

損保ジャパン 日本株ファンド

第23期（決算日 2022年7月15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主として日本の株式に分散投資することで、リスクを軽減しつつ信託財産の中長期的な成長と安定した収益の獲得を目指します。</p> <p>②「東証株価指数（TOPIX）」をベンチマークとし、これを中長期的に上回る運用成果を目指します。</p>	
主要投資対象	損保ジャパン日本株ファンド	「損保ジャパン日本株マザーファンド」受益証券
	損保ジャパン日本株マザーファンド	わが国の株式
主な組入制限	損保ジャパン日本株ファンド	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。
	損保ジャパン日本株マザーファンド	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、取得時において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・配当収入及び売買益（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、「損保ジャパン日本株ファンド」は、このたび第23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)	税金	み騰落	(東証株価指数)	騰落			
	円	円	%		%	%	%	百万円
19期(2018年7月17日)	13,008	0	7.5	1,745.05	7.7	98.1	—	4,227
20期(2019年7月16日)	12,030	0	△7.5	1,568.74	△10.1	98.5	—	3,958
21期(2020年7月15日)	10,983	0	△8.7	1,589.51	1.3	98.7	—	3,367
22期(2021年7月15日)	13,752	0	25.2	1,939.61	22.0	98.9	—	3,905
23期(2022年7月15日)	14,491	0	5.4	1,892.50	△2.4	98.4	—	3,703

(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	騰落率	(東証株価指数)	騰落率		
(期首) 2021年7月15日	円	%		%	%	%
	13,752	—	1,939.61	—	98.9	—
7月末	13,494	△1.9	1,901.08	△2.0	98.1	—
8月末	13,676	△0.6	1,960.70	1.1	98.2	—
9月末	14,309	4.1	2,030.16	4.7	97.1	—
10月末	13,975	1.6	2,001.18	3.2	97.4	—
11月末	13,203	△4.0	1,928.35	△0.6	96.9	—
12月末	13,725	△0.2	1,992.33	2.7	97.3	—
2022年1月末	13,871	0.9	1,895.93	△2.3	98.0	—
2月末	13,904	1.1	1,886.93	△2.7	98.1	—
3月末	14,283	3.9	1,946.40	0.4	96.9	—
4月末	14,244	3.6	1,899.62	△2.1	96.7	—
5月末	14,416	4.8	1,912.67	△1.4	96.5	—
6月末	14,612	6.3	1,870.82	△3.5	97.7	—
(期末) 2022年7月15日	円	%		%	%	%
	14,491	5.4	1,892.50	△2.4	98.4	—

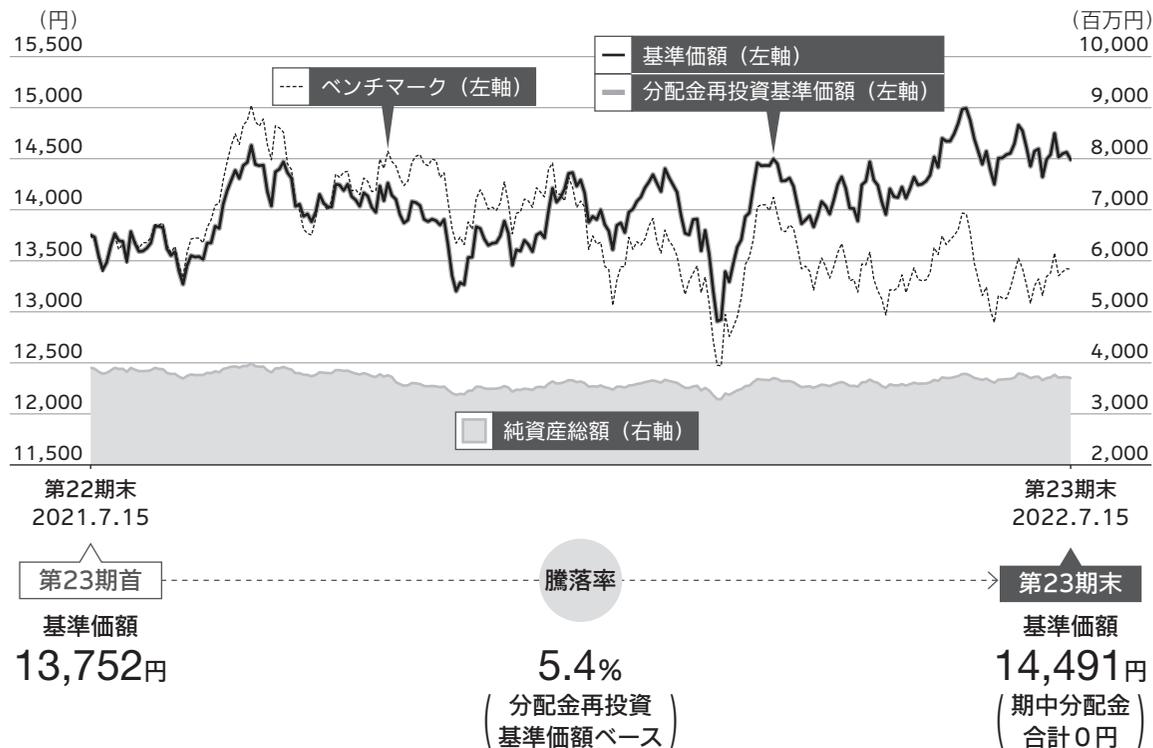
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(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、2021年7月15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

損保ジャパン日本株ファンド

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、当ファンドの基準価額は上昇しました。

損保ジャパン日本株マザーファンド

期中の騰落率は+7.0%となりました。

当期間の国内株式市場は下落したものの、マザーファンドのパフォーマンスは堅調に推移し、基準価額は上昇しました。個別銘柄では、日本電信電話、三菱UFJフィナンシャル・グループ、東京海上ホールディングス、日揮ホールディングス、第一生命ホールディングスなどの保有銘柄の上昇が、基準価額上昇に寄与しました。

- 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。

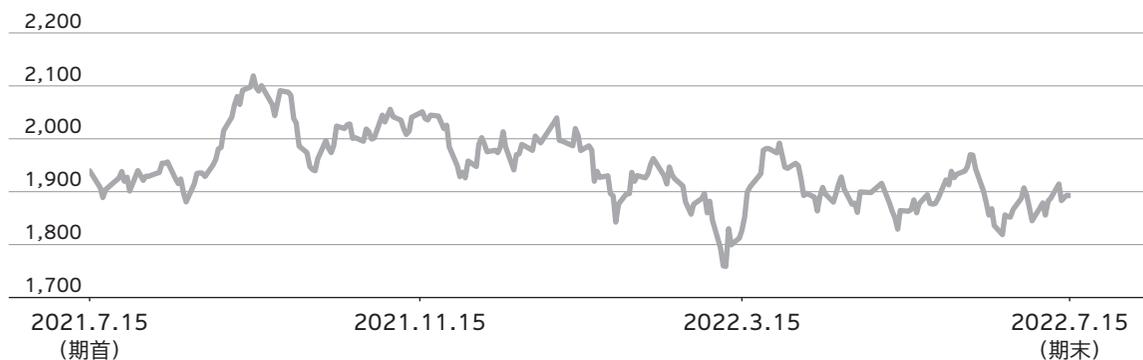
 ベビーファンド  マザーファンド

● 投資環境

TOPIXは2.4%の下落となりました。

期初は堅調な経済指標や、菅首相（当時）が自民党総裁選挙への不出馬を表明したことによる国内政治の安定、経済対策への期待の高まりなどから株価は上昇しました。その後は、南アフリカでの新型コロナウイルスのオミクロン株の発見やFRB（米連邦準備理事会）が金融政策正常化を急ぐと見られたこと、ウクライナをめぐる地政学リスクなどから下落しました。期末にかけては、約40年ぶりの高い伸び率となった米国CPI（消費者物価指数）を受けたFRBの積極的な金融引き締めスタンスや、上海における都市封鎖を背景とした中国景気減速観測が下押し圧力となった一方、大幅に進んだ円安や株価の割安感が下支えとなり、売り買い交錯となりました。

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日本株マザーファンドの組入比率を高位に維持しました。

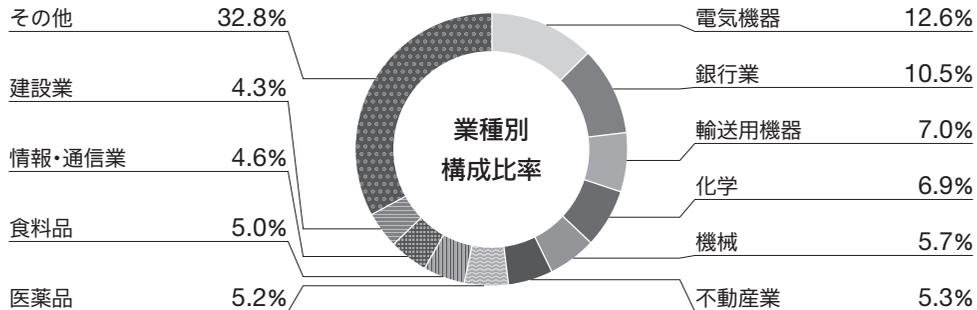
損保ジャパン日本株マザーファンド

期を通して株式の組入比率を高位に維持しました。期末の組入比率は、99.3%です。

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、大和ハウス工業、村田製作所、SUBARUなどです。

主な売却（ウェイトダウン）銘柄は、日本たばこ産業、三菱電機、日鉄ソリューションズなどです。

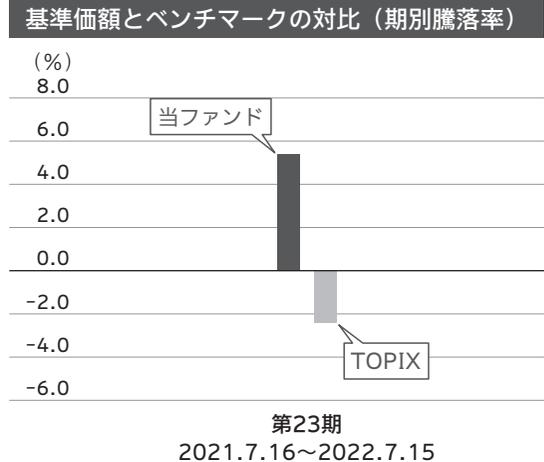


注1. 比率は、第23期末における国内株式の評価総額に対する各業種の評価額の割合。

注2. 端数処理の関係上、構成比合計が100%と異なる場合があります。

● 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（-2.4%）を7.8%上回りました。当ファンドは期を通じて「損保ジャパン日本株マザーファンド」を高位に組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。



損保ジャパン日本株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の騰落率（-2.4%）を9.4%上回りました。

要因別では、業種配分効果、個別銘柄選択効果ともにプラス要因となりました。業種配分効果では保険業、銀行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、海運業、卸売業、鉱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。個別銘柄では、日本電信電話、日揮ホールディングスのオーバーウェイト、ソフトバンクグループのアンダーウェイトなどがプラス要因に、第一三共、トヨタ自動車のアンダーウェイト、大塚商会のオーバーウェイトなどがマイナス要因となりました。

● 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23期 2021.7.16~2022.7.15
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	9,995

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。

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。

● 今後の運用方針

損保ジャパン日本株ファンド

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、中長期的な信託財産の成長を目指します。

損保ジャパン日本株マザーファンド

当社の投資哲学に基づいた運用プロセスを堅持し、独自の株式評価モデルで算出した相対的割安度に基づく銘柄選択を基本方針とします。今後も、固有の割安要因に着目した個別銘柄選択を中心とするポートフォリオ構築によって、中長期的に着実な信託財産の成長を目指します。

● 1万口当たりの費用明細

項目	第23期 2021.7.16~2022.7.15		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	215円	1.540%	(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13,976円です。
（投信会社）	（ 68）	（0.484）	ファンドの運用の対価
（販売会社）	（132）	（0.946）	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）	（ 15）	（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	8	0.060	(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）	（ 8）	（0.060）	
(c) その他費用	2	0.015	(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）	（0.000）	信託事務の処理にかかるその他の費用等
合計	225	1.615	

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。

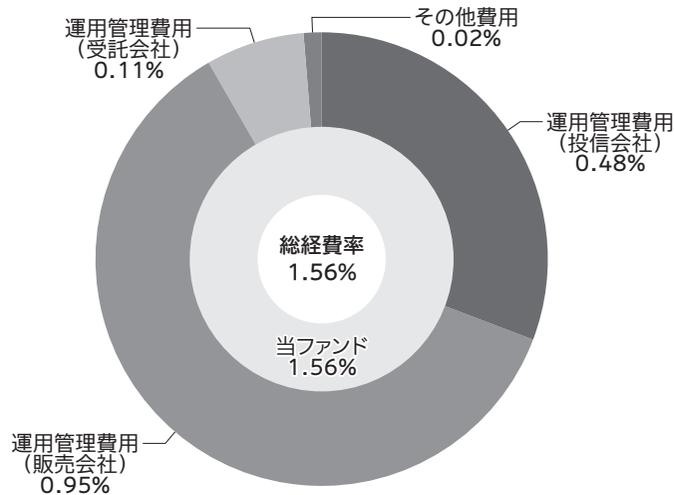
注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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1.56%**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

(2021年7月16日～2022年7月15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
損保ジャパン日本株マザーファンド	千口 58,684	千円 148,140	千口 243,914	千円 603,420

(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

(2021年7月16日～2022年7月15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	
	損保ジャパン日本株マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	3,435,533千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,536,170千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.75	

(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

(2021年7月16日～2022年7月15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

(2022年7月15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
損保ジャパン日本株マザーファンド	千口 1,610,467	千口 1,425,237	千円 3,671,413

(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

(2022年7月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
損保ジャパン日本株マザーファンド	3,671,413	98.4
コール・ローン等、その他	61,128	1.6
投資信託財産総額	3,732,541	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 (2022年7月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,732,541,385
コール・ローン等	61,128,380
損保ジャパン日本株マザーファンド(評価額)	3,671,413,005
(B) 負債	29,122,979
未払解約金	1,638,034
未払信託報酬	27,221,090
未払利息	184
その他未払費用	263,671
(C) 純資産総額(A-B)	3,703,418,406
元本	2,555,640,873
次期繰越損益金	1,147,777,533
(D) 受益権総口数	2,555,640,873口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,491円

(注1) 信託財産に係る期首元本額2,839,651,386円、期中追加設定元本額492,455,050円、期中一部解約元本額776,465,563円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額 1.4491円

○損益の状況 (2021年7月16日～2022年7月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 48,231
支払利息	△ 48,231
(B) 有価証券売買損益	229,674,653
売買益	252,773,511
売買損	△ 23,098,858
(C) 信託報酬等	△ 56,927,750
(D) 当期損益金(A+B+C)	172,698,672
(E) 前期繰越損益金	572,088,050
(F) 追加信託差損益金	402,990,811
(配当等相当額)	(1,807,417,738)
(売買損益相当額)	(△1,404,426,927)
(G) 計(D+E+F)	1,147,777,533
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	1,147,777,533
追加信託差損益金	402,990,811
(配当等相当額)	(1,809,815,178)
(売買損益相当額)	(△1,406,824,367)
分配準備積立金	744,786,722

(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 (2021年7月16日～2022年7月15日) は以下の通りです。

項 目	2021年7月16日～ 2022年7月15日
a. 配当等収益(費用控除後)	82,697,000円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	90,001,672円
c. 信託約款に規定する収益調整金	1,809,815,178円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	572,088,050円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	2,554,601,900円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	9,995円
g. 分配金	0円

損保ジャパン日本株マザーファンド

運用報告書

第24期（決算日 2022年7月5日）

<計算期間 2021年7月6日～2022年7月5日>

損保ジャパン日本株マザーファンドの第24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。 当ファンドの運用は、「東証株価指数（TOPIX）」をベンチマークとし、これを中長期的に上回る運用成果を目指します。
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、取得時において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		T O P I X (東証株価指数)		株組入比率	株先物比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
20期(2018年7月5日)	21,071	5.0	1,676.20	3.6	99.1	—	5,023
21期(2019年7月5日)	20,712	△ 1.7	1,592.58	△ 5.0	99.1	—	4,909
22期(2020年7月6日)	18,866	△ 8.9	1,577.15	△ 1.0	98.3	—	4,159
23期(2021年7月5日)	24,223	28.4	1,948.99	23.6	98.2	—	4,966
24期(2022年7月5日)	25,937	7.1	1,879.12	△ 3.6	98.9	—	4,741

(注1) 株先物比率＝買建比率－売建比率。

(注2) 基準価額は1万円当たり（以下同じ）。

○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	(東証株価指数)		
(期 首)	円	%		%	%
2021年7月5日	24,223	—	1,948.99	—	98.2
7月末	23,637	△2.4	1,901.08	△2.5	99.0
8月末	23,990	△1.0	1,960.70	0.6	99.2
9月末	25,138	3.8	2,030.16	4.2	98.0
10月末	24,572	1.4	2,001.18	2.7	98.2
11月末	23,228	△4.1	1,928.35	△1.1	98.0
12月末	24,187	△0.1	1,992.33	2.2	98.3
2022年1月末	24,480	1.1	1,895.93	△2.7	99.0
2月末	24,566	1.4	1,886.93	△3.2	98.9
3月末	25,275	4.3	1,946.40	△0.1	97.8
4月末	25,232	4.2	1,899.62	△2.5	97.6
5月末	25,577	5.6	1,912.67	△1.9	97.5
6月末	25,961	7.2	1,870.82	△4.0	98.9
(期 末)					
2022年7月5日	25,937	7.1	1,879.12	△3.6	98.9

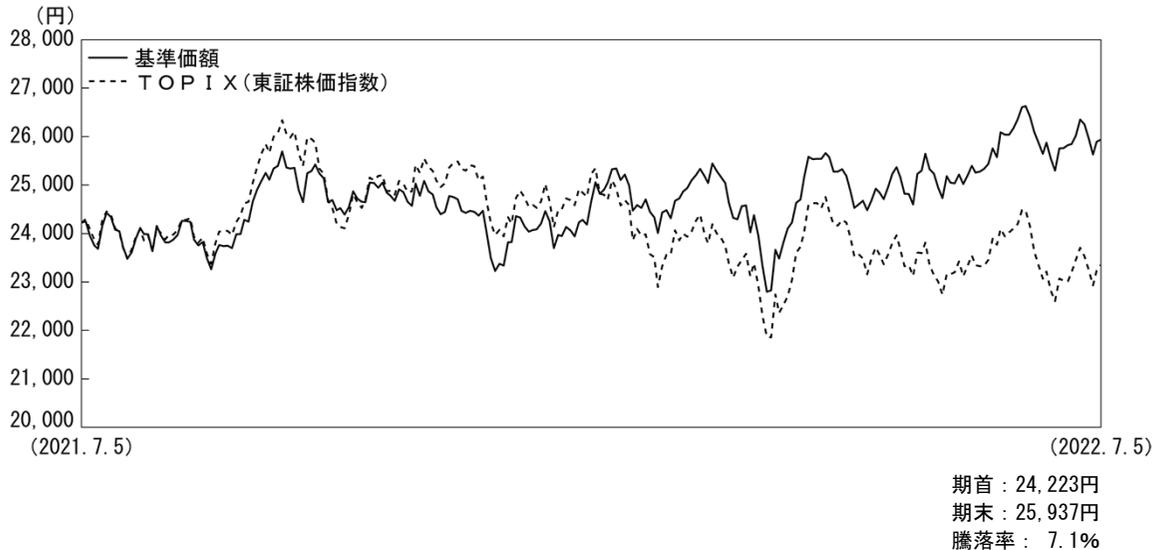
(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

○運用経過

(2021年7月6日～2022年7月5日)

■基準価額の推移



・ベンチマーク（TOPIX（東証株価指数））の推移は、2021年7月5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。

■基準価額の主な変動要因

期中の騰落率は+7.1%となりました。

当期間の国内株式市場は下落したものの、当ファンドのパフォーマンスは堅調に推移し、基準価額は上昇しました。

個別銘柄では、日本電信電話、三菱UFJフィナンシャル・グループ、東京海上ホールディングス、日揮ホールディングス、第一生命ホールディングス、KDDIなどの保有銘柄の上昇が、基準価額上昇に寄与しました。

■投資環境

TOPIXは3.6%の下落となりました。

期初は堅調な経済指標や、菅首相（当時）が自民党総裁選挙への不出馬を表明したことによる国内政治の安定、経済対策への期待の高まりなどから株価は上昇しました。その後は、南アフリカでの新型コロナウイルスのオミクロン株の発見やFRB（米連邦準備理事会）が金融政策正常化を急ぐと見られたこと、ウクライナをめぐる地政学リスクなどから下落しました。期末にかけては、約40年ぶりの高い伸び率となった米国CPI（消費者物価指数）を受けたFRBの積極的な金融引き締めスタンスや、上海における都市封鎖を背景とした中国景気減速観測が下押し圧力となった一方、大幅に進んだ円安や株価の割安感が下支えとなり、売り買い交錯となりました。

TOPIX（東証株価指数）の推移



■当該投資信託のポートフォリオ

期を通して株式の組入比率を高位に維持しました。期末の組入比率は、98.9%です。

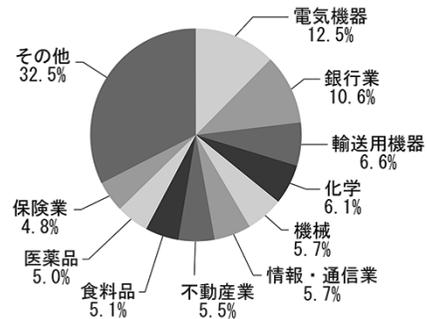
期末時点での業種別構成比率はグラフのとおりです。

当期間中に当社独自の調査分析に基づく割安度に従って、以下の銘柄入れ替えを行いました。

主な購入（ウェイトアップ）銘柄は、大和ハウス工業、SUBARU、村田製作所などです。

主な売却（ウェイトダウン）銘柄は、日本たばこ産業、三菱電機、KDDIなどです。

業種別構成比率



(注1) 比率は、第24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%にならない場合があります。

■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は、ベンチマーク（TOPIX）の騰落率（-3.6%）を10.7%上回りました。

要因別では、業種配分効果、個別銘柄選択効果ともにプラス要因となりました。業種配分効果では保険業、銀行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、海運業、卸売業、鉱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。個別銘柄では、日揮ホールディングス、日本電信電話、第一生命ホールディングスのオーバーウェイトなどがプラス要因に、第一三共、トヨタ自動車のアンダーウェイト、大塚商会のオーバーウェイトなどがマイナス要因となりました。

■今後の運用方針

当社の投資哲学に基づいた運用プロセスを堅持し、独自の株式評価モデルで算出した相対的割安度に基づく銘柄選択を基本方針とします。今後も、固有の割安要因に着目した個別銘柄選択を中心とするポートフォリオ構築によって、中長期的に着実な信託財産の成長を目指します。

○1万口当たりの費用明細

(2021年7月6日～2022年7月5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 14 (14)	% 0.057 (0.057)	(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)	0 (0)	0.000 (0.000)	(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	14	0.057	
期中の平均基準価額は24,653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

(2021年7月6日～2022年7月5日)

株式

国 内	上 場	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
		千株	千円	千株	千円
		840	1,453,003	890	1,818,368
		(36)	(-)		

(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

(2021年7月6日～2022年7月5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	3,271,372千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,536,170千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.72

(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

(2021年7月6日～2022年7月5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

(2022年7月5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 (4.4%)			
コムシスホールディングス	—	4.3	11,197
鹿島建設	34.8	21.9	33,594
西松建設	11.3	—	—
大和ハウス工業	—	19.1	59,935
エクシオグループ	5.8	10.5	22,470
日揮ホールディングス	43.3	45.2	78,693
食料品 (5.1%)			
江崎グリコ	2.6	2.1	8,242
森永乳業	—	6.2	31,310
ヤクルト本社	7.3	2.3	18,055
日本ハム	6.7	9.4	40,514
キリンホールディングス	47.3	53.3	114,461
味の素	12.4	3.6	11,923
キュービー	5.6	7.3	16,790
日本たばこ産業	48	—	—
繊維製品 (3.0%)			
東洋紡	14.2	20.8	21,112
東レ	110.3	111.8	85,404
ワコールホールディングス	12.8	16.5	35,277
パルプ・紙 (1.3%)			
王子ホールディングス	—	61.1	35,438
北越コーポレーション	52	—	—
レンゴー	—	14	10,276
ザ・バック	4.1	6.1	14,005
化学 (6.1%)			
クラレ	19.1	17.5	19,162
旭化成	—	17.8	18,547

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本曹達	3.1	—	—
東亜合成	15.5	14.4	14,904
日本触媒	3.2	4.6	24,012
三菱瓦斯化学	—	15.9	31,259
積水化学工業	14.2	11	20,119
日本ゼオン	—	29.6	39,723
日本化薬	16	18.5	20,220
花王	8.1	10.6	59,402
三洋化成工業	1.6	0.7	3,328
D I C	7.7	7.9	19,228
東洋インキS Cホールディングス	3.7	4.5	8,577
マンダム	5.5	5.2	8,278
医薬品 (5.0%)			
武田薬品工業	30	33.3	127,805
アステラス製薬	23.8	—	—
日本新薬	6.7	6.9	54,579
キョーリン製薬ホールディングス	12.7	11.7	20,884
サワイグループホールディングス	7.8	7.1	29,607
石油・石炭製品 (0.6%)			
ENEOSホールディングス	61	54.7	28,526
ゴム製品 (0.3%)			
横浜ゴム	—	8.6	15,798
ガラス・土石製品 (0.5%)			
A G C	—	1.9	8,968
太平洋セメント	—	5.6	11,160
日本特殊陶業	15	—	—
ニチハ	—	1.9	4,981

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
鉄鋼 (2.1%)			
日本製鉄	44.5	38.1	73,285
JFEホールディングス	12.8	6.8	9,826
大同特殊鋼	2	2	7,060
山陽特殊製鋼	9.7	4.1	7,790
非鉄金属 (0.9%)			
住友電気工業	40.4	28.9	42,136
金属製品 (0.6%)			
SUMCO	8.4	8.1	13,883
横河ブリッジホールディングス	5.5	5.1	10,001
東プレ	6.4	5.9	6,018
機械 (5.7%)			
アマダ	21.6	23.3	23,276
牧野フライス製作所	6.8	6.8	28,560
オーエスジー	16.5	18	29,178
小松製作所	23.7	5.6	16,867
住友重機械工業	16.7	17.1	50,205
日本精工	30	48.7	35,648
ジェイテクト	—	39.4	40,306
THK	—	16.6	43,442
IHI	5.1	—	—
電気機器 (12.5%)			
日立製作所	12.4	8.2	53,242
三菱電機	56.6	13	19,045
明電舎	11.1	8.7	17,739
マブチモーター	—	8	28,600
日新電機	17.9	16.7	23,780
日本電気	—	2.4	13,080
セイコーエプソン	23	12.8	24,537
EIZO	8.5	8	30,200
TDK	—	10.2	39,984
アルプスアルパイン	12.8	21.6	28,771
日本航空電子工業	13.8	12.4	25,407
コーセル	14.3	13	10,803
イリソ電子工業	—	2	6,380
スタンレー電気	—	11.1	24,309
ウシオ電機	24.2	—	—
カシオ計算機	—	24.2	30,540
ファナック	3.6	4.7	100,885

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
京セラ	6.2	5.7	40,395
村田製作所	—	6.3	45,952
ニチコン	—	17.1	20,605
輸送用機器 (6.6%)			
ユニプレス	10.1	0.4	322
デンソー	3.5	1.6	11,224
いすゞ自動車	17.2	16	23,488
トヨタ自動車	5.9	27.4	57,992
アイシン	3.4	5.4	22,464
本田技研工業	28.9	26.7	85,520
SUBARU	—	22.9	53,940
豊田合成	—	14.6	30,441
エフ・シー・シー	9	8.2	10,824
テイ・エス テック	9.5	8.6	12,194
精密機器 (0.8%)			
シチズン時計	112	72	39,312
その他製品 (0.5%)			
トッパン・フォームズ	11.6	—	—
リンテック	8.6	9.7	22,533
電気・ガス業 (2.6%)			
中部電力	47.5	19.5	27,280
沖縄電力	3	2.5	3,297
東京瓦斯	37.8	34.8	89,018
大阪瓦斯	20.1	—	—
陸運業 (4.0%)			
京成電鉄	7.4	10.4	37,648
東日本旅客鉄道	13	12.4	84,282
ヤマトホールディングス	—	15.1	33,204
セイノーホールディングス	30.5	30.6	34,272
情報・通信業 (5.7%)			
日鉄ソリューションズ	15.7	—	—
フジ・メディア・ホールディングス	13.2	—	—
大塚商会	10.9	13.3	54,264
ネットワンシステムズ	—	7.7	23,908
日本テレビホールディングス	37.2	12.4	15,462
日本電信電話	62.7	23.2	90,410
KDDI	37.9	15	64,560
SCSK	5.3	7	16,310

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
卸売業 (3.4%)			
コメダホールディングス	5.7	—	—
日本ライフライン	28.4	28.5	26,220
三菱商事	21.4	17.5	69,650
東邦ホールディングス	13.1	13.2	27,535
トラスコ中山	4.9	10.1	17,866
スズケン	4.1	4.5	17,122
小売業 (4.0%)			
エービーシー・マート	—	2.2	12,804
J. フロント リテイリング	14.1	—	—
ドトール・日レスホールディングス	8.5	7.7	11,827
ツルハホールディングス	—	3.1	22,568
ユナイテッドアローズ	19.5	18.2	35,399
コメリ	11.9	11.1	29,082
青山商事	10.7	9.8	8,633
イズミ	4.6	6.3	18,881
ケーズホールディングス	21.1	19.5	26,520
ヤマダホールディングス	26.3	24.3	11,907
パローホールディングス	—	5.3	9,677
銀行業 (10.6%)			
めぶきフィナンシャルグループ	—	115.1	30,846
西日本フィナンシャルホールディングス	14.5	19.4	14,705
第四北越フィナンシャルグループ	—	2.7	6,801
ひろぎんホールディングス	15.7	13.7	8,740
三菱UFJフィナンシャル・グループ	278.5	235	174,605
三井住友トラスト・ホールディングス	18.8	17.4	74,924
三井住友フィナンシャルグループ	35.7	33	135,168
群馬銀行	14.4	32.4	12,441
七十七銀行	2.9	2.7	4,822

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
八十二銀行	24.6	22.8	11,422	
伊予銀行	—	18.4	12,493	
北洋銀行	58.5	54.1	12,334	
保険業 (4.8%)				
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	22	16.5	71,461	
第一生命ホールディングス	55.1	30.6	77,310	
東京海上ホールディングス	14.7	9.1	74,055	
その他金融業 (0.9%)				
クレディセゾン	29.1	26.9	42,259	
リコーリース	0.6	—	—	
不動産業 (5.5%)				
野村不動産ホールディングス	7.4	5.5	18,040	
パーク24	16.5	15.3	27,846	
三井不動産	32.9	32.6	93,301	
三菱地所	51.6	47.8	93,018	
ダイビル	14.7	—	—	
イオンモール	—	16	26,544	
サービス業 (2.5%)				
UTグループ	—	15.5	37,308	
総合警備保障	—	8.4	31,164	
H. U. グループホールディングス	9.3	6.4	18,995	
エン・ジャパン	4.4	3.1	5,651	
ベルシステム24ホールディングス	—	7.3	10,351	
メイテック	5.9	6.3	14,263	
合 計	株 数 ・ 金 額	2,611	2,598	4,690,266
	銘柄数 < 比率 >	122	142	< 98.9% >

(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

(2022年7月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	4,690,266	98.9
コール・ローン等、その他	51,943	1.1
投資信託財産総額	4,742,209	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 (2022年7月5日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,742,209,662
コール・ローン等	44,851,842
株式(評価額)	4,690,266,020
未収入金	720,600
未収配当金	6,371,200
(B) 負債	1,007,901
未払金	1,006,979
その他未払費用	922
(C) 純資産総額(A-B)	4,741,201,761
元本	1,827,990,939
次期繰越損益金	2,913,210,822
(D) 受益権総口数	1,827,990,939口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,937円

(注1) 信託財産に係る期首元本額2,050,269,721円、期中追加設定元本額101,671,244円、期中一部解約元本額323,950,026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

損保ジャパン日本株オープン	153,545,164円
損保ジャパン日本株ファンド	1,425,237,968円
損保ジャパン日本株オープン(DC年金)	249,207,807円

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 2.5937円

○損益の状況 (2021年7月6日~2022年7月5日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	143,700,969
受取配当金	143,728,244
受取利息	49
その他収益金	24,733
支払利息	△ 52,057
(B) 有価証券売買損益	176,997,547
売買益	468,055,044
売買損	△ 291,057,497
(C) 保管費用等	△ 1,637
(D) 当期損益金(A+B+C)	320,696,879
(E) 前期繰越損益金	2,916,125,161
(F) 追加信託差損益金	152,438,756
(G) 解約差損益金	△ 476,049,974
(H) 計(D+E+F+G)	2,913,210,822
次期繰越損益金(H)	2,913,210,822

(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。