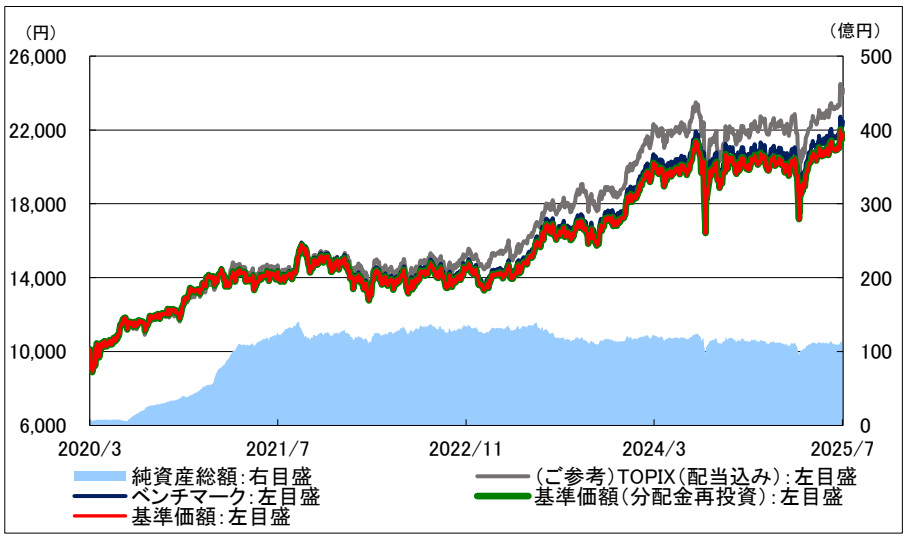
ジャパンESGクオリティ200インデックスファンド

〈愛称：ESGナビ〉

追加型投信／国内／株式／インデックス型

当初設定日 ： 2020年3月10日
作成基準日 ： 2025年7月31日
決算日 ： 毎年 3月10日

基準価額の推移



※ 基準価額およびベンチマーク、（ご参考）TOPIX（配当込み）は、設定日前営業日を10,000円として計算したものです。
※ 基準価額（分配金再投資）は、分配金（税引前）を再投資したものとして計算しています。
※ 基準価額は、信託報酬控除後です。
※ ベンチマークは、iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス（配当込み）です。詳しくは、後掲「本資料で使用している指数について」をご覧ください。

基準価額、純資産総額

	当月末	前月末比
基準価額	21,761 円	+ 373 円
純資産総額	112.44 億円	− 1.38 億円

期間別騰落率

	ファンド	ベンチマーク	（ご参考）TOPIX（配当込み）
1ヵ月	+ 1.74%	+ 1.80%	+ 3.17%
3ヵ月	+ 9.45%	+ 9.60%	+ 10.56%
6ヵ月	+ 5.91%	+ 6.25%	+ 6.97%
1年	+ 7.26%	+ 7.94%	+ 7.98%
2年	+ 30.94%	+ 32.47%	+ 32.90%
3年	+ 53.02%	+ 55.64%	+ 63.44%
設定来	+ 117.84%	+ 124.65%	+ 142.08%

※ 騰落率は、分配金（税引前）を再投資したものとして計算しています。
※ 設定来騰落率は、設定日前営業日との比較です。

※ ESG情報とROEなどの財務情報を活用した銘柄選定の有無によるパフォーマンスの違いを比較することを目的に、市場全体の動きを反映した、（ご参考）TOPIX（配当込み）を掲載しています。したがって「（ご参考）TOPIX（配当込み）」は、当ファンドのベンチマークおよび参考指数ではありません。

分配の推移（1万口当たり、税引前）

設定来分配金合計額　20　円

決算期	2021年3月	2022年3月	2023年3月	2024年3月	2025年3月
分配金	0 円	0 円	0 円	20 円	0 円

※ 運用状況等によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

資産構成

資産種別	比率
株式	99.7%
株式先物	0.3%
短期金融資産等	0.0%
合計	100.0%

※ 比率は対純資産総額比（マザーファンドベース）です。
※ 追加設定や解約への売買対応により、株式組入比率が100%からかい離することや、短期金融資産等の比率が一時的にマイナスになることがあります。

株式　市場別内訳

市場種別	比率
東証プライム	99.3%
東証スタンダード	0.4%
東証グロース	0.0%
その他	−
株式 合計	99.7%

※ 比率は対純資産総額比（マザーファンドベース）です。
※ 比率は小数第2位を四捨五入しており、合計は四捨五入の関係で合わないことがあります。

組入上位10業種

	業種	マザーファンド	（ご参考）TOPIX	差
1	電気機器	23.6%	17.7%	5.9%
2	情報・通信業	9.2%	8.0%	1.2%
3	卸売業	7.3%	6.9%	0.3%
4	機械	6.7%	6.2%	0.5%
5	化学	6.7%	4.8%	1.9%
6	小売業	5.9%	4.7%	1.1%
7	サービス業	5.6%	4.4%	1.2%
8	医薬品	5.5%	3.9%	1.7%
9	保険業	4.5%	3.3%	1.2%
10	精密機器	4.1%	2.0%	2.1%

※ 業種は東証33業種分類によるものです。
※ 比率は対純資産総額比（マザーファンドベース）です。

ジャパンESGクオリティ200インデックスファンド

〈愛称：ESGナビ〉

追加型投信／国内／株式／インデックス型

当初設定日 ： 2020年3月10日
作成基準日 ： 2025年7月31日
決算日 ： 毎年 3月10日

組入上位10銘柄

	銘柄	業種	比率
1	日立製作所	電気機器	2.2%
2	リクルートホールディングス	サービス業	2.1%
3	東京エレクトロン	電気機器	2.1%
4	伊藤忠商事	卸売業	2.1%
5	三井物産	卸売業	2.0%
6	三菱重工業	機械	2.0%
7	三菱電機	電気機器	2.0%
8	三菱商事	卸売業	2.0%
9	第一三共	医薬品	2.0%
10	東京海上ホールディングス	保険業	2.0%

※ 業種は東証33業種分類によるものです。

※ 比率は対純資産総額比（マザーファンドベース）です。

日本株式市場の動向

7月の国内株式市場は、日米間の関税交渉が合意に至り、米国の日本に対する相互関税および自動車関税が15%となる見通しとなったことなどが好感され、上昇しました。日経平均株価は前月末比+1.44%の41,069円82銭、東証株価指数（TOPIX）は同+3.16%の2,943.07ポイントとなりました。

日経平均株価は、6月末にかけての上昇を受けた利益確定売りや米国の関税政策に対する警戒感、参議院選挙への不透明感などが重石となり、中旬にかけて軟調な推移となりました。その後、米国株式市場がハイテク株を中心に上昇基調となったことに加え、日米関税交渉合意の報道を受けて一段高となり、24日の取引時間中に一時42,000円台を回復しました。月末にかけては高値警戒感から利益確定売りが広がり、41,000円台で引けました。

物色面では、データセンター関連投資拡大への期待から電線株が買われたほか、米国の自動車関税引き下げの報道を受けて自動車株なども買われました。

東証33業種では、「非鉄金属」「石油・石炭製品」「銀行業」「ガラス・土石製品」「電気・ガス業」など20業種がTOPIXの騰落率を上回り、「その他製品」「小売業」「情報・通信業」「食料品」「空運業」など13業種が下回りました。

運用状況

7月の騰落率は、+1.74%となりました。
日立製作所やフジクラ、HOYAなどが上昇した一方、信越化学工業やファーストリテイリング、カプコンなどが下落し、市場全体のパフォーマンスに劣後しました。

ESG取組事例紹介 ～ KDDI ～

KDDIは2024年5月、自然資本保全への貢献のため、ネットゼロ目標を含む中長期の環境保全計画である「KDDI GREEN PLAN」を策定し、推進しています。
同社は「地球環境との調和」を経営理念の一つとし、「脱炭素社会の実現」「循環型社会の形成」「生物多様性保全」を重点課題として取り組んでおり、さらに、中長期的な企業価値向上のため、リスクの低減と事業機会の創出についての目標を新設しました。「脱炭素社会の実現」は「2030年度KDDIグループのカーボンニュートラル実現」など、「循環型社会の形成」は「事業活動における資源リサイクルの追求」など、「生物多様性の保全」は「2030年度末森林破壊防止」などへの取り組みを進めることで、さらなる環境価値向上を目指し、活動の活発化を進めています。

※ 企業の紹介を目的としており、個別銘柄の推奨を目的とするものではありません。また、当該銘柄の将来の価格の上昇または下落を示唆するものではありません。

ジャパンESGクオリティ200インデックスファンド

〈愛称：ESGナビ〉

追加型投信／国内／株式／インデックス型

当初設定日 ： 2020年3月10日
作成基準日 ： 2025年7月31日
決算日 ： 毎年 3月10日

ファンドの特色

1. わが国の金融商品取引所に上場している株式を主要投資対象とし、ファミリーファンド方式で運用を行います。
2. iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス（配当込み）に連動する投資成果をめざします。
   - iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス（配当込み）をベンチマークとします。

※ベンチマークとの連動を維持するため、先物取引等を利用することがあります。その結果、先物を含めた株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。

※市況動向および資金動向などにより、上記のような運用が行えない場合があります。

ベンチマークの指数構築プロセスのイメージ

①投資ユニバース
STOXX Japan 600 ex REIT

① 日本株式市場上場銘柄のうちSTOXX社が選定する流動性の高い600銘柄（リートを除く）

②ESGスクリーニング

② 国連グローバル・コンパクト[*1]違反企業、特定兵器関連企業およびESG不祥事スコアが基準を満たさない銘柄を除外

③財務スクリーニング

③ ROE[*2]、財務3指標[*3]および流動性の低い銘柄を除外

④合成スコアの作成

④ 下記の3項目を1/3ずつ合成し上位200銘柄を選定
- ROE
- 財務3指標
- ESGマネジメントスコア

iSTOXX MUTB JAPAN ESG クオリティ200インデックス（配当込み）

用語説明

＊1 国連グローバル・コンパクト

・各企業、団体が責任ある創造的なリーダーシップを発揮することによって、社会の良き一員として行動し、持続可能な成長を実現するための世界的な枠組み作りに参加する自発的な取り組みとして、国連が提唱。
・「人権の保護」「不当な労働の排除」「環境への対応」「腐敗の防止」に関わる4分野・10の原則を順守し、実践し続ける事が求められている。

＊2 ROE

ROE（%）＝ 当期純利益 ÷ 自己資本 × 100
数値が高いほど自己資本を有効に利用しており、企業の収益力が高いと評価される。

＊3 財務3指標

・財務健全性
・キャッシュフロー収益性
・利益安定性

※ベンチマークの指数構築プロセスのイメージは作成時点のものであり、今後変更となる場合があります。

ジャパンESGクオリティ200インデックスファンド

〈愛称：ESGナビ〉

追加型投信／国内／株式／インデックス型

当初設定日 ： 2020年3月10日
作成基準日 ： 2025年7月31日
決算日 ： 毎年 3月10日

投資リスク

《基準価額の変動要因》

- ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。
  したがって、**投資者の皆様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。**
- **信託財産に生じた利益および損失は、全て投資者の皆様に帰属します。**
- **投資信託は預貯金とは異なります。**

【価格変動リスク】
株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

【流動性リスク】
時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

【ESG投資に関するリスク】
ファンドが連動をめざす指数は、構築プロセスにおいてESG評価を用いており、ESG評価に基づく組入および除外基準により株式市場全体の値動きとファンドの基準価額の値動きが大きく異なる場合があります。

※ 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。

《その他の留意点》

- ファンドは、iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、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。また、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。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、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。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。
- 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。
- 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及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

委託会社・その他の関係法人の概要

■ 委託会社　ちばぎんアセットマネジメント株式会社（ファンドの運用の指図を行う者）
金融商品取引業者　関東財務局長（金商）第443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
ホームページ ： http://www.chibagin-am.co.jp/
サポートダイヤル ： 03-5638-1451　受付時間 9:00～17:00 [土日・祝日等は除く]

■ 受託会社　三菱UFJ信託銀行株式会社（ファンドの財産の保管および管理を行う者）

販売会社

商号等		登録番号	加入協会			
			日本証券業協会	一般社団法人日本投資顧問業協会	一般社団法人金融先物取引業協会	一般社団法人第二種金融商品取引業協会
株式会社千葉銀行	登録金融機関	関東財務局長（登金）第39号	○		○	
ちばぎん証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第114号	○			
株式会社横浜銀行	登録金融機関	関東財務局長（登金）第36号	○		○	
株式会社武蔵野銀行	登録金融機関	関東財務局長（登金）第38号	○			

・お申込み、投資信託説明書（交付目論見書）のご請求は、販売会社へお申し出ください。
・販売会社は今後変更となる場合があります。

ジャパンESGクオリティ200インデックスファンド

〈愛称：ESGナビ〉

追加型投信／国内／株式／インデックス型

当初設定日 ： 2020年3月10日
作成基準日 ： 2025年7月31日
決算日 ： 毎年 3月10日

お申込みメモ

購入単位	販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
購入価額	購入申込受付日の基準価額とします。 （基準価額は1万口当たりで表示しています。）
換金単位	販売会社が個別に定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
換金価額	換金申込受付日の基準価額とします。
換金代金	原則として、換金申込受付日から起算して4営業日目からお支払いします。
申込締切時間	原則として、購入・換金のお申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが午後3時30分までに完了したものを当日の申込受付分とします。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳細は販売会社にご確認ください。
換金制限	ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間および金額の制限を行う場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
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、委託会社は購入・換金のお申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた購入・換金のお申込みの取り消しを行うことがあります。
信託期間	無期限（2020年3月10日設定）
繰上償還	次のいずれかの場合には、委託会社は、事前に受益者の意向を確認し、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了（繰上償還）させることができます。 ・受益権の口数が30億口を下回った場合 ・ファンドを償還することが受益者のために有利であると認める場合 ・やむを得ない事情が発生した場合
決算日	毎年3月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配	年1回、毎決算時に分配の方針に基づき分配します。 「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」の2つの申込方法があります。 詳しくは販売会社にお問い合わせください。
課税関係	課税上は株式投資信託として取り扱われます。 公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。 当ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。 配当控除の適用があります。

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

購入申込受付日の基準価額に**3.3%（税抜3.0%）**を上限として販売会社が定める率を乗じて得た額とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

■ 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）

純資産総額に対して**年率0.77%（税抜0.70%）**を乗じて得た額とします。

■ その他の費用・手数料

組入有価証券の売買委託手数料、信託事務にかかる諸費用等はその都度、監査費用は日々、ファンドが負担します。これらの費用は、運用状況等により変動する等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※ 上記の手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

※ 詳しくは投資信託説明書（交付目論見書）の「お申込みメモ」、「ファンドの費用・税金」をご覧ください。

ジャパンESGクオリティ200インデックスファンド

〈愛称：ESGナビ〉

追加型投信／国内／株式／インデックス型

当初設定日	：	2020年3月10日
作成基準日	：	2025年7月31日
決算日	：	毎年 3月10日

■ 本資料で使用している指数について

iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ 200インデックス（配当込み）とは、東京証券取引所を主たる市場とする普通株式等の中から、時価総額、流動性、ESGデータによりスクリーニングされる投資ユニバースのうち、高ROEかつ、高ROEの持続性のポテンシャルの高さ、ESGマネジメントスコアの高さを評価して200銘柄を選定し算出される株価指数です。iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス（配当込み）は、三菱UFJ信託銀行が有するアクティブ運用機関としてのノウハウとドイツ取引所傘下のSTOXXリミテッド（以下「STOXX社」）が有する指数提供機関としての経験を活用し、両社で共同開発したものです。

iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ 200インデックス（配当込み）およびそれに含まれるデータおよび商標は、ライセンスに基づいてSTOXX社またはISS STOXX Index GmbHが提供したものです。

STOXX社またはISS STOXX Index GmbHは、報告された情報の作成に何ら関与するものではなく、かつ報告された情報、またはiSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ 200インデックス（配当込み）もしくはそのデータに関するエラー、遺漏もしくは中断について、何ら保証するものではなく、（過失の有無を問わず）いかなる責任も負うものではありません。これらについては、正確性、妥当性、正当性、完全性、適時性および目的への適合性を含みますが、これらに限定されません。STOXX社またはISS STOXX Index GmbHに関係する情報の流布または再配信は、一切禁止されています。

東証株価指数（TOPIX）とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、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、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。

TOPIXおよびTOPIX（配当込み）の指数値および両指数に係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」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など両指数に関するすべての権利・ノウハウおよび両指数に係る標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、両指数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。

＜本資料のお取扱いにおけるご留意点＞

●当資料はちばぎんアセットマネジメントが作成したものであり、金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。

●ご購入のお申込みの際は最新の投資信託説明書（交付目論見書）の内容を必ずご確認のうえ、ご自身でご判断ください。

●投資信託は値動きのある有価証券等に投資しますので基準価額は変動します。したがって、投資元本や利回りが保証されるものではありません。ファンドの運用による損益は全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金や保険契約とは異なり預金保険機構および保険契約者保護機構等の保護の対象ではありません。また、証券会社以外でご購入いただいた場合は、投資者保護基金の保護の対象ではありません。

●当資料は信頼できると判断した各種情報等に基づき作成していますが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、今後予告なく変更される場合があります。

●当資料中の図表、数値、その他データについては、過去のデータに基づき作成したものであり、将来の成果を示唆あるいは保証するものではありません。また、将来の市場環境の変動等により運用方針等が変更される場合があります。

●当資料で使用している各指数に関する著作権等の知的財産権、その他の一切の権利はそれぞれの指数開発元もしくは公表元に帰属します。

ちばぎんアセットマネジメント