

騰落率推移



基準日	
2022/2/28	
基準価額 (円)	
13,885	
純資産 (億円)	
18.53	
設定日	27-Jan-17
経過取引日数	1242
ISIN	JP90C000EGQ9
Bloomberg	9A311171 JP

Capital Asset Management
www.capital-am.co.jp

パフォーマンス

	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	合計
2017 ESGマザー・ファンド	--	0.41	1.40	1.33	4.77	2.68	1.65	-0.46	5.21	5.45	2.70	1.16	29.47
TOPIX	--	0.90	-1.48	1.27	2.39	2.78	0.42	-0.07	3.55	5.45	1.48	1.42	19.45
2018 ESGマザー・ファンド	0.31	-2.73	-1.04	3.66	0.01	-0.70	0.70	-0.52	4.22	-10.41	1.87	-10.85	-15.56
TOPIX	1.05	-3.73	-2.94	3.55	-1.68	-0.95	1.29	-1.02	4.72	-9.42	1.30	-10.45	-17.80
2019 ESGマザー・ファンド	4.67	4.14	0.37	2.99	-7.83	3.56	2.09	-3.82	6.77	7.98	1.64	2.16	26.40
TOPIX	4.91	2.56	-1.00	1.65	-6.53	2.57	0.90	-3.40	5.02	4.99	1.94	1.29	15.21
2020 ESGマザー・ファンド	-2.07	-10.35	-3.24	5.52	6.79	2.70	-3.27	4.55	2.93	-2.48	11.64	2.57	14.26
TOPIX	-2.14	-10.30	-7.14	4.35	6.81	-0.31	-4.02	8.16	0.45	-2.84	11.12	2.84	4.84
2021 ESGマザー・ファンド	0.50	-1.42	4.90	-1.69	-0.25	2.99	-3.48	2.65	2.99	-0.85	-3.01	3.48	6.58
TOPIX	0.23	3.08	4.80	-2.85	1.30	1.07	-2.19	3.14	3.54	-1.42	-3.63	3.31	10.39
2022 ESGマザー・ファンド	-8.60	1.49											-7.24
TOPIX	-4.83	-0.47											-5.29

CAM ESG日本株ファンド (ベビー・ファンド)

	年率 (%)				
	前日比 (bp)	設定来 (%)	リターン	リスク	シャープレシオ
ファンド	+ 51	+ 38.85	+ 6.7	16.6	0.40
TOPIX	+ 57	+ 22.12	+ 4.1	16.5	0.25
JPX400	+ 38	+ 22.46	+ 4.1	16.5	0.25
日経平均	+ 19	+36.72	+ 6.4	18.5	0.35

CAM ESG日本株ファンド (マザー・ファンド)

設定来 (%)	超過リターン (設定来、%)		勝ち日数	負け日数	年率 (%)		
					リターン	リスク	シャープレシオ
+54.1					+9	16.8	0.53
+22.12	+ 31.98	+ 2.6 bp/day	656	586	+4.1	16.5	0.25
+22.46	+ 31.64	+ 2.5 bp/day	663	579	+4.1	16.5	0.25
+36.72	+ 17.38	+ 1.4 bp/day	636	606	+6.4	18.5	0.35

CAM ESG ポートフォリオ特性

財務指標・バリュエーション	CAM ESG 日本株	TOPIX	JPX 400	日経平均
ROE	11.99	8.71	10.73	12.45
ROA	2.80	1.34	1.64	3.56
営業利益率 (直近12ヶ月)	7.57	7.53	9.06	11.37
純利益率 (直近12ヶ月)	6.61	5.87	7.24	8.48
PER (ブルームバーグ予想)	14.92	12.31	12.38	14.82
PBR	1.70	1.17	1.32	1.71
配当利回り (ブルームバーグ予想)	2.07	2.58	2.62	2.19
時価総額 (兆円)	169 **	691	540	449

** 「CAM ESG日本株ファンド」が保有する銘柄の時価総額合計です

(出所)ブルームバーグのデータを基にキャピタルアセットマネジメントが計算

当資料は、情報提供を目的として、キャピタルアセットマネジメント株式会社が作成したもので、投資信託の売買を推奨・勧誘するものではありません。当資料のデータ・分析等は過去の実績及び将来の予想であり、今後の市場環境等を保証するものではありません。当資料は当社が信頼性が高い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。取得申込に際しては必ず「投資信託説明書(交付日論見書)」の内容をご確認ください。