

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	信託期間は2006年11月30日から2023年10月4日まで(繰上償還決定前は無期限)です。	
運用方針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	社会的責任 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(M)	わが国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	社会的責任 ファンド	株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
	SRI マザーファンド(M)	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	年2回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入及び売買益(評価益を含みます。)等の合計額とします。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、分配対象収益が少額の場合は分配を行わないことがあります。	

社会的責任ファンド (愛称:SRI計画)

運用報告書(全体版)

第33期(決算日 2023年8月28日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

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/>

- 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。)

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		株式組入率	株式先物比率	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
第29期(2021年8月26日)	10,677	0	1.5	3,058.12	4.9	95.1	4.0	192
第30期(2022年2月28日)	10,318	0	△3.4	3,012.57	△1.5	96.6	3.0	187
第31期(2022年8月26日)	10,824	0	4.9	3,203.69	6.3	96.1	3.1	190
第32期(2023年2月27日)	10,592	0	△2.1	3,268.15	2.0	96.0	3.1	192
第33期(2023年8月28日)	12,747	0	20.3	3,824.01	17.0	—	—	188

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入率	株式先物比率
		騰落率		騰落率		
(当期首)	円	%		%	%	%
2023年2月27日	10,592	—	3,268.15	—	96.0	3.1
2月末	10,604	0.1	3,269.12	0.0	96.8	2.1
3月末	10,816	2.1	3,324.74	1.7	93.1	6.1
4月末	10,997	3.8	3,414.45	4.5	95.1	3.1
5月末	11,480	8.4	3,537.93	8.3	96.5	2.1
6月末	12,378	16.9	3,805.00	16.4	98.6	—
7月末	12,676	19.7	3,861.80	18.2	98.4	—
(当期末)						
2023年8月28日	12,747	20.3	3,824.01	17.0	—	—

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

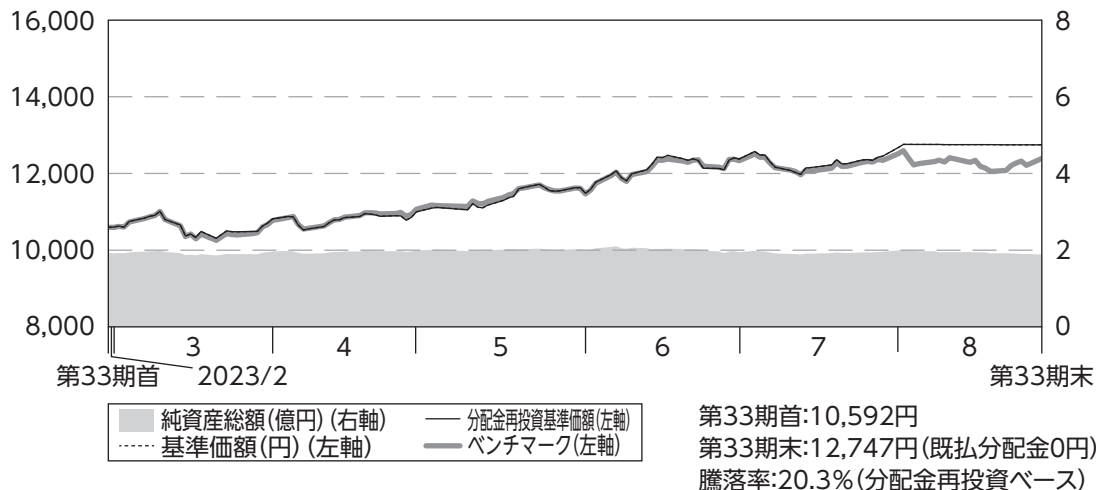
(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）です。

TOPIX（東証株価指数）とは、株式会社J P X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指数です。

TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みTOPIX」という。）の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、配当込みTOPIX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、J P X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J P Xは責任を負いません。

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、2023年2月27日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

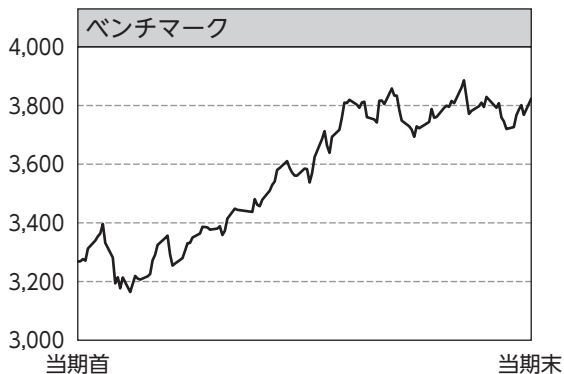
基準価額の主な変動要因

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、米国での物価上昇懸念の後退や日本企業の堅調な業績などを背景に上昇しました。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など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、自動車関連事業の業績が好調に推移している伊藤忠商事、環境負荷が低い自動車の開発・販売を手がけており生産回復による業績拡大が見込まれたトヨタ自動車、半導体市況の底打ちに対する期待から選好された東京エレクトロンなどがプラスに寄与しました。

投資環境



当期の国内株式市場は上昇しました。米国での物価上昇懸念の後退や国内における賃金上昇や資本効率改善に対する期待感、日本企業の堅調な業績などが好感され、株式市場は大幅高となりました。

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(M)」の組み入れを通じて行いました。

【「SRIマザーファンド(M)」の運用経過】

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、繰上償還に向けて2023年8月に現物株式の全ポジションを解消し安定運用に切り替えました。

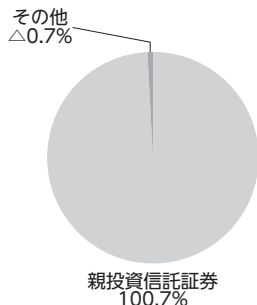
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

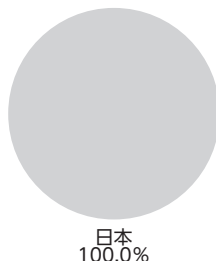
	当期末
	2023年8月28日
SRIマザーファンド(M)	100.7%
その他	△0.7%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

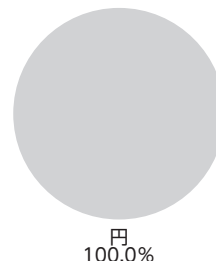
○資産別配分



○国別配分



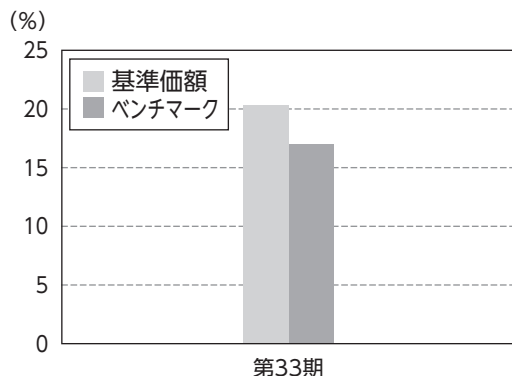
○通貨別配分



(注)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。

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上回りました。
個別銘柄では、イビデン、伊藤忠商事、日本電気などがプラスに寄与しました。

分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送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33期	
	2023年2月28日～2023年8月28日	
当期分配金 (円)	—	
(対基準価額比率) (%)	(—)	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	3,657	

(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

償還に向けて、コール・ローン等による安定運用を維持します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2023年2月28日～2023年8月28日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	95円	0.823%	(a) 信託報酬 = $\frac{\text{[期中の平均基準価額]} \times \text{信託報酬率}}{\text{期中の平均基準価額}}$ は11,491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)	(44)	(0.384)	
(販売会社)	(44)	(0.384)	
(受託会社)	(6)	(0.055)	
(b) 売買委託手数料	13	0.117	(b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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
(株式)	(13)	(0.117)	
(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)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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	0	0.003	(d) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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)	(0)	(0.003)	
(その他)	(-)	(-)	
合計	108	0.943	

(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。

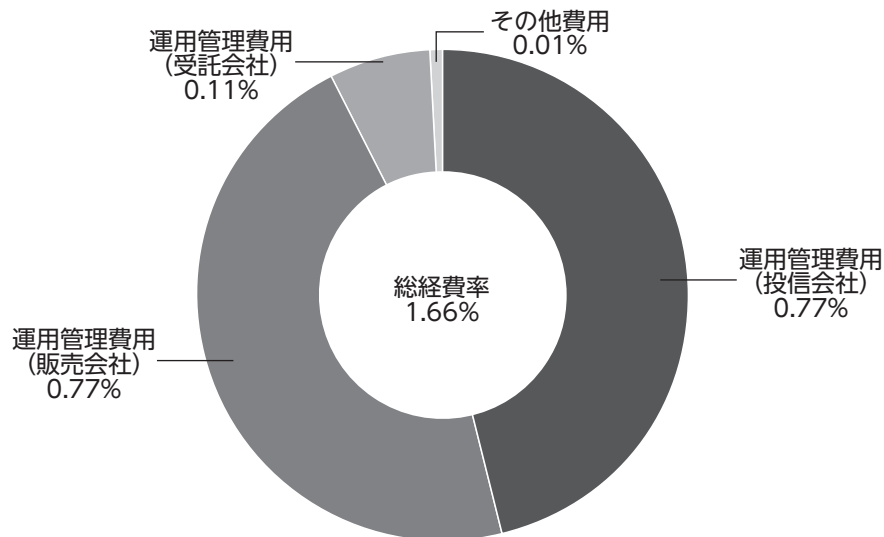
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

<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1.66%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。

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
S R I マザーファンド (M)	千口 843	千円 2,486	千口 13,834	千円 43,921

株式売買比率

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

<SR Iマザーファンド (M) >

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	416,337千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	189,819千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	2.19

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c)売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 111	百万円 18	% 16.2	百万円 111	百万円 18	% 16.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※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。

〈SR I マザーファンド (M) 〉

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 3,888	百万円 228	% 5.9	百万円 3,705	百万円 229	% 6.2

〈平均保有割合 100.0%〉

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

〈親投資信託残高〉

種 類	当 期 首 (前 期 末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
S R I マザーファンド (M)	千口 69,237	千口 56,246	千円 189,978

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、56,246千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
S R I マザーファンド (M)	千円 189,978	% 98.6
コール・ローン等、その他	2,772	1.4
投資信託財産総額	192,750	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年8月28日現在
(A) 資 産	192,750,645円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,014,052
SRIマザーファンド(M) (評価額)	189,978,053
未 収 入 金	758,540
(B) 負 債	4,163,937
未 払 解 約 金	2,542,641
未 払 信 託 報 酬	1,615,968
未 払 利 息	4
そ の 他 未 払 費 用	5,324
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	188,586,708
元 本	147,948,627
次 期 繰 越 損 益 金	40,638,081
(D) 受 益 権 総 口 数	147,948,627口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,747円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年2月28日 至 2023年8月28日
(A) 配 当 等 収 益	△222円
支 払 利 息	△222
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	33,186,934
売 買 益	38,257,863
売 買 損	△5,070,929
(C) 信 託 報 酬 等	△1,621,292
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	31,565,420
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	9,632,454
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△559,793
(配 当 等 相 当 額)	(12,897,379)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△13,457,172)
(G) 計 (D+E+F)	40,638,081
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	40,638,081
追 加 信 託 差 損 益 金	△559,793
(配 当 等 相 当 額)	(12,910,141)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△13,469,934)
分 配 準 備 積 立 金	41,197,874

- (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す。
(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。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は182,202,742円、期中追加設定元本額は3,369,135円、期中一部解約元本額は37,623,250円です。

※分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	1,549,088円
(B) 有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)	26,661,854円
(C) 収益調整金額	12,910,141円
(D) 分配準備積立金額	12,986,932円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	54,108,015円
(F) 期末残存口数	147,948,627口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	3,657円
(H) 分配金額(1万口当たり)	—円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	—円

お知らせ

ベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2023年6月28日)

信託終了に関する異議申立手続の結果、2023年10月4日付で繰上償還いたします。

(異議申立期間終了日：2023年7月5日)

SRI マザーファンド (M)

運用報告書

第19期 (決算日 2023年8月28日)

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2004年8月27日から2023年10月3日まで(繰上償還決定前は無期限)です。
運用方針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
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	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

当親投資信託はこのたび上記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。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入 比率	株式先物 比率	純資産 総額
	円	騰落率	円	騰落率			
第15期(2019年8月26日)	20,752	△13.5	2,228.89	△12.5	97.8	1.7	172
第16期(2020年8月26日)	23,594	13.7	2,513.11	12.8	94.4	5.2	188
第17期(2021年8月26日)	27,396	16.1	3,058.12	21.7	95.1	4.0	192
第18期(2022年8月26日)	28,234	3.1	3,203.69	4.8	96.1	3.1	190
第19期(2023年8月28日)	33,776	19.6	3,824.01	19.4	-	-	189

(注) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入 比率	株式先物 比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2022年 8月26日	28,234	-	3,203.69	-	96.1	3.1
8月末	28,038	△0.7	3,177.98	△0.8	95.9	3.1
9月末	26,454	△6.3	3,003.39	△6.3	97.5	2.1
10月末	28,010	△0.8	3,156.44	△1.5	96.5	2.0
11月末	28,339	0.4	3,249.61	1.4	97.6	1.0
12月末	26,954	△4.5	3,101.25	△3.2	96.3	1.0
2023年 1月末	28,053	△0.6	3,238.48	1.1	93.7	5.2
2月末	27,897	△1.2	3,269.12	2.0	96.0	2.1
3月末	28,498	0.9	3,324.74	3.8	93.1	6.1
4月末	29,011	2.8	3,414.45	6.6	95.1	3.1
5月末	30,319	7.4	3,537.93	10.4	96.6	2.1
6月末	32,715	15.9	3,805.00	18.8	97.7	-
7月末	33,552	18.8	3,861.80	20.5	98.4	-
(当期末) 2023年 8月28日	33,776	19.6	3,824.01	19.4	-	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

ベンチマークは、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）です。

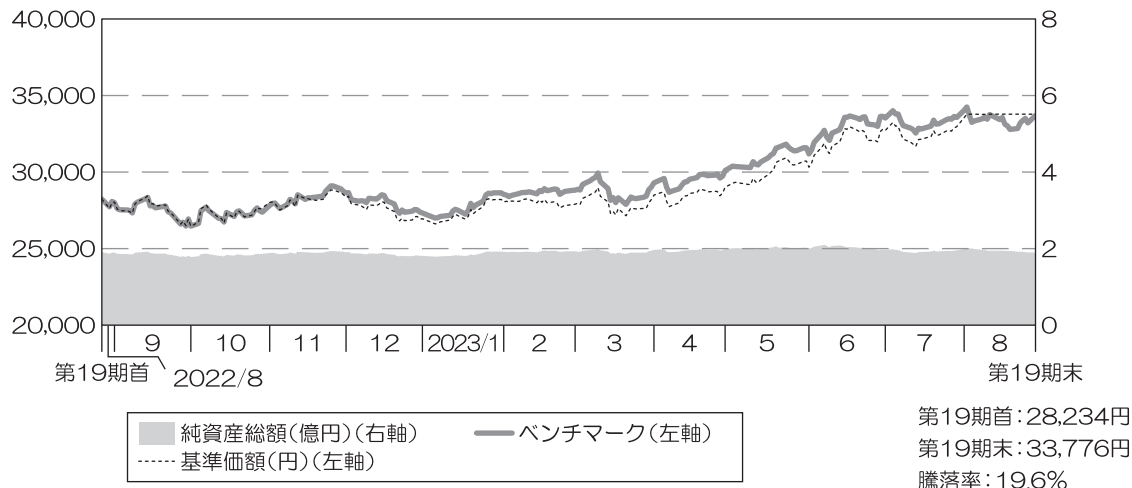
TOPIX（東証株価指数）とは、株式会社J P X総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みTOPIX」という。）の指数値及び配当込みTOPIXに係る商標又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る商標又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、配当込みTOPIX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、J P X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J P Xは責任を負いません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、2022年8月26日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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、米国での物価上昇懸念の後退や日本企業の堅調な業績などを背景に上昇しました。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など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、国内金利の上昇観測を背景に業績拡大期待が高まった三菱UFJフィナンシャル・グループや三井住友フィナンシャルグループ、自動車関連事業の業績が好調に推移している伊藤忠商事などがプラスに寄与しました。

投資環境



当期の国内株式市場は上昇しました。米国での物価上昇懸念の後退や中国での新型コロナウイルスに関連した行動制限の緩和などが好感され、株式市場は底堅く推移しました。2023年5月以降は、国内における賃金上昇や資本効率改善に対する期待感、日本企業の堅調な業績などが好感され、株式市場は大幅高となりました。

当ファンドのポートフォリオ

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。

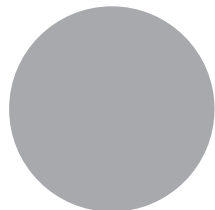
当期につきましては、繰上償還に向けて2023年8月に現物株式の全ポジションを解消し安定運用に切り替えました。

当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

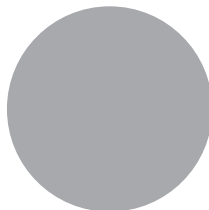
当期末における該当事項はありません。

○資産別配分



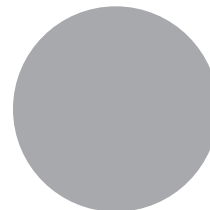
短期金融資産等
100.0%

○国別配分



日本
100.0%

○通貨別配分

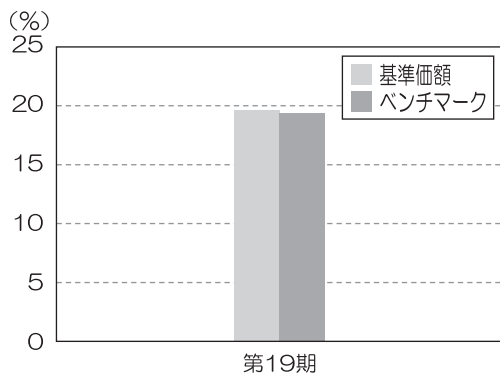


円
100.0%

(注)比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

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と概ね同程度となりました。個別銘柄では、SHIFTやイビデンがプラスに寄与した一方、JCRファーマやエムスリーがマイナスに影響しました。

今後の運用方針

償還に向けて、コール・ローン等による安定運用を維持します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年8月27日～2023年8月28日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	47円	0.163%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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
(株式)	(47)	(0.161)	
(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)	(0.002)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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)	(-)	(-)	
(c) その他費用	-	-	(c) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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)	(-)	(-)	
(その他)	(-)	(-)	
合計	47	0.163	

(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。

(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(28,986円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 52 (14)	千円 171,871 (-)	千株 119	千円 387,044

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は株式分割、予約権行使、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。

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 33	百万円 40	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

株式売買比率

<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	558,915千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	184,674千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	3.02

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

利害関係人*との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.000365	百万円 0.000365	% 100.0	百万円 0.000365	百万円 0.000365	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	4,593	290	6.3	4,411	290	6.6

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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

当期末における該当事項はありません。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	190,735	100.0
投資信託財産総額	190,735	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年8月28日現在
(A) 資 産	190,735,808円
コール・ローン等	190,644,008
未 収 配 当 金	91,800
(B) 負 債	758,981
未 払 解 約 金	758,540
未 払 利 息	441
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	189,976,827
元 本	56,246,463
次 期 繰 越 損 益 金	133,730,364
(D) 受 益 権 総 口 数	56,246,463口
1万口当たり基準価額(C/D)	33,776円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年8月27日 至 2023年8月28日
(A) 配 当 等 収 益	3,606,485円
受 取 配 当 金	3,620,950
受 取 利 息	20
そ の 他 収 益 金	33
支 払 利 息	△14,518
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	31,694,322
売 買 益	42,834,178
売 買 損	△11,139,856
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	673,094
取 引 益	863,910
取 引 損	△190,816
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	35,973,901
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	123,292,506
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	7,208,211
(G) 解 約 差 損 益 金	△32,744,254
(H) 計 (D+E+F+G)	133,730,364
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	133,730,364

(注1) (B) 有価証券売買損益及び(C) 先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含まず。

(注2) (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。

(注3) (G) 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。

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は67,616,746円、期中追加設定元本額は3,960,654円、期中一部解約元本額は15,330,937円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

社会的責任ファンド

56,246,463円

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。

ベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。(変更日：2023年6月28日)

当ファンドを投資対象とする全てのベビーファンドが償還となる予定のため、2023年10月3日付で繰上償還いたします。