

第19期

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	2005年8月12日から、原則として無期限です。	
運用方針	日本ESGマザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券への投資を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式に投資し、投資信託財産の成長を図ることを目標に積極的な運用を行います。 マザーファンドの運用指図に関する権限を「富国生命投資顧問株式会社」に委託します。	
主要投資対象	当ファンド	マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
	日本ESGマザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資制限	当ファンド	マザーファンドの受益証券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。
	日本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は行いません。
分配方針	毎年8月11日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、原則として、以下の方針に基づき、収益分配を行います。 分配対象収益の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みません。）等の全額とします。繰越分を含めた経費控除後の配当等収益には、マザーファンドの配当等収益のうち、投資信託財産に帰属すべき配当等収益を含むものとします。 分配金額は、委託会社が分配可能額、基準価額水準等を勘案のうえ決定します。 分配可能額が少額の場合や基準価額水準によっては、収益分配を行わないことがあります。	

運用報告書（全体版）

日本ESGオープン 愛称 絆（きずな）

【2024年8月13日決算】

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。
皆様の「日本ESGオープン（愛称 絆（きずな））」は、2024年8月13日に第19期決算を迎えたので、期中の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。
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。

SBI 岡三アセットマネジメント

〒104-0031 東京都中央区京橋2-2-1

お問い合わせは弊社投信営業部へ

フリーダイヤル ☎ 0120-048-214（営業日の9:00～17:00）

お取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

【ホームページ】

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

※アクセスにかかる通信料はお客様のご負担となります。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			東証株価指数 (TOPIX)		東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率			
15期(2020年8月11日)	円	円	%	ポイント	%	ポイント	%	%	%	百万円
16期(2021年8月11日)	10,281	200	7.9	1,585.96	6.7	—	—	96.6	—	1,876
17期(2022年8月12日)	11,366	1,300	23.2	1,954.08	23.2	—	—	95.9	—	2,309
18期(2023年8月14日)	10,714	700	0.4	1,973.18	1.0	—	—	96.5	—	2,236
19期(2024年8月13日)	11,394	1,200	17.5	2,280.89	15.6	—	—	91.6	—	2,317
	11,458	1,400	12.8	—	—	4,343.30	—	89.9	—	2,314

(注) 基準価額および分配金(税引前)は1万円当たり、基準価額の騰落率は分配金(税引前)込み。

(注) 2024年5月14日に東証株価指数(TOPIX)から東証株価指数(TOPIX)(配当込み)にベンチマークを変更いたしました。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、株式組入比率および株式先物比率は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率=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		東証株価指数 (TOPIX)		東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
(期首) 2023年8月14日	円	%	ポイント	%	ポイント	%	%	%
8月末	11,394	—	2,280.89	—	—	—	91.6	—
9月末	11,672	2.4	2,332.00	2.2	—	—	95.6	—
10月末	11,605	1.9	2,323.39	1.9	—	—	95.4	—
11月末	11,231	△ 1.4	2,253.72	△ 1.2	—	—	94.7	—
12月末	11,810	3.7	2,374.93	4.1	—	—	95.8	—
2024年1月末	11,962	5.0	2,366.39	3.7	—	—	96.0	—
2月末	12,716	11.6	2,551.10	11.8	—	—	96.8	—
3月末	13,235	16.2	2,675.73	17.3	—	—	97.3	—
4月末	13,782	21.0	2,768.62	21.4	—	—	96.6	—
5月末	13,620	19.5	2,743.17	20.3	—	—	96.7	—
6月末	13,789	21.0	—	—	4,710.15	—	97.0	—
7月末	14,193	24.6	—	—	4,778.56	—	96.7	—
(期末) 2024年8月13日	14,122	23.9	—	—	4,752.72	—	97.0	—
	12,858	12.8	—	—	4,343.30	—	89.9	—

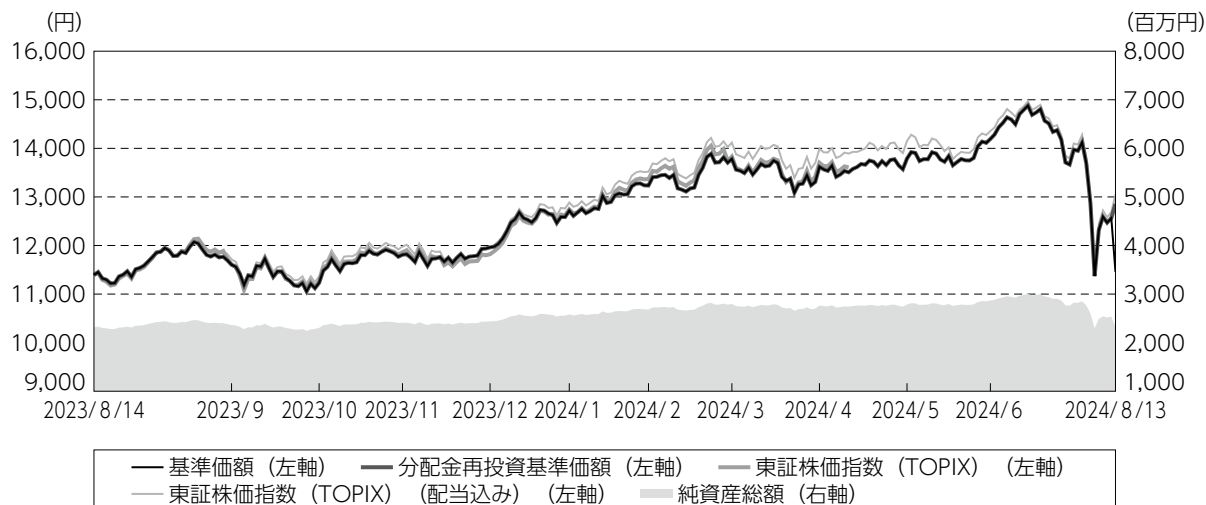
(注) 期末基準価額は1万円当たり分配金(税引前)込み、騰落率は期首比。

TOPIX (以下、「東証株価指数 (TOPIX)」といいます。）・配当込みTOPIX (以下、「東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)」といいます。) の指数値及び東証株価指数 (TOPIX) ・東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) 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 」といいます。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数 (TOPIX) ・東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (TOPIX) ・東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) 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、東証株価指数 (TOPIX) ・東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) 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。

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2023年8月15日～2024年8月13日)



期首：11,394円

期末：11,458円（既払分配金（税引前）：1,400円）

騰落率：12.8%（分配金再投資ベース）

- (注) 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) 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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、東証株価指数（TOPIX）および東証株価指数（TOPIX）（配当込み）です。
- (注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首（2023年8月14日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 2024年5月14日に東証株価指数（TOPIX）から東証株価指数（TOPIX）（配当込み）にベンチマークを変更いたしました。そのため、東証株価指数（TOPIX）の推移は2024年5月13日までを記載、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の推移は見やすさの観点から期首（2023年8月14日）より記載しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

<当ファンドに投資される際にご留意頂きたい事項>

- 当ファンドは、ESGファンドに該当いたします。
- 当ファンドは環境や社会的な課題に対するインパクト創出を目的とした具体的な目標値や目安を設定していません。

< SBI 岡三アセットマネジメントの考える責任投資について >

●エンゲージメント活動

ESGへの取り組みの面を含めて、投資先企業の企業価値の向上を目的として、投資先企業と建設的な対話を行います。

●適切な議決権行使

ESGの観点を考慮したうえで、投資家利益の最大化に資するよう、投資先企業に対する議決権を行使します。

●ESG投資

ESG評価を投資対象の選定に採り入れるESGインテグレーションや、外部運用機関のESG投資状況を確認するESGモニタリングなど、ファンド毎の特性に応じた実効性のあるESG投資を推進します。

< 運用委託先である富国生命投資顧問株式会社のスチュワードシップ方針（抜粋） >

「当社は、資産運用という業務の公共性、社会的責任の重みを十分に認識し、役職員が職務の専門性を念頭に置き、能力の開発や研鑽に努め、業務に関する知識および技能の蓄積とともに、教養を高め、人格の向上を図るよう努めています。このような取組みの下、投資先企業やその事業環境等に関する深い理解のほか、サステナビリティの考慮に基づき、ESG（環境、社会、ガバナンス）要素を含む建設的な「目的を持った対話」（エンゲージメント）や議決権行使等を行うことが、当該企業の企業価値向上やその持続的成長を促し、結果として、お客さまの中長期的な投資リターンの拡大が図られると考えます。」

※スチュワードシップ責任に関する基本方針の全文は同社のホームページで確認できます。

<https://www.fukoku-cm.co.jp/company-profile/stewardship.html>

○基準価額の主な変動要因

当ファンドの主要投資対象である「日本ESGマザーファンド（以下、マザーファンドといいます。）」における主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

- ・業種配分では、化学、電気機器、銀行業などが基準価額にプラスに寄与しました。
- ・個別銘柄では、日立製作所、リクルートホールディングス、三菱UFJフィナンシャル・グループなどが基準価額にプラスに寄与しました。

（主なマイナス要因）

- ・業種配分では、鉄鋼、陸運業、機械などが基準価額にマイナスに影響しました。
- ・個別銘柄では、浜松ホトニクス、ダイキン工業、ロームなどが基準価額にマイナスに影響しました。

また、当ファンドにおいては信託報酬などのコストが基準価額にマイナスに影響しました。

投資環境

(2023年8月15日～2024年8月13日)

国内株式市場は、米国の長期金利上昇などを受けて下落する場面もありましたが、米国の長期金利が低下に転じたことや、パウエル米連邦準備制度理事会（FRB）議長のジャクソンホール会議での講演が無難に終わったことなどが好感され、2023年9月中旬にかけては上昇しました。10月に入り、月末の日銀金融政策決定会合に向けて政策修正観測が強まり、国内の長期金利が上昇したことなどが国内株式市場の重しとなりました。11月以降は、日本企業の堅調な業績が確認され、日経平均株価は一時年初来高値を更新する場面もありましたが、再び日銀の政策修正観測が強まったことで、上値の重い展開となりました。年が明けてからは、元日に能登半島地震が発生しましたが、日銀が2024年1月下旬の金融政策決定会合で、マイナス金利の解除を見送るとの見方が強まり、為替市場で円安米ドル高が進行したことを好感し、日経平均株価は連日でバブル崩壊後の高値を更新する動きとなりました。その後も、人工知能（AI）関連銘柄や半導体関連銘柄がけん引して米国株筆頭に相場が上昇したほか、好調な企業業績や資本コストを意識した経営への変化を評価する海外投資家からの資金流入も株価を押し上げる要因となり、3月下旬にかけて上昇基調を辿りました。4月以降は、米国の堅調な経済指標を背景に早期利下げ観測が後退したことに加え、中東情勢の緊迫化も投資家心理を冷やす要因となりました。6月中旬以降は、円安米ドル高の進行を背景に輸出関連銘柄が買い戻されたほか、米国ハイテク株の上昇を背景に半導体関連銘柄が買われたことなどから、堅調に推移しました。7月に入ってから、上場企業による自社株買いや海外投資家の日本株再評価による資金流入など複数の上昇要因が重なったことを受けて、国内株式市場は上値を追う展開となり、日経平均株価は史上最高値を更新しました。7月末には日銀の利上げや半導体関連株の急反発で一時的に上昇する場面もありましたが、8月に入ると再び下落に転じ、質への逃避から5日にかけて急落しました。その後は、日銀副総裁が早期の追加利上げを否定したことなどから急反発しました。

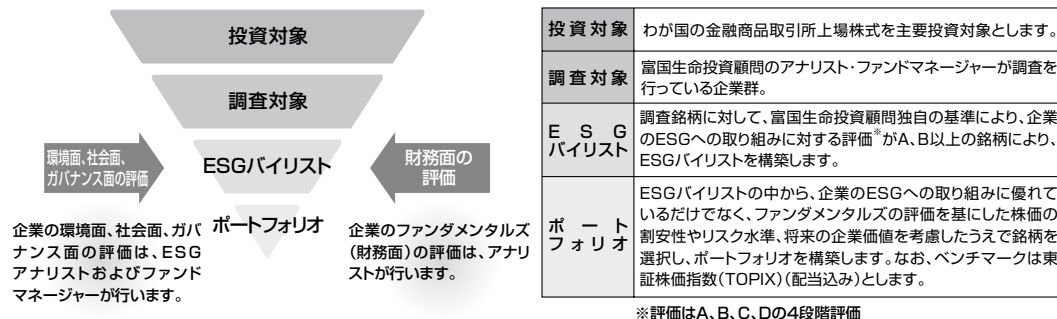
当ファンドのポートフォリオ

(2023年8月15日～2024年8月13日)

当ファンドの運用はマザーファンドを通じて行いました。マザーファンドの運用につきましては、個別企業に対する調査分析を重視し、環境面、社会面、ガバナンス面での評価が高く、かつ財務面で投資価値が高いと判断される銘柄でポートフォリオを構築しました。

ポートフォリオ構築プロセス

- 個別企業に対する調査分析を重視し、環境面、社会面、ガバナンス面での評価が高く、かつ財務面で投資価値が高いと判断される銘柄でポートフォリオを構築します。



上記ポートフォリオ構築プロセスにより、ESG総合評価がAおよびBの銘柄のみを組み入れることとなるため、ESGを主要な要素として選定する投資対象への投資額の比率およびESGのポートフォリオ全体の評価指標の達成状況についての目標や目安は設定しておりません。

【ESG評価の定義等】

富国生命投資顧問ではESG面の評価を行う目的で、アナリスト及びファンドマネージャーが企業のESGに関する取組みについて情報を収集します。具体的には、個別企業に対する直接取材を通じて「ガバナンス」、「社会」、「環境」の各項目に関してそれぞれ企業の取組み度合でスコア（0～3点）を算出し、加重平均したもので総合評価を決定します。評価基準は以下の通りです。なお、「A」「B」は投資適格、「C」「D」は投資不適格と判断します。

ESG総合評価	点数
A	2.3点以上～3点
B	1.8点以上～2.3点未満
C	0点～1.8点未満
D	取材拒否により算出不能

※ポートフォリオ構築プロセスは変更になる場合があります。

< ESG総合評価別投資比率 >

ESG総合評価	比率
A	88.9%
B	10.8%
C	—
D	—

※マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

※比率は小数点第2位を四捨五入しています。

※富国生命投資顧問株式会社のデータを基にSBI岡三アセットマネジメントが作成しております。

個別銘柄では、深井頭取のリーダーシップのもとに、顧客ニーズに対応できる地域密着型の地銀へと変化している群馬銀行、民営化後入社の社長による、過去にないユニークな取組みに変化が感じられる東日本旅客鉄道、パートナーの持つさまざまな技術力と社会への実装力を繋げる共創型化学会社を標榜し、社長のリーダーシップにより組織を活性化させているレゾナック・ホールディングスなどを新規に組み入れました。

一方、株価が上昇し、相対的に期待収益率が低くなった西日本旅客鉄道、豊田自動織機などを売却し、ディスクなどのウェイトを引き下げました。

主要組入銘柄の概要

三菱UFJフィナンシャル・グループ

「世界が進むチカラになる」というパーパスを体現するため、「挑戦と変革」を支える人材育成に注力し、経営者が社内風土の改革を徹底している点を評価。

ソニーグループ

クリエイティビティとテクノロジーの力で、世界を感動で満たすことを目指し、過去の実績に固執しない自由闊達なアイディアを受け入れる社風、ガバナンスの透明性などを評価。

日立製作所

組織・地域・世代を超えた連携力や多様な人材が活躍できるインクルーシブな組織づくりなどにより、社会課題の解決を目指している点や透明性の高いガバナンス体制を評価。

信越化学工業

「優先順位を決め、余計な事をせず、価値を生み出すことに集中」する社風が根付いており、従業員のモチベーションが高い点や、汎用化学品（塩ビ）のリサイクルなど資源循環にも注力している点を評価。

当ファンドのベンチマークとの差異

（2023年8月15日～2024年8月13日）

株式指数が上昇するなか、個別銘柄では、組織・地域・世代を超えた連携力や多様な人財が活躍できるインクルーシブな組織づくりなどにより社会課題の解決を目指している日立製作所、情報の非対称性を軸に様々な新ビジネスを創出する力や中長期的な成長戦略と融合したサステナビリティへコミットメントしているリクルートホールディングスなどの株価が上昇し、プラスに寄与しました。

一方、冷媒と空調機の研究開発により、環境対応を進めるダイキン工業、世界最先端の光技術をもち、開発意欲の高い従業員のモチベーションにこたえる環境を構築している浜松ホトニクスなどは、海外での在庫増加などから株価が下落し、マイナスに影響しました。

なお、当ファンドのベンチマークは、2024年5月13日までは東証株価指数（TOPIX）でしたが、2024年5月14日以降は、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に変更いたしました。このため、当期中にベンチマークが変更となったことからファンドとの比較ができないため、「基準価額とベンチマークの対比（騰落率）」の掲載は行っておりません。

分配金

（2023年8月15日～2024年8月13日）

当ファンドは、毎年8月11日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象収益とします。分配金額は、分配可能額、基準価額水準等を勘案のうえ決定します。当期の分配につきましては、1万口当たり1,400円（税引前）とさせていただきます。なお、収益分配に充てなかった留保益につきましては、運用の基本方針と同一の運用を行ってまいります。

（単位：円、1万口当たり・税引前）

項 目	第19期
	2023年8月15日～ 2024年8月13日
当期分配金	1,400
(対基準価額比率)	10.888%
当期の収益	1,400
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,624

（注）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）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。

今後の運用方針

当ファンドはマザーファンドの運用指図に関する権限を「富国生命投資顧問株式会社」に委託しております。

地球環境問題が深刻化し、感染症の拡大を背景に従業員の健康管理や働き方改革などの重要性が高まるなか、持続可能性を高めるための投資がグローバルに拡大しています。日本においてもコーポレートガバナンス・コードやスチュワードシップ・コードの改訂が続き、企業と投資家が各々の立場で取組みを強化しています。

当ファンドの運用はマザーファンドを通じて行ってまいります。マザーファンドの運用につきましては、直接取材により企業のESGに関する取組み、および、財務面の評価を行うことにより、ベンチマークの東証株価指数（TOPIX）（配当込み）を中長期にわたり上回る収益獲得を目指します。具体的には、社会の課題を解決するとともに、これによるビジネスチャンスを得ることで、中長期的な企業価値向上に繋がることを期待される銘柄で、株価が割安な銘柄に投資します。保有銘柄に不祥事が発生した場合は、再調査の上、売却を検討するほか、建設的な「目的を持った対話」を通じて、投資先企業の企業価値向上を促すことにより、中長期的な投資リターンの向上を図ります。

※文中の投資行動は、個別銘柄の売買等いかなる投資行動も推奨するものではありません。

○1万口当たりの費用明細

(2023年8月15日～2024年8月13日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社)	197 (87) (98) (11)	1.536 (0.680) (0.768) (0.088)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 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
(b) 売買委託手数料 (株 式)	10 (10)	0.078 (0.078)	(b) 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
(c) その他費用 (監査費用) (その他)	1 (1) (0)	0.011 (0.011) (0.000)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託支払手数料
合 計	208	1.625	
期中の平均基準価額は、12,811円です。			

(注) 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。

(注) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

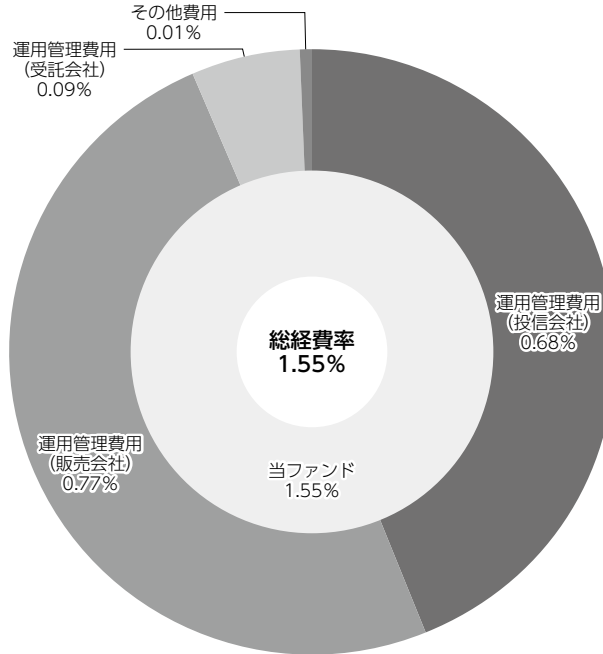
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

○総経費率

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）は1.55%です。



(注) 当ファンドの費用は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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 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。

○売買及び取引の状況

(2023年8月15日～2024年8月13日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日本ESGマザーファンド	千口 44,553	千円 110,000	千口 183,442	千円 504,000

(注) 単位未満は切捨て。

○株式売買比率

(2023年8月15日～2024年8月13日)

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
	日本ESGマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	3,736,045千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	5,865,245千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.63

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2023年8月15日～2024年8月13日)

<日本ESGオープン（愛称 絆（きずな））>

該当事項はございません。

<日本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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株 式	百万円 1,452	百万円 482	% 33.2	百万円 2,283	百万円 290	% 12.7

平均保有割合42.5%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額(A)	2,035千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額(B)	294千円
(B)／(A)	14.5%

(注) 売買委託手数料総額は、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あり、当ファンドに係る利害関係人とは株式会社SBI証券です。

○組入資産の明細

(2024年8月13日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期 首(前期末)	当 期		末
	口 数	口 数	評 価	額
日 本 E S G マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 876,033	千口 737,144		千円 2,087,962

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年8月13日現在)

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
日 本 E S G マ ザ ー フ ァ ン ド	千円 2,087,962		% 79.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	530,656		20.3
投 資 信 託 財 産 総 額	2,618,618		100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年8月13日現在）

項目	当 期 末
(A) 資産	2,618,618,877
コール・ローン等	530,653,742
日本ESGマザーファンド(評価額)	2,087,962,357
未収利息	2,778
(B) 負債	303,994,768
未払収益分配金	282,814,677
未払解約金	114
未払信託報酬	21,029,824
その他未払費用	150,153
(C) 純資産総額(A-B)	2,314,624,109
元本	2,020,104,839
次期繰越損益金	294,519,270
(D) 受益権総口数	2,020,104,839口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,458円

- (注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1,1458円です。
(注) 当ファンドの期首元本額は2,033,603,536円、期中追加設定元本額は63,954,881円、期中一部解約元本額は77,453,578円です。

○損益の状況（2023年8月15日～2024年8月13日）

項目	当 期
(A) 配当等収益	4,777
受取利息	19,064
支払利息	△ 14,287
(B) 有価証券売買損益	332,264,003
売買益	339,342,858
売買損	△ 7,078,855
(C) 信託報酬等	△ 40,006,381
(D) 当期損益金(A+B+C)	292,262,399
(E) 前期繰越損益金	515,158,248
(F) 追加信託差損益金	△230,086,700
(配当等相当額)	(207,441,220)
(売買損益相当額)	(△437,527,920)
(G) 計(D+E+F)	577,333,947
(H) 収益分配金	△282,814,677
次期繰越損益金(G+H)	294,519,270
追加信託差損益金	△230,086,700
(配当等相当額)	(207,594,637)
(売買損益相当額)	(△437,681,337)
分配準備積立金	524,605,970

- (注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注) 当ファンドが投資対象としている投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託する場合における当該委託に要する費用は8,853,776円です。
(注) 収益分配金

決算期	第19期
(a) 配当等収益(費用控除後)	46,309,216円
(b) 有価証券等損益額(費用控除後、繰越欠損金補填後)	245,953,183円
(c) 信託約款に規定する収益調整金	207,594,637円
(d) 信託約款に規定する分配準備積立金	515,158,248円
分配対象収益(a+b+c+d)	1,015,015,284円
分配対象収益(1万口当たり)	5,024円
分配金額	282,814,677円
分配金額(1万口当たり)	1,400円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税引前)	1,400円
支払開始日	2024年8月19日(月)までの間に支払いを開始します。
お支払場所	取得申込みを取扱った販売会社の本支店

＜お知らせ＞

- 取得申込の受付の中止および取消し、ならびに一部解約の実行の請求の受付の中止および取消しの記載を整備するため、投資信託約款の変更を行いました。(実施日:2023年11月14日)
- ベンチマークとする指数を、より運用の実態に即している「配当込み指数」に変更することで運用内容の説明力の向上をはかり、投資者への適正な情報開示を行うことを目的として投資信託約款の変更を行いました。(実施日:2024年5月14日)

用語解説

○資産、負債、元本及び基準価額の状況は、期末における資産、負債、元本及び基準価額の計算過程を表しています。主な項目の説明は次の通りです。

項目	説明
資産	ファンドが保有する財産の合計です。
コール・ローン等	金融機関向けの安全性の高い短期貸付運用などの残高です。
各種有価証券等(評価額)	組入れた株式・債券・ファンドなどの評価金額です。
未収入金	入金が予定されている有価証券の売却代金などです。
未取配当金	入金が予定されている株式の配当金等です。
未取利息	入金が予定されているコール・ローン等の利息や債券の利息の合計です。
負債	支払いが予定されている金額の合計です。
未払収益分配金	期末時点で支払いが予定されている収益分配金です。
未払解約金	支払いが予定されている解約金です。
未払信託報酬	支払いが予定されている信託報酬の額です。
その他未払費用	支払いが予定されている監査費用、その他の費用です。
純資産総額(資産－負債)	ファンドが保有する財産の合計から支払いが予定されている金額の合計を差し引いたものです。
元本	ファンド全体の元本残高です。
次期繰越損益金	純資産総額と元本の差額（翌期に繰り越す損益金の合計額）です。
受益権総口数	受益者が保有する受益権口数の合計です。
1(万)口当たり基準価額	1(万)口当たりのファンドの時価です。

用語解説

○損益の状況は、期中にファンドがどのような収益や損失を計上したかを表しています。主な項目の説明は次の通りです。

項目	説明
配当等収益	ファンドが受取った配当金・利息等の合計です。
受取配当金	保有する株式等の配当金等です。
受取利息	債券、コール・ローン等の利息等です。
有価証券売買損益	有価証券の売買損益と期末の評価損益の合計額です。
売買益	売買益と期末評価益の合計です。
売買損	売買損と期末評価損の合計です。
信託報酬等	信託報酬のほか保管費用、監査費用、その他の費用と、それらに掛かる消費税等相当額です。
当期損益金	当期における収支合計です。
前期繰越損益金	前期分の分配準備積立金と繰越損益金の合計額から当期中の解約に対する持分を控除した金額です。
追加信託差損益金	受益者がファンドに払い込んだ金額と元本との差額です。
(配当等相当額)	配当等に相当する額です。
(売買損益相当額)	売買損益に相当する額です。
計	収益分配前の期中の収支の総合計です。
収益分配金	期中の分配可能額から受益者に支払われる分配金です。
次期繰越損益金	翌期に繰り越す損益金の合計です。
追加信託差損益金	翌期に繰り越す追加信託差損益金です。
(配当等相当額)	配当等に相当する額です。
(売買損益相当額)	売買損益に相当する額です。
分配準備積立金	翌期に繰り越す分配準備積立金の額です。
繰越損益金	翌期に繰り越す損益金の額です。

日本ESGマザーファンド 第19期 運用状況のご報告

決算日：2024年8月13日

当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とし、投資信託財産の成長を図ることを目標に積極的な運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場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。外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数 (TOPIX)		東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	騰落率	中率	(ベンチマーク)	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
	円	%	ポイント	%	ポイント	%	%	%	百万円
15期(2020年8月11日)	15,828	9.7	1,585.96	6.7	—	—	98.8	—	4,257
16期(2021年8月11日)	19,996	26.3	1,954.08	23.2	—	—	99.1	—	5,060
17期(2022年8月12日)	20,404	2.0	1,973.18	1.0	—	—	98.9	—	4,990
18期(2023年8月14日)	24,459	19.9	2,280.89	15.6	—	—	99.1	—	5,284
19期(2024年8月13日)	28,325	15.8	—	—	4,343.30	—	99.7	—	5,148

(注) 基準価額は1万口当たり。

(注) 2024年5月14日に東証株価指数 (TOPIX) から東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) にベンチマークを変更いたしました。

(注) 株式先物比率=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		東証株価指数 (TOPIX)		東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首) 2023年8月14日	円	%	ポイント	%	ポイント	%	%	%
8月末	24,459	—	2,280.89	—	—	—	99.1	—
9月末	25,089	2.6	2,332.00	2.2	—	—	99.1	—
10月末	24,973	2.1	2,323.39	1.9	—	—	98.5	—
11月末	24,180	△ 1.1	2,253.72	△ 1.2	—	—	98.4	—
12月末	25,506	4.3	2,374.93	4.1	—	—	98.7	—
2024年1月末	25,875	5.8	2,366.39	3.7	—	—	98.6	—
2月末	27,587	12.8	2,551.10	11.8	—	—	98.7	—
3月末	28,771	17.6	2,675.73	17.3	—	—	99.0	—
4月末	30,018	22.7	2,768.62	21.4	—	—	98.2	—
5月末	29,700	21.4	2,743.17	20.3	—	—	98.1	—
6月末	30,113	23.1	—	—	4,710.15	—	98.3	—
7月末	31,050	26.9	—	—	4,778.56	—	98.7	—
(期末) 2024年8月13日	30,933	26.5	—	—	4,752.72	—	98.8	—
	28,325	15.8	—	—	4,343.30	—	99.7	—

(注) 騰落率は期首比。

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2023年8月15日～2024年8月13日)



(注) ベンチマークは、東証株価指数 (TOPIX) および東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) です。

(注) ベンチマークは、期首 (2023年8月14日) の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 2024年5月14日に東証株価指数 (TOPIX) から東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) にベンチマークを変更いたしました。そのため、東証株価指数 (TOPIX) の推移は2024年5月13日までを記載、東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) の推移は見やすさの観点から期首 (2023年8月14日) より記載しております。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドにおける主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・業種配分では、化学、電気機器、銀行業などが基準価額にプラスに寄与しました。
- ・個別銘柄では、日立製作所、リクルートホールディングス、三菱UFJフィナンシャル・グループなどが基準価額にプラスに寄与しました。

(主なマイナス要因)

- ・業種配分では、鉄鋼、陸運業、機械などが基準価額にマイナスに影響しました。
- ・個別銘柄では、浜松ホトニクス、ダイキン工業、ロームなどが基準価額にマイナスに影響しました。

投資環境

(2023年8月15日～2024年8月13日)

国内株式市場は、米国の長期金利上昇などを受けて下落する場面もありましたが、米国の長期金利が低下に転じたことや、パウエル米連邦準備制度理事会（FRB）議長のジャクソンホール会議での講演が無難に終わったことなどが好感され、2023年9月中旬にかけては上昇しました。10月に入り、月末の日銀金融政策決定会合に向けて政策修正観測が強まり、国内の長期金利が上昇したことなどが国内株式市場の重しとなりました。11月以降は、日本企業の堅調な業績が確認され、日経平均株価は一時年初来高値を更新する場面もありましたが、再び日銀の政策修正観測が強まったことで、上値の重い展開となりました。年が明けてからは、元日に能登半島地震が発生しましたが、日銀が2024年1月下旬の金融政策決定会合で、マイナス金利の解除を見送るとの見方が強まり、為替市場で円安米ドル高が進行したことを好感し、日経平均株価は連日でバブル崩壊後の高値を更新する動きとなりました。その後も、人工知能（AI）関連銘柄や半導体関連銘柄がけん引して米国株筆頭に相場が上昇したほか、好調な企業業績や資本コストを意識した経営への変化を評価する海外投資家からの資金流入も株価を押し上げる要因となり、3月下旬にかけて上昇基調を辿りました。4月以降は、米国の堅調な経済指標を背景に早期利下げ観測が後退したことに加え、中東情勢の緊迫化も投資家心理を冷やす要因となりました。6月中旬以降は、円安米ドル高の進行を背景に輸出関連銘柄が買い戻されたほか、米国ハイテク株の上昇を背景に半導体関連銘柄が買われたことなどから、堅調に推移しました。7月に入ってから、上場企業による自社株買いや海外投資家の日本株再評価による資金流入など複数の上昇要因が重なったことを受けて、国内株式市場は上値を追う展開となり、日経平均株価は史上最高値を更新しました。7月末には日銀の利上げや半導体関連株の急反発で一時的に上昇する場面もありましたが、8月に入ると再び下落に転じ、質への逃避から5日にかけて急落しました。その後は、日銀副総裁が早期の追加利上げを否定したことなどから急反発しました。

当ファンドのポートフォリオ

(2023年8月15日～2024年8月13日)

個別企業に対する調査分析を重視し、環境面、社会面、ガバナンス面での評価が高く、かつ財務面で投資価値が高いと判断される銘柄でポートフォリオを構築しました。

個別銘柄では、深井頭取のリーダーシップのもとに、顧客ニーズに対応できる地域密着型の地銀へと変化している群馬銀行、民営化後入社の社長による、過去にないユニークな取組みに変化が感じられる東日本旅客鉄道、パートナーの持つさまざまな技術力と社会への実装力を繋げる共創型化学会社を標榜し、社長のリーダーシップにより組織を活性化させているレゾナック・ホールディングスなどを新規に組み入れました。

一方、株価が上昇し、相対的に期待収益率が低くなった西日本旅客鉄道、豊田自動織機などを売却し、ディスコなどのウェイトを引き下げました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2023年8月15日～2024年8月13日)

株式指数が上昇するなか、個別銘柄では、組織・地域・世代を超えた連携力や多様な人財が活躍できるインクルーシブな組織づくりなどにより社会課題の解決を目指している日立製作所、情報の非対称性を軸に様々な新ビジネスを創出する力や中長期的な成長戦略と融合したサステナビリティへコミットメントしているリクルートホールディングスなどの株価が上昇し、プラスに寄与しました。

一方、冷媒と空調機の研究開発により、環境対応を進めるダイキン工業、世界最先端の光技術をもち、開発意欲の高い従業員のモチベーションにこたえる環境を構築している浜松ホトニクスなどは、海外での在庫増加などから株価が下落し、マイナスに影響しました。

なお、当ファンドのベンチマークは、2024年5月13日までは東証株価指数（TOPIX）でしたが、2024年5月14日以降は、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に変更いたしました。このため、当期中にベンチマークが変更となったことからファンドとの比較ができないため、「基準価額とベンチマークの対比（騰落率）」の掲載は行っておりません。

今後の運用方針

当ファンドは運用指図に関する権限を「富国生命投資顧問株式会社」に委託しております。

地球環境問題が深刻化し、感染症の拡大を背景に従業員の健康管理や働き方改革などの重要性が高まるなか、持続可能性を高めるための投資がグローバルに拡大しています。日本においてもコーポレートガバナンス・コードやスチュワードシップ・コードの改訂が続き、企業と投資家が各々の立場で取組みを強化しています。

当ファンドは、直接取材により企業のESGに関する取組み、および、財務面の評価を行うことにより、ベンチマークの東証株価指数（TOPIX）（配当込み）を中長期にわたり上回る収益獲得を目指します。具体的には、社会の課題を解決するとともに、これによるビジネスチャンスを得ることで、中長期的な企業価値向上に繋がることが期待される銘柄で、株価が割安な銘柄に投資します。保有銘柄に不祥事が発生した場合は、再調査の上、売却を検討するほか、建設的な「目的を持った対話」を通じて、投資先企業の企業価値向上を促すことにより、中長期的な投資リターンの向上を図ります。

※文中の投資行動は、個別銘柄の売買等いかなる投資行動も推奨するものではありません。

○1万口当たりの費用明細

(2023年8月15日～2024年8月13日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 22 (22)	% 0.079 (0.079)	(a) 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
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、金銭信託支払手数料
合 計	22	0.079	
期中の平均基準価額は、27,816円です。			

(注) 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。

(注) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2023年8月15日～2024年8月13日)

株式

国 内	上場	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
		千株	千円	千株	千円
		617 (305)	1,452,779 ()	889	2,283,266

(注) 金額は受渡代金。

(注) 単位未満は切捨て。

(注) () 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。

○株式売買比率

(2023年8月15日～2024年8月13日)

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	3,736,045千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	5,865,245千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.63

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2023年8月15日～2024年8月13日)

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株 式	1,452	482	33.2	2,283	290	12.7

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)	4,709千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	679千円
(B) / (A)	14.4%

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、当ファンドに係る利害関係人とは株式会社SBI証券です。

○組入資産の明細

(2024年8月13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
水産・農林業 (0.6%)			
サカタのタネ	—	8.6	29,197
建設業 (2.2%)			
大和ハウス工業	30.1	25.8	112,333
食料品 (4.6%)			
日本ハム	2.9	11.9	61,285
味の素	13.4	11.4	59,929
ニチレイ	17.3	14.7	57,918
日清食品ホールディングス	6.7	14.5	55,317
繊維製品 (0.4%)			
東レ	36.6	24.7	17,944
パルプ・紙 (0.6%)			
レンゴー	43.5	31.9	29,571
化学 (10.3%)			
レゾナック・ホールディングス	—	33.6	110,812
信越化学工業	36	30.8	190,806
KHネオケム	13.7	19.3	38,870
富士フイルムホールディングス	12.6	32.3	113,922
ファンケル	28.4	—	—
エフピコ	6	—	—

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユニ・チャーム	12.7	15	74,130
医薬品 (3.2%)			
協和キリン	23	19.7	59,907
中外製薬	11.7	9.7	60,518
ロート製薬	13.7	5.9	19,151
小野薬品工業	11.5	—	—
ペプチドリーム	6.1	9.9	22,270
ゴム製品 (—%)			
TOYO TIRE	14.9	—	—
ガラス・土石製品 (1.4%)			
AGC	18.6	16	74,128
鉄鋼 (1.1%)			
JFEホールディングス	30.5	30.8	57,796
非鉄金属 (0.0%)			
DOWAホールディングス	2.3	0.2	940
機械 (6.2%)			
ディスコ	5	1.5	64,425
小松製作所	29.7	25.6	102,732
ダイキン工業	6	5.2	91,676
日本精工	98.1	84.8	60,954

日本ESGマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
電気機器 (18.6%)			
コニカミノルタ	54.4	27.2	9,922
日立製作所	20.2	67.4	234,552
ニデック	13.6	11.7	69,310
ソニーグループ	17.7	17.9	231,715
リオン	7.6	6.8	14,348
芝浦電子	5	14.1	42,934
ローム	4.8	17.2	27,262
浜松ホトニクス	15.2	18.8	73,094
村田製作所	15.4	40.5	117,105
東京エレクトロン	4.4	4.9	134,260
輸送用機器 (4.1%)			
豊田自動織機	8.4	—	—
川崎重工業	—	14.7	65,047
トヨタ自動車	60.8	57.8	146,176
シマノ	1.8	—	—
精密機器 (—%)			
島津製作所	15.9	—	—
その他製品 (5.0%)			
バンダイナムコホールディングス	19.2	17.3	49,711
フジシールインターナショナル	16.4	21.2	47,297
ヤマハ	—	14	39,802
任天堂	18.3	15.7	121,675
電気・ガス業 (0.7%)			
大阪瓦斯	25.2	10.3	35,226
陸運業 (1.5%)			
東日本旅客鉄道	—	29.2	75,014
西日本旅客鉄道	17.4	—	—
海運業 (1.6%)			
商船三井	20.4	17.4	82,702
情報・通信業 (9.9%)			
野村総合研究所	29.2	27.9	131,157
オービック	5	4.9	119,070
LINEヤフー	112.5	42.9	16,353
日本電信電話	810.8	769.7	114,608
ソフトバンクグループ	18.9	16.2	127,623
卸売業 (6.0%)			
伊藤忠商事	30.7	22.2	153,668
三菱商事	14.1	53.9	154,315
小売業 (3.8%)			
J.フロント リテイリング	44	37.2	53,326
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	25.4	18.6	68,317
しまむら	2	—	—
丸井グループ	11.4	5.1	11,658

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ファーストリテイリング	—	1.5	60,900	
銀行業 (8.9%)				
三菱UFJフィナンシャル・グループ	197.8	157.5	226,563	
三井住友トラスト・ホールディングス	21.4	28.9	99,936	
千葉銀行	60.5	51	57,579	
群馬銀行	—	82.1	71,624	
保険業 (2.2%)				
東京海上ホールディングス	25.9	21.9	114,865	
不動産業 (2.8%)				
三井不動産	41.8	97.7	146,256	
サービス業 (4.3%)				
サイバーエージェント	—	30.5	27,928	
リクルートホールディングス	22.8	23.4	193,752	
合 計	株 数・金 額	2,367	2,401	5,133,201
	銘柄 数<比率>	63	62	<99.7%>

(注) 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) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年8月13日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 5,133,201	% 99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	15,072	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	5,148,273	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年8月13日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,148,273,064
コール・ローン等	10,341,060
株式(評価額)	5,133,201,950
未収配当金	4,730,000
未収利息	54
(B) 純資産総額(A)	5,148,273,064
元本	1,817,595,936
次期繰越損益金	3,330,677,128
(C) 受益権総口数	1,817,595,936口
1万口当たり基準価額(B/C)	28,325円

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、2,8325円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は2,160,639,676円、期中追加設定元本額は115,451,750円、期中一部解約元本額は458,495,490円です。

(注) 当親ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、以下の通りです。

私募日本株ESGオープン (適格機関投資家専用)	1,080,451,238円
日本ESGオープン (愛称 絆 (きずな))	737,144,698円

○損益の状況 (2023年8月15日~2024年8月13日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	125,766,692
受取配当金	125,748,558
受取利息	26,870
その他収益金	824
支払利息	△ 9,560
(B) 有価証券売買損益	726,878,542
売買益	1,052,925,197
売買損	△ 326,046,655
(C) その他費用等	△ 3,122
(D) 当期損益金(A+B+C)	852,642,112
(E) 前期繰越損益金	3,123,991,276
(F) 追加信託差損益金	204,548,250
(G) 解約差損益金	△ 850,504,510
(H) 計(D+E+F+G)	3,330,677,128
次期繰越損益金(H)	3,330,677,128

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で(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。

<お知らせ>

・ベンチマークとする指数を、より運用の実態に即している「配当込み指数」に変更することで運用内容の説明力の向上をはかり、投資者への適正な情報開示を行うことを目的として投資信託約款の変更を行いました。(実施日:2024年5月14日)

<当ファンドのベンチマークについて>

TOPIX (以下、「東証株価指数 (TOPIX)」)と申します。)・配当込みTOPIX (以下、「東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)」)と申します。)の指数値及び東証株価指数 (TOPIX)・東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)に係る標準又は商標は、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」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数 (TOPIX)・東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (TOPIX)・東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)に係る標準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、東証株価指数 (TOPIX)・東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)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。