

ESG GOLD

追加型投信/国内/資産複合

Capital Asset Management

商品概要

商品分類	追加型投信／国内／資産複合
投資対象	当ファンドは、ファミリーファンド方式により、日本の金融商品取引所に上場している株式等と金上場投信（以下、「金ETF」といいます。）を主要投資対象とし、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。
設定日	2022年5月20日
信託期間	2022年5月20日(設定日)から2032年5月17日まで
決算日	年1回。原則、5月15日（休業日の場合は翌営業日）

ファンドの状況

基準価額	
基準日	2022年6月30日
基準価額	10,120 円
前月比	-57 円
純資産総額	0.20 億円
前月比	±0.00 億円

期間収益	
1カ月	-0.6%
3カ月	—
6カ月	—
1年	—
設定来	1.2%

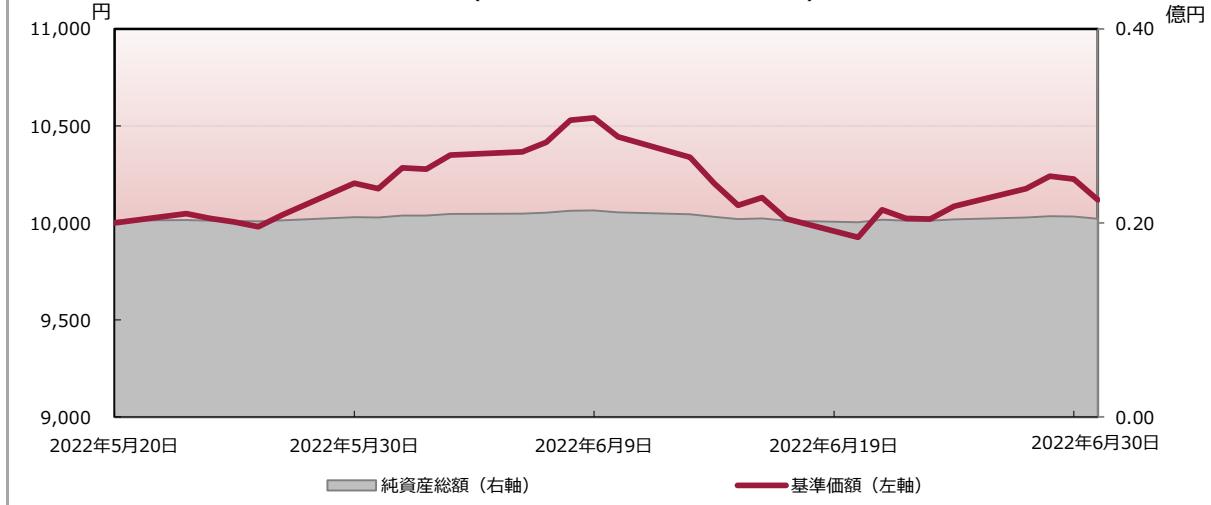
* ファンドの期間収益は、収益分配金（税引前）を再投資したと仮定して計算した理論上のものである点にご留意下さい。

資産構成	
CAM ESG日本株マザーファンド	73.9%
金ETF	23.6%
現金・その他	2.5%
合計	100.0%

※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。

基準価額・純資産総額の推移等

(2022/5/20 ~ 2022/6/30)



記載された事項は、キャピタル アセットマネジメント株式会社が信頼できると考えられる情報に基づき作成したものですが、正確性、完全性を保証するものではありません。記載内容等は作成時点のものであり、今後予告なく変更されることがあります。

取得申込に際しては必ず「投資信託説明書（交付目論見書）」の内容をご確認ください。

ESG GOLD

追加型投信/国内/資産複合

Capital Asset Management

投資先 : CAM ESG日本株マザーファンド(2017年1月27日設定) の状況



現状	
基準日	2022年6月30日
基準価額	15,334 円
前月比	-261 円
純資産総額	13.83 億円
前月比	-2.85 億円

期間収益	
1ヶ月	-1.7%
3ヶ月	-3.5%
6ヶ月	-7.7%
1年	-6.3%
設定来	53.3%

資産構成	
国内株式	97.5%
現金・その他	2.5%
合計	100.0%

* 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。

組入銘柄数
100

業種構成比	
業種	組入比率
電気機器	20.5%
化学生	11.7%
情報・通信業	9.6%
卸売業	8.3%
医薬品	8.2%
輸送用機器	7.8%
サービス業	6.9%
精密機器	5.8%
その他	21.2%
合計	100.0%

* 業種は東証33業種分類に準拠しています。

* 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。

組入銘柄上位10銘柄		
銘柄名	業種	組入比率
日立	電気機器	3.2%
ソニーグループ	電気機器	2.3%
三井物産	卸売業	2.2%
川崎重工業	輸送用機器	2.1%
オリックス	精密機器	2.0%
本田技研	輸送用機器	2.0%
塩野義製薬	医薬品	1.9%
上村工業	化学生	1.9%
オリエンタルランド	サービス業	1.8%
スズキ	輸送用機器	1.7%
合計		21.1%

記載された事項は、キャピタル アセットマネジメント株式会社が信頼できると考えられる情報に基づき作成したものですが、正確性、完全性を保証するものではありません。記載内容等は作成時点のものであり、今後予告なく変更されることがあります。

取得申込に際しては必ず「投資信託説明書（交付目論見書）」の内容をご確認ください。

ESG GOLD

追加型投信/国内/資産複合

Capital Asset Management

マンスリーコメント

■国内株式市場

国内株式市場は、6月も上旬は順調な展開でした。上海市の都市封鎖解除により中国経済の回復期待が高まったことなどから、当月8日の東証株価指数（TOPIX）は1,969.98ポイント（前月末比+3.0%）まで上昇しました。しかし、その後は調整しました。米国連邦準備制度理事会が0.75%の政策金利の引き上げに踏み切ったことなどから、景気後退懸念が高まりました。国内外の株式市場は調整し、当月20日のTOPIXは1,818.94ポイント（同▲4.9%）まで下落しました。下旬には米国金利の低下などを支えに買い戻されたものの、当月末のTOPIXは前月末比2.2%低い1,870.82ポイントで終えました。

6月の金上場投信（ETF）は上昇しました。米国の金融引き締め等を受けて、ロンドン市場でのドル建て金価格は軟調でした。しかし、円安が進行したため、国内ETFのSPDRゴールド・シェアは当月末に23,080円（同+4.5%）となりました。

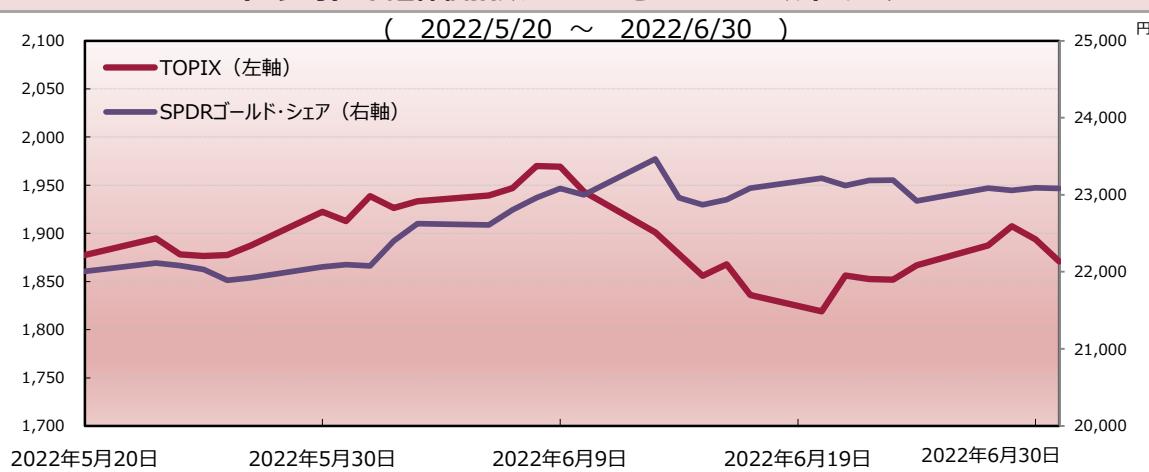
■運用状況

当ファンドが組み入れているCAM ESG日本株マザーファンドは、6月も基本方針に沿った運用を継続しました。当月のパフォーマンスは、ロート製薬（前月末比+18.6%）などの株価が順調に上昇ましたが、東京エレクトロン（同▲24.9%）などの株価が下落し、当月末の同マザーファンドの基準価額は15,334円（同▲1.7%）となりました。金ETFのSPDRゴールド・シェアの価格は既述通り上昇したものの、同マザーファンドの下落の影響が大きく、当ファンドの当月末の基準価額は10,120円（同▲0.6%）となりました。

■今後の見通し

欧米では金融引き締め政策が続行され、その結果、景気後退の可能性が高まりつつあります。他方、国内経済は総じて堅調な状況が継続しています。CAM ESG日本株マザーファンドでは、企業の「環境対応- E」、「社会責任 - S」、「企業統治 - G」の総合評価に基づき、信託財産の中長期的な成長を目指していきます。また、金利などの動向によりロンドン金地金価格が変動する可能性があるものの、為替市場における円安と相殺されることも期待できるため円建ての金ETFの価格は底堅く推移すると見込まれます。当ファンドは、引き続き同マザーファンドと金ETFに投資することにより、信託財産の安定的な成長を目指して行きます。

(ご参考) 東証株価指数TOPIXとSPDRゴールド・シェア



出所：ブルームバーグのデータを基にキャピタル アセットマネジメントが加工して作成

記載された事項は、キャピタル アセットマネジメント株式会社が信頼できると考えられる情報に基づき作成したものですが、正確性、完全性を保証するものではありません。記載内容等は作成時点のものであり、今後予告なく変更されることがあります。

取得申込に際しては必ず「投資信託説明書（交付目論見書）」の内容をご確認ください。

ESG GOLD

追加型投信/国内/資産複合

Capital Asset Management

ファンドの特色

- CAM ESG日本株マザーファンドを通じて日本株式等に投資することで収益の確保を目指しつつ、金ETFに直接投資することでリスク低減効果が期待できます。
 - 運用は、グッドバンカー社から提供を受けた“ESGスコア”（非財務情報）と、独自の“財務スコア”（財務情報）を組み合わせたアプローチを用います。
 - ESG分析に財務分析を加味して、当社独自の“サステナブル（持続成長力）・インベストメント・スコア”的総合評価で、投資対象銘柄を選択します。
 - ESGスコアを基に、各銘柄への投資比率を決定します。
 - CAM ESG日本株マザーファンドの受益証券と金ETFへの投資割合は、CAM ESG日本株マザーファンドの受益証券に75%、金ETFに25%を中心とします。
- ※ なお、市況動向および資金動向により、上記の様な運用が行えない場合があります。

ファンドに係わるリスクについて

当ファンドの基準価額は、主に以下のリスク要因により、変動することが想定されます。

株式の価格変動リスク	当ファンドは、実質的に株式に投資しますので、当ファンドの基準価額は、株式の価格変動の影響を受けます。株式の価格は政治経済情勢、発行企業の業績、市場の需給を反映して変動し、短期的または長期的に大きく下落することがあります。このような場合には、当ファンドの基準価額が影響を受け損失を被ることがあります。
金ETFに関する価格変動リスク	金ETFは、運動目標とする金地金価格の変動の影響を受けます。金市場は、金の需給関係、為替・金利の変動、政府の規制・介入、投機家の参入など様々な要因により変動します。金地金の価格が下落する場合、金ETFの価格は下がり、ファンドに損失が生じるリスクがあります。なお、円建ての金ETFに投資するため米ドルに対する為替変動リスクが含まれています。
信用リスク	株式を発行する企業が、経営不安・倒産等に陥った場合、投資した資金が回収できなくなることがあります。また、こうした状況に陥ると予想された場合、当該企業の株式等の価値は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。
流動性リスク	急激かつ多量の売買により市場が大きな影響を受けた場合、または市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、機動的に株式を売買できないことがあります。このような場合には、効率的な運用が妨げられ、当該株式の価格の下落により、当ファンドの基準価額が影響を受け損失を被ることがあります。
解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動リスク	解約によるファンドの資金流出に伴い、保有有価証券等を大量に売却しなければならないことがあります。その際には、市況動向や市場の流動性等の状況によって、保有有価証券を市場実勢と乖離した価格で売却せざるをえないこともあり、基準価額が大きく下落することがあります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

記載された事項は、キャピタル アセットマネジメント株式会社が信頼できると考えられる情報に基づき作成したものですが、正確性、完全性を保証するものではありません。記載内容等は作成時点のものであり、今後予告なく変更されることがあります。

取得申込に際しては必ず「投資信託説明書（交付目論見書）」の内容をご確認ください。

ESG GOLD

追加型投信/国内/資産複合

Capital Asset Management

お客様にご負担いただく費用

①お申込時に直接ご負担いただく費用

■ 購入時手数料：ありません

②ご解約時に直接ご負担いただく費用

■ 信託財産留保額：ありません

③投資信託の保有期間中に間接的にご負担いただく費用

■ 信託報酬：信託財産の純資産総額に対して年率2.255%（税抜2.05%）

■ その他の費用：有価証券等の取引に伴う手数料（売買委託手数料、保管手数料等）、監査費用、信託財産に関する租税、信託事務の処理等に要する諸費用等

※上記の費用（手数料等）の合計額は保有される金額および期間等により異なりますので、予め表示することができません。

※詳しくは「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。

【お申込に際してのご注意】

1.当ファンドは、「CAM ESG日本株マザーファンド」の受益証券への投資を通じて、実質的に日本の金融取引所に上場する企業の株式および金ETFなど値動きのある有価証券に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元金が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。当ファンドに生じた利益および損失は、すべて投資家の皆様に帰属することになります。投資信託は預貯金と異なります。当ファンドの基準価額は、主に以下のリスク要因により、変動することが想定されます。

2.本資料はキャピタル アセットマネジメント株式会社が作成した情報提供資料であり、金融商品取引法により義務づけられた資料ではありません。お申込の際には、投資信託説明書（交付目論見書）をあらかじめあるいは同時に渡しますので、必ず内容をご確認の上、ご自身でご判断ください。

3.この資料におけるデータ・分析等は過去の実績に基づくものであり、将来の運用成果および市場環境の変動を保証もしくは予想するものではありません。

4.本資料はキャピタル アセットマネジメント株式会社が信頼性が高いと判断した情報等に基づき作成しておりますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。

委託会社その他関係法人の概要

■ 委託会社： 信託財産の運用業務等を行います。

キャピタル アセットマネジメント株式会社

金融商品取引業者関東財務局長（金商）第383号

加入協会： 一般社団法人投資信託協会/ 一般社団法人日本投資顧問業協会

■ 受託会社： 信託財産の保管・管理業務等を行います。

三井住友信託銀行株式会社

■ 販売会社

金融商品取引業者名	登録番号	日本証券業協会	日本一般投社資団顧法人業協会	金一融一般先物取引人業協会	第二種金融商品取引業協会
キャピタル・パートナーズ証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長（金商） 第62号	○			○

記載された事項は、キャピタル アセットマネジメント株式会社が信頼できると考えられる情報に基づき作成したものですが、正確性、完全性を保証するものではありません。記載内容等は作成時点のものであり、今後予告なく変更されることがあります。

取得申込に際しては必ず「投資信託説明書（交付目論見書）」の内容をご確認ください。