

■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 | |
| 運用方針 | <p>①わが国の経済における長期的な課題である「人的資本の活用力」に優れた企業への投資を通じて、好循環経済の実現に貢献するとともに、信託財産の安定的な成長を目指します。</p> <p>②投資対象となる「人的資本の活用力」に優れた企業は、企業の「働き方の改革」への取り組みと「付加価値創出力」に着目し、厳選します。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、当社アナリストの個別企業リサーチをもとに、組入銘柄およびウェイト配分を決定します。</p> | |
| 主要投資対象 | 好循環社会促進日本株ファンド | 好循環社会促進日本株マザーファンド受益証券 |
| | 好循環社会促進日本株マザーファンド | わが国の株式 |
| 主な組入制限 | 好循環社会促進日本株ファンド | <p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の株式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。</p> <p>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30%以下とします。</p> |
| | 好循環社会促進日本株マザーファンド | <p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> |
| 分配方針 | <p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当収入と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>②収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。</p> | |

好循環社会促進 日本株ファンド

〈愛称〉 みんなのチカラ

第5期（決算日 2021年11月5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申し上げます。
さて、「好循環社会促進日本株ファンド」は、このたび第5期の決算を行いましたので、運用状況をご報告申し上げます。
今後とも引き続きお引立て賜りますようお願い申し上げます。



SOMPOアセットマネジメント

東京都中央区日本橋二丁目2番16号 共立日本橋ビル



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

お問い合わせ先



リテール営業部 0120-69-5432

（受付時間 営業日の午前9時～午後5時）

○設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 騰落率 | | | 株組入比率 | 株式先物比率 | 純資産額 |
|----------------|---------------|-----|-------|------|-------|--------|------|
| | | 税金 | 分配 | 騰落 | | | |
| (設定日) | 円 | 円 | % | % | % | % | 百万円 |
| 2016年10月25日 | 10,000 | — | — | — | — | — | 100 |
| 1期(2017年11月6日) | 12,377 | 0 | 23.8 | 98.1 | — | — | 138 |
| 2期(2018年11月5日) | 11,895 | 0 | △ 3.9 | 96.3 | — | — | 157 |
| 3期(2019年11月5日) | 13,023 | 0 | 9.5 | 97.4 | — | — | 178 |
| 4期(2020年11月5日) | 13,072 | 0 | 0.4 | 97.1 | — | — | 186 |
| 5期(2021年11月5日) | 16,412 | 0 | 25.6 | 97.9 | — | — | 239 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 基準価額及び分配金は1万口当たり(以下同じ)。

(注3) 株式組入比率および株式先物比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注4) 株式先物比率=買建比率-売建比率。

(注5) 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として、わが国の株式の中から、「好循環経済の実現」に貢献すると期待される企業へ投資するファンドです。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | | 株組入比率 | 株式先物比率 |
|------------|--------|------|------|-------|--------|
| | | 騰落 | 率 | | |
| (期首) | 円 | % | % | % | % |
| 2020年11月5日 | 13,072 | — | — | 97.1 | — |
| 11月末 | 13,835 | 5.8 | 97.7 | — | — |
| 12月末 | 14,376 | 10.0 | 98.1 | — | — |
| 2021年1月末 | 14,710 | 12.5 | 98.1 | — | — |
| 2月末 | 14,823 | 13.4 | 97.8 | — | — |
| 3月末 | 15,818 | 21.0 | 97.1 | — | — |
| 4月末 | 15,218 | 16.4 | 97.6 | — | — |
| 5月末 | 15,589 | 19.3 | 97.5 | — | — |
| 6月末 | 15,812 | 21.0 | 97.7 | — | — |
| 7月末 | 15,537 | 18.9 | 98.2 | — | — |
| 8月末 | 16,072 | 22.9 | 98.0 | — | — |
| 9月末 | 16,509 | 26.3 | 97.2 | — | — |
| 10月末 | 16,255 | 24.3 | 97.9 | — | — |
| (期末) | | | | | |
| 2021年11月5日 | 16,412 | 25.6 | 97.9 | — | — |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

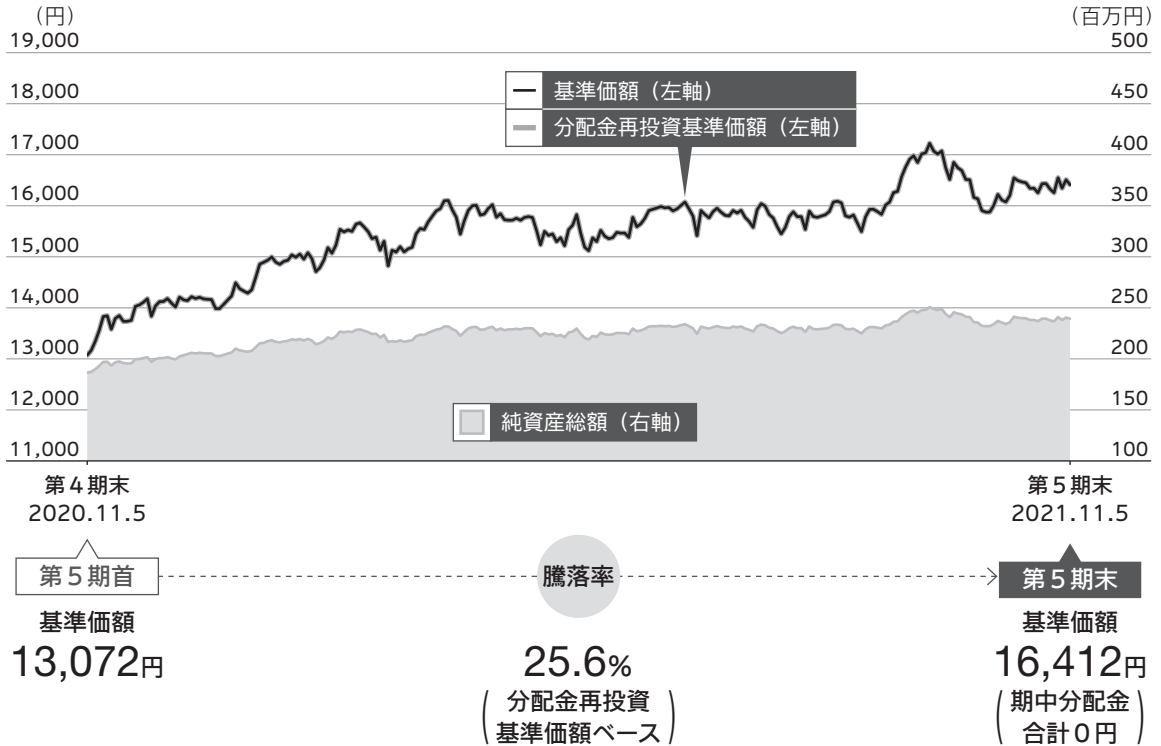
(注2) 株式組入比率および株式先物比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注3) 株式先物比率=買建比率-売建比率。

(注4) 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として、わが国の株式の中から、「好循環経済の実現」に貢献すると期待される企業へ投資するファンドです。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

運用経過

● 基準価額の推移



- 分配金再投資基準価額の推移は、2020年11月5日の基準価額をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 分配金再投資基準価額は、収益分配金（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。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として、わが国の株式の中から、「好循環経済の実現」に貢献すると期待される企業へ投資するファンドです。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載していません。

● 基準価額の主な変動要因

好循環社会促進日本株ファンド

高位に組入れていたマザーファンドの基準価額が上昇したため、当ファンドの基準価額も上昇しました。

好循環社会促進日本株マザーファンド

期中の騰落率は+27.4%となりました。

国内株式市場が上昇する中、期を通じて株式を高位に組入れていたマザーファンドの基準価額も上昇しました。個別銘柄では、デンソー、セブン&アイ・ホールディングス、ブリヂストンなどの保有銘柄が上昇したことで基準価額は上昇しました。

- 本報告書では、ベビーファンドとマザーファンドを下記の様に統一して表記しています。

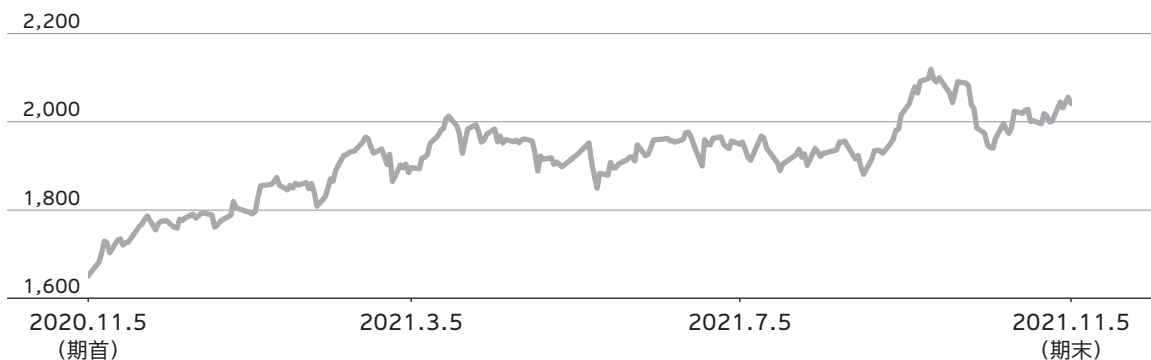
 ベビーファンド  マザーファンド

● 投資環境

TOPIXは23.7%の上昇となりました。

期初は、米国大統領選挙においてバイデン氏の当選が確実となり、米国政治の先行き不透明感が後退したことや、新型コロナウイルスワクチンの開発が進み経済正常化への期待が高まったことが好感され、上昇しました。2021年の年明けには、米国で民主党が上下両院において過半数を獲得したことや、国内外企業の好調な決算発表が好感されて株価は続伸しました。その後は、ワクチン接種の進展を背景とした経済正常化への期待と新型コロナウイルスの感染再拡大の懸念が綱引きする一進一退の展開となり、ほぼ横ばいで推移する期間が長く継続しました。期末にかけては、新首相誕生への期待感からバブル期以来の高値水準まで上昇しましたが、原油などの高騰や米国長期金利の上昇などを背景に上げ幅は縮小しました。

TOPIX（東証株価指数）の推移



(出所：Bloomberg)

● 当該投資信託のポートフォリオ

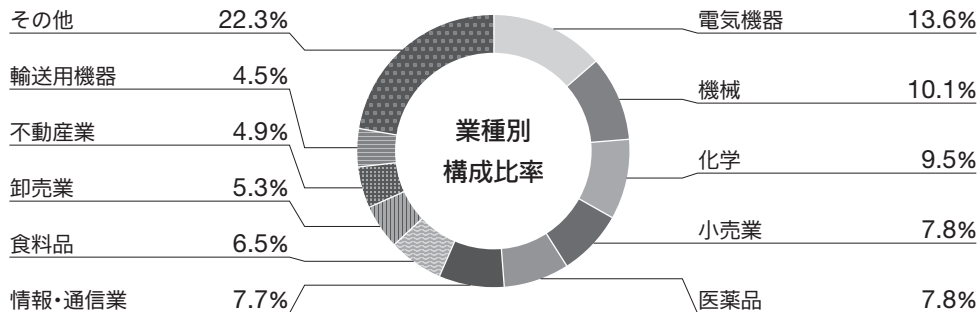
期を通して好循環社会促進日本株マザーファンドの組入比率を高位に維持しました。

好循環社会促進日本株マザーファンド

期を通して株式の組入比率を高位に維持しました。

期末時点での業種別構成比率はグラフのとおりです。

当期間中は、働き方改革への取り組みや付加価値創出力に加え、投資魅力度の両面からの分析により銘柄入れ替えを行いました。日本電産、ダイキン工業、HOYA、シスメックスを売却した一方で、SCSK、スタンレー電気、ピジョン、不二製油グループ本社を購入しました。



注1. 比率は、第5期末における国内株式の評価総額に対する各業種の評価額の割合。

注2. 端数処理の関係上、構成比合計が100%と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、マザーファンドへの投資を通じて、主として、わが国の株式の中から、「好循環経済の実現」に貢献すると期待される企業へ投資するファンドです。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

● 分配金

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、次表の通りと致しました。なお、収益分配に充てなかった収益については、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて引き続き元本と同一の運用を行います。

分配原資の内訳 (単位：円、1万口当たり・税引前)

| 項目 | 第5期 2020.11.6~2021.11.5 |
|-----------|----------------------------|
| 当期分配金 | — |
| (対基準価額比率) | —% |
| 当期の収益 | — |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 6,412 |

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」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

注2. 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税引前）に合致しない場合があります。

注3. 当期分配金の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、ファンドの収益率とは異なります。

中長期的な観点から、複利効果による資産の成長を目指すために分配を抑えるファンドです。

● 今後の運用方針

好循環社会促進日本株ファンド

今後も、マザーファンド受益証券の組入水準を高位に維持することで、信託財産の着実な成長を目指します。

好循環社会促進日本株マザーファンド

当ファンドは企業の「働き方の改革」への取り組みと「付加価値創出力」に着目し、投資銘柄を厳選しており、今後もこの運用方針を堅持します。少子高齢化・人口減少が進行する日本においては、成長制約打破のため労働力人口の確保が不可欠となっており、人的資本の有効活用が企業の競争優位性に直結する時代となっています。今後も、日本経済の長期的な課題である人的資本の活用力に優れ、好循環経済の実現に貢献すると期待される企業への投資を通じて、信託財産の安定的な成長を目指します。

● 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第5期 2020.11.6~2021.11.5 | | 項目の概要 |
|-------------|----------------------------|--------------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 191円 | 1.243% | (a)信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率(年率)× $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は15,379円です。 |
| (投信会社) | (85) | (0.550) | ファンドの運用の対価 |
| (販売会社) | (102) | (0.660) | 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) | (5) | (0.033) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | 6 | 0.041 | (b)売買委託手数料= $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (株式) | (6) | (0.041) | |
| (c) その他費用 | 2 | 0.015 | (c)その他費用= $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ |
| (監査費用) | (2) | (0.015) | 監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用 |
| (その他) | (0) | (0.000) | 信託事務の処理にかかるその他の費用等 |
| 合計 | 199 | 1.299 | |

注1. 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、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンド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。

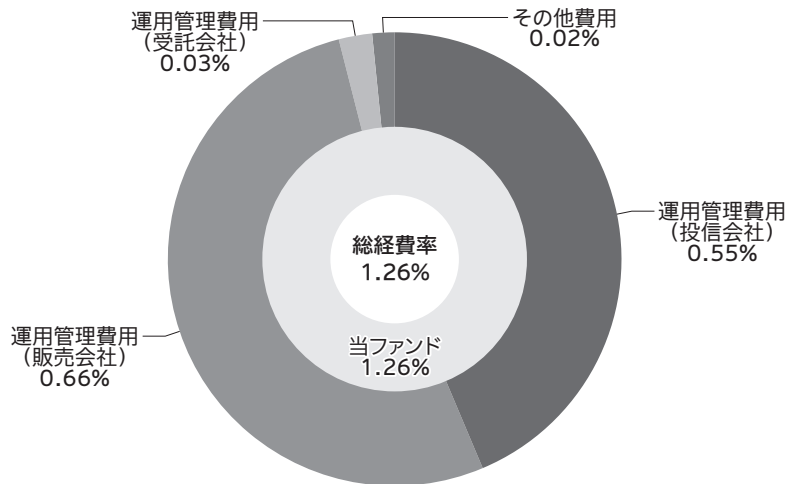
注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

注3. 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。

(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1.26%**です。



注1. 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2. 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3. 各比率は、年率換算した値です。

注4. 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5. 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

(2020年11月6日～2021年11月5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 |
| 好循環社会促進日本株マザーファンド | 千口 5,452 | 千円 8,690 | 千口 4,212 | 千円 6,870 |

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 金額は受渡代金。

○株式売買比率

(2020年11月6日～2021年11月5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 | |
|---------------------|-------------------|--|
| | 好循環社会促進日本株マザーファンド | |
| (a) 期中の株式売買金額 | 139,452千円 | |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 218,358千円 | |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.63 | |

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) (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

(2020年11月6日～2021年11月5日)

該当事項はございません。

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

(2021年11月5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 |
| 好循環社会促進日本株マザーファンド | 千口 133,591 | 千口 134,831 | 千円 236,764 |

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 当ファンドは、当期末において、直接投資をする株式及び新株予約権証券の組入れはありません。

○投資信託財産の構成

(2021年11月5日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------|---------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 好循環社会促進日本株マザーファンド | 千円 236,764 | % 98.4 |
| ユール・ローン等、その他 | 3,927 | 1.6 |
| 投資信託財産総額 | 240,691 | 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 (2021年11月5日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 240,691,563 |
| コール・ローン等 | 3,926,919 |
| 好循環社会促進日本株マザーファンド(評価額) | 236,764,644 |
| (B) 負債 | 1,490,994 |
| 未払解約金 | 20,787 |
| 未払信託報酬 | 1,452,897 |
| 未払利息 | 11 |
| その他未払費用 | 17,299 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 239,200,569 |
| 元本 | 145,743,376 |
| 次期繰越損益金 | 93,457,193 |
| (D) 受益権総口数 | 145,743,376口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 16,412円 |

(注1) 信託財産に係る期首元本額142,511,300円、期中追加設定元本額11,248,652円、期中一部解約元本額8,016,576円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額 1.6412円

○損益の状況 (2020年11月6日～2021年11月5日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 2,495 |
| 支払利息 | △ 2,495 |
| (B) 有価証券売買損益 | 49,140,904 |
| 売買益 | 50,801,990 |
| 売買損 | △ 1,661,086 |
| (C) 信託報酬等 | △ 2,822,185 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 46,316,224 |
| (E) 前期繰越損益金 | 32,395,133 |
| (F) 追加信託差損益金 | 14,745,836 |
| (配当等相当額) | (11,755,727) |
| (売買損益相当額) | (2,990,109) |
| (G) 計(D+E+F) | 93,457,193 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 93,457,193 |
| 追加信託差損益金 | 14,745,836 |
| (配当等相当額) | (11,784,212) |
| (売買損益相当額) | (2,961,624) |
| 分配準備積立金 | 78,711,357 |

(注1) 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) 信託報酬等には、消費税相当額を含めて表示しております。

(注3) 追加信託差損益金とは、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。

(注4) 分配金の計算過程(2020年11月6日～2021年11月5日)は以下の通りです。

| 項 目 | 2020年11月6日～ 2021年11月5日 |
|---------------------|---------------------------|
| a. 配当等収益(費用控除後) | 4,140,388円 |
| b. 有価証券等損益額(費用控除後) | 41,922,448円 |
| c. 信託約款に規定する収益調整金 | 14,745,836円 |
| d. 信託約款に規定する分配準備積立金 | 32,648,521円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 93,457,193円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 6,412円 |
| g. 分配金 | 0円 |

好循環社会促進日本株マザーファンド

運用報告書

第5期（決算日 2021年11月5日）

＜計算期間 2020年11月6日～2021年11月5日＞

好循環社会促進日本株マザーファンドの第5期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。

| | |
|--------|---|
| 信託期間 | 無期限 |
| 運用方針 | わが国の株式の中から、「好循環経済の実現」に貢献すると期待される企業へ投資し、信託財産の安定的な成長を目指します。 |
| 主要投資対象 | わが国の株式 |
| 主な組入制限 | 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、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 |

○設定以来の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 | 期 騰 落 中 率 | | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 純 総 資 産 額 |
|----------------|---------|-----------|------|-----------|-----------|-----------|
| | | 期 騰 落 | 中 率 | | | |
| (設定日) | 円 | | % | % | % | 百万円 |
| 2016年10月25日 | 10,000 | | — | — | — | 99 |
| 1期(2017年11月6日) | 12,556 | | 25.6 | 99.2 | — | 136 |
| 2期(2018年11月5日) | 12,218 | △ | 2.7 | 97.5 | — | 155 |
| 3期(2019年11月5日) | 13,556 | | 11.0 | 98.3 | — | 176 |
| 4期(2020年11月5日) | 13,784 | | 1.7 | 98.2 | — | 184 |
| 5期(2021年11月5日) | 17,560 | | 27.4 | 98.9 | — | 236 |

(注1) 基準価額は1万口当たり（以下同じ）。

(注2) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

(注3) 当ファンドは、主として、わが国の株式の中から、「好循環経済の実現」に貢献すると期待される企業へ投資するファンドです。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 | 月 | 日 | 基 準 | 価 額 | | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 |
|---|------------|---|--------|-------|-------|-----------|-----------|
| | | | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| | (期 首) | | 円 | % | % | % | % |
| | 2020年11月5日 | | 13,784 | — | 98.2 | — | — |
| | 11月末 | | 14,609 | 6.0 | 98.6 | — | — |
| | 12月末 | | 15,201 | 10.3 | 99.1 | — | — |
| | 2021年1月末 | | 15,574 | 13.0 | 99.1 | — | — |
| | 2月末 | | 15,709 | 14.0 | 99.0 | — | — |
| | 3月末 | | 16,790 | 21.8 | 98.1 | — | — |
| | 4月末 | | 16,163 | 17.3 | 98.4 | — | — |
| | 5月末 | | 16,579 | 20.3 | 98.5 | — | — |
| | 6月末 | | 16,836 | 22.1 | 98.7 | — | — |
| | 7月末 | | 16,558 | 20.1 | 99.1 | — | — |
| | 8月末 | | 17,154 | 24.4 | 99.0 | — | — |
| | 9月末 | | 17,643 | 28.0 | 98.2 | — | — |
| | 10月末 | | 17,386 | 26.1 | 98.9 | — | — |
| | (期 末) | | | | | | |
| | 2021年11月5日 | | 17,560 | 27.4 | 98.9 | — | — |

(注1) 騰落率は期首比。

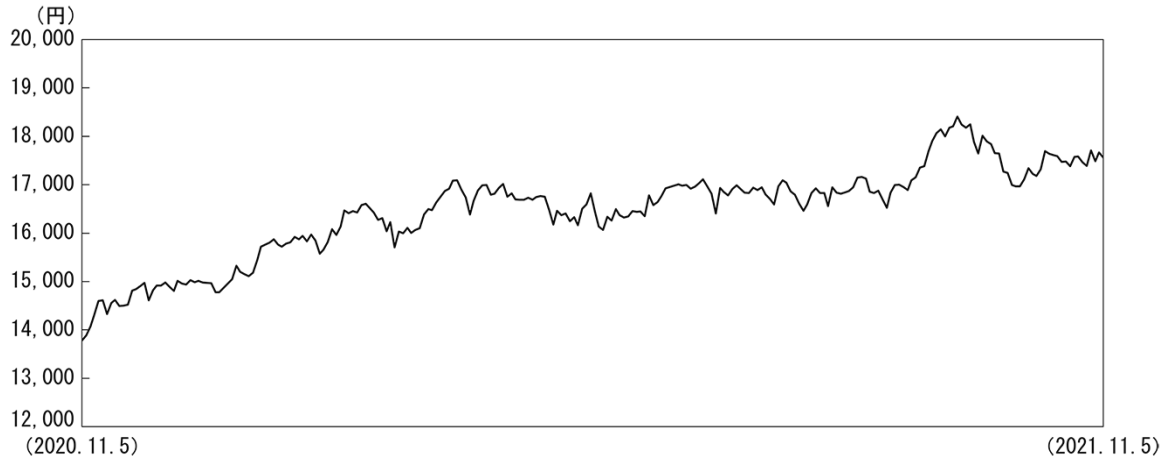
(注2) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

(注3) 当ファンドは、主として、わが国の株式の中から、「好循環経済の実現」に貢献すると期待される企業へ投資するファンドです。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

○運用経過

(2020年11月6日～2021年11月5日)

■基準価額の推移



期首：13,784円
 期末：17,560円
 騰落率：27.4%

P 2～P 7をご参照下さい。

○1万口当たりの費用明細

(2020年11月6日～2021年11月5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 (7) | % (0.041) | (a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (b) そ の 他 費 用 (そ の 他) | 0 (0) | 0.000 (0.000) | (b) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 信託事務の処理にかかるその他の費用等 |
| 合 計 | 7 | 0.041 | |
| 期中の平均基準価額は16,350円です。 | | | |

(注1) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

○売買及び取引の状況

(2020年11月6日～2021年11月5日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---|----|-------|--------|-----|--------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国 | 上場 | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| 内 | | 23 | 73,147 | 14 | 66,305 |
| | | (1) | (-) | | |

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) ()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おりません。

○株式売買比率

(2020年11月6日～2021年11月5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 | 139,452千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 218,358千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.63 |

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) (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

(2020年11月6日～2021年11月5日)

該当事項はございません。

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

(2021年11月5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 |
| 食料品 (6.5%) | | | |
| ヤクルト本社 | 0.7 | 0.8 | 4,680 |
| 不二製油グループ本社 | — | 1.4 | 3,817 |
| 味の素 | 1.8 | 1.9 | 6,680 |
| 繊維製品 (3.9%) | | | |
| 東レ | 8 | 7.5 | 5,606 |
| ワコールホールディングス | — | 1.6 | 3,600 |
| 化学 (9.5%) | | | |
| 旭化成 | 4.4 | 4.8 | 5,512 |
| 積水化学工業 | 2.2 | 2.5 | 4,880 |
| 花王 | 0.8 | 1.2 | 7,598 |
| 太陽ホールディングス | 0.5 | 1.4 | 4,256 |
| ニフコ | 1.1 | — | — |
| 医薬品 (7.8%) | | | |
| アステラス製薬 | 3.6 | 4.1 | 8,169 |
| 塩野義製薬 | 0.8 | 0.8 | 6,014 |
| ツムラ | 0.9 | 1.1 | 4,020 |
| ゴム製品 (3.3%) | | | |
| ブリヂストン | 1.6 | 1.5 | 7,690 |
| 金属製品 (2.1%) | | | |
| リンナイ | 0.3 | 0.4 | 4,808 |
| 機械 (10.1%) | | | |
| 小松製作所 | 2.3 | 2.7 | 8,248 |
| クボタ | 2.5 | 2.7 | 6,729 |
| ダイキン工業 | 0.3 | — | — |
| タダノ | 3.4 | 3.3 | 3,785 |
| マキタ | 0.8 | 0.9 | 4,793 |
| 電気機器 (13.6%) | | | |
| 日本電産 | 0.7 | — | — |
| アンリツ | — | 2.1 | 4,191 |
| 堀場製作所 | 0.5 | 0.5 | 3,865 |
| シスメックス | 0.4 | — | — |
| スタンレー電気 | — | 1.5 | 4,450 |
| ファナック | 0.4 | 0.4 | 9,102 |
| 村田製作所 | 0.9 | 1.2 | 10,294 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | |
|----------------------|---------|-------|--------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 輸送用機器 (4.5%) | | | | |
| デンソー | 1.5 | 1.3 | 10,587 | |
| 精密機器 (—%) | | | | |
| HOYA | 0.5 | — | — | |
| その他製品 (3.0%) | | | | |
| フジシールインターナショナル | — | 1.4 | 3,578 | |
| ビジョン | — | 1.5 | 3,453 | |
| 陸運業 (2.2%) | | | | |
| 東急 | 2.4 | 3.1 | 5,118 | |
| 情報・通信業 (7.7%) | | | | |
| KDDI | 3.6 | 4.1 | 14,149 | |
| SCSK | — | 1.8 | 3,985 | |
| 卸売業 (5.3%) | | | | |
| 伊藤忠商事 | 2.5 | 2.7 | 8,818 | |
| トラスコ中山 | 1.1 | 1.3 | 3,542 | |
| 小売業 (7.8%) | | | | |
| セブン&アイ・ホールディングス | 1.7 | 1.7 | 8,568 | |
| 良品計画 | 1.5 | — | — | |
| ユナイテッドアローズ | 1.8 | 2.1 | 4,876 | |
| 丸井グループ | 1.6 | 2.1 | 4,874 | |
| 保険業 (4.3%) | | | | |
| 東京海上ホールディングス | 1.2 | 1.7 | 10,167 | |
| 不動産業 (4.9%) | | | | |
| パーク24 | 1.9 | 2.1 | 3,855 | |
| 三菱地所 | 3.4 | 4.4 | 7,596 | |
| サービス業 (3.5%) | | | | |
| 総合警備保障 | 0.6 | 0.8 | 3,872 | |
| EPSホールディングス | 2.8 | — | — | |
| メイテック | 0.5 | 0.6 | 4,236 | |
| 計 | 株数・金額 | 67 | 79 | 234,072 |
| | 銘柄数<比率> | 39 | 39 | <98.9%> |

(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。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年11月5日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 234,072 | 98.9 |
| コール・ローン等、その他 | 2,696 | 1.1 |
| 投資信託財産総額 | 236,768 | 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 (2021年11月5日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 236,768,055 |
| コール・ローン等 | 747,927 |
| 株式(評価額) | 234,072,850 |
| 未収配当金 | 1,947,278 |
| (B) 負債 | 2 |
| 未払利息 | 2 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 236,768,053 |
| 元本 | 134,831,802 |
| 次期繰越損益金 | 101,936,251 |
| (D) 受益権総口数 | 134,831,802口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 17,560円 |

(注1) 信託財産に係る期首元本額133,591,580円、期中追加設定元本額5,452,770円、期中一部解約元本額4,212,548円

(注2) 期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託ごとの元本の内訳

好循環社会促進日本株ファンド 134,831,802円

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 1.7560円

○損益の状況 (2020年11月6日～2021年11月5日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 4,395,186 |
| 受取配当金 | 4,396,780 |
| その他収益金 | 197 |
| 支払利息 | △ 1,791 |
| (B) 有価証券売買損益 | 46,416,405 |
| 売買益 | 51,605,020 |
| 売買損 | △ 5,188,615 |
| (C) 保管費用等 | △ 8 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 50,811,583 |
| (E) 前期繰越損益金 | 50,544,890 |
| (F) 追加信託差損益金 | 3,237,230 |
| (G) 解約差損益金 | △ 2,657,452 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 101,936,251 |
| 次期繰越損益金(H) | 101,936,251 |

(注1) 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) 追加信託差損益金とは、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。

(注3) 解約差損益金とは、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。