

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13期（決算日 2017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SRIオープン」は、このたび第13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	株式先物比率	純資産額
	(分配落)	込金 税分配	期中騰落率	(東証株価指数)	期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
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
13期(2017年12月8日)	11,544	1,000	11.0	1,803.73	19.2	97.1	—	1,567

(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	株式先物比率
	騰落率	(東証株価指数)	騰落率			
(期首)	円	%		%	%	%
2016年12月8日	11,302	—	1,512.69	—	94.7	—
12月末	11,105	△1.7	1,518.61	0.4	98.3	—
2017年1月末	11,219	△0.7	1,521.67	0.6	97.6	—
2月末	11,291	△0.1	1,535.32	1.5	98.3	—
3月末	11,097	△1.8	1,512.60	△0.0	96.7	—
4月末	11,041	△2.3	1,531.80	1.3	97.3	—
5月末	10,959	△3.0	1,568.37	3.7	97.3	—
6月末	11,448	1.3	1,611.90	6.6	97.5	—
7月末	11,437	1.2	1,618.61	7.0	98.4	—
8月末	11,253	△0.4	1,617.41	6.9	98.2	—
9月末	11,888	5.2	1,674.75	10.7	97.3	—
10月末	12,356	9.3	1,765.96	16.7	97.2	—
11月末	12,544	11.0	1,792.08	18.5	97.4	—
(期末)						
2017年12月8日	12,544	11.0	1,803.73	19.2	97.1	—

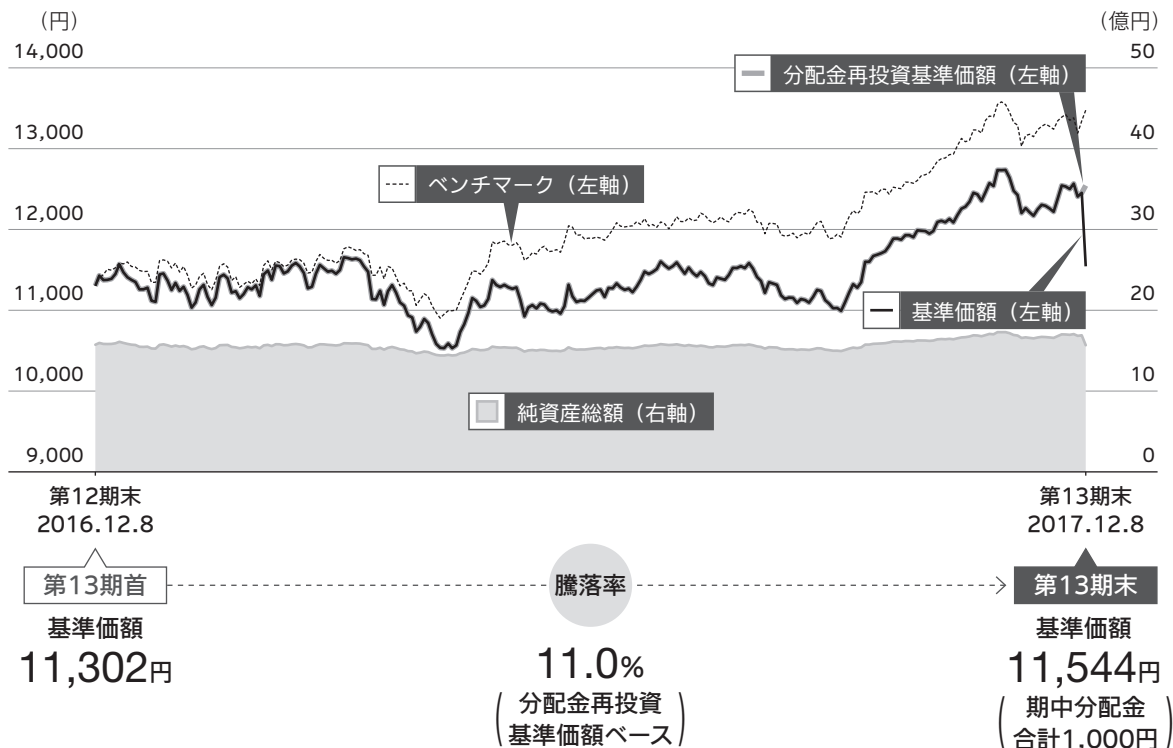
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(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、2016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+12.9%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、デンソー、日立製作所、ツムラ、日本電信電話、第一生命ホールディングス、大林組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ように統一して表記しています。

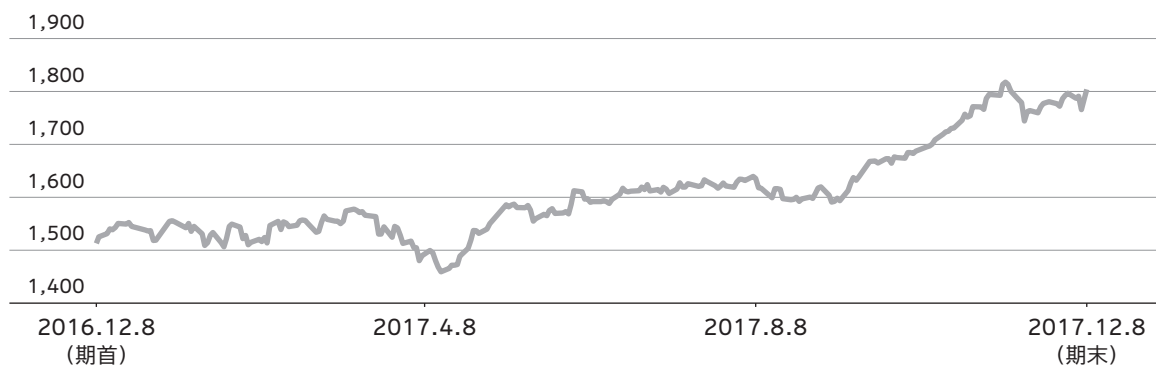
 ベビーファンド  マザーファンド

● 投資環境

TOPIXは19.2%の上昇となりました。

期初はトランプ政権による財政支出拡大や減税に対する見方が交錯してもみ合う展開となり、期待が後退して株価が下落する場面も見られましたが、米政府高官による大型減税やインフラ投資への言及を好感して反発しました。6月にはFRB(米連邦準備理事会)が今年2回目の利上げを行うなど、良好な米経済を背景に米国の主要株式指数が過去最高値の更新を続ける中で、国内株式市場も緩やかな上昇を続けました。その後、北朝鮮のミサイル発射による地政学リスクの高まりから調整局面を迎えましたが、好調な国内企業業績や良好な海外経済を背景に株価は上昇基調を維持しました。期末にかけて、株価の過熱感やトランプ政権のロシア疑惑などから一時的に売りが優勢となりましたが、反発し、年初来高値圏で推移して当期を終えました。

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。期末の組入比率(対純資産総額比)は、99.0%です。

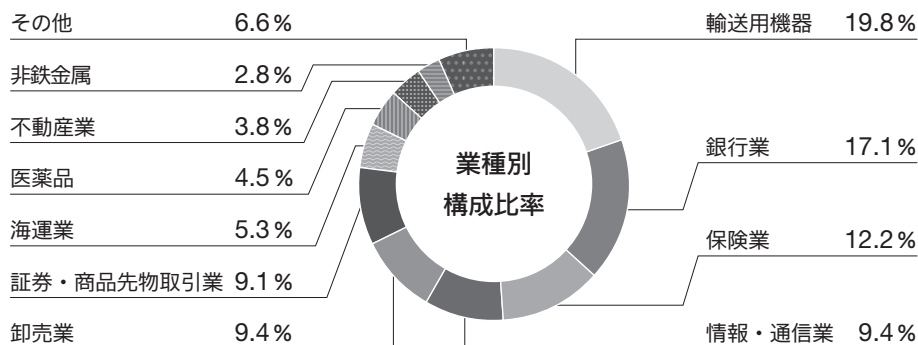
損保ジャパンSRIマザーファンド

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、98.1%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、大和証券グループ本社、三菱地所、KDDIなど、主な売却(ウェイトダウン)銘柄は、大林組、グンゼ、日立製作所などです。

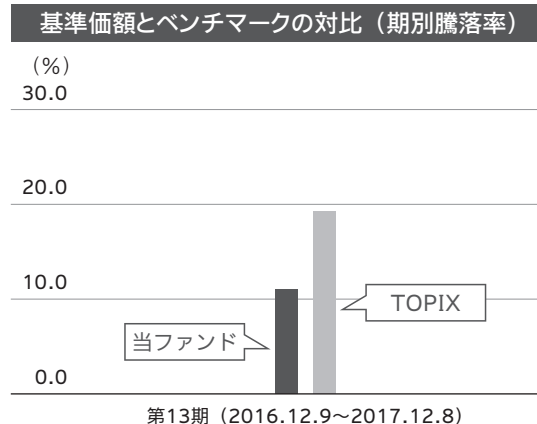


注1. 比率は、第13期末における国内株式の評価総額に対する各業種の評価額の割合。

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（+19.2%）を8.3%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。



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（+21.8%）を8.9%下回りました。

ベンチマークとの差異を要因分析しますと、業種要因は、陸運業、不動産業、電気・ガス業のアンダーウェイトなどがプラス要因、銀行業のオーバーウェイト、電気機器、化学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、ツムラ、デンソー、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、マツダ、三井物産、KDDI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、1万口当たり1,000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13期 2016.12.9~2017.12.8
当期分配金 (対基準価額比率)	1,000 7.97%
当期の収益	1,000
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,912

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

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

期中の総費用率は **1.703%** です。

項目	第13期 2016.12.9~2017.12.8		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	186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11,467円です。
（投信会社）	（ 87）	（0.756）	ファンドの運用の対価
（販売会社）	（ 87）	（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）	（ 12）	（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	9	0.080	(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）	（ 9）	（0.080）	
(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	195	1.703	

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

(2016年12月9日から2017年12月8日まで)

	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	5,689	12,870	88,456	213,270

(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	1,271,204千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	1,526,702千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.83

(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 (2016年12月9日から2017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

(2017年12月8日現在)

	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	700,162	617,396	1,550,961

(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

(2017年12月8日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
損保ジャパンSRIマザーファンド	1,550,961	90.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	166,264	9.7
投 資 信 託 財 産 総 額	1,717,225	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

(2017年12月8日現在)

項 目	当 期 末
a 資産	1,717,225,967円
コール・ローン等	166,264,898
損保ジャパンSRI マザーファンド(評価額)	1,550,961,069
b 負債	150,094,762
未払収益分配金	135,748,507
未払解約金	1,393,627
未払信託報酬	12,926,836
その他未払費用	25,792
c 純資産総額(a - b)	1,567,131,205
元本	1,357,485,073
次期繰越損益金	209,646,132
d 受益権総口数	1,357,485,073口
1万口当たり基準価額(c / d)	11,544円

(注1) 信託財産に係る期首元本額1,392,087,841円、期中追加設定元本額44,193,153円、期中一部解約元本額78,795,921円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額 1.1544円

■損益の状況

(2016年12月9日から2017年12月8日まで)

項 目	当 期
a 配当等収益	△ 19,070円
受取利息	219
支払利息	△ 19,289
b 有価証券売買損益	193,091,117
売買益	194,178,237
売買損	△ 1,087,120
c 信託報酬等	△ 25,404,855
d 当期損益金(a + b + c)	167,667,192
e 前期繰越損益金	173,458,141
f 追加信託差損益金	4,269,306
(配当等相当額)	(54,082,279)
(売買損益相当額)	(△ 49,812,973)
g 合計(d + e + f)	345,394,639
h 収益分配金	△135,748,507
次期繰越損益金(g + h)	209,646,132
追加信託差損益金	4,269,306
(配当等相当額)	(54,176,178)
(売買損益相当額)	(△ 49,906,872)
分配準備積立金	205,376,826

(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(2016年12月9日から2017年12月8日まで)

計算期間末における経費控除後の配当等収益(35,921,573円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益(131,736,991円)、収益調整金(54,176,178円)及び分配準備積立金(173,466,769円)を対象収益(395,301,511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、配当等収益から35,921,573円、有価証券売買等損益から99,826,934円の合計135,748,507円(1万口当たり1,000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13期
1万口当たり分配金（税引前）	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。

※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。

■お知らせ

○信用リスク集中回避のための投資制限に関する記載を追加するため、投資信託約款に所要の変更を行いました（2017年9月1日）。

損保ジャパンSRIマザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2017年12月8日）

<計算期間 2016年12月9日～2017年12月8日>

損保ジャパンSRIマザーファンドの第13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		TOPIX		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰落	中率	(東証株価指数 配当込み)	期騰落			
	円	%		%	%	%	百万円
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
13期（2017年12月8日）	25,121	12.9	2,622.46	21.8	98.1	—	1,550

（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 比	株 式 先 物 率 比
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2016年12月 8 日	円	%	2,153.40	%	%	%
12月末	22,251	—	2,164.57	—	95.7	—
2017年 1 月末	21,880	△ 1.7	2,169.23	0.5	99.2	—
2 月末	22,137	△ 0.5	2,189.71	0.7	98.8	—
3 月末	22,309	0.3	2,176.87	1.7	99.3	—
4 月末	21,953	△ 1.3	2,204.51	1.1	97.7	—
5 月末	21,868	△ 1.7	2,257.27	2.4	98.2	—
6 月末	21,736	△ 2.3	2,324.06	4.8	98.2	—
7 月末	22,746	2.2	2,333.91	7.9	98.3	—
8 月末	22,755	2.3	2,332.80	8.4	99.2	—
9 月末	22,416	0.7	2,434.16	8.3	99.1	—
10 月末	23,722	6.6	2,566.81	13.0	98.1	—
11 月末	24,701	11.0	2,604.86	19.2	98.1	—
(期 末) 2017年12月 8 日	25,114	12.9	2,622.46	21.0	98.4	—
	25,121	12.9	2,622.46	21.8	98.1	—

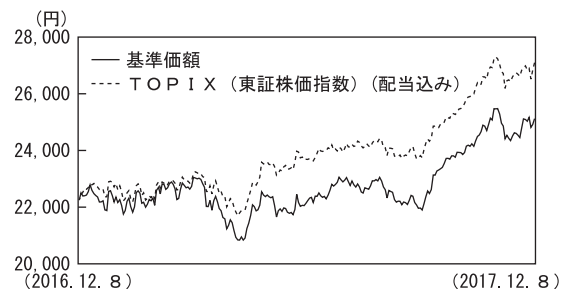
(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

運用経過

P 2 ～ P 8 をご参照下さい。

基準価額の推移



期首：22,251円
 期末：25,121円
 騰落率：12.9%

- ベンチマーク（TOPIX（東証株価指数）（配当込み））の推移は、2016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

(2016年12月9日から2017年12月8日まで)

項 目	
売買委託手数料 (株 式)	18円 (18)
その他費用 (そ の 他)	0 (0)
合 計	18

(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9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

(2016年12月9日から2017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	504.9 (△290.5)	575,474 (-)	797.6	695,730

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 金額の単位未満切捨て。

(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

P10をご参照下さい。

■ 主要な売買銘柄

○国内株式

(2016年12月9日から2017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
大和証券グループ本社	84	60,196	716.625	大林組	55.2	71,752	1,299.855
三菱地所	29.9	58,191	1,946.187	グンゼ	155	67,871	437.877
KDDI	17.9	53,331	2,979.408	日立製作所	79	62,520	791.399
ローソン	5.8	43,522	7,503.835	商船三井	176	61,267	348.108
日本郵船	186	42,335	227.611	三菱電機	22.6	38,294	1,694.438
東京海上ホールディングス	8.5	38,270	4,502.430	JXTGホールディングス	62.6	31,179	498.080
日産自動車	33.4	36,099	1,080.809	ツムラ	6.2	26,090	4,208.107
トヨタ自動車	4.8	28,487	5,934.856	旭硝子	26.6	24,861	934.635
SUBARU	6	23,603	3,933.943	SUBARU	6	21,524	3,587.345
T&Dホールディングス	13.4	22,152	1,653.200	住友商事	13.3	20,872	1,569.335

(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 (2016年12月9日から2017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（617,396千口）の内容です。

○国内株式

(2017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
建設業（一）			
大林組	37.4	—	—
鹿島建設	17	—	—
繊維製品（一）			
グンゼ	151	—	—
化学（一）			
クラレ	3.7	—	—
昭和電工	8.1	—	—
医薬品（4.5%）			
ツムラ	21.1	18.4	68,448
石油・石炭製品（一）			
JXTGホールディングス	60.3	—	—
ガラス・土石製品（一）			
旭硝子	29	—	—
非鉄金属（2.8%）			
住友電気工業	29.3	23.1	42,515
電気機器（1.6%）			
日立製作所	105	28	23,816
三菱電機	22.6	—	—
セイコーエプソン	3.5	—	—
リコー	16.6	—	—
輸送用機器（19.8%）			
デンソー	11.3	12.2	75,603
日産自動車	10.6	39.5	42,877
トヨタ自動車	6.5	10.3	72,275
マツダ	26	29.8	44,104
本田技研工業	17.8	17.8	67,159
その他製品（一）			
大日本印刷	8	—	—
海運業（5.3%）			
日本郵船	133	29.5	80,092
商船三井	176	—	—
情報・通信業（9.4%）			
日本電信電話	12.1	13.3	76,727
KDDI	5.6	20.8	66,040
卸売業（9.4%）			
三井物産	42.7	39.8	67,381
住友商事	13.3	—	—
三菱商事	25.8	25.7	75,211
小売業（2.7%）			
ローソン	—	5.1	40,443

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
銀行業（17.1%）				
三菱UFJフィナンシャル・グループ	87.4	86.4	67,685	
りそなホールディングス	—	15.9	9,602	
三井住友トラスト・ホールディングス	11.1	10.1	42,500	
三井住友フィナンシャルグループ	14.8	15.7	72,659	
八十二銀行	9.3	—	—	
滋賀銀行	30	15	8,670	
みずほフィナンシャルグループ	315.9	293.7	59,386	
証券・商品先物取引業（9.1%）				
大和証券グループ本社	19	98	68,031	
野村ホールディングス	102.1	106.7	70,880	
保険業（12.2%）				
第一生命ホールディングス	38.6	35.1	82,397	
東京海上ホールディングス	—	7.5	37,770	
T&Dホールディングス	26.7	34.8	66,033	
その他金融業（2.4%）				
リコーリース	5.1	9.4	36,331	
不動産業（3.8%）				
三菱地所	—	28.5	57,356	
合 計	株 数 ・ 金 額	株 数	株 数	評 価 額
		1,653.3	1,070.1	1,521,999
	銘柄数 <比率>	37銘柄	27銘柄	<98.1%>

(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

(2017年12月8日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	1,521,999	98.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	28,959	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	1,550,958	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

(2017年12月8日現在)

項 目	当 期 末
a 資産	1,550,958,999円
コール・ローン等	27,909,629
株式(評価額)	1,521,999,370
未収配当金	1,050,000
b 負債	-
c 純資産総額(a - b)	1,550,958,999
元本	617,396,230
次期繰越損益金	933,562,769
d 受益権総口数	617,396,230口
1万口当たり基準価額(c/d)	25,121円

(注1) 信託財産に係る期首元本額700,162,685円、期中追加設定元本額5,689,972円、期中一部解約元本額88,456,427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	617,396,230円
---------------	--------------

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 2.5121円

■損益の状況

(2016年12月9日から2017年12月8日まで)

項 目	当 期
a 配当等収益	41,559,334円
受取配当金	41,572,000
その他収益金	250
支払利息	△ 12,916
b 有価証券売買損益	151,848,817
売買益	189,231,515
売買損	△ 37,382,698
c 信託報酬等	△ 736
d 当期損益金(a + b + c)	193,407,415
e 前期繰越損益金	857,788,899
f 解約差損益金	△124,813,573
g 追加信託差損益金	7,180,028
h 合計(d + e + f + g)	933,562,769
次期繰越損益金(h)	933,562,769

(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。

■お知らせ

○信用リスク集中回避のための投資制限に関する記載を追加するため、投資信託約款に所要の変更を行いました(2017年9月1日)。