

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〉

運用報告書（全体版）

第1期（決算日 2021年3月10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。
「ジャパンESGクオリティ200インデックスファンド」は、2021年3月10日に第1期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。
今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

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／インデックス型 | |
| 信託期間 | 2020年3月10日から無期限です。 | |
| 運用方針 | 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て運用を行います。 | |
| 主要投資対象 | ジャパンESGクオリティ200インデックスファンド | 「JAPAN ESGクオリティ200インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 なお、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。）に直接投資する場合があります。 |
| | JAPAN ESGクオリティ200インデックスマザーファンド | 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。）を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | ジャパンESGクオリティ200インデックスファンド | 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。 |
| | JAPAN ESGクオリティ200インデックスマザーファンド | 株式への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。 |
| 分配方針 | 毎決算時に、原則として、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。）等のうちから、基準価額水準等、市況動向等を勘案して、分配を行う方針です。 ただし、分配対象金額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。 収益分配に充てなかった留保益については、元本部分と同一の運用を行います。 | |

〈照会先〉

電話番号：03-5638-1451

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

ホームページ：<http://www.chibagin-am.co.jp/>



ちばぎんアセットマネジメント

東京都墨田区江東橋2丁目13番7号

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス (配当込み) | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産額 | |
|---------------------|-------------|----------|----------|--|----------|--------|--------|--------|------------|
| | (分配落) | 税込 分配 | み金 騰落 | 期中 騰落 | 中率 騰落 | | | | |
| (設定日) 2020年3月10日 | 円 10,000 | | 円 — | | % — | 207.85 | % — | % — | 百万円 693 |
| 1期(2021年3月10日) | 13,675 | | 0 | 36.8 | 285.94 | 37.6 | 99.7 | 0.3 | 9,282 |

- (注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額、純資産総額は、設定元本を表示しております。
- (注2) 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。STOXX社は、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の発行元です。STOXX社は、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社に關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。
- (注3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」と「株式先物比率」は実質比率を記載しております。
- (注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

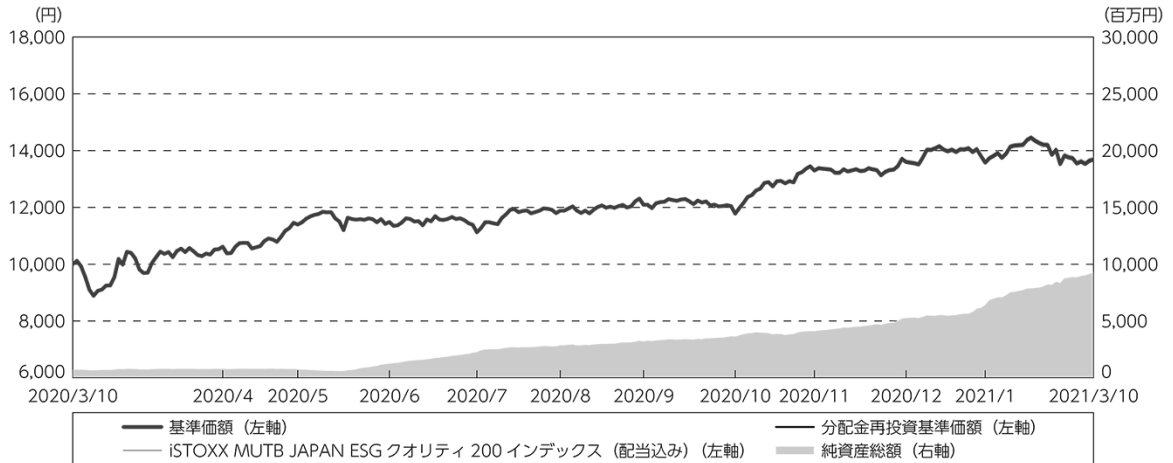
| 年月日 | 基準価額 | | iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス (配当込み) | | 株式組入比率 | 株式先物比率 |
|---------------------|-------------|--------|--|--------|--------|--------|
| | 騰落率 | 騰落率 | | | | |
| (設定日) 2020年3月10日 | 円 10,000 | % — | 207.85 | % — | % — | % — |
| 3月末 | 10,203 | 2.0 | 211.98 | 2.0 | 98.5 | 1.5 |
| 4月末 | 10,616 | 6.2 | 220.74 | 6.2 | 98.7 | 1.4 |
| 5月末 | 11,396 | 14.0 | 237.11 | 14.1 | 99.0 | 1.1 |
| 6月末 | 11,486 | 14.9 | 239.17 | 15.1 | 99.9 | 0.2 |
| 7月末 | 11,123 | 11.2 | 231.80 | 11.5 | 99.9 | 0.2 |
| 8月末 | 11,885 | 18.9 | 247.85 | 19.2 | 94.3 | 0.5 |
| 9月末 | 12,092 | 20.9 | 252.11 | 21.3 | 99.1 | 0.8 |
| 10月末 | 11,780 | 17.8 | 245.76 | 18.2 | 99.1 | 0.9 |
| 11月末 | 13,296 | 33.0 | 277.54 | 33.5 | 99.2 | 0.9 |
| 12月末 | 13,596 | 36.0 | 283.96 | 36.6 | 99.9 | 0.3 |
| 2021年1月末 | 13,575 | 35.8 | 283.70 | 36.5 | 99.9 | 0.3 |
| 2月末 | 13,523 | 35.2 | 282.68 | 36.0 | 99.9 | 0.3 |
| (期末) 2021年3月10日 | 13,675 | 36.8 | 285.94 | 37.6 | 99.7 | 0.3 |

- (注1) 騰落率は設定日比です。
- (注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」と「株式先物比率」は実質比率を記載しております。
- (注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率。

○運用経過

(2020年3月10日～2021年3月10日)

期中の基準価額等の推移



設定日：10,000円

期末：13,675円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：36.8% (分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)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。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス(配当込み)は、設定時の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注4) iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス(配当込み)は当ファンドのベンチマークです。
- (注5) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は、当期末において13,675円となりました。期中に分配金が0円でしたので、2020年3月10日設定来では36.8% (信託報酬控除後)の上昇となりました。

(プラス要因)

- ・新型コロナウイルスのワクチン開発進展
- ・ワクチン接種の開始を受けた経済正常化への期待
- ・米国大統領選挙通過による政治的不透明感の後退
- ・米国のバイデン新政権の大規模景気対策への期待

(マイナス要因)

- ・新型コロナウイルスの世界的な感染拡大
- ・経済活動の停滞による世界景気の急速な悪化
- ・国内企業の業績悪化

投資環境

当期の国内株式市場は上昇しました。

期初、新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済への不安を背景に日経平均株価は一時16,300円台まで急落しましたが、各国の金融・財政政策やワクチン開発進展への期待に加え、経済活動の一部再開などが好感されたことから戻り歩調となり、2020年6月上旬に23,000円台を回復しました。その後、10月にかけては新型コロナウイルス感染拡大への懸念などを背景にもみ合う展開でしたが、11月の米国大統領選挙を通過し政治的不透明感が後退したことに加え、新型コロナウイルスのワクチン開発進展の報道が相次ぐ中で、年末にかけて日経平均株価は上昇しました。

2021年の年明け以降、米国で追加経済対策協議が合意に至ったことに加え、1月のジョージア州における米国上院選決選投票で民主党が勝利し、バイデン新政権による大規模な景気対策への期待が高まったことなどを受けて日経平均株価は一段高となりました。その後、米国個人投資家の投機的な取引による市場の混乱から株価が調整する場面もありましたが、多くの企業で2020年10-12月期業績が市場予想を上回ったことや、ワクチン接種に伴う経済活動正常化への期待などを背景に再び上昇に転じ、日経平均株価は一時30,000円を超えました。2月下旬以降、米国長期金利の上昇を背景にテクノロジー関連をはじめとするグロース銘柄への売りが優勢となり、期末にかけてはやや値を下げて終わりました。

このような環境下、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）は37.6%上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

（当ファンド）

当ファンドは、「JAPAN ESGクオリティ200インデックスマザーファンド」受益証券を高位に組入れて運用を行いました。

（JAPAN ESGクオリティ200インデックスマザーファンド）

資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。株式ポートフォリオは、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）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

ベンチマークとのかい離は△0.82%程度となりました。

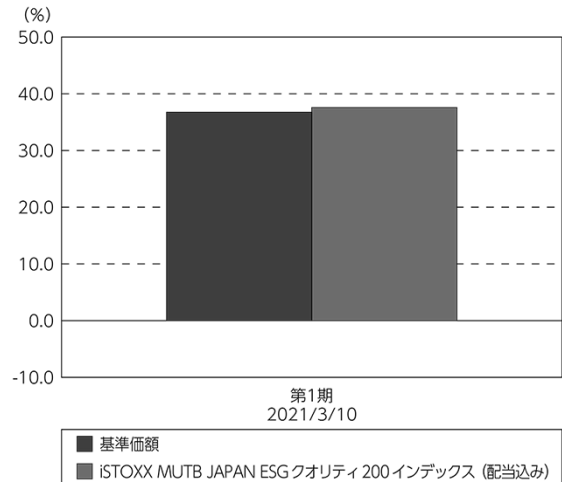
マザーファンド保有以外の要因

管理コスト等による影響は△1.00%程度でした。

マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は+0.18%程度でした。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注1) 基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。

(注2) iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス（配当込み）は当ファンドのベンチマークです。

分配金

基準価額水準、市況動向等を勘案し、収益分配を行わないことといたしました。

なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

〇分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

| 項目 | 第1期 |
|--------------------|---------------------------|
| | 2020年3月10日～ 2021年3月10日 |
| 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 | 3,675 |

(注1) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

(当ファンド)

引き続き、ファンドの基本方針に則り、「JAPAN ESGクオリティ200インデックスマザーファンド」受益証券を高位に組入れて運用を行います。

(JAPAN ESGクオリティ200インデックスマザーファンド)

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年3月10日～2021年3月10日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|--------|-----------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 93 | 0.772 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| (投 信 会 社) | (49) | (0.408) | 委託した資金の運用の対価 |
| (販 売 会 社) | (40) | (0.331) | 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、購入後の 情報提供等の対価 |
| (受 託 会 社) | (4) | (0.033) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 6 | 0.053 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (株 式) | (5) | (0.039) | |
| (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | (2) | (0.014) | |
| (c) そ の 他 費 用 | 1 | 0.006 | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (監 査 費 用) | (1) | (0.006) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| (そ の 他) | (0) | (0.000) | 信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合 計 | 100 | 0.831 | |
| 期中の平均基準価額は、12,047円です。 | | | |

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

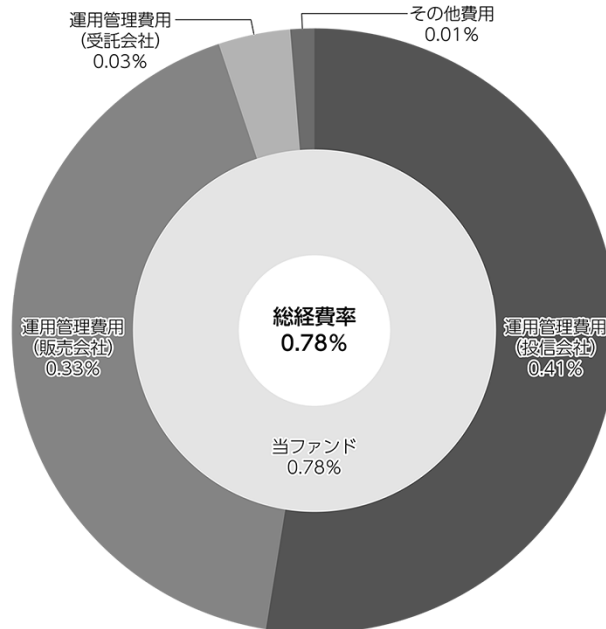
(注3) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注4) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(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0.78%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、親投資信託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3月10日～2021年3月10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 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| JAPAN ESGクオリティ200インデックスマザーファンド | 10,509,159 | 11,956,478 | 2,944,413 | 3,406,710 |

○株式売買比率

(2020年3月10日～2021年3月10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 | |
|---------------------|--------------------------------|--|
| | JAPAN ESGクオリティ200インデックスマザーファンド | |
| (a) 期中の株式売買金額 | 16,826,811千円 | |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 10,230,286千円 | |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.64 | |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年3月10日～2021年3月10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。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2020年3月10日～2021年3月10日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2020年3月10日～2021年3月10日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2021年3月10日現在)

親投資信託残高

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | |
|--------------------------------|---|-----------------|-----------------|
| | | 口 数 | 評 価 額 |
| JAPAN ESGクオリティ200インデックスマザーファンド | | 千口 7,564,745 | 千円 9,282,699 |

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2021年3月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| JAPAN ESGクオリティ200インデックスマザーファンド | 千円 9,282,699 | % 99.7 |
| コール・ローン等、その他 | 31,872 | 0.3 |
| 投資信託財産総額 | 9,314,571 | 100.0 |

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年3月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 9,314,571,032 |
| JAPAN ESGクオリティ200インデックスマザーファンド(評価額) | 9,282,699,277 |
| 未収入金 | 31,871,755 |
| (B) 負債 | 31,871,755 |
| 未払解約金 | 12,671,871 |
| 未払信託報酬 | 19,063,771 |
| その他未払費用 | 136,113 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 9,282,699,277 |
| 元本 | 6,788,004,588 |
| 次期繰越損益金 | 2,494,694,689 |
| (D) 受益権総口数 | 6,788,004,588口 |
| 1万円当たり基準価額(C/D) | 13.675円 |

(注1) 当ファンドの設定時元本額は693,172,081円、期中追加設定元本額は8,711,845,486円、期中一部解約元本額は2,617,012,979円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1.3675円です。

○損益の状況 (2020年3月10日～2021年3月10日)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|-----------------------------------|
| | 円 |
| (A) 有価証券売買損益 | 412,317,181 |
| 売買益 | 662,225,192 |
| 売買損 | △ 249,908,011 |
| (B) 信託報酬等 | △ 24,403,751 |
| (C) 当期損益金(A+B) | 387,913,430 |
| (D) 追加信託差損益金 (売買損益相当額) | 2,106,781,259 (2,106,781,259) |
| (E) 計(C+D) | 2,494,694,689 |
| (F) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(E+F) | 2,494,694,689 |
| 追加信託差損益金 (配当等相当額) | 2,106,781,259 (6,880,087) |
| (売買損益相当額) | (2,099,901,172) |
| 分配準備積立金 | 387,913,430 |

(注1) 損益の状況の中で(A)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) 損益の状況の中で(B)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(D)追加信託差損益金とあるのは、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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(40,952,270円)、費用控除後の有価証券等損益額(346,961,160円)、および信託約款に規定する収益調整金(2,106,781,259円)より分配対象収益は2,494,694,689円(1万円当たり3.675円)ですが、当期に分配した金額はありません。

○分配金のお知らせ

| | |
|----------------|----|
| 1万円当たり分配金(税込み) | 0円 |
|----------------|----|

○お知らせ

2020年3月10日から2021年3月10日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

JAPAN ESGクオリティ200 インデックスマザーファンド

運用報告書

第3期（決算日 2021年3月10日）
（2020年9月11日～2021年3月10日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|---|
| 信託期間 | 2019年9月20日から無期限です。 |
| 運用方針 | 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て運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 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。）を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | 株式への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。 |



ちばきんアセットマネジメント

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス(配当込み) | | 株組入比率 | 株先物比率 | 純資産総額 |
|----------------|--------|-------|---|-------|-------|-------|--------|
| | 騰落 | 中率 | (ベンチマーク) 騰落 | 中率 | | | |
| (設定日) | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 2019年9月20日 | 10,000 | — | 232.30 | — | — | — | 1,500 |
| 1期(2020年3月10日) | 9,015 | △ 9.9 | 210.29 | △ 9.5 | 99.8 | 0.2 | 7,292 |
| 2期(2020年9月10日) | 10,653 | 18.2 | 248.56 | 18.2 | 99.4 | 0.5 | 9,613 |
| 3期(2021年3月10日) | 12,271 | 15.2 | 285.94 | 15.0 | 99.7 | 0.3 | 16,359 |

(注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額、純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注2) 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。

STOXX社は、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の発行元です。STOXX社は、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社に關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。

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス(配当込み) | | 株組入比率 | 株先物比率 |
|------------|--------|-------|---|-------|-------|-------|
| | 騰落 | 率 | (ベンチマーク) 騰落 | 率 | | |
| (期首) | 円 | % | | % | % | % |
| 2020年9月10日 | 10,653 | — | 248.56 | — | 99.4 | 0.5 |
| 9月末 | 10,815 | 1.5 | 252.11 | 1.4 | 99.0 | 0.8 |
| 10月末 | 10,543 | △ 1.0 | 245.76 | △ 1.1 | 99.0 | 0.9 |
| 11月末 | 11,906 | 11.8 | 277.54 | 11.7 | 99.1 | 0.9 |
| 12月末 | 12,182 | 14.4 | 283.96 | 14.2 | 99.7 | 0.3 |
| 2021年1月末 | 12,171 | 14.2 | 283.70 | 14.1 | 99.7 | 0.3 |
| 2月末 | 12,132 | 13.9 | 282.68 | 13.7 | 99.7 | 0.3 |
| (期末) | | | | | | |
| 2021年3月10日 | 12,271 | 15.2 | 285.94 | 15.0 | 99.7 | 0.3 |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は買建比率－売建比率。

○運用経過

(2020年9月11日～2021年3月10日)

期中の基準価額等の推移

○基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は、当期末において12,271円となり、期首比15.2%の上昇となりました。

(プラス要因)

- ・新型コロナウイルスのワクチン開発進展
- ・ワクチン接種の開始を受けた経済正常化への期待
- ・米国大統領選挙通過による政治的不透明感の後退
- ・米国のバイデン新政権の大規模景気対策への期待

(マイナス要因)

- ・国内外の新型コロナウイルス新規感染者数の増加
- ・米国の財政負担増加懸念による長期金利の上昇

投資環境

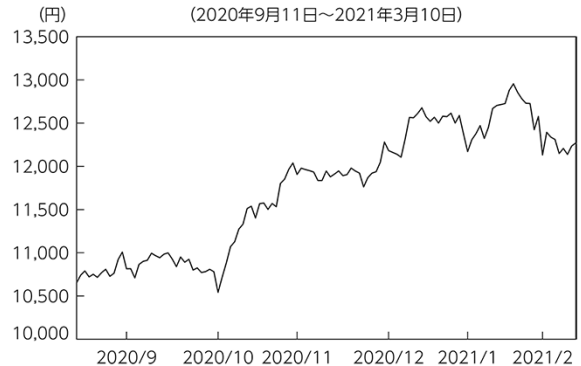
当期の国内株式市場は上昇しました。

期初から2020年10月にかけては、新型コロナウイルス感染拡大への懸念などを背景にもみ合う展開でしたが、11月の米国大統領選挙を通過し政治的不透明感が後退したことに加え、新型コロナウイルスのワクチン開発進展の報道が相次ぐ中で、年末にかけて日経平均株価は上昇しました。

2021年の年明け以降、米国で追加経済対策協議が合意に至ったことに加え、1月のジョージア州における米国上院選決選投票で民主党が勝利し、バイデン新政権による大規模な景気対策への期待が高まったことなどをを受けて日経平均株価は一段高となりました。その後、米国個人投資家の投機的な取引による市場の混乱から株価が調整する場面もありましたが、多くの企業で2020年10-12月期業績が市場予想を上回ったことや、ワクチン接種に伴う経済活動正常化への期待などを背景に再び上昇に転じ、日経平均株価は一時30,000円を超えました。2月下旬以降、米国長期金利の上昇を背景にテクノロジー関連をはじめとするグロース銘柄への売りが優勢となり、期末にかけてはやや値を下げて終わりました。

このような環境下、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）は期首比15.0%上昇しました。

【基準価額の推移】



基準価額の推移



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



当ファンドのポートフォリオ

資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。株式ポートフォリオは、ベンチマークであるiSTOXX MUTB JAPAN ESG クオリティ200インデックスの個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

ベンチマークとのかい離は+0.15%程度となりました。

（主なプラス要因）

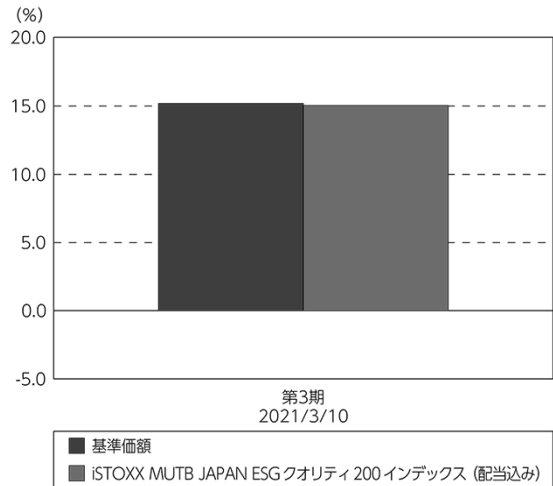
配当要因*

※ベンチマークとファンドの配当計上方法の違いによるプラス要因です。

（主なマイナス要因）

取引コスト要因

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



（注）iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス（配当込み）は当ファンドのベンチマークです。

○今後の運用方針

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2020年9月11日～2021年3月10日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|--|----------------------|----------------------------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先物・オプション) | 円 3 (2) (1) | % 0.025 (0.018) (0.006) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、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＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合 計 | 3 | 0.025 | |
| 期中の平均基準価額は、11,624円です。 | | | |

(注1) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2020年9月11日～2021年3月10日)

株式

| 国 内 | 上 場 | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|-----|-------|-----------|-----|-----------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| | | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| | | 2,241 | 8,194,657 | 748 | 2,813,544 |
| | | (15) | (-) | | |

(注1) 金額は受け渡し代金。

(注2) ()内は株式分割、予約権行使、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。

先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|--------|-------|-------|-------|-------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国 内 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式先物取引 | 6,299 | 6,317 | 85 | 86 |

○株式売買比率

(2020年9月11日～2021年3月10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 | 11,008,201千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 12,006,680千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.91 |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年9月11日～2021年3月10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3月10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 |
| 建設業 (3.5%) | | | |
| コムシスホールディングス | — | 8.3 | 27,099 |
| 大成建設 | 8.7 | 13.7 | 55,622 |
| 大林組 | 29.8 | 47.2 | 46,728 |
| 清水建設 | 29.9 | 47.5 | 41,990 |
| 鹿島建設 | 21.8 | 34.6 | 52,453 |
| 大東建託 | 2.8 | 4.5 | 51,975 |
| 五洋建設 | — | 18.7 | 15,483 |
| 住友林業 | 7.1 | 11.3 | 24,464 |
| 大和ハウス工業 | 27.5 | 43.7 | 141,238 |
| 積水ハウス | 26.7 | 42.4 | 95,209 |
| 九電工 | 2.3 | 3.6 | 13,320 |
| 食料品 (4.9%) | | | |
| 日清製粉グループ本社 | — | 18.8 | 35,720 |
| 森永製菓 | 1.9 | 3.1 | 12,121 |
| 寿スビリッツ | 0.9 | — | — |
| カルビー | 3.6 | 5.8 | 16,408 |
| 森永乳業 | 1.8 | 2.9 | 14,558 |
| ヤクルト本社 | 6.1 | 9.8 | 55,566 |
| 明治ホールディングス | 6.3 | 10 | 70,600 |
| アサヒグループホールディングス | 18.9 | 33.2 | 162,381 |
| キリンホールディングス | — | 54.6 | 117,608 |
| サントリー食品インターナショナル | 5.1 | 8.2 | 32,923 |
| 伊藤園 | 2.7 | — | — |
| 不二製油グループ本社 | 2.4 | 3.6 | 10,944 |
| キッコーマン | 8 | 12.7 | 87,376 |
| 味の素 | — | 36 | 81,936 |
| ニチレイ | 5.8 | 9.2 | 27,075 |
| 東洋水産 | 4.2 | 6.7 | 30,920 |
| 日清食品ホールディングス | 3.5 | 5.6 | 44,240 |
| 繊維製品 (0.1%) | | | |
| ゴールドウイン | 1.6 | 2.5 | 17,400 |
| パルプ・紙 (0.1%) | | | |
| レンゴー | 10.2 | 16.2 | 15,066 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 化学 (8.0%) | | | |
| 昭和電工 | 6.2 | — | — |
| 日産化学 | 6.1 | 9.5 | 55,480 |
| 東ソー | 13.4 | — | — |
| 信越化学工業 | 14.7 | 18.3 | 320,433 |
| 三井化学 | 7.9 | 12.5 | 46,000 |
| J S R | 8.8 | — | — |
| 東京応化工業 | — | 2.7 | 16,605 |
| 積水化学工業 | 18.9 | 30.9 | 64,890 |
| 日本化薬 | — | 11.6 | 12,586 |
| 日油 | 3.5 | 5.6 | 31,304 |
| 花王 | 19.9 | 31.6 | 228,183 |
| D I C | 3.4 | 5.4 | 15,552 |
| 富士フィルムホールディングス | 16.5 | 26.2 | 165,033 |
| 資生堂 | 16.5 | — | — |
| ライオン | 12.3 | 19.6 | 43,355 |
| ファンケル | 3.3 | 5.3 | 19,716 |
| コーセー | 1.5 | — | — |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 4.1 | — | — |
| 小林製薬 | 2.6 | 4.4 | 44,792 |
| アース製薬 | — | 1.1 | 7,183 |
| 日東電工 | 6.5 | 9.7 | 88,755 |
| ニフコ | 3.7 | — | — |
| ユニ・チャーム | 19.3 | 30.5 | 137,951 |
| 医薬品 (7.9%) | | | |
| 協和キリン | 10.3 | 16.5 | 52,800 |
| アステラス製薬 | 76.8 | 122 | 225,944 |
| 塩野義製薬 | 12.3 | 19.2 | 113,760 |
| 日本新薬 | 2.9 | 4.6 | 35,374 |
| 中外製薬 | 27.8 | 44.1 | 198,670 |
| 科研製薬 | 1.5 | 2.4 | 10,692 |
| エーザイ | 12.2 | 19.4 | 143,307 |
| ロート製薬 | 4.9 | 7.8 | 22,978 |
| 小野薬品工業 | 20.6 | 32.7 | 92,753 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 久光製薬 | 3.5 | 5.6 | 38,640 |
| 参天製薬 | 16.5 | 26.2 | 37,885 |
| 沢井製薬 | 1.8 | 2.9 | 14,906 |
| 第一三共 | — | 92.9 | 297,280 |
| ゴム製品 (—%) | | | |
| 横浜ゴム | 5.9 | — | — |
| ブリヂストン | 26.3 | — | — |
| ガラス・土石製品 (0.6%) | | | |
| 太平洋セメント | 5.2 | 7.9 | 21,740 |
| TOTO | 6.9 | 10.9 | 70,087 |
| 日本碍子 | 13.5 | — | — |
| 日本特殊陶業 | 8.6 | — | — |
| 非鉄金属 (0.1%) | | | |
| 三井金属鉱業 | — | 3.8 | 13,490 |
| 金属製品 (0.3%) | | | |
| 三和ホールディングス | 9.2 | 15.1 | 21,472 |
| リンナイ | 1.7 | 2.8 | 31,136 |
| 機械 (7.9%) | | | |
| 三浦工業 | 4.7 | 7.4 | 39,960 |
| FUJ I | — | 5.6 | 14,610 |
| オーエスジー | 4.1 | — | — |
| ディスコ | 1.2 | 2 | 65,300 |
| ナブテスコ | 5.2 | 8.2 | 38,335 |
| SMC | 2.5 | 3.9 | 234,507 |
| 小松製作所 | 40.1 | 63.7 | 212,949 |
| クボタ | — | 75.1 | 186,886 |
| 荏原製作所 | 3.9 | 6.3 | 26,586 |
| ダイキン工業 | 11.3 | 13.9 | 304,827 |
| 栗田工業 | 4.8 | 7.6 | 33,896 |
| アマノ | 2.9 | 4.6 | 12,144 |
| ホシザキ | 2.5 | 4 | 38,560 |
| マキタ | — | 18.4 | 88,596 |
| 三菱重工業 | 13.9 | — | — |
| 電気機器 (21.5%) | | | |
| ブラザー工業 | 10.8 | 17.2 | 41,159 |
| ミネベアミツミ | 17.6 | 28 | 76,748 |
| 三菱電機 | 88.6 | 140.7 | 234,406 |
| 日本電産 | 22.6 | 25.4 | 317,119 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| オムロン | 8.5 | 13.5 | 116,370 |
| 日本電気 | 10.7 | 17.9 | 112,770 |
| 富士通 | 8.5 | 13.6 | 213,452 |
| ルネサスエレクトロニクス | — | 66.1 | 75,221 |
| ワコム | — | 10.2 | 7,517 |
| エレコム | — | 1.7 | 8,177 |
| アンリツ | 5.7 | 9.1 | 21,903 |
| 富士通ゼネラル | — | 4.1 | 12,156 |
| ソニー | 24.8 | 32.1 | 353,100 |
| TDK | 5.3 | 8.5 | 126,225 |
| 横河電機 | — | 17.6 | 36,907 |
| アズビル | 6 | 9.5 | 42,085 |
| 日本光電工業 | 3.7 | 5.8 | 18,618 |
| アドバンテス | — | 13.1 | 108,861 |
| キーエンス | 4.2 | 6 | 294,780 |
| シスメックス | 7.2 | 11.5 | 127,477 |
| レーザータック | 3.9 | 6.2 | 75,702 |
| カシオ計算機 | 10 | 15.9 | 33,723 |
| ファナック | — | 12.1 | 317,685 |
| 浜松ホトニクス | 6.1 | 9.6 | 59,040 |
| 村田製作所 | 26.4 | 35.9 | 323,818 |
| 小糸製作所 | 5.3 | — | — |
| 東京エレクトロン | 6.5 | 8.7 | 353,655 |
| 輸送用機器 (2.9%) | | | |
| トヨタ自動車 | 27 | 42.2 | 343,001 |
| シマノ | 3.5 | 5.6 | 136,304 |
| テイ・エス テック | 2.2 | — | — |
| 精密機器 (3.8%) | | | |
| テルモ | 29.7 | 47.1 | 197,207 |
| 島津製作所 | 11.4 | 19.4 | 74,108 |
| マニー | 3.3 | 5.4 | 13,105 |
| HOYA | 15.5 | 24.3 | 288,562 |
| 朝日インテック | 9.8 | 15.6 | 46,441 |
| その他製品 (3.2%) | | | |
| パナダイナムコホールディングス | 9.2 | 14.5 | 114,796 |
| 凸版印刷 | 14.4 | — | — |
| 大日本印刷 | 11.6 | — | — |
| ヤマハ | 6.8 | 10.8 | 66,960 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ビジョン | 5 | 8 | 32,480 |
| 任天堂 | 4 | 5.3 | 312,700 |
| 電気・ガス業 (0.8%) | | | |
| 東京瓦斯 | — | 29 | 68,106 |
| 大阪瓦斯 | — | 27.3 | 55,446 |
| 陸運業 (0.7%) | | | |
| 東日本旅客鉄道 | 15.6 | — | — |
| 西日本旅客鉄道 | 7.9 | — | — |
| 東海旅客鉄道 | 8.5 | — | — |
| 山九 | 2.5 | 4 | 19,360 |
| 日立物流 | 1.9 | 2.5 | 8,962 |
| SGホールディングス | 10.4 | 33 | 80,586 |
| 倉庫・運輸関連業 (0.1%) | | | |
| 三菱倉庫 | — | 5.8 | 20,097 |
| 情報・通信業 (10.0%) | | | |
| NECネットエスアイ | 3.8 | 6 | 11,028 |
| システナ | — | 4.7 | 9,155 |
| 日鉄ソリューションズ | 1.5 | 2.4 | 8,328 |
| T I S | 10.9 | 17.2 | 39,921 |
| コーエーテクモホールディングス | 2.2 | 3.6 | 22,068 |
| ネクソン | 19.1 | 30.5 | 103,242 |
| SHIFT | — | 0.7 | 8,239 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | — | 3.1 | 6,717 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 1.8 | 2.8 | 37,044 |
| チェンジ | — | 1.8 | 5,400 |
| 野村総合研究所 | 17.1 | 25.1 | 79,818 |
| オービック | 3 | 4.7 | 88,031 |
| ジャストシステム | 1.3 | 2.1 | 12,369 |
| Zホールディングス | 111.2 | 176.8 | 107,476 |
| トレンドマイクロ | 5.8 | 9.2 | 48,300 |
| 日本オラクル | 1.4 | 2.2 | 25,146 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 4.4 | 6.9 | 22,321 |
| 大塚商会 | 5.4 | 8.6 | 42,226 |
| ネットワンシステムズ | 3.6 | 5.6 | 19,292 |
| 日本ユニシス | 3.3 | 5.2 | 16,406 |
| 日本電信電話 | 74.1 | 122.3 | 345,803 |
| KDD I | 58.8 | 106.9 | 372,974 |
| 光通信 | 1 | 1.5 | 31,470 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| NTTドコモ | 47.8 | — | — |
| 東宝 | 5.7 | — | — |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 26.5 | 42.1 | 73,632 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 3.8 | 6 | 35,160 |
| カプコン | 4 | 6.3 | 40,698 |
| S C S K | 2.1 | 3.4 | 21,964 |
| 卸売業 (4.2%) | | | |
| 双日 | 51.6 | 81.9 | 24,979 |
| 神戸物産 | 3 | 9.5 | 27,132 |
| シップヘルスケアホールディングス | 1.8 | — | — |
| 第一興商 | 1.8 | — | — |
| アズワン | — | 1.1 | 14,069 |
| 伊藤忠商事 | 61.6 | 97.5 | 335,302 |
| 三井物産 | 71.9 | 112.5 | 259,931 |
| 岩谷産業 | — | 3.2 | 20,224 |
| 小売業 (7.2%) | | | |
| ローソン | 2.1 | — | — |
| エービーシー・マート | 1.3 | 2 | 12,880 |
| MonotaRO | 5.2 | 8.2 | 46,986 |
| マツモトキヨシホールディングス | 4 | 6.7 | 33,265 |
| ZOZO | 4.3 | 7 | 22,470 |
| ウエルシアホールディングス | 4.3 | 6.8 | 24,412 |
| コスモス薬品 | 1 | 1.6 | 26,240 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 33.7 | 53.6 | 234,982 |
| ツルハホールディングス | 1.8 | 2.8 | 40,180 |
| クスリのアオキホールディングス | 0.9 | 1.2 | 9,960 |
| スシローグローバルホールディングス | 4.5 | 7.1 | 32,447 |
| 良品計画 | 10.9 | — | — |
| パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス | — | 26.4 | 68,904 |
| スキホールディングス | 1.8 | 2.8 | 22,176 |
| 日本瓦斯 | 1.7 | 2.6 | 14,092 |
| 丸井グループ | 9.2 | 14.7 | 31,458 |
| ヤオコー | 1.2 | 1.9 | 12,711 |
| ケーズホールディングス | 8.7 | 13.9 | 20,474 |
| アインホールディングス | 1.2 | 1.9 | 13,395 |
| ヤマダホールディングス | — | 49.3 | 26,572 |
| ニトリホールディングス | 3.9 | 6.1 | 115,869 |
| ファーストリテイリング | 2.9 | 3.7 | 339,475 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| サンドラッグ | 3.1 | 5 | 20,550 |
| 銀行業 (0.1%) | | | |
| りそなホールディングス | 95.8 | — | — |
| セブン銀行 | 29.9 | 47.5 | 12,017 |
| 保険業 (2.5%) | | | |
| SOMPOホールディングス | 15.4 | 24.5 | 101,209 |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 20.8 | — | — |
| 東京海上ホールディングス | 29.3 | 46 | 259,072 |
| T&Dホールディングス | 24.8 | 39.3 | 56,002 |
| その他金融業 (1.6%) | | | |
| 全国保証 | 2.8 | 4.5 | 22,365 |
| オリックス | 51.5 | 81.7 | 151,022 |
| 日本取引所グループ | 22.1 | 35.1 | 87,451 |
| 不動産業 (1.7%) | | | |
| ヒューリック | — | 35.8 | 43,604 |
| 野村不動産ホールディングス | 5.3 | 7.7 | 19,789 |
| オープンハウス | 2.8 | 4.4 | 19,844 |
| 東急不動産ホールディングス | — | 39.6 | 27,720 |
| パーク24 | 5.2 | — | — |
| 三井不動産 | 40.4 | — | — |
| 三菱地所 | 57.4 | 91.2 | 173,827 |
| イオンモール | 4.1 | — | — |
| サービス業 (6.3%) | | | |
| ミクシィ | — | 3 | 8,070 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | |
|-----------------|---------|-------|---------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 日本M&Aセンター | 6 | 10.3 | 58,504 | |
| エス・エム・エス | 2.9 | 4.7 | 14,805 | |
| パーソルホールディングス | — | 12.8 | 27,596 | |
| 総合警備保障 | 3.7 | 5.9 | 29,736 | |
| カカコム | 5.3 | 8.5 | 27,710 | |
| ベネフィット・ワン | 3.2 | 5.2 | 14,227 | |
| エムスリー | 18.5 | 29.4 | 213,561 | |
| アウトソーシング | — | 7.1 | 11,388 | |
| 博報堂DYホールディングス | 13.2 | 20.9 | 39,438 | |
| ケネディクス | 7.3 | — | — | |
| オリエンタルランド | 9.3 | — | — | |
| ユー・エス・エス | 10.3 | 16.3 | 32,159 | |
| エン・ジャパン | 1.4 | 2.5 | 7,562 | |
| テクノプロ・ホールディングス | 1.5 | 2.4 | 18,096 | |
| リクルートホールディングス | 47.5 | 75.4 | 370,892 | |
| ペイカレント・コンサルティング | — | 0.9 | 21,159 | |
| カナモト | 1.6 | — | — | |
| セコム | 9 | 14.3 | 133,833 | |
| 合 計 | 株 数・金 額 | 2,544 | 4,052 | 16,311,265 |
| | 銘柄数<比率> | 199 | 200 | <99.7%> |

(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) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 | 別 | 当 期 末 | |
|----|---------|-------|-------|
| | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国内 | 株式先物取引 | 百万円 | 百万円 |
| | TOPIX | 37 | — |
| | ミニTOPIX | 9 | — |

○投資信託財産の構成

(2021年3月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 16,311,265 | 98.2 |
| コール・ローン等、その他 | 298,338 | 1.8 |
| 投資信託財産総額 | 16,609,603 | 100.0 |

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年3月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 16,609,603,497 |
| コール・ローン等 | 276,000,627 |
| 株式(評価額) | 16,311,265,120 |
| 未収入金 | 1,489,550 |
| 未収配当金 | 17,609,200 |
| 差入委託証拠金 | 3,239,000 |
| (B) 負債 | 249,612,899 |
| 未払金 | 166,528,961 |
| 未払解約金 | 83,083,197 |
| 未払利息 | 741 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 16,359,990,598 |
| 元本 | 13,331,769,726 |
| 次期繰越損益金 | 3,028,220,872 |
| (D) 受益権総口数 | 13,331,769,726口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,271円 |

(注1) 当ファンドの期首元本額は9,024,124,303円、期中追加設定元本額は7,107,973,770円、期中一部解約元本額は2,800,328,347円です。

(注2) 2021年3月10日現在の元本の内訳は以下の通りです。

- ・ジャパンESGクオリティ200インデックスファンド 7,564,745,561円
- ・JAPAN ESGクオリティ200インデックスファンド(通称機関投資家限定) 5,767,024,165円

(注3) 1口当たり純資産額は1,2271円です。

○損益の状況 (2020年9月11日～2021年3月10日)

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 94,420,035 |
| 受取配当金 | 94,358,775 |
| その他収益金 | 157,418 |
| 支払利息 | △ 96,158 |
| (B) 有価証券売買損益 | 1,371,062,639 |
| 売買益 | 1,682,518,987 |
| 売買損 | △ 311,456,348 |
| (C) 先物取引等取引損益 | 16,264,080 |
| 取引益 | 43,241,340 |
| 取引損 | △ 26,977,260 |
| (D) 保管費用等 | △ 26 |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 1,481,746,728 |
| (F) 前期繰越損益金 | 589,679,185 |
| (G) 追加信託差損益金 | 1,462,145,718 |
| (H) 解約差損益金 | △ 505,350,759 |
| (I) 計(E+F+G+H) | 3,028,220,872 |
| 次期繰越損益金(I) | 3,028,220,872 |

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、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) 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、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。

○お知らせ

2020年9月11日から2021年3月10日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。