

日本株式SRIファンド

追加型投信／国内／株式

交付運用報告書

第17期(決算日 2023年6月9日)
(作成対象期間 2022年6月10日～2023年6月9日)

当期末

基準価額	11,420円
純資産総額	2,249百万円
騰落率	9.9%
分配金合計	200円

(注1) 以下本書において、基準価額及び分配金は1万口当たりで表記しています。

(注2) 騰落率は、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す。

■口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

フリーダイヤル:0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

SMTAM投信関連情報サービス



お客様が指定されたファンドに関する情報(基準価額、レポート)や投資に関するコラム等をLINEでお知らせします。

※LINEご利用設定は、お客様のご判断でお願いします。

※サービスのご利用にあたっては、あらかじめ「SMTAM投信関連情報サービス利用規約」をご確認ください。

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。さて、当ファンドは、このたび、上記の決算を行いました。当ファンドは、わが国の取引所上場企業および店頭登録企業のうち、企業の社会的責任に積極的に取り組んでいる企業の株式に投資しました。ここに期間中の運用状況についてご報告申し上げます。今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

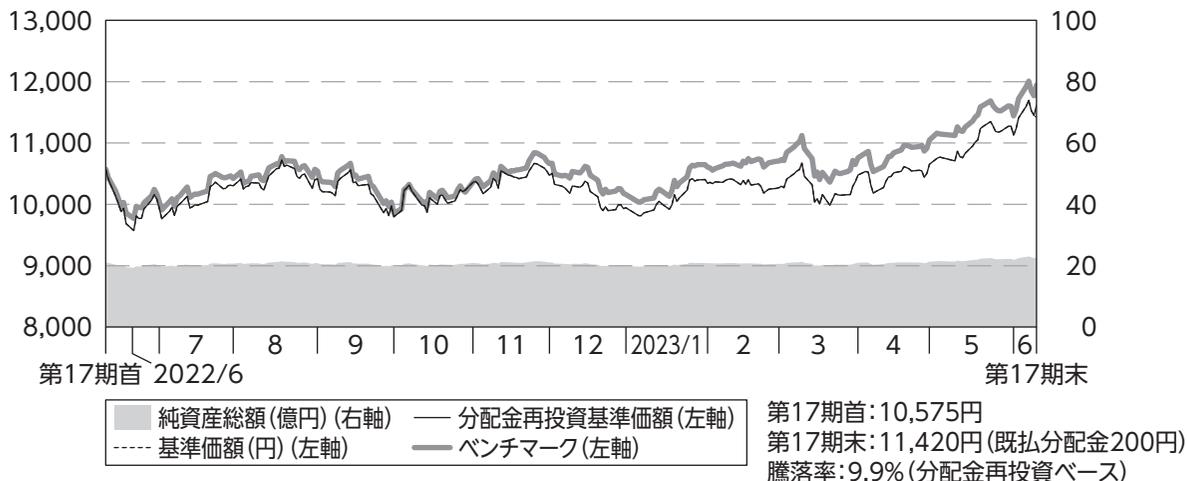
〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

当ファンドは、投資信託約款において運用報告書(全体版)を電磁的方法によりご提供することを定めております。上記ホームページにアクセスし、「ファンド検索」等から、当ファンドのページを表示させることにより、運用報告書(全体版)を閲覧及びダウンロードすることができます。なお、ご請求いただいた場合には交付いたしますので、販売会社までお問い合わせください。

運用経過の説明

1 基準価額等の推移



(注1) 分配金再投資基準価額は、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。

(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2022年6月9日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。詳細につきましては後記をご覧ください。

2 基準価額の主な変動要因

当期末の基準価額は、期首比で上昇しました。

国内株式市場は、円安・米ドル高の進行や中国景気の回復に対する期待などから上昇しました。

このような環境下、CSR(企業の社会的責任)やESGへの取り組みを好業績に繋げている銘柄の株価上昇が基準価額に対してプラスに寄与した一方、先行きの不透明感が懸念された銘柄の株価下落が基準価額にマイナスに影響しました。

個別銘柄では、市場拡大が見込まれる再生可能エネルギーなど環境に配慮した事業活動を行っている伊藤忠商事、金利上昇による利ざや改善が期待された三菱UFJフィナンシャル・グループ、三井住友フィナンシャルグループなどがプラスに寄与しました。一方、新型コロナウイルスワクチンの製造受託終了や新薬の開発進捗の遅れが嫌気されたJCRファーマなどがマイナスに影響しました。

運用経過の説明

3 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年6月10日~2023年6月9日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	182円	1.760%	(a) 信託報酬 = [期中の平均基準価額] × 信託報酬率 期中の平均基準価額は10,342円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付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、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(85)	(0.825)	
(販売会社)	(85)	(0.825)	
(受託会社)	(11)	(0.110)	
(b) 売買委託手数料	9	0.086	
(株式)	(9)	(0.085)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	1	0.005	(d) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(-)	(-)	
合計	192	1.851	

(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、簡便法により算出した結果です。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

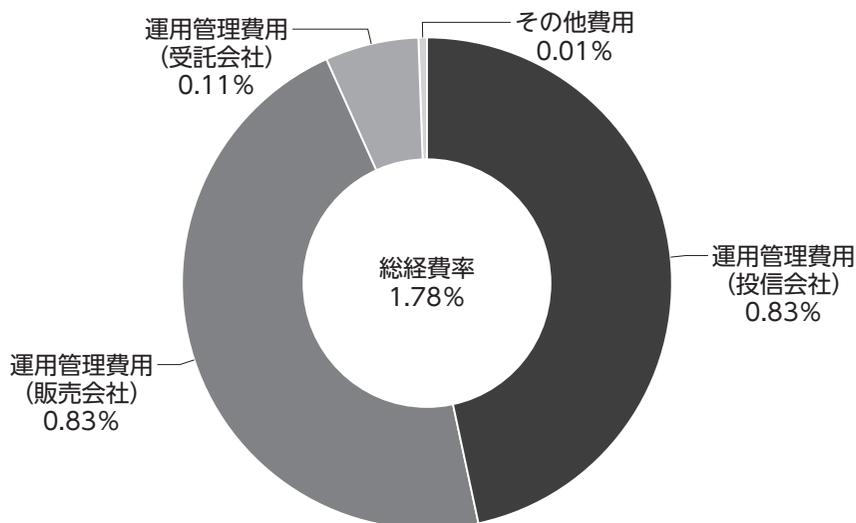
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

運用経過の説明

<参考情報>

総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及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1.78%です。



(注1) 各費用は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。

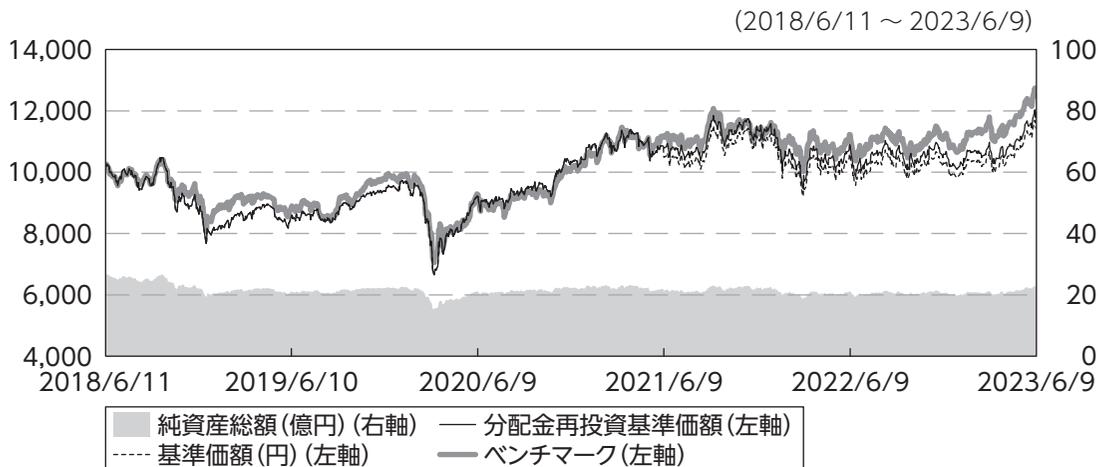
(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 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。

運用経過の説明

4 最近5年間の基準価額等の推移



(注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しております。

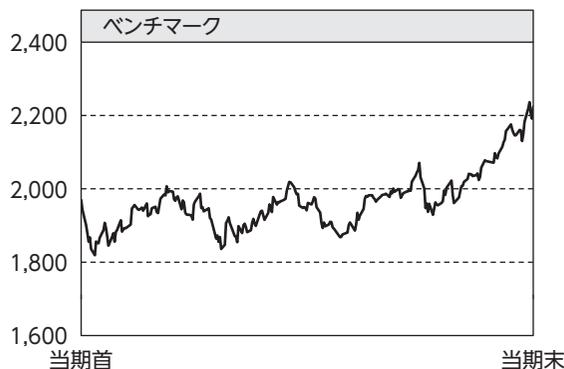
(注2) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2018年6月11日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

	2018年6月11日 決算日	2019年6月10日 決算日	2020年6月9日 決算日	2021年6月9日 決算日	2022年6月9日 決算日	2023年6月9日 決算日
基準価額 (円)	10,184	8,561	9,195	10,485	10,575	11,420
期間分配金合計(税引前) (円)	—	0	0	300	0	200
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	△15.9	7.4	17.3	0.9	9.9
ベンチマーク騰落率 (%)	—	△13.1	4.9	20.2	0.6	13.0
純資産総額 (百万円)	2,636	2,101	2,104	2,112	2,122	2,249

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

5 投資環境



当期の国内株式市場は上昇しました。

新型コロナウイルス感染拡大や米国の金融引き締めペースの加速が懸念される一方で、円安・米ドル高が進行したことなどが下支えとなり、国内株式市場は2022年11月にかけて一進一退の展開となりました。その後は、日銀による金融政策の修正を受けて一時下落したものの、中国政府がゼロコロナ政策の転換を発表したことで中国景気の回復が意識され上昇しました。期末にかけては、米国におけるインフレ率の鈍化を背景に景気悪化に対する懸念が後退したことなどから、国内株式市場は一段高となりました。

6 当ファンドのポートフォリオ

株式への投資は、「SRI マザーファンド(S)」の組み入れを通じて行いました。

【「SRI マザーファンド(S)」の運用状況】

SRIユニバース約400社の中から、CSRへの取り組みが持続的な業績成長に寄与することが見込まれる銘柄や株価動向から投資魅力が高いと判断される銘柄を厳選して、ファンドへの組み入れを行いました。

当期につきましては、半導体の情報処理能力向上やデータ転送速度高速化、低消費電力化などデジタル技術の革新に貢献している東京エレクトロン、事業活動を通じて人々の「美」の実現に貢献しているほか、CO2排出量の削減など環境負荷低減にも取り組んでいる資生堂を新規に組み入れました。一方、新型コロナウイルス関連事業の特需剥落などヘルスケア事業の成長鈍化が懸念された富士フイルムホールディングス、原料費の高騰による収益性の悪化が懸念されたレゾナック・ホールディングスを全売却しました。

組入上位銘柄のプロファイル(ESG評価とファンドマネージャー評価)

銘柄	ESGスコア	ESG評価のポイント
		ファンドマネージャー評価のポイント
ソニーグループ	4.19	<p>【ESG評価のポイント】 「クリエイティビティとテクノロジーの力で、世界を感動で満たす」という存在意義と「人に近づく」という経営の方向性のもと、「人」を軸に多様な事業を展開し、多様性を強みとした持続的な価値創造と長期視点での企業価値向上を目指している</p> <ul style="list-style-type: none"> ・2021年度から、各事業が重視している人材や環境などのサステナビリティ課題への取り組みについて、それぞれの中期計画に含めるとともに、KPIを設定し、事業の業績評価の一部にも組み込んでいる。 ・2022年5月、気候変動領域における環境負荷ゼロの達成目標年を10年前倒しし、2040年までにスコープ3まで含めたカーボンニュートラルの実現を目指すことを決定した。 <p>【ファンドマネージャー評価のポイント】 映画や音楽などクリエイターに対するサポートを通じた才能の育成と多様な人々の心を豊かにする作品の提供による事業の拡大、イメージング技術などを活用した世界の技術革新に対する貢献拡大を通じた成長に期待。</p>
トヨタ自動車	3.32	<p>【ESG評価のポイント】 「幸せを量産する」をミッションとし、事業を通じて社会の課題を解決することを目指している</p> <ul style="list-style-type: none"> ・自動運転に代表される先進技術の開発により交通事故死傷者ゼロの実現を目指している。 ・世界170以上の国・地域で、それぞれの経済状況、エネルギー政策、産業政策、お客様のニーズの違いなどを考慮しながら、SDGsに対応し、「ライフサイクルCO2ゼロ」「新車CO2ゼロ」「工場CO2ゼロ」「人と自然が共生する未来づくり」など全方位で電動車戦略(次世代自動車の開発・調達・生産)に取り組んでいる。 <p>【ファンドマネージャー評価のポイント】 優位性のあるハイブリッド車に加え電気自動車や燃料電池車など地域特性等に合わせた多様な商品展開を通じた環境負荷の低い移動手段の提供による成長に加え、継続的なコストダウン施策を通じた利益創出力を評価。</p>

銘柄	ESGスコア	ESG評価のポイント
		ファンドマネージャー評価のポイント
三菱UFJフィナンシャル・グループ	3.63	<p>【ESG評価のポイント】 「世界が進むチカラになる。」をパーパス(存在意義)として、環境・社会課題解決と会社の経営戦略を一体と捉えて価値創造に取り組んでいる</p> <ul style="list-style-type: none"> ・2050年までに投融資ポートフォリオの温室効果ガス排出量のネットゼロ、および2030年までに会社自らの温室効果ガス排出量のネットゼロ達成を目指している。 ・銀行、信託、証券の3社において、2024年3月末までに日本国内の女性のマネジメント(次課長以上)比率を20%とする合同数値目標を設定し、女性の登用を推進している。 ・少子・高齢化がもたらす社会構造の変化や顧客ニーズの変化・多様化に対して、グループ力を総合的に発揮した金融商品・サービスの拡充や研究、社会貢献活動を実施している。
		<p>【ファンドマネージャー評価のポイント】 デジタル拡張による利便性の高い金融機能の提供やアジアなど海外での金融サービス提供拡大に加え、金利上昇による利ザヤ改善や資金需要の拡大を通じた利益成長に期待。</p>
伊藤忠商事	4.70	<p>【ESG評価のポイント】 「三方よし」を企業理念とし、中期経営計画「Brand-new Deal 2023」の基本方針の一つとして「『SDGs』への貢献・取組強化」を掲げ、SDGsに関する取り組みを加速させている</p> <ul style="list-style-type: none"> ・GHG排出量削減に関して、2040年までにGHG排出量から再生可能エネルギー等のビジネス拡大に伴う削減貢献分を差し引いて、ゼロとする「オフセットゼロ」、2050年までにGHG排出量「実質ゼロ」を目指し、排出量削減に貢献するビジネスを積極推進している。 ・「人材の多様化」に対する社会的な要請が一層高まる中、喫緊の課題である「女性の活躍支援」を加速化させている。
		<p>【ファンドマネージャー評価のポイント】 景気変動の影響を受けにくいバランスされた事業ポートフォリオを有しているほか、優秀な人材の定着と生産性向上に資する誰もが働きやすい環境を整備し続けている点を評価。衣食住を中心とする非資源分野での安定的な成長と、再エネ・リサイクル・低炭素化など資源分野での需要変化を捉えた中期的な成長に期待。</p>

銘柄	ESGスコア	ESG評価のポイント
		ファンドマネージャー評価のポイント
第一三共	3.15	<p>【ESG評価のポイント】 「世界中の人々の健康で豊かな生活に貢献する」をパーパス(存在意義)として、革新的医薬品を継続的に創出し、多様な医療ニーズに応える医薬品を提供することを目指している</p> <ul style="list-style-type: none"> ・第5期中期経営計画(2021~2025年度)では、「がんに強みを持つ先進的グローバル創薬企業」を実現し、2030年ビジョンである「サステナブルな社会の発展に貢献する先進的グローバルヘルスケアカンパニー」達成に向けた成長ステージへの移行を目指している。 ・「研究開発の促進」、「医薬品へのアクセス向上」、「地域医療基盤の強化」を活動の3本柱として、研究開発から製造、販売、安全性管理にわたるバリューチェーン全体で医療アクセスの課題に取り組んでいる。
		<p>【ファンドマネージャー評価のポイント】 抗体研究と技術の融合による革新的な創薬力を評価。優れた薬剤を適切にがん細胞に運ぶADC(抗体薬物複合体)技術を用いて、乳がんを中心とするがん疾患に対する医薬品を開発しており、未だに有効な治療が確立されていない疾患に対する新薬の提供を通じた中長期的な成長に期待。</p>

ESGスコア平均及びスコア別構成比

		ファンド	ベンチマーク
ESGスコア平均		3.70	3.48
構成比	5	0.0%	0.0%
	4以上5未満	35.9%	29.1%
	3以上4未満	57.4%	52.3%
	2以上3未満	6.7%	15.0%
	1以上2未満	0.0%	1.8%

※対現物株式構成比です。

スチュワードシップ活動についてはこちらで確認できます。

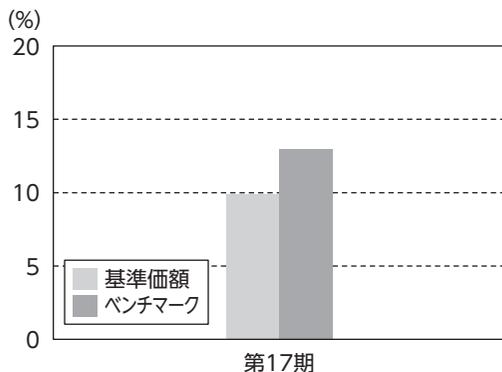


※ESGスコアとは、当社が重要と考えるESG課題(ESGマテリアリティ)を評価項目として、定量・定性の両面から総合的に評価し、1(最低)~5(最高)のスコアで表したものです。

運用経過の説明

7 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドの基準価額騰落率はベンチマーク騰落率を下回りました。

個別銘柄では、伊藤忠商事、イビデンなどがプラスに寄与した一方、JCRファーマ、エムスリー、コニカミノルタなどがマイナスに影響しました。

8 分配金

分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきます。なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目	第17期	
	2022年6月10日~2023年6月9日	
当期分配金	(円)	200
(対基準価額比率)	(%)	(1.721)
当期の収益	(円)	178
当期の収益以外	(円)	21
翌期繰越分配対象額	(円)	4,319

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2) 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)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3) -印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

SRI マザーファンド(S)の受益証券への投資を通じて、わが国の取引所上場企業および店頭登録企業のうち、企業の社会的責任に積極的に取り組んでいる企業の株式に投資します。

企業の社会的責任への取組みは、法的責任、社会的責任、環境的責任、経済的責任の4つの評価軸から評価し、この4つの評価軸をもとに組入候補銘柄群を定めます。

組入候補銘柄群の中から、中長期的に株価の上昇が見込める銘柄に投資し、ポートフォリオを構築します。

お知らせ

ESGリサーチの更なる高度化を目指し、ESGリサーチを担う主体の変更(変更前:株式会社日本総合研究所→変更後:三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社)を行いました。

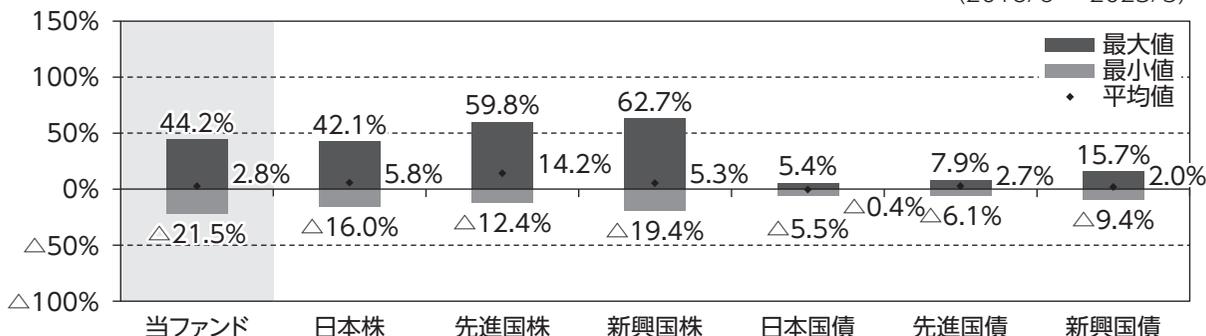
なお、この変更によるファンドの運用哲学・運用プロセス、その他(ファンドの費用等)の変更はありません。

当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／国内／株式	
信託期間	信託期間は2006年6月12日から無期限です。	
運用方針	主として、SRI マザーファンド(S)の受益証券(以下「マザーファンド受益証券」といいます。)への投資を通じて、中長期的にベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)を上回る投資成果を目指します。	
主要投資対象	日本株式SRIファンド	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	SRI マザーファンド(S)	わが国の株式を主要投資対象とします。
運用方法	マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の取引所上場企業および店頭登録企業のうち、企業の社会的責任に積極的に取り組んでいる企業の株式に投資します。 企業の社会的責任への取組みは、法的責任、社会的責任、環境的責任、経済的責任の4つの評価軸から評価し、この4つの評価軸をもとに組入候補銘柄群を定めます。 組入候補銘柄群の中から、中長期的に株価の上昇が見込める銘柄に投資し、ポートフォリオを構築します。	
分配方針	原則として、毎年6月9日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。 分配金額については、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、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2018/6 ~ 2023/5)



(注1) 2018年6月~2023年5月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したものであり、決算日に対応した数値とは異なります。

(注2) 当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

(注3) 各資産クラスの指数

日本株 …… TOPIX (東証株価指数、配当込み)^{*1}

先進国株 …… MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)^{*2}

新興国株 …… MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)^{*3}

日本国債 …… NOMURA-BPI国債^{*4}

先進国債 …… FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)^{*5}

新興国債 …… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド (円ベース)^{*6}

海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※1 TOPIX (東証株価指数) とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社 (以下「JPX」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

※2 MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

※3 MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

※4 NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

※5 FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

※6 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

当ファンドのデータ

1 当ファンドの組入資産の内容

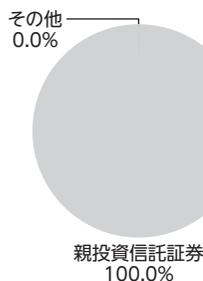
○組入ファンド

	当期末
	2023年6月9日
SRI マザーファンド(S)	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載されています。

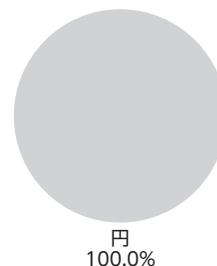
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

2 純資産等

項目	第17期末
	2023年6月9日
純資産総額	2,249,765,345円
受益権総口数	1,970,064,445口
1万口当たり基準価額	11,420円

※当期間中における追加設定元本額は149,429,131円、同解約元本額は186,541,784円です。

当ファンドのデータ

3 組入ファンドの概要

現時点で入手し得る下記ファンドの直近の決算日の情報を掲載しております。

SRI マザーファンド(S)

○基準価額の推移



○1万口当たりの費用明細

(2021年12月25日～2022年12月26日)

項目	
(a) 売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	12円 (12) (0)
合計	12

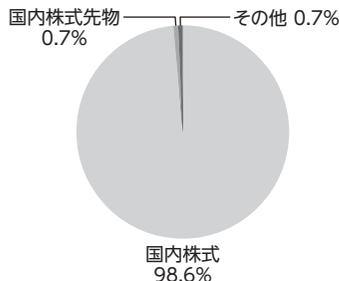
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	日本電信電話	日本	4.2%
2	ソニーグループ	日本	4.1%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	4.1%
4	トヨタ自動車	日本	3.9%
5	伊藤忠商事	日本	3.4%
6	リクルートホールディングス	日本	3.3%

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	三井住友フィナンシャルグループ	日本	3.3%
8	ダイキン工業	日本	3.2%
9	西日本旅客鉄道	日本	2.7%
10	第一三共	日本	2.5%
組入銘柄数			67

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

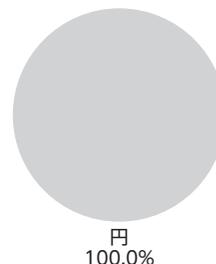
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注1) 上位10銘柄、資産別・国別・通貨別配分のデータは2022年12月26日現在のものです。

(注2) 1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の決算期のものです。費用項目の概要等については「運用経過の説明 1万口当たりの費用明細」をご参照ください。

(注3) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注4) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して0.7%買建てております。