

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成31年4月17日
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	植松 克彦
【電話番号】	03-5405-0784
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	<七十七> E S G日本株オープン
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2019年3月15日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)の記載事項のうち、有価証券報告書の提出等に伴う訂正事項がありますので、本訂正届出書を提出するものではありません。

2【訂正箇所および訂正事項】

第一部【証券情報】

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(2)内国投資信託受益証券の形態等

(以下略)

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友アセットマネジメント株式会社（2019年4月1日より、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社となります（予定）。以下、新会社名を記載します。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(以下略)

(4)発行（売出）価格

(以下略)

照会先の名称	電話番号	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

(注)委託会社に対する照会先の情報は、2019年4月1日現在（予定）のものであります（以下同じ。）。お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

(5)申込手数料

申込手数料は、申込価額（発行価格）に申込手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料率は、1.08%（税抜1.0%）を上限とし、販売会社毎に定めた率とします。

(以下略)

申込手数料は、販売会社による商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに販売の事務等の対価です。

(6)申込単位

(以下略)

<訂正後>

(2)内国投資信託受益証券の形態等

(以下略)

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友D Sアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(以下略)

(4)発行（売出）価格

(以下略)

照会先の名称	電話番号	ホームページ

三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp
-----------------------	--------------	---

お問い合わせは、午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)までとさせていただきます。

(5) 申込手数料

申込手数料は、申込価額(発行価格)に申込手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料率は、 $1.08\%^{*}$ (税抜1.0%)を上限とし、販売会社毎に定めた率とします。

(以下略)

申込手数料は、販売会社による商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに販売の事務等の対価です。

*消費税率が10%になった場合は、1.1%となります。

(6) 申込単位

(以下略)

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1) ファンドの目的及び基本的性格

(以下略)

ファンドの特色

(以下略)

お客様にご負担いただいた運用管理費用(信託報酬)の一部を震災により壊滅的な被害を受けた海岸防災林の再生活動のために寄付します。

- 当ファンドの販売会社は、收受した運用管理費用(信託報酬)の一部(運用管理費用(信託報酬)率のうち年率0.1%程度)を寄付するものです。
- 寄付先は、公益社団法人宮城県緑化推進委員会とします。

寄付金額

各販売会社が、毎年1月の計算期末を基準に、当該計算期間に收受した運用管理費用(信託報酬)の中から、各販売会社の取扱純資産総額に応じて、当該期間中の日々の純資産総額に年率0.1%を乗じて得た金額(ただし、将来的には状況によって寄付先および寄付金額が変更になることがあります。)

(以下略)

(2) ファンドの沿革

(以下略)

2019年4月1日 ファンドの委託会社としての業務を大和住銀投信投資顧問株式会社から三井住友D Sアセットマネジメント株式会社へ承継(予定)

(3) ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況

- ・資本金の額 20億円(2019年4月1日現在(予定))
- ・会社の沿革 1985年7月15日 三生投資顧問株式会社設立
(以下略)
2019年4月1日 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更(予定)
- ・大株主の状況(2019年4月1日現在(予定))

(以下略)

<訂正後>

(1) ファンドの目的及び基本的性格

(以下略)

ファンドの特色

(以下略)

お客様にご負担いただいた運用管理費用(信託報酬)の一部を震災により
壊滅的な被害を受けた海岸防災林の再生活動のために寄付します。

●当ファンドの販売会社は、收受した運用管理費用(信託報酬)の一部(運用管理費用(信託報酬)率のうち年率0.1%程度)を寄付するものです。

●2019年1月の決算期末を基準として行った寄付先および寄付金額は以下の通りです。

寄付先：公益社団法人宮城県緑化推進委員会

寄付金額：412,963円

寄付金額

各販売会社が、毎年1月の計算期末を基準に、当該計算期間に收受した運用管理費用(信託報酬)の中から、各販売会社の取扱純資産総額に応じて、当該期間中の日々の純資産総額に年率0.1%を乗じて得た金額(ただし、将来的には状況によって寄付先および寄付金額が変更になることがあります。)

(以下略)

(2)ファンドの沿革

(以下略)

2019年4月1日 ファンドの委託会社としての業務を大和住銀投信投資顧問株式会社から三井住友D S アセットマネジメント株式会社へ承継

(3)ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況

・資本金の額 20億円(2019年4月1日現在)

・会社の沿革 1985年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

(以下略)

2019年4月1日 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D S アセットマネジメント株式会社に商号変更

・大株主の状況(2019年4月1日現在)

(以下略)

2 投資方針

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(3)運用体制

(以下略)

委託会社によるファンドの関係法人(販売会社を除く)に対する管理体制

ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務(保管・管理・計算等)を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

上記の運用体制は、2019年4月1日現在(予定)のものであります。

(4)分配方針

(以下略)

<訂正後>

(3)運用体制

(以下略)

委託会社によるファンドの関係法人(販売会社を除く)に対する管理体制

ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務(保管・管理・計算等)を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

(4) 分配方針

(以下略)

[次へ](#)

3 投資リスク

<リスクの管理体制>

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、リスク管理部において信託約款等に定める各種投資制限・リスク指標のモニタリング等、コンプライアンス部において法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行っています。当該モニタリングおよび確認結果等は、運用評価会議、リスク管理会議およびコンプライアンス会議に報告されます。（2019年4月1日現在（予定））

<訂正後>

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、リスク管理部において信託約款等に定める各種投資制限・リスク指標のモニタリング等、コンプライアンス部において法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行っています。当該モニタリングおよび確認結果等は、運用評価会議、リスク管理会議およびコンプライアンス会議に報告されます。

<参考情報>

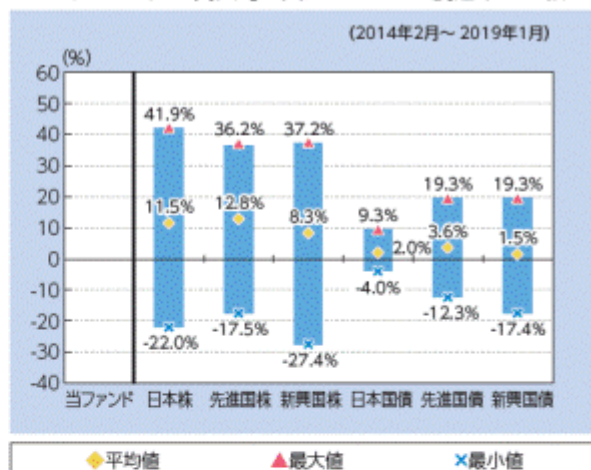
原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

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



※当ファンドは設定から1年が経過していないため、年間騰落率を表示できません。
 ※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計算しているため、実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※上記グラフは、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・最小値を表示したものであり、当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ています。全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
 ※ただし、当ファンドは設定から1年が経過していないため年間騰落率を表示できません。

<各資産クラスの指数について>

資産クラス	指数名	権利者
日本株	TOPIX(配当込み)	株式会社東京証券取引所
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Inc.
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 Inc.
日本国債	NOMURA-BPI国債	野村證券株式会社
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	FTSE Fixed Income LLC
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)	J.P.Morgan Securities LLC

(注) 上記指数に関する著作権等の知的財産権およびその他一切の権利は、各権利者に帰属します。各権利者は、当ファンドの運用に関して一切の責任を負いません。

[次へ](#)

4 手数料等及び税金

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1) 申込手数料

申込手数料は、申込価額（発行価格）に申込手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料率は、1.08%（税抜1.0%）を上限とし、販売会社毎に定めた率とします。

（以下略）

申込手数料は、販売会社による商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに販売の事務等の対価です。

(2) 換金（解約）手数料

（以下略）

(3) 信託報酬等

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.4904%（税抜1.38%）を乗じて得た金額とします。委託会社は販売会社に対して、販売会社の行う業務に対する代行手数料を支払います。委託会社、販売会社および受託会社間の配分は以下の表のとおりです。

（以下略）

上記の委託会社、販売会社および受託会社間の信託報酬の配分はそれぞれ「ファンドの運用等の対価」、「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」および「運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価」です。

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

（以下略）

(4) その他の手数料等

（以下略）

信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年率0.00972%（税抜0.0090%）以内の率を乗じて得た額とし、毎計算期末または信託終了時に信託財産中から支弁します。また、委託会社は信託財産の規模等を考慮してその率または金額を変更することができます。

信託財産留保額はありません。

(5) 課税上の取扱い

（以下略）

* 上記の内容は2018年4月末現在のものですので、税法等が変更・改正された場合には、変更になることがあります。

（以下略）

<訂正後>

(1) 申込手数料

申込手数料は、申込価額（発行価格）に申込手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料率は、1.08%^{*}（税抜1.0%）を上限とし、販売会社毎に定めた率とします。

（以下略）

申込手数料は、販売会社による商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに販売の事務等の対価です。

* 消費税率が10%になった場合は、1.1%となります。

(2) 換金（解約）手数料

(以下略)

(3) 信託報酬等

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.4904%^{*}(税抜1.38%)を乗じて得た金額とします。委託会社は販売会社に対して、販売会社の行う業務に対する代行手数料を支払います。委託会社、販売会社および受託会社の間での配分は以下の表のとおりです。

(以下略)

上記の委託会社、販売会社および受託会社の間での信託報酬の配分はそれぞれ「ファンドの運用等の対価」、「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」および「運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価」です。

*消費税率が10%になった場合は、年率1.518%となります。

信託報酬は日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

(以下略)

(4) その他の手数料等

(以下略)

信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年率0.00972%^{*}(税抜0.0090%)以内の率を乗じて得た額とし、毎計算期末または信託終了時に信託財産中から支弁します。また、委託会社は信託財産の規模等を考慮してその率または金額を変更することができます。

*消費税率が10%になった場合は、年率0.0099%となります。

信託財産留保額はありません。

(5) 課税上の取扱い

(以下略)

*上記の内容は2019年1月末現在のものですので、税法等が変更・改正された場合には、変更になることがあります。

(以下略)

[前へ](#) [次へ](#)

5 運用状況

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

<七十七> E S G日本株オープン

(1) 投資状況

(2019年1月末現在)

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
親投資信託受益証券 (E S G日本株マザーファンド)	日本	1,085,358,859	100.32%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		3,461,760	0.32%
純資産総額		1,081,897,099	100.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(2019年1月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1 E S G日本株マザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	1,185,666,222	0.9008 1,068,060,788	0.9154 1,085,358,859	- -	100.32%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
親投資信託受益証券	100.32%
合計	100.32%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

(2019年1月末現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(2019年1月末現在)

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額(百万円)		1口当りの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
設定時 (2018年8月10日)	606	-	1.0000	-
2018年8月末日	747	-	1.0045	-
2018年9月末日	949	-	1.0708	-
2018年10月末日	1,004	-	0.9590	-
2018年11月末日	1,100	-	0.9924	-
2018年12月末日	1,016	-	0.8833	-
第1計算期間末 (2019年1月17日)	1,058	-	0.9078	-
2019年1月末日	1,081	-	0.9220	-

(注) 純資産総額は百万円未満切捨てで表記しております。

分配の推移

該当事項はありません。

収益率の推移

期間	収益率
第1期(2018年8月10日~2019年1月17日)	9.2%

(注) 収益率 = (当計算期末分配付基準価額 - 前計算期末分配落基準価額) ÷ 前計算期末分配落基準価額 × 100

(4) 設定及び解約の実績

期間	設定総額(円)	解約総額(円)
第1期(2018年8月10日~2019年1月17日)	1,213,121,663	47,525,943

(注) 本邦外における設定及び解約の実績はありません。

(参考) マザーファンドの運用状況

ESG日本株マザーファンド

(1) 投資状況

(2019年1月末現在)

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
株式	日本	1,157,467,900	98.35%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		19,464,494	1.65%
純資産総額		1,176,932,394	100.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(2019年1月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	ダイキョーニシカワ 日本	株式 化学	37,000	1,118.38 41,380,407	1,121.00 41,477,000	- -	3.52%
2	ニチアス 日本	株式 ガラス・土石製 品	21,300	1,897.00 40,406,100	1,884.00 40,129,200	- -	3.41%
3	小松製作所 日本	株式 機械	14,200	2,688.96 38,183,248	2,761.50 39,213,300	- -	3.33%
4	日本毛織 日本	株式 繊維製品	44,300	847.43 37,541,461	875.00 38,762,500	- -	3.29%
5	オリックス 日本	株式 その他金融業	22,600	1,692.25 38,245,024	1,640.00 37,064,000	- -	3.15%
6	E P Sホールディングス 日本	株式 サービス業	22,400	1,653.37 37,035,559	1,652.00 37,004,800	- -	3.14%
7	栗田工業 日本	株式 機械	13,400	2,692.31 36,076,992	2,760.00 36,984,000	- -	3.14%
8	住友商事 日本	株式 卸売業	21,600	1,632.14 35,254,234	1,681.50 36,320,400	- -	3.09%
9	山九 日本	株式 陸運業	6,700	5,231.28 35,049,619	5,300.00 35,510,000	- -	3.02%
10	大塚ホールディングス 日本	株式 医薬品	7,800	4,444.72 34,668,830	4,453.00 34,733,400	- -	2.95%
11	良品計画 日本	株式 小売業	1,300	22,490.00 29,237,000	25,700.00 33,410,000	- -	2.84%
12	丸紅 日本	株式 卸売業	39,100	803.40 31,412,940	846.60 33,102,060	- -	2.81%
13	デジタルハーツホールディング ス 日本	株式 情報・通信業	22,700	1,473.28 33,443,516	1,417.00 32,165,900	- -	2.73%
14	住友林業 日本	株式 建設業	22,100	1,422.92 31,446,640	1,419.00 31,359,900	- -	2.66%
15	モリタホールディングス 日本	株式 輸送用機器	17,800	1,811.92 32,252,237	1,760.00 31,328,000	- -	2.66%
16	武蔵野銀行 日本	株式 銀行業	12,000	2,538.95 30,467,481	2,497.00 29,964,000	- -	2.55%
17	東京瓦斯 日本	株式 電気・ガス業	10,200	2,913.16 29,714,249	2,858.50 29,156,700	- -	2.48%
18	クラレ 日本	株式 化学	17,300	1,672.00 28,925,600	1,671.00 28,908,300	- -	2.46%
19	日本ユニシス 日本	株式 情報・通信業	11,100	2,618.07 29,060,677	2,593.00 28,782,300	- -	2.45%
20	日本碍子 日本	株式 ガラス・土石製 品	16,500	1,605.98 26,498,825	1,670.00 27,555,000	- -	2.34%
21	塩野義製薬 日本	株式 医薬品	4,100	6,470.00 26,527,000	6,686.00 27,412,600	- -	2.33%
22	ダイキン工業 日本	株式 機械	2,200	12,337.25 27,141,964	11,765.00 25,883,000	- -	2.20%
23	協和エクシオ 日本	株式 建設業	9,500	2,638.23 25,063,199	2,670.00 25,365,000	- -	2.16%
24	大林組 日本	株式 建設業	24,400	1,016.56 24,804,072	1,033.00 25,205,200	- -	2.14%
25	クボタ 日本	株式 機械	14,000	1,659.59 23,234,310	1,714.00 23,996,000	- -	2.04%
26	積水化学工業 日本	株式 化学	14,000	1,548.00 21,672,000	1,692.00 23,688,000	- -	2.01%

27	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	38,900	570.50 22,192,450	583.60 22,702,040	- -	1.93% -
28	高砂熱学工業 日本	株式 建設業	12,800	1,778.09 22,759,654	1,714.00 21,939,200	- -	1.86% -
29	日立製作所 日本	株式 電気機器	6,100	3,482.00 21,240,200	3,413.00 20,819,300	- -	1.77% -
30	三菱商事 日本	株式 卸売業	6,500	3,089.00 20,078,500	3,181.00 20,676,500	- -	1.76% -

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
株式	98.35%
合計	98.35%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種別	投資比率
(国内)	
化学	12.00%
機械	10.71%
建設業	10.23%
情報・通信業	9.48%
卸売業	8.81%
ガラス・土石製品	5.75%
医薬品	5.28%
サービス業	5.09%
銀行業	4.47%
電気機器	3.44%
繊維製品	3.29%
その他金融業	3.15%
陸運業	3.02%
小売業	2.84%
輸送用機器	2.66%
電気・ガス業	2.48%
非鉄金属	2.46%
食料品	2.19%
ゴム製品	1.00%
小計	98.35%
合計	98.35%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

(2019年1月末現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(2019年1月末現在)

該当事項はありません。

(参考情報)

基準価額・純資産の推移（設定日～2019年1月31日）



分配の推移

2019年1月	0円
設定来累計	0円

* 分配金は1万口当たり、税引前

主要な資産の状況

投資銘柄	投資比率
ESG日本株マザーファンド	100.3%

■ 参考情報

ESG日本株マザーファンド

上位10銘柄

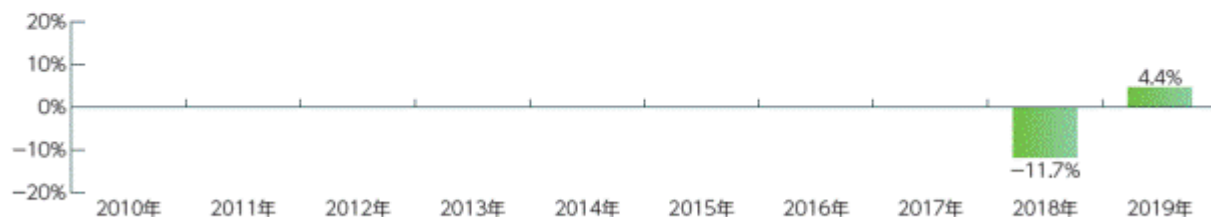
	投資銘柄	業種	投資比率
1	ダイキョーニシカワ	化学	3.5%
2	ニチアス	ガラス・土石製品	3.4%
3	小松製作所	機械	3.3%
4	日本毛織	繊維製品	3.3%
5	オリックス	その他金融業	3.1%
6	E P Sホールディングス	サービス業	3.1%
7	栗田工業	機械	3.1%
8	住友商事	卸売業	3.1%
9	山九	陸運業	3.0%
10	大塚ホールディングス	医薬品	3.0%

* 投資比率は全て純資産影額対比 * 業種は東証33業種分類

上位10業種

	業種	投資比率
1	化学	12.0%
2	機械	10.7%
3	建設業	10.2%
4	情報・通信業	9.5%
5	卸売業	8.8%
6	ガラス・土石製品	5.8%
7	医薬品	5.3%
8	サービス業	5.1%
9	銀行業	4.5%
10	電気機器	3.4%

年間収益率の推移



* ファンドの収益率は暦年ベースで表示しております。但し、2018年は当初設定日(2018年8月10日)から年末までの収益率、2019年は1月末までの収益率です。

* ファンドの年間収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。

* ファンドには、ベンチマークはありません。

- ・ ファンドの運用実績はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

[前へ](#)

第2【管理及び運営】

3 資産管理等の概要

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(5)その他

(以下略)

公告(2019年4月1日現在(予定))

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

(以下略)

<訂正後>

(5)その他

(以下略)

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

(以下略)

第3【ファンドの経理状況】

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載されている金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(平成30年8月10日から平成31年1月17日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

[次へ](#)

1 財務諸表

<七十七> E S G日本株オープン

(1) 貸借対照表

区分	第1期 平成31年1月17日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	1,064,304,180
流動資産合計	1,064,304,180
資産合計	1,064,304,180
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	133,819
未払委託者報酬	6,023,218
その他未払費用	40,078
流動負債合計	6,197,115
負債合計	6,197,115
純資産の部	
元本等	
元本	1,165,595,720
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	107,488,655
（分配準備積立金）	3,155,749
元本等合計	1,058,107,065
純資産合計	1,058,107,065
負債純資産合計	1,064,304,180

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	第1期 自 平成30年8月10日 至 平成31年1月17日 金額（円）
営業収益	
有価証券売買等損益	99,157,129
営業収益合計	99,157,129
営業費用	
受託者報酬	133,819
委託者報酬	6,023,218
その他費用	40,078
営業費用合計	6,197,115
営業利益又は営業損失（ ）	105,354,244
経常利益又は経常損失（ ）	105,354,244
当期純利益又は当期純損失（ ）	105,354,244

一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	2,505,178
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	431,135
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	431,135
剰余金減少額又は欠損金増加額	60,368
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	60,368
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	107,488,655

[次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第1期	
	自 平成30年 8月10日	至 平成31年 1月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。	
2. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、投資信託約款の定めに従い、平成30年 8月10日から平成31年 1月17日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	
	平成31年 1月17日現在	
1. 元本状況		
期首元本額	606,519,539円	
期中追加設定元本額	606,602,124円	
期中一部解約元本額	47,525,943円	
2. 受益権の総数	1,165,595,720口	
3. 元本の欠損	107,488,655円	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期	
自 平成30年 8月10日	
至 平成31年 1月17日	
分配金の計算過程	
該当事項はありません。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第1期	
	自 平成30年 8月10日	至 平成31年 1月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク及び流動性リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、リスク管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。	
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。	

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期	
	平成31年 1月17日現在	
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	

2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) 金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
------------	---

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(平成31年1月17日現在)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	101,766,879
合計	101,766,879

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第1期(平成31年1月17日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期(自平成30年8月10日 至 平成31年1月17日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第1期 平成31年1月17日現在	
1口当たり純資産額	0.9078円
	「1口 = 1円(10,000口 = 9,078円)」

(4) 附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	親投資信託 受益証券	E S G 日本株マザーファンド	1,181,641,146	1,064,304,180	
	合計	1銘柄	1,181,641,146	1,064,304,180	

[前へ](#) [次へ](#)

<参考>

当ファンドは、「ESG日本株マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

ESG日本株マザーファンド

(1)貸借対照表

区分	平成31年1月17日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,467,738
コール・ローン	19,578,749
株式	1,126,103,010
未収入金	61,487,093
未収配当金	1,285,200
流動資産合計	1,209,921,790
資産合計	1,209,921,790
負債の部	
流動負債	
未払金	55,595,873
その他未払費用	65
流動負債合計	55,595,938
負債合計	55,595,938
純資産の部	
元本等	
元本	1,281,640,587
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	127,314,735
元本等合計	1,154,325,852
純資産合計	1,154,325,852
負債純資産合計	1,209,921,790

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成30年 8月10日 至 平成31年 1月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等の提示する気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 国内株式についての受取配当金は、原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成31年 1月17日現在
1. 元本状況	
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	714,944,276円
期中追加設定元本額	614,676,339円
期中一部解約元本額	47,980,028円
元本の内訳	
<七十七> ESG日本株オープン	1,181,641,146円
ESGオポチュニティ日本株F-1（適格機関投資家限定）	999,441円
ヘッジ付ESGオポチュニティ日本株F-1（適格機関投資家限定）	99,000,000円
合計	1,281,640,587円
2. 受益権の総数	1,281,640,587口
3. 元本の欠損	127,314,735円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年 8月10日 至 平成31年 1月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、リスク管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成31年 1月17日現在

1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成31年1月17日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株 式	112,537,071
合計	112,537,071

「計算期間」とは、「ESG日本株マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年5月31日から平成31年1月17日まで）を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(平成31年1月17日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成30年8月10日 至 平成31年1月17日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成31年1月17日現在	
1口当たり純資産額	0.9007円 「1口 = 1円(10,000口 = 9,007円)」

(3) 附属明細表

有価証券明細表

<株式>

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
円	大林組	29,600	1,016.00	30,073,600	
	住友林業	18,900	1,412.00	26,686,800	
	大和ハウス工業	4,400	3,619.00	15,923,600	
	協和エクシオ	10,200	2,636.00	26,887,200	
	高砂熱学工業	11,800	1,788.00	21,098,400	
	キュービー	5,800	2,484.00	14,407,200	
	ニチレイ	4,600	3,010.00	13,846,000	
	クラレ	20,000	1,672.00	33,440,000	
	旭化成	22,600	1,135.00	25,651,000	
	積水化学工業	19,900	1,548.00	30,805,200	
	アイカ工業	4,900	3,670.00	17,983,000	
	ダイキョーニシカワ	35,500	1,119.00	39,724,500	
	日東電工	5,200	5,647.00	29,364,400	
	塩野義製薬	6,000	6,470.00	38,820,000	
	大塚ホールディングス	6,800	4,427.00	30,103,600	
	ブリヂストン	3,300	4,222.00	13,932,600	
	日本碍子	15,600	1,592.00	24,835,200	
	ニチアス	21,300	1,897.00	40,406,100	
	日本軽金属ホールディングス	90,600	226.00	20,475,600	
	住友金属鉱山	4,600	3,073.00	14,135,800	
	小松製作所	14,200	2,673.00	37,956,600	
	クボタ	14,700	1,640.00	24,108,000	
	ダイキン工業	1,600	12,480.00	19,968,000	
	栗田工業	13,300	2,689.00	35,763,700	
	日立製作所	6,600	3,482.00	22,981,200	
	アズビル	7,600	2,224.00	16,902,400	
	モリタホールディングス	13,900	1,821.00	25,311,900	
	関西電力	6,000	1,717.00	10,302,000	
	東京瓦斯	10,200	2,911.00	29,692,200	
	山九	6,000	5,220.00	31,320,000	
	デジタルハーツホールディングス	15,400	1,491.00	22,961,400	

メルカリ	4,400	2,129.00	9,367,600	
日本ユニシス	6,200	2,658.00	16,479,600	
日本電信電話	4,200	4,552.00	19,118,400	
KDDI	7,500	2,697.00	20,227,500	
シップヘルスケアホールディングス	3,100	4,180.00	12,958,000	
丸紅	48,900	803.40	39,286,260	
住友商事	21,200	1,630.00	34,556,000	
三菱商事	9,500	3,089.00	29,345,500	
良品計画	1,600	22,490.00	35,984,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	51,500	570.50	29,380,750	
オリックス	20,600	1,691.00	34,834,600	
EPSホールディングス	21,800	1,651.00	35,991,800	
トーカイ	3,900	2,750.00	10,725,000	
セコム	1,300	9,216.00	11,980,800	
合計 45銘柄	656,800	-	1,126,103,010	

[前へ](#) [次へ](#)

2 ファンドの現況

純資産額計算書

(2019年1月末現在)

<七十七> E S G日本株オープン

資産総額	1,085,358,859 円
負債総額	3,461,760 円
純資産総額 (-)	1,081,897,099 円
発行済数量	1,173,372,129 口
1 単位当り純資産額 (/)	0.9220 円

(参考) E S G日本株マザーファンド

資産総額	1,235,685,194 円
負債総額	58,752,800 円
純資産総額 (-)	1,176,932,394 円
発行済数量	1,285,665,503 口
1 単位当り純資産額 (/)	0.9154 円

[前へ](#)

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

（2019年4月1日現在（予定））

（以下略）

< 訂正後 >

（2019年4月1日現在）

（以下略）

2 事業の内容及び営業の概況

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

委託会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に変更しました。

2019年1月31日現在における三井住友アセットマネジメント株式会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(円)
追加型株式投資信託	461	5,697,482,455,782
単位型株式投資信託	92	474,652,949,632
追加型公社債投資信託	1	28,708,114,745
単位型公社債投資信託	112	297,559,017,761
合計	666	6,498,402,537,920

（ご参考）

2019年1月31日現在における大和住銀投信投資顧問株式会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(円)
追加型株式投資信託	306	2,935,345,882,278
単位型株式投資信託	21	61,052,877,832
追加型公社債投資信託	-	-
単位型公社債投資信託	74	257,921,999,681

合 計	401	3,254,320,759,791
-----	-----	-------------------

3 委託会社等の経理状況

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に変更する予定です。

(以下略)

< 訂正後 >

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に変更しました。

(以下略)

5 その他

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

(以下略)

b. 2019年4月1日付で、取締役の員数の上限を変更する等の定款の変更を行う予定です。

(ロ) その他の重要事項

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に変更する予定です。

(以下略)

< 訂正後 >

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

(以下略)

b. 2019年4月1日付で、取締役の員数の上限を変更する等の定款の変更を行いました。

(ロ) その他の重要事項

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に変更しました。

(以下略)

第2【その他の関係法人の概況】

1 名称、資本金の額及び事業の内容

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1) 受託会社

名称	資本金の額(百万円) 2017年9月末現在	事業の内容

(以下略)

<参考:再信託受託会社(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)の概要>

・資本金:51,000百万円(2017年9月末現在)

(以下略)

(2) 販売会社

名称	資本金の額(百万円) 2017年9月末現在	事業の内容

(以下略)

<訂正後>

(1) 受託会社

名称	資本金の額(百万円) 2018年9月末現在	事業の内容

(以下略)

<参考:再信託受託会社(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)の概要>

・資本金:51,000百万円(2018年9月末現在)

(以下略)

(2) 販売会社

名称	資本金の額(百万円) 2018年9月末現在	事業の内容

(以下略)

3 資本関係

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(持株比率5%以上を記載しています。)

該当事項はありません。(2019年4月1日現在(予定))

<訂正後>

(持株比率5%以上を記載しています。)

該当事項はありません。

以上

独立監査人の監査報告書

平成31年2月22日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている〈七十七〉ESG日本株オープンの平成30年8月10日から平成31年1月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、〈七十七〉ESG日本株オープンの平成31年1月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

大和住銀投信投資顧問株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。