

# 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



- 本書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書です。
- 本書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は投資信託説明書(請求目論見書)に掲載されております。
- ファンドに関する投資信託説明書(請求目論見書)は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

照会先

 **ちばぎんアセットマネジメント**

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:営業日の午前9時~午後5時)

■ 委託会社 (ファンドの運用の指図を行う者)

**ちばぎん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443号  
設立年月日:1986年3月31日  
資本金:2億円  
運用する投資信託財産の合計純資産総額:1,205億円  
(資本金、運用純資産総額は2024年3月29日現在)

■ 受託会社 (ファンドの財産の保管および管理を行う者)

**三菱UFJ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。

商品分類			
単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
追加型投信	国内	株式	インデックス型

属性区分				
投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))	年1回	日本	ファミリーファンド	その他 (ISTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200 インデックス (配当込み))

※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ジャパンESGクオリティ200インデックスファンドの募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2024年6月11日に関東財務局長に提出しており、2024年6月12日にその届出の効力が生じております。

ファンドの商品内容につい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。

ファンドの信託財産は、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。

投資信託説明書（請求目論見書）については、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。その際、投資者は自ら請求したことを記録しておいてください。



# ファンドの目的・特色

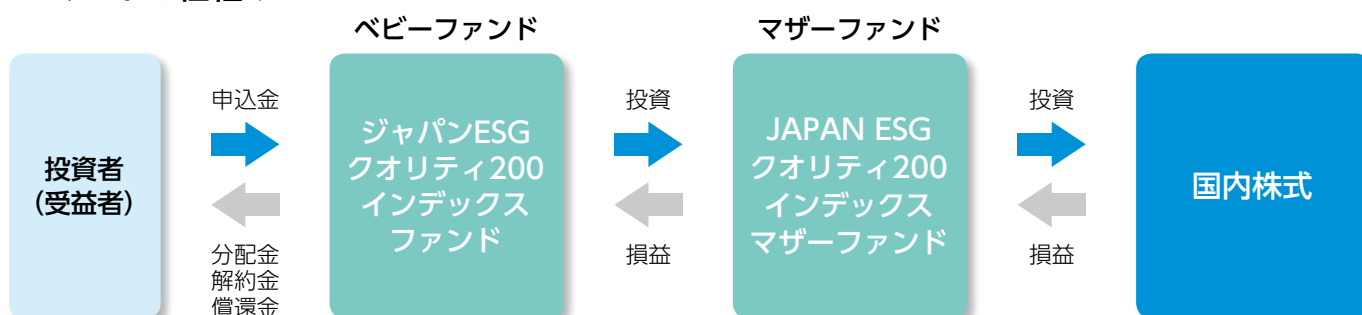
## ファンドの目的

わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定株式を含みます。）に投資し、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。

## ファンドの特色

**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。

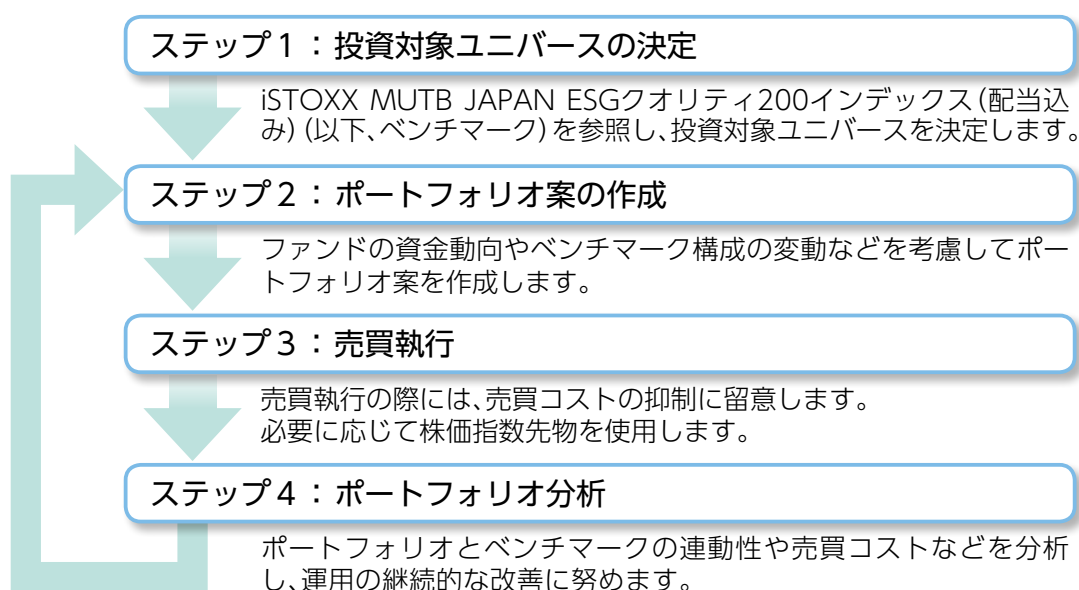
### <ファンドの仕組み>



### ファミリーファンド方式とは

投資者の皆様から投資いただいた資金をまとめて「ベビーファンド」とし、その資金を「マザーファンド」に投資することを通じ、「マザーファンド」において実質的な運用を行う仕組みです。当ファンドは「ベビーファンド」にあたります。

## 運用プロセスのイメージ



※ベンチマークの構成銘柄および組入比率の変動に応じて、ポートフォリオは定期的に銘柄入替（6月、12月）およびリバランス（3月、6月、9月、12月）を行います。

※2024年3月末現在のプロセスのイメージであり、将来変更となる場合があります。

※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できない場合があります。



# ファンドの目的・特色

## ファンドの特色

特色 **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。

## iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス（配当込み）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。2010年12月17日の時価総額を100として、STOXX社が算出・公表しています。

※ROE（自己資本利益率）とは、Return on Equityの略で、当期純利益を自己資本で割って算出されます。一般的にはこの数値が高いほど企業の収益力は高いと評価されます。

### ■ STOXX社とは

- ・ドイツ取引所傘下の指数プロバイダーです。
- ・ドイツのDAX<sup>®</sup>\*、ユーロ・ストックス50指数、ストックス欧州600指数などヨーロッパのベンチマーク指数を算出しています。
- ・世界60超の国・地域をカバーする13,000以上の指数を算出しています。
- ・STOXX社は本社をスイス・ツークに置き、ニューヨーク、ロンドン、フランクフルト、香港、東京など世界各地で展開しています。

\*DAX<sup>®</sup>はISS STOXX GmbHの登録商標です。

※「STOXX社とは」は、2024年3月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

※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できない場合があります。



# ファンドの目的・特色

## ベンチマークの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<sup>\*1</sup>違反企業、特定兵器関連企業およびESG不祥事スコアが一定水準以下の銘柄を除外

### ③財務スクリーニング

- ③ ROE<sup>\*2</sup>、財務3指標<sup>\*3</sup>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

※ベンチマークの構築プロセスのイメージは、2024年3月末現在のものであり、将来変更される場合があります。



# ファンドの目的・特色

## ご参考

下記スコアの算出にあたってはESG調査会社であるサステナリティクス社のESGデータを活用します。

### ESG不祥事スコア

環境や社会に悪影響を与え得る企業活動を調査し、下記10項目の平均スコアが90以下（最大100）の銘柄を除外。

	Environment (環境)	Social (社会)	Governance (ガバナンス)
評価項目	<ul style="list-style-type: none"> <li>・オペレーション不祥事</li> <li>・環境サプライチェーン不祥事</li> <li>・製品&amp;サービス不祥事</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・従業員不祥事</li> <li>・社会サプライチェーン不祥事</li> <li>・顧客不祥事</li> <li>・社会&amp;コミュニティ不祥事</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ビジネス倫理不祥事</li> <li>・ガバナンス不祥事</li> <li>・公序良俗不祥事</li> </ul>

### ESGマネジメントスコア

ESGに関連した下記の項目に関してスコアを算出。

	Environment (環境)	Social (社会)	Governance (ガバナンス)
評価項目	<ul style="list-style-type: none"> <li>・環境マネジメントシステム</li> <li>・水資源利用状況</li> <li>・温暖化ガス削減プログラム</li> </ul> <p style="text-align: right;">など</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・労働時間ポリシー</li> <li>・人材多様性プログラム</li> <li>・人権政策</li> </ul> <p style="text-align: right;">など</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・贈収賄&amp;汚職方針</li> <li>・役員報酬の開示</li> <li>・取締役会の独立性</li> </ul> <p style="text-align: right;">など</p>

ESG不祥事スコアおよびESGマネジメントスコアの評価項目は、今後変更される可能性があります。

## ちばぎんアセットマネジメントが当指数をベンチマークとして採用した理由

ベンチマークの選定にあたっては、指数の過去のパフォーマンス実績、指数におけるESG勘案方法、指数提供機関のサービス内容などを総合的に勘案しています。当ファンドのベンチマークとして、「iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス（配当込み）」が相応しいと判断した主な理由は以下のとおりです。

- ①当指数は、環境や社会に悪影響を与え得る企業を排除していることに加え、組入銘柄の選定にあたりESGデータを考慮していること。
- ②当指数の構成銘柄を決定するメソッドロジーは、STOXX社から公表されており、定量的なデータをもとに決定されていることから、十分な透明性があると判断したこと。

## ESGを主要な要素として選定した投資銘柄の組入比率の目標

- ・当ファンドは、ESGを主要な要素として選定した投資銘柄の組入比率について100%とすることを目標としています。



# ファンドの目的・特色

## ベンチマークの構成比率上位10銘柄

(2024年3月末時点)

	銘柄	業種	構成比率
1	ファーストリテイリング	小売業	2.1%
2	リクルートホールディングス	サービス業	2.1%
3	三菱商事	卸売業	2.1%
4	日立製作所	電気機器	2.1%
5	三井物産	卸売業	2.1%
6	東京海上ホールディングス	保険業	2.1%
7	東京エレクトロン	電気機器	2.1%
8	信越化学工業	化学	2.0%
9	ソニーグループ	電気機器	2.0%
10	任天堂	その他製品	1.9%

※業種については東証33業種分類に基づいています。

## ベンチマークの推移

(2010年12月17日～2024年3月29日、日次)



(出所) ブルームバーグのデータを基にちばぎんアセットマネジメント作成

※上記は過去の情報であり、将来の運用成果を示唆・保証するものではありません。また、ファンドの運用状況を表したものではありません。



# ファンドの目的・特色

## ファンドの特色

### 分配方針

年1回、毎決算時（毎年3月10日、休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- 収益分配金額は、分配対象額の範囲内で、基準価額水準等を勘案して委託会社が決定します。なお、分配対象金額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）

※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。

※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できない場合があります。

### 主な投資制限

- 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。
- デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。

### 「iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス（配当込み）」の免責事項について

STOXXリミテッド（以下「STOXX社」）、ドイツ取引所グループおよび同社のライセンサー、リサーチパートナーまたはデータプロバイダーは、金融商品に関して対象インデックスおよび関連商標を利用するライセンスを付与することを除き、ライセンサーと一切の関係は有していません。

iSTOXX指数は、個別のルール・ブックに基づき、顧客の要求またはマーケットの要望に合わせて作成されるものであり、STOXXグローバル指数シリーズに含まれるものではありません。

STOXX社、ドイツ取引所グループおよび同社のライセンサー、リサーチパートナーまたはデータプロバイダーは、以下のことを行うものではありません。

- ▶ 金融商品を支援、推奨、販売または宣伝すること
- ▶ 金融商品またはその他の証券への投資を勧めること
- ▶ 金融商品についてタイミング、数量もしくは価格について責任もしくは義務を負ったり、またはこれらについての何らかの意思決定を行ったりすること
- ▶ 金融商品の管理、運営またはマーケティングについて、何らかの責任や義務を負うこと
- ▶ 対象インデックスの決定、組成もしくは計算にあたり、金融商品へのニーズもしくは金融商品の保有者を考慮すること、またはそのような考慮をすべき義務を負うこと

STOXX社、ドイツ取引所グループおよび同社のライセンサー、リサーチパートナーまたはデータプロバイダーは、金融商品またはその運用成果に関連して、何ら保証するものではなく、かつ（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。

また、STOXX社は、金融商品の購入者または他のいかなる第三者との間でも、何ら契約上の関係を有していません。具体的には、

- ▶ STOXX社、ドイツ取引所グループおよび同社のライセンサー、リサーチパートナーまたはデータプロバイダーは、以下について、何ら明示または黙示の保証を行うことなく、かつあらゆる責任を否認します。
  - ▶ 対象インデックスおよびそれに包含されるデータの利用に関連し、金融商品、その保有者または他のいずれかの者が取得すべき成果
  - ▶ 対象インデックスおよびそのデータの正確性、適時性および完全性
  - ▶ 対象インデックスおよびそのデータの商品性、ならびに特定の目的または使用への適合性
  - ▶ 金融商品の運用成果一般

▶ STOXX社、ドイツ取引所グループおよび同社のライセンサー、リサーチパートナーまたはデータプロバイダーは、対象インデックスまたはそのデータに関するエラー、遺漏または中断について、何ら保証するものではなく、かつ一切の責任を負いません。

▶ STOXX社、ドイツ取引所グループおよび同社のライセンサー、リサーチパートナーまたはデータプロバイダーは、いかなる状況の下でも、対象インデックスもしくはそのデータにおけるか、もしくは金融商品に一般的に関連するエラー、遺漏もしくは中断の結果として生じる逸失利益または間接的、懲罰的、特別もしくは結果的な損害もしくは損失について、（過失の有無を問わず）一切の責任を負いません。これは、たとえSTOXX社、ドイツ取引所グループおよび同社のライセンサー、リサーチパートナーまたはデータプロバイダーがそうした損失もしくは損害が発生しうること認識していた場合であっても同様です。

ちばぎんアセットマネジメント株式会社とSTOXX社との間のライセンス契約は、専ら両者の利益を図るためのものであって、金融商品の保有者または他いかなる第三者の利益を図るものでもありません。





# 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、投資者の皆様は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、全て投資者の皆様へ帰属します。
- 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動きとファンドの基準価額の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。



# 投資リスク

## 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性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。

## リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

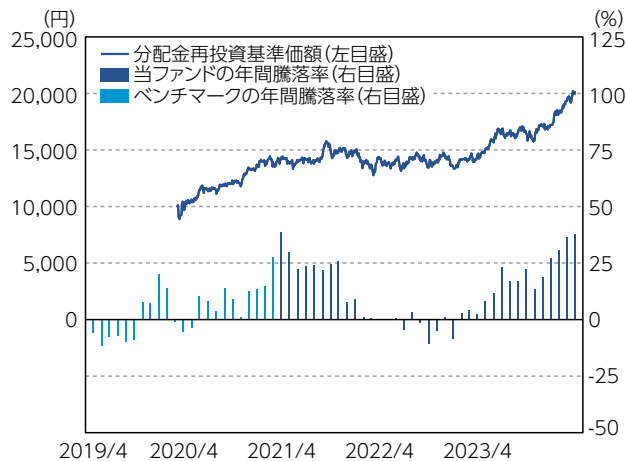
- 委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行います。
- 取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。
- コンプライアンス部が、運用パフォーマンスおよび運用に係るリスクのモニタリングを行い、モニタリング結果を投資信託委員会に報告します。
- コンプライアンス部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性を評価・検証し、結果を社長に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の点検を行います。

※上記は、2024年3月末現在のリスク管理体制です。リスク管理体制は変更されることがあります。

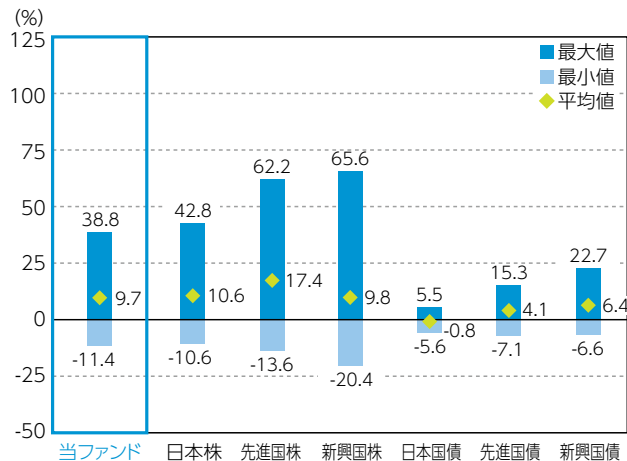
# 投資リスク

## <参考情報>

### 当ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



### 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



- \* 当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ますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- \* 当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。
- \* 設定前については、ベンチマークの年間騰落率を用いて算出していますので、当ファンドの実績ではありません。

- \* 2019年4月~2024年3月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の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。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 当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。
- \* 当ファンドの年間騰落率のうち、設定前については、ベンチマークの年間騰落率を用いて算出していますので、当ファンドの実績ではありません。

#### 各資産クラスの指数

- 日本株…Morningstar 日本株式指数
- 先進国株…Morningstar 先進国株式指数 (除く日本)
- 新興国株…Morningstar 新興国株式指数
- 日本国債…Morningstar 日本国債指数
- 先進国債…Morningstar グローバル国債指数 (除く日本)
- 新興国債…Morningstar 新興国ソブリン債指数

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。各指数は、すべて利子・配当込みのグロス・リターンの指数です。

#### 各指数の概要

- ・日本株…Morningstar 日本株式指数は、Morningstar, Incが発表している配当込み株価指数で、日本に上場する株式で構成されています。
- ・先進国株…Morningstar 先進国株式指数 (除く日本)は、Morningstar, Incが発表している配当込み株価指数で、日本を除く世界の先進国に上場する株式で構成されています。
- ・新興国株…Morningstar 新興国株式指数は、Morningstar, Incが発表している配当込み株価指数で、世界の新興国に上場する株式で構成されています。
- ・日本国債…Morningstar 日本国債指数は、Morningstar, Incが発表している債券指数で、日本の国債で構成されています。
- ・先進国債…Morningstar グローバル国債指数 (除く日本)は、Morningstar, Incが発表している債券指数で、日本を除く主要先進国の政府や政府系機関により発行された債券で構成されています。
- ・新興国債…Morningstar 新興国ソブリン債指数は、Morningstar, Incが発表している債券指数で、新興国の政府や政府系機関により発行された米ドル建て債券で構成されています。

#### <重要事項>

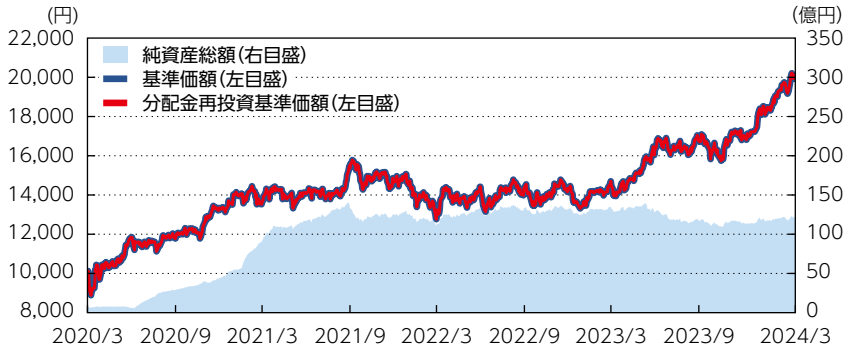
当ファンドは、Morningstar, Inc.、またはモーニングスター・ジャパン株式会社を含むMorningstar, Inc.の関連会社(これらの法人全てを総称して「Morningstarグループ」と言います)が組成、推薦、販売または宣伝するものではありません。Morningstarグループは、投資信託への一般的な投資の当否、特に当ファンドに投資することの当否、または当ファンドが投資対象とする市場の一般的な騰落率と連動するMorningstarのインデックス(以下「Morningstarインデックス」と言います)の能力について、当ファンドの受益者または公衆に対し、明示または黙示を問わず、いかなる表明保証も行いません。本ファンドとの関連においては、ちばぎんアセットマネジメント株式会社(以下、「委託会社」と言います)とMorningstarグループとの唯一の関係は、Morningstarのサービスマークおよびサービスマーク並びに特定のMorningstarインデックスの使用の許諾であり、Morningstarインデックスは、Morningstarグループが委託会社または当ファンドとは無関係に判断、構成、算定しています。Morningstarグループは、Morningstarインデックスの判断、構成または算定を行うにあたり、委託会社または当ファンドの受益者のニーズを考慮する義務を負いません。Morningstarグループは、当ファンドの基準価額および設定金額あるいは当ファンドの設定あるいは販売の時期の決定、または当ファンドの解約時の基準価額算出式の決定あるいは計算について責任を負わず、また関与しておりません。Morningstarグループは、当ファンドの運営管理、マーケティングまたは売買取引に関連していかなる義務も責任も負いません。

Morningstarグループは、Morningstarインデックスまたはそれに含まれるデータの正確性および/または完全性を保証せず、また、Morningstarグループは、その誤謬、脱漏、中断についていかなる責任も負いません。Morningstarグループは、委託会社、当ファンドの受益者もしくはユーザー、またはその他の人もしくは法人が、Morningstarインデックスまたはそれに含まれるデータを使用して得る結果について、明示または黙示を問わず、いかなる保証も行いません。Morningstarグループは、Morningstarインデックスまたはそれに含まれるデータについて明示または黙示の保証を行わず、また商品性あるいは特定目的または使用への適合性に関する一切の保証を明確に否認します。上記のいずれも制限することなく、いかなる場合であれ、Morningstarグループは、特別損害、懲罰的損害、間接損害または結果損害(逸失利益を含む)について、例えこれらの損害の可能性を告知されていたとしても責任を負いません。

# 運用実績

設定日：2020年3月10日  
作成基準日：2024年3月29日

## ◆ 基準価額・純資産の推移



基準価額	20,051円
純資産総額	121.32億円

※上記グラフは設定日から作成基準日までを表示しております。  
※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計算しております。

## ◆ 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	2026年3月
分配金	0円	0円	0円	20円	—	—

※運用状況によっては、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。

## ◆ 主要な資産状況

ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行っています。  
比率は対純資産総額比(マザーファンドベース)です。

### ● JAPAN ESGクオリティ200インデックスマザーファンド

#### 資産配分

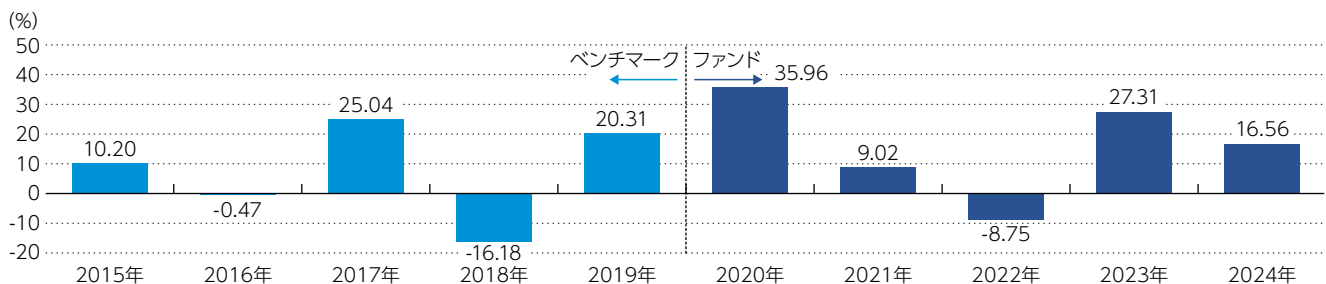
資産	比率(%)
株式	98.8
株式先物	1.2
短期金融資産等	0.0
合計	100.0

※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。

#### 上位10銘柄

	銘柄名	業種	比率(%)
1	ファーストリテイリング	小売業	2.1
2	リクルートホールディングス	サービス業	2.1
3	三菱商事	卸売業	2.1
4	日立製作所	電気機器	2.1
5	三井物産	卸売業	2.1
6	東京海上ホールディングス	保険業	2.0
7	東京エレクトロン	電気機器	2.0
8	信越化学工業	化学	2.0
9	ソニーグループ	電気機器	2.0
10	任天堂	その他製品	1.9

## ◆ 年間収益率の推移 (暦年ベース)



※2020年は当初設定日から年末までの収益率です。  
※2024年は年初から作成基準日までの収益率です。  
※2015年から2019年はファンドのベンチマークである「iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス(配当込み)」の年間収益率です。  
※ベンチマーク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。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。



# 手続・手数料等

## 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。)
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	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。
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。  原則として、販売会社の営業日の午後3時までとします。
申込締切時間	※申込締切時間は2024年11月5日より原則として、購入・換金の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する予定です。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。
購入の申込期間	2024年6月12日から2024年12月11日までとします。 ※上記期間満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	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及び取消	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。 <ul style="list-style-type: none"><li>● 受益権の口数が30億口を下回った場合</li><li>● 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</li><li>● やむを得ない事情が発生した場合</li></ul>
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。
信託金の限度額	2,000億円
公 告	原則、 <a href="http://www.chibagin-am.co.jp/">http://www.chibagin-am.co.jp/</a> に電子公告を掲載します。
運用報告書	毎決算時および償還時に交付運用報告書および運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。
課税関係	課税上は株式投資信託として取り扱われます。 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。

# 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	購入申込受付日の基準価額に <b>3.3% (税抜3.0%)</b> 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。 購入時手数料は、商品説明等に係る費用の対価として、販売会社にお支払いいただくものです。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	<b>ありません。</b>	
投資者が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、 <b>年率0.77% (税抜0.70%)</b> を乗じて得た額とします。 信託期間を通じて毎日計算し、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産から支払われます。 信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率	
	支払先	内 訳
	委託会社	年率0.407% (税抜0.37%)
	販売会社	年率0.330% (税抜0.30%)
	主な役務	
	受託会社	年率0.033% (税抜0.03%)
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。 組入有価証券の売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料 信託事務にかかる諸費用は、投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息等 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用	

※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。

### <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%

※上記税率は2024年3月末現在のものです。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※法人の場合は上記とは異なります。

※税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。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。



# 手続・手数料等

## (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
0.77%	0.77%	0.00%

※対象期間は2023年3月11日～2024年3月11日です。

※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を除きます。)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値(年率)です。

※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。

※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。

