

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	2017年1月27日から無期限	
運用方針	CAM ESG日本株マザーファンドに投資し、中長期的に信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要投資対象	当ファンド	CAM ESG日本株マザーファンドの受益証券
	CAM ESG日本株マザーファンド	日本の金融取引所に上場する、ESG（環境対応、社会責任、企業統治）に優れた企業もしくは関連企業によって発行された株式及び株式関連証券
主な組入制限	当ファンド	CAM ESG日本株マザーファンドの受益証券への投資割合は、制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	CAM 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。 外貨資産への投資は行いません。
分配方針	年1回（原則として毎年1月26日。ただし、休業日の場合は翌営業日とします。）決算を行い、原則として、収益分配方針に基づいて分配を行います。収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して収益分配金額を決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、収益分配を行わないことがあります。	

CAM ESG日本株ファンド

追加型投信／国内／株式

運用報告書(全体版)

第1期

決算日：2018年1月26日

作成対象期間：2017年1月27日～2018年1月26日

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼を申し上げます。さて、「CAM ESG日本株ファンド」は、2018年1月26日に第1期の決算を行いました。ここに、期中の運用状況と収益分配状況についてご報告申し上げます。今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

キャピタル アセット マネジメント 株式会社

東京都千代田区神田錦町一丁目16番1号いちご神田錦町ビル5階

< お問い合わせ先 >

【電話番号】 **03-5259-7401**

(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

【ホームページ】 <http://www.capital-am.co.jp/>

◆ 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			参考指数		株式組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率			
(設定日) 2017年1月27日	円 10,000	円 —	% —		% —	% —	百万円 230
1期 2018年1月26日	12,818	0	28.2	1,879.39	21.3	93.0	722

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 基準価額は1万円当たり。(基準価額の全てに共通)

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(注4) 当ファンドは、適切なベンチマークが存在しないため、ベンチマークを設けていません。当報告書では、東証株価指数 (TOPIX) を参考指数として表示しています。

◆ 当期中の基準価額と市況等の推移

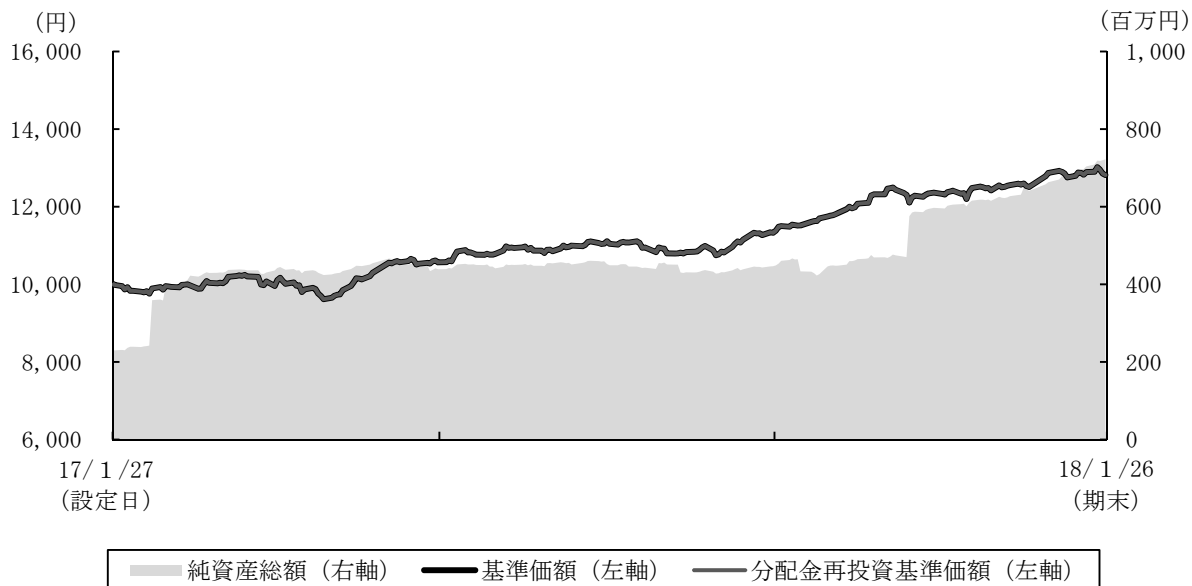
年月日	基準価額		参考指数		株式組入比率
		騰落率		騰落率	
(設定日) 2017年1月27日	円 10,000	% —		% —	% —
1月末	9,869	△ 1.3	1,521.67	△ 1.8	88.9
2月末	9,891	△ 1.1	1,535.32	△ 0.9	98.2
3月末	10,012	0.1	1,512.60	△ 2.4	98.2
4月末	10,129	1.3	1,531.80	△ 1.1	98.6
5月末	10,595	6.0	1,568.37	1.2	98.7
6月末	10,865	8.7	1,611.90	4.0	98.5
7月末	11,024	10.2	1,618.61	4.5	98.6
8月末	10,952	9.5	1,617.41	4.4	98.7
9月末	11,502	15.0	1,674.75	8.1	96.0
10月末	12,100	21.0	1,765.96	14.0	93.1
11月末	12,393	23.9	1,792.08	15.7	93.2
12月末	12,508	25.1	1,817.56	17.3	94.2
(期末) 2018年1月26日	12,818	28.2	1,879.39	21.3	93.0

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

◆ 運用経過の説明 ◆

● 基準価額の推移 (2017年1月27日～2018年1月26日)



設定日：10,000円

第1期末：12,818円 (当期分配金0円)

騰落率：28.2% (分配金再投資ベース)

(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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

● 基準価額の主な変動要因 (2017年1月27日～2018年1月26日)

当期末の基準価額は28.2%上昇し、12,818円となりました。日本株式市場が堅調に推移し、組入銘柄の株価が上昇したことが基準価額上昇の主要因となりました。

● 投資環境 (2017年1月27日～2018年1月26日)

当期の日本株式市場は堅調に推移しました。期前半は世界的に株式市場は一進一退となりました。3月に米国で利上げが決定された後、米国長期金利の低下を背景に金融株が下落しました。5月に仏大統領選挙の決選投票でマクロン氏が勝利して反EUの動きが沈静化する期待と、好調な企業決算の発表を受けて、国内株式市場は上昇しました。

期後半は9月に北朝鮮による核実験の実施を受けてリスク回避の売り圧力が高まり、円高と株安が進みました。10月に入ると、日銀短観が景況感の改善示したことや、IMF(国際通貨基金)が世界経済の見通しを上方修正したことで世界同時株高になりました。さらに衆院選挙で連立与党が絶対安定多数を確保し、安倍政権が当面安定した政権運営を続けるとの期待から、外国人投資家を中心に資金流入が続き、日経平均株価指数は21年ぶりの高値となる22,000円台まで上昇しました。12月には米国の連邦法人税が現行の35%から21%への引き下げ決定を好感して、TOPIX(東証株価指数)は21.3%上昇し、1,879.39ポイントで期末を迎えました。

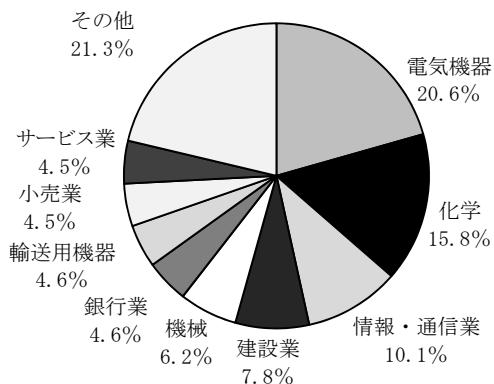
● 当該投資信託のポートフォリオ (2017年1月27日～2018年1月26日)

銘柄選定プロセス：当ファンドは非財務情報であるESGスコアと財務情報による総合評価(CAMサステナブル・インベストメント・モデル[®])に従って、100銘柄を組み入れ銘柄としております。当期は合計19銘柄の入れ替えを実施しました。その理由は① 公開買付で上場廃止になった2銘柄、② 3月の定期見直し9銘柄、③ 9月の定期見直し8銘柄です。

組み入れ銘柄の投資比率：ポートフォリオ構築は基本的に、各銘柄のESGスコアを投資比率に反映させています。ESGスコアが高い企業の投資比率を高めることを原則としています。期中に不祥事が発覚した企業群に関しては個別に内容を精査しながら判断いたしました。組入銘柄2社の投資比率を引き下げました。

【業種別比率の推移】

期末 (2018年1月26日)



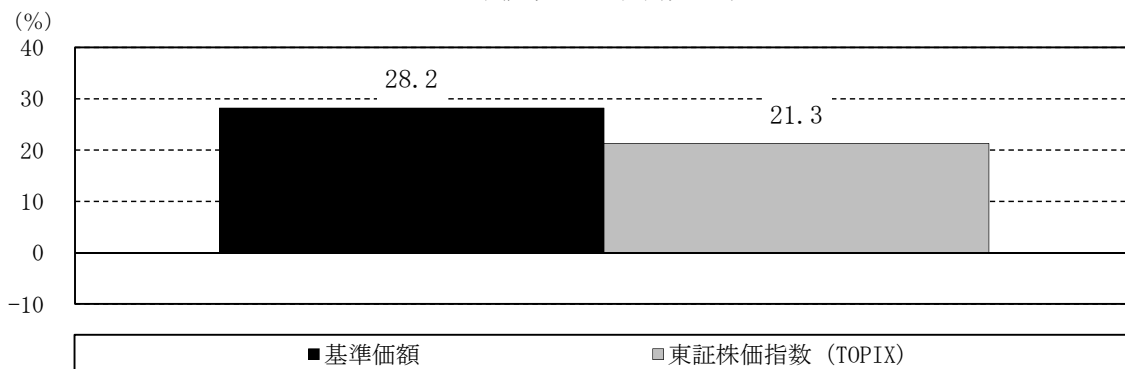
※ マザーファンドにおける株式ポートフォリオに対する比率です。

※ 表示単位未満を四捨五入しているため、合計が100%にならない場合があります。

● 当該投資信託の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いません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数である東証株価指数（TOPIX）の騰落率の対比です。

基準価額と参考指数の対比



(注1) 基準価額は分配金（税引前）込み。

(注2) 当ファンドは、適切なベンチマークが存在しないため、ベンチマークを設けていません。当報告書では、「東証株価指数（TOPIX）」を参考指数として表示しています。

● 分配金

分配原資、基準価額水準等を勘案し、当期の収益分配は見送らせていただきました。
留保益は、「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用します。

(単位：円、1万口当たり・税引前)

	第1期
	2017年1月27日～ 2018年1月26日
当期分配金	0
(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	2,818

(注1) 当期の収益は経費控除後の配当等収益および経費控除後の有価証券売買等損益、当期の収益以外は収益調整金および分配準備積立金です。
(注2) 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)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
(注3) 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(税引前)と一致しない場合があります。

● 今後の運用方針

当ファンドの投資判断においては、企業の「環境対応 - E」、「社会責任 - S」、「企業統治 - G」の評価に基づき、中長期的な視点に立って持続的成長可能な企業への投資を継続していきます。

当ファンドは年2回(3月・9月)の組み入れ銘柄の見直しを実施する方針です。銘柄見直しは、“CAMサステナブル・インベストメント・モデル” (ESGスコアと財務情報の組合せ)に従って、サステナブル・インベストメント・スコアが低値の組み入れ銘柄を排除し、投資対象銘柄の中から最上位の銘柄と入れ替えます。期中で公開買付等により上場廃止になる企業があれば、投資対象銘柄の中から最上位のサステナブル・インベストメント・スコアを持つ銘柄と入れ替えます。組み入れ銘柄の投資比率は各企業の最新のESGスコアを反映するように適時見直しを行います。

◆ 当期中の1万口(元本10,000円)当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	163円	1.469%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率です。 なお、期中の平均基準価額は11,101円です。
(委 託 会 社)	(72)	(0.648)	・ 委託した資金の対価
(販 売 会 社)	(84)	(0.756)	・ 運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後のアフターフォローの対価
(受 託 会 社)	(7)	(0.065)	・ 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	14	0.123	(b) 売買委託手数料は期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。 売買委託手数料とは、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料です。
(株 式)	(14)	(0.123)	
(c) そ の 他 費 用	72	0.651	(c) その他費用は期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。
(監 査 費 用)	(8)	(0.071)	・ 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(64)	(0.580)	・ 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	249	2.242	

(注1) 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、その他費用は、当ファンドが組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を含みます。

(注2) 「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。

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

◆ 親投資信託受益証券の設定、解約状況 (2017年1月27日から2018年1月26日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
CAM ESG日本株マザーファンド	千口 621,250	千円 665,200	千口 93,129	千円 103,600

(注) 単位未満は切捨て。

◆ 親投資信託における株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合 (2017年1月27日から2018年1月26日まで)

項 目	当 期
	CAM ESG日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	932,803千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	440,303千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	2.11

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

◆ 主要な売買銘柄 (2017年1月27日から2018年1月26日まで)

CAM ESG日本株マザーファンドにおける株式の売買

買 柄	付			売 柄	付		
	株数	金額	平均単価		株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
富士通	14.0	10,175	726	帝人	3.1	6,897	2,224
KDDI	3.4	10,055	2,957	武田薬品工業	1.1	6,618	6,016
セブン&アイ・ホールディングス	2.1	9,510	4,528	第一三共	2.5	6,459	2,583
ローソン	1.2	9,350	7,791	マツダ	3.7	5,990	1,619
大成建設	7.6	9,233	1,214	横河電機	3.1	5,664	1,827
日立化成	2.9	9,174	3,163	荏原製作所	1.6	5,590	3,494
カシオ計算機	5.6	9,010	1,609	セイコーエプソン	2.2	5,546	2,520
NTTドコモ	3.3	9,006	2,729	第一生命ホールディングス	3.1	5,483	1,768
積水化学工業	4.5	8,967	1,992	住友化学	8.0	5,268	658
アステラス製薬	6.0	8,933	1,488	カルソニックカンセイ	4.0	5,140	1,285

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

◆ 利害関係人との取引状況等 (2017年1月27日から2018年1月26日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 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 (2018年1月26日現在)

親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
CAM ESG日本株マザーファンド	千口 528,121	千円 693,687

(注) 単位未満は切捨て。

◆ 投資信託財産の構成 (2018年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
CAM ESG日本株マザーファンド	千円 693,687	% 94.8
コール・ローン等、その他	37,929	5.2
投 資 信 託 財 産 総 額	731,617	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

(2018年1月26日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	731,617,132円
コール・ローン等	37,929,708
C A M E S G 日 本 株 マザーファンド(評価額)	693,687,424
(B) 負 債	9,434,048
未 払 解 約 金	3,824,428
未 払 信 託 報 酬	3,860,620
そ の 他 未 払 費 用	1,749,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	722,183,084
元 本	563,398,946
次 期 繰 越 損 益 金	158,784,138
(D) 受 益 権 総 口 数	563,398,946口
1万口当り基準価額(C/D)	12,818円

<注記事項>当運用報告書作成時点では、監査未了です。

(注) 期首元本額	230,214,975円
期中追加設定元本額	528,203,363円
期中一部解約元本額	195,019,392円

◆ お知らせ ◆

該当事項はございません。

◆ 損益の状況

当期：自2017年1月27日 至2018年1月26日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 10,383円
受 取 利 息	943
支 払 利 息	△ 11,326
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	108,693,940
売 買 益	131,606,939
売 買 損	△ 22,912,999
(C) 信 託 報 酬 等	△ 9,907,068
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	98,776,489
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	60,007,649
(配 当 等 相 当 額)	(△ 3,469)
(売 買 損 益 相 当 額)	(60,011,118)
(F) 合 計 (D + E)	158,784,138
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F + G)	158,784,138
追 加 信 託 差 損 益 金	60,007,649
(配 当 等 相 当 額)	(893,624)
(売 買 損 益 相 当 額)	(59,114,025)
分 配 準 備 積 立 金	98,776,489

(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) (E)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。

CAM ESG 日本株マザーファンド

運用報告書

第 1 期

(決算日：2018年1月26日)

(作成対象期間：2017年1月27日～2018年1月26日)

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（設定日：2017年1月27日）
運用方針	日本の株式に投資し中長期的に信託財産の成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主な運用対象	日本の金融取引所に上場する、ESG（環境対応、社会責任、企業統治）に優れた企業もしくは関連企業によって発行された株式及び株式関連証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資割合は、制限を設けません。

◆ 設定以来の運用実績

決算期	基準価額		参考指数		株式組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率		
(設定日) 2017年1月27日	円 10,000	% —	1,549.25	% —	% —	百万円 230
1期 2018年1月26日	13,135	31.4	1,879.39	21.3	96.8	693

(注1) 基準価額は1万口当たりです。(基準価額の全てに共通)

(注2) 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います。

(注3) 純資産総額は単位未満切捨て、騰落率・組入比率は小数第2位を四捨五入しています。

(注4) 適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載していません。当報告書では、東証株価指数(TOPIX)を参考指数として表示しています。

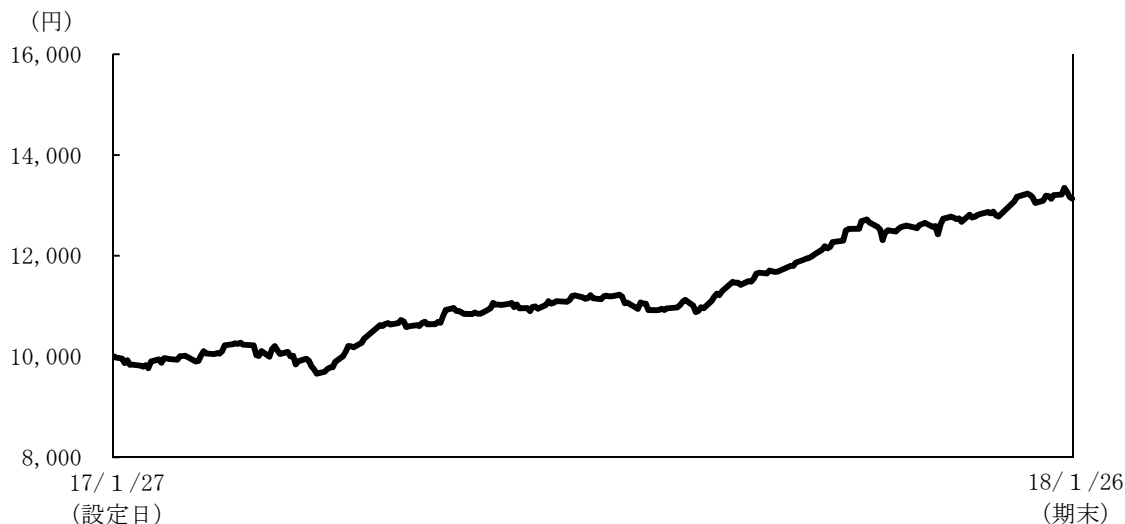
◆ 当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		参考指数		株式組入比率
		騰落率		騰落率	
(設定日) 2017年1月27日	円 10,000	% —	1,549.25	% —	% —
1月末	9,871	△ 1.3	1,521.67	△ 1.8	89.5
2月末	9,911	△ 0.9	1,535.32	△ 0.9	98.5
3月末	10,050	0.5	1,512.60	△ 2.4	98.4
4月末	10,184	1.8	1,531.80	△ 1.1	98.8
5月末	10,670	6.7	1,568.37	1.2	98.8
6月末	10,956	9.6	1,611.90	4.0	98.9
7月末	11,137	11.4	1,618.61	4.5	96.7
8月末	11,086	10.9	1,617.41	4.4	98.8
9月末	11,664	16.6	1,674.75	8.1	97.6
10月末	12,300	23.0	1,765.96	14.0	96.8
11月末	12,632	26.3	1,792.08	15.7	97.1
12月末	12,780	27.8	1,817.56	17.3	97.8
(期末) 2018年1月26日	13,135	31.4	1,879.39	21.3	96.8

(注1) 騰落率は設定日比です。

(注2) 騰落率・組入比率は小数第2位を四捨五入しています。

◆ 基準価額の推移 (2017年1月27日から2018年1月26日まで)



◆ 1万口(元本10,000円)当たりの費用明細

項目	当期
(a) 売買委託手数料 (株 式)	14円 (14)
合 計	14

(注) 費用項目の概要及び注記については、6頁の費用明細をご参照ください。

◆ 期中の売買及び取引の状況 (2017年1月27日から2018年1月26日まで)

株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株 370.2 (1.9)	千円 741,047 (-)	千株 115.9	千円 191,756

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は増資割当、株式転換・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。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

◆ **株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合** (2017年1月27日から2018年1月26日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	932,803千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	440,303千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	2.11

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

◆ **主要な売買銘柄** (2017年1月27日から2018年1月26日まで)

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
富士通	14.0	10,175	726	帝人	3.1	6,897	2,224
KDDI	3.4	10,055	2,957	武田薬品工業	1.1	6,618	6,016
セブン&アイ・ホールディングス	2.1	9,510	4,528	第一三共	2.5	6,459	2,583
ローソン	1.2	9,350	7,791	マツダ	3.7	5,990	1,619
大成建設	7.6	9,233	1,214	横河電機	3.1	5,664	1,827
日立化成	2.9	9,174	3,163	荏原製作所	1.6	5,590	3,494
カシオ計算機	5.6	9,010	1,609	セイコーエプソン	2.2	5,546	2,520
NTTドコモ	3.3	9,006	2,729	第一生命ホールディングス	3.1	5,483	1,768
積水化学工業	4.5	8,967	1,992	住友化学	8.0	5,268	658
アステラス製薬	6.0	8,933	1,488	カルソニックカンセイ	4.0	5,140	1,285

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

◆ **利害関係人との取引状況等** (2017年1月27日から2018年1月26日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 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 (2018年1月26日現在)

国内株式
上場株式

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
建設業(7.8%)	千株	千円
大成建設	1.3	7,514
大林組	5.3	7,409
清水建設	5.6	6,529
長谷工コーポレーション	2.1	3,784
鹿島建設	6.0	6,762
前田建設工業	4.6	7,074
大東建託	0.3	6,120
五洋建設	8.3	7,237
食料品(1.2%)		
カゴメ	2.0	8,240
化学(15.8%)		
昭和電工	1.6	8,448
第一稀元素化学工業	3.3	5,111
積水化学工業	3.7	8,288
アイカ工業	1.7	7,038
日立化成	2.8	8,220
花王	1.2	9,240
ライオン	3.6	7,563
ファンケル	2.2	7,579
コーセー	0.4	7,612
ポーラ・オルビスホールディングス	1.6	7,192
上村工業	0.6	5,172
小林製薬	0.6	4,452
日東電工	0.8	8,036
信越ポリマー	5.1	6,630
ユニ・チャーム	1.9	5,697
医薬品(3.6%)		
アステラス製薬	5.7	8,105
塩野義製薬	0.8	5,009
科研製薬	0.7	4,137
久光製薬	0.9	6,984
石油・石炭製品(1.1%)		
昭和シェル石油	4.9	7,683
ガラス・土石製品(3.8%)		
日本板硝子	8.0	8,008
TOTO	1.5	9,525
日本碍子	3.7	8,184
機械(6.2%)		
タクマ	3.7	5,476
ディスコ	0.3	7,794

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ダイキン工業	0.6	8,010
ダイフク	0.7	5,208
アマノ	1.0	3,050
セガサミーホールディングス	4.5	6,583
ホシザキ	0.5	5,290
電気機器 (20.6%)		
ミネベアミツミ	2.9	7,206
日立製作所	10.0	9,200
三菱電機	4.4	9,015
東芝テック	7.0	4,802
日本電産	0.5	9,095
オムロン	1.2	8,676
富士通	11.0	8,938
アルバック	0.7	5,369
パナソニック	3.6	5,972
日立国際電気	2.0	6,230
ヒロセ電機	0.4	6,796
アズビル	1.6	8,240
アドバンテスト	2.2	4,818
シスメックス	0.9	8,190
コーセル	3.6	6,692
カシオ計算機	4.9	8,330
浜松ホトニクス	1.6	6,504
S C R E E Nホールディングス	0.8	7,680
東京エレクトロン	0.3	6,547
輸送用機器 (4.6%)		
トヨタ紡織	3.2	7,689
日産自動車	3.7	4,373
スズキ	1.3	8,039
S U B A R U	1.3	4,785
テイ・エス テック	1.2	5,802
精密機器 (1.9%)		
ニコン	3.6	7,869
H O Y A	0.9	5,148
その他製品 (3.1%)		
バンダイナムコホールディングス	1.8	6,543
ヤマハ	1.9	9,063
ビジョン	1.1	4,900
情報・通信業 (10.1%)		
N E C ネットズエスアイ	2.7	8,013
ティーガイア	1.7	4,637
トレンドマイクロ	1.0	6,070
オービックビジネスコンサルタント	0.6	3,804
大塚商会	0.6	5,604

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
日本ユニシス	3.6	8,517
KDD I	3.2	9,022
NTTドコモ	3.1	8,483
DTS	0.8	3,160
日本システムウエア	1.6	4,294
JBCCHホールディングス	5.2	6,432
卸売業(1.5%)		
進和	0.7	1,771
日立ハイテクノロジーズ	0.8	4,184
サンリオ	2.3	4,374
小売業(4.5%)		
ローソン	1.2	8,832
アダストリア	2.1	5,035
セブン&アイ・ホールディングス	2.0	9,244
良品計画	0.2	7,240
銀行業(4.6%)		
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10.1	8,493
三井住友フィナンシャルグループ	1.8	9,095
千葉銀行	8.0	7,664
紀陽銀行	3.0	5,538
保険業(3.9%)		
SOMPOホールディングス	1.9	8,776
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2.2	8,456
東京海上ホールディングス	1.7	8,950
その他金融業(1.0%)		
日本取引所グループ	3.3	6,854
サービス業(4.5%)		
ぐるなび	1.7	2,327
みらかホールディングス	1.3	6,565
オリエンタルランド	0.4	4,410
トーカイ	2.3	6,290
セコム	0.9	7,741
メイテック	0.5	3,010
合 計	株 数 ・ 金 額	256.2 671,410
	銘 柄 数 < 比 率 >	100 銘柄 <96.8%>

(注1) 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です。

(注2) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

◆ 投資信託財産の構成 (2018年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	671,410	94.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	38,827	5.5
投 資 信 託 財 産 総 額	710,237	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

(2018年1月26日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	710,237,603円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	38,225,713
株 式 (評価額)	671,410,590
未 収 配 当 金	601,300
(B) 負 債	16,572,812
未 払 金	16,572,812
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	693,664,791
元 本	528,121,374
次 期 繰 越 損 益 金	165,543,417
(C) 受 益 権 総 口 数	528,121,374口
1万口当たり基準価額 (C / D)	13,135円

<注記事項>

- | | |
|-----------------|--------------|
| (1) 期首元本額 | 230,000,000円 |
| 期中追加設定元本額 | 391,250,481円 |
| 期中一部解約元本額 | 93,129,107円 |
| (2) 期末における元本の内訳 | |
| CAM ESG 日本株ファンド | 528,121,374円 |

◆ 損益の状況

当期：自 2017年1月27日 至 2018年1月26日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	9,945,438円
受 取 配 当 金	9,960,700
そ の 他 収 益 金	42
支 払 利 息	△ 15,304
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	122,119,353
売 買 益	130,370,124
売 買 損	△ 8,250,771
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	132,064,791
(D) 解 約 差 損 益 金	△ 10,470,893
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	43,949,519
(F) 合 計 (C + D + E)	165,543,417
次 期 繰 越 損 益 金 (F)	165,543,417

(注) (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。

◆ お知らせ ◆

該当事項はございません。