



# 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 国内企業のESGへの取り組み事例

**E**nvironment  
(環境)



**S**ocial  
(社会)

**G**overnance  
(ガバナンス・企業統治)



## 組入上位10銘柄の主なESGへの取り組み事例

2022年9月30日時点

**任天堂**  
世界的  
ゲームメーカー



幅広い世代が安心してプレイできるよう、Nintendo Switchでは保護者による使用制限機能（みまもり設定）を導入している。インターネットに起因するトラブル防止のためのフォーラムや、青少年を守るため内閣府が作成した冊子において、同機能の活用を紹介している。

**日本電信電話**  
通信事業最大手



経営の健全性の確保、適正な意思決定と事業遂行の実現、アカウントビリティ（説明責任）の明確化、コンプライアンスの徹底を基本方針として取り組み、コーポレートガバナンス・コードの各原則についてすべて実施している。また、具体的な目標として、反競争的な違反行為・贈収賄違反件数0件を掲げている。

**東京海上  
ホールディングス**  
損保大手



自然災害リスクに対応し、お客様や地域社会の「安心・安全」につながる商品・サービスの提供を使命としている。防災啓発活動として、全国の小学校、特別支援学校にて「ぼうさい授業（地震・津波編／水害土砂災害編）」を実施している。

**KDDI**  
携帯事業が主力の  
総合通信会社



DX推進をはじめとする環境整備や、職務領域を明確にする「ジョブ型」を取り入れた「KDDI版ジョブ型人事制度」による新たな働き方のビジョン策定など、人財ファースト企業への変革に向け働き方改革を推進している。

**三井物産**  
三井グループの  
大手総合商社



環境方針に大気・水・土壌の汚染防止に努めることや、有害廃棄物・汚染物質の削減および適正処理を通じて、自然環境の保全に努めることを掲げている。一例として、海を汚さず、海水に依存しない持続可能なサーモン陸上養殖への取り組みを2017年より実施。

**ファースト  
リテイリング**  
「ユニクロ」を  
グローバルに展開



「届けよう、服のチカラ」プロジェクトを通じ、日本全国の小・中・高校生とともに難民などの社会課題を考え、衣料支援を行っている。経済産業省「第11回キャリア教育アワード大企業の部」最優秀賞、文部科学省「第9回青少年の体験活動推進企業表彰」審査委員会優秀賞を受賞。

**伊藤忠商事**  
非財閥系の  
大手総合商社



日本の総合商社として初めて、「SDGs債フレームワーク」を発表し、SDGsに貢献する事業に資金使途を限定する2026年満期米ドル建て無担保普通社債（SDGs債）を総額5億米ドル発行した。資金は再生可能エネルギーの利用増加に向けた取り組みなどに充当された。

**HOYA**  
光学ガラス  
大手



コンタクトレンズ販売店として事業展開している「アイシティ」では、2010年4月よりコンタクト業界初となる、使い捨てコンタクトレンズの空ケースリサイクル運動「アイシティecoプロジェクト」を開始した。本プロジェクトを通じて、障がい者の自立・就労支援を行ったり、得られた収益を日本アイバンク協会に寄付したりすることで、社会貢献活動につなげている。

**セブン&アイ・  
ホールディングス**  
コンビニ  
総合スーパー



株主・投資家との建設的な対話は中長期的な企業価値の向上と持続的な成長に資すると考えており、活動を企画・実行するための専門部署（IR・SR部）を設置、社長が統括している。株主・投資家との対話から得た意見・要望・懸念等については経営陣および取締役会に適時報告し、経営活動や事業運営に活かしている。

**リクルート  
ホールディングス**  
人材・販促  
サービス大手



経営の透明性と健全性を向上し意思決定の質を上げるために、取締役会構成員の多様性を高めることを目指している。特にジェンダーについては目標を定めて取り組んでおり、2030年度までに監査役を含む取締役会構成員の女性比率を約50%にすることを目指している。

上記は2022年6月の銘柄入れ替実施後の、2022年9月30日時点の当ファンドのマザーファンドにおける組入上位銘柄について、ちばぎんアセットマネジメントがまとめたものです。ESGの要素への分類は、ちばぎんアセットマネジメントの独自の判断によるものです。当該銘柄について組入を約束するものではなく、売買を推奨するものではありません。また上記は過去の情報であり将来を約束するものではありません。



## ファンドの特色

- 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。
  - JAPAN ESGクオリティ200インデックスマザーファンドへの投資を通じて、主として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。

## 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、全て投資者の皆様には帰属します。**
- **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。

※ 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。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幅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ある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。

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、販売会社の営業日の午後3時までとします。
- 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)
- 線上償還・・・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(線上償還)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、少額投資非課税制度および未成年者少額投資非課税制度の適用対象です。  
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。



<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へ帰属します。
- 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。