

■ 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 | 無期限（設定日：2018年2月9日） |
| 運用方針 | マザーファンドへの投資を通じて、日本の取引所に上場している株式に投資し、信託財産の中長期的な成長を目指します。 |
| 主要投資対象 | 当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 日本株式ESGマザーファンド 日本の取引所に上場している株式 |
| 当ファンドの運用方法 | マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下のような運用を行います。 ■主として、ESG投資 [※] の拡大が期待される日本株式を投資対象とします。 ※企業の環境(Environment)、社会(Social)、ガバナンス(Governance)への取組みを考慮する投資手法。 ■企業調査に精通したアナリストが企業のESGへの取組みを評価(ESG評価)し、企業価値向上が期待される銘柄を選定します。 |
| 組入制限 | 当ファンド ■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。 日本株式ESG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。 ■外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 |
| 分配方針 | ■年1回（原則として毎年11月30日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ■分配金額は、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。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;">ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）</div> |

三井住友・日本株式 ESGファンド 【運用報告書(全体版)】

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

第 **4** 期
決算日 2021年11月30日

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、日本の取引所に上場している株式に投資し、信託財産の中長期的な成長を目指します。

当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。



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>

■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。

■当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・日本株式ESGファンド

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | (参考指数) TOPIX (東証株価指数、配当込み) | | 株式組入率 株比 | 株式先物率 (買建-売建) | 純資産額 | |
|--------------------|-------------|--------|--------|----------------------------------|----------|-------------|------------------|-----------|-------|
| | (分配落) | 税金 | 期中騰落率 | 期中騰落率 | 期中騰落率 | | | | |
| (設定日) 2018年2月9日 | 円 10,000 | 円 - | % - | | 2,570.45 | % - | % - | 百万円 55 | |
| 1期(2018年11月30日) | 9,965 | 0 | △0.4 | | 2,475.92 | △3.7 | 94.2 | 5.5 | 1,603 |
| 2期(2019年12月2日) | 10,727 | 0 | 7.6 | | 2,611.46 | 5.5 | 96.3 | 3.8 | 1,124 |
| 3期(2020年11月30日) | 11,331 | 0 | 5.6 | | 2,738.72 | 4.9 | 97.9 | 2.4 | 961 |
| 4期(2021年11月30日) | 12,715 | 0 | 12.2 | | 3,073.26 | 12.2 | 90.9 | 9.3 | 1,327 |

※基準価額の騰落率は分配金込み。

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

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | (参考指数) TOPIX (東証株価指数、配当込み) | | 株式組入率 株比 | 株式先物率 (買建-売建) | |
|---------------------|-------------|-----------|----------------------------------|----------|-------------|------------------|----------|
| | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | | |
| (期首) 2020年11月30日 | 円 11,331 | % - | | 2,738.72 | % - | % 2.4 | |
| 12月末 | 11,667 | 3.0 | | 2,819.93 | 3.0 | 98.4 | 1.6 |
| 2021年1月末 | 11,655 | 2.9 | | 2,826.50 | 3.2 | 98.9 | 0.9 |
| 2月末 | 11,558 | 2.0 | | 2,914.58 | 6.4 | 92.7 | 7.0 |
| 3月末 | 12,334 | 8.9 | | 3,080.87 | 12.5 | 91.8 | 8.4 |
| 4月末 | 11,987 | 5.8 | | 2,993.46 | 9.3 | 91.6 | 8.4 |
| 5月末 | 12,091 | 6.7 | | 3,034.76 | 10.8 | 90.8 | 9.0 |
| 6月末 | 12,234 | 8.0 | | 3,070.81 | 12.1 | 93.9 | 6.0 |
| 7月末 | 12,149 | 7.2 | | 3,003.91 | 9.7 | 93.7 | 6.1 |
| 8月末 | 12,564 | 10.9 | | 3,099.08 | 13.2 | 94.5 | 5.5 |
| 9月末 | 13,075 | 15.4 | | 3,234.08 | 18.1 | 93.2 | 6.8 |
| 10月末 | 12,949 | 14.3 | | 3,188.28 | 16.4 | 90.4 | 9.8 |
| (期末) 2021年11月30日 | 円 12,715 | % 12.2 | | 3,073.26 | 12.2 | % 90.9 | % 9.3 |

※騰落率は期首比です。

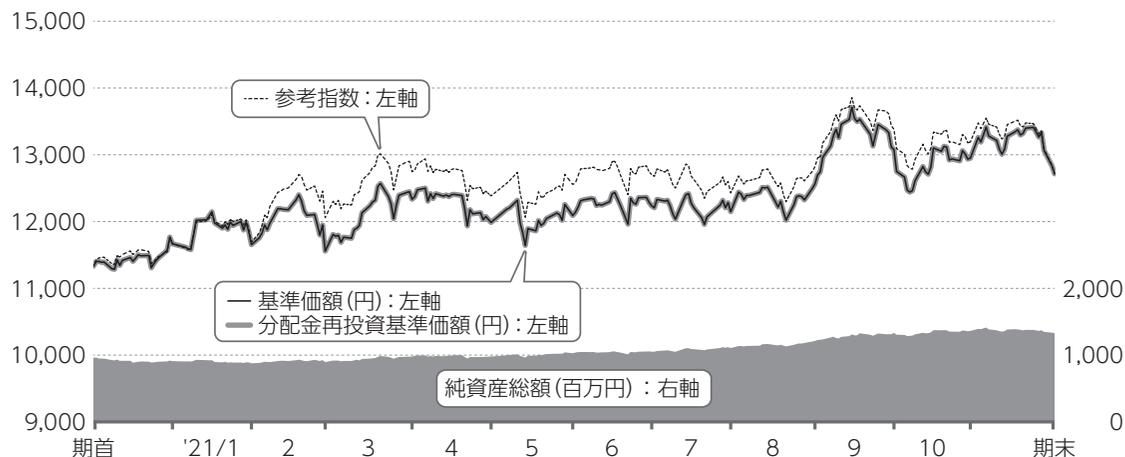
※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

基準価額等の推移について(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額および参考指数は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

| | |
|-----|---------------------------|
| 期首 | 11,331円 |
| 期末 | 12,715円 (既払分配金0円(税引前)) |
| 騰落率 | +12.2% (分配金再投資ベース) |

分配金再投資基準価額について

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と仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さま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などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドの参考指数は、TOPIX(東証株価指数、配当込み)です。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

基準価額の主な変動要因(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、日本の取引所に上場している株式を主要投資対象とし、主として、ESG投資*の拡大が期待される日本株式に投資を行いました。また、銘柄選択にあたっては、企業調査に精通したアナリストが企業のESGへの取組みを評価(ESG評価)し、企業価値向上が期待される銘柄を選定し、その上で、計量モデル等に基づいてポートフォリオを構築しました。

※ESG投資とは、投資判断の際に企業の環境(Environment)、社会(Social)、ガバナンス(Governance)への取組みを考慮する投資手法をいいます。



「ESGへの取組み」には、一般的に以下のような項目が該当します。

- E: 温室効果ガスの排出削減、水資源の効率的な利用 など
- S: 労働環境の改善、地域社会への貢献 など
- G: 企業統治の強化、リスク管理体制の整備 など

上昇要因

- トヨタ自動車、HOYA、ソニーグループなどの株価が上昇したこと

下落要因

- 日本ペイントホールディングス、東京センチュリー、日本ユニシスなどの株価が下落したこと

投資環境について(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

国内株式市場は上昇しました。

期初は米国の追加経済対策への期待と国内製造業の好業績から上昇しました。

2月から8月にかけては、変異ウイルス(デルタ型)の感染が拡大する一方、国内製造業の好業績発表により、もみ合う展開となりました。

9月になると、菅総理の辞任表明により、新政権の政策期待から国内株式市場は高値を更新しました。

その後、中国の不動産大手の信用不安で日本を含み世界的な株安が進行しました。しかし、債務が履行されたことや企業業績が好調な米国株が上昇したことで、国内株式市場も上昇に転じました。

期末には欧州を中心とした新型コロナウイルスの感染再拡大に加え、南アフリカでの新たな変異ウイルス(オミクロン型)の検出が嫌気され、下落しました。

ポートフォリオについて(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当ファンド

期を通じて「日本株式ESGマザーファンド」を高位に組み入れました。

日本株式ESGマザーファンド

●株式組入比率

期中は、99%~100%程度で推移しました(株式先物を含む)。期末時点では100%程度となっています。

●個別銘柄

1月末および7月末に当社ESG評価の一斉見直しを行ったことに伴い、当ファンドは2月初旬および8月初旬にポートフォリオのリバランス(投資配分比率の調整)を行いました。

2月初旬のリバランスでは、新たにESG評価により企業価値向上が期待される銘柄として、三和ホールディングスや東京センチュリーなどを購入した一方、日本M&Aセンターホールディングスやビックカメラなどを売却しました。

8月初旬のリバランスでは、同様に富士フ

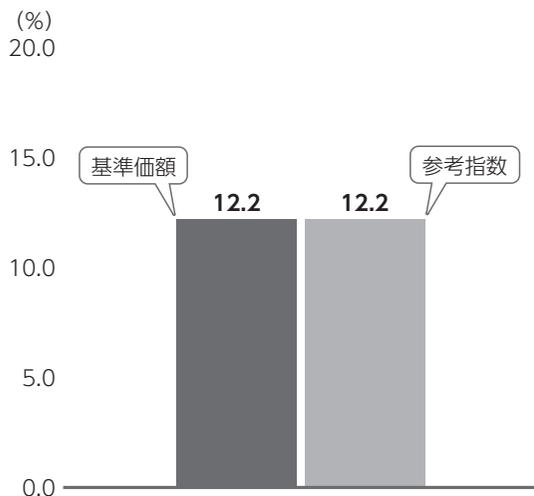
イルムホールディングスや豊田自動織機などを購入した一方、三菱電機やSUBARUなどを売却しました。

●ポートフォリオの特性

当社ESG評価により、企業価値向上が期待される銘柄を選定して、その投資パフォーマンスを効率良く獲得することが期待できるポートフォリオを構築した結果、企業の売上げや利益の成長性に特化したポートフォリオ特性となりました。

ベンチマークとの差異について(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

基準価額と参考指数の騰落率対比



※基準価額は分配金再投資ベース

当ファンドは運用の指標となるベンチマークはありませんが、参考指数としてTOPIX(東証株価指数、配当込み)を設けています。左のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

分配金について(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

(単位：円、1万口当たり、税引前)

| 項目 | 第4期 |
|-----------|---------|
| 当期分配金 | 0円 |
| (対基準価額比率) | (0.00%) |
| 当期の収益 | - |
| 当期の収益以外 | - |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,715 |

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。
 ※「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(税引前)込み)に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

期間の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りとしたしました。

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いたします。

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き「日本株式ESGマザーファンド」を高位に組み入れて運用を行います。

日本株式ESGマザーファンド

国内株式市場は、岸田政権の下で景気配慮型の政策運営が続く中、世界景気と企業業績の持続的な拡大が支援材料となり、緩やかな上昇が続くと予想します。低下基調が続いていたバリュエーション(投資価値評価)に注

目が集まることで、日本株の保有比率の少ない海外投資家の買い越す動きを想定します。

一方で、今後もESG投資の拡大が期待される日本の株式市場において、ESGは長期的な企業業績や株価に影響を及ぼし、ひいては投資家の長期的な投資パフォーマンスにも貢献すると考えています。企業調査に精通したアナリストによるESG評価により企業価値向上が期待される銘柄を選定して、その投資パフォーマンスを効率良く獲得することが期待できるポートフォリオを、計量モデルを活用して構築する方針です。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

1万口当たりの費用明細(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|-------------|------|---------|---|
| (a) 信託報酬 | 147円 | 1.188% | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数／年日数) 期中の平均基準価額は12,382円です。 |
| (投信会社) | (75) | (0.605) | 投信会社:ファンド運用の指図等の対価 |
| (販売会社) | (68) | (0.550) | 販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、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) | (4) | (0.033) | 受託会社:ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | 3 | 0.022 | 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) | (2) | (0.016) | 売買委託手数料:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (先物・オプション) | (1) | (0.005) | |
| (投資信託証券) | (-) | (-) | |
| (c) 有価証券取引税 | - | - | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 |
| (株式) | (-) | (-) | 有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (公社債) | (-) | (-) | |
| (投資信託証券) | (-) | (-) | |
| (d) その他費用 | 1 | 0.006 | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (-) | (-) | 保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用 |
| (監査費用) | (1) | (0.005) | 監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用 |
| (その他) | (0) | (0.001) | その他:信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合計 | 151 | 1.216 | |

※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ています。

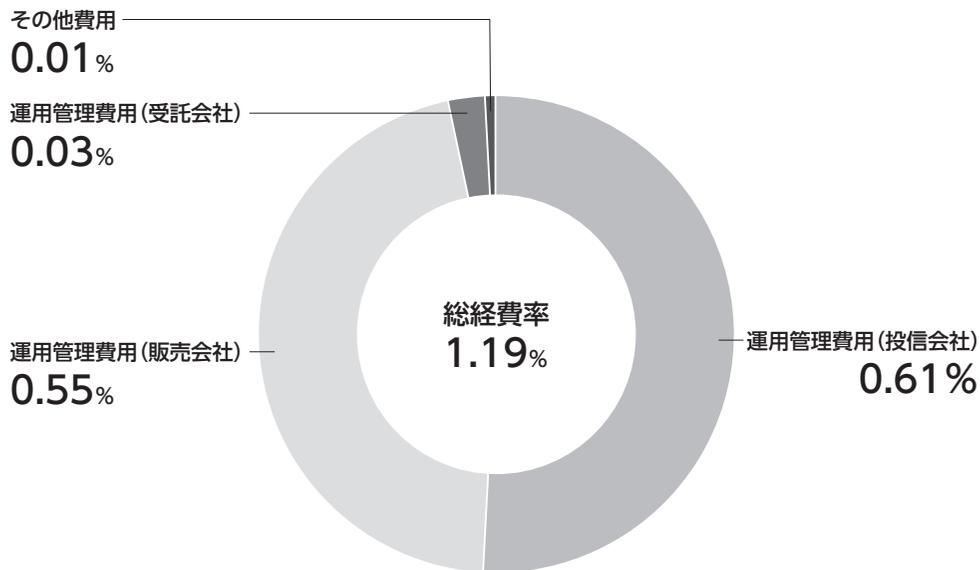
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。



参考情報 総経費率(年率換算)



※各費用は、前掲「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、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。

※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、「1万口当たりの費用明細」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、売買委託手数料およ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(年率換算)は1.19%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2020年12月1日から2021年11月30日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| | 設 定 | | 解 約 | |
|----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 日本株式ESGマザーファンド | 千口 462,927 | 千円 601,073 | 千口 284,811 | 千円 359,864 |

■ 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12月1日から2021年11月30日まで)

| 項 目 | 当 期 | |
|---------------------|----------------|--|
| | 日本株式ESGマザーファンド | |
| (a) 期中の株式売買金額 | 14,177,200千円 | |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 8,577,228千円 | |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.65 | |

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

※外貨建資産については、(a)は各月末(ただし、決算日の属する月については決算日)の日本の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計、(b)は各月末の同仲値で換算した邦貨金額合計の平均です。

■ 利害関係人との取引状況等 (2020年12月1日から2021年11月30日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

三井住友・日本株式ESGファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

日本株式ESGマザーファンド

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | |
|--------|--------------|--------------------|-----------|--------------|--------------------|-----------|
| | | | B A | | | D C |
| 株式 | 百万円 7,792 | 百万円 6,627 | % 85.0 | 百万円 6,384 | 百万円 6,345 | % 99.4 |
| 株式先物取引 | 5,257 | 5,257 | 100.0 | 4,369 | 4,369 | 100.0 |

※平均保有割合 11.8%

※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該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

日本株式ESGマザーファンド

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 期 末 保 有 額 |
|-----|------------|-----------|------------|
| 株式 | 百万円 174 | 百万円 38 | 百万円 246 |

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

三井住友・日本株式ESGファンド

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-------|
| (a) 売買委託手数料総額 | 238千円 |
| (b) うち利害関係人への支払額 | 130千円 |
| (c) (b) / (a) | 54.6% |

※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が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託およ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、株式会社三井住友フィナンシャルグループです。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況
(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細 (2021年11月30日現在)

親投資信託残高

| 種 類 | 期首(前期末) | 期 末 | |
|----------------|---------------|-----------------|-----------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| 日本株式ESGマザーファンド | 千口 824,889 | 千口 1,003,005 | 千円 1,335,101 |

※日本株式ESGマザーファンドの期末の受益権総口数は8,448,619,173口です。

■ 投資信託財産の構成 (2021年11月30日現在)

| 項 目 | 期 | 末 |
|----------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 日本株式ESGマザーファンド | 千円 1,335,101 | % 99.6 |
| コール・ローン等、その他 | 5,146 | 0.4 |
| 投資信託財産総額 | 1,340,247 | 100.0 |

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年11月30日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|-------------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 1,340,247,184円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 5,146,087 |
| 日本株式ESGマザーファンド(評価額) | 1,335,101,097 |
| (B) 負 債 | 12,428,354 |
| 未 払 解 約 金 | 5,144,458 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 7,250,383 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 33,513 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 1,327,818,830 |
| 元 本 | 1,044,282,058 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 283,536,772 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 1,044,282,058口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 12,715円 |

※当期における期首元本額848,217,216円、期中追加設定元本額697,148,371円、期中一部解約元本額501,083,529円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

(自2020年12月1日 至2021年11月30日)

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △ 1,829円 |
| 受 取 利 息 | 141 |
| 支 払 利 息 | △ 1,970 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 91,378,959 |
| 売 買 益 | 126,832,879 |
| 売 買 損 | △ 35,453,920 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 12,864,592 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 78,512,538 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 61,197,864 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 143,826,370 |
| (配 当 等 相 当 額) | (110,210,095) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (33,616,275) |
| (G) 合 計 (D + E + F) | 283,536,772 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G) | 283,536,772 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 143,826,370 |
| (配 当 等 相 当 額) | (112,221,304) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (31,605,066) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 139,710,402 |

※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。

※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※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。

分配金の計算過程は以下の通りです。

| | 当 期 |
|---------------------------|-------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 17,968,487円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 60,544,051 |
| (c) 収益調整金 | 143,826,370 |
| (d) 分配準備積立金 | 61,197,864 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 283,536,772 |
| 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 2,715.14 |
| (f) 分配金 | 0 |
| 1 万 口 当 た り 分 配 金 | 0 |

■ 分配金のお知らせ

| 1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前) | 当 期 |
|-----------------------------|-----|
| | 0円 |

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

日本株式ESGマザーファンド

第4期（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

| | |
|------|---|
| 信託期間 | 無期限（設定日：2018年2月9日） |
| 運用方針 | <p>■日本の取引所に上場している株式を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。</p> <p>■銘柄選択にあたっては、各企業との対話や独自の調査に基づき、各企業のESG[※]への取組みに関する変化の可能性を評価します。その上で、計量モデルに基づき、幅広い銘柄に分散投資するポートフォリオを構築します。</p> <p>※環境、社会およびコーポレート・ガバナンスを指します。</p> |

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | （参考指数） TOPIX （東証株価指数、配当込み） | | 株式組入率 | 株式先物率 （買建－売建） | 純資産額 |
|--------------------|-------------|--------|----------------------------------|--------|--------|------------------|------------|
| | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | | |
| （設定日） 2018年2月9日 | 円 10,000 | % — | 2,570.45 | % — | % — | % — | 百万円 287 |
| 1期（2018年11月30日） | 10,059 | 0.6 | 2,475.92 | △ 3.7 | 94.0 | 5.4 | 1,841 |
| 2期（2019年12月2日） | 10,961 | 9.0 | 2,611.46 | 5.5 | 95.5 | 3.7 | 1,382 |
| 3期（2020年11月30日） | 11,717 | 6.9 | 2,738.72 | 4.9 | 97.4 | 2.4 | 7,996 |
| 4期（2021年11月30日） | 13,311 | 13.6 | 3,073.26 | 12.2 | 90.4 | 9.3 | 11,245 |

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | （参考指数） TOPIX （東証株価指数、配当込み） | | 株式組入率 | 株式先物率 （買建－売建） |
|---------------------|-------------|--------|----------------------------------|--------|-----------|------------------|
| | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | |
| （期首） 2020年11月30日 | 円 11,717 | % — | 2,738.72 | % — | % 97.4 | % 2.4 |
| 12月末 | 12,078 | 3.1 | 2,819.93 | 3.0 | 98.4 | 1.5 |
| 2021年1月末 | 12,079 | 3.1 | 2,826.50 | 3.2 | 98.7 | 0.9 |
| 2月末 | 11,991 | 2.3 | 2,914.58 | 6.4 | 92.4 | 7.0 |
| 3月末 | 12,807 | 9.3 | 3,080.87 | 12.5 | 91.5 | 8.3 |
| 4月末 | 12,461 | 6.3 | 2,993.46 | 9.3 | 91.2 | 8.3 |
| 5月末 | 12,581 | 7.4 | 3,034.76 | 10.8 | 90.8 | 9.0 |
| 6月末 | 12,742 | 8.7 | 3,070.81 | 12.1 | 93.8 | 6.0 |
| 7月末 | 12,666 | 8.1 | 3,003.91 | 9.7 | 93.6 | 6.1 |
| 8月末 | 13,112 | 11.9 | 3,099.08 | 13.2 | 94.2 | 5.5 |
| 9月末 | 13,658 | 16.6 | 3,234.08 | 18.1 | 92.8 | 6.8 |
| 10月末 | 13,539 | 15.6 | 3,188.28 | 16.4 | 90.0 | 9.7 |
| （期末） 2021年11月30日 | 13,311 | 13.6 | 3,073.26 | 12.2 | 90.4 | 9.3 |

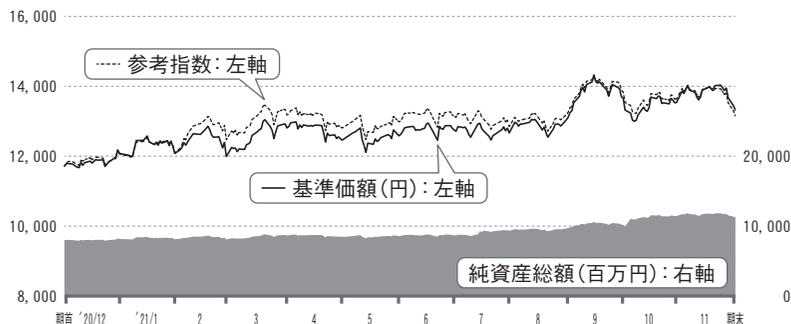
※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 11,717円 |
| 期末 | 13,311円 |
| 騰落率 | +13.6% |

※参考指数は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドの参考指数は、TOPIX（東証株価指数、配当込み）です。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

▶ 基準価額の主な変動要因（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

当ファンドは、日本の取引所に上場している株式を主要投資対象とし、主として、ESG投資[※]の拡大が期待される日本株式に投資を行いました。また、銘柄選択にあたっては、企業調査に精通したアナリストが企業のESGへの取組みを評価（ESG評価）し、企業価値向上が期待される銘柄を選定し、その上で、計量モデル等に基づいてポートフォリオを構築しました。

※ESG投資とは、投資判断の際に企業の環境（Environment）、社会（Social）、ガバナンス（Governance）への取組みを考慮する投資手法をいいます。

上昇要因

・トヨタ自動車、HOYA、ソニーグループなどの株価が上昇したこと

下落要因

・日本ペイントホールディングス、東京センチュリー、日本ユニシスなどの株価が下落したこと

▶ 投資環境について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

国内株式市場は上昇しました。

期初は米国の追加経済対策への期待と国内製造業の好業績から上昇しました。

2月から8月にかけては、変異ウイルス（デルタ型）の感染が拡大する一方、国内製造業の好業績発表により、もみ合う展開となりました。

9月になると、菅総理の辞任表明により、新政権の政策期待から国内株式市場は高値を更新しました。

その後、中国の不動産大手の信用不安で日本を含み世界的な株安が進行しました。しかし、債務が履行されたことや企業業績が好調な米国株が上昇したことで、国内株式市場も上昇に転じました。

期末には欧州を中心とした新型コロナウイルスの感染再拡大に加え、南アフリカでの新たな変異ウイルス（オミクロン型）の検出が嫌気され、下落しました。

▶ ポートフォリオについて（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

株式組入比率

期中は、99%～100%程度で推移しました（株式先物を含む）。期末時点では100%程度となっています。

個別銘柄

1月末および7月末に当社ESG評価の一斉見直しを行ったことに伴い、当ファンドは2月初旬および8月初旬にポートフォリオのリバランス（投資配分比率の調整）を行いました。

2月初旬のリバランスでは、新たにESG評価により企業価値向上が期待される銘柄として、三和ホールディングスや東京センチュリーなどを購入した一方、日本M&Aセンターホールディングスやビックカメラなどを売却しました。

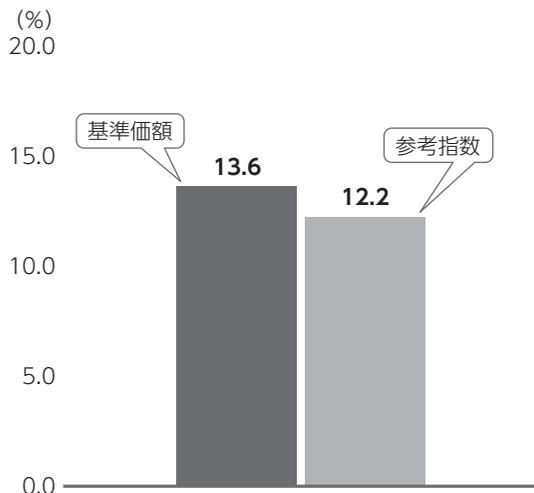
8月初旬のリバランスでは、同様に富士フィルムホールディングスや豊田自動織機などを購入した一方、三菱電機やSUBARUなどを売却しました。

ポートフォリオの特性

当社ESG評価により、企業価値向上が期待される銘柄を選定して、その投資パフォーマンスを効率良く獲得することが期待できるポートフォリオを構築した結果、企業の売上げや利益の成長性に特化したポートフォリオ特性となりました。

▶ ベンチマークとの差異について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

基準価額と参考指数の騰落率対比



当ファンドは運用の指標となるベンチマークはありませんが、参考指数としてTOPIX（東証株価指数、配当込み）を設けています。

左のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

2 今後の運用方針

国内株式市場は、岸田政権の下で景気配慮型の政策運営が続く中、世界景気と企業業績の持続的な拡大が支援材料となり、緩やかな上昇が続くと予想します。低下基調が続いていたバリュエーション（投資価値評価）に注目が集まることで、日本株の保有比率の少ない海外投資家の買い越す動きを想定します。

一方で、今後もESG投資の拡大が期待される日本の株式市場において、ESGは長期的な企業業績や株価に影響を及ぼし、ひいては投資家の長期的な投資パフォーマンスにも貢献すると考えています。企業調査に精通したアナリストによるESG評価により企業価値向上が期待される銘柄を選定して、その投資パフォーマンスを効率良く獲得することが期待できるポートフォリオを、計量モデルを活用して構築する方針です。

■ 1万口当たりの費用明細 (2020年12月1日から2021年11月30日まで)

| 項 目 | 金 額 | 比 率 | 項 目 の 概 要 |
|--|------------------|------------------------------|--|
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先物・オプション) | 3円 (2) (1) | 0.022% (0.016) (0.005) | 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：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (b) そ の 他 費 用 (そ の 他) | 0 (0) | 0.001 (0.001) | 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：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合 計 | 3 | 0.022 | |

期中の平均基準価額は12,834円です。

※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ています。
※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。
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2020年12月1日から2021年11月30日まで)

(1) 株 式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|-----|---------------------------|------------------------|----------------|-----------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国 内 | 上 場 | 千株 3,105.3 (269.24) | 千円 7,792,677 () | 千株 2,502.34 | 千円 6,384,523 |

※金額は受渡し代金。

※（ ）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。

※管理上の都合により、一部において属性が変わっている場合があります。

(2) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | 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 5,257 | 百万円 4,369 | 百万円 - | 百万円 - |

※金額は受渡し代金。

■ 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12月1日から2021年11月30日まで)

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|--------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 14,177,200千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 8,577,228千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a) / (b) | 1.65 |

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

※外貨建資産については、(a)は各月末(ただし、決算日の属する月については決算日)の日本の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計、(b)は各月末の同仲値で換算した邦貨金額合計の平均です。

■ 利害関係人との取引状況等 (2020年12月1日から2021年11月30日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | |
|--------|-----------|--------------------|--------|-----------|--------------------|--------|
| | | | B A | | | D C |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 株式 | 7,792 | 6,627 | 85.0 | 6,384 | 6,345 | 99.4 |
| 株式先物取引 | 5,257 | 5,257 | 100.0 | 4,369 | 4,369 | 100.0 |

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 期 末 保 有 額 |
|-----|-------|-------|-----------|
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式 | 174 | 38 | 246 |

(3) 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 |
|------------------|---------|
| (a) 売買委託手数料総額 | 2,005千円 |
| (b) うち利害関係人への支払額 | 1,100千円 |
| (c) (b) / (a) | 54.9% |

利害関係人とは、投資信託およ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、株式会社三井住友フィナンシャルグループです。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細 (2021年11月30日現在)

(1) 国内株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | 期末 | |
|------------------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 鉱業 (-) | | | |
| 石油資源開発 | 5.5 | - | - |
| 建設業 (0.4%) | | | |
| コムシスホールディングス | 18.2 | 1.8 | 4,456 |
| 大東建託 | 1.9 | 2.4 | 29,496 |
| エクシオグループ | 31 | 3.7 | 8,902 |
| 九電工 | 4.1 | - | - |
| 食料品 (0.8%) | | | |
| 日清製粉グループ本社 | 29.4 | 20.3 | 33,210 |
| ヤクルト本社 | 12.5 | - | - |
| 不二製油グループ本社 | - | 21.4 | 47,850 |
| ニチレイ | 19.9 | - | - |
| 繊維製品 (1.8%) | | | |
| 東レ | 223 | 276.4 | 182,645 |
| 化学 (8.2%) | | | |
| 旭化成 | 147.2 | 177.8 | 190,512 |
| デンカ | 3 | - | - |
| 積水化学工業 | 88 | 118.6 | 218,817 |
| アイカ工業 | 18.8 | 21.6 | 71,604 |
| 宇部興産 | 0.9 | - | - |
| 日本ペイントホールディングス | 12.6 | 48.5 | 57,860 |
| 富士フイルムホールディングス | - | 21.4 | 191,123 |
| ファンケル | - | 12.6 | 43,155 |
| JCU | - | 13.5 | 64,800 |
| 日東電工 | 15.5 | - | - |
| 医薬品 (4.3%) | | | |
| 塩野義製薬 | 36.7 | 36.7 | 290,774 |
| 中外製薬 | 27.7 | 39 | 143,520 |
| JCRファーマ | 16.4 | - | - |
| ガラス・土石製品 (1.2%) | | | |
| 東海カーボン | 26 | 13.6 | 16,007 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 期末 | |
|---------------------|---------|------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| ニチアス | 60.1 | 39.4 | 101,100 |
| 鉄鋼 (0.8%) | | | |
| 日本製鉄 | 74.1 | - | - |
| 丸一鋼管 | 16.9 | 2.5 | 6,067 |
| 大同特殊鋼 | 1.2 | - | - |
| 山陽特殊製鋼 | - | 40.3 | 73,265 |
| 非鉄金属 (1.3%) | | | |
| 三井金属鉱業 | 3.7 | - | - |
| 古河電気工業 | 17.2 | - | - |
| 住友電気工業 | 106.2 | 87.2 | 129,884 |
| 金属製品 (1.0%) | | | |
| 三和ホールディングス | - | 80.5 | 97,646 |
| 機械 (6.9%) | | | |
| 三浦工業 | 26.2 | 5.2 | 20,722 |
| アマダ | 13.4 | 63 | 66,969 |
| ディスコ | 4.3 | 5.9 | 192,340 |
| ローツェ | - | 4.2 | 50,190 |
| ダイキン工業 | 6.4 | 12.2 | 282,430 |
| 栗田工業 | 18.7 | - | - |
| JUKI | - | 91.6 | 84,180 |
| T P R | 33.3 | - | - |
| 電気機器 (20.6%) | | | |
| イビデン | - | 6.1 | 43,127 |
| 三菱電機 | 15.5 | - | - |
| 富士電機 | - | 15.6 | 92,664 |
| 安川電機 | 31.6 | 29.7 | 151,173 |
| 日本電産 | 7.3 | - | - |
| オムロン | - | 18.6 | 203,949 |
| 富士通ゼネラル | 4.9 | - | - |
| ソニーグループ | 13.4 | 44.3 | 612,447 |
| TDK | 9.9 | 50 | 225,000 |
| アルプスアルパイン | 20.9 | 7.6 | 7,774 |

日本株式ESGマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 期末 | |
|----------------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| キーエンス | 8 | 3.8 | 267,254 |
| シスメックス | — | 9.2 | 130,272 |
| レーザーテック | — | 3.9 | 116,005 |
| スタンレー電気 | 19.6 | — | — |
| 太陽誘電 | 24.5 | — | — |
| 村田製作所 | 13.3 | 26.3 | 220,394 |
| 小糸製作所 | — | 3.4 | 22,202 |
| 輸送用機器 (9.2%) | | | |
| 豊田自動織機 | — | 13.8 | 128,616 |
| いすゞ自動車 | 47.6 | 98.3 | 150,595 |
| トヨタ自動車 | 50.9 | 246.3 | 492,846 |
| 日野自動車 | — | 55.4 | 52,297 |
| KYB | — | 6.3 | 18,295 |
| SUBARU | 1.4 | — | — |
| 豊田合成 | — | 41.4 | 93,936 |
| 精密機器 (5.1%) | | | |
| 島津製作所 | — | 27.7 | 133,237 |
| HOYA | 14.9 | 21.5 | 387,430 |
| 朝日インテック | 27.2 | — | — |
| その他製品 (3.4%) | | | |
| バンダイナムコホールディングス | 25.6 | 30.6 | 270,412 |
| 凸版印刷 | 36.2 | 44.8 | 77,190 |
| ビジョン | 23.1 | — | — |
| 電気・ガス業 (0.9%) | | | |
| 中部電力 | 59.6 | 30 | 34,380 |
| 関西電力 | 42.5 | 58.9 | 60,490 |
| 陸運業 (1.9%) | | | |
| 東武鉄道 | 14.5 | — | — |
| 小田急電鉄 | — | 9 | 19,683 |
| 京王電鉄 | 4.4 | 2.8 | 14,308 |
| 阪急阪神ホールディングス | 18.6 | 17.4 | 58,551 |
| 日本通運 | 11.6 | 9.8 | 63,406 |
| セイノーホールディングス | 15.4 | — | — |
| 日立物流 | 13.3 | — | — |
| SGホールディングス | 37.8 | 15.3 | 38,403 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 期末 | |
|-----------------------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| 情報・通信業 (8.4%) | | | |
| NECネットエスアイ | — | 24.3 | 43,958 |
| 野村総合研究所 | 41.8 | — | — |
| オービック | — | 4.5 | 94,455 |
| トレンドマイクロ | 0.1 | 3.9 | 25,545 |
| 大塚商会 | 12.5 | 19.4 | 100,686 |
| 電通国際情報サービス | — | 24.1 | 88,688 |
| ネットワンシステムズ | — | 20.2 | 68,882 |
| 日本ユニシス | 26.3 | — | — |
| 日本電信電話 | 70.9 | 93.4 | 291,875 |
| ソフトバンク | — | 86.4 | 135,000 |
| GMOインターネット | — | 0.9 | 2,572 |
| 卸売業 (2.2%) | | | |
| 伊藤忠商事 | 54.2 | 63.9 | 208,314 |
| 豊田通商 | 8.9 | — | — |
| 兼松 | 23.2 | 7.2 | 8,863 |
| 阪和興業 | 31.2 | — | — |
| 岩谷産業 | — | 0.3 | 1,719 |
| サンゲツ | — | 2.2 | 3,341 |
| 小売業 (2.9%) | | | |
| ビックカメラ | 47.7 | — | — |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 38.7 | 107.6 | 83,497 |
| ウエルシアホールディングス | — | 22.5 | 90,562 |
| すかいらーくホールディングス | 22.9 | — | — |
| コスモス薬品 | 0.1 | — | — |
| ツルハホールディングス | 3.2 | — | — |
| パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス | — | 4.6 | 8,905 |
| ユナイテッドアローズ | 2.5 | 10.2 | 19,410 |
| スギホールディングス | 0.1 | — | — |
| イズミ | 7.1 | — | — |
| ケースホールディングス | 40.6 | 21.3 | 24,473 |
| ニトリホールディングス | 2.4 | 3.5 | 63,105 |
| 銀行業 (3.9%) | | | |
| めぶきフィナンシャルグループ | 11.5 | 126.7 | 28,380 |
| 新生銀行 | — | 3.3 | 6,322 |

日本株式ESGマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 期末 | |
|--------------------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| あおぞら銀行 | 10.6 | 1.9 | 4,696 |
| リソナホールディングス | 29 | — | — |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 28.1 | 66.6 | 246,619 |
| 千葉銀行 | 24.9 | — | — |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 11.1 | 11.4 | 20,953 |
| 静岡銀行 | 66.4 | 108.7 | 86,960 |
| 証券、商品先物取引業 (1.3%) | | | |
| ＳＢＩホールディングス | — | 44.3 | 129,533 |
| 保険業 (2.1%) | | | |
| ＳＯＭＰＯホールディングス | 18.2 | — | — |
| 東京海上ホールディングス | 40.2 | 37.3 | 212,908 |
| その他金融業 (5.7%) | | | |
| 芙蓉総合リース | — | 12.4 | 89,032 |
| みずほリース | — | 18.8 | 55,723 |
| 東京センチュリー | — | 35.1 | 190,242 |
| リコーリース | — | 31.6 | 114,234 |
| 日本取引所グループ | 29.8 | 53 | 130,327 |
| 不動産業 (-) | | | |
| 東京建物 | 6.8 | — | — |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 期末 | | |
|---------------------|---------|---------|---------|------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | |
| サービス業 (5.9%) | | | | |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 11.7 | — | — | |
| パーソルホールディングス | 38.8 | 59.7 | 195,816 | |
| 総合警備保障 | 17.8 | 12.2 | 59,048 | |
| リゾートトラスト | 23.4 | 31.3 | 58,218 | |
| ユー・エス・エス | 4.3 | — | — | |
| サイバーエージェント | 6.4 | 60.7 | 127,045 | |
| リクルートホールディングス | 31.5 | — | — | |
| メイテック | 3 | 3.8 | 25,308 | |
| 船井総研ホールディングス | — | 0.2 | 511 | |
| ダイセキ | 21.2 | 26.3 | 135,708 | |
| 合計 | 株数・金額 | 2,602.6 | 3,474.8 | 10,167,314 |
| | 銘柄数<比率> | 100 | 95 | <90.4%> |

※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。
 ※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
 ※管理上の都合により、一部において属性が変わっている場合があります。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 | 別 | 期 | 末 |
|----|-------|--------------|----------|
| | | 買建額 | 売建額 |
| 国内 | TOPIX | 百万円 1,042 | 百万円 — |

■ 投資信託財産の構成

(2021年11月30日現在)

| 項目 | 期 | 末 |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| 株式 | 千円 10,167,314 | % 90.0 |
| コール・ローン等、その他 | 1,129,088 | 10.0 |
| 投資信託財産総額 | 11,296,403 | 100.0 |

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年11月30日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 11,296,403,150円 |
| コーポレートローン等 | 998,825,160 |
| 株式(評価額) | 10,167,314,820 |
| 未収配当金 | 66,098,170 |
| 差入委託証拠金 | 64,165,000 |
| (B) 負 債 | 50,480,708 |
| 未払金 | 50,475,500 |
| その他未払費用 | 5,208 |
| (C) 純資産総額(A - B) | 11,245,922,442 |
| 元 本 | 8,448,619,173 |
| 次期繰越損益金 | 2,797,303,269 |
| (D) 受益権総口数 | 8,448,619,173口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,311円 |

※当期における期首元本額6,824,672,847円、期中追加設定元本額1,915,257,089円、期中一部解約元本額291,310,763円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・日本株式ESGファンド 1,003,005,858円
SMDAM・年金日本株式ESGファンド<適格機関投資家限定> 7,445,613,315円

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

(自2020年12月1日 至2021年11月30日)

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------------|---------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 171,083,605円 |
| 受 取 配 当 金 | 171,532,822 |
| 受 取 利 息 | 1,023 |
| そ の 他 収 益 金 | 881 |
| 支 払 利 息 | △ 451,121 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 972,058,885 |
| 売 買 益 | 1,552,140,959 |
| 売 買 損 | △ 580,082,074 |
| (C) 先 物 取 引 等 損 益 | △ 38,716,200 |
| 取 引 益 | 67,070,000 |
| 取 引 損 | △ 105,786,200 |
| (D) そ の 他 費 用 等 | △ 62,619 |
| (E) 当期損益金(A + B + C + D) | 1,104,363,671 |
| (F) 前期繰越損益金 | 1,172,061,910 |
| (G) 解約差損益金 | △ 77,228,697 |
| (H) 追加信託差損益金 | 598,106,385 |
| (I) 合計(E + F + G + H) | 2,797,303,269 |
| 次期繰越損益金(I) | 2,797,303,269 |

※有価証券売買損益および先物取引等損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※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。

※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。

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。