

損保ジャパン SRIオープン

〈愛称〉 未来のちから

第19期（決算日 2023年12月8日）

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式	
信託期間	無期限	
運用方針	<p>①日本の株式に投資します。 東証株価指数（TOPIX）をベンチマークとし、中長期的にこれを上回る運用成果を目指します。</p> <p>②企業の社会的責任に着目します。</p> <p>③相対的に割安と評価される銘柄に投資します。</p>	
主要投資対象	損保ジャパンSRIオープン	損保ジャパンSRIマザーファンド受益証券
	損保ジャパンSRIマザーファンド	わが国の株式
主な組入制限	損保ジャパンSRIオープン	株式への実質投資割合には制限を設けません。 同一銘柄の株式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。
	損保ジャパンSRIマザーファンド	株式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10%以内とします。
分配方針	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>①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。</p> <p>②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。</p>	

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
さて、「損保ジャパンSRIオープン」は、このたび第19期の決算を行いましたので、運用状況をご報告申し上げます。
今後とも引き続きお引立て賜りますようお願い申し上げます。



SOMPOアセットマネジメント

東京都中央区日本橋二丁目2番16号 共立日本橋ビル



<https://www.sompo-am.co.jp/>

お問い合わせ先



リテール営業部 0120-69-5432
(受付時間 営業日の午前9時～午後5時)

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			T O P I X		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	(分配落)	税込 分配	み 騰落 中率	(東証株価指数)	騰落 中率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
15期(2019年12月9日)	10,657	0	5.8	1,722.07	8.3	96.9	—	912
16期(2020年12月8日)	9,875	0	△ 7.3	1,758.81	2.1	97.6	—	843
17期(2021年12月8日)	10,928	600	16.7	2,002.24	13.8	97.9	—	925
18期(2022年12月8日)	10,642	800	4.7	1,941.50	△ 3.0	95.8	—	53
19期(2023年12月8日)	11,710	1,000	19.4	2,324.47	19.7	93.6	—	62

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 基準価額及び分配金は1万口当たり(以下同じ)。

(注3) 株式組入比率および株式先物比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注4) 株式先物比率=買建比率-売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		T O P I X		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	騰落率	(東証株価指数)	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2022年12月8日	10,642	—	1,941.50	—	95.8	—
12月末	10,557	△ 0.8	1,891.71	△ 2.6	96.2	—
2023年1月末	10,896	2.4	1,975.27	1.7	96.7	—
2月末	11,030	3.6	1,993.28	2.7	94.8	—
3月末	11,014	3.5	2,003.50	3.2	95.4	—
4月末	11,498	8.0	2,057.48	6.0	95.0	—
5月末	11,487	7.9	2,130.63	9.7	94.8	—
6月末	12,209	14.7	2,288.60	17.9	93.6	—
7月末	12,543	17.9	2,322.56	19.6	95.6	—
8月末	12,855	20.8	2,332.00	20.1	96.5	—
9月末	13,018	22.3	2,323.39	19.7	95.0	—
10月末	12,543	17.9	2,253.72	16.1	94.6	—
11月末	12,956	21.7	2,374.93	22.3	94.0	—
(期末)						
2023年12月8日	12,710	19.4	2,324.47	19.7	93.6	—

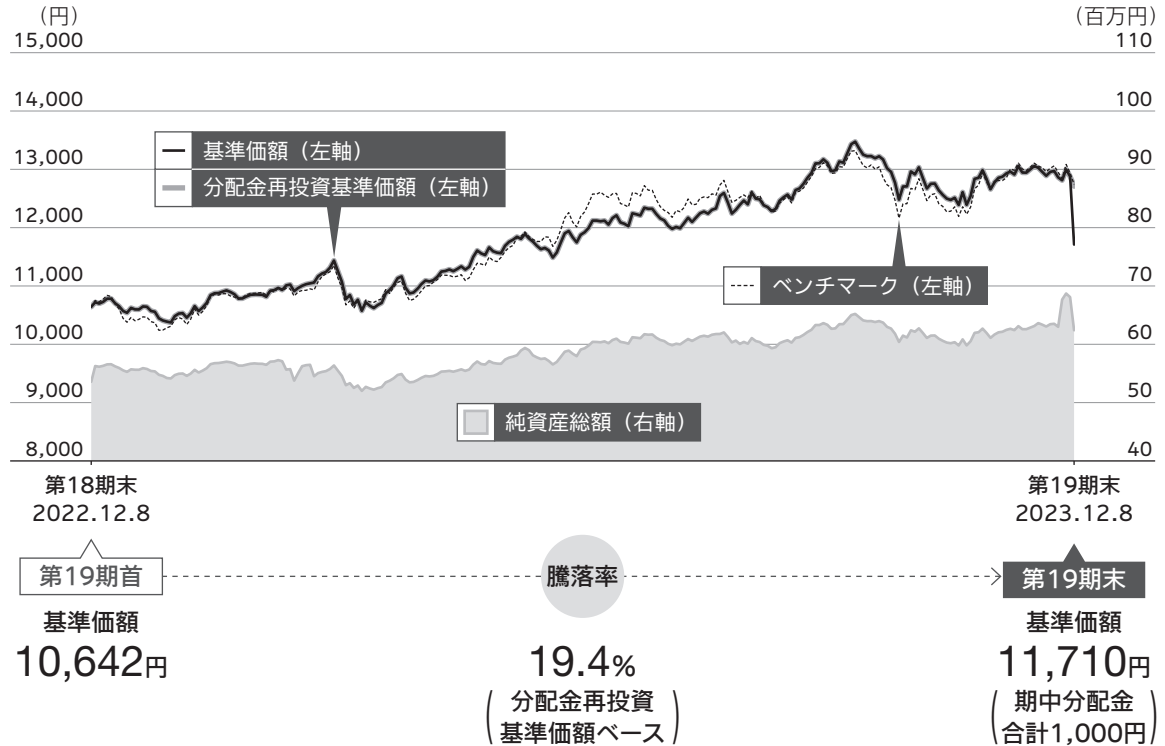
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注2) 株式組入比率および株式先物比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注3) 株式先物比率=買建比率-売建比率。

運用経過

● 基準価額の推移



- 分配金再投資基準価額およびベンチマーク（TOPIX（東証株価指数））の推移は、2022年12月8日の基準価額をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

● 基準価額の主な変動要因

損保ジャパンSRIオープン

高位に組入れていたマザーファンドの基準価額が上昇したため、当ファンドの分配金再投資基準価額も上昇しました。

損保ジャパンSRIマザーファンド

期中の騰落率は+21.5%となりました。

国内株式市場が上昇する中、期を通じて株式を高位に組入れていたマザーファンドの基準価額も上昇しました。個別銘柄では、三井住友トラスト・ホールディングス、豊田合成、野村総合研究所、第一生命ホールディングス、E I Z O、三井住友フィナンシャルグループなどがプラスに寄与しました。

- 本報告書では、ベビーファンドとマザーファンドを下記の様に統一して表記しています。

 ベビーファンド  マザーファンド

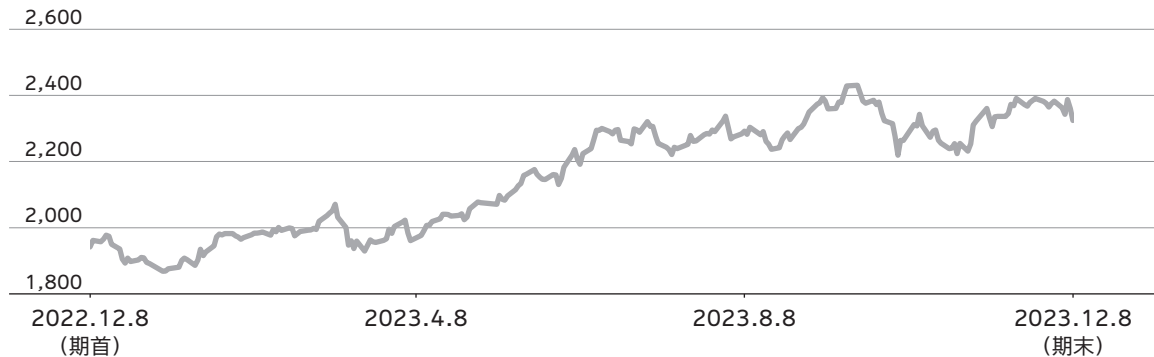
● 投資環境

TOPIXは19.7%の上昇となりました。

期初は、日銀金融政策決定会合において10年債利回りの変動許容幅拡大が決定され、円高が進行したことが下押し圧力となったものの、FRB（米連邦準備理事会）の利上げペース鈍化や中国のゼロコロナ政策解除による景気回復への期待から横ばい圏での推移となりました。その後は、米欧の金融システム不安の高まりから急落する場面もあったものの、政府、中央銀行の迅速な対応に加えて、東証の要請（資本コストや株価の重視、投資家対話の開示、正確な情報開示）を契機に国内企業の資本効率改善への期待も高まり、海外投資家が大幅な買い越しに転じたことから大きく上昇しました。

期末にかけては、FRBによる金融引き締め長期化懸念や中国経済の先行き不透明感が高まった一方、日本企業の堅調な決算や円安の進行などが支えとなり横ばい圏での推移となりました。

TOPIX（東証株価指数）の推移



(出所：Bloomberg)

● 当該投資信託のポートフォリオ

期を通して損保ジャパンSRIマザーファンドの組入比率を高位に維持しました。

期末時点における株式のESG ポジティブ・スクリーニング投資比率は93.6%です*。

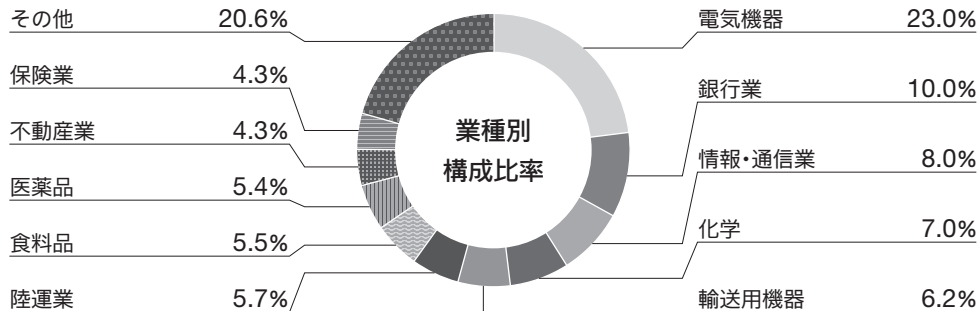
※ ESG ポジティブ・スクリーニングとは、調査対象とする企業をESGの観点から評価し、評価の高い企業を投資候補銘柄として選定する手法です。なお、マザーファンドで投資している株式は、全てESG ポジティブ・スクリーニングの手法で選定された銘柄です。比率はマザーファンドを通じた実質比率です。

損保ジャパンSRIマザーファンド

期を通して株式の組入比率を高位に維持しました。

期末時点での業種別構成比率はグラフのとおりです。

主な購入（ウェイトアップ）銘柄は、りそなホールディングス、マブチモーター、日本ゼオンなど、主な売却（ウェイトダウン）銘柄は、豊田自動織機、日本電気、J. フロント リテイリングなどです。



注1. 比率は、第19期末における国内株式の評価総額に対する各業種の評価額の割合。

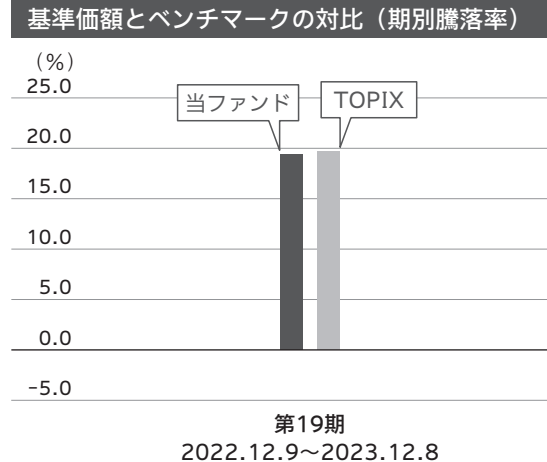
注2. 端数処理の関係上、構成比合計が100%とならない場合があります。

スチュワードシップ方針

- 当社は創業以来、自主運用においてアクティブ運用に特化した事業展開を行ってきました。長期的視点を持つ当社のアクティブ運用手法はスチュワードシップの精神と高い親和性があり、企業のESG情報は運用パフォーマンスに直結する極めて重要な要素として評価しています。良質なアクティブ運用を提供することを通じて、お客さまに対する受託者責任を果たしながら、投資先企業やその先にある社会・経済全体の持続的発展に貢献します。
- 当社の「責任ある投資家としての考え方と行動方針」や「日本版スチュワードシップ・コード対応方針」、活動報告は当社のホームページをご参照ください。
(<https://www.sompo-am.co.jp/institutional/responsible.html>)
(<https://www.sompo-am.co.jp/institutional/stewardship.html>)

● 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドの騰落率（分配金再投資基準価額ベース）は、ベンチマーク（TOPIX）の騰落率（+19.7%）を0.3%下回りました。当ファンドは期を通じて「損保ジャパンSRIマザーファンド」を高位に組み入れておりましたので、以下ではマザーファンドとベンチマークとの差異についてご説明します。



損保ジャパンSRIマザーファンドとベンチマークとの差異

マザーファンドの騰落率は、TOPIX（配当込み）の騰落率（+22.8%）を1.3%下回りました。

要因別では、業種配分効果はマイナス要因、銘柄選択効果はプラス要因となりました。業種配分は、銀行業、保険業のオーバーウェイト、サービス業のアンダーウェイトなどがプラス要因、繊維製品、陸運業のオーバーウェイト、電気・ガス業のアンダーウェイトなどがマイナス要因となりました。

個別銘柄寄与度では豊田合成、八十二銀行、シチズン時計のオーバーウェイトなどがプラス要因、ニデック、東レのオーバーウェイト、三菱UFJフィナンシャル・グループのアンダーウェイトなどがマイナス要因となり、全体ではプラスとなりました。

● 分配金

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、次表の通りと致しました。なお、収益分配に充てなかった収益は、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて引き続き元本と同一の運用を行います。

分配原資の内訳 (単位：円、1万口当たり・税引前)

項目	第19期 2022.12.9~2023.12.8
当期分配金	1,000
(対基準価額比率)	7.868%
当期の収益	1,000
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,927

注1. 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

注2. 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税引前）に合致しない場合があります。

注3. 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

決算期におけるファンドの運用成果[※]をもとに、分配を行うことを目指すファンドです。

※ 運用成果には、インカム収入とキャピタルゲイン・ロスの両方を考慮します。

インカム収入とは株式の配当収入等、キャピタルゲイン・ロスとは値上がり益・値下がり損をいいます。

・ ファンドに蓄積された過去の運用成果（分配原資）を加味する場合があります。

● 今後の運用方針

損保ジャパンSRIオープン

今後もマザーファンド受益証券の組入水準を高位に維持することで、信託財産の中長期的に着実な成長を目指します。

損保ジャパンSRIマザーファンド

今後も「ESG（環境、社会、ガバナンス）」に先進的に取り組んでいる企業の中から、当社独自の投資価値分析に基づき相対的に割安度の高い銘柄へ投資することで、リスクを軽減しつつ信託財産の中長期的に着実な成長と安定した収益の確保を目指します。

● 1万口当たりの費用明細

項目	第19期 2022.12.9~2023.12.8		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	196円	1.650%	(a)信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率(年率)× $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は11,883円です。
(投信会社)	(91)	(0.770)	ファンドの運用の対価
(販売会社)	(91)	(0.770)	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
(受託会社)	(13)	(0.110)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	6	0.049	(b)売買委託手数料= $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(6)	(0.049)	
(c) その他費用	2	0.018	(c)その他費用= $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
(監査費用)	(2)	(0.015)	監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.003)	信託事務の処理にかかるその他の費用等
合計	204	1.717	

注1. 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

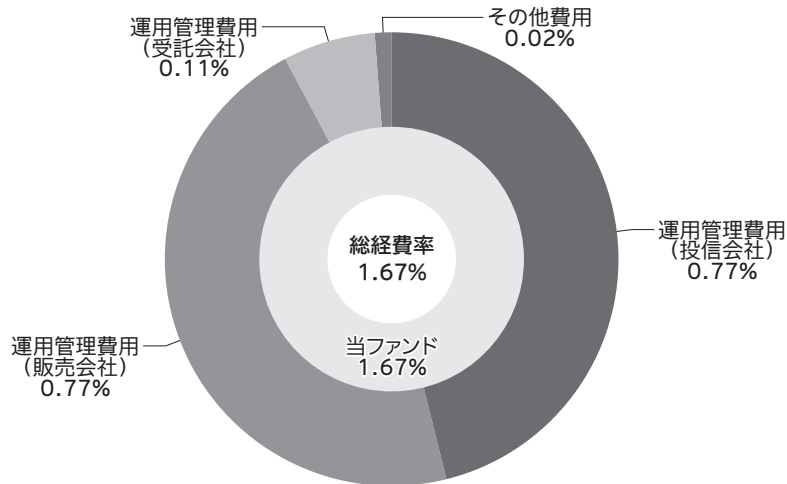
注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

注3. 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）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**総経費率（年率）は1.67%**です。



注1. 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

注2. 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

注3. 各比率は、年率換算した値です。

注4. 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

注5. 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2022年12月9日～2023年12月8日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
損保ジャパンSRIマザーファンド	千口 2,435	千円 7,340	千口 3,216	千円 9,730

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 金額は受渡代金。

○株式売買比率

(2022年12月9日～2023年12月8日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	損保ジャパンSRIマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	41,312千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	56,129千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.73	

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2022年12月9日～2023年12月8日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2023年12月8日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
損保ジャパンSRIマザーファンド	千口 18,970	千口 18,190	千円 61,771

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 当ファンドは、当期末において、直接投資をする株式及び新株予約権証券の組入れはありません。

○投資信託財産の構成

(2023年12月8日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
損保ジャパンSRIマザーファンド	千円 61,771	% 90.5
コール・ローン等、その他	6,479	9.5
投資信託財産総額	68,250	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年12月8日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	68,250,794
コール・ローン等	6,478,922
損保ジャパンSRIマザーファンド(評価額)	61,771,872
(B) 負債	5,844,804
未払収益分配金	5,329,286
未払解約金	476
未払信託報酬	510,353
その他未払費用	4,689
(C) 純資産総額(A-B)	62,405,990
元本	53,292,863
次期繰越損益金	9,113,127
(D) 受益権総口数	53,292,863口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,710円

(注1) 信託財産に係る期首元本額50,335,590円、期中追加設定元本額12,214,098円、期中一部解約元本額9,256,825円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額 1.1710円

○損益の状況 (2022年12月9日～2023年12月8日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 205
支払利息	△ 205
(B) 有価証券売買損益	10,431,841
売買益	11,154,432
売買損	△ 722,591
(C) 信託報酬等	△ 977,717
(D) 当期損益金(A+B+C)	9,453,919
(E) 前期繰越損益金	2,242,291
(F) 追加信託差損益金	2,746,203
(配当等相当額)	(3,898,223)
(売買損益相当額)	(△ 1,152,020)
(G) 計(D+E+F)	14,442,413
(H) 収益分配金	△ 5,329,286
次期繰越損益金(G+H)	9,113,127
追加信託差損益金	2,746,203
(配当等相当額)	(3,907,637)
(売買損益相当額)	(△ 1,161,434)
分配準備積立金	6,366,924

(注1) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 信託報酬等には、消費税相当額を含めて表示しております。

(注3) 追加信託差損益金とは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程(2022年12月9日～2023年12月8日)は以下の通りです。

項 目	2022年12月9日～ 2023年12月8日
a. 配当等収益(費用控除後)	1,382,056円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	6,139,374円
c. 信託約款に規定する収益調整金	3,907,637円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	4,174,780円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	15,603,847円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,927円
g. 分配金	5,329,286円
h. 分配金(1万口当たり)	1,000円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	1,000円
-----------------	--------

<分配金をお支払いする場合>

・分配金は、原則として各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しています。

<分配金を再投資する場合>

・お手持り分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資しています。

<課税上の取扱いについて>

- ・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）」があります。
- ・分配金落ち後の基準価額が個別元本と同額の場合または個別元本を上回っている場合は、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配金落ち後の基準価額が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）となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、収益分配金発生時に個々の受益者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、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人の受益者に対する課税
 税率は普通分配金について、20.315%（所得税及び復興特別所得税15.315%、並びに地方税5%）です。

※上記は源泉徴収時の税率であり、税率は課税方法等により異なる場合があります。

※少額投資非課税制度「愛称：N I S A（ニーサ）」をご利用の場合、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及び譲渡所得が5年間非課税となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※法人の受益者に対する課税は、税率が異なります。

※上記内容は、税法が改正された場合等には変更になることがあります。

※課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家または税務署等にご確認ください。

○お知らせ

- ・実態に即した記載とするとともに、新N I S A制度の成長投資枠の対象商品に係る法令上の要件を満たすため、投資信託約款に所要の変更（デリバティブ取引等の利用を価格等の変動リスクのヘッジと現物投資の代替に限定）を致しました（2023年9月29日）。

損保ジャパンSRIマザーファンド

運用報告書

第19期（決算日 2023年12月8日）

<計算期間 2022年12月9日～2023年12月8日>

損保ジャパンSRIマザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	無期限
運用方針	信託財産の長期的成長を目指して、積極的な運用を行います。 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）をベンチマークとします。
主要投資対象	わが国の株式
主な組入制限	株式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10%以内とします。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		TOPIX（東証株価指数） （配当込み）		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	円	騰落率	騰落率	騰落率			
15期(2019年12月9日)	23,886	7.3	2,623.16	11.1	97.7	—	百万円 905
16期(2020年12月8日)	22,483	△ 5.9	2,744.78	4.6	98.4	—	837
17期(2021年12月8日)	26,726	18.9	3,191.01	16.3	98.9	—	916
18期(2022年12月8日)	27,950	4.6	3,177.50	△ 0.4	96.8	—	53
19期(2023年12月8日)	33,959	21.5	3,901.95	22.8	94.5	—	61

(注1) 基準価額は1万円当たり（以下同じ）。

(注2) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	TOPIX (東証株価指数)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	
		騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2022年12月8日	円 27,950	% —	(配当込み) 3,177.50	% —	% 96.8	% —
12月末	27,761	△ 0.7	3,101.25	△ 2.4	97.0	—
2023年1月末	28,703	2.7	3,238.48	1.9	97.6	—
2月末	29,098	4.1	3,269.12	2.9	95.9	—
3月末	29,094	4.1	3,324.74	4.6	96.3	—
4月末	30,421	8.8	3,414.45	7.5	95.7	—
5月末	30,439	8.9	3,537.93	11.3	95.8	—
6月末	32,420	16.0	3,805.00	19.7	94.6	—
7月末	33,356	19.3	3,861.80	21.5	95.1	—
8月末	34,233	22.5	3,878.51	22.1	97.3	—
9月末	34,717	24.2	3,898.26	22.7	95.8	—
10月末	33,486	19.8	3,781.64	19.0	95.7	—
11月末	34,650	24.0	3,986.65	25.5	95.2	—
(期 末) 2023年12月8日	33,959	21.5	3,901.95	22.8	94.5	—

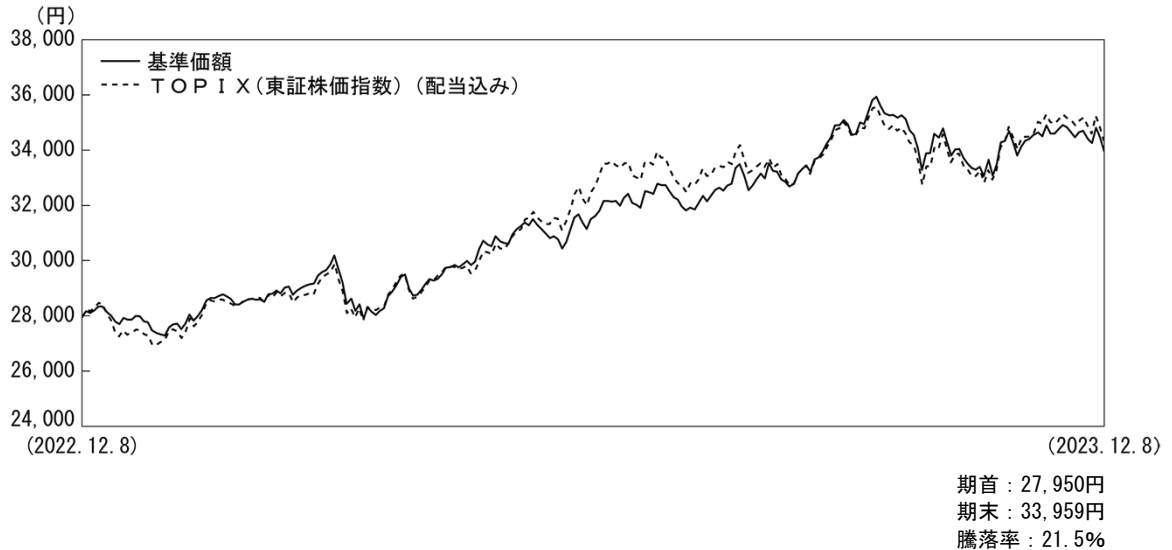
(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

○運用経過

(2022年12月9日～2023年12月8日)

■基準価額の推移



・ベンチマーク（TOPIX（東証株価指数）（配当込み））の推移は、2022年12月8日の基準価額をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。

P 2～P 9 をご参照下さい。

○1万口当たりの費用明細

(2022年12月9日～2023年12月8日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 16 (16)	% 0.050 (0.050)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	1 (1)	0.002 (0.002)	(b) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 信託事務の処理にかかるその他の費用等
合 計	17	0.052	
期中の平均基準価額は31,531円です。			

(注1) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2022年12月9日～2023年12月8日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国		千株	千円	千株	千円
内	上場	9	19,383	9	21,929
		(16)	(-)		

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) ()内は増資割当、株式転換・合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

○株式売買比率

(2022年12月9日～2023年12月8日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	41,312千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	56,129千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.73

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2022年12月9日～2023年12月8日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2023年12月8日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
建設業 (3.8%)			
大林組	1.9	1.8	2,205
食料品 (5.5%)			
森永乳業	0.4	0.4	1,111
キリンホールディングス	0.9	1	2,100
味の素	0.3	—	—
繊維製品 (3.6%)			
東レ	2.8	2.9	2,105
ワコールホールディングス	0.3	—	—
化学 (7.0%)			
日本触媒	0.2	0.2	1,046
日本ゼオン	—	1	1,327
花王	0.2	0.3	1,730
医薬品 (5.4%)			
武田薬品工業	0.3	0.3	1,217
サワイグループホールディングス	0.4	0.4	1,962
非鉄金属 (2.1%)			
住友電気工業	0.5	0.7	1,225
機械 (3.8%)			
クボタ	0.5	0.6	1,201
ダイフク	0.1	0.3	787
ジェイテクト	—	0.2	249
電気機器 (23.0%)			
明電舎	0.3	0.6	1,431
マブチモーター	—	0.3	1,361
ニデック	0.2	0.3	1,616
日本電気	0.3	—	—
富士通	0.1	0.1	2,156
セイコーエプソン	0.3	0.3	624
E I Z O	0.3	0.3	1,492
パナソニック ホールディングス	—	0.8	1,142
富士通ゼネラル	0.5	0.3	717
TDK	—	0.1	652
ウシオ電機	0.5	—	—
村田製作所	0.2	0.8	2,243

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
輸送用機器 (6.2%)				
豊田自動織機	0.2	—	—	
デンソー	0.1	0.7	1,496	
いすゞ自動車	0.6	0.7	1,303	
豊田合成	0.6	0.3	809	
精密機器 (1.4%)				
シチズン時計	2.2	1	821	
陸運業 (5.7%)				
西日本旅客鉄道	0.2	0.2	1,173	
ヤマトホールディングス	0.5	0.8	2,144	
NIPPON EXPRESSホールディングス	0.1	—	—	
情報・通信業 (8.0%)				
野村総合研究所	0.4	0.5	2,011	
日本電信電話	0.5	15.6	2,659	
小売業 (4.1%)				
J・フロント リテイリング	1.7	0.5	655	
セブン&アイ・ホールディングス	—	0.1	573	
丸井グループ	—	0.5	1,160	
銀行業 (10.0%)				
りそなホールディングス	—	1.9	1,509	
三井住友トラスト・ホールディングス	0.5	0.4	2,188	
三井住友フィナンシャルグループ	0.2	0.3	2,171	
八十二銀行	1.9	—	—	
保険業 (4.3%)				
第一生命ホールディングス	0.9	0.8	2,492	
不動産業 (4.3%)				
三菱地所	1.2	1.3	2,500	
サービス業 (1.8%)				
セコム	0.1	0.1	1,025	
合 計	株 数・金 額	23	39	58,405
	銘柄数<比率>	39	40	<94.5%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年12月8日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	58,405	94.5
コール・ローン等、その他	3,367	5.5
投資信託財産総額	61,772	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年12月8日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	61,772,781
コール・ローン等	3,328,691
株式(評価額)	58,405,090
未収配当金	39,000
(B) 負債	240
その他未払費用	240
(C) 純資産総額(A-B)	61,772,541
元本	18,190,133
次期繰越損益金	43,582,408
(D) 受益権総口数	18,190,133口
1万口当たり基準価額(C/D)	33,959円

(注1) 信託財産に係る期首元本額18,970,994円、期中追加設定元本額2,435,403円、期中一部解約元本額3,216,264円

(注2) 期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託ごとの元本の内訳

 損保ジャパンSRIオープン 18,190,133円

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 3.3959円

○損益の状況 (2022年12月9日～2023年12月8日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,525,203
受取配当金	1,525,800
その他収益金	10
支払利息	△ 607
(B) 有価証券売買損益	9,614,896
売買益	10,732,883
売買損	△ 1,117,987
(C) 保管費用等	△ 1,308
(D) 当期損益金(A+B+C)	11,138,791
(E) 前期繰越損益金	34,052,756
(F) 追加信託差損益金	4,904,597
(G) 解約差損益金	△ 6,513,736
(H) 計(D+E+F+G)	43,582,408
次期繰越損益金(H)	43,582,408

(注1) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 追加信託差損益金とは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) 解約差損益金とは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

・実態に即した記載とするとともに、新NISA制度の成長投資枠の対象商品に係る法令上の要件を満たすため、投資信託約款に所要の変更(デリバティブ取引等の利用を価格等の変動リスクのヘッジと現物投資の代替に限定)を致しました(2023年9月29日)。