

- MONTHLY REPORT -

せとうち応援株式ファンド
(愛称:せとうちサポーター)



Chugin Asset Management

追加型投信 / 内外 / 株式

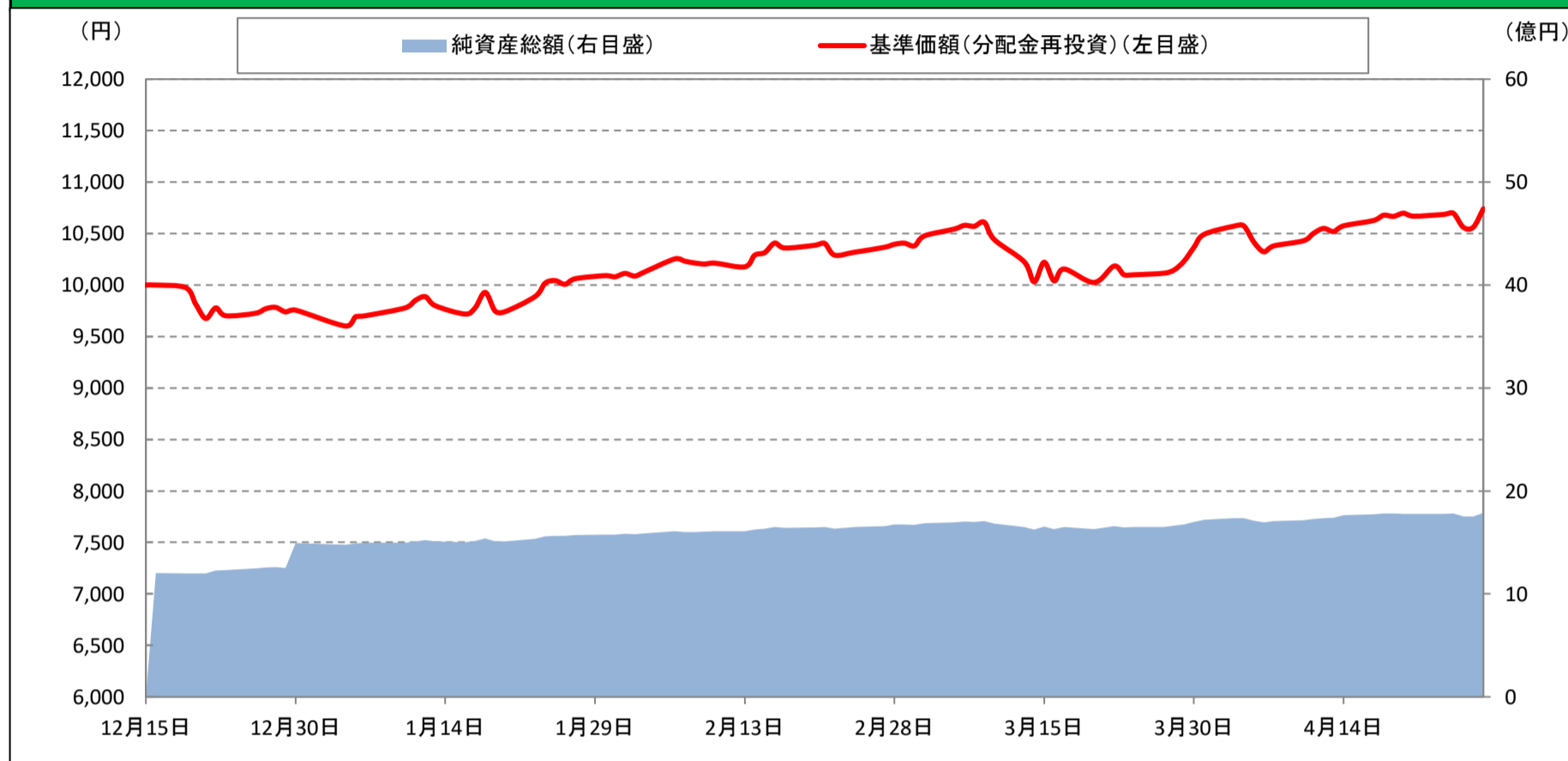
運用実績

| 設定日・決算日・信託期間 | |
|--------------|---------------------------|
| 設定日 | 2022年12月16日 |
| 決算日 | 毎年12月15日 (休業日の場合は翌営業日) |
| 信託期間 | 無期限 |

| 基準価額・解約価額・純資産総額 | |
|-----------------|-----------|
| 基準価額(分配金控除後) | 10,740 円 |
| 解約価額 | 10,740 円 |
| 純資産総額 | 1,786 百万円 |

※基準価額および解約価額は1万口当たりの価額で表示しております。

基準価額の推移



基準価額の騰落率

| 1カ月 | 3カ月 | 6カ月 | 1年 | 3年 | 5年 | 設定来 |
|------|------|-----|----|----|----|------|
| 2.4% | 6.6% | — | — | — | — | 7.4% |

分配金実績(税引前)

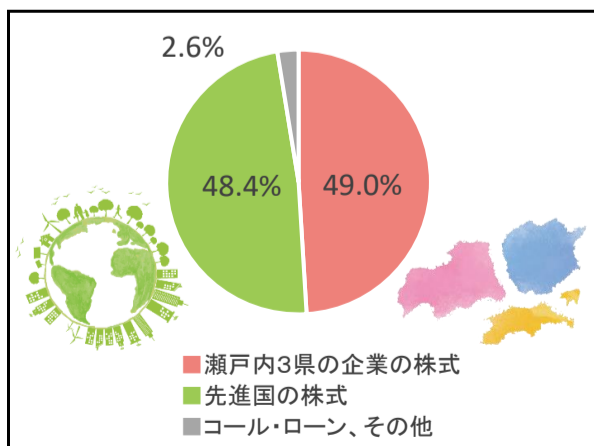
| 決算年月 | — | — | — | — | — | 設定来累計 |
|------|---|---|---|---|---|-------|
| 分配金 | — | — | — | — | — | 0円 |

※上記のグラフ、数値等は過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。
 ※基準価額の推移および騰落率は、当ファンドの運用管理費用(信託報酬)等控除後の価額を用い、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しております。実際のファンドにおいては、課税条件によって騰落率は異なります。また、換金時の費用・税金等は考慮していません。
 ※分配金実績の分配金は、1万口当たりの実績です。分配金実績は、将来の分配金の水準を示唆あるいは保証するものではありません。
 ※分配金は、ファンドの純資産から支払われますので、分配金支払いにより純資産が減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。
 基準日時点での分配金実績はございません。

主な資産の状況

資産構成

| | |
|-------------|--------|
| 瀬戸内3県の企業の株式 | 49.0 % |
| 先進国の株式 | 48.4 % |
| コール・ローン、その他 | 2.6 % |



基準価額の要因分析

| | |
|----------------|----------|
| 当月末基準価額 | 10,740 円 |
| 騰落額(前月末比) | 249 円 |
| 瀬戸内3県の企業の株式の要因 | 126 円 |
| 先進国株式の要因 | 132 円 |
| その他要因 | -9 円 |

※資産構成は、純資産総額を100%として計算した値です。
 ※資産構成における「瀬戸内3県の企業の株式」は「瀬戸内3県株式マザーファンド」の構成の割合を記載しております。
 ※資産構成における「先進国の株式」は「先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド(適格機関投資家限定)」の構成の割合を記載しております。
 ※基準価額の要因分析の騰落額は各資産がファンドの基準価額の騰落額に与えた影響等の目安をお伝えするために簡便的に計算した概算値です。
 ※その他要因には信託報酬等を含みます。

※最終ページの「当資料のご利用にあたっての注意事項等」を必ずご確認ください。

- MONTHLY REPORT -

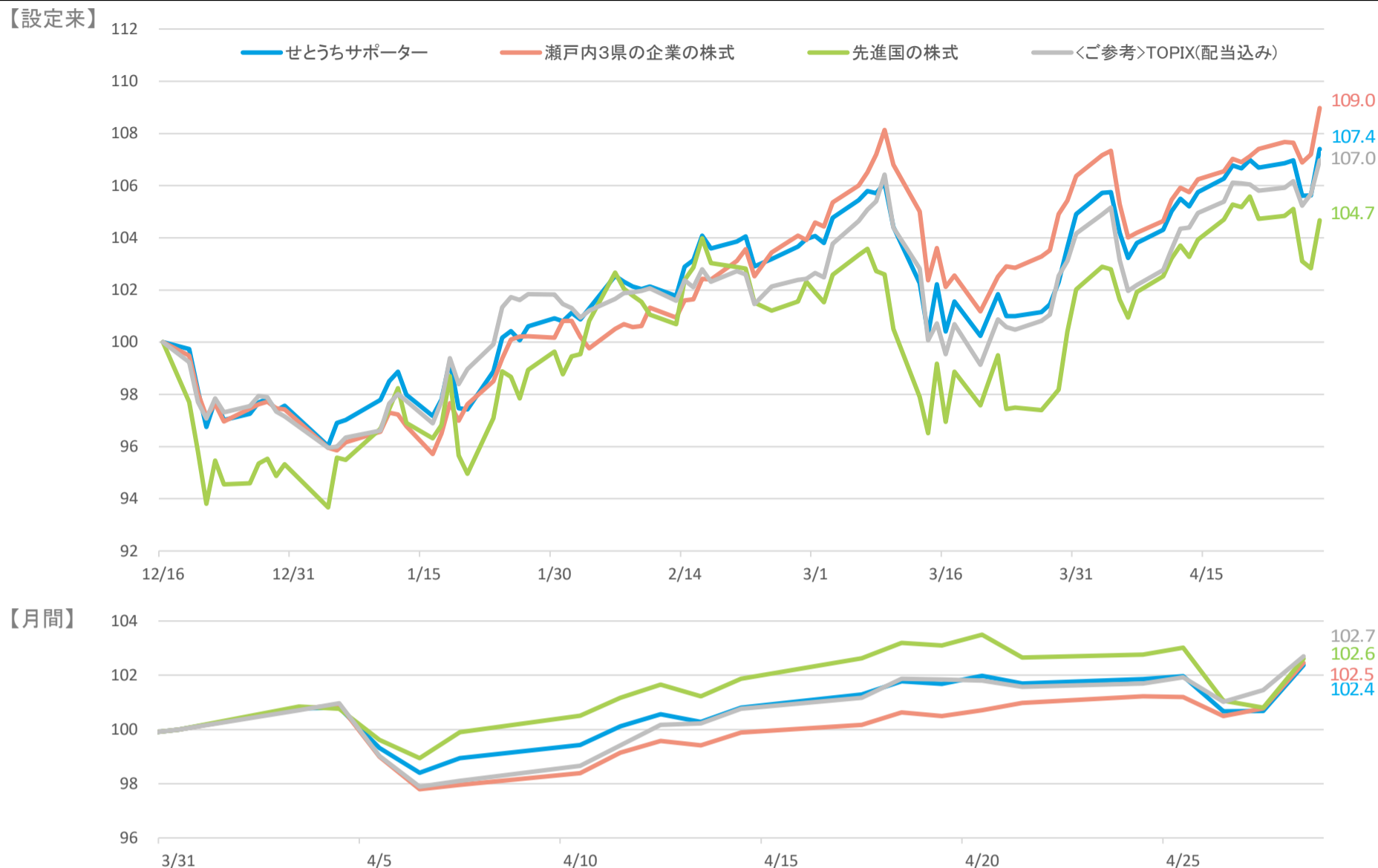
せとうち応援株式ファンド
(愛称:せとうちサポーター)



Chugin Asset Management

追加型投信／内外／株式

ファンドと各資産の基準価額の推移



※「瀬戸内3県の企業の株式」は投資対象である「瀬戸内3県株式マザーファンド」を、「先進国の株式」は投資対象である「先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド(適格機関投資家限定)」を表しています。
 ※上記のグラフは、せとうちサポーターならびに瀬戸内3県株式マザーファンド、先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド(適格機関投資家限定)の基準価額を、設定日(2022年12月16日)の値を100として指数化したものです。
 ※基準価額は、信託報酬控除後の価額を用い、決算時に収益分配があった場合にその分配金を非課税で再投資したものと計算しております。
 ※TOPIX(配当込み)は「瀬戸内3県の企業の株式」および当ファンドのベンチマークではありません。

市場動向および運用状況

【国内株式市場】

4月の国内株式市場は上昇しました。
 米国の経済指標の鈍化などを嫌気する局面があったものの、日銀の植田新総裁が現行の金融政策を当面維持する姿勢を示したことや、訪日外国人数の増加などによる国内消費の拡大が期待され底堅く推移しました。
 業種別では、建設業や電気・ガス業などがアウトパフォームし、鉄鋼や電気機器などがアンダーパフォームとなりました。規模別では、中小型より大型株が相対的に優位な展開となりました。

【海外株式市場】

4月の海外株式市場は上昇しました。
 米国では、上旬はもみ合いの展開となりましたが、中旬に入り、米金融機関決算を無難に通過したことなどから堅調な推移となりました。下旬には、米中堅銀行の預金流出などから下落する場面がありましたが、ハイテク企業の好決算などを背景に月末にかけて持ち直す動きとなりました。欧州では、米欧金融システム不安が徐々に和らぎ、市場心理の回復が進みました。また、堅調な経済指標や企業決算などから株式市場は高値圏での推移が継続しました。
 米ドル/円相場においては、月初は市場予想を下回る米国の景気指標などを受け円高ドル安となりましたが、中旬以降は、日銀新総裁が金融緩和策維持を示唆したことなどから、ドル円相場は円安基調となりました。

【運用状況】

4月の当ファンドの騰落率は+2.4%となりました。
 また、瀬戸内3県株式マザーファンドの4月の騰落率は+2.5%となりました。先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド(適格機関投資家限定)においては、海外株式市場の上昇に加えて、為替相場が円安となった影響から4月の騰落率は+2.6%となりました。

今後の運用方針 (以下の内容は当資料作成日時点のものであり、予告なく変更する場合があります。)

当ファンドでは、瀬戸内3県株式マザーファンドの受益証券および先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド(適格機関投資家限定)の受益証券を主要投資対象とし、信託財産の成長を目指して運用を行います。各投資対象ファンドの受益証券については、組入比率を各50%を目途に投資を行います。

※最終ページの「当資料のご利用にあたっての注意事項等」を必ずご確認ください。



- MONTHLY REPORT -

せとうち応援株式ファンド
(愛称：せとうちサポーター)

Chugin Asset Management

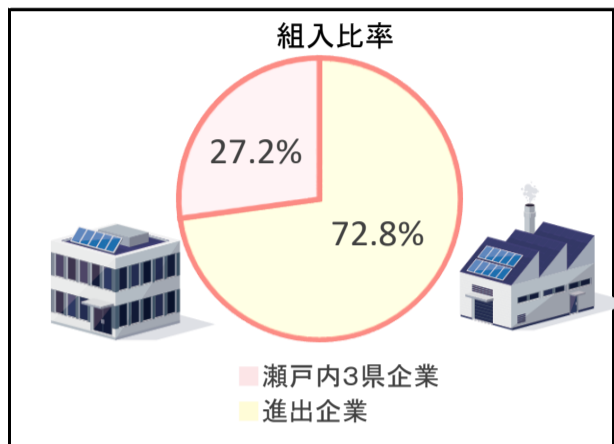
追加型投信／内外／株式



※このページは「瀬戸内3県株式マザーファンド」の情報を記載しています。

選定区分および組入銘柄内訳

| 選定区分 | 銘柄数 | 組入比率 |
|---------|-----|---------|
| 瀬戸内3県企業 | 74 | 27.2 % |
| 進出企業 | 63 | 72.8 % |
| 合計 | 137 | 100.0 % |



瀬戸内3県企業とは、岡山県、広島県、香川県内に本社またはこれに準ずるものを置いている企業とします。(金融業を除きます)



進出企業とは、岡山県、広島県、香川県内に進出している企業とします。(金融業を除きます)



瀬戸内3県企業の株式組入上位20銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 組入比率 |
|----|---------------|--------|
| 1 | ウッドワン | 0.6 % |
| 2 | マツオカコーポレーション | 0.6 % |
| 3 | ローツエ | 0.6 % |
| 4 | マツダ | 0.6 % |
| 5 | リョービ | 0.6 % |
| 6 | 大黒天物産 | 0.6 % |
| 7 | クラレ | 0.6 % |
| 8 | 福山通運 | 0.6 % |
| 9 | 中国塗料 | 0.6 % |
| 10 | エフピコ | 0.6 % |
| 11 | イズミ | 0.6 % |
| 12 | テイツー | 0.6 % |
| 13 | ダイキョーニシカワ | 0.6 % |
| 14 | E・Jホールディングス | 0.6 % |
| 15 | 四国電力 | 0.6 % |
| 16 | 穴吹興産 | 0.5 % |
| 17 | ビーアールホールディングス | 0.5 % |
| 18 | TAKISAWA | 0.5 % |
| 19 | 四電工 | 0.5 % |
| 20 | 中国電力 | 0.5 % |
| 合計 | | 11.6 % |

進出企業の株式組入上位20銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 組入比率 |
|----|-----------------|--------|
| 1 | 神戸製鋼所 | 1.5 % |
| 2 | 大日本印刷 | 1.4 % |
| 3 | 横浜ゴム | 1.4 % |
| 4 | ディスコ | 1.3 % |
| 5 | プレス工業 | 1.3 % |
| 6 | 三井E&S | 1.3 % |
| 7 | 京セラ | 1.2 % |
| 8 | アルフレッサ ホールディングス | 1.2 % |
| 9 | メディパルホールディングス | 1.2 % |
| 10 | 山崎製パン | 1.2 % |
| 11 | NTN | 1.2 % |
| 12 | 日清食品ホールディングス | 1.2 % |
| 13 | イーグル工業 | 1.2 % |
| 14 | エクセディ | 1.2 % |
| 15 | オムロン | 1.2 % |
| 16 | ジェイテクト | 1.2 % |
| 17 | ヤクルト本社 | 1.1 % |
| 18 | 住友重機械工業 | 1.1 % |
| 19 | カルビー | 1.1 % |
| 20 | 帝人 | 1.1 % |
| 合計 | | 24.6 % |

| 市場区分 | 組入比率 |
|----------|--------|
| 東証プライム | 88.9 % |
| 東証スタンダード | 10.1 % |
| 東証グロース | 1.0 % |
| その他 | 0.0 % |

※選定区分および市場区分の組入比率は「瀬戸内3県株式マザーファンド」の組入株式評価金額合計に対する割合です。

「瀬戸内3県株式マザーファンド」の株式組入上位10銘柄および組入上位10業種

| 順位 | 銘柄名 | 選定区分 | 県 | 市場 | 業種 | 組入比率 | 業種 | 組入比率 |
|----|-----------------|------|----------|--------|-------|--------|---------|--------|
| 1 | 神戸製鋼所 | 進出 | 岡山・広島 | 東証プライム | 鉄鋼 | 1.5 % | 1 機械 | 14.6 % |
| 2 | 大日本印刷 | 進出 | 岡山・広島・香川 | 東証プライム | その他製品 | 1.4 % | 2 化学 | 12.4 % |
| 3 | 横浜ゴム | 進出 | 広島 | 東証プライム | ゴム製品 | 1.4 % | 3 電気機器 | 9.6 % |
| 4 | ディスコ | 進出 | 広島 | 東証プライム | 機械 | 1.3 % | 4 食料品 | 8.4 % |
| 5 | プレス工業 | 進出 | 広島 | 東証プライム | 輸送用機器 | 1.3 % | 5 小売業 | 7.5 % |
| 6 | 三井E&S | 進出 | 岡山 | 東証プライム | 機械 | 1.3 % | 6 輸送用機器 | 6.3 % |
| 7 | 京セラ | 進出 | 広島 | 東証プライム | 電気機器 | 1.2 % | 7 非鉄金属 | 4.9 % |
| 8 | アルフレッサ ホールディングス | 進出 | 岡山・香川 | 東証プライム | 卸売業 | 1.2 % | 8 建設業 | 4.6 % |
| 9 | メディパルホールディングス | 進出 | 岡山・広島 | 東証プライム | 卸売業 | 1.2 % | 9 その他製品 | 4.2 % |
| 10 | 山崎製パン | 進出 | 岡山・広島 | 東証プライム | 食料品 | 1.2 % | 10 卸売業 | 4.1 % |
| 合計 | | | | | | 13.0 % | 合計 | 76.5 % |

※瀬戸内3県企業の株式組入上位20銘柄および進出企業の株式組入上位20銘柄、「瀬戸内3県株式マザーファンド」の株式組入上位10銘柄および組入上位10業種の組入比率は、「瀬戸内3県株式マザーファンド」の純資産総額を100%として計算した値です。

- MONTHLY REPORT -

せとうち応援株式ファンド
(愛称：せとうちサポーター)

追加型投信／内外／株式

Chugin Asset Management



※このページは「瀬戸内3県株式マザーファンド」の情報を記載しています。

「瀬戸内3県株式マザーファンド」のポートフォリオの組入全137銘柄(2023年4月28日現在)

| 銘柄名 | 県名 |
|-------------------|----------|
| あ IHI | 広島 |
| アオイ電子 | 香川 |
| 青山商事 | 広島 |
| 旭化成 | 岡山 |
| アシードホールディングス | 広島 |
| あじかん | 広島 |
| アスカネット | 広島 |
| アドテック プラズマ テクノロジー | 広島 |
| 穴吹興産 | 香川 |
| アルフレッサ ホールディングス | 岡山 香川 |
| アヲハタ | 広島 |
| イーグル工業 | 岡山 広島 |
| E・Jホールディングス | 岡山 |
| イオン | 岡山 広島 香川 |
| 石井表記 | 広島 |
| イズミ | 広島 |
| ウエスコホールディングス | 岡山 |
| ウエストホールディングス | 広島 |
| ウエルシアホールディングス | 岡山 広島 香川 |
| ウッドワン | 広島 |
| エクセディ | 岡山 広島 |
| エディオ | 広島 |
| NTN | 岡山 |
| ENEOSホールディングス | 岡山 |
| エフピコ | 広島 |
| 大倉工業 | 香川 |
| オービス | 広島 |
| 大本組 | 岡山 |
| 岡山県貨物運送 | 岡山 |
| 岡山製紙 | 岡山 |
| オムロン | 岡山 |
| オルパヘルスケアホールディングス | 岡山 |
| か カルビー | 広島 |
| 川崎重工業 | 香川 |
| 北川精機 | 広島 |
| 北川鉄工所 | 広島 |
| 京セラ | 広島 |
| キリンホールディングス | 岡山 |
| 倉敷紡績 | 岡山 |
| クラレ | 岡山 |
| KG情報 | 香川 |
| 研創 | 広島 |
| 神戸製鋼所 | 岡山 広島 |
| コンセック | 広島 |
| さ サンマルクホールディングス | 岡山 |
| JFEホールディングス | 岡山 広島 |
| JMS | 広島 |
| ジェイテクト | 香川 |
| 四国化成ホールディングス | 香川 |
| 四国電力 | 香川 |
| 自重堂 | 広島 |
| シャープ | 広島 |

| 銘柄名 | 県名 |
|-----------------|----------|
| 住友ゴム工業 | 岡山 |
| 住友重機械工業 | 岡山 広島 |
| 住友電気工業 | 岡山 |
| セーラー広告 | 香川 |
| セーラー万年筆 | 広島 |
| 積水化学工業 | 岡山 広島 香川 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 岡山 広島 香川 |
| た ダイキョーニシカワ | 広島 |
| 大建工業 | 岡山 |
| 大黒天物産 | 岡山 |
| ダイセル | 広島 |
| 大日本印刷 | 岡山 広島 香川 |
| 大和重工 | 広島 |
| 大和ハウス工業 | 岡山 |
| TAKISAWA | 岡山 |
| タダノ | 香川 |
| タツモ | 岡山 |
| 中国工業 | 広島 |
| 中国電力 | 広島 |
| 中国塗料 | 広島 |
| 中電工 | 広島 |
| 帝人 | 広島 |
| ディスコ | 広島 |
| テイツー | 岡山 |
| データホライズン | 広島 |
| 天満屋ストア | 岡山 |
| 東洋炭素 | 香川 |
| 東和ハイシステム | 岡山 |
| DOWAホールディングス | 岡山 |
| 東和薬品 | 岡山 |
| 戸田工業 | 広島 |
| ドリームベッド | 広島 |
| トレックス・セミコンダクター | 岡山 |
| な 内海造船 | 広島 |
| 長瀬産業 | 岡山 |
| 南海プライウッド | 香川 |
| 西川ゴム工業 | 広島 |
| 西日本旅客鉄道 | 岡山 広島 |
| 日清食品ホールディングス | 香川 |
| 日東電工 | 広島 |
| 日本興業 | 香川 |
| 日本精機 | 広島 |
| 日本製鋼所 | 広島 |
| 日本たばこ産業 | 香川 |
| 日本ペイントホールディングス | 岡山 広島 香川 |
| は 萩原工業 | 岡山 |
| パナソニック ホールディングス | 岡山 |
| はるやまホールディングス | 岡山 |
| ハローズ | 広島 |
| ビーアールホールディングス | 広島 |
| 日立造船 | 岡山 広島 |
| 広島ガス | 広島 |

| 銘柄名 | 県名 |
|-----------------|----------|
| 広島電鉄 | 広島 |
| フェローテックホールディングス | 岡山 |
| 福山通運 | 広島 |
| プレス工業 | 広島 |
| ベネッセホールディングス | 岡山 |
| ポエック | 広島 |
| ま マツオカコーポレーション | 広島 |
| マツダ | 広島 |
| マルヨシセンター | 香川 |
| 三井E&S | 岡山 |
| 三井金属鉱業 | 岡山 広島 |
| 三菱ケミカルグループ | 岡山 広島 香川 |
| 三菱自動車工業 | 岡山 |
| 三菱重工業 | 広島 |
| 三菱マテリアル | 岡山 香川 |
| ミツ星ベルト | 香川 |
| ミライト・ワン | 広島 |
| 村田製作所 | 岡山 |
| 明治ホールディングス | 岡山 香川 |
| メディパルホールディングス | 岡山 広島 |
| や ヤクルト本社 | 岡山 |
| ヤスハラケミカル | 広島 |
| 山崎製パン | 岡山 広島 |
| ヤマトホールディングス | 岡山 広島 香川 |
| やまみ | 広島 |
| ユニ・チャーム | 香川 |
| 横田製作所 | 広島 |
| 横浜ゴム | 広島 |
| 四電工 | 香川 |
| ら ライオン | 香川 |
| リョービ | 広島 |
| ローツェ | 広島 |
| ローム | 岡山 |

(50音順)

 瀬戸内3県企業
 進出企業

※瀬戸内3県企業においては、本社等の所在する県名を記載しております。
 ※進出企業においては、主に進出している県名を記載しております。



- MONTHLY REPORT -

せとうち応援株式ファンド
(愛称：せとうちサポーター)

Chugin Asset Management

追加型投信／内外／株式

※このページは「先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド(適格機関投資家限定)」の情報を記載しています。

資産構成

| | |
|-------------|--------|
| 外国株式実質組入 | 99.9 % |
| 現物等 | 94.7 % |
| 先物等 | 5.2 % |
| コール・ローン、その他 | 0.1 % |
| 組入銘柄数 | 575 |

組入上位10カ国

| | | |
|----|---------|--------|
| 1 | アメリカ | 67.3 % |
| 2 | イギリス | 4.7 % |
| 3 | フランス | 4.6 % |
| 4 | カナダ | 3.4 % |
| 5 | スイス | 2.5 % |
| 6 | オーストラリア | 2.3 % |
| 7 | ドイツ | 2.0 % |
| 8 | オランダ | 1.9 % |
| 9 | デンマーク | 1.5 % |
| 10 | スウェーデン | 1.1 % |

組入上位10通貨

| | | |
|----|------------|--------|
| 1 | 米ドル | 71.1 % |
| 2 | ユーロ | 11.1 % |
| 3 | 英ポンド | 4.9 % |
| 4 | カナダドル | 3.6 % |
| 5 | スイスフラン | 2.6 % |
| 6 | 豪ドル | 2.4 % |
| 7 | デンマーククローネ | 1.6 % |
| 8 | スウェーデンクローナ | 1.1 % |
| 9 | 香港ドル | 0.7 % |
| 10 | ノルウェークローネ | 0.4 % |

組入上位10業種

| | | |
|----|----------------|--------|
| 1 | ソフトウェア・サービス | 13.1 % |
| 2 | 医薬品・バイオテクノ・ライフ | 11.0 % |
| 3 | 金融サービス | 6.6 % |
| 4 | メディア・娯楽 | 6.0 % |
| 5 | 資本財 | 5.5 % |
| 6 | 半導体・半導体製造装置 | 5.3 % |
| 7 | 銀行 | 4.4 % |
| 8 | 素材 | 4.2 % |
| 9 | 保険 | 4.1 % |
| 10 | 家庭用品・パーソナル用品 | 3.5 % |

株式組入上位10銘柄

| | 銘柄名 | 国 | 業種 | 組入比率 |
|----|----------------------|------|----------------|-------|
| 1 | マイクロソフト | アメリカ | ソフトウェア・サービス | 8.1 % |
| 2 | エヌビディア | アメリカ | 半導体・半導体製造装置 | 2.5 % |
| 3 | アルファベット クラスA | アメリカ | メディア・娯楽 | 2.4 % |
| 4 | アルファベット クラスC | アメリカ | メディア・娯楽 | 2.3 % |
| 5 | テスラ | アメリカ | 自動車・自動車部品 | 1.6 % |
| 6 | ジョンソン・エンド・ジョンソン | アメリカ | 医薬品・バイオテクノ・ライフ | 1.6 % |
| 7 | ビザ | アメリカ | 金融サービス | 1.4 % |
| 8 | プロクター・アンド・ギャンブル(P&G) | アメリカ | 家庭用品・パーソナル用品 | 1.4 % |
| 9 | イーライリリー | アメリカ | 医薬品・バイオテクノ・ライフ | 1.2 % |
| 10 | マスターカード | アメリカ | 金融サービス | 1.2 % |

※このページは三菱UFJ国際投信株式会社からの情報提供を基に作成しています。

※このページに記載されている構成比を示す比率は、すべて「先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド(適格機関投資家限定)」の純資産総額を100%として計算した値です。

※国は原則、主要取引所所在地で分類しています。

※業種は、GICS(世界産業分類基準)で分類しています。

※“GICS”(Global Industry Classification Standard)は、MSCI Inc.とS&P(Standard & Poor's)が開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。

- MONTHLY REPORT -

せとうち応援株式ファンド
(愛称：せとうちサポーター)

Chugin Asset Management

追加型投信／内外／株式



ファンドの目的・特色 (くわしくは販売会社へお問い合わせください)

◆ファンドの目的

信託財産の成長を目指して運用を行います。

◆ファンドの特色

＜投資対象＞

瀬戸内3県の企業の株式および先進国の株式へ実質的に投資します。

※「瀬戸内3県の企業の株式」部分の運用は瀬戸内3県株式マザーファンドを通じて行います。

※「先進国の株式」部分の運用は先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド(適格機関投資家限定)を通じて行います。

各資産について、50%ずつの組入比率を目途に投資します。

＜各資産の投資方針＞

①瀬戸内3県の企業の株式

「瀬戸内3県の企業の株式」部分の運用にあたっては、わが国の金融商品取引所上場株式の中から、瀬戸内3県の企業(金融業を除きます。)に投資します。

●瀬戸内3県の企業とは、岡山県、広島県、香川県内に本社またはこれに準ずるものを置いている企業(以下、「瀬戸内3県企業」といいます。)および瀬戸内3県に進出している企業(以下、「進出企業」といいます。)とします。

●瀬戸内3県企業の株式への投資については、時価総額、市場流動性及び投資リスク等を考慮して銘柄選定を行い、投資比率を決定します。

●進出企業の株式への投資については、時価総額、瀬戸内3県との関連度及び投資リスク等を考慮して銘柄選定を行い、投資比率を決定します。

②先進国の株式

「先進国の株式」部分の運用にあたっては、日本を除く先進国の株式に投資します。

●MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

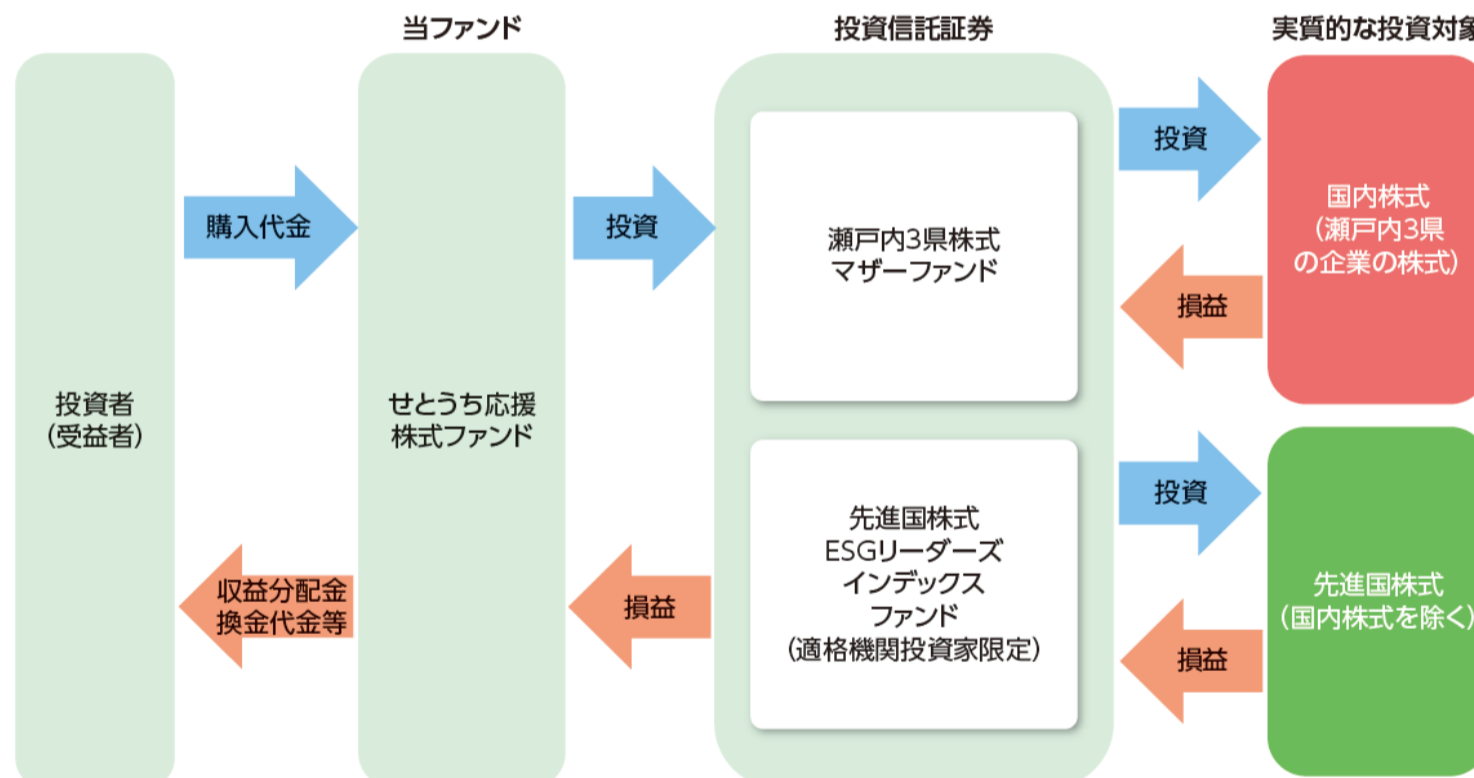
●MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)をベンチマークとします。

* ESGとは、環境(Environment)、社会(Social)、ガバナンス(Governance)の頭文字をとったものです。

原則として、為替ヘッジを行いません。

＜ファンドの仕組み＞

運用は主に以下の投資信託証券への投資を通じて、瀬戸内3県の企業の株式および先進国の株式へ実質的に投資するファンド・オブ・ファンズ方式により行います。



＜主な投資制限＞

- ・株式への直接投資は行いません。
- ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- ・外貨建資産への直接投資は行いません。
- ・同一銘柄の投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- ・デリバティブの直接利用は行いません。


＜収益分配方針＞

毎年12月15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として、以下の方針に基づき収益分配を行います。

- ・分配対象額の範囲は、経費等控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ・収益分配金額は、委託者が分配可能額、基準価額水準、市況動向等を勘案のうえ決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ・収益の分配に充てなかった留保益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

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。

※最終ページの「当資料のご利用にあたっての注意事項等」を必ずご確認ください。  中銀アセットマネジメント

- MONTHLY REPORT -

せとうち応援株式ファンド
(愛称:せとうちサポーター)

Chugin Asset Management

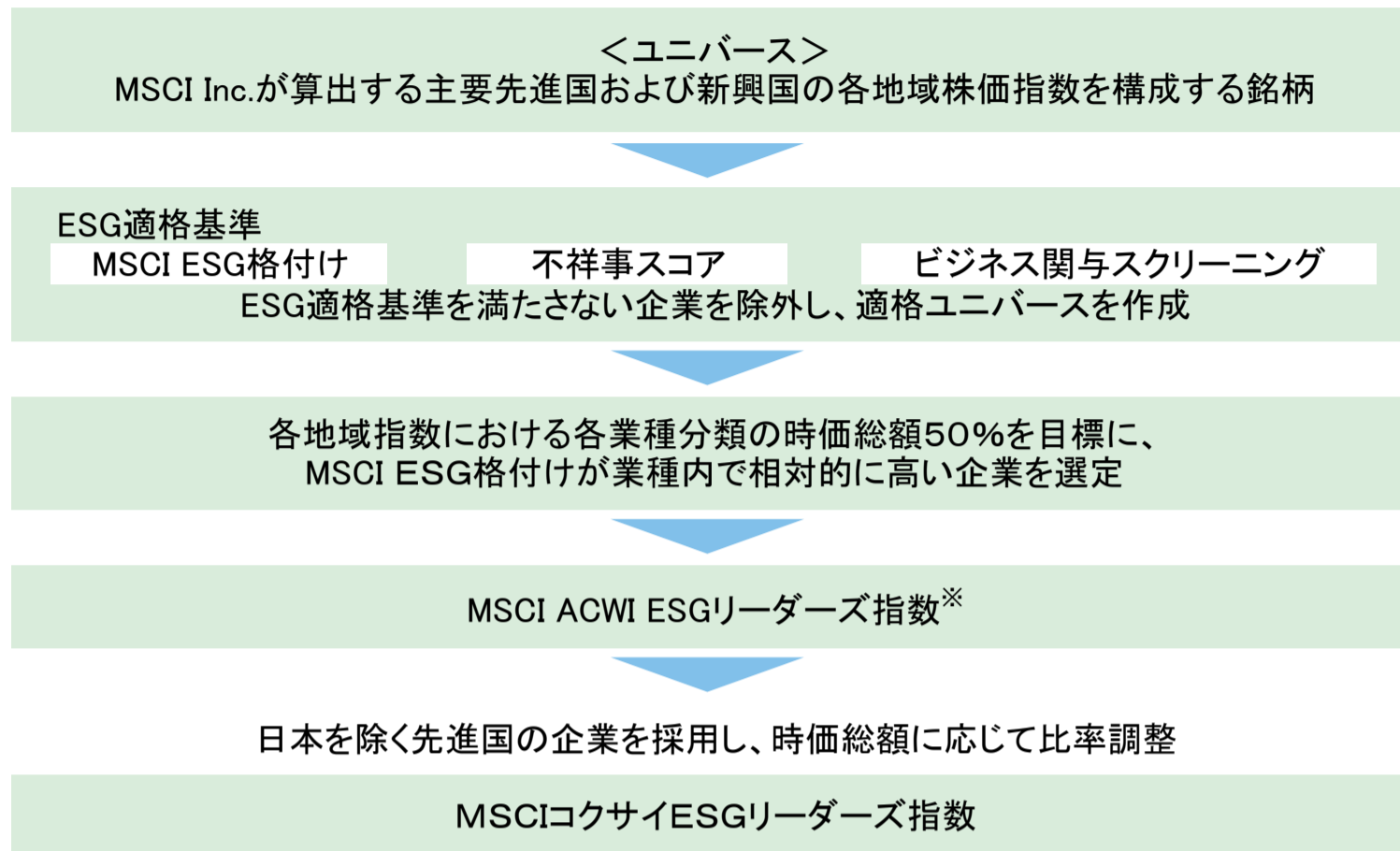
追加型投信／内外／株式



追加的記載事項

◆「MSCIコクサイESGリーダーズ指数」について

■MSCIコクサイESGリーダーズ指数の構築プロセス



- ・年次レビュー(毎年5月)において適格ユニバースを更新し、各業種分類時価総額の50%を目標に一定の条件に従って銘柄を選定
- ・四半期レビュー(毎年2・8・11月)において、ESG適格基準の継続採用条件を満たしていない既存構成銘柄を除外した上で、各業種分類時価総額の45%未満となる場合、一定の条件に従って50%の目標に達するまで銘柄を新規採用

※MSCI ACWI ESGリーダーズ指数とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の主要先進国および新興国の大型株・中型株の中から、業種内において、相対的にESG評価が優れた企業で構成されています。

■ESG適格基準

| 項目 | 内容 | 新規採用条件 | 継続採用条件 |
|---------------|---|--------|--------|
| MSCI ESG格付け | ・各企業のESGに関するリスクと機会への対応力を調査・分析 ・各企業に係る主要な問題への対応力を同業他社と比較 ・AAA～CCCの7段階で各企業を評価(BBは最上位から5番目) | BB以上 | BB以上 |
| 不祥事スコア | ・各企業の事業、製品やサービスがESGにネガティブな影響を与え得る不祥事の深刻度やその解決のための対策を0～10で評価(0が最低評価) | 3以上 | 1以上 |
| ビジネス関与スクリーニング | ・非人道的兵器と関連性を有するすべての企業、核兵器に関する製造やサービスに関連するすべての企業を除外 ・民間銃器、たばこ、アルコール、通常兵器、ギャンブル、原子力、化石燃料抽出、石炭火力の製造、販売などに関連する事業から一定以上の売上や収益を得ている企業を除外 | | |

■MSCI ESG格付けの評価項目

●環境(Environment)

| 地球温暖化 | 自然資源 | 廃棄物管理 | 環境市場機会 |
|------------------|--------------------|---------------------|------------------------|
| 二酸化炭素排出、環境配慮融資など | 水資源枯渇、生物多様性と土地利用など | 有害物質と廃棄物管理、包装材廃棄物など | クリーンテクノロジー、再生可能エネルギーなど |

●社会(Social)

| 人的資源 | 製品サービスの安全 | ステークホルダーマネジメント | 社会市場機会 |
|-------------------|--------------------|---------------------|------------------------|
| 労働マネジメント、労働安全衛生など | 製品安全・品質、製品化学物質安全など | 透明性のある物資調達、コミュニティ関係 | 金融へのアクセス、ヘルスケアへのアクセスなど |

●ガバナンス(Governance)

| コーポレートガバナンス | 企業行動 |
|-------------|-------------|
| 取締役会構成、報酬など | 企業倫理、租税回避など |

※産業により重要とされる項目が異なるため、全ての項目で評価するものではありません。

※ESG適格基準やMSCI ESG格付けの評価項目は、今後変更される可能性があります。

※MSCI Inc.の資料を基に中銀アセットマネジメントが作成

※最終ページの「当資料のご利用にあたっての注意事項等」を必ずご確認ください。

- MONTHLY REPORT -

せとうち応援株式ファンド
(愛称：せとうちサポーター)

Chugin Asset Management

追加型投信／内外／株式

投資リスク (くわしくは販売会社へお問い合わせください)

◆基準価額変動要因

当ファンドは、実質的に国内外の株式等値動きのある有価証券等に投資しますので、組入れた有価証券等の価格の下落等の影響により、基準価額が下落し、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではありません。

投資信託は預貯金と異なります。投資信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者のみなさまに帰属します。

■株価変動リスク

株式の価格は、国内および国際的な政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給関係等の影響を受け変動します。当ファンドが実質的に投資する株式の価格が下落した場合には、その影響を受け、基準価額が下落する要因となります。

■為替変動リスク

外貨建資産については、当該外貨の円に対する為替相場の影響を受け変動します。

当ファンドが実質的に保有する外貨建資産について、当該外貨の為替相場が円安方向に進んだ場合には当ファンドの基準価額が上昇する要因となり、円高方向に進んだ場合には下落する要因となります。

■信用リスク

有価証券等の価格は、その発行体の倒産、財務状況又は信用状況の悪化、債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。

当ファンドが実質的に保有する有価証券等の発行体にこうした状況が発生または予想される場合には、その影響を受け、基準価額が下落する要因となります。

■流動性リスク

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、換金代金の支払いが遅延す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

当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。

◆リスクの管理体制

- ・委託会社では、各種社内規定において、運用に関するリスク管理方針を定め、運用部から独立した部署が、運用の指図について運用の基本方針や法令諸規則等に照らして適切かどうかのモニタリング・検証を通じて、運用リスクの管理を行っております。
- ・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。

※最終ページの「当資料のご利用にあたっての注意事項等」を必ずご確認ください。


中銀アセットマネジメント

- MONTHLY REPORT -

せとうち応援株式ファンド
(愛称：せとうちサポーター)

Chugin Asset Management

追加型投信／内外／株式

お申込みメモ (くわしくは販売会社へお問い合わせください)

| | |
|--------------------|---|
| 購入単位 | 販売会社が定める単位とします。 |
| 購入価額 | 購入申込受付日の翌営業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 | お申込みをされた販売会社が定める所定の日時まで購入代金を販売会社に支払うものとします。 |
| 換金単位 | 販売会社が定める単位とします。 |
| 換金価額 | 換金申込受付日の翌営業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7営業日目からお支払いいたします。 |
| 申込締切時間 | 原則として、日本における販売会社の営業日の午後3時まで受け付けます。 |
| 申込不可日 | ニューヨーク証券取引所の休業日、ロンドン証券取引所の休業日は、購入・換金のお申込みができません。 |
| 換金制限 | 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金請求に制限を設ける場合があります。 |
| 購入・換金申込受付の中止および取消し | 金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた購入・換金のお申込みの受付を取消す場合があります。 |
| 信託期間 | 無期限(2022年12月16日設定) |
| 繰上償還 | 次のいずれかに該当する場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解消し、当該信託を終了する場合があります。 ①一部解約により残存口数が5億口を下回った場合 ②受益者のために有利であると認めた場合 ③やむを得ない事情が発生したとき |
| 決算日 | 毎年12月15日。ただし、決算日が休業日の場合は翌営業日とします。 |
| 収益分配 | 年1回、毎決算日に収益分配方針に基づき、収益分配を行います。 (委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。) ※決算日から起算して原則として5営業日目までにお支払いを開始します。 |
| 公告 | 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行います。 |
| 運用報告書 | 委託会社は、毎計算期間終了後および償還時に、期中の運用経過等を記載した交付運用報告書を作成し、知っている受益者に、販売会社を通じて交付します。 |
| 課税関係 | 課税上は、株式投資信託として取扱われます。 公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」の適用対象です。 益金不算入制度、配当控除の適用はありません。 ※2024年以降、NISA制度が見直しされます。また、ジュニアNISAで新規の購入ができなくなります。 詳しくは、販売会社にお問い合わせください。 ※税法が改正された場合等には、上記の内容が変更されることがあります。 |

お客様にご負担いただく費用について (くわしくは販売会社へお問い合わせください)

以下の手数料等の合計額等については、保有期間などに応じて異なりますので、表示することができません。
詳細については、投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

●購入時

| | |
|--------|--|
| 購入時手数料 | 購入価額に3.3%(税抜3.0%)以内で販売会社が独自に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。 |
|--------|--|

●換金時

| | |
|---------|--------|
| 換金時手数料 | ありません。 |
| 信託財産留保額 | ありません。 |

●保有期間中(信託財産から間接的にご負担いただきます。)

| | | |
|------------------|---------------|---|
| 運用管理費用 (信託報酬) | ファンド | 日々の純資産総額に対して年率1.133%(税抜1.03%)を乗じた額 |
| | 投資対象とする投資信託証券 | 投資対象ファンドの純資産総額に対して年率0.121%程度(税抜0.11%程度) |
| | 実質的な負担 | ファンドの純資産総額に対して年率1.254%程度(税抜1.14%程度) |

| | |
|------------|---|
| その他の費用・手数料 | その他の費用、手数料として、投資者のみなさまの保有期間中、監査法人に支払われるファンドの監査費用、有価証券等の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用等を信託財産からご負担いただきます。 ※監査費用は、日々のファンドの純資産総額に対して、年率0.0055%(税抜0.005%)を乗じた額をその費用の合計額とみなして、実際の費用に関わらずファンドからご負担いただきます。(監査費用とは、監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用です。) ※投資対象とする投資信託証券においては、上記以外にもその他の費用・手数料・監査費用・信託財産留保額等が別途かかる場合があります。 ※上記の費用・手数料等については、売買条件等により異なるため、当ファンドにかかる監査費用の料率を除き、事前に金額または上限額等を記載することができません。 |
|------------|---|

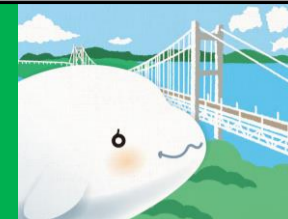
※最終ページの「当資料のご利用にあたっての注意事項等」を必ずご確認ください。  中銀アセットマネジメント

- MONTHLY REPORT -

せとうち応援株式ファンド
(愛称：せとうちサポーター)

Chugin Asset Management

追加型投信／内外／株式



販売会社

| 商号 | 登録番号等 | | 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 |
| アイザワ証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第3283号 | ○ | ○ | | |
| 中銀証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 中国財務局長(金商)第6号 | ○ | | | |
| 株式会社中国銀行 | 登録金融機関 | 中国財務局長(登金)第2号 | ○ | | ○ | |
| 株式会社トマト銀行 | 登録金融機関 | 中国財務局長(登金)第11号 | ○ | | | |

(50音順)

委託会社、その他関係法人

| | |
|------|--|
| 委託会社 | 中銀アセットマネジメント株式会社(金融商品取引業者 中国財務局長(金商)第10号) 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 会員 信託財産の運用指図、目論見書および運用報告書の作成等を行います。 |
| 受託会社 | 三菱UFJ信託銀行株式会社(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社) 追加信託に係る振替機関への通知等、信託財産の保管・管理・計算等を行います。 |

当資料のご利用にあたっての注意事項等

- ◆投資信託は、預金等や保険契約とは異なり、預金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。／販売会社が登録金融機関の場合、投資者保護基金に加入していません。／投資信託は、販売会社がお申込みの取扱いを行い委託会社が運用を行います。／投資信託をご購入の場合は、販売会社よりお渡しする最新の投資信託説明書(交付目論見書)等の内容を必ずご確認のうえ、ご自身でご判断ください。
- ◆当資料は、当ファンドの運用状況をお知らせするために中銀アセットマネジメントが作成した資料です。／当資料の内容は作成時点のものであり、将来予告なく変更されることがあります。／当資料は信頼できると判断した情報等に基づき作成しておりますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。／当資料中のグラフ・数値等は、過去の実績・状況であり、将来の市場環境等や運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。また税金・手数料等を考慮していませんので、実質的な投資成果を示すものではありません。
- ◆当資料にインデックス・指数等が記載されている場合、それらの知的所有権その他一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。
- ◆当資料中の各数値は四捨五入して表示している場合がありますので、それを用いて計算すると誤差を生じることがあります。
- ◆市況動向および資金動向等により、ファンドの運用方針どおりの運用が行われない場合があります。
- ◆当資料は、特定銘柄の売買などの推奨、また価格などの上昇や下落を示唆するものではありません。

当資料で使用した指数について

- ◆MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)とは、MSCI Inc.が開発したMSCIコクサイESGリーダーズ指数(米ドルベース)をもとに三菱UFJ国際投信株式会社が計算したものです。MSCIコクサイESGリーダーズ指数(米ドルベース)は、MSCI ESGリサーチが提供する企業格付けと調査を利用し、日本を除く先進国の株式から、業種内において相対的にESG(環境、社会、ガバナンス)評価が優れた企業で構成されています。MSCIコクサイESGリーダーズ指数(米ドルベース)に対する著作権およびその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
- ◆東証株価指数(TOPIX)とは、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る株価指数です。TOPIXの指数値およびTOPIX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」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX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。

中銀アセットマネジメント