運用報告書（全体版）

第１期
決算日　2019年１月17日

＜七十七＞ＥＳＧ日本株オープン
（愛称）みやぎの絆

受益者の皆様へ

毎々、格別のお引き立てにあずかり厚くお礼申し上げます。
さて「＜七十七＞ＥＳＧ日本株オープン（愛称：みやぎの絆）」は、去る2019年１月17日に第１期の決算を行いました。
ここに、期中の運用状況を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。

大和住銀投信投資顧問株式会社は、関係当局の認可等を得ることを前提に、2019年４月１日に三井住友アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社となる予定です。

資産運用のベストパートナー、だいわすみぎん

大和住銀投信投資顧問
Daiwa SB Investments

東京都千代田区霞が関三丁目2番1号

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
設定日	2018年８月10日
信託期間	2018年８月10日～2023年１月17日（約４年半）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、わが国の株式に投資することにより、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。主にわが国の株式の中から、ＥＳＧ（環境／社会／企業統治）課題等への取り組みを通じて、企業価値向上が期待される企業に実質的に投資することで、信託財産の成長を目指します。銘柄選定は、主に企業との対話や綿密な企業調査を通じたボトムアップリサーチをもとに、バリュエーション等を勘案して行います。
主要運用対象	＜七十七＞ＥＳＧ日本株オープン ・ＥＳＧ日本株マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 ＥＳＧ日本株マザーファンド ・わが国の株式を主要投資対象とします。
投資制限	＜七十七＞ＥＳＧ日本株オープン ・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、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ・外貨建資産への直接投資は行いません。 ＥＳＧ日本株マザーファンド ・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、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	毎年１月17日（休業日の場合は、翌営業日）の決算日に、収益分配金額は経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益も含みます。）等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には分配を行わないことがあります。 ＊分配金自動再投資型の場合、分配金は税金を差し引いた後自動的に無手数料で再投資されます。

ホームページアドレス
https://www.daiwasbi.co.jp/
お問い合わせ先
受付窓口：（電話番号）0120-286104
受付時間：午前9時から午後5時まで（土、日、祝日除く。）
※お客様のお取引内容につきましては、ご購入された販売会社にお問い合わせください。

＜七十七＞ＥＳＧ日本株オープン
愛称：「みやぎの絆」

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			TOPIX（配当込み）		株式組入比率	株式先物組入比率	純資産総額
	（分配落）	税込分配金	期中騰落率	（参考指数）	期中騰落率			
（設定日）	円	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
2018年８月10日	10,000	－	－	2,562.63	－	－	－	606
第１期(2019年１月17日)	9,078	0	△9.2	2,296.18	△10.4	98.1	－	1,058

東証株価指数（ＴＯＰＩＸ（配当込み））は、株式会社東京証券取引所（㈱東京証券取引所）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は、㈱東京証券取引所が有しています。
＊設定日の基準価額は設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
＊先物組入比率は、買建比率－売建比率
＊当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質組入比率を記載しています。

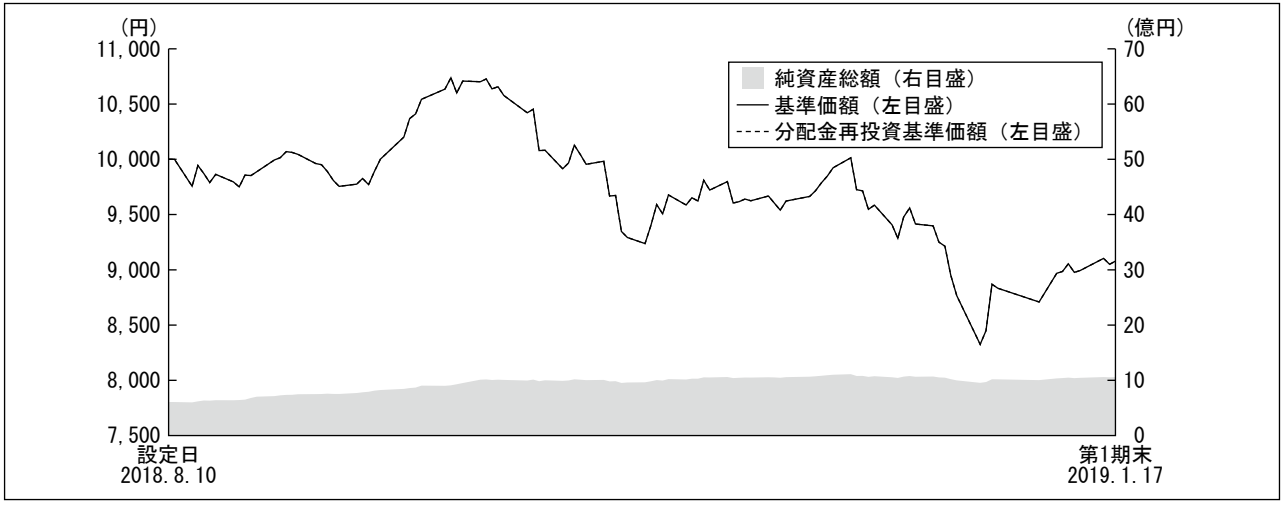
当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ＴＯＰＩＸ（配当込み）		株式組入比率	株式先物組入比率
		騰落率	（参考指数）	騰落率		
	円	%	ポイント	%	%	%
（設定日）2018年８月10日	10,000	－	2,562.63	－	－	－
８月末	10,045	0.5	2,556.25	△ 0.2	99.6	－
９月末	10,708	7.1	2,698.09	5.3	98.7	－
10月末	9,590	△ 4.1	2,444.11	△ 4.6	98.8	－
11月末	9,924	△ 0.8	2,475.92	△ 3.4	99.0	－
12月末	8,833	△11.7	2,223.11	△13.2	99.7	－
（期　末）2019年１月17日	9,078	△ 9.2	2,296.18	△10.4	98.1	－

＊設定日の基準価額は、設定価額を記載しています。
＊騰落率は設定日比です。
＊先物組入比率は、買建比率－売建比率
＊当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質組入比率を記載しています。

運用経過

【基準価額等の推移】



＊設定日の基準価額は設定価額を、純資産総額は当初設定元本を表示しております。
＊当ファンドにはベンチマークはありません。
＊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。
＊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、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

設定日　：10,000円
第１期末：　9,078円（既払分配金　0円）
騰落率　：　△9.2％（分配金再投資ベース）

【基準価額の主な変動要因】

当ファンドは、ＥＳＧ日本株マザーファンドへの投資を通じて、わが国の金融商品取引所に上場されている株式に投資を行いました。

（上昇要因）

日本銀行による緩和的な金融政策とETF（上場投資信託）の購入が要因となりました。また、日本企業のコーポレートガバナンスの改善も要因となりました。

（下落要因）

世界的な景気業績の悪化と米中貿易摩擦の激化が要因となりました。

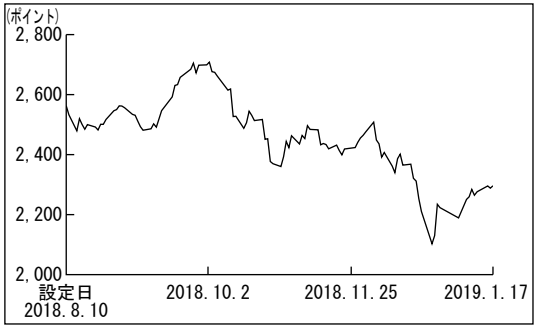
＜七十七＞ＥＳＧ日本株オープン
愛称：「みやぎの絆」

【投資環境】

設定当初から2018年10月中旬までの日本株式市場はボックス圏で推移しました。貿易政策、中国経済、新興国為替などの動向に一喜一憂する展開が続きました。

10月下旬以降の日本株式市場は下落しました。世界的な景気や業績の悪化、米中貿易摩擦の激化、対米ドルでの円高が背景でした。自動車・住宅・スマートフォンという3大耐久消費財の販売鈍化、中国のシャドーバンキング引き締めと設備投資の鈍化などから、世界的にやや冴えない業績見通しを発表する企業が増加しました。また、中国通信機器メーカーのファーウェイ副会長が逮捕されるなど、米中貿易摩擦が激化したことも株価の重石となりました。

ＴＯＰＩＸ（配当込み）の推移



【ポートフォリオ】

■＜七十七＞ＥＳＧ日本株オープン

主要投資対象であるＥＳＧ日本株マザーファンドを期を通じて高位に組み入れ、期末の実質的な株式組入比率は98.1％としました。

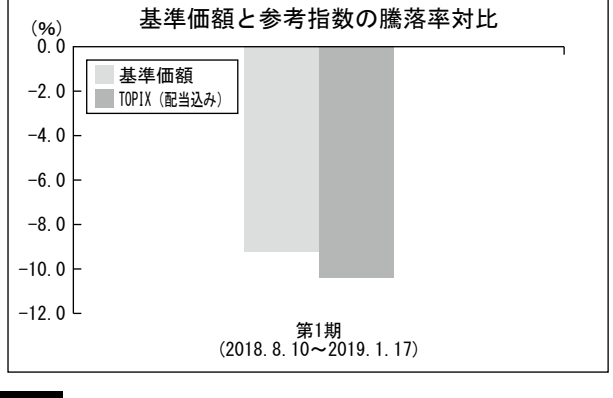
■ＥＳＧ日本株マザーファンド

当期の騰落率は、△10.7％となりました。

『社会問題を客観的に特定し、問題を解決する企業に投資する』という理念に基づき、利益に対して割安な企業に投資をしました。銘柄入れ替えはほとんど行わず、株価の変動時には、ポートフォリオ内で相対的に割高な企業のウェイトを減らし、割安な企業のウェイトを増やしました。また、『長期投資を行い、経営者と一緒に企業価値を上げる努力をする』という考えのもと、投資先企業の経営者とミーティングを積極的に行い、中長期的な企業価値の向上につながるようなアイデアの提供に努めました。業種別配分のガイドラインは定めていませんが、銘柄選択の結果として、化学、建設業、機械の構成比率が高くなりました。

【ベンチマークとの差異】

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



【分配金】

収益分配金につきましては、分配可能額、基準価額水準等を勘案し、見送りとさせて頂きました。
なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用を行います。

■分配原資の内訳

（１万口当り・税引前）

項目		第１期 2018年８月10日 ～2019年１月17日
当期分配金	（円）	0
（対基準価額比率）	（％）	0.00
当期の収益	（円）	－
当期の収益以外	（円）	－
翌期繰越分配対象額	（円）	40

※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、ファンドの収益率とは異なります。

今後の運用方針

■＜七十七＞ＥＳＧ日本株オープン

引き続き、運用の基本方針に従い、マザーファンドへの投資を通じて、わが国の金融商品取引所に上場されている株式に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。

■ＥＳＧ日本株マザーファンド

ESGへの関心が高まる一方、株式市場の下落によって、優良株が以前より割安となりました。そのため、綿密な調査に基づき、ESG課題等への取組を通じて企業価値向上が期待される新しい銘柄を発掘し、投資を行う方針です。投資先の経営者との対話も継続します。また、社会問題を指摘する本の内容を参考にして投資をすることで、『本を書いたり読んだりした人の気持ちが、お金の流れに変わり、事業を行う企業や経営者へと届けられたら』と考えています。

１万口当りの費用明細

項　目	当　期 2018年８月10日～2019年１月17日		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	65円	0.657%	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9,820円です。
（投信会社）	(33)	(0.333)	ファンドの運用等の対価
（販売会社）	(30)	(0.310)	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）	(1)	(0.014)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	17	0.174	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）	(17)	(0.174)	有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
その他費用	0	0.004	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.004)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	82	0.835	

＊「比率」欄は１万口当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。
＊期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む。）は、追加・解約により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、売買委託手数料及びその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託受益証券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。
＊各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

（2018年８月10日から2019年１月17日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ＥＳＧ日本株マザーファンド	1,229,620	1,213,552	47,979	50,091

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

（2018年８月10日から2019年１月17日まで）

項　目	当　期
	ＥＳＧ日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	2,586,331千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,051,553千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	2.45

＊(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均

＜七十七＞ＥＳＧ日本株オープン
愛称：「みやぎの絆」

主要な売買銘柄

（2018年８月10日から2019年１月17日まで）

■ＥＳＧ日本株マザーファンドにおける株式の主要な売買銘柄

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
小松製作所	21.5	62,942	2,927	デジタルハーツホールディングス	27.9	45,818	1,642
良品計画	2	62,859	31,429	ＫＤＤＩ	12	32,028	2,669
デジタルハーツホールディングス	41.1	60,037	1,460	日本電信電話	6.6	30,486	4,619
ニチアス	31.6	59,469	1,881	ナブテスコ	10.2	30,102	2,951
大塚ホールディングス	10.5	53,051	5,052	日本ユニシス	10.2	27,712	2,716
ＫＤＤＩ	18.9	51,743	2,737	シップヘルスケアホールディングス	6.4	27,362	4,275
ＥＰＳホールディングス	24.4	51,061	2,092	小松製作所	8.2	24,866	3,032
山九	8.7	49,888	5,734	ダイキン工業	1.8	23,025	12,791
日本電信電話	10.5	49,192	4,685	住友金属鉱山	6.4	22,106	3,454
ダイキョーニシカワ	36	49,050	1,362	大和ハウス工業	6.6	22,093	3,347

＊金額は受渡し代金

利害関係人との取引状況等

（2018年８月10日から2019年１月17日まで）

＜＜七十七＞ＥＳＧ日本株オープン＞

■利害関係人との取引状況

当期における利害関係人との取引はありません。

＜ＥＳＧ日本株マザーファンド＞

■利害関係人との取引状況

当期における利害関係人との取引はありません。

組入資産の明細

2019年１月17日現在

■親投資信託残高

	当期末	
	口数	評価額
	千口	千円
ＥＳＧ日本株マザーファンド	1,181,641	1,064,304

＊ＥＳＧ日本株マザーファンド全体の受益権口数は、1,281,640千口です。

投資信託財産の構成

2019年１月17日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ＥＳＧ日本株マザーファンド	1,064,304	100.0
投資信託財産総額	1,064,304	100.0

＜七十七＞ＥＳＧ日本株オープン
愛称：「みやぎの絆」

資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2019年１月17日）現在

項目	当期末
(A) 資産	1,064,304,180円
ＥＳＧ日本株マザーファンド(評価額)	1,064,304,180
(B) 負債	6,197,115
未払信託報酬	6,157,037
その他未払費用	40,078
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	1,058,107,065
元本	1,165,595,720
次期繰越損益金	△ 107,488,655
(D) 受益権総口数	1,165,595,720口
１万口当り基準価額(Ｃ／Ｄ)	9,078円

＊元本状況

当初設定元本額	606,519,539円
期中追加設定元本額	606,602,124円
期中一部解約元本額	47,525,943円
＊元本の欠損	107,488,655円

損益の状況

自2018年８月10日
至2019年１月17日

項目	当期
(A) 有価証券売買損益	△101,662,307円
売買益	3,094,911
売買損	△104,757,218
(B) 信託報酬等	△ 6,197,115
(C) 当期損益金(Ａ＋Ｂ)	△107,859,422
(D) 追加信託差損益金	370,767
(売買損益相当額)	(370,767)
(E) 計(Ｃ＋Ｄ)	△107,488,655
次期繰越損益金(Ｅ)	△107,488,655
追加信託差損益金	370,767
(配当等相当額)	(1,577,760)
(売買損益相当額)	(△ 1,206,993)
分配準備積立金	3,155,749
繰越損益金	△111,015,171

＊有価証券売買損益には、期末の評価換えによるものを含みます。
＊信託報酬等には、消費税等相当額を含めて表示しております。
＊追加信託差損益金とは、追加信託金と元本の差額をいい、元本を下回る額は損失として、上回る額は利益として処理されます。

＜分配金の計算過程＞
信託約款に基づき計算した収益分配可能額及び収益分配金の計算過程は以下のとおりです。

(A) 配当等収益(費用控除後)	3,155,749円
(B) 有価証券売買等損益(費用控除後、繰越欠損金補填後)	0
(C) 収益調整金	1,577,760
(D) 分配準備積立金	0
分配可能額(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	4,733,509
(１万口当り分配可能額)	(40.61)
収益分配金	0
(１万口当り収益分配金)	(0)

お知らせ

◆当ファンドの販売会社は、収受した運用管理費用（信託報酬）の一部（運用管理費用（信託報酬）率のうち年率0.1%程度）を震災により壊滅的な被害を受けた海岸防災林の再生活動のために寄付します。

2019年１月の決算期末を基準として行った寄付先および寄付金額は以下の通りです。
寄付先　：公益社団法人宮城県緑化推進委員会
寄付金額：412,963円

※各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しております。

ＥＳＧ日本株マザーファンド

運用報告書

決算日：2019年１月17日

（第１期：2018年５月31日～2019年１月17日）

当ファンドは、上記の通り決算を行いました。ここに、期中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。

商品分類	親投資信託
信託期間	無期限
運用方針	わが国の金融証券取引所に上場されている株式に投資することにより、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。
投資制限	・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、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。

資産運用のベストパートナー、だいわすみぎん

Top in Quality

大和住銀投信投資顧問

Daiwa SB Investments

東京都千代田区霞が関三丁目2番1号

https://www.daiwasbi.co.jp/

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ＴＯＰＩＸ（配当込み）		株式組入比率	株式先物組入比率	純資産総額
		期中騰落率	（参考指数）	期中騰落率			
（設定日）	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
2018年５月31日	10,000	－	2,551.57	－	－	－	100
第１期（2019年１月17日）	9,007	△9.9	2,296.18	△10.0	97.6	－	1,154

東証株価指数（ＴＯＰＩＸ（配当込み））は、株式会社東京証券取引所（㈱東京証券取引所）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は、㈱東京証券取引所が有しています。
＊設定日の基準価額は設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
＊先物組入比率は、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		ＴＯＰＩＸ（配当込み）		株式組入比率	株式先物組入比率
		騰落率	（参考指数）	騰落率		
	円	%	ポイント	%	%	%
（設定日）2018年５月31日	10,000	－	2,551.57	－	－	－
６月末	9,982	△ 0.2	2,548.78	△ 0.1	97.6	－
７月末	10,173	1.7	2,581.96	1.2	98.1	－
８月末	9,913	△ 0.9	2,556.25	0.2	99.6	－
９月末	10,579	5.8	2,698.09	5.7	98.6	－
10月末	9,483	△ 5.2	2,444.11	△ 4.2	98.5	－
11月末	9,826	△ 1.7	2,475.92	△ 3.0	98.6	－
12月末	8,758	△12.4	2,223.11	△12.9	99.1	－
（期末）2019年１月17日	9,007	△ 9.9	2,296.18	△10.0	97.6	－

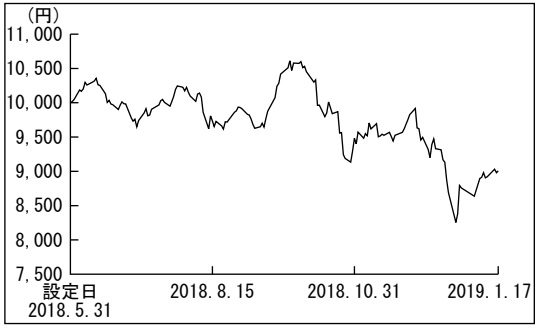
＊設定日の基準価額は、設定価額を記載しています。
＊騰落率は設定日比です。
＊先物組入比率は、買建比率－売建比率

運用経過

【基準価額等の推移】

設定日：10,000円
期　末：　9,007円
騰落率：　△9.9％

基準価額の推移



【基準価額の主な変動要因】

（上昇要因）

日本銀行による緩和的な金融政策とETF（上場投資信託）の購入が要因となりました。また、日本企業のコーポレートガバナンスの改善も要因となりました。

（下落要因）

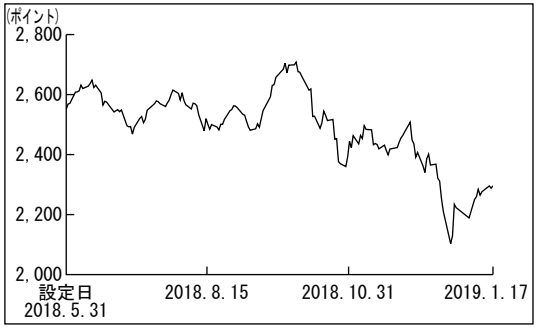
世界的な景気業績の悪化と米中貿易摩擦の激化が要因となりました。

【投資環境】

設定当初から2018年10月上旬までの日本株式市場はボックス圏で推移しました。貿易政策、中国経済、新興国為替などの動向に一喜一憂する展開が続きました。

10月中旬以降の日本株式市場は下落しました。世界的な景気や業績の悪化、米中貿易摩擦の激化、対米ドルでの円高が背景でした。自動車・住宅・スマートフォンという3大耐久消費財の販売鈍化、中国のシャドーバンキング引き締めと設備投資の鈍化などから、世界的にやや冴えない業績見通しを発表する企業が増加しました。また、中国通信機器メーカーのファーウェイ副会長が逮捕されるなど、米中貿易摩擦が激化したことも株価の重石となりました。

ＴＯＰＩＸ（配当込み）の推移



【ポートフォリオ】

当期の騰落率は、△9.9％となりました。

『社会問題を客観的に特定し、問題を解決する企業に投資する』という理念に基づき、利益に対して割安な企業に投資をしました。銘柄入れ替えはほとんど行わず、株価の変動時には、ポートフォリオ内で相対的に割高な企業のウェイトを減らし、割安な企業のウェイトを増やしました。また、『長期投資を行い、経営者と一緒に企業価値を上げる努力をする』という考えのもと、投資先企業の経営者とミーティングを積極的に行い、中長期的な企業価値の向上につながるようなアイデアの提供に努めました。業種別配分のガイドラインは定めていませんが、銘柄選択の結果として、化学、建設業、機械の構成比率が高くなりました。

【ベンチマークとの差異】

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

基準価額の騰落率は、参考指数であるTOPIX（配当込み）の騰落率△10.0％を0.1％上回りました。

今後の運用方針

ESGへの関心が高まる一方、株式市場の下落によって、優良株が以前より割安となりました。そのため、綿密な調査に基づき、ESG課題等への取組を通じて企業価値向上が期待される新しい銘柄を発掘し、投資を行う方針です。投資先の経営者との対話も継続します。また、社会問題を指摘する本の内容を参考にして投資をすることで、『本を書いたり読んだりした人の気持ちが、お金の流れに変わり、事業を行う企業や経営者へと届けられたら』と考えています。

１万口当りの費用明細

項　目	当　期 2018年５月31日～2019年１月17日		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料	23円	0.237%	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）	(23)	(0.237)	有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
その他費用	0	0.000	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（その他）	(0)	(0.000)	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	23	0.237	
期中の平均基準価額は9,816円です。			

＊「比率」欄は１万口当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。
＊期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む。）は、追加・解約により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。
＊各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

売買及び取引の状況

（2018年５月31日から2019年１月17日まで）

■株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
		株	千円	株	千円
国内	上場	1,064,800 (△ 29,900)	1,993,950 (－)	378,100	748,232

＊金額は受渡し代金
＊（ ）内は増資割当、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いません。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

（2018年５月31日から2019年１月17日まで）

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	2,742,182千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	779,282千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	3.51

＊(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均

主要な売買銘柄

（2018年５月31日から2019年１月17日まで）

■株式

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
小松製作所	22.6	66,738	2,953	デジタルハーツホールディングス	27.9	45,818	1,642
デジタルハーツホールディングス	43.3	63,549	1,467	ＫＤＤＩ	12.2	32,642	2,675
良品計画	2	62,859	31,429	日本電信電話	6.7	31,010	4,628
ニチアス	33.6	62,188	1,850	ナブテスコ	10.4	30,757	2,957
大塚ホールディングス	11.2	56,699	5,062	シップヘルスケアホールディングス	6.6	28,197	4,272
ＫＤＤＩ	19.7	54,107	2,746	日本ユニシス	10.3	27,986	2,717
ＥＰＳホールディングス	25.5	53,419	2,094	小松製作所	8.4	25,514	3,037
山九	9.2	52,837	5,743	大塚ホールディングス	4.4	23,640	5,372
ダイキョーニシカワ	38.1	52,693	1,383	ダイキン工業	1.8	23,025	12,791
日東電工	6.6	51,417	7,790	住友金属鉱山	6.5	22,525	3,465

＊金額は受渡し代金

利害関係人との取引状況等

（2018年５月31日から2019年１月17日まで）

■利害関係人との取引状況

当期における利害関係人との取引はありません。

組入資産の明細

2019年１月17日現在

■国内株式

銘柄	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千円
建設業（10.7%）		
大林組	29.6	30,073
住友林業	18.9	26,686
大和ハウス工業	4.4	15,923
協和エクシオ	10.2	26,887
高砂熱学工業	11.8	21,098
食料品（2.5%）		
キユーピー	5.8	14,407
ニチレイ	4.6	13,846
化学（15.7%）		
クラレ	20	33,440
旭化成	22.6	25,651
積水化学工業	19.9	30,805
アイカ工業	4.9	17,983
ダイキョーニシカワ	35.5	39,724
日東電工	5.2	29,364
医薬品（6.1%）		
塩野義製薬	6	38,820
大塚ホールディングス	6.8	30,103
ゴム製品（1.2%）		
ブリヂストン	3.3	13,932
ガラス・土石製品（5.8%）		
日本碍子	15.6	24,835
ニチアス	21.3	40,406
非鉄金属（3.1%）		
日本軽金属ホールディングス	90.6	20,475
住友金属鉱山	4.6	14,135
機械（10.5%）		
小松製作所	14.2	37,956
クボタ	14.7	24,108
ダイキン工業	1.6	19,968
栗田工業	13.3	35,763
電気機器（3.5%）		
日立製作所	6.6	22,981
アズビル	7.6	16,902
輸送用機器（2.2%）		
モリタホールディングス	13.9	25,311
電気・ガス業（3.6%）		
関西電力	6	10,302
東京瓦斯	10.2	29,692
陸運業（2.8%）		
山九	6	31,320
情報・通信業（7.8%）		
デジタルハーツホールディングス	15.4	22,961
メルカリ	4.4	9,367
日本ユニシス	6.2	16,479
日本電信電話	4.2	19,118
ＫＤＤＩ	7.5	20,227
卸売業（10.3%）		
シップヘルスケアホールディングス	3.1	12,958
丸紅	48.9	39,286
住友商事	21.2	34,556
三菱商事	9.5	29,345
小売業（3.2%）		
良品計画	1.6	35,984
銀行業（2.6%）		
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	51.5	29,380
その他金融業（3.1%）		
オリックス	20.6	34,834
サービス業（5.2%）		
ＥＰＳホールディングス	21.8	35,991
トーカイ	3.9	10,725
セコム	1.3	11,980
合計 株数、金額	千株 656.8	千円 1,126,103
合計 銘柄数〈比率〉	45銘柄	〈97.6%〉

＊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
＊合計欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率
＊各銘柄の業種分類は、期末の時点での分類に基づき表示しています。

投資信託財産の構成

2019年１月17日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	1,126,103	93.1
コール・ローン等、その他	83,818	6.9
投資信託財産総額	1,209,921	100.0

資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2019年１月17日）現在

項目	当期末
(A) 資産	1,209,921,790円
コール・ローン等	21,046,487
株式(評価額)	1,126,103,010
未収入金	61,487,093
未収配当金	1,285,200
(B) 負債	55,595,938
未払金	55,595,873
その他未払費用	65
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	1,154,325,852
元本	1,281,640,587
次期繰越損益金	△ 127,314,735
(D) 受益権総口数	1,281,640,587口
１万口当り基準価額(Ｃ／Ｄ)	9,007円

＊元本状況

当初設定元本額	100,000,000円
期中追加設定元本額	1,229,620,615円
期中一部解約元本額	47,980,028円

＊元本の内訳

＜七十七＞ＥＳＧ日本株オープン	1,181,641,146円
ＥＳＧオポチュニティ日本株Ｆ－１（適格機関投資家限定）	999,441円
ヘッジ付ＥＳＧオポチュニティ日本株Ｆ－１（適格機関投資家限定）	99,000,000円

＊元本の欠損 127,314,735円

損益の状況

自2018年５月31日
至2019年１月17日

項目	当期
(A) 配当等収益	10,481,011円
受取配当金	10,500,400
受取利息	289
支払利息	△ 19,678
(B) 有価証券売買損益	△119,614,368
売買益	31,505,481
売買損	△151,119,849
(C) その他費用	△ 1,551
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△109,134,908
(E) 解約差損益金	△ 2,112,010
(F) 追加信託差損益金	△ 16,067,817
(G) 計 (Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	△127,314,735
次期繰越損益金(Ｇ)	△127,314,735

＊有価証券売買損益には、期末の評価換えによるものを含みます。
＊解約差損益金とは、一部解約時の解約金額と元本の差額をいい、元本を下回る額は利益として、上回る額は損失として処理されます。
＊追加信託差損益金とは、追加信託金と元本の差額をいい、元本を下回る額は損失として、上回る額は利益として処理されます。

お知らせ

該当事項はございません。

※各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しております。