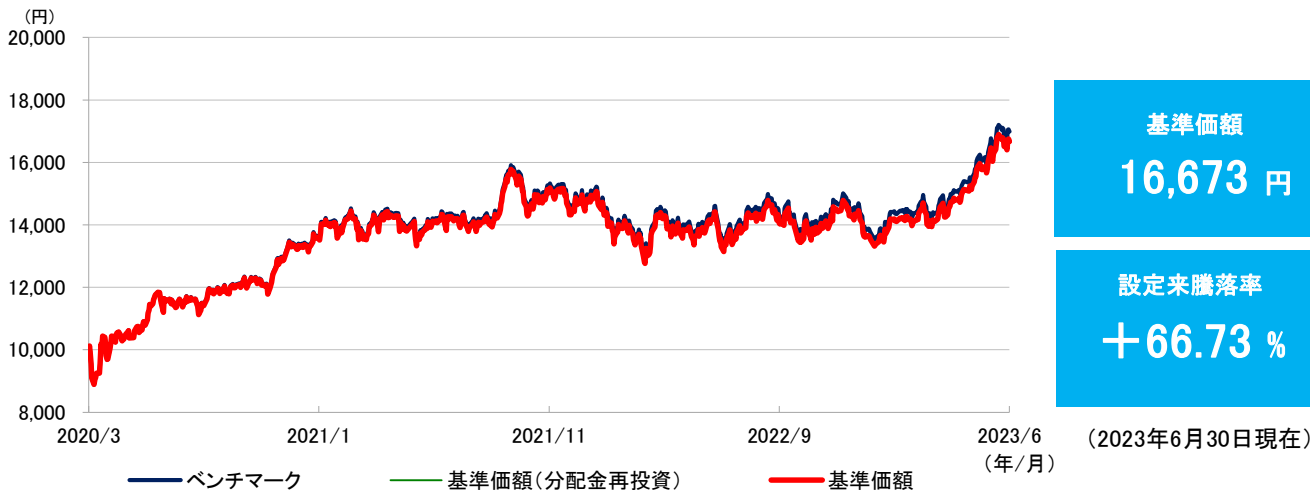


## 足元の運用状況と組入銘柄のご紹介

- 2023年1-6月の国内株式市場は上昇しました。日銀による金融緩和策維持の決定や金融システム不安の後退、米国の著名投資家による日本株買いなどが上昇要因となりました。
- こうした市場要因に加え、米半導体大手の好決算を受けて生成AI向け半導体の需要拡大が期待されると、半導体関連銘柄に買いが広がり当該期間の基準価額は堅調に推移しました。

### ＜パフォーマンスの推移＞



※期間: 2020年3月10日(設定日)～2023年6月30日(日次)

※基準価額およびベンチマーク(iSTOXX MUTB JAPAN ESGクオリティ200インデックス(配当込み))は、当ファンド設定日の前営業日を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。

### ＜組入上位20銘柄＞

(2023年6月末時点)

	銘柄	業種	比率(%)		銘柄	業種	比率(%)
1	三井物産	卸売業	2.2	11	リクルートホールディングス	サービス業	2.0
2	伊藤忠商事	卸売業	2.1	12	KDDI	情報・通信業	1.9
3	東京エレクトロン	電気機器	2.1	13	キーエンス	電気機器	1.9
4	任天堂	その他製品	2.1	14	HOYA	精密機器	1.9
5	ファーストリテイリング	小売業	2.1	15	ソニーグループ	電気機器	1.9
6	信越化学工業	化学	2.1	16	第一三共	医薬品	1.8
7	日本電信電話	情報・通信業	2.0	17	村田製作所	電気機器	1.6
8	日立製作所	電気機器	2.0	18	デンソー	輸送用機器	1.6
9	オリエンタルランド	サービス業	2.0	19	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1.6
10	東京海上ホールディングス	保険業	2.0	20	SMC	機械	1.5

※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。

**記載されている個別の銘柄・企業名について、その銘柄又は企業の株式等の売買を推奨するものではなく、また、当ファンドへの組み入れを示唆・保証するものではありません。**

**※上記は過去の情報または運用実績であり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。**

- 当資料は、投資者の皆様へ「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)」へのご理解を深めていただくことを目的として、ちばぎんアセットマネジメント株式会社が作成した販売用資料です。
- 掲載されている見解は、当資料作成時点のものであり、将来の市場環境の変動や運用成果等を示唆・保証するものではありません。
- 当資料のお取扱いについては最終ページの「本資料のお取扱い」をご覧ください。

## 組入上位銘柄のご紹介

### 伊藤忠商事

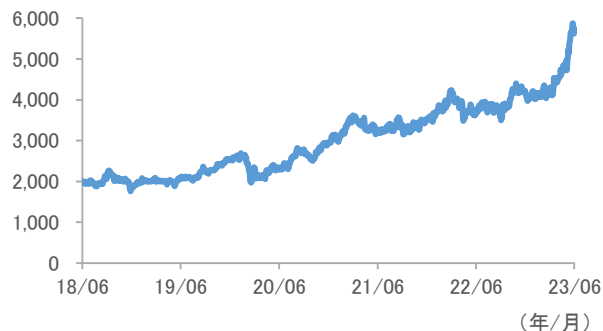
#### 企業概要

総合商社大手で、繊維や食料に強みを持ち、幅広い分野でビジネスを展開しています。

#### 【ESGへの取り組み】

- 2021年10月から「女性活躍推進委員会」を取締役会の諮問委員会として設置しています。
- 2022年5月より、早朝の勤務を推奨し15時以降の早帰りを認める「朝型フレックスタイム制度」の導入や、対象を全従業員とする「在宅勤務制度」の拡充を行いました。

(円) <株価の推移>



期間: 2018年6月29日～2023年6月30日 (日次)

### ソニーグループ

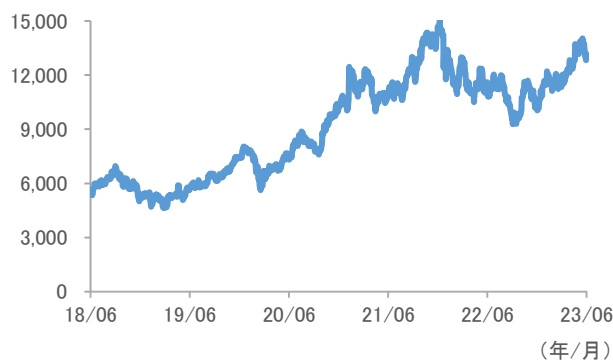
#### 企業概要

ゲーム、音楽、アニメなどで幅広い事業を展開するエンターテインメント企業です。

#### 【ESGへの取り組み】

- 2050年までに「環境負荷ゼロ」を実現するため、環境計画「Road to Zero」を推進しています。
- 2025年度までに「自社オペレーションのGHG (温室効果ガス) 総排出量を2020年度比5%削減」や「商品1台当たりの年間消費電力量の2018年度比5%削減」などを目指しています。

(円) <株価の推移>



期間: 2018年6月29日～2023年6月30日 (日次)

出所: ブルームバーグおよび各種資料をもとにちばぎんアセットマネジメントが作成

**当該銘柄について当ファンドへの組入を約束するものではなく、個別銘柄の推奨を目的とするものではありません。**

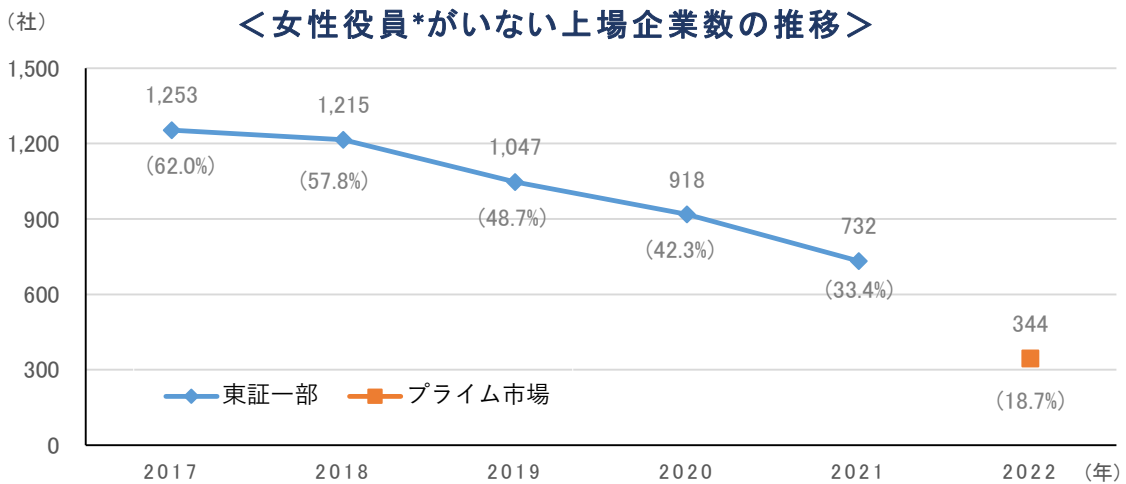
**※上記は過去の情報または運用実績であり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。**

- 当資料は、投資者の皆様へ「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)」へのご理解を深めていただくことを目的として、ちばぎんアセットマネジメント株式会社が作成した販売用資料です。
- 掲載されている見解は、当資料作成時点のものであり、将来の市場環境の変動や運用成果などを示唆・保証するものではありません。
- 当資料のお取扱いについては最終ページの「本資料のお取扱い」をご覧ください。

## 女性活躍に向けた取り組みを推進

日本政府は6月13日、「女性版骨太の方針」を公表しました。東証プライム市場へ上場する企業を対象に、2025年を目途に女性役員を1名以上選任するよう努めることや、2030年までに女性役員比率を30%以上とすることなどの目標が設定されました。

昨年7月末時点で、プライム市場上場企業のうち18.7%の企業には女性役員がおらず、これらの企業は、新たに女性役員の登用が求められることとなります。また、日本は欧米諸国と比べて女性役員比率は低いとされており、日本企業における女性取締役比率の一段の向上が求められます。



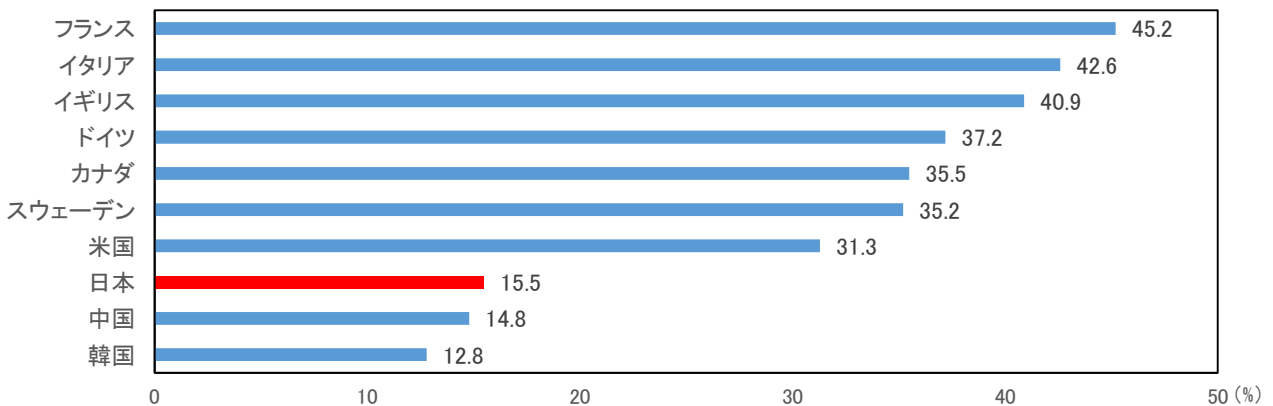
\*役員は、取締役、監査役および執行役

※2021年以前のカッコ内の数値は各年における東証一部上場企業全体に占める割合

※2022年のカッコ内の数値はプライム市場上場企業全体(1,837社)に占める割合

出所: 内閣府の資料をもとにちばぎんアセットマネジメントが作成

## ＜諸外国の女性役員割合(2022年)＞



※フランス、イタリア、ドイツ、スウェーデンは、各国の優良企業銘柄50社が対象。ほかの国はMSCI ACWI構成銘柄(2,800社程度、大型、中型銘柄)の企業が対象

出所: 内閣府の資料をもとにちばぎんアセットマネジメントが作成

**※上記は過去の情報であり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。**

■ 当資料は、投資者の皆様へ「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)」へのご理解を深めていただくことを目的として、ちばぎんアセットマネジメント株式会社が作成した販売用資料です。

■ 掲載されている見解は、当資料作成時点のものであり、将来の市場環境の変動や運用成果などを示唆・保証するものではありません。

■ 当資料のお取扱いについては最終ページの「本資料のお取扱いにおけるご留意点」をご覧ください。

## 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。

※ 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。

### ■ 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Qontigo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。

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。

- 当資料は、投資者の皆様に「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)」へのご理解を深めていただくことを目的として、ちばぎんアセットマネジメント株式会社が作成した販売用資料です。
- 掲載されている見解は、当資料作成時点のものであり、将来の市場環境の変動や運用成果などを示唆・保証するものではありません。
- 当資料のお取扱いについては最終ページの「本資料のお取扱いにおける留意点」をご覧ください。

お申込みメモ

購入単 購入価 換金単 換金価 換金代 申込締 換金制	位 額 位 額 金 切時 限	… 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。) … 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。 … 換金申込受付日の基準価額とします。 … 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。 … 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。	<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。
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

組入資産の売買委託手数料、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。

■ 当資料は、投資者の皆様へ「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)」へのご理解を深めていただくことを目的として、ちばぎんアセットマネジメント株式会社が作成した販売用資料です。  
■ 掲載されている見解は、当資料作成時点のものであり、将来の市場環境の変動や運用成果などを示唆・保証するものではありません。  
■ 当資料のお取扱いについては最終ページの「本資料のお取扱いにおけるご留意点」をご覧ください。



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。

<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。

- 当資料は、投資者の皆様へ「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)」へのご理解を深めていただくことを目的として、ちばぎんアセットマネジメント株式会社が作成した販売用資料です。
- 掲載されている見解は、当資料作成時点のものであり、将来の市場環境の変動や運用成果などを示唆・保証するものではありません。
- 当資料のお取扱いについては最終ページの<本資料のお取扱いにおけるご留意点>をご覧ください。