

## 損保ジャパン SRIオープン 〈愛称〉未来のちから

第17期（決算日 2021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	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。 ②企業の社会的責任に着目します。 ③相対的に割安と評価される銘柄に投資します。	
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	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。 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。 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。	

### 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17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)	税金分配	み騰落	騰落率	(東証株価指数)			
	円	円	騰落率			%	%	百万円
13期(2017年12月8日)	11,544	1,000	11.0	1,803.73	19.2	97.1	—	1,567
14期(2018年12月10日)	10,077	0	△12.7	1,589.81	△11.9	96.6	—	1,378
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

(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) 2020年12月8日	円	%		%	%	%
	9,875	—	1,758.81	—	97.6	—
12月末	10,031	1.6	1,804.68	2.6	98.3	—
2021年1月末	10,044	1.7	1,808.78	2.8	98.4	—
2月末	10,517	6.5	1,864.49	6.0	97.8	—
3月末	11,193	13.3	1,954.00	11.1	98.0	—
4月末	10,891	10.3	1,898.24	7.9	97.2	—
5月末	11,186	13.3	1,922.98	9.3	97.3	—
6月末	11,226	13.7	1,943.57	10.5	97.1	—
7月末	10,898	10.4	1,901.08	8.1	97.5	—
8月末	11,277	14.2	1,960.70	11.5	97.5	—
9月末	11,801	19.5	2,030.16	15.4	97.0	—
10月末	11,623	17.7	2,001.18	13.8	97.3	—
11月末	11,115	12.6	1,928.35	9.6	97.0	—
(期末) 2021年12月8日	11,528	16.7	2,002.24	13.8	97.9	—

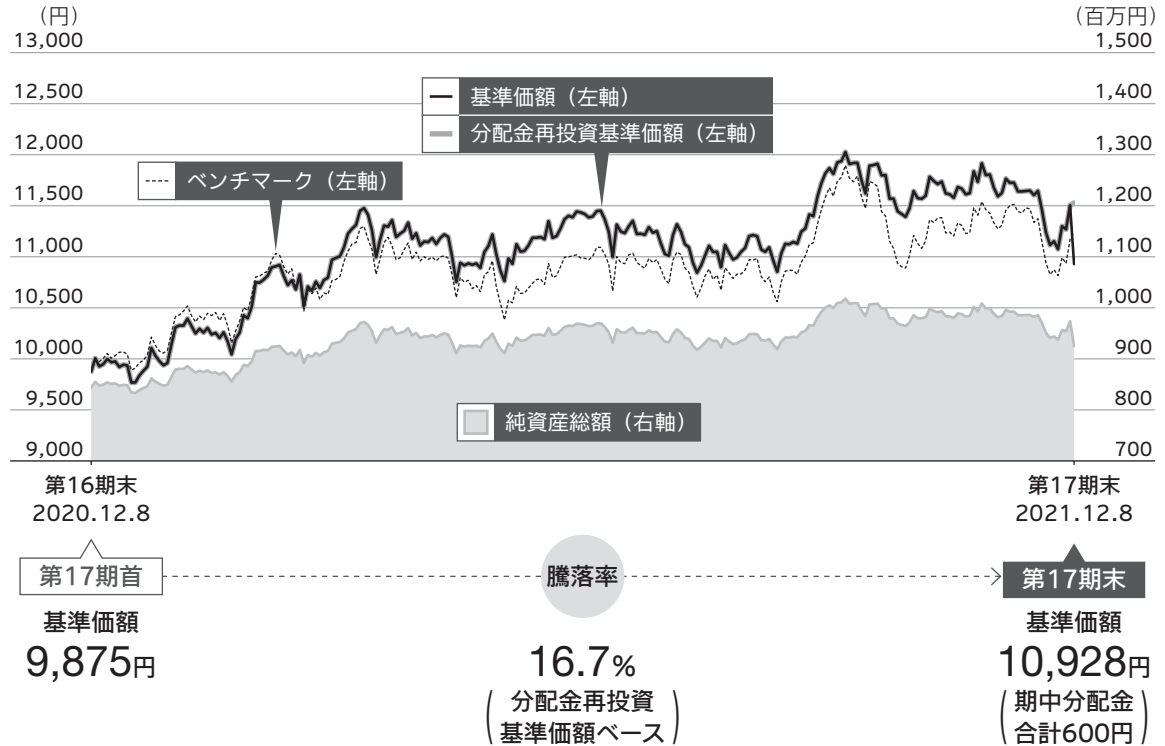
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(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、2020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+18.9%となりました。

国内株式市場が上昇したため、期を通し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、味の素、シチズン時計、野村総合研究所、第一生命ホールディングス、日本電信電話、デンソー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

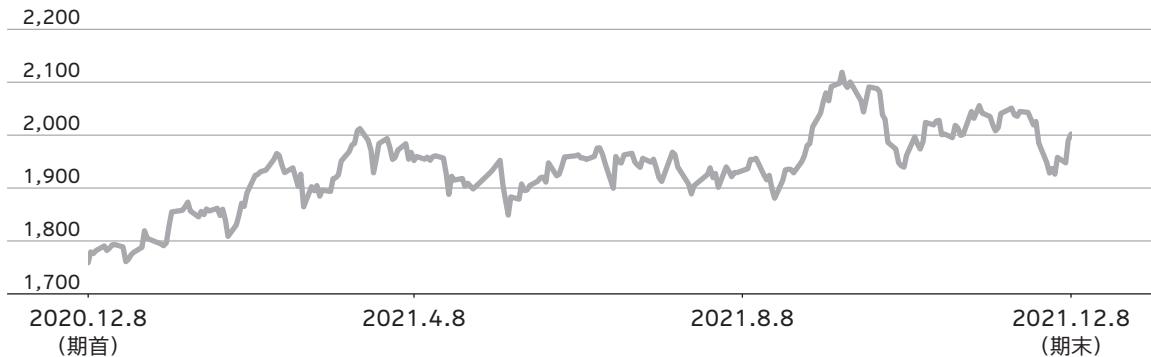
TOPIXは13.8%の上昇となりました。

期初は、海外での新型コロナウイルスのワクチン投与開始や米国の追加経済対策の決定などが好感され、上昇しました。

その後は、国内でのワクチン接種の遅れや新型コロナウイルスの感染再拡大、東京オリンピック開催を巡る不透明感が重しとなり、ほぼ横ばいで推移する局面が続きました。

2021年8月の末には、新規感染者数がピークアウトしたことや、支持率が低迷する菅首相が自民党総裁選挙への不出馬を表明し国内政治の安定継続への期待が高まったことから、上昇に転じました。しかし、原油など資源価格が高騰すると経済への悪影響や利上げ時期の前倒しが懸念され、上昇幅が縮小しました。期末には新たな新型コロナウイルスの変異株が発見され、世界的な感染拡大への警戒感が高まり、さらに上昇幅を縮小して取引を終えました。

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

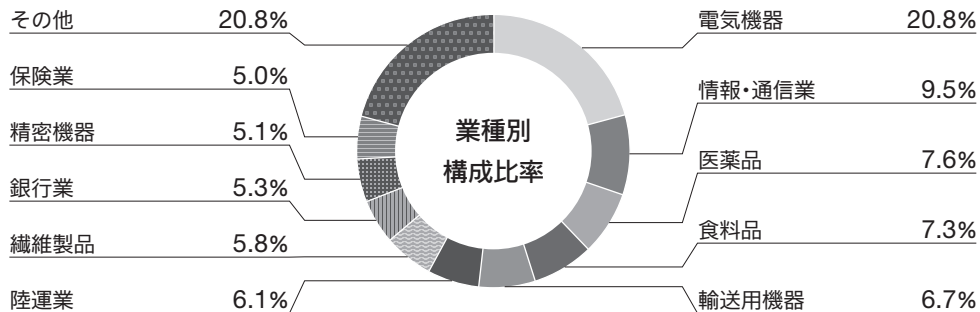
期を通して損保ジャパンSRIマザーファンドの組入比率を高位に維持しました。

### 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。

当期間中に独自の調査分析に基づく割安度にしたがって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、富士電機、東レ、日本触媒など、主な売却（ウェイトダウン）銘柄は、SUMCO、シスメックス、日本酸素ホールディングスなどです。

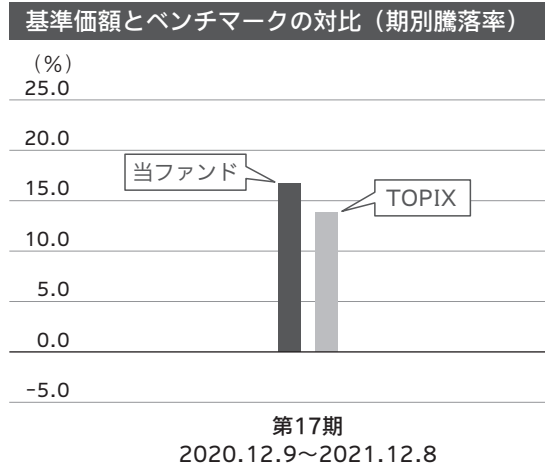


注1. 比率は、第17期末における国内株式の評価総額に対する各業種の評価額の割合。

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。

## ● 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（+13.8%）を2.9%上回りました。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（+16.3%）を2.6%上回りました。

要因別では、業種配分効果はマイナス要因、個別銘柄選択効果はプラス要因となりました。業種配分効果は、その他製品、電気・ガス業のアンダーウェイト、海運業のオーバーウェイトなどがプラス要因、医薬品、陸運業のオーバーウェイト、卸売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。

個別銘柄選択効果ではシチズン時計、味の素、ウシオ電機のオーバーウェイトなどがプラス要因、キリンホールディングス、三菱地所のオーバーウェイト、トヨタ自動車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17期 2020.12.9~2021.12.8
当期分配金	600
(対基準価額比率)	5.205%
当期の収益	247
当期の収益以外	352
翌期繰越分配対象額	2,071

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<sup>※</sup>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17期 2020.12.9~2021.12.8		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	181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10,983円です。
( 投信会社 )	( 85 )	( 0.770 )	ファンドの運用の対価
( 販売会社 )	( 85 )	( 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 )	( 12 )	( 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	7	0.062	(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 )	( 7 )	( 0.062 )	
(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	190	1.727	

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。

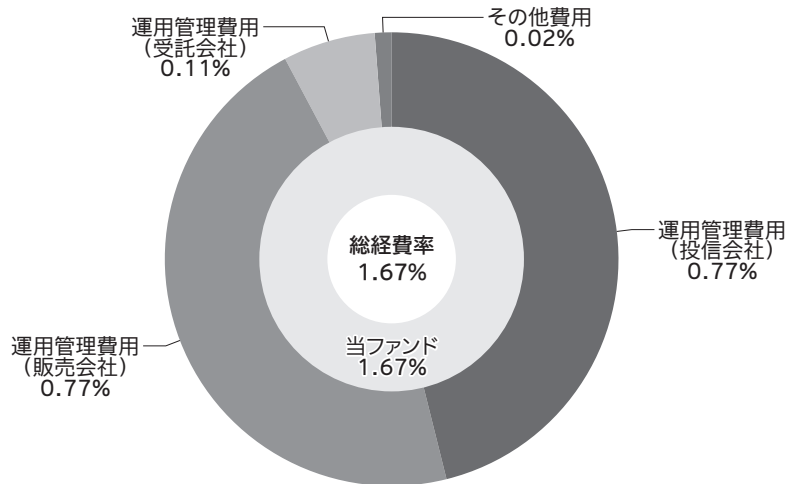
注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(2020年12月9日～2021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 -	千円 -	千口 29,634	千円 77,270

(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

(2020年12月9日～2021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	863,034千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	907,826千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.95	

(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

(2020年12月9日～2021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

(2021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 372,446	千口 342,812	千円 916,201

(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

(2021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 916,201	% 93.1
コール・ローン等、その他	67,863	6.9
投資信託財産総額	984,064	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 (2021年12月8日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	984,064,541
コール・ローン等	16,233,373
損保ジャパンSRIマザーファンド(評価額)	916,201,168
未収入金	51,630,000
(B) 負債	58,864,053
未払収益分配金	50,796,242
未払解約金	22
未払信託報酬	7,995,848
未払利息	42
その他未払費用	71,899
(C) 純資産総額(A-B)	925,200,488
元本	846,604,043
次期繰越損益金	78,596,445
(D) 受益権総口数	846,604,043口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,928円

(注1) 信託財産に係る期首元本額854,571,770円、期中追加設定元本額2,468,940円、期中一部解約元本額10,436,667円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額 1.0928円

○損益の状況 (2020年12月9日～2021年12月8日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 10,921
支払利息	△ 10,921
(B) 有価証券売買損益	155,245,324
売買益	156,112,066
売買損	△ 866,742
(C) 信託報酬等	△ 15,630,409
(D) 当期損益金(A+B+C)	139,603,994
(E) 前期繰越損益金	△ 13,821,306
(F) 追加信託差損益金	3,609,999
(配当等相当額)	( 37,079,019)
(売買損益相当額)	(△ 33,469,020)
(G) 計(D+E+F)	129,392,687
(H) 収益分配金	△ 50,796,242
次期繰越損益金(G+H)	78,596,445
追加信託差損益金	3,609,999
(配当等相当額)	( 37,085,466)
(売買損益相当額)	(△ 33,475,467)
分配準備積立金	138,287,034
繰越損益金	△ 63,300,588

(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 (2020年12月9日～2021年12月8日) は以下の通りです。

項 目	2020年12月9日～ 2021年12月8日
a. 配当等収益(費用控除後)	20,967,090円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	37,085,466円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	168,116,186円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	226,168,742円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,671円
g. 分配金	50,796,242円
h. 分配金(1万口当たり)	600円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	600円
----------------	------

# 損保ジャパンSRIマザーファンド

## 運用報告書

第17期（決算日 2021年12月8日）

<計算期間 2020年12月9日～2021年12月8日>

損保ジャパンSRIマザーファンドの第17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）		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
	円	騰 落 中 率	(配当込み)	騰 落 中 率			
13期(2017年12月8日)	25,121	12.9	2,622.46	21.8	98.1	—	百万円 1,550
14期(2018年12月10日)	22,259	△11.4	2,361.60	△9.9	97.6	—	1,364
15期(2019年12月9日)	23,886	7.3	2,623.16	11.1	97.7	—	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

(注1) 基準価額は1万口当たり（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	(配当込み) 騰 落 率		
(期 首)	円	%	%	%	%
2020年12月8日	22,483	—	2,744.78	—	98.4
12月末	22,862	1.7	2,819.93	2.7	99.3
2021年1月末	22,924	2.0	2,826.50	3.0	99.4
2月末	24,042	6.9	2,914.58	6.2	98.8
3月末	25,642	14.1	3,080.87	12.2	98.7
4月末	24,978	11.1	2,993.46	9.1	98.0
5月末	25,698	14.3	3,034.76	10.6	98.2
6月末	25,826	14.9	3,070.81	11.9	97.9
7月末	25,099	11.6	3,003.91	9.4	98.4
8月末	26,017	15.7	3,099.08	12.9	98.2
9月末	27,273	21.3	3,234.08	17.8	97.9
10月末	26,895	19.6	3,188.28	16.2	98.0
11月末	25,747	14.5	3,073.26	12.0	97.9
(期 末)					
2021年12月8日	26,726	18.9	3,191.01	16.3	98.9

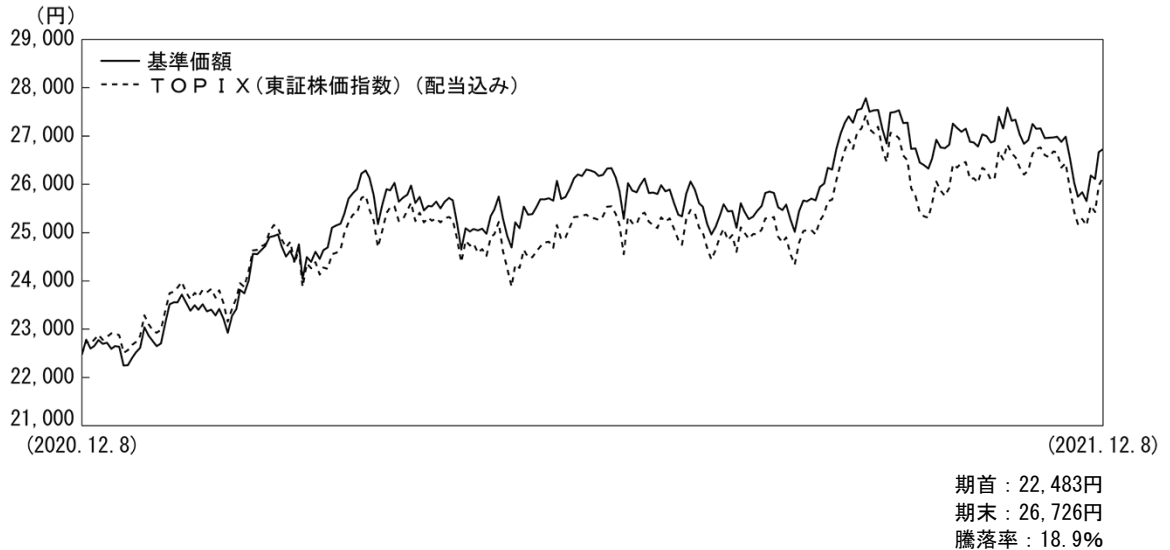
(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

## ○運用経過

(2020年12月9日～2021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、2020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 8をご参照下さい。

## ○1万口当たりの費用明細

(2020年12月9日～2021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 )	16 (16)	0.062 (0.062)	(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	16	0.062	
期中の平均基準価額は25,250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

(2020年12月9日～2021年12月8日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		185	406,334	164	456,700
		( 17)	( -)		

(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

(2020年12月9日～2021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	863,034千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	907,826千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.95

(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

(2020年12月9日～2021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

(2021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
<b>建設業 (2.3%)</b>			
エクシオグループ	5.7	8.5	21,301
<b>食料品 (7.3%)</b>			
キリンホールディングス	14.1	18.7	35,174
味の素	12.3	8.9	30,687
<b>繊維製品 (5.8%)</b>			
東レ	—	42.4	29,841
ワコールホールディングス	12	10.8	23,144
<b>化学 (5.0%)</b>			
日本酸素ホールディングス	11.9	—	—
日本触媒	—	5	26,550
花王	2.8	3.1	18,804
富士フイルムホールディングス	2.2	—	—
マンダム	7.3	—	—
<b>医薬品 (7.6%)</b>			
武田薬品工業	7	7.3	22,870
沢井製薬	4.3	—	—
第一三共	5.4	7.8	21,945
サワイグループホールディングス	—	5.3	23,876
<b>鉄鋼 (1.9%)</b>			
日本製鉄	6.8	9.2	17,259
<b>非鉄金属 (2.0%)</b>			
住友電気工業	16.4	11.4	17,715
<b>金属製品 (—%)</b>			
SUMCO	13.2	—	—
<b>機械 (1.4%)</b>			
小松製作所	11.2	4.5	12,557
クボタ	6.6	—	—
<b>電気機器 (20.8%)</b>			
富士電機	—	5.1	31,161
日本電産	1.8	1.4	18,760
日本電気	—	4.7	25,427
セイコーエプソン	13.2	9.6	19,190
EIZO	—	4.2	17,556
アンリツ	4.8	9	16,110
富士通ゼネラル	—	5	13,630
ソニーグループ	2.6	1.5	21,405
TDK	1.2	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
シスメックス	2.1	—	—	
ウシオ電機	—	12	25,152	
<b>輸送用機器 (6.7%)</b>				
デンソー	4.7	1.9	16,598	
いすゞ自動車	—	11.3	17,492	
豊田合成	—	10.7	26,418	
<b>精密機器 (5.1%)</b>				
オリンパス	9	8	20,236	
シチズン時計	47.9	48.1	26,070	
<b>陸運業 (6.1%)</b>				
東日本旅客鉄道	3.7	4.8	34,320	
日本通運	3.3	3.2	21,120	
<b>海運業 (—%)</b>				
日本郵船	3.8	—	—	
<b>情報・通信業 (9.5%)</b>				
野村総合研究所	7.1	4.8	23,688	
日本電信電話	15.6	11.7	36,480	
S C S K	3.6	11.2	25,580	
<b>小売業 (2.7%)</b>				
J. フロント リテイリング	32.7	24.8	24,204	
<b>銀行業 (5.3%)</b>				
三井住友トラスト・ホールディングス	9.2	8.3	32,204	
三井住友フィナンシャルグループ	—	4	15,620	
<b>保険業 (5.0%)</b>				
第一生命ホールディングス	15.3	13.6	32,334	
東京海上ホールディングス	2.6	2.2	13,371	
<b>その他金融業 (—%)</b>				
日立キャピタル	6.6	—	—	
<b>不動産業 (3.8%)</b>				
三菱地所	18.5	21.8	34,487	
<b>サービス業 (1.7%)</b>				
セコム	1.5	2	15,608	
合 計	株数・金額	350	387	905,953
	銘柄数<比率>	38	39	<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

(2021年12月8日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	905,953	93.6
コール・ローン等、その他	61,894	6.4
投資信託財産総額	967,847	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 (2021年12月8日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	967,847,935
コール・ローン等	18,551,014
株式(評価額)	905,953,870
未収入金	42,349,051
未収配当金	994,000
(B) 負債	51,630,048
未払解約金	51,630,000
未払利息	48
(C) 純資産総額(A-B)	916,217,887
元本	342,812,680
次期繰越損益金	573,405,207
(D) 受益権総口数	342,812,680口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,726円

(注1) 信託財産に係る期首元本額372,446,776円、期中追加設定元本額0円、期中一部解約元本額29,634,096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 342,812,680円

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 2.6726円

○損益の状況 (2020年12月9日～2021年12月8日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	23,353,009
受取配当金	23,358,600
その他収益金	3,046
支払利息	△ 8,637
(B) 有価証券売買損益	132,780,540
売買益	184,337,892
売買損	△ 51,557,352
(C) 保管費用等	△ 32
(D) 当期損益金(A+B+C)	156,133,517
(E) 前期繰越損益金	464,907,594
(F) 解約差損益金	△ 47,635,904
(G) 計(D+E+F)	573,405,207
次期繰越損益金(G)	573,405,207

(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) 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。