

■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／内外／資産複合
信託期間	2017年12月21日から2023年8月31日まで （当初、2027年12月24日まで）
運用方針	①主として投資信託証券への投資を通じて、実質的に日本および先進国の債券、株式等に分散投資します。なお、指定投資信託証券については、資産規模、流動性、コスト等を考慮して選定し、継続的なモニタリングを行い、必要に応じて入れ替えも行います。 ②外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行います。なお、先進国株式部分の投資信託証券が投資する米ドル建て以外の通貨建て資産については、米ドルに対する当該資産通貨の為替変動の影響を受けます。 ③各資産への配分比率は、中期的な運用収益目標（年率４％程度（運用管理費用（信託報酬）等控除後）・円ベース）を目指し、当社開発のモデルに基づく一貫した投資判断（定量判断）により決定のうえ、機動的にリバランスします。 ④基準価額の下落リスクを抑制するため、純資産総額に対して日本株式および先進国株式部分の割合を０％まで引き下げ、短期金融資産を５０％まで保有する場合があります。
主要投資対象	日本および先進国の債券、株式等に投資する投資信託証券 なお、短期金融資産等に直接投資する場合があります。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 デリバティブの直接利用は行いません。 株式への直接投資は行いません。 同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
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、経費控除後の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、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。

ターゲット・リターン
戦略ファンド
〈愛称〉 ターゲット４Ｕ

最終期（償還日 2023年8月31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、「ターゲット・リターン戦略ファンド」は、信託約款の規定に基づき、2023年8月31日をもって繰上償還いたしました。ここに謹んで設定以来の運用状況と償還の内容をご報告申し上げます。
今後とも当社商品につ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 (分配落)	価 額			債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比	純 資 産 総 額
		税 分	達 配	み 騰 落 中 率			
	円 銭		円	%	%	%	百万円
2 期 (2019 年 12 月 25 日)	10,351		0	5.4	77.2	20.5	532
3 期 (2020 年 12 月 25 日)	10,628		0	2.7	77.9	20.3	550
4 期 (2021 年 12 月 27 日)	10,792		0	1.5	63.8	10.8	566
5 期 (2022 年 12 月 26 日)	9,557		0	△11.4	63.8	29.2	510
(償還時)	(償還価額)						
6 期 (2023 年 8 月 31 日)	9,723.03		—	1.7	—	—	504

(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) 債券組入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) 当ファンドは投資信託証券への投資を通じて、実質的に日本および先進国の債券、株式に分散投資します。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数は記載しておりません。

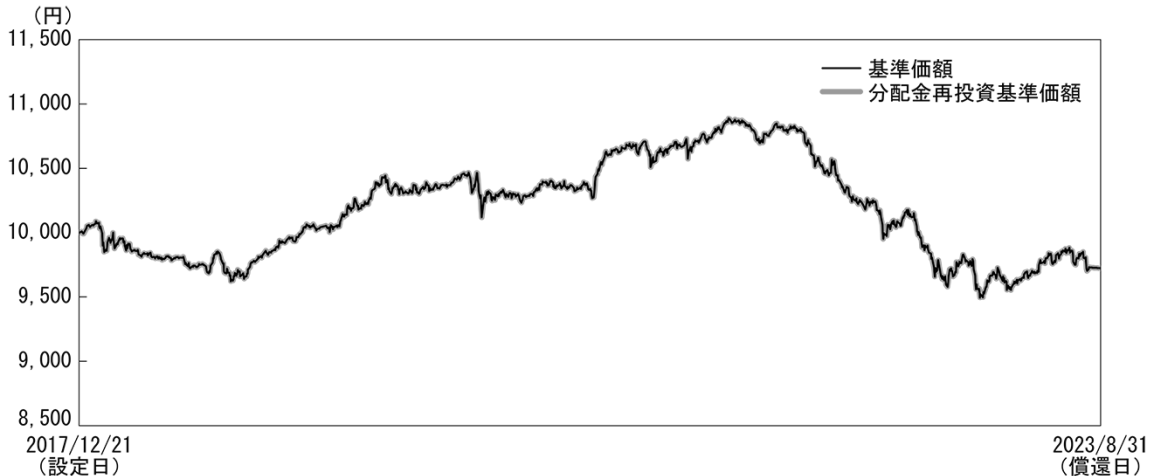
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比
		騰 落	率		
(期 首)	円 銭		%	%	%
2022 年 12 月 26 日	9,557	—	—	63.8	29.2
12 月末	9,521	△0.4	—	63.8	29.3
2023 年 1 月末	9,643	0.9	—	63.5	20.5
2 月末	9,577	0.2	—	63.9	31.1
3 月末	9,692	1.4	—	64.4	19.6
4 月末	9,749	2.0	—	67.2	30.5
5 月末	9,771	2.2	—	67.4	30.5
6 月末	9,844	3.0	—	79.4	10.7
7 月末	9,800	2.5	—	63.1	20.1
(償還時)	(償還価額)				
2023 年 8 月 31 日	9,723.03	1.7	—	—	—

(注 1) 騰落率は期首比。
(注 2) 債券組入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) 当ファンドは投資信託証券への投資を通じて、実質的に日本および先進国の債券、株式に分散投資します。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数は記載しておりません。

設定以来の運用経過（2017年12月21日（設定日）～2023年8月31日（償還日））

■基準価額の推移



設定日：10,000円

償還日：9,723円03銭（期中分配金合計0円）

騰落率：△2.8%（分配金再投資基準価額ベース）

- ・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。
- ・当ファンドは投資信託証券への投資を通じて、実質的に日本および先進国の債券、株式に分散投資します。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数は記載しておりません。

■基準価額の主な変動要因

（ターゲット・リターン戦略ファンド）

損保ジャパン日本債券マザーファンド、損保ジャパン外国債券マザーファンド、日本株式ETF、先進国株式ETFおよび短期金融資産等の配分比率を機動的にリバランスしました。

リバランスにより、主に先進国債券を中心とした組入れが下落要因となり、当ファンドの基準価額は2.8%下落しました。

なお、当ファンドでは、外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジが行われているため為替変動リスクが軽減されています。

■投資環境

○日本債券市場

日本債券の利回りは上昇（価格は下落）しました。

設定月から2019年8月にかけて日本株式の下落や円高懸念などから長期金利は－0.2%台まで低下しました。

その後、債券利回りは方向感に乏しい推移となったものの、2022年12月から償還月にかけて海外金利の上昇や国内消費者物価指数の上昇を背景とした日銀のイールドカーブ（長短金利操作）政策の修正などから、債券の利回りは上昇しました。

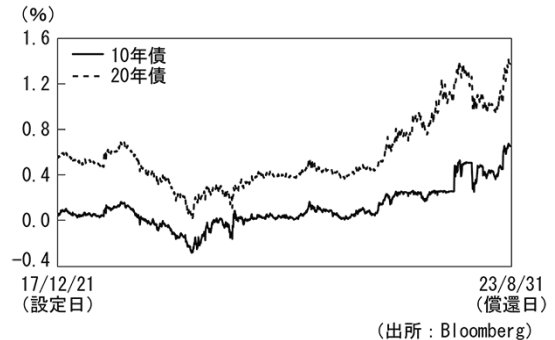
○先進国債券市場

先進国債券の利回りは大幅に上昇しました。

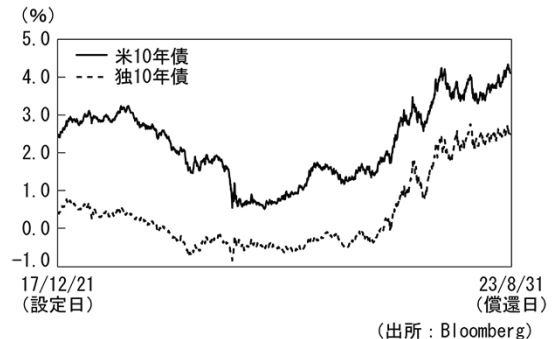
設定月から2020年3月にかけて米国経済のピークアウト感を背景に米国の中央銀行が利下げに転じたことや新型コロナウイルス対策による緊急利下げを背景に、債券の利回りは低下（価格は上昇）しました。

その後、債券の利回りは方向感に乏しい推移となったものの、2022年1月から償還月にかけてインフレ懸念を背景に欧米の主要中央銀行による大幅な利上げが開始されたことから、債券の利回りは大幅に上昇しました。

日本債券利回りの推移



先進国債券利回りの推移



○日本株式市場

日本株式市場は、大幅に上昇しました。

設定月から2020年3月にかけて中国の景気減速を受けた企業業績期待の鈍化や新型コロナウイルスの感染拡大による世界景気悪化懸念などから、下落しました。

その後、各国の大規模な経済政策による世界景気回復期待から上昇に転じ、2023年以降は、日本や中国のゼロコロナ政策の緩和・撤廃を受けて景気の回復期待が高まったことなどから、一段と上昇しました。

○先進国株式市場

先進国株式市場は、大幅に上昇しました。

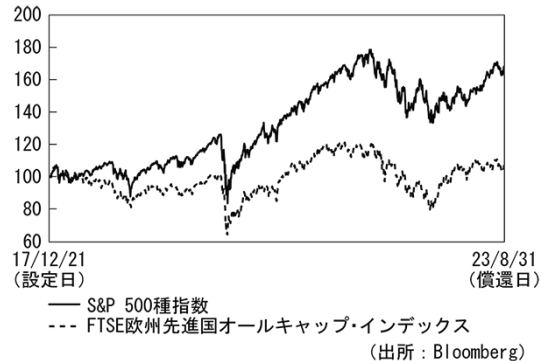
設定月から2020年2月にかけて米国経済の底堅さや欧米の主要中央銀行の金融緩和姿勢などから、上昇しました。2020年3月には新型コロナウイルスの感染拡大を受けた金融市場の混乱から下落する局面が見られたものの、各国の大規模な経済政策による景気下支え策や米国経済の底堅さなどから大幅に上昇しました。

2022年以降は、インフレ抑制のために欧米の主要中央銀行が金融引き締めに転じたことから、株価の上昇が抑えられました。

TOPIXの推移



先進国株価指数の推移



(注) 設定時を100として、委託会社にて指数化したものを使用しております。

■当該投資信託のポートフォリオ

主として投資信託証券への投資を通じて、実質的に日本および先進国の債券、株式等を投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行いました。

外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いました。

各資産への配分比率は、中期的な運用収益目標を目指し、当社開発のモデルに基づく一貫した投資判断（定量判断）により決定のうえ、機動的にリバランスを行いました。

信託期間中の各資産別の主な投資行動は以下のとおりです。なお、繰上償還が決定された2023年8月上旬に組入ファンドを順次売却し償還日まで短期金融資産による運用を行いました。

○日本債券

総じて、設定月から2019年9月まで基準配分比率並み～高位に組入れました。2019年10月から2023年7月にかけて総じて低位～基準配分比率並みに組入れました。

○先進国債券

総じて、基準配分比率～高位とした2018年12月から2020年6月を除き、設定月から2023年7月にかけて低位～基準配分比率並みに組入れました。

○日本株式

総じて、非保有とした2020年3月から2020年7月を除き、設定月から2022年10月まで非保有～基準配分比率並みに組入れました。2022年11月から2023年7月にかけては基準配分比率～高位に組入れました。

○先進国株式

総じて、非保有とした2020年3月から2020年7月を除き、設定月から2022年1月まで基準配分比率並み～高位に組入れました。2022年2月から2022年11月まで非保有としました。2022年12月から2023年7月にかけては非保有～基準配分比率並みに組入れました。

なお、2023年7月末時点の組入比率は、日本債券39.7%、先進国債券25.0%、日本株式10.0%、先進国株式10.1%、短期金融資産等15.2%です。

(損保ジャパン日本債券マザーファンド)

期を通して債券の組入比率を高位に維持しました。2023年8月31日の組入比率は、98.5%です。金利戦略は長期及び超長期ゾーンを中心にポジションを機動的に変更しました。債券種別戦略は、非国債のオーバーウェイトを継続しました。

(損保ジャパン外国債券マザーファンド)

期を通して債券の組入比率を高位に維持しました。2023年8月31日の組入比率は、99.3%です。金利戦略は米国と欧州を中心にポジションを機動的に変更しました。国別配分戦略はユーロ圏内の国別配分戦略を中心にポジションを機動的に変更しました。

■当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドは、主として投資信託証券への投資を通じて、実質的に日本および先進国の債券、株式等に分散投資し、必要に応じて入れ替えも行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。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。

＜損保ジャパン日本債券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、NOMURA-BPI 総合指数の騰落率（－3.3％）を1.4％上回りました。非国債をオーバーウェイトした債券種別戦略や、市場状況に応じて機動的にデュレーションを調整した金利戦略がプラス要因となりました。

＜損保ジャパン外国債券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、ベンチマーク（FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース））の騰落率（－11.6％）を0.1％下回りました。市場状況に応じて機動的にデュレーションを調整した金利戦略などがマイナス要因となりました。

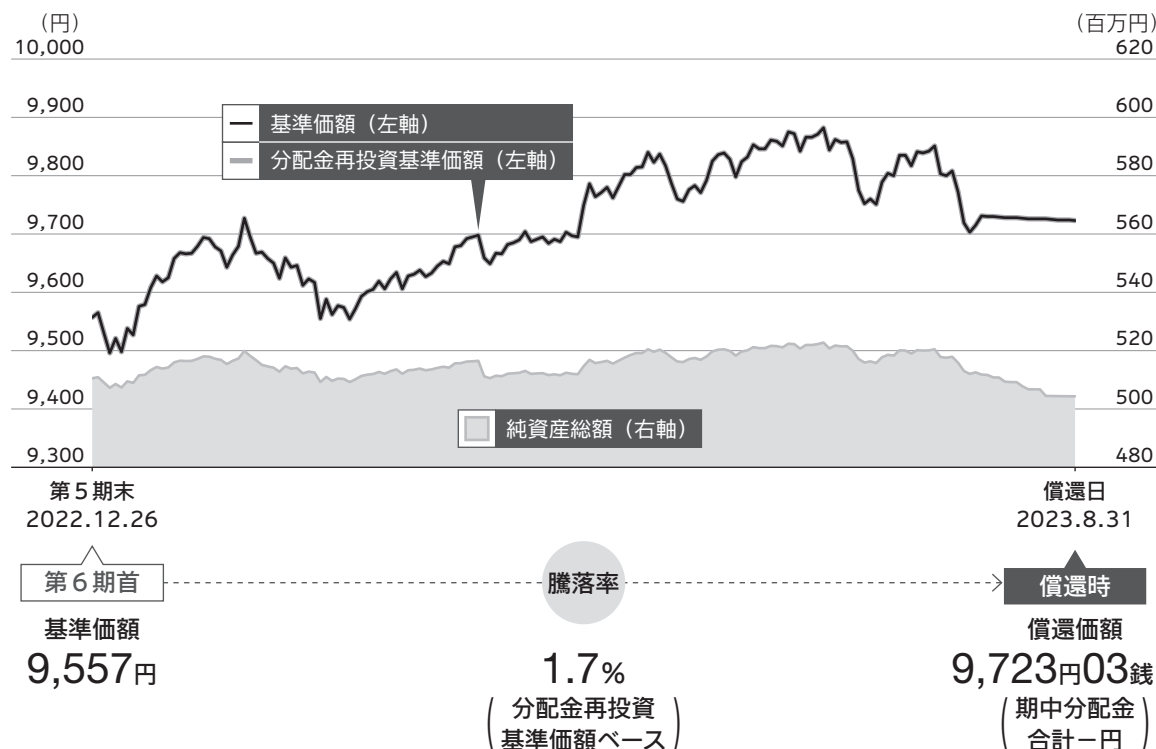
■分配金

収益分配金については、基準価額水準等を勘案し、全運用期間を通じて分配を行いませんでした。

最終期の運用経過（2022年12月27日～2023年8月31日（償還日））

運用経過

● 基準価額の推移



- 分配金再投資基準価額の推移は、2022年12月26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。
- 当ファンドは投資信託証券への投資を通じて、実質的に日本および先進国の債券、株式に分散投資します。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数は記載しておりません。

● 基準価額の主な変動要因

ターゲット・リターン戦略ファンド

損保ジャパン日本債券マザーファンド、損保ジャパン外国債券マザーファンド、日本株式ETF、先進国株式ETFおよび短期金融資産等の配分比率を機動的にリバランスしました。

リバランスにより、主に日本株式を中心とした組入れが上昇要因となり、当ファンドの基準価額は1.7%上昇しました。

なお、当ファンドでは、外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジが行われているため為替変動リスクが軽減されています。

- 本報告書では、ベビーファンド、マザーファンド及びマザーファンド以外の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



マザーファンド以外のファンド

● 投資環境

○日本債券市場

日本債券の利回りは上昇（価格は下落）しました。

期初から2023年6月にかけて日銀新体制による早期の金融正常化観測が後退したことや、4月の日銀展望レポートを受け金融緩和政策が長期化するとの見方が強くなったことから、債券の利回りは低下（価格は上昇）しました。

その後、7月の日銀の金融政策決定会合にてイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）の運用の柔軟化決定を受け利回りは大幅に上昇し、期を通して見ると債券の利回りは上昇しました。

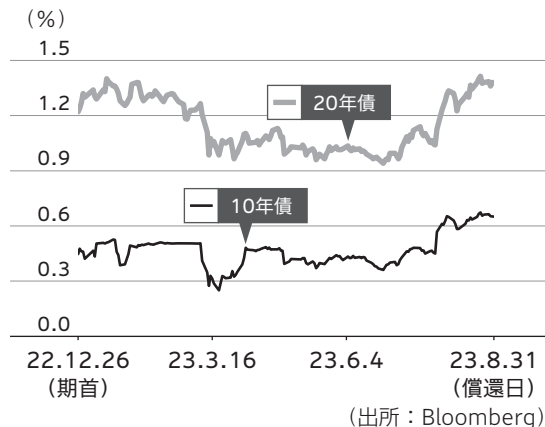
○先進国債券市場

先進国債券の利回りは上昇しました。

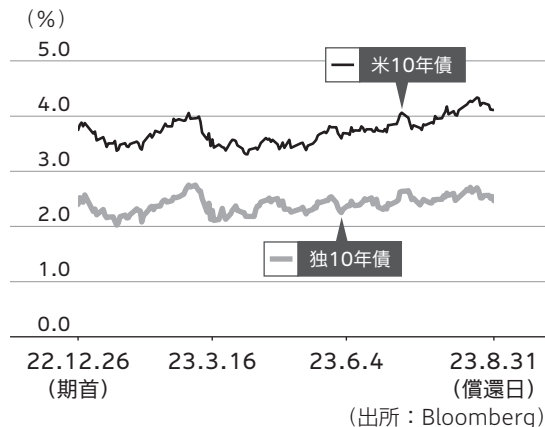
期初から2023年4月にかけて金融システム不安を受け欧米の主要中央銀行の大幅な利上げ観測が後退したことなどから債券の利回りは低下しました。

その後、金融システム不安が後退したことや欧米の主要中央銀行による追加利上げ実施などから利回りは上昇し、期を通して見ると債券の利回りは上昇しました。

日本債券利回りの推移



先進国債券利回りの推移



○日本株式市場

日本株式市場は、大幅に上昇しました。

中国のゼロコロナ政策の解除を受け中国景気の回復期待が高まったことや、2023年4月以降に欧米との金融政策の違いが意識され円安ドル高となり堅調な企業業績見通しが維持されたことなどから、大幅に上昇しました。

TOPIXの推移

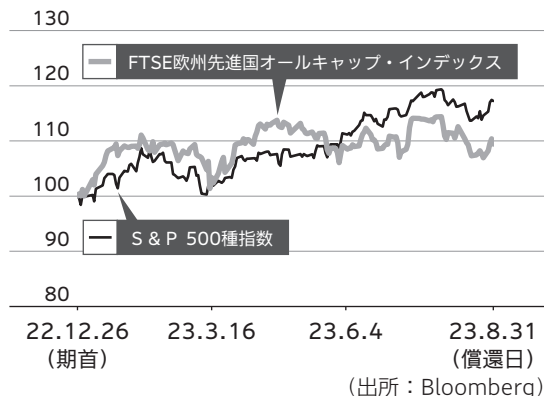


○先進国株式市場

先進国株式市場は、大幅に上昇しました。

2023年3月に米国の地方銀行の破綻などで下落する局面も見られましたが、当局の迅速な対応を受け欧米の金融システム不安が後退したことや、米国経済の底堅さなどから、大幅に上昇しました。

先進国株価指数の推移



注. 期首を100として、委託会社にて指数化したものを使用しております。

● 当該投資信託のポートフォリオ

主として投資信託証券への投資を通じて、実質的に日本および先進国の債券、株式等を投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行いました。

外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いました。

各資産への配分比率は、中期的な運用収益目標を目指し、当社開発のモデルに基づく一貫した投資判断（定量判断）により決定のうえ、機動的にリバランスを行いました。

当期中の各資産別の主な投資行動は以下のとおりです。なお、繰上償還が決定された2023年8月上旬に組入ファンドを順次売却し償還日まで短期金融資産による運用を行いました。

○日本債券

低位～基準配分比率並みに組入れました。期初月から2023年2月までは低位に組入れました。3月から7月までは低位とした5月を除き基準配分比率並みに組入れました。

○先進国債券

低位～基準配分比率並みに組入れました。期初月から2023年2月までは基準配分比率並みに組入れました。3月から7月にかけては基準配分比率並みとした6月を除き低位に組入れました。

○日本株式

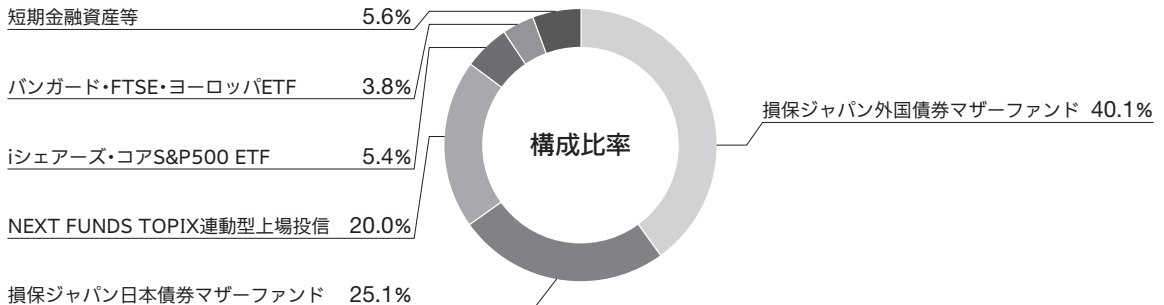
総じて高位に組入れました。期初月から2023年5月までは基準配分比率並みとした1月を除き高位に組入れました。その後、7月にかけて基準配分比率並みに組入れました。

○先進国株式

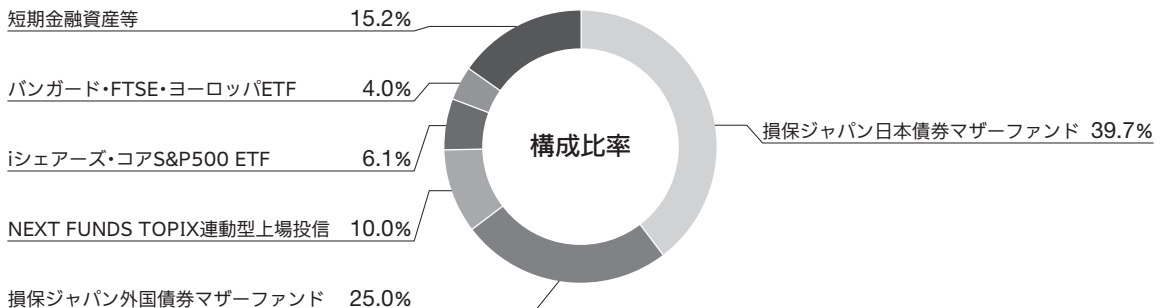
総じて基準配分比率並みに組入れました。期初月から2023年7月までは非保有とした3月・6月を除き基準配分比率並みに組入れました。

なお、2023年7月末時点の組入比率は、日本債券39.7%、先進国債券25.0%、日本株式10.0%、先進国株式10.1%、短期金融資産等15.2%です。

2022年12月26日（期首）



2023年7月31日



※2023年8月上旬に繰上償還が決定され、組入ファンドを順次売却したため、2023年7月末時点の構成比率を掲載しております。



損保ジャパン日本債券マザーファンド

期を通して債券の組入比率を高位に維持しました。2023年8月31日の組入比率は、98.5%です。金利戦略は超長期ゾーンを中心にポジションを機動的に変更しました。債券種別戦略は、非国債のオーバーウェイトを継続しました。



損保ジャパン外国債券マザーファンド

期を通して債券の組入比率を高位に維持しました。2023年8月31日の組入比率は、99.3%です。金利戦略は米国と欧州を中心にポジションを機動的に変更しました。国別配分戦略はユーロ圏内の国別配分戦略を中心にポジションを機動的に変更しました。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドは、主として投資信託証券への投資を通じて、実質的に日本および先進国の債券、株式等に分散投資し、必要に応じて入れ替えも行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。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。

<損保ジャパン日本債券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、NOMURA-BPI総合指数の騰落率（-0.1%）を0.2%上回りました。利回りの高い事業債を組入れた個別銘柄戦略や、2023年8月の金利上昇局面で短めのデュレーションとした金利戦略がプラス要因となりました。

<損保ジャパン外国債券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、ベンチマーク（FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース））の騰落率（-2.8%）を0.3%下回りました。2023年3月の金利低下局面で短めのデュレーションとした金利戦略などがマイナス要因となりました。

● 分配金

該当事項はありません。

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。

<償還を迎えて>

当ファンドは、2023年8月31日をもちまして信託期間を終了し、繰上償還とさせていただくこととなりました。受益者の皆様のご愛顧に心より御礼を申し上げます。誠にありがとうございました。

● 1万口当たりの費用明細

項目	最終期 2022.12.27～2023.8.31		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	64円	0.658%	(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9,699円です。
（投信会社）	(29)	(0.299)	ファンドの運用の対価
（販売会社）	(33)	(0.336)	購入後の情報提供、運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの 管理等の対価
（受託会社）	(2)	(0.022)	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	0.060	(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
（投資信託証券）	(6)	(0.060)	
(c) 有価証券取引税	0	0.000	(c) 有価証券取引税 = $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	3	0.035	(d) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
（保管費用）	(2)	(0.019)	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
（監査費用）	(1)	(0.007)	監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用
（その他）	(1)	(0.009)	信託事務の処理にかかるその他の費用等
合計	73	0.753	

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、有価証券取引税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。

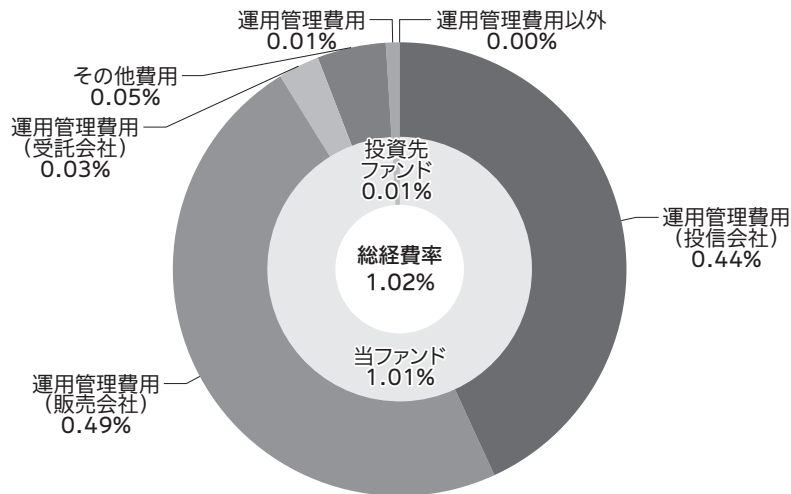
注3. 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

注4. 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(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1.02%**です。



(単位：%)

総経費率(①+②+③)	1.02
①当ファンドの費用の比率	1.01
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.01
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.00

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. 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

注5. 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、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

注6. 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

注7. 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27日～2023年 8月31日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	NEXT FUNDS TOPIX連動型上場投信	24,300	千円 50,098	75,820	千円 166,002
	アメリカ		千アメリカ・ドル		千アメリカ・ドル
外国	ISHARES CORE S&P 500 ETF	1,577	686	2,123	913
	VANGUARD FTSE EUROPE ETF	7,133	441	9,758	598
	小計	8,710	1,127	11,881	1,511

(注1) 金額は受渡代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

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
損保ジャパン日本債券マザーファンド		74,742	103,810	167,509	233,014
損保ジャパン外国債券マザーファンド		56,756	82,690	196,986	281,210

(注1) 単位未満は切捨て。
(注2) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2022年12月27日～2023年 8月31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。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2022年12月27日～2023年 8月31日)

当期首残高 (元本)	当期設定 元本	当期解約 元本	償還時残高 (元本)	取引理由
万円 1,000	万円 －	万円 －	万円 1,000	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2023年8月31日現在)

2023年8月31日現在、有価証券等の組入れはございません。

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	期首(前期末)	
		口	数
NEXT FUNDS TOPIX連動型上場投信			口 51,520
合	計		51,520

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

銘	柄	期首(前期末)	
		口	数
(アメリカ)			口
ISHARES CORE S&P 500 ETF			546
VANGUARD FTSE EUROPE ETF			2,625
合	計		3,171

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	
		口	数
損保ジャパン日本債券マザーファンド			千口 92,767
損保ジャパン外国債券マザーファンド			140,229

(注) 単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年8月31日現在)

項	目	償		還		時	
		評	価	額		比	率
				千円			%
	コール・ローン等、その他			505,270			100.0
	投資信託財産総額			505,270			100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2023年8月31日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	505,270,842
コール・ローン等	505,270,842
(B) 負債	942,441
未払解約金	49
未払信託報酬	914,247
未払利息	1,508
その他未払費用	26,637
(C) 純資産総額(A－B)	504,328,401
元本	518,694,478
償還差損金	△ 14,366,077
(D) 受益権総口数	518,694,478口
1万口当たり償還価額(C／D)	9,723円03銭

(注1) 信託財産に係る期首元本額534,147,266円、期中追加設定元本額2,358,651円、期中一部解約元本額17,811,439円

(注2) 償還時における1口当たりの純資産総額 0.972303円

(注3) 償還時における元本の欠損金額 14,366,077円

○損益の状況 (2022年12月27日～2023年8月31日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,086,160
受取配当金	1,106,114
支払利息	△ 19,954
(B) 有価証券売買損益	10,986,759
売買益	26,564,318
売買損	△15,577,559
(C) 信託報酬等	△ 3,521,429
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	8,551,490
(E) 前期繰越損益金	△23,974,032
(F) 追加信託差損益金	1,056,465
(配当等相当額)	(2,040,029)
(売買損益相当額)	(△ 983,564)
償還差損金(D＋E＋F)	△14,366,077

(注1) 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。

○投資信託財産運用総括表

信 託 期 間	投資信託契約締結日	2017年12月21日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2023年8月31日		資 産 総 額	505,270,842円
区 分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負 債 総 額	942,441円
				純 資 産 総 額	504,328,401円
受益権口数	510,000,000口	518,694,478口	8,694,478口	受 益 権 口 数	518,694,478口
元 本 額	510,000,000円	518,694,478円	8,694,478円	1万口当たり償還金	9,723円03銭
毎計算期末の状況					
計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第1期	512,673,710円	503,267,366円	9,817円	0円	0%
第2期	514,175,853	532,245,136	10,351	0	0
第3期	518,234,753	550,801,157	10,628	0	0
第4期	525,013,724	566,601,384	10,792	0	0
第5期	534,147,266	510,505,616	9,557	0	0

○償還金のお知らせ

1万口当たり償還金(税込み)	9,723円03銭
----------------	-----------