

運用報告書（全体版）

第3期

決算日 2021年1月18日

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、分配金額は経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益も含まれます。）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。

<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2021年1月18日に第3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。

- 口座残高など、お取引状況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。
- 運用報告書についてのお問い合わせ
コールセンター 0120-88-2976
受付時間：午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

<https://www.smd-am.co.jp>

<七十七> E S G 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)	税金	騰落率	(参考指数)	騰落率			
(設定日) 2018年8月10日	円 10,000	円 —	% —	ポイント 2,562.63	% —	% —	% —	百万円 606
第1期(2019年1月17日)	9,078	0	△ 9.2	2,296.18	△10.4	98.1	—	1,058
第2期(2020年1月17日)	10,177	0	12.1	2,647.39	15.3	99.2	—	826
第3期(2021年1月18日)	10,663	0	4.8	2,883.70	8.9	85.0	—	593

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			
(期首) 2020年1月17日	円 10,177	% —	ポイント 2,647.39	% —	% 99.2	% —
1月末	9,924	△ 2.5	2,569.77	△ 2.9	93.9	—
2月末	8,858	△13.0	2,305.76	△12.9	95.6	—
3月末	8,303	△18.4	2,167.60	△18.1	95.3	—
4月末	8,552	△16.0	2,261.88	△14.6	94.2	—
5月末	9,229	△ 9.3	2,416.04	△ 8.7	95.9	—
6月末	9,107	△10.5	2,411.45	△ 8.9	95.8	—
7月末	8,513	△16.4	2,314.39	△12.6	94.2	—
8月末	9,413	△ 7.5	2,503.59	△ 5.4	94.4	—
9月末	9,487	△ 6.8	2,536.14	△ 4.2	97.4	—
10月末	9,106	△10.5	2,464.21	△ 6.9	97.1	—
11月末	10,079	△ 1.0	2,738.72	3.4	91.3	—
12月末	10,431	2.5	2,819.93	6.5	93.2	—
(期末) 2021年1月18日	10,663	4.8	2,883.70	8.9	85.0	—

*騰落率は期首比です。

*先物組入比率は、買建比率－売建比率

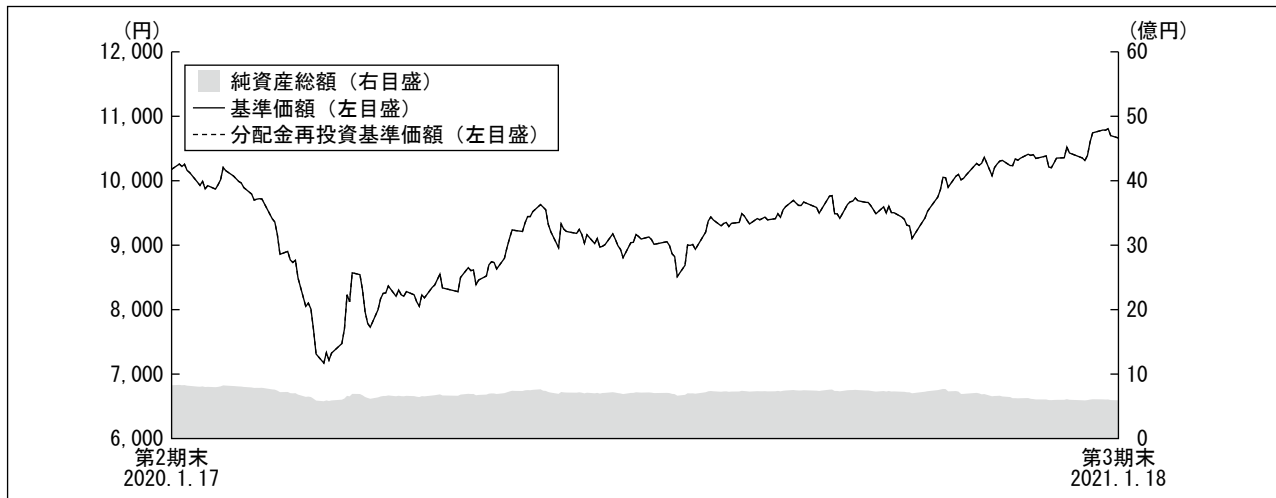
*当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質組入比率を記載しています。

<七十七> E S G 日本株オープン

愛称：「みやぎの絆」

運用経過

【基準価額等の推移】



*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、期首の基準価額を基準に算出しております。

*分配金再投資基準価額は、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はありません。

*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。

第3期首：10,177円

第3期末：10,663円（既払分配金 0円）

騰落率：+4.8%（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）

金融緩和と財政支出の増加、新型コロナウイルスのワクチンや治療薬の開発進展、経済指標の底入れなどが要因となりました。

（下落要因）

新型コロナウイルスの感染拡大、世界的な景気後退などが要因となりました。

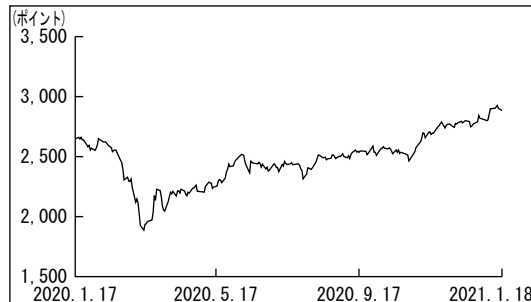
<七十七> ESG日本株オープン

愛称：「みやぎの絆」

【投資環境】

2020年1月下旬から3月にかけて、新型コロナウイルスが世界的に流行し、景気や企業業績の見通しが急激に悪化したことから、株式市場は大幅に下落しました。一方、3月下旬以降の株式市場は上昇基調となりました。新型コロナウイルスに対する治療薬やワクチンの開発が進展したことが好感されました。また、景気後退から脱却するために、FRB（米連邦準備制度理事会）がハイイールド債券を含めた社債買入れプログラムの運用を開始したほか、各国政府が大規模な財政支出をしたことも、株価の下支えとなりました。加えて、経済指標が4-5月頃に底入れしたことも、景気見通しの改善につながりました。

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85.0%としました。

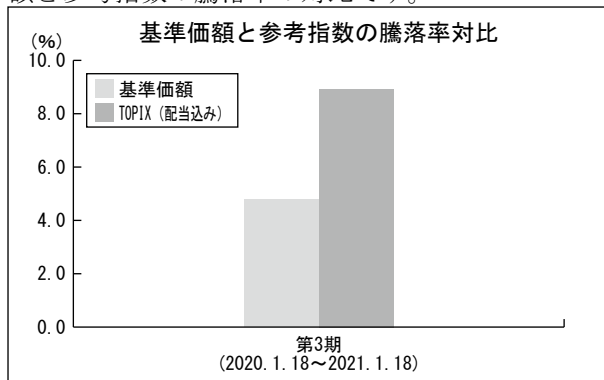
■ ESG日本株マザーファンド

当期の騰落率は、+6.4%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』という当ファンドの理念に基づき、利益に対して割安な企業に投資をしました。具体的には、テクマトリックス（3762）、デジタルホールディングス（2389）、ハマキョウレックス（9037）などを新規に組み入れました。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を行い、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、サービス業、情報・通信業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。



<七十七> ESG日本株オープン

愛称：「みやぎの絆」

【分配金】

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、見送りとさせていただきます。
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3期	
	2020年1月18日 ～2021年1月18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)		845

※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への関心が年々高まっており、今後もESGを考慮した投資や企業経営が増えると予想されます。特に、温室効果ガスの排出量の削減や人材の多様化がより注目されると見えています。また、バリュー株とグロース株のバリュエーション（投資価値評価）格差が広がっており、バリュー株への投資の魅力が増していると考えています。こうした環境認識のもと、引き続き、綿密な調査に基づき、ESG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銘柄を発掘し、投資を行う方針です。

<七十七> E S G 日本株オープン

愛称：「みやぎの絆」

1 万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2020年1月18日～2021年1月18日		
	金額	比率	
信託報酬	141円	1.522%	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9,250円です。
(投信会社)	(71)	(0.772)	ファンドの運用等の対価
(販売会社)	(66)	(0.717)	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)	(3)	(0.033)	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	28	0.299	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)	(28)	(0.299)	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	1	0.010	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)	(1)	(0.010)	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	169	1.831	

* 「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。

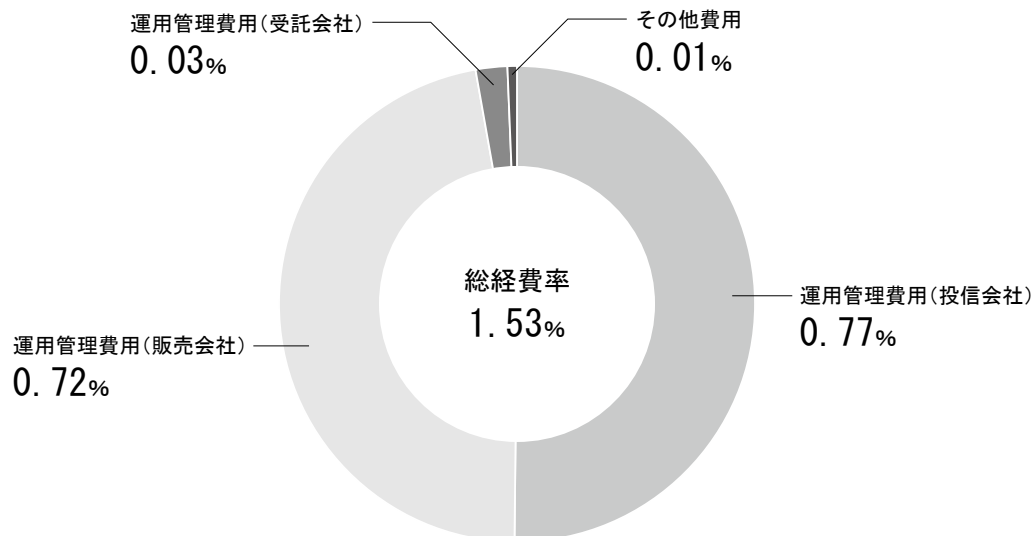
* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む。）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

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。

<七十七> E S G 日本株オープン 愛称：「みやぎの絆」

参考情報 総経費率（年率換算）



*各費用は、前掲「1万口当りの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、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。

*各比率は、年率換算した値（小数点以下第2位未満を四捨五入）です。

*上記の前提条件で算出しているため、「1万口当りの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、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。

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口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率換算）は1.53%です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

（2020年1月18日から2021年1月18日まで）

	設		解	
	口	数	口	数
E S G 日本株マザーファンド	70,791	千口	341,971	千口
		金額		金額
		65,379		343,588
		千円		千円

<七十七> E S G 日本株オープン

愛称：「みやぎの絆」

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 (2020年1月18日から2021年1月18日まで)

項 目	当 期
	E S G 日本株マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	2,333,951千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	667,027千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	3.49

* (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均

利害関係人との取引状況等 (2020年1月18日から2021年1月18日まで)

■ 利害関係人との取引状況

<<七十七> E S G 日本株オープン>

当期における利害関係人との取引はありません。

< E S G 日本株マザーファンド >

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	B / A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	D / C
株 式	百万円 1,000	百万円 92	% 9.3	百万円 1,333	百万円 187	% 14.1

* 平均保有割合99.9%

* 平均保有割合とは親投資信託残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合

■ 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

<<七十七> E S G 日本株オープン>

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	2,109千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	186千円
(B) / (A)	8.8%

* 売買委託手数料総額は、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。

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あり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、S M B C 日興証券株式会社です。

組入資産の明細

2021年1月18日現在

■ 親投資信託残高

	期首 (前期末)	当 期	末
	口 数	口 数	評 価 額
E S G 日 本 株 マ ー マ ー フ ァ ン ド	千口 816,128	千口 544,948	千円 594,484

* E S G 日本株マザーファンド全体の受益権口数は、544,948千口です。

<七十七> ESG日本株オープン

愛称：「みやぎの絆」

投資信託財産の構成

2021年1月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ESG日本株マザーファンド	594,484千円	97.8%
コール・ローン等、その他	13,578	2.2
投資信託財産総額	608,062	100.0

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年1月18日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	608,062,912円
コール・ローン等	4,114,088
ESG日本株マザーファンド(評価額)	594,484,548
未 収 入 金	9,464,276
(B) 負 債	14,763,362
未 払 解 約 金	9,349,348
未 払 信 託 報 酬	5,344,351
そ の 他 未 払 費 用	69,663
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	593,299,550
元 本	556,417,310
次 期 繰 越 損 益 金	36,882,240
(D) 受 益 権 総 口 数	556,417,310口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)	10,663円

*元本状況

期首元本額	812,540,462円
期中追加設定元本額	83,099,493円
期中一部解約元本額	339,222,645円

損益の状況

自2020年1月18日
至2021年1月18日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 30円
支 払 利 息	△ 30
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	42,546,554
売 買 損 益	55,640,768
売 買 損 益	△13,094,214
(C) 信 託 報 酬 等	△10,779,174
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	31,767,350
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	12,415,054
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 7,300,164
(配 当 等 相 当 額)	(2,647,117)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 9,947,281)
(G) 計 (D+E+F)	36,882,240
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	36,882,240
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 7,300,164
(配 当 等 相 当 額)	(2,859,970)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△10,160,134)
分 配 準 備 積 立 金	44,182,404

*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)	11,392,228円
(B) 有 価 証 券 売 買 等 損 益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)	20,222,530
(C) 收 益 調 整 金	2,859,970
(D) 分 配 準 備 積 立 金	12,567,646
分 配 可 能 額 (A+B+C+D)	47,042,374
(1 万 口 当 り 分 配 可 能 額)	(845.45)
収 益 分 配 金	0
(1 万 口 当 り 収 益 分 配 金)	(0)

<七十七> E S G 日本株オープン

愛称：「みやぎの絆」

お知らせ

当ファンドの販売会社は、收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。

2021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：706,623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：2021年1月18日

(第3期：2020年1月18日～2021年1月18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	<ul style="list-style-type: none">・ 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。



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

<https://www.smd-am.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
	期騰落率	中率	(参考指数)	期騰落率			
(設定日) 2018年5月31日	円 10,000	% —	ポイント 2,551.57	% —	% —	% —	百万円 100
第1期 (2019年1月17日)	9,007	△ 9.9	2,296.18	△10.0	97.6	—	1,154
第2期 (2020年1月17日)	10,252	13.8	2,647.39	15.3	98.1	—	837
第3期 (2021年1月18日)	10,909	6.4	2,883.70	8.9	84.9	—	594

東証株価指数（TOPIX（配当込み））は、株式会社東京証券取引所（関東証券取引所）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、関東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	中率	(参考指数)	騰落率		
(期首)2020年1月17日	円 10,252	% —	ポイント 2,647.39	% —	% 98.1	% —
1月末	10,003	△ 2.4	2,569.77	△ 2.9	93.7	—
2月末	8,940	△12.8	2,305.76	△12.9	95.4	—
3月末	8,393	△18.1	2,167.60	△18.1	95.0	—
4月末	8,655	△15.6	2,261.88	△14.6	93.8	—
5月末	9,349	△ 8.8	2,416.04	△ 8.7	95.2	—
6月末	9,239	△ 9.9	2,411.45	△ 8.9	95.1	—
7月末	8,648	△15.6	2,314.39	△12.6	94.2	—
8月末	9,574	△ 6.6	2,503.59	△ 5.4	94.2	—
9月末	9,661	△ 5.8	2,536.14	△ 4.2	97.1	—
10月末	9,287	△ 9.4	2,464.21	△ 6.9	96.7	—
11月末	10,298	0.4	2,738.72	3.4	88.6	—
12月末	10,668	4.1	2,819.93	6.5	91.8	—
(期末)2021年1月18日	10,909	6.4	2,883.70	8.9	84.9	—

*騰落率は期首比です。

*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】

期首：10,252円
 期末：10,909円
 騰落率：+6.4%

【基準価額の主な変動要因】

（上昇要因）

金融緩和政策と財政支出の増加、新型コロナウイルスのワクチンや治療薬の開発進展、経済指標の底入れなどが要因となりました。

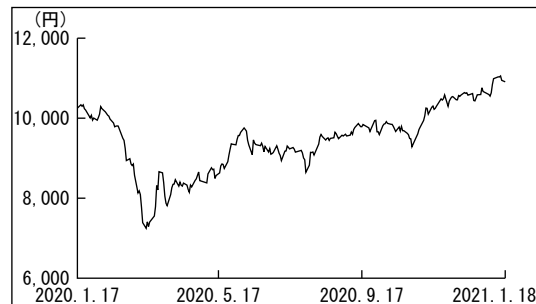
（下落要因）

新型コロナウイルスの感染拡大、世界的な景気後退などが要因となりました。

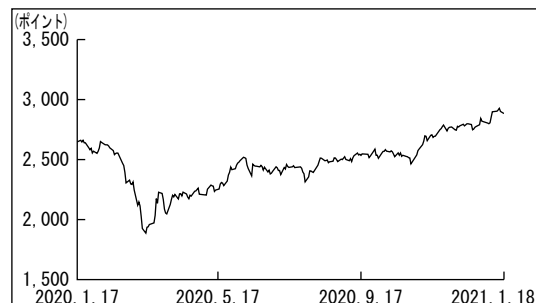
【投資環境】

2020年1月下旬から3月にかけて、新型コロナウイルスが世界的に流行し、景気や企業業績の見通しが急激に悪化したことから、株式市場は大幅に下落しました。一方、3月下旬以降の株式市場は上昇基調となりました。新型コロナウイルスに対する治療薬やワクチンの開発が進展したことが好感されました。また、景気後退から脱却するために、FRB（米連邦準備制度理事会）がハイールド債券を含めた社債買入れプログラムの運用を開始したほか、各国政府が大規模な財政支出をしたことも、株価の下支えとなりました。加えて、経済指標が4-5月頃に底入れしたことも、景気見通しの改善につながりました。

基準価額の推移



TOPIX（配当込み）の推移



【ポートフォリオ】

当期の騰落率は、+6.4%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』という当ファンドの理念に基づき、利益に対して割安な企業に投資をしました。具体的には、テクマトリックス（3762）、デジタルホールディングス（2389）、ハマキョウレックス（9037）などを新規に組み入れました。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、サービス業、情報・通信業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+8.9%を2.5%下回りました。

今後の運用方針

ESGへの関心が年々高まっており、今後もESGを考慮した投資や企業経営が増えると予想されます。特に、温室効果ガスの排出量の削減や人材の多様化がより注目されると見えています。また、バリュー株とグロース株のバリュエーション（投資価値評価）格差が広がっており、バリュー株への投資の魅力が増していると考えています。こうした環境認識のもと、引き続き、綿密な調査に基づき、ESG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銘柄を発掘し、投資を行う方針です。

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2020年1月18日～2021年1月18日		
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式)	28円 (28)	0.297% (0.297)	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 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 (その他)	0 (0)	0.000 (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 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	28	0.297	
期中の平均基準価額は9,393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

(2020年1月18日から2021年1月18日まで)

■株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	株 719,000 (△ 48,540)	千円 1,000,517 ()	株 912,060	千円 1,333,433

*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 (2020年1月18日から2021年1月18日まで)

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	2,333,951千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	667,027千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	3.49

* (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

(2020年1月18日から2021年1月18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
旭化成	49.4	41,241	834	旭化成	52	44,936	864
日本碍子	23.2	33,470	1,442	ダイキョーニシカワ	66.7	42,018	629
あさひ	23	32,252	1,402	日本碍子	26	39,287	1,511
デジタルホールディングス	21.9	31,875	1,455	あさひ	24.7	37,747	1,528
積水化学工業	20.3	30,373	1,496	オリックス	25.7	37,713	1,467
住友林業	20.1	30,068	1,495	積水化学工業	23.5	37,089	1,578
ダイキョーニシカワ	50.7	29,573	583	東京瓦斯	15	37,007	2,467
日本ユニシス	9.6	28,604	2,979	大塚ホールディングス	8.2	36,112	4,404
クラレ	25.7	27,875	1,084	日本ユニシス	10.1	34,688	3,434
協和エクシオ	11.1	27,565	2,483	高砂熱学工業	21.3	33,551	1,575

*金額は受渡し代金

利害関係人との取引状況等

(2020年1月18日から2021年1月18日まで)

■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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株式	百万円 1,000	百万円 92	% 9.3	百万円 1,333	百万円 187	% 14.1

■売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	当	期
売買委託手数料総額(A)		2,111千円
うち利害関係人への支払額(B)		186千円
(B)/(A)		8.8%

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あり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C日興証券株式会社です。

組入資産の明細

2021年1月18日現在

■国内株式

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 (9.8%)			
大林組	17.2	—	—
住友林業	5.8	6.7	13,668
大和ハウス工業	5.1	4.2	12,831
協和エクシオ	5.3	4.8	13,795
高砂熱学工業	11.4	5.7	8,977
食料品 (3.1%)			
キューピー	2.2	2.4	5,654
ニチレイ	5.6	3.4	10,094
繊維製品 (2.7%)			
日本毛織	21.9	13.7	13,467
化学 (9.0%)			
クラレ	4.1	10.2	10,924
旭化成	9.8	7.2	8,013
積水化学工業	6.8	3.6	7,207
アイカ工業	5.2	2.2	7,744
ダイキョーニシカワ	30.5	14.5	11,730
日東電工	2.6	—	—
医薬品 (4.5%)			
塩野義製薬	1.5	2.3	13,268
大塚ホールディングス	5	2.1	9,282
ゴム製品 (-)			
ブリヂストン	1.4	—	—
ガラス・土石製品 (5.9%)			
日本碍子	11.6	8.8	15,232
ニチアス	7.3	5.8	14,453
非鉄金属 (2.6%)			
日本軽金属ホールディングス	90.1	4.5	8,820
住友金属鉱山	1.2	0.9	4,383
機械 (3.5%)			
小松製作所	5.4	1.6	4,811
クボタ	11	3.4	8,115
ダイキン工業	0.5	0.2	4,603
電気機器 (3.3%)			
日立製作所	4.3	—	—
アズビル	5.8	0.9	5,292
小糸製作所	5.6	1.7	11,509
輸送用機器 (2.3%)			
モリタホールディングス	16.6	6.5	11,615

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
電気・ガス業 (-)			
東京瓦斯	4.4	—	—
陸運業 (7.3%)			
ハマキョウレックス	—	6.7	19,738
山九	5.1	4.2	17,031
情報・通信業 (10.4%)			
デジタルハーツホールディングス	4.8	5.3	6,852
テクマトリックス	—	2.7	5,178
野村総合研究所	3.5	1.1	4,290
日本ユニシス	3.2	2.7	10,908
日本電信電話	3.1	4	10,950
KDDI	5.2	4.4	14,220
卸売業 (9.6%)			
シブヘルスケアホールディングス	1.3	1.3	7,644
丸紅	31	22.1	16,146
兼松	19.2	13.3	17,635
住友商事	14.6	—	—
三菱商事	9	2.6	6,921
小売業 (3.0%)			
あさひ	10.6	8.9	15,085
銀行業 (5.3%)			
三菱UFJフィナンシャル・グループ	41.5	21.7	10,659
武蔵野銀行	11.6	10.4	16,213
その他金融業 (5.0%)			
全国保証	4.4	3.4	15,130
オリックス	11.9	5.8	10,164
サービス業 (12.7%)			
デジタルホールディングス	—	8.7	15,633
EPSホールディングス	10	—	—
イチネンホールディングス	7.6	13.4	17,299
トーカイ	3.9	7	14,336
セコム	0.8	0.9	8,664
ダイセキ	4.5	2.5	8,250
合 計	千株	千株	千円
	株数、金額	512	270.4
	銘柄数<比率>	50銘柄	46銘柄
			<84.9%>

*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、期首、期末の各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

2021年1月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 504,446	% 83.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	99,492	16.5
投 資 信 託 財 産 総 額	603,939	100.0

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年1月18日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	603,939,446円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 株 式(評価額)	57,485,521 504,446,900
未 収 入 金	40,952,025
未 収 配 当 金	1,055,000
(B) 負 債	9,464,276
未 払 解 約 金	9,464,276
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	594,475,170
元 本	544,948,711
次 期 繰 越 損 益 金	49,526,459
(D) 受 益 権 総 口 数	544,948,711口
1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D)	10,909円

*元本状況

期首元本額	817,127,436円
期中追加設定元本額	70,791,032円
期中一部解約元本額	342,969,757円

*元本の内訳

<七十七> ESG日本株オープン	544,948,711円
------------------	--------------

損益の状況

自2020年1月18日
至2021年1月18日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	20,295,707円
受 取 配 当 金	20,312,850
受 取 利 息	1,025
そ の 他 収 益 金	517
支 払 利 息	△ 18,685
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	15,693,602
売 買 益 損	120,364,544
売 買 損 益	△104,670,942
(C) そ の 他 費 用	36
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	35,989,273
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	20,584,316
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 1,635,449
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 5,411,681
(H) 計 (D+E+F+G)	49,526,459
次 期 繰 越 損 益 金(H)	49,526,459

*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。