

運用報告書(全体版)

第35期

(決算日：2022年9月15日)

りそなジャパンCSRファンド ＜愛称：誠実の杜＞

*当ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	追加型投信／国内／株式	
信託期間	原則として無期限です。	
運用方針	<ul style="list-style-type: none">・パインブリッジ・ジャパンCSRマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）への投資を通じて、わが国の株式に投資を行い、信託財産の積極的な成長を目指します。・東証株価指数（TOPIX）をベンチマークとし、これを上回る投資成果を目指して運用を行います。・銘柄の選定にあたっては、企業の社会的責任（CSR：Corporate Social Responsibility）の考え方を重視し、当社独自の銘柄選定基準にしたがって行います。	
主要投資対象	りそなジャパンCSRファンド	マザーファンドを主要投資対象とします。
	パインブリッジ・ジャパンCSRマザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	りそなジャパンCSRファンド	<ul style="list-style-type: none">・株式への実質投資割合には、制限を設けません。・外貨建て資産への投資は行いません。・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%以下とします。
	パインブリッジ・ジャパンCSRマザーファンド	<ul style="list-style-type: none">・株式への投資割合には制限を設けません。・外貨建て資産への投資は行いません。・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%以下とします。
分配方針	毎年2回の決算時（原則として3月、9月の各15日）に、決算を行い、配当等収益および売買益を中心に、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。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。	

—— 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。

「りそなジャパンCSRファンド」は、2022年9月15日に第35期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。



パインブリッジ・インベストメンツ株式会社
〒100-6813 東京都千代田区大手町一丁目3番1号 JAビル

お問い合わせ先・・・投資信託担当

電話番号／03-5208-5858

(受付時間／9：00～17：00（土、日、祝休日を除く）)

ホームページ／<https://www.pinebridge.co.jp/>

目次

◆りそなジャパンCSRファンド〈愛称：誠実の杜〉 運用報告書

◆最近5期の運用実績	1
◆当期中の基準価額と市況等の推移	1
◆投資環境	2
◆運用経過	3
◆今後の市況見通しと運用方針	5
◆1万口(元本10,000円)当たりの費用明細	6
◆〈参考情報〉総経費率	6
◆売買および取引の状況	7
◆利害関係人との取引状況等	7
◆組入資産の明細	7
◆投資信託財産の構成	7
◆資産、負債、元本および基準価額の状況	8
◆損益の状況	8
◆分配金のお知らせ	9
◆パインブリッジ・ジャパンCSRマザーファンド運用報告書	10

◆最近5期の運用実績

決算期	基準価額			<ベンチマーク> 東証株価指数(TOPIX)		株式 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率		期中 騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
第31期(2020年9月15日)	9,960	20	37.3	1,640.84	32.7	97.4	1,158
第32期(2021年3月15日)	11,594	250	18.9	1,968.73	20.0	96.8	1,115
第33期(2021年9月15日)	12,085	450	8.1	2,096.39	6.5	96.4	1,068
第34期(2022年3月15日)	10,404	0	△13.9	1,826.63	△12.9	96.2	907
第35期(2022年9月15日)	10,966	250	7.8	1,950.43	6.8	99.0	935

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組入れますので「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(注3) 東証株価指数 (TOPIX) は、日本の株式市場を広範に網羅する、日本の代表的な株価指数です。当ファンドでは、配当収益も反映した配当込み指数をベンチマークとしています。

東証株価指数 (TOPIX) に関する著作権等の知的財産権、その他一切の権利は株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社に帰属します。

◆当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		<ベンチマーク> 東証株価指数(TOPIX)		株式 組入比率
		騰落率		騰落率	
(期首)	円	%		%	%
2022年3月15日	10,404	—	1,826.63	—	96.2
3月末	11,159	7.3	1,946.40	6.6	95.5
4月末	10,886	4.6	1,899.62	4.0	95.0
5月末	10,815	4.0	1,912.67	4.7	97.1
6月末	10,730	3.1	1,870.82	2.4	97.3
7月末	11,047	6.2	1,940.31	6.2	96.9
8月末	11,251	8.1	1,963.16	7.5	96.6
(期末)					
2022年9月15日	11,216	7.8	1,950.43	6.8	99.0

(注1) 騰落率は期首比です。

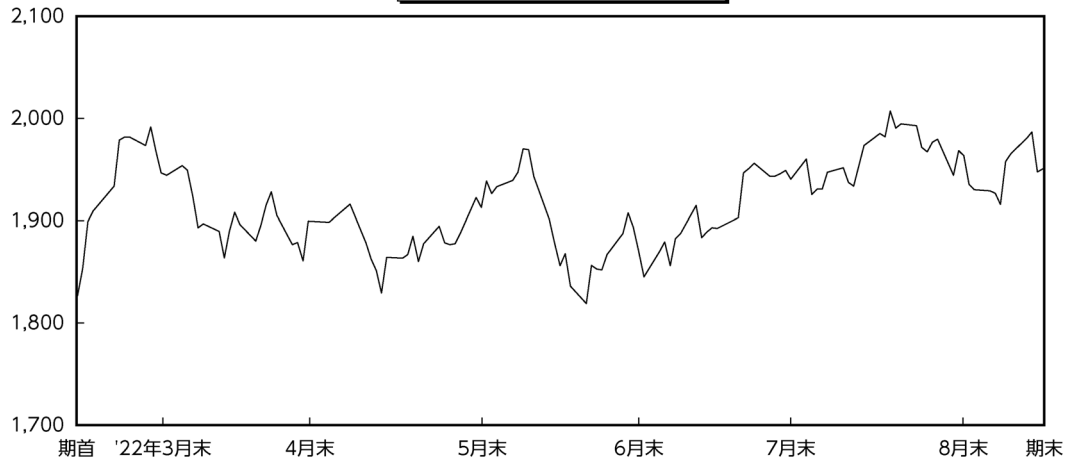
(注2) 当ファンドは親投資信託を組入れますので「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

投資環境

(2022年3月16日～2022年9月15日)

国内株式市場

東証株価指数(TOPIX)の推移

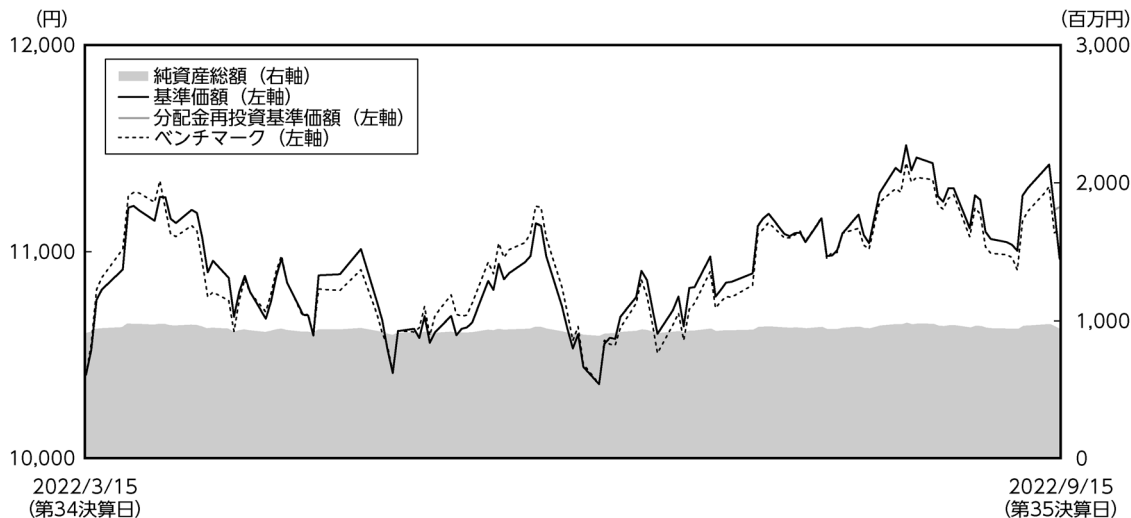


FRB（米連邦準備制度理事会）の金融政策を受けて下落する場面もあったものの、企業の好決算や日銀による大規模金融緩和策の維持が決定されたことを下支えに期を通じて上昇しました。

運用経過

(2022年3月16日～2022年9月15日)

基準価額等の推移



第35期首：10,404円

第35期末：10,966円

(作成対象期間中の既払分配金：250円)

騰落率：7.8% (分配金再投資ベース)

(注1) 分配金再投資基準価額は、収益分配金(税込み)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。期首の基準価額をもとに指数化しています。

(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、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) ベンチマークは東証株価指数(TOPIX)です。期首の基準価額をもとに指数化しています。

基準価額の主な変動要因

「パインブリッジ・ジャパンCSRマザーファンド」の基準価額が上昇した結果、当ファンドは堅調に推移しました。

分配金の状況

当期の収益分配金につきましては、基準価額水準と市況動向を勘案して250円（元本1万口当たり課税前）とさせていただきます。なお、分配に充てなかった収益につきましては、信託財産中に留保し、元本部分と同一の運用を行うことといたします。

分配原資の内訳

(単位：円・%、1万口当たり、税引前)

項目	第35期
	2022年3月16日～2022年9月15日
当期分配金	250
(対基準価額比率)	2.229
当期の収益	105
当期の収益以外	144
翌期繰越分配対象額	2,217

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」と「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益(含、評価益)」から、それぞれ当期の分配に充当した額の合計を表示しています。なお、「当期の収益」「当期の収益以外」は小数点以下切捨てで算出しているため合計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(税込み)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。

運用経過

<りそなジャパンCSRファンド>

期を通じて「パインブリッジ・ジャパンCSRマザーファンド」への投資を高位に維持しました。

<パインブリッジ・ジャパンCSRマザーファンド>

金利上昇により増益が期待される銀行業、コロナによる物流混乱が収束し、増益が期待されるその他製品、経済再開の恩恵を享受できる陸運業のウエイトを引き上げました。一方、金融引き締めによる景気減速の影響が懸念される電気機器、精密機器、機械のウエイトを引き下げました。セクター別では期中を通じて電気機器、食料品、パルプ・紙をオーバーウエイト、機械、サービス業、化学をアンダーウエイトとしました。

今後の市況見通しと運用方針

今後の市況見通し

新型コロナウイルスの世界的拡大に加えて、米中関係、ロシア・ウクライナ情勢、中東情勢や世界的な物価・金利上昇など、世界景気の先行きに対する不透明感は依然として高いと考えます。新型コロナウイルスの経済への影響については、各国でワクチン接種が進み、収束のめどが立ちつつあると見ており、景気の下支え要因になると考えます。一方で、米中関係、ロシア・ウクライナ情勢、中東情勢および世界的な物価・金利上昇が、世界経済や株式市場および各国・地域の政策に与える影響などを注視していきます。為替については、日米の金融政策の方向性の違いから円安に推移しています。中期的にはレンジ内の推移を予想していますが、引き続き日米欧金融当局の金融政策の変化も注視していきます。

運用方針

CSRの秀でた企業は中長期的には高い業績パフォーマンスを達成するという考えに基づいた運用を続けます。個別銘柄の継続的なファンダメンタルズの調査・分析に基づいた投資判断により当ファンドの成長性を維持したいと考えています。CSR面では、個々の企業、事象毎に対応するとともに、企業のCSR活動を積極的な評価項目として捉え、総合的な判断を続けます。自社だけでなくサプライヤーに対してもCSR重視の経営を行うよう要請できているか、コーポレートガバナンスの強化体制の進捗状況などに注目しています。

◆1万口(元本10,000円)当たりの費用明細

(2022年3月16日～2022年9月15日)

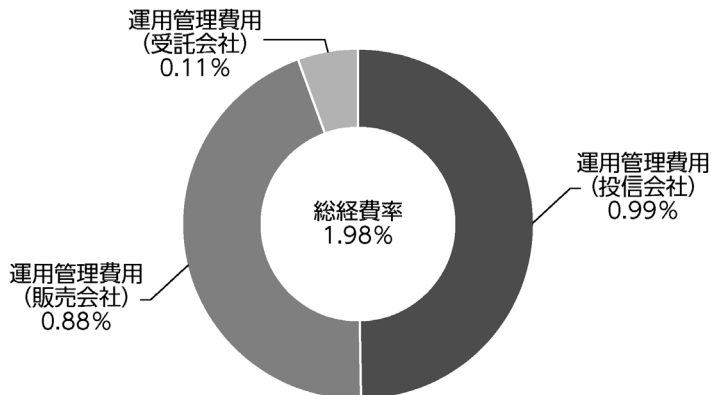
項 目	第35期 (2022.3.16～2022.9.15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信託報酬	110円	0.998%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,981円です。
(投信会社)	(55)	(0.499)	委託した資金の運用、交付運用報告書等の作成、ファンドの監査等の対価
(販売会社)	(49)	(0.444)	交付運用報告書等各种資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(6)	(0.055)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	3	0.029	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(株式)	(3)	(0.029)	売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
合 計	113円	1.027%	

(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。また、各項目ごとに円未満は四捨五入しています。なお、売買委託手数料は、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、当ファンドに対応するものを含みます。

(注2) 比率は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

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、売買委託手数料および有価証券取引税を除きます。)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1.98%です。



(注1) 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) 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。

◆売買および取引の状況

(2022年3月16日～2022年9月15日)

【親投資信託受益証券の設定、解約状況】

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
パインブリッジ・ジャパンCSRマザーファンド	千□ -	千円 -	千□ 20,540	千円 51,000

(注) 単位未満は切捨て。

◆利害関係人との取引状況等

(2022年3月16日～2022年9月15日)

【りそなジャパンCSRファンド】

当期における利害関係人との取引等はありません。

※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。

【パインブリッジ・ジャパンCSRマザーファンド】

当期における利害関係人との取引等はありません。

※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

(2022年9月15日現在)

【親投資信託残高】

種 類	期首(前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
パインブリッジ・ジャパンCSRマザーファンド	千□ 392,617	千□ 372,077	千円 933,281

(注) 単位未満は切捨て。

◆投資信託財産の構成

(2022年9月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
パインブリッジ・ジャパンCSRマザーファンド	千円 933,281	% 96.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	33,330	3.4
投 資 信 託 財 産 総 額	966,611	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

(2022年9月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	966,611,847
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,330,669
パインブリッジ・ジャパンCSR マザーファンド(評価額)	933,281,178
未 収 入 金	32,000,000
(B) 負 債	30,714,950
未 払 収 益 分 配 金	21,336,737
未 払 信 託 報 酬	9,378,212
未 払 利 息	1
(C) 純資産総額(A-B)	935,896,897
元 本	853,469,519
次期繰越損益金	82,427,378
(D) 受益権総口数	853,469,519口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,966円

<注記事項(当運用報告書作成時点では監査未了です。)>

期首元本額	872,537,016円
期中追加設定元本額	732,688円
期中一部解約元本額	19,800,185円
1口当たり純資産額	1.0966円

◆損益の状況

(2022年3月16日～2022年9月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	△ 565
支 払 利 息	△ 565
(B) 有価証券売買損益	78,608,907
売 買 益	79,807,799
売 買 損	△ 1,198,892
(C) 信託報酬等	△ 9,378,212
(D) 当期損益金(A+B+C)	69,230,130
(E) 前期繰越損益金	51,023,632
(F) 追加信託差損益金	△ 16,489,647
(配 当 等 相 当 額)	(7,208,068)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 23,697,715)
(G) 計(D+E+F)	103,764,115
(H) 収 益 分 配 金	△ 21,336,737
次期繰越損益金(G+H)	82,427,378
追加信託差損益金	△ 16,489,647
(配 当 等 相 当 額)	(7,209,737)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 23,699,384)
分 配 準 備 積 立 金	182,016,718
繰 越 損 益 金	△ 83,099,693

(注1) (B)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せん。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、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。

(分配金の計算過程)

	第35期
a.配当等収益(費用控除後)	9,046,055円
b.有価証券売買損益(費用控除後)	0円
c.信託約款に規定する収益調整金	7,209,737円
d.信託約款に規定する分配準備積立金	194,307,400円
e.分配対象収益(a+b+c+d)	210,563,192円
f.分配金	21,336,737円
g.分配金(1万口当たり)	250円

◆分配金のお知らせ

1万口当たり分配金	第35期
	250円

- ◇分配金をお支払いする場合
分配金は、原則として決算日から起算して、5営業日までにお支払いいたします。
- ◇分配金を再投資する場合
分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、税金を差し引いた後、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。
- ◇分配金に対する税金は次のとおりです。
普通分配金について、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、個人の受益者に対して20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）、法人の受益者に対して15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の率による源泉徴収が行われます。
なお、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。
個人の受益者の場合は、原則として確定申告は必要ありません。
※元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額がその後の新たな個別元本となります。
※税法が改正された場合等においては、上記内容が変更になることがあります。

パインブリッジ・ジャパンCSRマザーファンド 運用報告書《第35期》

決算日 2022年9月15日
(計算期間：2022年3月16日～2022年9月15日)

受益者のみなさまへ

「パインブリッジ・ジャパンCSRマザーファンド」は、2022年9月15日に第35期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第35期の運用状況をご報告申し上げます。

当マザーファンドの仕組みは次のとおりです。

運用方針	<ul style="list-style-type: none">① 東証株価指数 (TOPIX) をベンチマークとし、これを上回る投資成果を目指して運用を行います。② 投資候補銘柄の選定にあたっては、MSCI ESG Research社の調査情報を参考に選定します。③ ポートフォリオの構築にあたっては、企業の社会責任投資 (CSR : Corporate Social Responsibility) の考え方を重視し、当社独自の銘柄選定基準にしたがって行います。④ 株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。⑤ 資金動向や市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
主要運用対象	わが国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	<ul style="list-style-type: none">① 株式への投資割合には制限を設けません。② 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%以下とします。③ 外貨建て資産への投資は行いません。④ 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

◆最近5期の運用実績

決算期	基準価額		<ベンチマーク> 東証株価指数(TOPIX)		株式 組入比率	純資産 総額
		期中 騰落率		期中 騰落率		
	円	%		%	%	百万円
第31期(2020年9月15日)	20,220	38.6	1,640.84	32.7	97.5	1,202
第32期(2021年3月15日)	24,264	20.0	1,968.73	20.0	97.2	1,166
第33期(2021年9月15日)	26,484	9.1	2,096.39	6.5	96.7	1,124
第34期(2022年3月15日)	23,037	△13.0	1,826.63	△12.9	96.5	956
第35期(2022年9月15日)	25,083	8.9	1,950.43	6.8	99.3	988

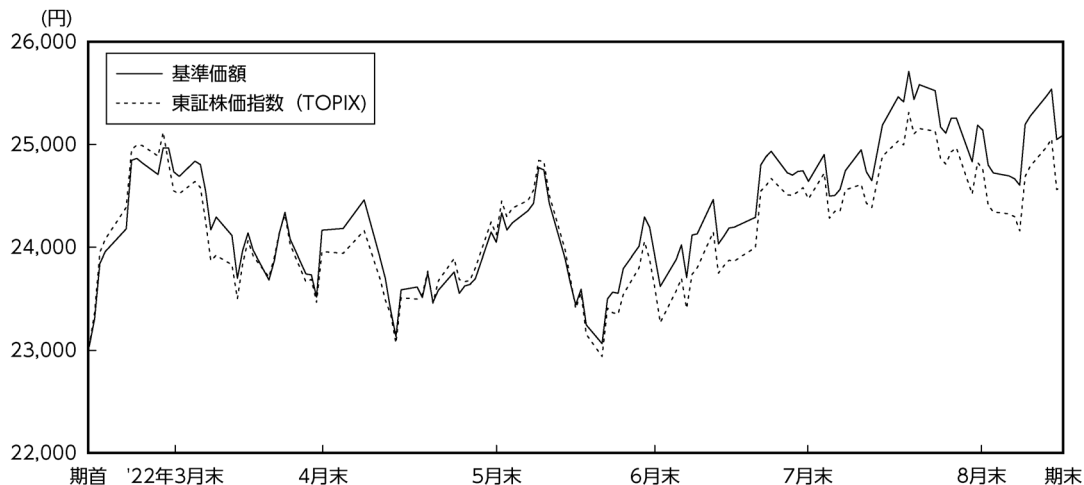
◆当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		<ベンチマーク> 東証株価指数(TOPIX)		株式 組入比率
		騰落率		騰落率	
(期首)	円	%		%	%
2022年3月15日	23,037	-	1,826.63	-	96.5
3月末	24,734	7.4	1,946.40	6.6	95.6
4月末	24,166	4.9	1,899.62	4.0	95.1
5月末	24,050	4.4	1,912.67	4.7	97.0
6月末	23,901	3.8	1,870.82	2.4	96.8
7月末	24,641	7.0	1,940.31	6.2	96.6
8月末	25,139	9.1	1,963.16	7.5	95.9
(期末)					
2022年9月15日	25,083	8.9	1,950.43	6.8	99.3

(注) 騰落率は期首比です。

基準価額の推移

(2022年3月16日～2022年9月15日)



(注) 東証株価指数 (TOPIX) は、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

アミノサイエンス事業の成長が期待される味の素、ランニング用シューズの販売が好調なアシックス、がん治療薬の開発が期待される第一三共がプラスに寄与しました。一方で、物流費や原材料価格の上昇によるコストアップ、米国住宅市場減速が懸念されたダイキン工業、ロシア・ウクライナ情勢悪化により景気減速懸念が高まった結果業績悪化懸念も高まった富士電機、国内の生活関連分野に強みを持つ伊藤忠商事は、物価上昇による悪影響が懸念され、マイナスに寄与しました。

投資環境は2ページ、運用経過は4ページ、今後の市況見通しと運用方針は5ページをご参照ください。

◆1万口(元本10,000円)当たりの費用明細

(2022年3月16日～2022年9月15日)

項 目	第35期 (2022.3.16～2022.9.15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
			期中の平均基準価額は24,438円です。
売買委託手数料 (株式)	7円 (7)	0.029% (0.029)	売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
合 計	7円	0.029%	

(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。また、各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注2) 比率は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。

◆売買および取引の状況

(2022年3月16日～2022年9月15日)

【株 式】

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内 上 場		千株	千円	千株	千円
		148	317,558	146	333,657

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

◆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	651,216千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	962,801千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.67

(注) (b)は各月末および決算日現在の組入株式時価総額の平均。

◆主要な売買銘柄

(2022年3月16日～2022年9月15日)

【株 式】

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
三菱UFJフィナンシャル・グループ	34.3	25,609	746	三菱UFJフィナンシャル・グループ	29.7	21,818	734
日本電信電話	6.8	25,467	3,745	日本電信電話	5	18,552	3,710
ヤマハ	4.3	22,890	5,323	H O Y A	1.3	16,664	12,818
アシックス	9.6	21,429	2,232	富士電機	3	16,643	5,547
三井住友フィナンシャルグループ	4.2	16,935	4,032	参天製薬	14.8	15,892	1,073
東急	9.4	15,193	1,616	森永乳業	2.9	14,206	4,898
富士電機	2.6	14,945	5,748	日本電産	1.4	13,547	9,677
第一生命ホールディングス	5.5	13,633	2,478	ニトリホールディングス	0.9	12,378	13,754
レンゴー	16	11,944	746	カシオ計算機	8.6	11,967	1,391
ミネベアミツミ	4.8	11,749	2,447	ダイキン工業	0.6	11,915	19,859

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載。

◆利害関係人との取引状況等

(2022年3月16日～2022年9月15日)

当期における利害関係人との取引等はありません。

※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

(2022年9月15日現在)

【国内株式】

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.0%)			
日本水産	1.2	0.6	325
建設業 (2.4%)			
ショーボンドホールディングス	—	1.5	9,330
ライト工業	6.4	7.3	14,081
食料品 (6.9%)			
森永乳業	4.9	2	8,100
アサヒグループホールディングス	4	4.2	19,563
不二製油グループ本社	3.1	2.2	5,216
味の素	7.1	8.6	34,443
パルプ・紙 (3.1%)			
レンゴー	27.1	36.9	30,885
化学 (3.3%)			
信越化学工業	1.4	1.5	24,277
三菱瓦斯化学	0.5	0.2	414
太陽ホールディングス	2.8	2.8	7,478
ファンケル	0.3	—	—
医薬品 (5.8%)			
参天製薬	15.7	0.9	887
JCRファーマ	3.5	4.2	9,017
第一三共	11	11	46,783
非鉄金属 (3.0%)			
住友電気工業	8.2	0.4	644
フジクラ	35	30.1	28,956
機械 (0.9%)			
NITTOKU	4.1	3.3	8,444
ダイキン工業	0.6	—	—
電気機器 (25.5%)			
ミネベアミツミ	4.4	6.2	14,911
日立製作所	5.3	5.8	39,602
富士電機	4.8	4.4	26,004
日本電産	2.8	2.5	23,090
日本電気	5.7	6	30,120
ソニーグループ	3.3	3.4	35,598
メイコー	1.2	0.1	295
アドバンテスト	1	0.7	5,327
キーエンス	0.9	0.8	41,648
ウシオ電機	4.4	3.8	6,270
カシオ計算機	8.7	0.1	131
ファナック	1.2	1.1	24,112
小糸製作所	1.6	0.7	3,265

銘柄	期首(前期末)			
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
輸送用機器 (6.4%)				
トヨタ自動車	26.2	25.6	52,224	
スズキ	2.8	2.2	10,958	
精密機器 (1.1%)				
HOYA	1.3	—	—	
メニコン	3.9	3.4	10,421	
その他製品 (4.7%)				
アシックス	—	9.6	24,806	
ヤマハ	—	4.1	21,320	
陸運業 (5.0%)				
東急	21.3	28.5	49,390	
情報・通信業 (8.4%)				
JMDC	1.8	1.6	8,896	
日本電信電話	17.1	18.9	73,010	
卸売業 (3.1%)				
伊藤忠商事	7.3	8	30,272	
小売業 (6.2%)				
セブン&アイ・ホールディングス	6	5.2	30,810	
バン・ロイヤリティ・インターナショナルホールディングス	6.9	8.3	22,268	
ニトリホールディングス	1.1	0.6	7,764	
銀行業 (7.8%)				
コンソルディア・フィナンシャルグループ	24.1	27.5	12,485	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	39.2	43.8	31,693	
三井住友フィナンシャルグループ	5.3	7.4	31,886	
保険業 (2.5%)				
第一生命ホールディングス	8.9	10.2	24,582	
その他金融業 (—%)				
東京センチュリー	0.4	—	—	
不動産業 (2.5%)				
三井不動産	8.7	8.4	24,780	
サービス業 (1.4%)				
M&Aキャピタルパートナーズ	3.3	2.5	8,500	
リクルートホールディングス	0.9	0.9	4,034	
ソラスト	—	1.5	1,342	
合計	株数・金額	368	371	980,670
	銘柄数<比率>	50	50	<99.3%>

(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) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 単位未満は切捨て。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載。

(注4) —印は組入れなし。

◆投資信託財産の構成

(2022年9月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	980,670	95.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	44,858	4.4
投 資 信 託 財 産 総 額	1,025,528	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

(2022年9月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	1,025,528,812
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	40,804,747
株 式 (評 価 額)	980,670,280
未 収 入 金	3,510,585
未 収 配 当 金	543,200
(B) 負 債	37,515,125
未 払 金	3,715,070
未 払 解 約 金	33,800,000
未 払 利 息	55
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	988,013,687
元 本	393,899,398
次 期 繰 越 損 益 金	594,114,289
(D) 受 益 権 総 口 数	393,899,398口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,083円

<注記事項>

期首元本額	415,225,440円
期中追加設定元本額	982,518円
期中一部解約元本額	22,308,560円
1口当たり純資産額	2.5083円
期末における元本の内訳	
りそなジャパンCSRファンド	372,077,175円
パインブリッジ日本株式SR1ファンド<DC>	21,822,223円

◆損益の状況

(2022年3月16日～2022年9月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	10,926,860
受 取 配 当 金	10,934,866
受 取 利 息	4
そ の 他 収 益 金	21
支 払 利 息	△ 8,031
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	73,490,474
売 買 益	105,099,240
売 買 損	△ 31,608,766
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	84,417,334
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	541,320,913
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,417,482
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 33,041,440
(G) 計 (C + D + E + F)	594,114,289
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	594,114,289

(注1) (B)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せん。

(注2) (E)追加信託差損益金とあるのは、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) (F)解約差損益金とあるのは、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。