

## 損保ジャパン S R I 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	<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 S R I オープン	損保ジャパン S R I マザーファンド受益証券
	損保ジャパン S R I 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 S R I 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 S R I 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>	

第12期（決算日 2016年12月8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 S R I オープン」は、このたび第12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。



損保ジャパン日本興亜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



<http://www.sjnk-am.co.jp/>

お問い合わせ先



クライアントサービス第二部 0120-69-5432

（受付時間 営業日の午前9時～午後5時）

■最近10期の運用実績

決算期	基準価額			T O P I X		株式組入率 株比	株式先物率 株比	純資産額
	(分配落)	税金 込金 分配	期中 騰落 率	(東証株価指数)	期中 騰落 率			
3期(2007年12月10日)	円 11,432	円 800	% 6.2	1,558.51	% △3.6	% 98.0	% —	百万円 1,577
4期(2008年12月8日)	5,989	0	△47.6	812.08	△47.9	96.5	—	852
5期(2009年12月8日)	6,864	0	14.6	896.70	10.4	96.9	—	979
6期(2010年12月8日)	7,632	0	11.2	887.39	△1.0	97.1	—	1,082
7期(2011年12月8日)	6,354	0	△16.7	745.11	△16.0	97.0	—	889
8期(2012年12月10日)	6,212	0	△2.2	788.48	5.8	97.6	—	866
9期(2013年12月9日)	10,037	0	61.6	1,255.32	59.2	96.6	—	1,377
10期(2014年12月8日)	11,334	1,000	22.9	1,447.58	15.3	97.0	—	1,546
11期(2015年12月8日)	11,278	1,000	8.3	1,568.73	8.4	98.2	—	1,560
12期(2016年12月8日)	11,302	500	4.6	1,512.69	△3.6	94.7	—	1,573

(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		株式組入率 株比	株式先物率 株比
	騰落率	(東証株価指数)	騰落率			
(期首) 2015年12月8日	円 11,278	% —	1,568.73	% —	% 98.2	% —
12月末	11,052	△2.0	1,547.30	△1.4	98.0	—
2016年1月末	9,982	△11.5	1,432.07	△8.7	98.0	—
2月末	8,875	△21.3	1,297.85	△17.3	98.0	—
3月末	9,389	△16.7	1,347.20	△14.1	96.8	—
4月末	9,371	△16.9	1,340.55	△14.5	97.1	—
5月末	9,677	△14.2	1,379.80	△12.0	97.3	—
6月末	8,414	△25.4	1,245.82	△20.6	96.9	—
7月末	9,056	△19.7	1,322.74	△15.7	98.1	—
8月末	9,647	△14.5	1,329.54	△15.2	98.3	—
9月末	9,442	△16.3	1,322.78	△15.7	97.2	—
10月末	10,213	△9.4	1,393.02	△11.2	97.4	—
11月末	11,118	△1.4	1,469.43	△6.3	97.0	—
(期末) 2016年12月8日	11,802	4.6	1,512.69	△3.6	94.7	—

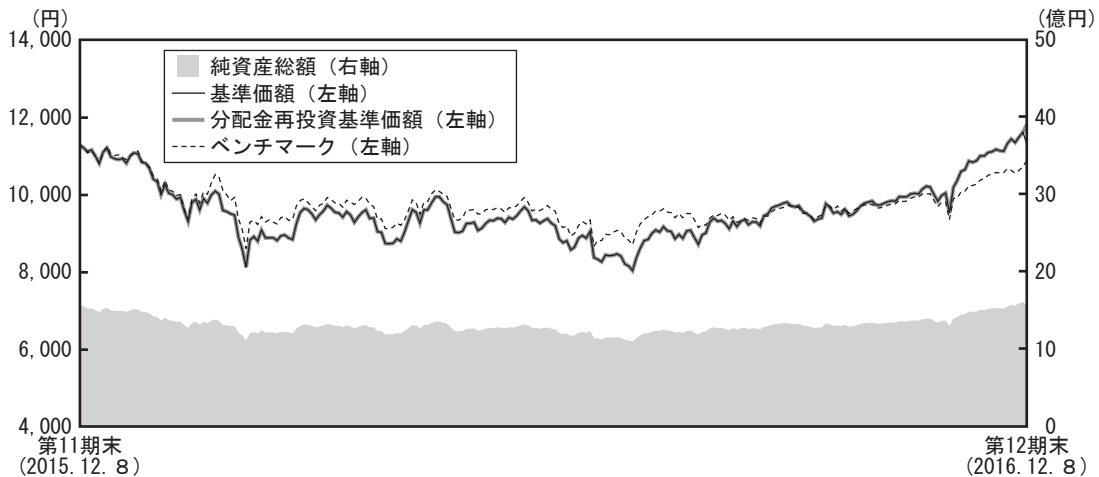
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(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



第12期首：11,278円

第12期末：11,302円（期中分配金合計500円）

騰落率：4.6%（分配金再投資基準価額ベース）

- ・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、2015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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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）

高位に組み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が上昇しました。

## （損保ジャパンSRIマザーファンド）

期中の騰落率は+6.6%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み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、野村ホールディングス、三菱商事、滋賀銀行、三井物産、第一生命ホールディングス、T&Dホールディングスなどがプラスに寄与しました。

## ■投資環境

TOPIXは3.6%の下落となりました。

期初は、FOMC（米連邦公開市場委員会）による9年半ぶりの利上げを受けて株価は上昇しましたが、年頭の中国経済減速懸念に加え、1月末の日銀によるマイナス金利政策導入及び追加利上げに対するFRB（米連邦準備理事会）の慎重な姿勢がネガティブ視され、株価は2014年の量的緩和前の水準まで下落しました。

今年度に入り、日銀の金融政策への失望感と底堅い企業決算を背景に株価が一進一退で推移した後、6月末の英国国民投票がEU離脱との結果となると、急速な円高株安となりました。その後は、米追加利上げの時期を巡る思惑に左右されながらも株価は堅調に推移し、11月の米大統領選でトランプ氏が勝利すると、政策期待から米長期金利は上昇、米S&P500は連日の最高値更新となりました。また、国内株式市場はドル高円安効果もあり、年初の水準まで戻しました。

## ■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。期末の組入比率（対純資産総額比）は、99.0%です。

### （損保ジャパンSRIマザーファンド）

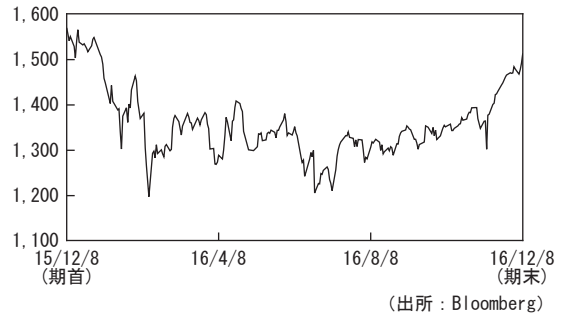
期を通して株式の組入比率を高位に維持しました。期末の組入比率は、95.7%です。

期末時点での業種別構成比率はグラフのとおりです。

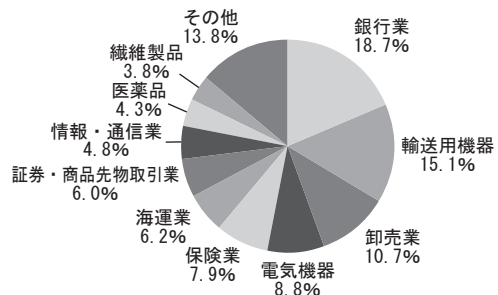
当期間中に独自の調査分析に基づく割安度にしたがって銘柄入れ替えを行いました。

主な購入（ウェイトアップ）銘柄は、第一生命ホールディングス、デンソー、野村ホールディングスなど、主な売却（ウェイトダウン）銘柄は、クラレ、キヤノン、宇部興産などです。

TOPIX（東証株価指数）の推移



損保ジャパンSRIマザーファンドの業種別構成比率



(注1) 比率は、第12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

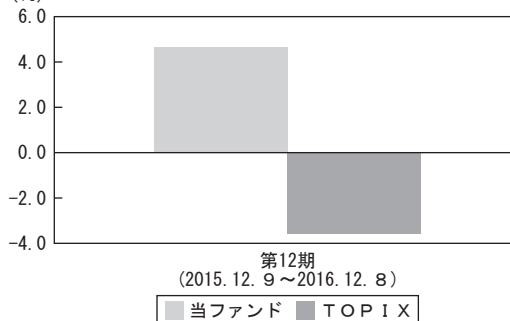
当ファンドの騰落率（分配金再投資基準価額ベース）は、ベンチマーク（TOPIX）の騰落率（-3.6%）を8.2%上回りました。当ファンドは期を通じて「損保ジャパンSRIマザーファンド」を高位に組入れておりましたので、以下ではマザーファンドとベンチマークとの差異についてご説明します。

### <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（-1.4%）を8.1%上回りました。

ベンチマークとの差異を要因分析しますと、業種要因では、卸売業、証券、商品先物取引業、保険業のオーバーウェイトなどがプラス要因、海運業のオーバーウェイト、機械、建設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。個別銘柄要因では、セイコーエプソン、ゲンゼ、三菱商事のオーバーウェイトなどがプラス要因、マツダ、リコー、日立製作所のオーバーウェイトなどがマイナス要因となりました。

(%) 基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



## ■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、1万口当たり500円の分配を行いました。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12期
	2015年12月9日～2016年12月8日
当期分配金	500
(対基準価額比率)	4.24%
当期の収益	500
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,674

(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。

## ■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「CSR(企業の社会的責任)」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12期		項目の概要
	(2015年12月9日～2016年12月8日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	155円	1.620%	(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9,595円です。
（投信会社）	（73）	（0.756）	ファンドの運用の対価
（販売会社）	（73）	（0.756）	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）	（10）	（0.108）	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	12	0.129	(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）	（12）	（0.129）	
(c) その他費用	0	0.003	(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）	（0）	（0.003）	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	168	1.753	

(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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2015年12月9日から2016年12月8日まで)

	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 11,100	千円 23,120	千口 51,172	千円 103,390

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 金額は受渡代金。

■期中の株式売買比率

○親投資信託の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	1,178,034千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	1,291,674千円
(c) 売 買 高 比 率(a) / (b)	0.91

(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 (2015年12月9日から2016年12月8日まで)

当ファンド及びマザーファンドにおける当期中の利害関係人との取引はございません。

■組入資産の明細

○親投資信託残高

(2016年12月8日現在)

	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 740,234	千口 700,162	千円 1,557,931

(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

(2016年12月8日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
損 保 ジ ャ パ ン S R I マ ザ ー フ ァ ン ド	千円 1,557,931	% 94.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	96,667	5.8
投 資 信 託 財 産 総 額	1,654,599	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。



## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2016年12月8日現在)

項 目	当 期 末
a 資産	1,654,599,373円
コール・ローン等	96,667,383
損保ジャパンSRI マザーファンド(評価額)	1,557,931,990
b 負債	81,195,413
未払収益分配金	69,604,392
未払解約金	996,235
未払信託報酬	10,573,693
その他未払費用	21,093
c 純資産総額(a - b)	1,573,403,960
元本	1,392,087,841
次期繰越損益金	181,316,119
d 受益権総口数	1,392,087,841口
1万口当たり基準価額(c / d)	11,302円

(注1) 信託財産に係る期首元本額1,383,914,860円、期中追加設定元本額51,139,363円、期中一部解約元本額42,966,382円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額 1.1302円

## ■損益の状況

(2015年12月9日から2016年12月8日まで)

項 目	当 期
a 配当等収益	△ 9,129円
受取利息	334
支払利息	△ 9,463
b 有価証券売買損益	97,289,796
売買益	101,803,798
売買損	△ 4,514,002
c 信託報酬等	△ 21,306,366
d 当期損益金(a + b + c)	75,974,301
e 前期繰越損益金	177,059,299
f 追加信託差損益金 (配当等相当額)	△ 2,113,089 ( 49,660,728)
(売買損益相当額)	(△ 51,773,817)
g 合計(d + e + f)	250,920,511
h 収益分配金	△ 69,604,392
次期繰越損益金(g + h)	181,316,119
追加信託差損益金 (配当等相当額)	△ 2,113,089 ( 49,660,728)
(売買損益相当額)	(△ 51,773,817)
分配準備積立金	183,438,337
繰越損益金	△ 9,129

(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(2015年12月9日から2016年12月8日まで)

計算期間末における有価証券売買等損益(75,983,430円)、収益調整金(49,660,728円)及び分配準備積立金(177,059,299円)を対象収益(302,703,457円)として、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案した結果、有価証券売買等損益から69,604,392円(1万口当たり500円)を分配に充てることに決定しました。

## ■ 分配金のお知らせ

	第12期
1 万口当たり分配金（税引前）	500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 >

- ・ お手取り分配金は、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：NISA（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。

# 損保ジャパンSRIマザーファンド

## 運用報告書

第12期（決算日 2016年12月8日）

<計算期間 2015年12月9日～2016年12月8日>

損保ジャパンSRIマザーファンドの第12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10期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	純 資 産 額 総
	期 騰 落	中 率	(東証株価指数 配当込み)	期 騰 落			
3期（2007年12月10日）	円 15,752	% 8.0	1,844.15	% △ 2.4	% 99.8	% —	百万円 2,065
4期（2008年12月8日）	8,317	△47.2	979.58	△46.9	97.6	—	1,113
5期（2009年12月8日）	9,693	16.5	1,102.37	12.5	97.8	—	970
6期（2010年12月8日）	10,955	13.0	1,112.08	0.9	97.8	—	1,074
7期（2011年12月8日）	9,251	△15.6	955.88	△14.0	98.0	—	881
8期（2012年12月10日）	9,187	△ 0.7	1,035.91	8.4	98.6	—	858
9期（2013年12月9日）	15,142	64.8	1,681.89	62.4	98.5	—	1,350
10期（2014年12月8日）	18,991	25.4	1,978.25	17.6	97.9	—	1,531
11期（2015年12月8日）	20,872	9.9	2,185.03	10.5	99.2	—	1,545
12期（2016年12月8日）	22,251	6.6	2,153.40	△ 1.4	95.7	—	1,557

(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		T O P I X (東証株価指数 配当込み)		株 式 組 入 率 株 比	株 式 先 物 率 物 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年12月8日	円 20,872	% —	2,185.03	% —	% 99.2	% —
12月末	20,470	△ 1.9	2,157.78	△ 1.2	98.9	—
2016年1月末	18,496	△11.4	1,997.22	△ 8.6	98.8	—
2月末	16,452	△21.2	1,810.63	△17.1	98.8	—
3月末	17,437	△16.5	1,898.02	△13.1	97.7	—
4月末	17,422	△16.5	1,888.68	△13.6	98.1	—
5月末	18,021	△13.7	1,944.06	△11.0	98.1	—
6月末	15,673	△24.9	1,757.69	△19.6	97.7	—
7月末	16,899	△19.0	1,866.36	△14.6	99.0	—
8月末	18,039	△13.6	1,876.60	△14.1	99.3	—
9月末	17,674	△15.3	1,883.03	△13.8	98.1	—
10月末	19,157	△ 8.2	1,983.08	△ 9.2	98.4	—
11月末	20,900	0.1	2,091.95	△ 4.3	98.1	—
(期 末) 2016年12月8日	22,251	6.6	2,153.40	△ 1.4	95.7	—

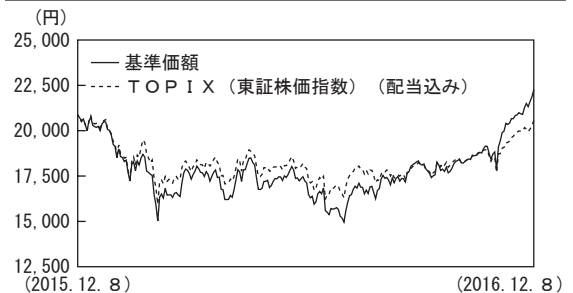
(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

## 運用経過

P2～P5をご参照下さい。

## 基準価額の推移



期首：20,872円  
 期末：22,251円  
 騰落率：6.6%

・ベンチマーク（TOPIX（東証株価指数）（配当込み））の推移は、2015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。

■ 1万口当たりの費用明細

(2015年12月9日から2016年12月8日まで)

項 目	
売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	23円 (23)
そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)
合 計	23

(注) 1万口当たりの費用明細は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。なお、費用項目については6ページ(1万口当たりの費用明細の項目の概要)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況

○国内株式

(2015年12月9日から2016年12月8日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
	千株	千円	千株	千円
国 内	717.9 (△274.5)	540,567 ( - )	706.1	637,466

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(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。

■ 期中の株式売買比率

P7をご参照下さい。

■ 主要な売買銘柄

○国内株式

(2015年12月9日から2016年12月8日まで)

当				期			
買		付		売		付	
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
第一生命ホールディングス	30.2	49,230	1,630.154	クラレ	40.4	59,512	1,473.092
デンソー	12	48,618	4,051.507	キャノン	19.5	58,946	3,022.920
野村ホールディングス	108.1	48,583	449.427	宇部興産	182	46,798	257.135
滋賀銀行	97	46,537	479.766	小松製作所	24.7	46,753	1,892.863
大林組	39.6	40,652	1,026.573	セイコーエプソン	23.5	45,395	1,931.724
T&Dホールディングス	28	32,211	1,150.417	住友商事	33.6	39,990	1,190.183
住友電気工業	21.7	32,020	1,475.585	滋賀銀行	67	38,791	578.977
三井住友トラスト・ホールディングス	67	27,391	408.832	旭硝子	45	30,202	671.170
JXホールディングス	63.9	27,211	425.851	日立建機	15.9	27,268	1,715.005
トヨタ自動車	4.4	26,591	6,043.451	日本電信電話	5.7	27,085	4,751.927

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■ 利害関係人との取引状況 (2015年12月9日から2016年12月8日まで)

当ファンドにおける当期中の利害関係人との取引はございません。

■組入資産の明細

下記は損保ジャパンSRIマザーファンド（700,162千口）の内容です。

○国内株式

(2016年12月8日現在)

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 (3.7%)</b>			
大林組	—	37.4	41,439
鹿島建設	—	17	13,906
<b>繊維製品 (3.8%)</b>			
グンゼ	184	151	57,229
<b>化学 (1.3%)</b>			
クラレ	44.1	3.7	6,308
昭和電工	187	8.1	13,713
宇部興産	182	—	—
<b>医薬品 (4.3%)</b>			
ツムラ	21.6	21.1	63,616
<b>石油・石炭製品 (2.0%)</b>			
JXホールディングス	—	60.3	30,150
<b>ガラス・土石製品 (1.6%)</b>			
旭硝子	74	29	23,229
<b>非鉄金属 (3.3%)</b>			
住友電気工業	9.4	29.3	49,531
<b>機械 (—)</b>			
小松製作所	24.7	—	—
日立建機	15.9	—	—
<b>電気機器 (8.8%)</b>			
ブラザー工業	4.6	—	—
日立製作所	98	105	67,914
三菱電機	30	22.6	37,572
富士通	9	—	—
セイコーエプソン	27	3.5	8,396
キャノン	17.9	—	—
リコー	29.3	16.6	17,081
<b>輸送用機器 (15.1%)</b>			
デンソー	—	11.3	55,720
日産自動車	14.4	10.6	11,755
トヨタ自動車	2.5	6.5	45,396
マツダ	28.3	26	51,337
本田技研工業	18.1	17.8	61,178
<b>その他製品 (0.6%)</b>			
大日本印刷	—	8	8,960
<b>電気・ガス業 (—)</b>			
大阪瓦斯	20	—	—
<b>海運業 (6.2%)</b>			
日本郵船	111	133	32,319
商船三井	190	176	60,016

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>情報・通信業 (4.8%)</b>			
日本電信電話	17.8	12.1	54,982
KDDI	—	5.6	16,256
<b>卸売業 (10.7%)</b>			
三井物産	45.2	42.7	72,163
住友商事	46.9	13.3	18,959
三菱商事	30.4	25.8	67,634
<b>銀行業 (18.7%)</b>			
三菱UFJフィナンシャル・グループ	54.2	87.4	65,209
三井住友トラスト・ホールディングス	51	11.1	49,794
三井住友フィナンシャルグループ	16.1	14.8	68,731
八十二銀行	—	9.3	6,342
滋賀銀行	—	30	19,050
みずほフィナンシャルグループ	294.6	315.9	69,308
<b>証券、商品先物取引業 (6.0%)</b>			
大和証券グループ本社	—	19	14,379
野村ホールディングス	—	102.1	75,043
<b>保険業 (7.9%)</b>			
第一生命ホールディングス	11.2	38.6	76,408
T&Dホールディングス	—	26.7	41,064
<b>その他金融業 (1.2%)</b>			
リコーリース	5.8	5.1	18,309
<b>合 計</b>			
	株 数・金 額	1,916	1,653.3
	銘柄数<比率>	33銘柄	37銘柄
			<95.7%>

(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

(2016年12月8日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	1,490,406	95.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	67,544	4.3
投 資 信 託 財 産 総 額	1,557,951	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2016年12月8日現在)

項 目	当 期 末
a 資産	1,557,951,584円
コール・ローン等	66,299,184
株式(評価額)	1,490,406,900
未収配当金	1,245,500
b 負債	—
c 純資産総額(a - b)	1,557,951,584
元本	700,162,685
次期繰越損益金	857,788,899
d 受益権総口数	700,162,685口
1万口当たり基準価額(c / d)	22,251円

(注1) 信託財産に係る期首元本額740,234,919円、期中追加設定元本額11,100,465円、期中一部解約元本額51,172,699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 700,162,685円

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 2.2251円

■損益の状況

(2015年12月9日から2016年12月8日まで)

項 目	当 期
a 配当等収益	38,107,312円
受取配当金	38,113,350
受取利息	216
その他収益金	171
支払利息	△ 6,425
b 有価証券売買損益	55,094,377
売買益	157,793,853
売買損	△102,699,476
c 信託報酬等	△ 596
d 当期損益金(a + b + c)	93,201,093
e 前期繰越損益金	804,785,572
f 解約差損益金	△ 52,217,301
g 追加信託差損益金	12,019,535
h 合計(d + e + f + g)	857,788,899
次期繰越損益金(h)	857,788,899

(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) 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。

(注4) 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。