

使用開始日  
2024年12月28日

## One国内株式ESGフォーカスファンド <DC年金>

追加型投信／国内／株式

商品分類			属性区分			
単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態
追加型	国内	株式	その他資産 (投資信託証券*)	年1回	日本	ファミリー ファンド

※投資信託証券への投資を通じて実質的な投資対象とする資産は、「株式 一般」です。

◆上記の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

この目論見書により行う「One国内株式ESGフォーカスファンド<DC年金>」の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第5条の規定により、有価証券届出書を2024年12月27日に関東財務局長に提出しており、2024年12月28日にその効力が生じております。

■本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

■ファンドに関する金融商品取引法第15条第3項に規定する目論見書(以下、「請求目論見書」といいます。)は、委託会社のホームページで閲覧できます。

本書には約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。なお、販売会社に請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。

■ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)に基づき事前に受益者の意向を確認いたします。

■ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

■ファンドの販売会社、基準価額等については委託会社の照会先までお問い合わせください。

〈委託会社〉[ファンドの運用の指図を行う者]

### アセットマネジメントOne 株式会社

金融商品取引業者登録番号:関東財務局長(金商)第324号  
設立年月日:1985年7月1日  
資本金:20億円(2024年9月末現在)  
運用する投資信託財産の合計純資産総額:19兆2,482億円  
(2024年9月末現在)

委託会社への照会先

【コールセンター】

0120-104-694

(受付時間:営業日の午前9時～午後5時)

【ホームページアドレス】

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

〈受託会社〉[ファンドの財産の保管および管理を行う者]

### みずほ信託銀行株式会社

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。



# ファンドの目的・特色

## ファンドの目的

信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。

## ファンドの特色

**1** 主として、国内株式ESGフォーカス・マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)への投資を通じて、わが国の株式に実質的に投資を行い、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)をベンチマークとして中長期的な観点でこれを上回る投資成果と持続可能な社会の実現の促進をめざします。

- 当ファンドおよびマザーファンドにおいては、わが国の金融商品取引所に上場する株式(上場予定を含みます。)を主要投資対象とします。
- マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。
- 当ファンドは、組入銘柄のうちESGを主要な要素として選定する銘柄の組入比率を合計70%以上とすることを目標としています。

**2** ESGの3要素(環境・社会・企業統治)のいずれかの観点から企業価値の向上が期待できる銘柄として、環境・社会に関する課題を解決する事業を行う企業や、課題解決へ向けた環境変化に積極的に対応ができる企業統治に優れた企業を組入候補として選定します。

- 「ESG」とは、環境(Environment)、社会(Social)、企業統治(Governance)の略称です。
- 環境・社会に関する課題の特定にあたっては、持続可能な社会の実現に向けた重要性と企業業績への影響の大きさを勘案します。
- 環境・社会に関する課題を解決する事業を行う企業として選定する銘柄は、企業に求められる最低要求水準<sup>(\*)</sup>を満たしながら、事業内容に即した環境か社会もしくはその両方の課題を解決することが期待される銘柄です。  
(\*) 要求水準は、委託会社が特に重要と考える課題に関して設定します。業種や企業が経済活動を行う国等により異なり、社会の環境変化等を踏まえて定期的に見直しを行います。
- 課題解決へ向けた環境変化に積極的に対応ができる企業統治に優れた企業として選定する銘柄は、企業に求められる最低要求水準を超えて、持続可能な社会の実現のための課題に対して先んじて行動していると期待される銘柄です。
- 持続可能な社会の実現において特に重要な課題<sup>(\*)</sup>に関して、企業に求められる要求水準を策定し、ESG調査対象のすべての企業に対してその要求水準に対する取り組み状況を把握の上、ESGの観点から企業価値の棄損の可能性が高い銘柄は組入候補から除外します。  
(\*) 特に重要な課題は、社会の環境変化等により変更される場合があります。



# ファンドの目的・特色

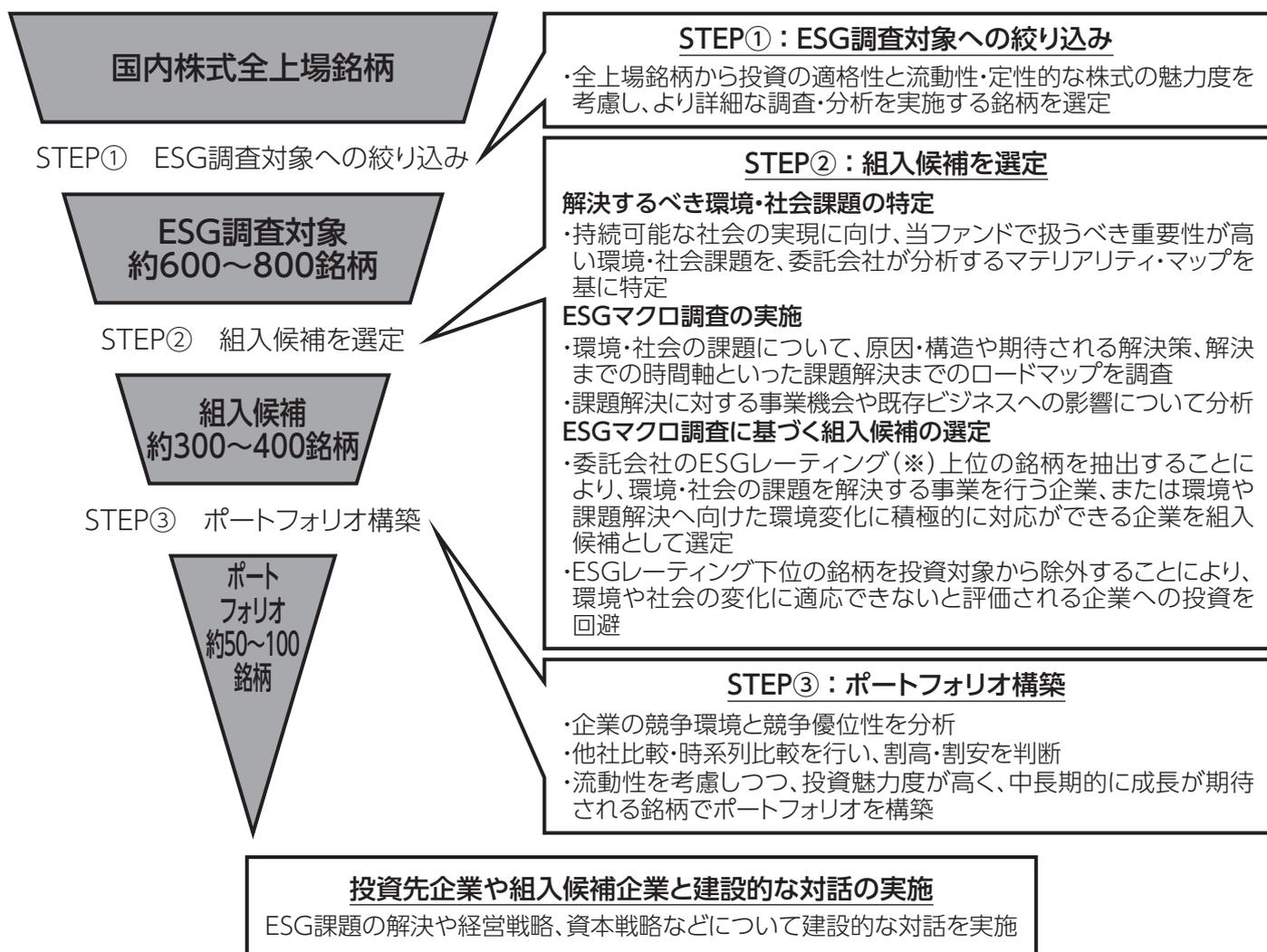
**3** ポートフォリオの構築にあたっては、企業の競争環境および競争優位性の分析を行い、バリュエーション等を勘案の上、投資魅力度が高い銘柄に投資を行います。

**4** 持続可能な社会の実現の促進をめざし、投資先企業や組入候補となる企業に対してエンゲージメント(\*)を行います。

(\*)「エンゲージメント」とは、企業と建設的な目的をもった対話を行うことで、企業価値の向上や持続的な成長、企業が抱える課題の解決などを促すための活動です。

## 運用プロセス

当ファンドは、ESGを重要な要素と位置づけて運用を行います。



### (※)ESGレーティングとは

委託会社は、独自に策定したマテリアリティ・マップにおける重要な環境・社会課題への企業の対応力を評価して、ESGレーティングを算出しています。このESGレーティングは、マテリアリティ・マップに示す委託会社が重視するグローバルな環境・社会課題への企業の取り組みを評価して点数化し、レーティング(Aが最良でFまで付与)に変換したものです。なお、当ファンドではESGレーティングがA~Cの企業を中心に組入れを行います。一方で、原則としてESGレーティングがF(最低ランク)の企業の組入れは行いません。

※上記はマザーファンドの運用プロセスです。

※運用プロセスおよび委託会社のESGレーティングは、2024年9月末時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。



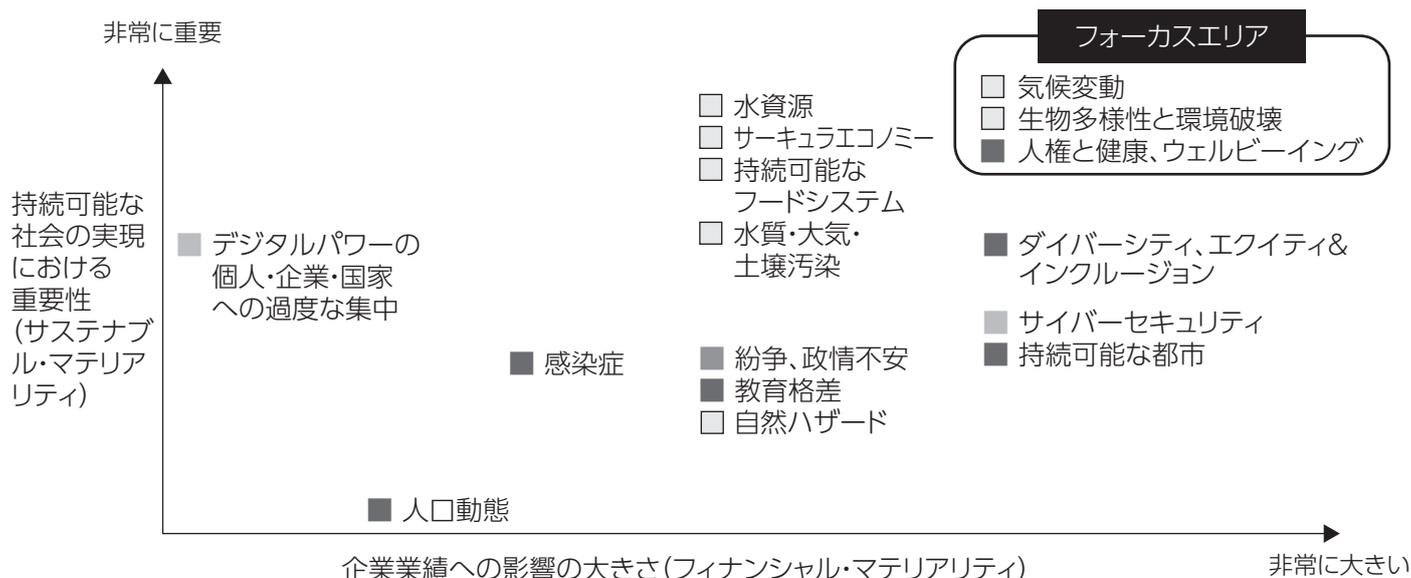
# ファンドの目的・特色

## ポイント① マテリアリティ・マップにおける課題の特定

- 委託会社では、持続可能な社会の実現に向けた重要性と企業業績への影響の大きさを勘案し、委託会社として考える取り組むべき環境・社会の課題を捉えた「マテリアリティ・マップ」を策定します。このマテリアリティ・マップの中から、より持続可能な社会に向けて重大なものかつ企業業績に大きな影響がある課題(特に重要な課題)については、フォーカスエリアとして位置付けます。
- 当ファンドでは、このような課題の重要性に関する分析を基に投資機会の発掘やリスクの把握に努めます。環境・社会に関する課題の解決に貢献する企業や環境・社会の課題が迫るビジネス環境の変化により早く上手に対応する企業は、社会全体が持続可能な形態に移行するにつれて、その持続的な成長性や競争優位性が評価されるとみられることから、これら企業による取り組みの成果は、当ファンドにおいて継続的なリターンの獲得やベンチマークに対する超過収益の源泉となることが期待されます。

- ESGマクロ調査を通じた銘柄選定においては、マテリアリティ・マップに挙げられている課題すべてに着目します。
- フォーカスエリアは、企業に求められる要求水準の策定およびエンゲージメントの実施において活用します。

### マテリアリティ・マップ(イメージ図)



※上記は、2024年9月末現在の委託会社のマテリアリティ・マップにおいて委託会社がフォーカスエリアと位置付ける社会課題の全てと、その他の社会課題から一部抜粋した課題をもとに作成したイメージ図です。マテリアリティ・マップの内容は、社会環境等によって変更する場合があります。

### フォーカスエリアにおける課題と問題意識

課題	問題意識
気候変動	気候変動リスクの低減には脱炭素社会への転換と大きな投資の流れが必要。
生物多様性と環境破壊	生物多様性の回復には人口増加に応じて地球環境に負荷をかける経済システムからの脱却が必要。
人権と健康、ウェルビーイング	持続可能な社会の実現には、すべての人の人権が尊重され、ウェルビーイング(心身ともに健康で仕事や地域社会で自分らしさを発揮し満たされた状態であること)が実感できる社会であることが必要。

※上記の内容は、2024年9月末時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。



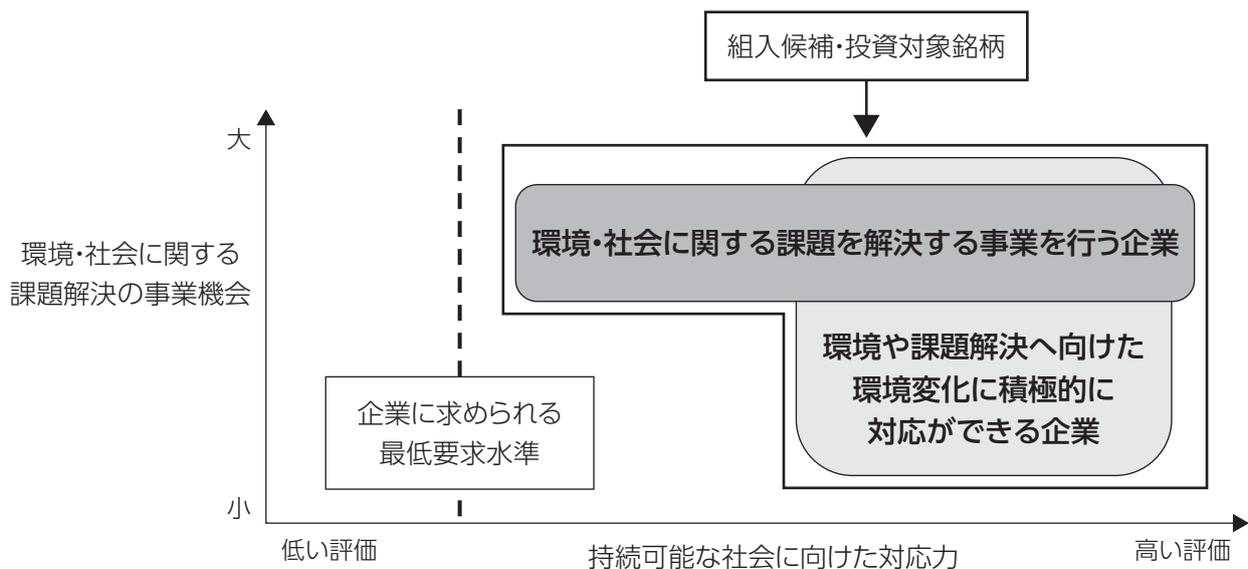
# ファンドの目的・特色

## ポイント② ESGマクロ調査に基づく銘柄選択

- ESGマクロ調査として、マテリアリティ・マップを基に、環境・社会の課題について、原因・構造や期待される解決策、解決までの時間軸といった課題解決までのロードマップを調査し、課題解決に対する事業機会や既存ビジネスへの影響について分析します。
- 上記の分析結果を踏まえ、環境や社会の課題を解決する事業を行う企業および課題解決へ向けた環境変化に積極的に対応ができる企業の抽出を行います。また、フォーカスエリアに関して、持続可能な社会に向けた取り組みとして企業に求められる要求水準を策定し、ESG調査対象のすべての企業に対して、その要求水準に対する取り組み状況を把握し、ESGの観点から企業価値の棄損の可能性が高い銘柄は組入候補から除外します。

### 組入候補および投資対象と要求水準のイメージ

- 組入候補・投資対象銘柄は、企業に求められる最低要求水準を満たした上で、環境・社会に関する課題を解決する事業を行う企業や、環境や課題解決へ向けた環境変化に積極的に対応ができる企業です。



※要求水準は、業種や企業が経済活動を行う国等により異なり、社会の環境変化等を踏まえて定期的に見直しを行います。

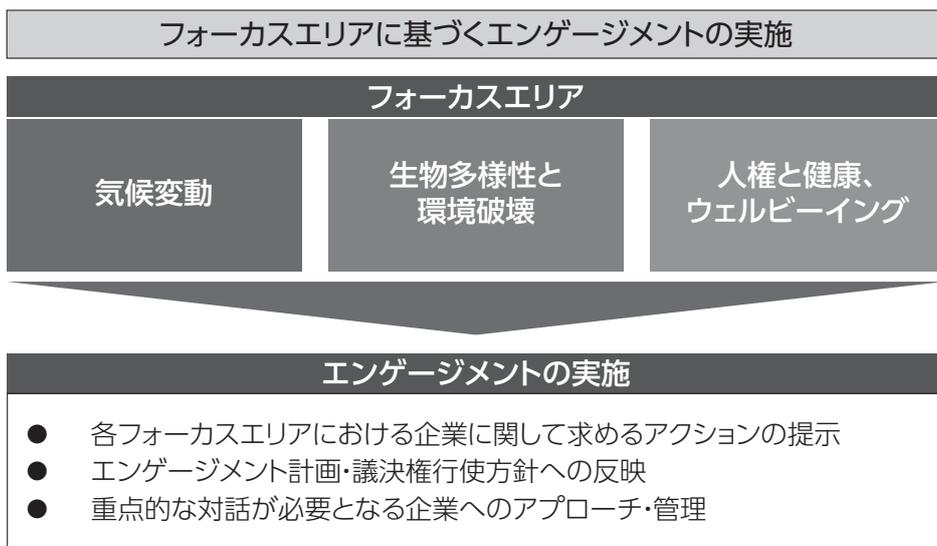
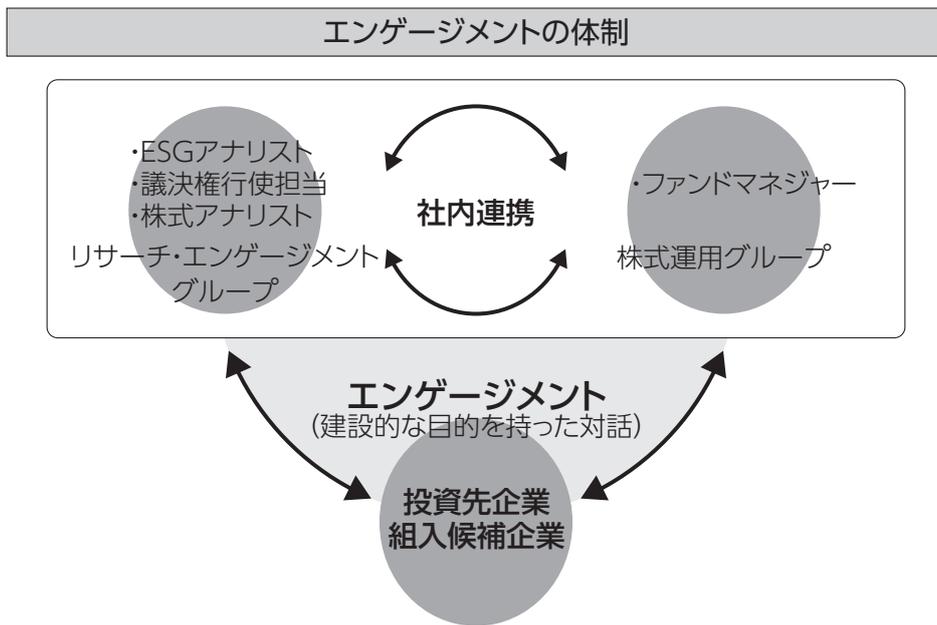
※上記の内容は、2024年9月末時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。



# ファンドの目的・特色

## ポイント③ 持続可能な社会の実現に向けたエンゲージメント

- 投資先企業や組入候補となる企業のうち課題対応により改善が見込まれる企業に対して、重点的にエンゲージメントを行うことで、持続可能な社会の実現の促進をめざします。
- 持続可能な社会の実現に向けた重要性が高く、企業業績への影響が大きいフォーカスエリアについて、ファンドマネジャーや株式アナリスト、ESGアナリストが協働してエンゲージメントを行います。企業との対話に際しては、企業ごとに取り組むべき課題と目標を設定し、目標に対する進捗状況を管理しながら、投資家の立場から課題解決への働きかけを行います。



※上記の内容は、2024年9月末時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。



# ファンドの目的・特色

## 委託会社のスチュワードシップ方針

- 委託会社は、スチュワードシップ活動における適切な体制とガバナンスの下、財務情報のみならず、ESG（環境・社会・ガバナンス）要因等の非財務情報も考慮し、投資先企業との建設的な「目的を持った対話」（エンゲージメント）や議決権行使を行うことで、お客さまの中長期的な投資収益の拡大をめざします。
- 委託会社は、投資先企業とのエンゲージメントや議決権行使等、スチュワードシップ責任を果たすための活動状況等について、委託会社ホームページ等を通じ、定期的に報告いたします。

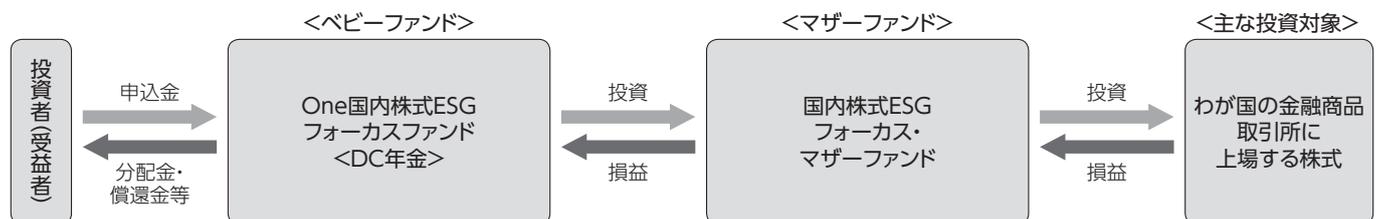
※詳細は、委託会社のホームページ (<https://www.am-one.co.jp/company/stewardship/>) をご覧ください。

※上記の内容は、2024年9月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

## ■ ファンドの仕組み

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド(当ファンド)とし、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。



## ■ 主な投資制限

- ・マザーファンドへの投資割合には、制限を設けません。
- ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ・外貨建資産への投資は行いません。
- ・マザーファンド以外の投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ・デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。
- ・1発行体等当たりの株式等、債券等およびデリバティブ等の信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とします。
- ・非株式(株式以外の資産)への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。



# ファンドの目的・特色

## ■ 配分方針

年1回の決算時(毎年9月27日(休業日の場合は翌営業日))に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

※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。

※分配金額は、配分方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

## ■ マザーファンドの概要

ファンド名	国内株式ESGフォーカス・マザーファンド
主要投資対象	わが国の金融商品取引所に上場する株式(上場予定を含みます。)
投資態度	<p>①主として、わが国の金融商品取引所に上場する株式(上場予定を含みます。)に投資を行い、持続可能な社会の実現の促進および、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)をベンチマークとして中長期的な観点でこれを上回る投資成果をめざします。</p> <p>②環境・社会に関する課題を解決する事業を行う企業や、課題解決へ向けた環境変化に積極的に対応ができる企業統治に優れた企業を選別し、ESG(*)の観点から企業価値の向上が期待できる銘柄を組入候補として選定します。なお、ESGの観点から企業価値の棄損の可能性が高い銘柄は除外します。</p> <p>(*)「ESG」とは、環境(Environment)、社会(Social)、企業統治(Governance)の略称です。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、企業の競争環境および競争優位性の分析を行い、バリュエーション等を勘案の上、投資魅力が高い銘柄に投資を行います。</p> <p>④株式の組入比率は、原則として高位を維持します。</p> <p>⑤非株式(株式以外の資産)への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>⑥信託財産の効率的な運用のために上場投資信託証券に投資を行う場合があります。また、株価指数先物取引等を活用する場合があります。</p>

○マザーファンドの主な投資制限については、請求目論見書または約款に記載しております。

### 指数の著作権等

東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)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(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。



# 投資リスク

## 基準価額の変動要因

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

### 株価変動 リスク

**投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。**

株式の価格は、国内外の政治・経済・社会情勢の変化、発行企業の業績・経営状況の変化、市場の需給関係等の影響を受け変動します。株式市場や当ファンドが実質的に投資する企業の株価が下落した場合には、その影響を受け、基準価額が下落する要因となります。

また、当ファンドは実質的に企業のESGへの取組みを考慮した投資を行うことから、投資対象が株式市場全体と比べて特定の銘柄や業種に偏ることがあり、このため基準価額の変動が株式市場全体の動向から乖離することや、株式市場が上昇する場合でも基準価額が下落する場合があります。

### 信用 リスク

**投資する有価証券の発行者の財政難・経営不安・倒産等の発生は、基準価額の下落要因となります。**

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。当ファンドが実質的に投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合、信用格付けが格下げされた場合等には、株式の価格が下落したり、その価値がなくなることがあり、基準価額が下落する要因となります。

### 流動性 リスク

**投資資産の市場規模が小さいことなどで希望する価格で売買できない場合は、基準価額の下落要因となります。**

有価証券等を売却または取得する際に市場規模や取引量、取引規制等により、その取引価格が影響を受ける場合があります。一般に市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす要因となります。

### ESG情報・ 評価に関連 する制約

**ESG情報や評価の入手・収集の制約は、運用に影響を及ぼす要因となる場合があります。**

当ファンドで勘案するESG情報は、委託会社が独自調査で入手した情報だけでなく、第三者のESG情報ベンダーによる情報や評価が含まれている場合があります。これらのESG情報は、企業開示や企業アンケート、取材等により入手・収集されますが、ESG情報ベンダーからの提供情報は、当該情報ベンダーの情報収集力により情報量が制限されることがあります。また、企業によって開示された情報やメディアによって報道される情報は、タイムリーに評価結果に反映されないことがあります。また、委託会社および情報ベンダーによる評価基準の変更により、過去からの情報継続性が失われることがあります。

※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。



# 投資リスク

## その他の留意点

- 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。
- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- 収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。
  - ・収益分配は、計算期間中に発生した運用収益(経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。))を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
  - ・受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のこと、受益者毎に異なります。
  - ・分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。
- 当ファンドはベンチマークを採用しておりますが、ベンチマークは市場の構造変化等の影響により今後見直す場合があります。また、当ファンドの運用成果は、ベンチマークを上回ることも下回ることもあり、ベンチマークに対して一定の運用成果をあげることを保証するものではありません。
- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。
- 当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。

## リスクの管理体制

委託会社では、運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。また、運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。なお、委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

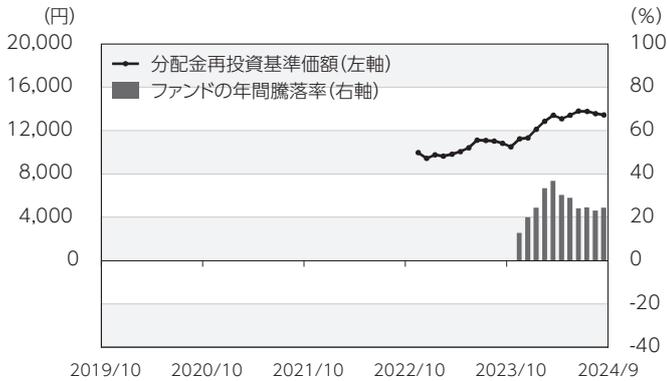
※リスク管理体制は、今後変更になることがあります。



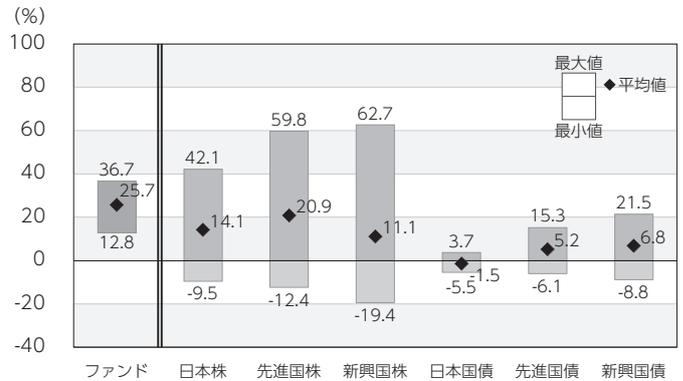
# 投資リスク

## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2023年11月~2024年9月

代表的な資産クラス:2019年10月~2024年9月

\*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

\*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

\*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数 (TOPIX)」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社 (以下「JPX」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス (除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド (円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。



# 運用実績

データの基準日:2024年9月30日

## 基準価額・純資産の推移 (2022年11月16日~2024年9月30日)

## 分配の推移(税引前)



2023年 9月	0円
2024年 9月	0円
設定来累計	0円

\*分配金は1万口当たりです。

\*基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

\*分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2022年11月16日)

## 主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内株式ESGフォーカス・マザーファンド	99.28

■国内株式ESGフォーカス・マザーファンド

\*比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、国/地域を表します。

### 資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	56.29
内 日本	56.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	43.71
合計(純資産総額)	100.00

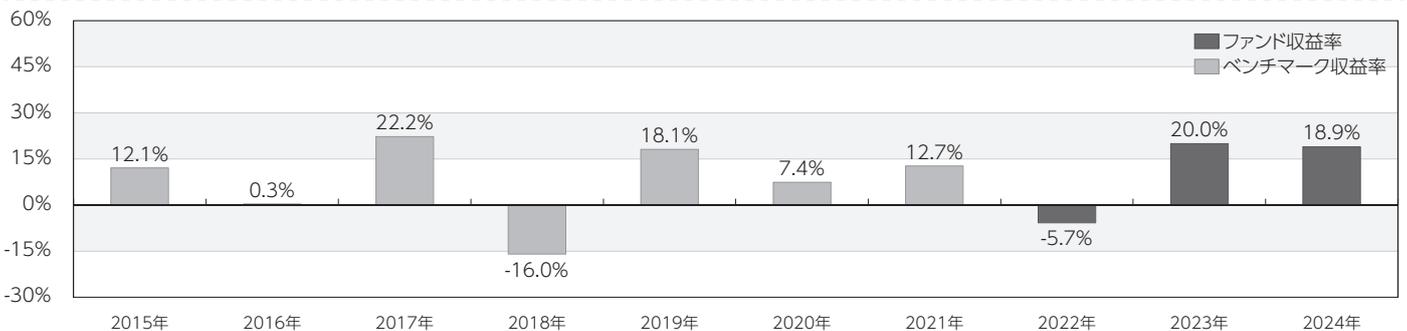
### 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	日立製作所	株式	日本	電気機器	2.93
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.31
3	信越化学工業	株式	日本	化学	2.28
4	東京海上ホールディングス	株式	日本	保険業	2.18
5	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	2.14
6	ウエストホールディングス	株式	日本	建設業	1.81
7	第一三共	株式	日本	医薬品	1.80
8	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.76
9	住友林業	株式	日本	建設業	1.68
10	アシックス	株式	日本	その他製品	1.65

### 株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	14.54
2	建設業	4.62
3	機械	4.47
4	化学	4.11
5	情報・通信業	4.07

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



\*年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

\*2022年は設定日から年未までの収益率、および2024年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

\*2021年以前は、ベンチマークの収益率を表示しています。当ファンドのベンチマークは「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」です。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。



# 手続・手数料等

## お申込みメモ

購入単位	1円以上1円単位(当初元本1口=1円)
購入価額	購入申込受付日の基準価額(基準価額は1万口当たりで表示しています。)
購入代金	販売会社が定める期日までにお支払いください。
換金単位	1口単位
換金価額	換金申込受付日の基準価額
換金代金	原則として換金申込受付日から起算して5営業日目からお支払いします。
申込締切時間	原則として営業日の午後3時30分までに販売会社が受けたものを当日分のお申込みとします。 なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。
購入の申込期間	2024年12月28日から2025年6月27日まで ※申込期間は上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。
換金制限	信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金請求に制限を設ける場合があります。
購入・換金申込受付の中止および取消し	金融商品取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止することおよびすでに受けた購入・換金のお申込みの受付を取り消す場合があります。
信託期間	無期限(2022年11月16日設定)
繰上償還	次のいずれかに該当する場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し、当該信託を終了(繰上償還)することがあります。 ・信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合 ・純資産総額が30億円を下回ることとなった場合 ・やむを得ない事情が発生した場合
決算日	毎年9月27日(休業日の場合は翌営業日)
収益分配	年1回の毎決算日に、収益分配方針に基づいて収益分配を行います。 ※収益分配金は自動的に全額再投資されます。
信託金の限度額	5,000億円
公 告	原則として、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページ( <a href="https://www.am-one.co.jp/">https://www.am-one.co.jp/</a> )に掲載します。
運用報告書	ファンドの決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて交付します。
課税関係	課税上は株式投資信託として取り扱われます。 配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。
そ の 他	確定拠出年金制度による購入のお申込みに関し限り取り扱います。



# 手続・手数料等

## ファンドの費用・税金

### ■ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用													
購入時手数料	ありません。												
信託財産留保額	ありません。												
投資者が信託財産で間接的に負担する費用													
運用管理費用 (信託報酬)	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して<b>年率0.836%(税抜0.76%)</b>            信託報酬=運用期間中の基準価額×信託報酬率            ※運用管理費用(信託報酬)は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>支払先</th> <th>内訳(税抜)</th> <th>主な役務</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>委託会社</td> <td>年率0.40%</td> <td>信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価</td> </tr> <tr> <td>販売会社</td> <td>年率0.33%</td> <td>購入後の情報提供、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等の対価</td> </tr> <tr> <td>受託会社</td> <td>年率0.03%</td> <td>運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価</td> </tr> </tbody> </table>	支払先	内訳(税抜)	主な役務	委託会社	年率0.40%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	販売会社	年率0.33%	購入後の情報提供、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等の対価	受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
	支払先	内訳(税抜)	主な役務										
	委託会社	年率0.40%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価										
	販売会社	年率0.33%	購入後の情報提供、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等の対価										
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価											
その他の費用・手数料	<p>その他の費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・組入価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料</li> <li>・信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>・外国での資産の保管等に要する費用</li> <li>・監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 等</li> </ul> <p>監査費用は毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のとき、その他の費用等はその都度ファンドから支払われます。</p> <p>※これらの費用等は、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。</p>												

※上記手数料等の合計額、その上限額については、購入金額や保有期間等に応じて異なりますので、あらかじめ表示することができません。



# 手続・手数料等

## ■税金

- 税金は表に記載の時期に適用されます。
- 以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

時期	項目	税金
分配時	所得税および地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して20.315%
換金（解約）時 および償還時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対して20.315%

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

※法人の場合は上記とは異なります。

※上記は2024年9月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## … (参考情報) ファンドの総経費率 …

総経費率 (①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.84%	0.84%	0.00%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年9月28日～2024年9月27日

※対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。

※総経費率には、ファンドにより購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税以外にも計算に含まれない費用が存在する場合があります。

※なお、当ファンドについては、入手し得る情報において計算に含まれていない費用はありません。

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

