

損保ジャパン
SRIオープン
〈愛称〉 未来のちから

■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。	

第20期（決算日 2024年12月9日）

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20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株式会社

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 (分配落)	価 額			T O P I X		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 金 騰 落	中 率 騰 落	(東証株価指数)	期 中 騰 落 率			
	円	円		%		%	%	%	百万円
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
20期(2024年12月 9 日)	12, 217	1, 000	12. 9		2, 734. 56	17. 6	95. 5	—	83

- (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 万円当たり (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。

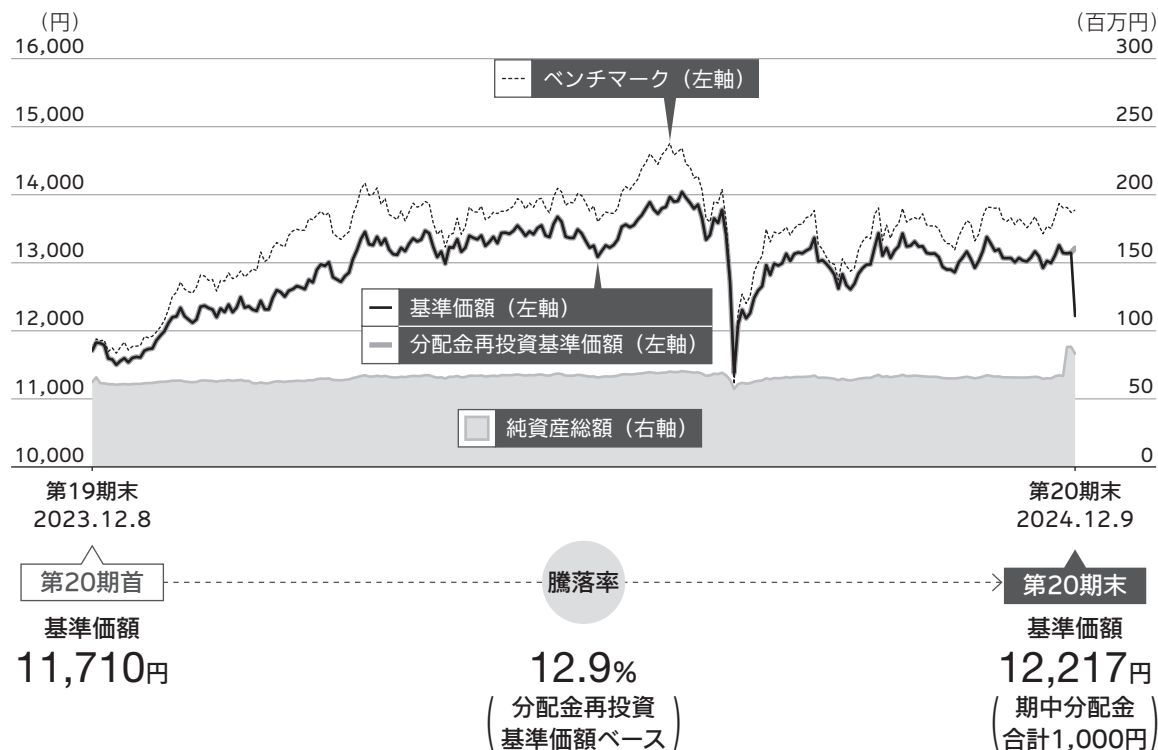
○当期中の基準価額と市況等の推移

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	(東証株価指数)	騰 落 率		
(期 首)	円		%		%	%	%
2023年12月 8 日	11, 710	—		2, 324. 47	—	93. 6	—
12月末	11, 740	0. 3		2, 366. 39	1. 8	94. 5	—
2024年 1 月 末	12, 386	5. 8		2, 551. 10	9. 7	95. 9	—
2 月 末	12, 613	7. 7		2, 675. 73	15. 1	96. 1	—
3 月 末	13, 353	14. 0		2, 768. 62	19. 1	94. 9	—
4 月 末	13, 398	14. 4		2, 743. 17	18. 0	96. 2	—
5 月 末	13, 571	15. 9		2, 772. 49	19. 3	95. 9	—
6 月 末	13, 553	15. 7		2, 809. 63	20. 9	96. 1	—
7 月 末	13, 779	17. 7		2, 794. 26	20. 2	96. 3	—
8 月 末	13, 180	12. 6		2, 712. 63	16. 7	96. 0	—
9 月 末	13, 105	11. 9		2, 645. 94	13. 8	95. 3	—
10月 末	13, 059	11. 5		2, 695. 51	16. 0	95. 6	—
11月 末	12, 997	11. 0		2, 680. 71	15. 3	96. 3	—
(期 末)							
2024年12月 9 日	13, 217	12. 9		2, 734. 56	17. 6	95. 5	—

- (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、2023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+14.9%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、大林組、三井住友フィナンシャルグループ、三井住友トラストグループ、第一生命ホールディングス、りそなホールディングス、東レ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

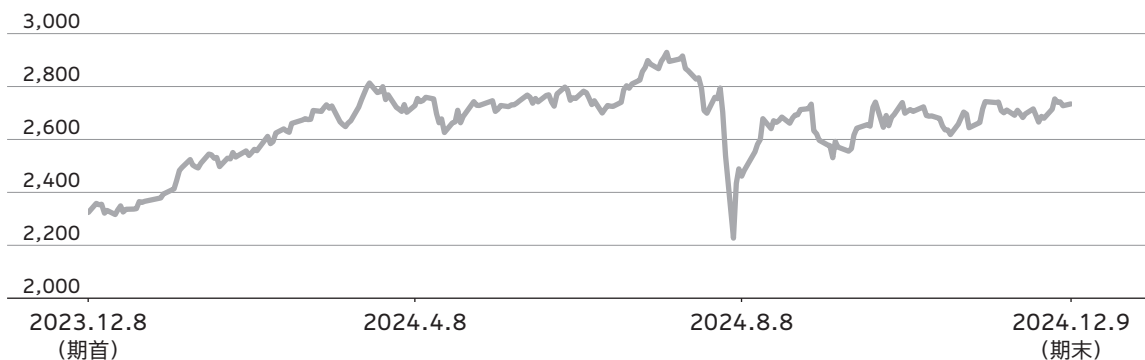
● 投資環境

TOPIXは17.6%の上昇となりました。

期初は堅調な企業業績、ガバナンスや資本効率改善期待などを背景に海外からの資金流入が加速し、国内株式市場は大きく上昇しました。その後も米国インフレ率鈍化による利下げ期待や、積極的な株主還元などが下支え要因となり、堅調な推移が続きました。2024年8月には米国景気後退懸念や日銀による利上げを受けて日米金利差が縮小し、急激に円高米ドル安が進んだことで急落する場面もあったものの、その後の堅調な米国の経済指標や企業業績推移などを背景に市場は落ち着きを取り戻しました。

期末にかけては国内外経済および政治動向の不透明感からやや変動幅の大きい不安定な相場となりました。

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95.5%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。

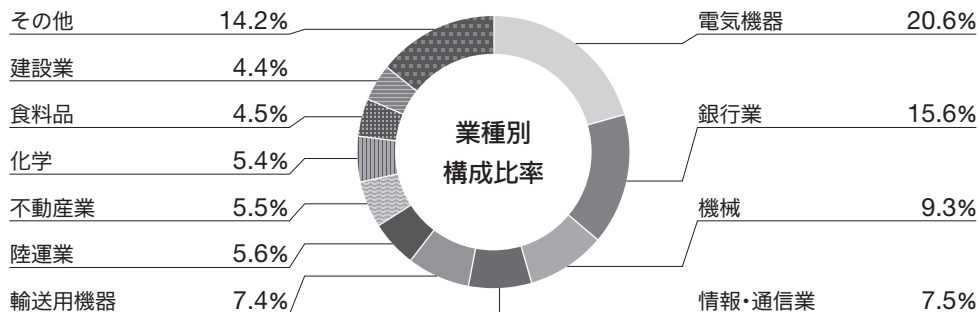


損保ジャパンSRIマザーファンド

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、めぶきフィナンシャルグループ、山陰合同銀行、アステラス製薬など、主な売却（ウェイトダウン）銘柄は、富士通、サワイグループホールディングス、第一生命ホールディングスなどです。



注1. 比率は、第20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。

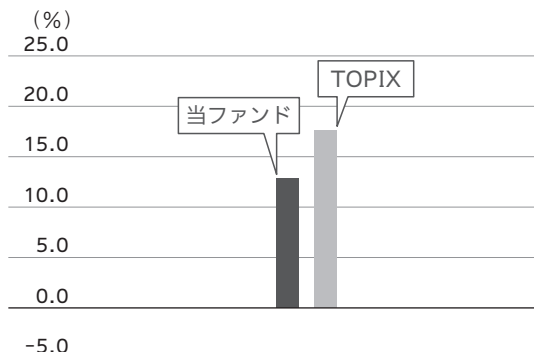
スチュワードシップ方針

- ・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（+17.6%）を4.8%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。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



第20期
2023.12.9～2024.12.9

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（+20.4%）を5.5%下回りました。

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

個別銘柄寄与度では大林組、りそなホールディングス、三井住友トラストグループのオーバーウェイトなどがプラス要因、ヤマトホールディングス、SUMCOのオーバーウェイト、日立製作所のアンダーウェイトなどがマイナス要因となり、全体ではマイナスとなりました。

● 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20期 2023.12.9～2024.12.9
当期分配金	1,000
(対基準価額比率)	7.566%
当期の収益	1,000
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,216

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

2025年1月30日の繰上償還に向けて償還手続きを進める予定です。

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20期 2023.12.9～2024.12.9		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	216円	1.655%	(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13,061円です。
（投信会社）	（101）	（0.772）	ファンドの運用の対価
（販売会社）	（101）	（0.772）	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）	（14）	（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	13	0.101	(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）	（13）	（0.101）	
(c) その他費用	2	0.012	(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）	（1）	（0.011）	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）	（0.001）	信託事務の処理にかかるその他の費用等
合計	231	1.768	

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。

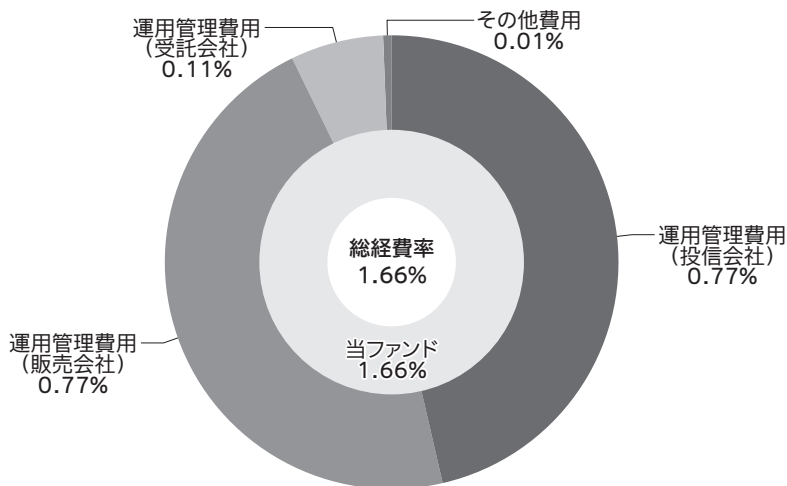
注2．金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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1.66%**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

(2023年12月9日～2024年12月9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
	千口	千円	千口	千円
損保ジャパンSRIマザーファンド	5,485	20,810	2,551	9,030

(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

(2023年12月9日～2024年12月9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	76,299千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	63,131千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.20

(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

(2023年12月9日～2024年12月9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

(2024年12月9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
	千口	千口	千円
損保ジャパンSRIマザーファンド	18,190	21,124	82,432

(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

(2024年12月9日現在)

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
	千円	%
損保ジャパンSRIマザーファンド	82,432	90.6
コール・ローン等、その他	8,591	9.4
投資信託財産総額	91,023	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 (2024年12月9日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	91,023,935
コール・ローン等	8,591,296
損保ジャパンSRIマザーファンド(評価額)	82,432,614
未収利息	25
(B) 負債	7,763,037
未払収益分配金	6,815,164
未払解約金	397,375
未払信託報酬	547,377
その他未払費用	3,121
(C) 純資産総額(A－B)	83,260,898
元本	68,151,641
次期繰越損益金	15,109,257
(D) 受益権総口数	68,151,641口
1万口当たり基準価額(C／D)	12,217円

(注1) 信託財産に係る期首元本額53,292,863円、期中追加設定元本額23,629,797円、期中一部解約元本額8,771,019円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額 1.2217円

○損益の状況 (2023年12月9日～2024年12月9日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	321
受取利息	443
支払利息	△ 122
(B) 有価証券売買損益	8,465,375
売買益	8,881,736
売買損	△ 416,361
(C) 信託報酬等	△ 1,093,535
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	7,372,161
(E) 前期繰越損益金	5,402,602
(F) 追加信託差損益金	9,149,658
(配当等相当額)	(7,767,290)
(売買損益相当額)	(1,382,368)
(G) 計(D＋E＋F)	21,924,421
(H) 収益分配金	△ 6,815,164
次期繰越損益金(G＋H)	15,109,257
追加信託差損益金	9,149,658
(配当等相当額)	(7,778,186)
(売買損益相当額)	(1,371,472)
分配準備積立金	5,959,599

(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 (2023年12月9日～2024年12月9日) は以下の通りです。

項 目	2023年12月9日～ 2024年12月9日
a. 配当等収益(費用控除後)	1,523,416円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	5,848,745円
c. 信託約款に規定する収益調整金	9,149,658円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	5,402,602円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	21,924,421円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,216円
g. 分配金	6,815,164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。

※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。

損保ジャパンSRIマザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2024年12月9日）

＜計算期間 2023年12月9日～2024年12月9日＞

損保ジャパンSRIマザーファンドの第20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 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
16期(2020年12月8日)	22,483	△ 5.9	4.6	98.4	—	837
17期(2021年12月8日)	26,726	18.9	16.3	98.9	—	916
18期(2022年12月8日)	27,950	4.6	△ 0.4	96.8	—	53
19期(2023年12月8日)	33,959	21.5	22.8	94.5	—	61
20期(2024年12月9日)	39,023	14.9	20.4	96.4	—	82

（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	T O P I X（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	%		%	%	%
2023年12月 8 日	33,959	—	3,901.95	—	94.5	—
12月末	34,085	0.4	3,977.63	1.9	95.5	—
2024年 1 月末	36,023	6.1	4,288.36	9.9	96.9	—
2 月末	36,736	8.2	4,499.61	15.3	97.2	—
3 月末	38,966	14.7	4,699.20	20.4	95.9	—
4 月末	39,156	15.3	4,656.27	19.3	97.2	—
5 月末	39,722	17.0	4,710.15	20.7	96.8	—
6 月末	39,721	17.0	4,778.56	22.5	97.0	—
7 月末	40,450	19.1	4,752.72	21.8	97.2	—
8 月末	38,714	14.0	4,615.06	18.3	97.0	—
9 月末	38,545	13.5	4,544.38	16.5	96.1	—
10月末	38,462	13.3	4,629.83	18.7	96.3	—
11月末	38,327	12.9	4,606.07	18.0	97.2	—
(期 末)						
2024年12月 9 日	39,023	14.9	4,698.60	20.4	96.4	—

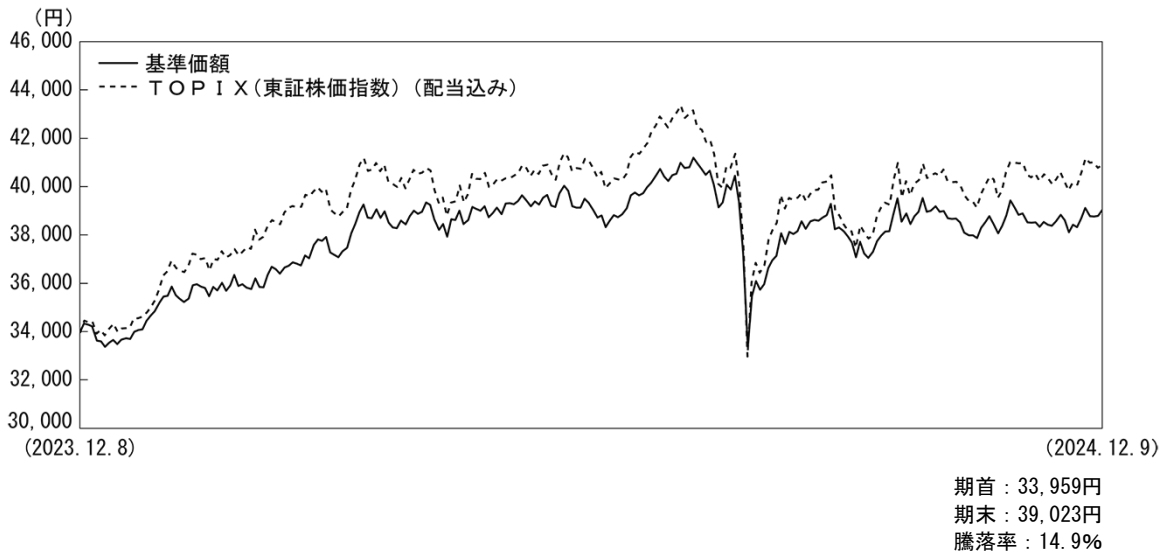
(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

○運用経過

(2023年12月9日～2024年12月9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、2023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。

P2～P9をご参照下さい。

○1万口当たりの費用明細

(2023年12月9日～2024年12月9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 39 (39)	% 0.102 (0.102)	(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)	0.001 (0.001)	(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	39	0.103	
期中の平均基準価額は38,242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

(2023年12月9日～2024年12月9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	33	45,120	13	31,179
		(3)	(ー)		

(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

(2023年12月9日～2024年12月9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	76,299千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	63,131千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.20

(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

(2023年12月9日～2024年12月9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

(2024年12月9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%)			
大林組	1.8	0.3	625
清水建設	—	1.2	1,433
大気社	—	0.3	1,413
食料品 (4.5%)			
森永乳業	0.4	0.2	589
キリンホールディングス	1	1.4	2,972
繊維製品 (4.3%)			
東レ	2.9	3.6	3,452
化学 (5.4%)			
日産化学	—	0.2	1,019
日本触媒	0.2	—	—
日本ゼオン	1	—	—
花王	0.3	0.4	2,655
artience	—	0.2	625
医薬品 (3.0%)			
武田薬品工業	0.3	—	—
アステラス製薬	—	1.5	2,373
サワイグループホールディングス	0.4	—	—
非鉄金属 (—%)			
住友電気工業	0.7	—	—
金属製品 (2.5%)			
SUMCO	—	1.6	1,950
機械 (9.3%)			
オーエスジー	—	0.8	1,390
クボタ	0.6	1.2	2,228
ダイキン工業	—	0.1	1,815
ダイフク	0.3	0.2	684
ジェイテクト	0.2	1.2	1,304
電気機器 (20.6%)			
明電舎	0.6	—	—
マブチモーター	0.3	1.1	2,456
ニデック	0.3	0.9	2,541
オムロン	—	0.4	2,008
富士通	0.1	—	—
セイコーエプソン	0.3	0.3	829
EIZO	0.3	0.9	2,032
パナソニック ホールディングス	0.8	—	—
富士通ゼネラル	0.3	0.9	1,898
TDK	0.1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
京セラ	—	0.9	1,381
村田製作所	0.8	1.3	3,256
輸送用機器 (7.4%)			
デンソー	0.7	0.8	1,730
いすゞ自動車	0.7	1.1	2,292
アイシン	—	0.5	854
豊田合成	0.3	0.4	1,033
精密機器 (—%)			
シチズン時計	1	—	—
陸運業 (5.6%)			
西日本旅客鉄道	0.2	0.6	1,689
ヤマトホールディングス	0.8	1.5	2,730
情報・通信業 (7.5%)			
野村総合研究所	0.5	0.5	2,352
日本電信電話	15.6	23.1	3,589
小売業 (0.6%)			
J. フロント リテイリング	0.5	—	—
セブン&アイ・ホールディングス	0.1	—	—
丸井グループ	0.5	0.2	504
銀行業 (15.6%)			
めぶきフィナンシャルグループ	—	4.2	2,820
りそなホールディングス	1.9	1.8	2,178
三井住友トラストグループ	0.4	0.9	3,448
三井住友フィナンシャルグループ	0.3	0.3	1,141
山陰合同銀行	—	2.2	2,776
保険業 (1.1%)			
第一生命ホールディングス	0.8	0.2	861
不動産業 (5.5%)			
三井不動産	—	0.8	987
三菱地所	1.3	1.6	3,405
サービス業 (2.7%)			
セコム	0.1	0.4	2,144
合 計	株 数 ・ 金 額	39	62
	銘柄数<比率>	40	42

(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

(2024年12月9日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	79,478	96.4
コール・ローン等、その他	2,955	3.6
投資信託財産総額	82,433	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 (2024年12月9日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	82,433,268
コール・ローン等	2,887,440
株式(評価額)	79,478,320
未収配当金	67,500
未収利息	8
(B) 負債	0
(C) 純資産総額(A－B)	82,433,268
元本	21,124,110
次期繰越損益金	61,309,158
(D) 受益権総口数	21,124,110口
1万口当たり基準価額(C／D)	39,023円

(注1) 信託財産に係る期首元本額18,190,133円、期中追加設定元本額5,485,815円、期中一部解約元本額2,551,838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 21,124,110円

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 3.9023円

○損益の状況 (2023年12月9日～2024年12月9日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,749,019
受取配当金	1,748,340
受取利息	842
その他収益金	6
支払利息	△ 169
(B) 有価証券売買損益	7,132,109
売買益	11,063,237
売買損	△ 3,931,128
(C) 保管費用等	△ 401
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	8,880,727
(E) 前期繰越損益金	43,582,408
(F) 追加信託差損益金	15,324,185
(G) 解約差損益金	△ 6,478,162
(H) 計(D＋E＋F＋G)	61,309,158
次期繰越損益金(H)	61,309,158

(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。