00	56,991,000
市光工業	368,100	513.00	188,835,300
トヨタ紡織	56,400	2,136.50	120,498,600
ユニプレス	18,800	1,366.00	25,680,800
豊田合成	78,700	2,797.00	220,123,900
テイ・エス テック	14,000	1,978.00	27,692,000
シチズン時計	46,400	1,070.00	49,648,000
メニコン	38,400	1,370.00	52,608,000
福山通運	7,400	4,025.00	29,785,000
テレビ朝日ホールディングス	274,800	2,182.00	599,613,600
第一興商	124,300	1,682.00	209,072,600
日本ライフライン	379,800	1,167.00	443,226,600
シークス	156,300	1,301.00	203,346,300
P A L T A C	10,400	4,283.00	44,543,200
トラスコ中山	150,700	2,472.00	372,530,400
スズケン	17,300	5,148.00	89,060,400
セリア	189,800	3,100.00	588,380,000
アルペン	17,100	2,098.00	35,875,800
ドトール・日レスホールディングス	18,900	2,244.00	42,411,600
ユナイテッドアローズ	114,900	2,139.00	245,771,100
コメリ	58,400	3,530.00	206,152,000
青山商事	101,200	1,511.00	152,913,200
イズミ	64,600	3,425.00	221,255,000
平和堂	45,500	2,387.00	108,608,500

ゼビオホールディングス	216,400	1,168.00	252,755,200	
ケーズホールディングス	434,000	1,579.50	685,503,000	
パローホールディングス	9,300	2,423.00	22,533,900	
いよぎんホールディングス	251,000	1,547.00	388,297,000	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	372,700	1,679.00	625,763,300	
西日本フィナンシャルホールディングス	311,800	2,046.00	637,942,800	
第四北越フィナンシャルグループ	122,500	5,210.00	638,225,000	
ひろぎんホールディングス	314,200	1,212.50	380,967,500	
群馬銀行	341,600	1,020.00	348,432,000	
滋賀銀行	94,900	4,165.00	395,258,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	338,100	2,035.50	688,202,550	
山陰合同銀行	321,000	1,434.00	460,314,000	
北洋銀行	1,119,900	517.00	578,988,300	
パーク24	76,000	1,590.00	120,840,000	
ゴールドクレスト	18,600	2,750.00	51,150,000	
日本M&Aセンターホールディングス	411,500	914.60	376,357,900	
総合警備保障	480,500	946.80	454,937,400	
H.U.グループホールディングス	64,700	2,531.00	163,755,700	
ビー・エム・エル	37,000	3,040.00	112,480,000	
エン・ジャパン	161,500	2,644.00	427,006,000	
ベルシステム24ホールディングス	120,800	1,517.00	183,253,600	
ソラスト	442,300	485.00	214,515,500	
カナモト	58,600	2,857.00	167,420,200	
合計	12,515,000		21,001,603,600	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

損保ジャパン日本債券マザーファンド

貸借対照表

科 目	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	399,756,680	-
コール・ローン	-	271,203,645
国債証券	22,165,196,800	22,069,977,500
地方債証券	990,722,000	680,001,000
特殊債券	855,042,904	836,571,006

科 目	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
	金額（円）	金額（円）
社債券	3,574,911,000	8,217,770,000
未収利息	31,737,353	51,810,504
前払費用	2,946,488	2,219,065
流動資産合計	28,020,313,225	32,129,552,720
資産合計	28,020,313,225	32,129,552,720
負債の部		
流動負債		
その他未払費用	12,219	-
流動負債合計	12,219	-
負債合計	12,219	-
純資産の部		
元本等		
元本	20,014,367,959	23,758,563,820
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,005,933,047	8,370,988,900
元本等合計	28,020,301,006	32,129,552,720
純資産合計	28,020,301,006	32,129,552,720
負債純資産合計	28,020,313,225	32,129,552,720

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7月18日現在	2024年7月16日現在
1．受益権の総数	20,014,367,959口	23,758,563,820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 1.4000円 (1万口当たり純資産額) (14,000円)	1口当たり純資産額 1.3523円 (1万口当たり純資産額) (13,523円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>（1）金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>（2）金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>	同左

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16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	17,116,439,892円	20,014,367,959円
同期中追加設定元本額	4,167,154,478円	5,107,910,940円
同期中一部解約元本額	1,269,226,411円	1,363,715,079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）	175,546,001円	- 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）	29,504,992円	15,956,153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	40,649,581円
損保ジャパン国内債券ファンド（適格機関投資家専用）	2,018,765,203円	2,039,461,231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	407,743,908円
損保ジャパン日本債券ファンド	987,722,964円	954,874,767円

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
ハッピーエイジング20	279,458,435円	420,343,406円
ハッピーエイジング30	1,193,294,452円	1,635,553,092円
ハッピーエイジング40	5,778,688,836円	7,253,685,550円
ハッピーエイジング50	4,286,893,538円	5,019,827,718円
ハッピーエイジング60	2,771,676,289円	3,024,133,869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	105,844,335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	13,146,595円	- 円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド203 5	1,271,679,781円	1,860,032,520円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド204 5	442,556,466円	690,969,059円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド205 5	157,761,650円	268,461,655円
ターゲット・リターン戦略ファンド	147,650,347円	- 円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド206 5	6,576,522円	18,217,588円
SOMPO世界分散ファンド（安定型）<DC 年金>	1,937,127円	1,866,012円
SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）< DC年金>	407,277円	612,414円
SOMPO世界分散ファンド（成長型）<DC 年金>	207,059円	330,962円
計	20,014,367,959円	23,758,563,820円

*当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）
国債証券	210,323,700	838,319,300
地方債証券	12,764,000	8,906,000
特殊債証券	8,655,589	13,599,999
社債証券	16,148,000	72,462,000
合計	247,891,289	933,287,299

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2024年7月16日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	第455回利付国債（2年）	200,000,000	199,506,000	
	第458回利付国債（2年）	100,000,000	99,927,000	
	第459回利付国債（2年）	1,050,000,000	1,048,834,500	

第460回利付国債(2年)	350,000,000	350,122,500	
第147回利付国債(5年)	650,000,000	647,504,000	
第156回利付国債(5年)	500,000,000	496,615,000	
第165回利付国債(5年)	850,000,000	842,630,500	
第166回利付国債(5年)	480,000,000	477,916,800	
第167回利付国債(5年)	700,000,000	695,849,000	
第10回利付国債(40年)	170,000,000	118,109,200	
第11回利付国債(40年)	20,000,000	13,227,600	
第14回利付国債(40年)	160,000,000	96,667,200	
第15回利付国債(40年)	280,000,000	187,082,000	
第350回利付国債(10年)	100,000,000	98,824,000	
第351回利付国債(10年)	450,000,000	443,920,500	
第352回利付国債(10年)	850,000,000	837,284,000	
第353回利付国債(10年)	450,000,000	442,201,500	
第358回利付国債(10年)	740,000,000	719,894,200	
第360回利付国債(10年)	660,000,000	639,196,800	
第362回利付国債(10年)	10,000,000	9,629,700	
第363回利付国債(10年)	200,000,000	191,946,000	
第364回利付国債(10年)	900,000,000	860,733,000	
第366回利付国債(10年)	540,000,000	516,947,400	
第367回利付国債(10年)	970,000,000	925,234,500	
第368回利付国債(10年)	150,000,000	142,599,000	
第369回利付国債(10年)	150,000,000	145,698,000	
第371回利付国債(10年)	950,000,000	908,874,500	
第373回利付国債(10年)	1,060,000,000	1,025,232,000	
第38回利付国債(30年)	100,000,000	100,280,000	
第43回利付国債(30年)	240,000,000	233,736,000	
第49回利付国債(30年)	160,000,000	145,382,400	
第53回利付国債(30年)	250,000,000	188,512,500	
第55回利付国債(30年)	50,000,000	39,183,000	
第58回利付国債(30年)	300,000,000	232,089,000	
第60回利付国債(30年)	510,000,000	400,926,300	
第61回利付国債(30年)	310,000,000	230,618,300	
第67回利付国債(30年)	200,000,000	140,666,000	
第71回利付国債(30年)	90,000,000	63,877,500	
第72回利付国債(30年)	100,000,000	70,699,000	
第74回利付国債(30年)	100,000,000	76,401,000	
第75回利付国債(30年)	180,000,000	148,383,000	
第76回利付国債(30年)	790,000,000	666,159,600	
第77回利付国債(30年)	180,000,000	159,161,400	
第80回利付国債(30年)	80,000,000	73,853,600	
第113回利付国債(20年)	180,000,000	194,094,000	
第130回利付国債(20年)	10,000,000	10,751,800	

	第131回利付国債(20年)	30,000,000	32,050,200
	第148回利付国債(20年)	50,000,000	52,343,500
	第149回利付国債(20年)	40,000,000	41,805,600
	第150回利付国債(20年)	320,000,000	330,752,000
	第151回利付国債(20年)	160,000,000	161,875,200
	第152回利付国債(20年)	70,000,000	70,634,900
	第154回利付国債(20年)	580,000,000	582,291,000
	第159回利付国債(20年)	150,000,000	138,174,000
	第162回利付国債(20年)	100,000,000	90,897,000
	第166回利付国債(20年)	510,000,000	460,948,200
	第167回利付国債(20年)	310,000,000	270,822,200
	第168回利付国債(20年)	510,000,000	436,488,600
	第169回利付国債(20年)	180,000,000	150,805,800
	第170回利付国債(20年)	240,000,000	199,944,000
	第171回利付国債(20年)	200,000,000	165,576,000
	第176回利付国債(20年)	800,000,000	666,192,000
	第182回利付国債(20年)	730,000,000	655,963,400
	第183回利付国債(20年)	1,000,000,000	942,040,000
	第184回利付国債(20年)	70,000,000	62,409,900
	第187回利付国債(20年)	220,000,000	200,983,200
国債証券 合計		23,790,000,000	22,069,977,500
地方債証券	第807回東京都公募公債	400,000,000	386,792,000
	令和2年度第10回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	193,432,000
	第15回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	99,777,000
地方債証券 合計		700,000,000	680,001,000
特殊債券	第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	300,000,000	307,338,000
	第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	400,000,000	399,968,000
	第78回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	80,638,000
	第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,579,000	17,037,409
	第65回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,404,000	31,589,597
特殊債券 合計		847,983,000	836,571,006
社債券	第1回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債(劣後特約付)	100,000,000	100,405,000
	第17回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付非	100,000,000	99,390,000
	第15回クレディ・アグリコル・エス・エー期限前償還条項付非上	300,000,000	299,568,000
	第10回ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー期限前償還	100,000,000	100,477,000
	第1回アサヒホールディングス株式会社利払繰延条項・期限前	200,000,000	200,160,000
	第2回不二製油グループ本社株式会社利払繰延条項・期限前償還条	100,000,000	99,660,000
	第1回帝人株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債	100,000,000	95,949,000
	第3回日本酸素ホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定)	300,000,000	298,401,000

第1回武田薬品工業株式会社無担保社債(劣後特約付)FR	200,000,000	200,370,000	
第2回武田薬品工業株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担	300,000,000	299,994,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	300,000,000	298,590,000	
第11回住友三井オートサービス株式会社無担保社債(社債間限定)	300,000,000	297,042,000	
E N E O Sホールディングス株式会社第1回利払繰延条項・期限前	200,000,000	197,596,000	
第4回E N E O Sホールディングス株式会社利払繰延条項・期限前	200,000,000	198,746,000	
日本製鉄株式会社第1回無担保社債(劣後特約付)FR	100,000,000	99,990,000	
第1回ジェイエフイーホールディングス無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	195,478,000	
第1回パナソニック株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担	200,000,000	197,878,000	
第2回パナソニック株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担	100,000,000	97,267,000	
第24回パナソニックホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	300,000,000	297,795,000	
第27回J A三井リース株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	300,000,000	298,008,000	
第3回株式会社かんぼ生命保険利払繰延条項・期限前償還条項付無担	200,000,000	195,682,000	
第4回株式会社かんぼ生命保険利払繰延条項・期限前償還条項付無担	100,000,000	98,258,000	
第1回ニプロ利払繰延条項・期限前償還条項付無担	100,000,000	99,683,000	
第24回イオン株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	197,590,000	
第17回NTTファイナンス株式会社無担保社債(日本電信電話保)	200,000,000	197,192,000	
第40回東京センチュリー株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	99,135,000	
第27回S B Iホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定)	200,000,000	200,078,000	
第37回S B Iホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定)	300,000,000	298,035,000	
第1回オリックス株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保	100,000,000	99,754,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	200,000,000	197,808,000	
第2回株式会社T & Dホールディングス無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	99,905,000	
第6回東日本旅客鉄道株式会社サステナビリティボンド・無担保普	100,000,000	96,745,000	
第30回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	200,000,000	206,344,000	
第1回株式会社商船三井利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	100,000,000	100,648,000	
第1回関西電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	200,000,000	198,164,000	
第562回関西電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	194,052,000	
第1回中国電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	100,000,000	91,742,000	
第1回東北電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	200,000,000	201,530,000	
第1回九州電力株式会社利払繰延条項・期限前	200,000,000	200,036,000	

第65回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	198,024,000	
第22回株式会社JERA無担保社債（社債間限定同順位特約付）	300,000,000	298,560,000	
第5回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債（社債間）	200,000,000	194,474,000	
第3回第一生命ホールディングス永久社債（劣後特約付）	200,000,000	186,242,000	
第3回A号富国生命劣後FR	200,000,000	197,024,000	
大樹生命保険株式会社第1回利払繰延条項・期限前	100,000,000	98,301,000	
社債券 合計	8,300,000,000	8,217,770,000	
合計		31,804,319,506	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

損保ジャパン外国債券（為替ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

科 目	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	73,350,438	80,701,047
金銭信託	22,744,682	-
コール・ローン	-	79,037,999
国債証券	12,326,266,829	15,735,642,487
派生商品評価勘定	-	1,049,180
未収利息	79,941,862	102,373,304
前払費用	32,926,826	34,725,856
流動資産合計	12,535,230,637	16,033,529,873
資産合計	12,535,230,637	16,033,529,873
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,061,724
その他未払費用	3,034	-
流動負債合計	3,034	1,061,724
負債合計	3,034	1,061,724
純資産の部		
元本等		
元本	6,874,125,125	7,596,095,620
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,661,102,478	8,436,372,529
元本等合計	12,535,227,603	16,032,468,149
純資産合計	12,535,227,603	16,032,468,149
負債純資産合計	12,535,230,637	16,033,529,873

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

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。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。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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。
4. 費用・収益の計上基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における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。
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

期別	2023年7月18日現在		2024年7月16日現在	
1. 受益権の総数	6,874,125,125口		7,596,095,620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)	1.8235円 (18,235円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1106円 (21,106円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p data-bbox="544 1167 986 1193">(1) 金融商品の内容</p> <p data-bbox="544 1200 986 1328">当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p data-bbox="544 1335 986 1395">また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。</p> <p data-bbox="544 1402 986 1462">為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p data-bbox="544 1469 986 1496">(2) 金融商品に係るリスク</p> <p data-bbox="544 1503 986 1599">当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>	

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。

(関連当事者との取引に関する注記)

2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16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	6,017,631,324円	6,874,125,125円
同期中追加設定元本額	1,100,681,132円	1,154,589,902円
同期中一部解約元本額	244,187,331円	432,619,407円
元本の内訳*		
S N A M絶対収益ターゲットファンド（適格機関投資家専用）	65,567,474円	- 円
ハッピーエイジング20	633,117,982円	810,471,324円
ハッピーエイジング30	2,252,688,094円	2,627,920,560円
ハッピーエイジング40	1,983,477,615円	2,119,145,273円
ハッピーエイジング50	624,716,025円	622,627,337円
ハッピーエイジング60	469,249,961円	431,940,396円

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
	損保ジャパン外国債券ファンド（為替ヘッジなし）	442,468,887円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	334,003,690円	435,928,085円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	42,753,152円	55,261,967円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	22,739,075円	29,529,840円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2065	2,771,964円	6,565,601円
SOMPO世界分散ファンド（安定型）＜DC年金＞	153,864円	245,945円
SOMPO世界分散ファンド（安定成長型）＜DC年金＞	105,153円	300,278円
SOMPO世界分散ファンド（成長型）＜DC年金＞	312,189円	901,282円
計	6,874,125,125円	7,596,095,620円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）
国債証券	521,848,450	111,436,382
合計	521,848,450	111,436,382

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年7月18日 現在				2024年7月16日 現在			
	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）
	うち1年 超				うち1年 超			
市場取引以外の取引 為替予約取引								
買建	-	-	-	-	653,679,200	-	652,617,476	1,061,724
ドル	-	-	-	-	653,679,200	-	652,617,476	1,061,724
売建	-	-	-	-	656,678,000	-	655,628,820	1,049,180
ユーロ	-	-	-	-	656,678,000	-	655,628,820	1,049,180
合計	-	-	-	-	1,310,357,200	-	1,308,246,296	12,544

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年7月16日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	ドル	Treasury 0.75 260331	7,550,000	7,083,728.53	
		Treasury 1.25 310815	1,020,000	838,631.25	
		Treasury 1.5 270131	200,000	186,601.56	
		Treasury 1.5 300215	30,000	26,067.18	
		Treasury 1.625 310515	20,000	17,003.90	
		Treasury 1.75 291115	950,000	844,089.83	
		Treasury 1.75 410815	2,730,000	1,831,872.64	
		Treasury 1.875 260630	40,000	38,092.18	
		Treasury 2.0 261115	30,000	28,441.40	
		Treasury 2.0 510815	1,160,000	705,878.11	
		Treasury 2.125 250515	6,630,000	6,476,991.99	
		Treasury 2.25 270215	1,460,000	1,387,399.22	
		Treasury 2.25 270815	100,000	94,296.87	
		Treasury 2.375 290515	10,000	9,230.46	
		Treasury 2.75 280215	9,880,000	9,402,981.25	
		Treasury 2.75 320815	50,000	45,074.21	
		Treasury 2.75 421115	485,000	376,519.13	
		Treasury 2.75 470815	440,000	324,964.06	
		Treasury 2.875 430515	620,000	487,692.96	
		Treasury 2.875 490515	1,040,000	777,968.75	
		Treasury 3.0 441115	500,000	395,488.28	
		Treasury 3.0 450515	75,000	59,041.99	
		Treasury 3.0 480215	1,340,000	1,033,422.65	
		Treasury 3.0 520815	320,000	243,962.49	
		Treasury 3.125 290831	100,000	95,312.50	
		Treasury 3.375 330515	340,000	319,002.34	
		Treasury 3.5 390215	195,000	177,686.13	
		Treasury 3.625 530515	20,000	17,250.00	
		Treasury 3.75 300531	1,030,000	1,008,434.37	
		Treasury 3.875 330815	240,000	233,690.62	
		Treasury 4.0 340215	3,020,000	2,966,206.25	
		Treasury 4.0 521115	10,000	9,234.37	
		Treasury 4.125 321115	10,000	9,951.17	
Treasury 4.125 530815	860,000	811,725.78			
Treasury 4.5 290531	2,290,000	2,327,928.12			

	Treasury 4.5 331115	120,000	122,512.50
	Treasury 4.625 310531	4,200,000	4,314,843.75
	Treasury 4.625 400215	220,000	226,161.71
	Treasury 4.75 531115	1,700,000	1,780,750.00
	Treasury 4.875 260531	3,790,000	3,815,612.09
	Treasury 6.125 271115	60,000	63,623.43
ドル 合計		54,885,000	51,015,366.02 (8,083,384,745)
カナダドル	CANADA 0.5 301201	1,570,000	1,315,726.81
	CANADA 3.5 451201	90,000	90,896.85
	CANADA 5.0 370601	130,000	150,907.06
	CANADA 5.75 290601	860,000	954,302.88
カナダドル 合計		2,650,000	2,511,833.60 (290,895,449)
メキシコペソ	MEXICO 8.5 290531	10,000,000	9,500,200.00
	MEXICO 8.5 381118	5,000,000	4,466,600.00
メキシコペソ 合計		15,000,000	13,966,800.00 (124,808,721)
ユーロ	AUSTRIA 0.75 261020	460,000	439,146.82
	AUSTRIA 3.8 620126	50,000	56,544.00
	AUSTRIA 4.15 370315	250,000	277,250.00
	BELGIUM 0.8 270622	460,000	434,700.00
	BELGIUM 3.0 340622	880,000	880,765.60
	BELGIUM 4.25 410328	155,000	172,716.50
	BELGIUM 5.0 350328	45,000	52,799.76
	BELGIUM 5.5 280328	100,000	109,458.80
	FINLAND 0.75 310415	360,000	314,629.92
	FRA 0.75 281125	100,000	91,490.00
	FRANCE 0.0 291125	90,000	77,438.34
	FRANCE 0.0 320525	10,000	7,958.39
	FRANCE 0.25 261125	2,460,000	2,312,523.00
	FRANCE 0.75 520525	1,070,000	555,698.08
	FRANCE 1.0 270525	100,000	94,915.40
	FRANCE 1.25 340525	330,000	279,379.65
	FRANCE 2.0 321125	980,000	909,582.10
	FRANCE 2.75 271025	720,000	717,072.48
	FRANCE 3.0 330525	50,000	49,939.70
	FRANCE 3.25 450525	110,000	106,947.94
	FRANCE 3.5 331125	380,000	393,528.00
	FRANCE 4.0 381025	250,000	269,930.00
	FRANCE 4.0 550425	320,000	346,060.80
	FRANCE 4.0 600425	280,000	305,447.52
	FRANCE 4.5 410425	40,000	45,760.00

FRANCE 5.5 290425	35,000	39,034.10
FRANCE 5.75 321025	265,000	317,794.62
GERMANY 0 310215	10,000	8,583.28
GERMANY 0.0 261009	10,000	9,430.00
GERMANY 0.0 310815	130,000	110,301.88
GERMANY 0.0 500815	980,000	499,447.20
GERMANY 0.25 290215	10,000	9,084.00
GERMANY 0.5 280215	10,000	9,337.35
GERMANY 1.7 320815	150,000	142,568.40
GERMANY 2.3 330215	400,000	396,680.00
GERMANY 2.5 460815	320,000	310,557.44
GERMANY 2.6 330815	810,000	821,412.09
GERMANY 4.0 370104	310,000	356,477.68
IRELAND 1.0 260515	310,000	299,681.96
IRELAND 2.0 450218	210,000	175,400.40
ITALY 0.95 320601	190,000	157,282.00
ITALY 2.0 251201	1,028,000	1,011,973.48
ITALY 2.2 270601	1,830,000	1,787,104.80
ITALY 2.45 330901	1,250,000	1,141,052.50
ITALY 2.7 470301	830,000	656,115.00
ITALY 2.8 281201	620,000	611,696.96
ITALY 2.8 670301	160,000	117,924.00
ITALY 3.25 460901	220,000	191,599.32
ITALY 4.0 370201	190,000	193,169.20
ITALY 4.75 440901	30,000	32,357.64
ITALY 5.0 400901	415,000	458,745.15
ITALY 7.25 261101	115,000	125,548.26
NETHERLANDS 0.5 260715	310,000	296,484.00
NETHERLANDS 2.5 330115	530,000	523,228.72
NETHERLANDS 2.75 470115	150,000	147,255.00
NETHERLANDS 4.0 370115	60,000	67,219.08
NETHERLANDS 5.5 280115	125,000	136,627.50
SPAIN 0.0 260131	10,000	9,543.37
SPAIN 0.0 280131	860,000	777,956.00
SPAIN 0.5 311031	2,470,000	2,074,822.23
SPAIN 1.5 270430	220,000	211,883.76
SPAIN 2.15 251031	360,000	355,590.72
SPAIN 3.45 660730	120,000	110,076.72
SPAIN 4.2 370131	120,000	130,288.80
SPAIN 4.7 410730	515,000	588,247.42
SPAIN 5.15 281031	55,000	60,046.47
SPAIN 5.75 320730	10,000	11,928.36
ユーロ 合計	26,803,000	24,793,239.66

ポンド	UK GILT 1.5 260722	580,000	550,089.40
	UK GILT 3.5 450122	390,000	334,932.00
	UK GILT 4.0 600122	340,000	307,700.00
	UK GILT 4.25 271207	90,000	90,665.40
	UK GILT 4.25 320607	480,000	489,240.00
	UK GILT 4.25 360307	269,000	270,152.15
	UK GILT 4.25 390907	380,000	373,692.00
	UK GILT 4.25 401207	100,000	97,700.00
	UK GILT 4.25 461207	321,000	306,118.66
	UK GILT 4.25 491207	160,000	151,888.00
	UK GILT 4.25 551207	70,000	66,157.00
	UK GILT 4.5 340907	125,000	128,810.12
	UK GILT 4.5 421207	70,000	69,909.00
	UK GILT 5.0 250307	200,000	200,300.00
	UK GILT 6.0 281207	260,000	281,490.30
	UK GILT 0.25 310731	290,000	225,013.55
	UK GILT 1.625 711022	100,000	45,970.00
ポンド 合計		4,225,000	3,989,827.58 (819,749,974)
スウェーデンクローナ	SWEDEN 2.5 250512	1,610,000	1,604,091.30
	SWEDEN 3.5 390330	400,000	465,248.00
スウェーデンクローナ 合計		2,010,000	2,069,339.30 (30,874,542)
ノルウェークローネ	NORWAY 1.375 300819	2,200,000	1,950,061.52
ノルウェークローネ 合計		2,200,000	1,950,061.52 (28,568,401)
デンマーククローネ	DENMARK 4.5 391115	1,460,000	1,797,230.80
デンマーククローネ 合計		1,460,000	1,797,230.80 (41,569,948)
ポーランドズロチ	POLAND 2.5 260725	2,000,000	1,901,820.00
ポーランドズロチ 合計		2,000,000	1,901,820.00 (77,085,899)
オーストラリアドル	AUSTRALIA 3.25 250421	370,000	366,839.65
	AUSTRALIA 3.75 370421	950,000	886,890.75
	AUSTRALIA 4.75 270421	790,000	804,239.59
オーストラリアドル 合計		2,110,000	2,057,969.99 (220,182,209)
シンガポールドル	SINGAPORE 2.875 290701	400,000	397,040.00
シンガポールドル 合計		400,000	397,040.00 (46,803,075)
マレーシアリングgit	MALAYSIA 3.733 280615	1,900,000	1,909,713.75
	MALAYSIA 4.059 240930	10,000	10,017.04
	MALAYSIA 5.248 280915	11,000	11,693.09

マレーシアリングット 合計		1,921,000	1,931,423.88 (65,451,706)
オフショア人民元	CGB 2.04 270225	10,000,000	10,051,204.00
	CGB 2.18 260815	12,000,000	12,108,678.00
	CGB 2.6 320901	7,000,000	7,176,135.40
	CGB 2.67 331125	9,500,000	9,764,257.70
	CGB 2.8 290324	6,000,000	6,202,498.20
	CGB 2.8 300325	7,500,000	7,772,559.00
	CGB 2.8 321115	11,000,000	11,444,853.20
	CGB 2.91 281014	4,000,000	4,146,710.00
	CGB 3.0 531015	5,500,000	6,074,283.60
オフショア人民元 合計		72,500,000	74,741,179.10 (1,627,698,450)
合計			15,735,642,487 (15,735,642,487)

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額です。

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額に対する比 率
ドル	国債証券 41銘柄	50.42%	51.37%
カナダドル	国債証券 4銘柄	1.81%	1.85%
メキシコペソ	国債証券 2銘柄	0.78%	0.79%
ユーロ	国債証券 67銘柄	26.69%	27.19%
ポンド	国債証券 17銘柄	5.11%	5.21%
スウェーデンクローナ	国債証券 2銘柄	0.19%	0.20%
ノルウェークローネ	国債証券 1銘柄	0.18%	0.18%
デンマーククローネ	国債証券 1銘柄	0.26%	0.26%
ポーランドズロチ	国債証券 1銘柄	0.48%	0.49%
オーストラリアドル	国債証券 3銘柄	1.37%	1.40%
シンガポールドル	国債証券 1銘柄	0.29%	0.30%
マレーシアリングット	国債証券 3銘柄	0.41%	0.42%
オフショア人民元	国債証券 9銘柄	10.15%	10.34%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド

貸借対照表

科 目	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	594,270,705	581,133,440
金銭信託	240,165,791	-
コール・ローン	-	415,041,953
株式	19,509,322,662	25,389,322,264
投資証券	842,860,303	1,237,530,658
未収配当金	17,221,681	22,344,091
未収利息	-	113
流動資産合計	21,203,841,142	27,645,372,519
資産合計	21,203,841,142	27,645,372,519
負債の部		
流動負債		
その他未払費用	6,525	-
流動負債合計	6,525	-
負債合計	6,525	-
純資産の部		
元本等		
元本	5,131,731,342	4,825,887,236
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	16,072,103,275	22,819,485,283
元本等合計	21,203,834,617	27,645,372,519
純資産合計	21,203,834,617	27,645,372,519
負債純資産合計	21,203,841,142	27,645,372,519

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。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ものが適当でないと認められた場合は、当該取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。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ものが適当でないと認められた場合は、当該取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</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。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7月18日現在		2024年7月16日現在	
1. 受益権の総数		5,131,731,342口		4,825,887,236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)	4.1319円 (41,319円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.7286円 (57,286円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は(有価証券に関する注記)に記載しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。 為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。 (2) 金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

項目	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

項目	自 2022年7月16日 至 2023年7月18日	自 2023年7月19日 至 2024年7月16日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	5,164,892,145円	5,131,731,342円
同期中追加設定元本額	557,930,295円	408,891,180円
同期中一部解約元本額	591,091,098円	714,735,286円
元本の内訳*		
損保ジャパン - T C W外国株式ファンド A コース（為替ヘッジあり）	649,704,029円	506,711,879円
損保ジャパン - T C W外国株式ファンド B コース（為替ヘッジなし）	733,851,921円	707,197,864円
ハッピーエイジング 2 0	1,589,287,285円	1,659,586,222円
ハッピーエイジング 3 0	1,079,652,915円	1,027,309,512円
ハッピーエイジング 4 0	845,047,445円	736,389,371円
ハッピーエイジング 5 0	207,413,232円	168,591,313円
ハッピーエイジング 6 0	26,774,515円	20,101,075円
計	5,131,731,342円	4,825,887,236円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年7月18日現在	2024年7月16日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	3,659,141,247	4,607,321,664
投資証券	46,124,044	78,977,560
合計	3,613,017,203	4,686,299,224

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第 1 有価証券明細表
(1) 株式

2024年7月16日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ドル	EXXON MOBIL CORP	11,415	115.21	1,315,122.15	
	BAKER HUGHES COMPANY	30,538	35.71	1,090,511.98	
	CONOCOPHILLIPS	666	114.57	76,303.62	

GE VERNOVA INC	3,667	177.44	650,672.48
MARATHON PETROLEUM CORP	647	166.71	107,861.37
NOV INC	4,586	19.20	88,051.20
RANGE RESOURCES CORP	2,407	34.84	83,859.88
SOUTHWESTERN ENERGY CO	7,140	6.96	49,694.40
CORTEVA INC	1,608	52.90	85,063.20
DUPONT DE NEMOURS INC	13,334	80.20	1,069,386.80
FREEMPORT-MCMORAN COPPER	22,788	50.42	1,148,970.96
LINDE PLC	6,971	438.18	3,054,552.78
AGCO CORP	653	98.78	64,503.34
ARCOSA INC	1,812	87.92	159,311.04
CARLISLE COS INC	133	430.91	57,311.03
GENERAL ELECTRIC CO.	12,700	159.56	2,026,412.00
HEICO CORP	17,031	225.17	3,834,870.27
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	12,763	70.01	893,537.63
MANITOWOC COMPANY INC	10,315	11.20	115,528.00
OTIS WORLDWIDE CORP	19,900	99.44	1,978,856.00
TEREX CORP	774	55.69	43,104.06
TRANSDIGM GROUP INC	1,729	1,241.94	2,147,314.26
WABTEC CORP	1,497	164.16	245,747.52
XYLEM INC	6,834	137.30	938,308.20
JACOBS SOLUTIONS INC	532	144.70	76,980.40
WASTE CONNECTIONS INC	21,307	179.99	3,835,046.93
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,048	87.03	91,207.44
FEDEX CORP	654	305.02	199,483.08
KIRBY CORP	1,028	123.79	127,256.12
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	1,725	44.32	76,452.00
UNITED PARCEL SERVICE-CLB	3,412	144.15	491,839.80
GENERAL MOTORS CO	21,304	49.30	1,050,287.20
DR HORTON INC	2,092	152.16	318,318.72
LENNAR CORP-CL A	12,078	159.18	1,922,576.04
PULTEGROUP INC	3,760	116.24	437,062.40
TAPESTRY INC	13,086	42.48	555,893.28
TOLL BROTHERS INC	5,255	123.48	648,887.40
DARDEN RESTAURANTS	234	143.27	33,525.18
HILTON GRAND VACATIONS INC	3,362	42.87	144,128.94
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	869	222.99	193,778.31
TRAVEL + LEISURE CO	1,967	47.24	92,921.08
WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC	4,715	74.59	351,691.85
ALPHABET, INC	16,703	188.19	3,143,337.57
COMCAST CORP-CL A	21,998	38.94	856,602.12
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	4,559	29.50	134,490.50

META PLATFORMS INC-CLASS A	2,882	496.16	1,429,933.12
THE WALT DISNEY CO.	12,799	96.87	1,239,839.13
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	35,448	100.09	3,547,990.32
AMAZON.COM INC	14,648	192.72	2,822,962.56
BEST BUY CO INC	4,503	85.50	385,006.50
DICKS SPORTING GOODS INC	6,321	215.52	1,362,301.92
EBAY INC	1,123	53.72	60,327.56
GAP INC	3,511	22.96	80,612.56
GUESS? INC	3,275	22.59	73,982.25
HOME DEPOT INC	2,481	358.46	889,339.26
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	890	1,042.41	927,744.90
ULTA BEAUTY INC	1,296	395.16	512,127.36
WILLIAMS SONOMA	582	154.87	90,134.34
COSTCO WHOLESALE CORP	1,642	848.73	1,393,614.66
DOLLAR TREE INC	825	103.83	85,659.75
SPROUTS FARMERS MARKET INC	1,358	83.84	113,854.72
TARGET CORP	6,428	151.30	972,556.40
PEPSICO INC	6,152	163.86	1,008,066.72
COTY INC-CL A	40,460	10.23	413,905.80
ACADIA HEALTHCARE CO INC	2,185	65.18	142,418.30
BOSTON SCIENTIFIC CORP	14,450	78.02	1,127,389.00
CENTENE CORP	9,156	66.00	604,296.00
DEXCOM INC	6,843	113.01	773,327.43
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	10,311	80.19	826,839.09
HENRY SCHEIN INC	1,006	65.84	66,235.04
INTUITIVE SURGICAL INC	2,427	437.25	1,061,205.75
MCKESSON HBOC INC	3,226	578.26	1,865,466.76
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,015	515.37	1,038,470.55
ABBVIE INC	7,041	168.03	1,183,099.23
AMGEN INC	4,261	330.15	1,406,769.15
DANAHER CORP	3,647	246.23	898,000.81
MERCK & CO. INC.	7,622	128.12	976,530.64
ZOETIS INC	5,321	177.98	947,031.58
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	62	1,775.67	110,091.54
JP MORGAN CHASE & CO	9,818	210.05	2,062,270.90
POPULAR INC	3,388	96.17	325,823.96
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,790	445.80	1,243,782.00
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	17,057	122.50	2,089,482.50
BANK OF NEW YORK CO INC	19,233	65.71	1,263,800.43
CORPAY INC	739	289.63	214,036.57
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,723	42.91	245,573.93
EVERCORE PARTNERS INC-CL A	408	236.39	96,447.12

FISERV INC	29,375	155.39	4,564,581.25
INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A	1,071	124.66	133,510.86
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	12,033	147.82	1,778,718.06
KKR & CO INC	3,878	114.96	445,814.88
MASTERCARD INC-CLASS A	5,594	444.00	2,483,736.00
MORGAN STANLEY	12,438	105.26	1,309,223.88
MSCI INC	4,393	501.50	2,203,089.50
ONEMAIN HOLDINGS INC	1,868	51.35	95,921.80
S&P GLOBAL INC	6,455	482.55	3,114,860.25
VISA INC-CLASS A SHARES	15,765	268.45	4,232,114.25
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,041	97.16	295,463.56
ASSURED GUARANTY LTD	966	81.13	78,371.58
METLIFE INC	18,130	74.43	1,349,415.90
ADOBE SYSTEMS INC	1,788	565.71	1,011,489.48
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	2,300	315.63	725,949.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	3,989	377.37	1,505,328.93
FAIR ISAAC CORP	1,161	1,590.03	1,846,024.83
GARTNER INC	1,838	455.02	836,326.76
INTL BUSINESS MACHINES CO	11,082	182.88	2,026,676.16
MICROSOFT CORP	17,136	453.96	7,779,058.56
ORACLE CORPORATION	10,194	143.07	1,458,455.58
PALO ALTO NETWORKS INC	3,054	340.91	1,041,139.14
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,963	559.15	1,097,611.45
SALESFORCE INC	6,504	252.86	1,644,601.44
SERVICENOW INC	3,300	767.85	2,533,905.00
SHOPIFY INC - CLASS A	10,735	64.21	689,294.35
SNOWFLAKE INC-CLASS A	2,078	133.72	277,870.16
AVNET INC	2,359	52.89	124,767.51
FLEX LTD	58,242	30.28	1,763,567.76
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,328	394.39	2,101,309.92
NETAPP INC	9,585	130.38	1,249,692.30
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	1,288	108.94	140,314.72
AES CORP	52,252	17.00	888,284.00
NISOURCE INC	35,197	29.73	1,046,406.81
SEMPRA	1,372	76.02	104,299.44
ANALOG DEVICES INC	362	237.72	86,054.64
ASML HOLDING NV-NY REG SHS	1,235	1,063.63	1,313,583.05
BROADCOM INC	1,221	171.42	209,303.82
BROADCOM INC(NEW)	10,989	171.42	1,883,734.38
NVIDIA CORP	48,979	128.44	6,290,862.76
ON SEMICONDUCTOR CORP	2,312	76.37	176,567.44
CBRE GROUP INC - A	1,695	95.85	162,465.75

	JONES LANG LASALLE INC	7,724	226.65	1,750,644.60
	ドル 小計	1,051,218		139,935,380.15 (22,172,760,984)
ユーロ	NESTE OIL OYJ	7,342	16.89	124,006.38
	TOTAL SA	5,974	63.28	378,034.72
	BASF AG	12,087	43.64	527,476.68
	HEIDELBERG MATERIALS AG	3,638	101.15	367,983.70
	AIRBUS GROUP	1,966	133.00	261,478.00
	SIEMENS AG	1,002	180.88	181,241.76
	VINCI S.A.	4,900	105.40	516,460.00
	DHL GROUP REG	13,423	40.87	548,598.01
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE	4,515	89.82	405,537.30
	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	14,506	35.04	508,290.24
	CONTINENTAL AG	5,538	58.42	323,529.96
	ADIDAS-SALOMON AG	929	231.40	214,970.60
	KERING	498	321.30	160,007.40
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	312	705.60	220,147.20
	INDITEX	4,479	46.42	207,915.18
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	8,406	55.34	465,188.04
	DANONE	3,659	58.36	213,539.24
	HEINEKEN NV	1,446	88.76	128,346.96
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	15,918	23.98	381,713.64
	SANOFI	5,164	92.43	477,308.52
	ALLIANZ AG-REG	2,900	265.20	769,080.00
	AXA	19,075	32.18	613,833.50
	SAP SE	3,811	187.76	715,553.36
	ORANGE	20,108	9.98	200,838.70
	IBERDROLA SA	18,173	11.83	214,986.59
	ASML HOLDING NV	156	989.20	154,315.20
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	4,102	35.74	146,625.99
	ユーロ 小計	184,027		9,427,006.87 (1,626,818,575)
ポンド	BP PLC	2,819	4.49	12,668.58
	SHELL PLC-NEW	10,451	28.07	293,411.82
	RIO TINTO PLC	9,488	51.92	492,616.96
	WPP GROUP PLC	35,364	7.31	258,652.29
	KINGFISHER PLC	60,344	2.68	161,721.92
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	12,298	24.76	304,498.48
	DIAGEO PLC	5,598	24.88	139,278.24
	HALEON PLC	14,092	3.32	46,855.90
	RECKITT&COLMAN PLC	4,338	42.79	185,623.02
	UNILEVER PLC	4,995	44.06	220,079.70

	GSK PLC	20,653	14.98	309,381.94	
	BARCLAYS PLC	48,331	2.25	109,107.23	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	771,143	0.58	453,432.08	
	VODAFONE GROUP PLC	252,581	0.69	176,048.95	
	ボンド 小計	1,252,495		3,163,377.11	(649,947,461)
スイスフラン	NESTLE SA-REGISTERED-B	5,302	93.14	493,828.28	
	LONZA GROUP AG-REG	383	516.20	197,704.60	
	NOVARTIS AG-REG SHS	1,239	99.10	122,784.90	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2,512	258.70	649,854.40	
	SWISS RE LTD	1,194	110.90	132,414.60	
	スイスフラン 小計	10,630		1,596,586.78	(282,372,337)
スウェーデンクローナ	ASSA ABLOY AB-B	22,141	309.70	6,857,067.70	
	スウェーデンクローナ 小計	22,141		6,857,067.70	(102,307,450)
ノルウェークローネ	TELENOR ASA	824	122.60	101,022.40	
	ノルウェークローネ 小計	824		101,022.40	(1,479,978)
デンマーククローネ	NOVO NORDISK A/S-B	2,755	973.30	2,681,441.50	
	デンマーククローネ 小計	2,755		2,681,441.50	(62,021,741)
オーストラリアドル	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	3,850	29.31	112,843.50	
	BHP BILLITON LTD	16,321	43.67	712,738.07	
	CSL LIMITED	1,448	308.56	446,794.88	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	11,680	29.83	348,414.40	
	WESTPAC BANKING CORP	37,930	28.11	1,066,212.30	
	オーストラリアドル 小計	71,229		2,687,003.15	(287,482,467)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS	43,128	40.15	1,731,589.20	
	AIA GROUP LTD	11,600	55.40	642,640.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	135,000	6.42	866,700.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	3,500	72.05	252,175.00	
	香港ドル 小計	193,228		3,493,104.20	(70,910,015)
シンガポールドル	DBS GROUP HOLDINGS LTD	8,890	37.90	336,931.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	22,500	32.96	741,600.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	18,700	2.76	51,612.00	
	シンガポールドル 小計	50,090		1,130,143.00	(133,221,256)
		2,838,637		25,389,322,264	

合計			(25,389,322,264)
----	--	--	------------------

(2) 株式以外の有価証券

2024年7月16日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	ドル	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	6,805	244,027.30	
		AMERICAN TOWER CORP	6,199	1,294,599.16	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	21,343	188,031.83	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,117	226,985.57	
		BRIGHTSPIRE CAPITAL INC	36,389	235,436.83	
		CHATHAM LODGING TRUST	15,990	140,072.40	
		COUSINS PROPERTIES INC	7,731	192,192.66	
		ELME COMMUNITIES	9,757	155,624.15	
		EQUINIX INC	324	260,709.84	
		EQUITY RESIDENTIAL	3,924	266,557.32	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	8,516	419,157.52	
		KITE REALTY GROUP TRUST	11,750	274,480.00	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	16,866	167,816.70	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,863	400,676.85	
		PROLOGIS INC	2,834	343,310.76	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1,383	290,789.58	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	5,463	819,777.78	
		SITE CENTERS CORP	8,955	134,683.20	
		TPG RE FINANCE TRUST INC	35,415	330,776.10	
		VENTAS INC	6,102	321,209.28	
		VICI PROPERTIES INC	14,063	425,968.27	
WELLTOWER INC	5,157	543,238.38			
WEYERHAEUSER CO	4,618	134,106.72			
	ドル 合計		233,564	7,810,228.20 (1,237,530,658)	
合計			233,564	1,237,530,658 (1,237,530,658)	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額です。

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
ドル	株式	130銘柄	80.20%	87.92%
	投資証券	23銘柄		
ユーロ	株式	27銘柄	5.88%	6.11%
ポンド	株式	14銘柄	2.35%	2.44%
スイスフラン	株式	5銘柄	1.02%	1.06%

スウェーデンクローナ	株式	1銘柄	0.37%		0.38%
ノルウェークローネ	株式	1銘柄	0.01%		0.01%
デンマーククローネ	株式	1銘柄	0.22%		0.23%
オーストラリアドル	株式	5銘柄	1.04%		1.08%
香港ドル	株式	4銘柄	0.26%		0.27%
シンガポールドル	株式	3銘柄	0.48%		0.50%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ハッピーエイジング20

2024年7月31日現在

資産総額	28,713,079,078円
負債総額	46,832,390円
純資産総額（ - ）	28,666,246,688円
発行済数量	9,898,352,436口
1単位当りの純資産額（ / ）	2.8961円

ハッピーエイジング30

2024年7月31日現在

資産総額	27,723,186,616円
負債総額	34,132,078円
純資産総額（ - ）	27,689,054,538円
発行済数量	10,722,171,101口
1単位当りの純資産額（ / ）	2.5824円

ハッピーエイジング40

2024年7月31日現在

資産総額	29,785,272,069円
負債総額	35,085,166円
純資産総額（ - ）	29,750,186,903円
発行済数量	13,949,705,894口
1単位当りの純資産額（ / ）	2.1327円

ハッピーエイジング50

2024年7月31日現在

資産総額	11,927,741,022円
負債総額	17,315,048円
純資産総額（ - ）	11,910,425,974円
発行済数量	6,947,128,543口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.7144円

ハッピーエイジング60

2024年7月31日現在

資産総額	5,615,970,842円
負債総額	7,454,440円
純資産総額（ - ）	5,608,516,402円
発行済数量	4,161,805,546口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.3476円

（参考）S J A Mラージキャップ・バリュース・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産総額	36,014,197,283円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	36,014,197,283円
発行済数量	8,992,234,246口
1単位当りの純資産額（ / ）	4.0050円

（参考）S J A Mスモールキャップ・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産総額	21,236,660,749円
負債総額	13,758,794円
純資産総額（ - ）	21,222,901,955円
発行済数量	4,123,602,614口
1単位当りの純資産額（ / ）	5.1467円

（参考）損保ジャパン日本債券マザーファンド

2024年7月31日現在

資産総額	31,980,174,765円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	31,980,174,765円
発行済数量	23,693,551,396口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.3497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

2024年7月31日現在

資産総額	15,851,753,007円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	15,851,753,007円
発行済数量	7,777,399,466口
1単位当りの純資産額（ / ）	2.0382円

（参考）損保ジャパン - T C W外国株式マザーファンド

2024年7月31日現在

資産総額	27,200,366,922円
負債総額	555,509,346円
純資産総額（ - ）	26,644,857,576円
発行済数量	4,891,851,505口
1単位当りの純資産額（ / ）	5.4468円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

1. 名義書換

該当事項はありません。

2. 受益者名簿
作成しません。
3. 受益者集会
開催しません。
4. 受益者に対する特典
ありません。
5. 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。
6. 受益証券の再発行
受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。
7. 受益権の譲渡
受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
前記の申請のある場合には、前記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
委託会社は、前記に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
8. 受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
9. 受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
10. 償還金
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。
11. 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【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】

(1) 資本金の額（2024年7月末現在）

資本金の額	1,550百万円
会社が発行する株式の総数	50,000株
発行済株式総数	24,085株
最近5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。	

(2) 会社の機構（2024年7月末現在）

会社の意思決定機構

定款に基づき10名以内の取締役が株主総会において選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上にあたる株式を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行います。また、その選任決議は、累積投票によらないものとします。

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。増員により、または補欠として選任された取締役の任期は、他の在任取締役の任期終了と同時に終了します。

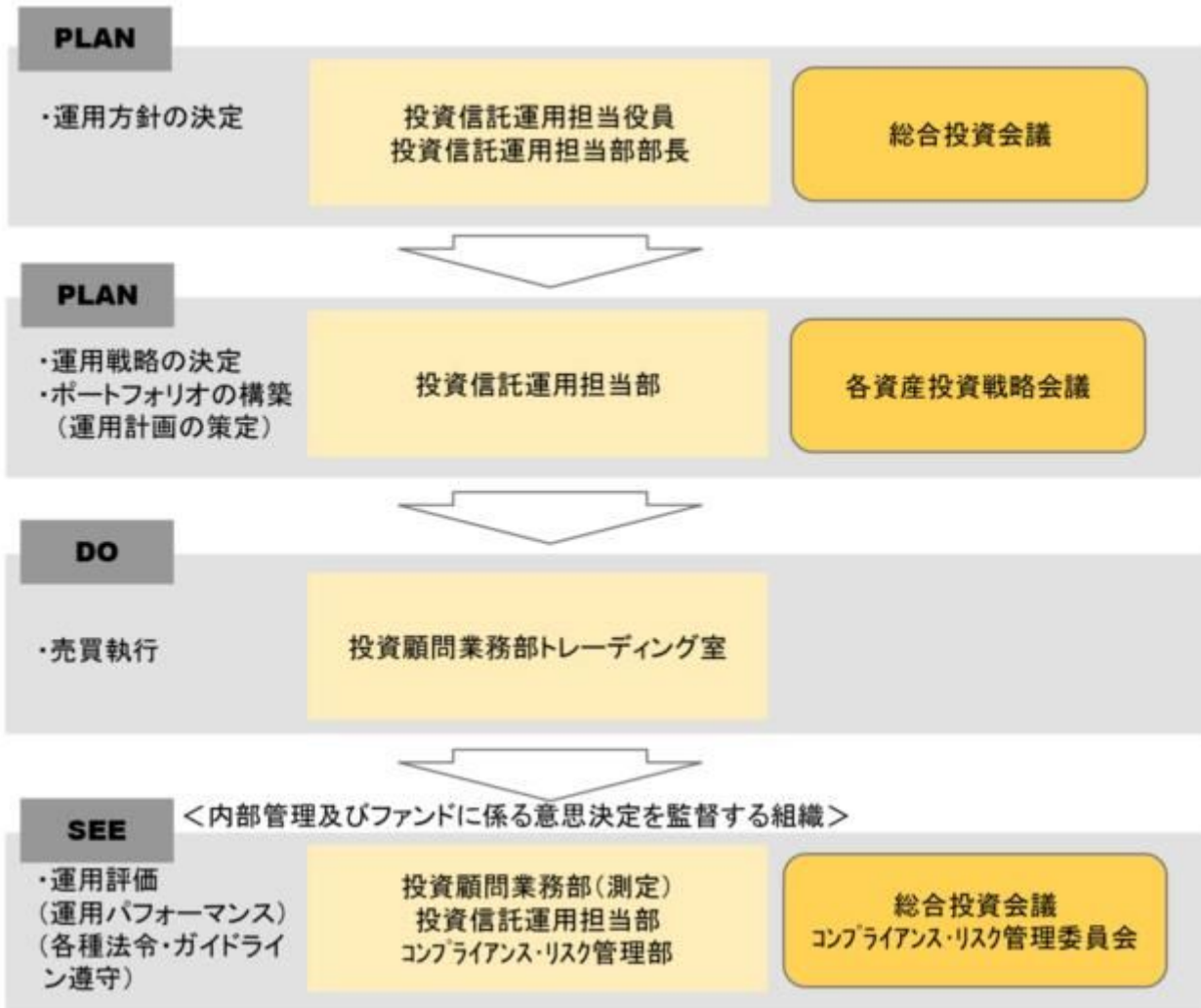
取締役会の決議によって、代表取締役を選定します。また、取締役会長、取締役社長各1名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役社長が招集し、議長となります。取締役社長に事故あるときは、あらかじめ取締役会で定めた順序により、他の取締役がその任にあたります。取締役会の招集通知は会日の3日前までに発します。ただし、緊急の必要のある場合には、この期間を短縮することができます。

取締役会は、法令または定款に別段の定めがある場合のほか、業務執行に関する重要事項を決定します。その決議は、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

投資運用の意思決定機構

- ・総合投資会議は、ファンドの運用方針の分析と決定を行います。
- ・各資産投資戦略会議は、総合投資会議の運用方針に基づき、ファンドの運用戦略を決定し、各運用担当部が運用計画を策定します。
銘柄の選定にあたっては「いかなる資産も本来の投資価値を有しており、市場価格は中長期的にはこの投資価値に収束する。したがって、市場価格と投資価値の乖離が超過収益の源泉となる。」という当社の投資哲学に基づき、各資産、市場、銘柄の割安・割高の度合いを算出するために、各々の「本来あるべき投資価値」を分析することに注力しています。
- ・各運用担当部で策定された運用計画に基づき、投資顧問業務部トレーディング室が最良執行の観点から売買を執行します。
- ・運用状況の分析・評価等は運用担当部で行い、総合投資会議に報告されます。また、売買チェック、リスク管理、各種法令、ガイドライン遵守の状況は、コンプライアンス・リスク管理部で確認を行い、コンプライアンス・リスク管理委員会に報告されます。



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託会社の運用する投資信託（親投資信託を除きます。）は2024年7月末現在、計308本（追加型株式投資信託168本、単体型株式投資信託101本、単体型公社債投資信託39本）であり、その純資産総額の合計は2,286,426百万円です。

3【委託会社等の経理状況】

- 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。
- 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(2023年4月1日から2024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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024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			3,546,171	4,034,755
2 前払費用			101,203	112,742
3 未収委託者報酬			1,194,368	1,702,469
4 未収運用受託報酬			2,618,849	4,148,794
5 その他			3,043	2,289
流動資産合計			7,463,635	10,001,052
固定資産				
1 有形固定資産				
(1) 建物		1	8,078	3,942
(2) 器具備品		1	73,225	43,412
有形固定資産合計			81,304	47,354
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			658,124	591,110
(2) 長期差入保証金			173,961	173,961
(3) 繰延税金資産			348,349	341,629
(4) その他			32	31
投資その他の資産合計			1,180,467	1,106,732
固定資産合計			1,266,307	1,158,622
資産合計			8,729,943	11,159,674

区分	注記 番号	前事業年度 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024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			7,771		15,473
2 未払金					
(1) 未払配当金	2	770,000		1,150,000	
(2) 未払手数料		460,087		606,388	
(3) その他未払金	2	141,725	1,371,812	216,600	1,972,988
3 未払費用			1,873,823		2,951,081
4 未払消費税等			214,504		301,562
5 未払法人税等			262,245		526,818
6 賞与引当金			205,460		185,326
7 役員賞与引当金			6,600		8,100
流動負債合計			3,942,217		5,961,351
固定負債					
1 退職給付引当金			245,172		257,375
2 資産除去債務			9,422		9,582
固定負債合計			254,594		266,957
負債合計			4,196,812		6,228,309
(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			2,544,383		2,875,330
利益剰余金合計			2,544,383		2,875,330
株主資本合計			4,507,664		4,838,610
評価・換算差額等					
1 その他有価証券評価差額金			25,466		92,755
評価・換算差額等合計			25,466		92,755
純資産合計			4,533,130		4,931,365
負債・純資産合計			8,729,943		11,159,674

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1 委託者報酬		6,268,013		8,333,682	
2 運用受託報酬		5,283,477	11,551,491	6,117,209	14,450,891
営業費用					
1 支払手数料		2,600,324		3,499,242	
2 広告宣伝費		25,984		14,970	
3 公告費		200		200	
4 調査費		3,945,034		5,246,032	
(1) 調査費		1,032,243		1,274,945	
(2) 委託調査費		2,909,783		3,968,103	
(3) 図書費		3,007		2,983	
5 営業雑経費		149,447		146,958	
(1) 通信費		13,489		13,473	
(2) 印刷費		115,724		111,483	
(3) 諸会費		20,233	6,720,990	22,001	8,907,404
一般管理費					
1 給料		1,754,897		1,780,148	
(1) 役員報酬		59,540		58,490	
(2) 給料・手当		1,460,378		1,479,591	
(3) 賞与		234,978		242,065	
2 福利厚生費		231,703		249,823	
3 交際費		10,365		15,575	
4 寄付金		1,300		1,330	
5 旅費交通費		29,102		35,906	
6 法人事業税		53,595		61,266	
7 租税公課		26,705		19,614	
8 不動産賃借料		221,573		221,404	
9 退職給付費用		87,487		91,397	
10 賞与引当金繰入		205,460		185,326	
11 役員賞与引当金繰入		6,600		8,100	
12 固定資産減価償却費		39,296		38,014	
13 諸経費		437,986	3,106,075	459,163	3,167,070
営業利益			1,724,425		2,376,417
営業外収益					
1 受取配当金		8,687		476	
2 受取利息		0		0	
3 有価証券償還益		3,726		-	
4 為替差益		11,910		9,754	
5 保険配当金		621		626	
6 雑益		2,493	27,439	2,615	13,473
営業外費用					
1 有価証券売却損		-		7,678	
2 有価証券償還損		-		278	
3 事務過誤費		9,164		228,515	
4 雑損		394	9,558	241	236,712
経常利益			1,742,306		2,153,177
特別損失					
1 有価証券評価損		4,032		-	
2 固定資産除却損	1	-	4,032	0	0
税引前当期純利益			1,738,274		2,153,177
法人税・住民税及び事業 税			522,813		695,208
法人税等調整額			30,682		22,977
当期純利益			1,184,778		1,480,946

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	2,544,383	2,544,383	4,507,664
当期変動額						
剰余金の配当				1,150,000	1,150,000	1,150,000
当期純利益				1,480,946	1,480,946	1,480,946
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	330,946	330,946	330,946
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	2,875,330	2,875,330	4,838,610

	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	25,466	25,466	4,533,130
当期変動額			
剰余金の配当			1,150,000
当期純利益			1,480,946
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	67,288	67,288	67,288
当期変動額合計	67,288	67,288	398,234
当期末残高	92,755	92,755	4,931,365

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。

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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
建物	104,035	108,411
器具備品	143,638	177,083

- 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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
未払金		
未払配当金	770,000	1,150,000
その他未払金	-	188

(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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024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 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。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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
2024年3月28日 取締役会	普通株式	1,150,000千円	47,747円	-	2024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（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	-

当事業年度（2024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）	590,360	590,360	-
資産計	590,360	590,360	-

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024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（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

当事業年度（2024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	4,034,755	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,702,469	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	4,148,794	-	-	-
(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	12,783	257,883	167,593	152,101
合計	9,898,803	257,883	167,593	152,101

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（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

当事業年度（2024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	-	333,213	257,147	590,360
資産計	-	333,213	257,147	590,360

(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 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	-	-

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：千円）

	投資有価証券	合計
期首残高	194,750	194,750
当事業年度の損益又は評価・換算差額等		
損益の計上	0	0
その他有価証券評価差額金	51,397	51,397
購入、売却、発行及び決済		
購入	11,100	11,100
売却	100	100
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	257,147	257,147
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（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

当事業年度（2024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	479,618	336,668	142,950
	小計	479,618	336,668	142,950
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	110,742	120,000	9,258
	小計	110,742	120,000	9,258
合計		590,360	456,668	133,692

5. 売却したその他有価証券

前事業年度（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	-	-	-

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	187,421	22,295	29,973
合計	187,421	22,295	29,973

（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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	208,284	245,172
退職給付費用	37,940	40,528
退職給付の支払額	1,052	28,325
退職給付引当金の期末残高	245,172	257,375

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	245,172	257,375
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	245,172	257,375
退職給付引当金	245,172	257,375
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	245,172	257,375

(3) 退職給付費用

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	37,940	40,528

3. 確定拠出制度

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当社の確定拠出制度への要拠出額	41,080	43,710

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024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	176,793	169,388
退職給付引当金	75,071	78,808
賞与引当金	62,912	56,746
繰延資産損金算入限度超過額	21,910	43,352
未払事業税	15,571	26,319
未払金否認	7,604	8,118
その他	7,100	7,165
繰延税金資産 小計	366,961	389,896
将来減算一時差異等の合計に係る評価性引当額	4,119	4,168
評価性引当額 小計	4,119	4,168
繰延税金資産 合計	362,842	385,728

繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	11,240	40,937
株式譲渡損益	3,031	3,031
固定資産除去価額	222	131
繰延税金負債 合計	14,493	44,099
繰延税金資産の純額	348,349	341,629

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

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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
期首残高	9,265	9,422
取得	-	-
時の経過による調整額	157	159
期末残高	9,422	9,582

（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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
投資信託事業（基本報酬）	6,264,984	8,199,234
投資信託事業（成功報酬）	3,029	134,447
投資顧問事業（基本報酬）	2,834,396	2,793,161
投資顧問事業（成功報酬）	2,449,080	3,324,047
合計	11,551,491	14,450,891

（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 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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	3,413,256

(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
該当事項はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
該当事項はありません。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 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 D C 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	SOM PO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。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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)	838,690	未払手数料	218,649
同一の親会社を持つ会社	SOMPOリスクマネジメント株式会社	東京都新宿区	0	リスクコンサルティング業	-	投資信託等に係る委託調査	投資信託等委託調査費の支払(注2)	180,252	未払費用	171,632

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）委託調査費の支払いについては、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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額(円)	188,213.85	204,748.41
1株当たり当期純利益金額(円)	49,191.55	61,488.32

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

（注）2.1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益(千円)	1,184,778	1,480,946
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)	1,184,778	1,480,946
期中平均株式数(株)	24,085	24,085

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)において同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更
該当事項はありません。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
該当事項はありません。

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】

(1) 受託会社

名称

みずほ信託銀行株式会社(再信託受託会社:株式会社日本カストディ銀行)

資本金の額

247,369百万円(2024年3月末現在)

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

<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(2024年3月末現在)
事業の内容	: 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。
再信託の目的	: 原信託契約に係る信託事務の一部(信託財産の管理)を原信託受託会社から再信託受託会社(株式会社日本カストディ銀行)へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2)販売会社

名称	資本金の額 ¹ (単位:百万円)	事業の内容
あかつき証券株式会社	3,067	「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。
岩井コスモ証券株式会社	13,500	
auカブコム証券株式会社	7,196	
S M B C 日興証券株式会社	135,000	
株式会社 S B I 証券	54,323	
岡三にいがた証券株式会社	852	
静岡東海証券株式会社 ²	600	
損保ジャパン D C 証券株式会社	3,000	
大熊本証券株式会社 ²	343	
松井証券株式会社	11,945	
マネックス証券株式会社	13,195	
丸八証券株式会社 ²	3,751	
みずほ証券株式会社	125,167	
三津井証券株式会社 ²	558	
楽天証券株式会社	19,495	
株式会社大東銀行 ³	14,743	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
PayPay銀行株式会社	72,216	
株式会社北海道銀行 ²	93,524	
株式会社みずほ銀行	1,404,065	損害保険法に基づき損害保険業を営んでいます。
損害保険ジャパン株式会社	70,000	

1 資本金の額は、2024年3月末現在

2 ハッピーエイジング20、30、40のみの取扱いとなります。

3 ハッピーエイジング40のみの取扱いとなります。

(3)投資顧問会社

TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY

資本金の額 62,741千ドル(2023年12月末現在)

(8,898百万円、1ドル=141.83円換算)

事業の内容

米国において有価証券等に係る投資顧問業務及び投資信託委託業務を行っています。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

受託会社として、信託財産の保管・管理業務などを行い、収益分配金、一部解約金及び償還金の交付等を行います。

(2) 販売会社

販売会社として、受益権の募集の取扱い、収益分配金等の支払い等を行います。

(3) 投資顧問会社

TCW INVESTMENT MANAGEMENT COMPANY

委託会社との投資一任契約に基づき、「損保ジャパン - TCW外国株式マザーファンド」に関して、外国株式の運用の指図に関する権限の委託を受けて投資判断、発注等を行います。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

(3) 投資顧問会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2023年10月17日	有価証券届出書
2023年10月17日	有価証券報告書
2024年 4月17日	有価証券届出書
2024年 4月17日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2024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2023年4月1日から2024年3月31日までの第39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2024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するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年9月17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 徳 山 勇 樹
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング20の2023年7月19日から2024年7月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハッピーエイジング20の2024年7月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年9月17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 徳 山 勇 樹
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング30の2023年7月19日から2024年7月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハッピーエイジング30の2024年7月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年9月17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 徳 山 勇 樹
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング40の2023年7月19日から2024年7月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハッピーエイジング40の2024年7月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年9月17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 徳 山 勇 樹
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング50の2023年7月19日から2024年7月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハッピーエイジング50の2024年7月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年9月17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 徳 山 勇 樹
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハッピーエイジング60の2023年7月19日から2024年7月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハッピーエイジング60の2024年7月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。