

2017年11月15日

ESG 指数への連動を目指す国内初の機関投資家向け私募投信を設定

- 「MSCI ジャパン ESG セレクトリーダーズパッシブファンド（適格機関投資家限定）」 -

アセットマネジメントOne株式会社（東京都千代田区、取締役社長 西恵正、以下「AM-One」）は、新ファンド「MSCI ジャパンESG セレクトリーダーズパッシブファンド（適格機関投資家限定）」を2017年10月31日付で設定しました。当ファンドはESG指数である「MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）」に連動を目指す国内初の機関投資家向け私募投信です。

ESGとは環境（Environment）、社会（Social）、企業統治（Governance）の3つの言葉の頭文字をとったものです。中長期的な財務情報の基盤として、非財務情報であるESG要素を考慮する投資を「ESG投資」といいます。近年、企業の長期的成長には、ESGが示す3つの観点が重要だという考え方が世界的に広まり、機関投資家の間で関心が高まってきました。それらを背景に組成された上記指数は、MSCI社のESGリサーチによる様々なESGリスクを包括的に評価したESG格付に基づき、各業種からESG評価が高い銘柄を選定し構築されています。

AM-Oneは、フィデューシャリー・デューティー（受託者責任）のNo.1運用会社を目指しています。企業・運用会社・投資家・家計を結ぶインベストメントチェーンにおける運用会社の社会的な役割期待に応えるべく、2015年10月より株式のESG投資に取り組んでいるほか、2016年10月に責任投資部を新設、現在ではESGアナリスト7名および議決権行使担当者4名を含む12名が活動しています。当部では、投資先企業との建設的な対話（エンゲージメント）や投資先企業の株主総会議案の議決権行使などの「スチュワードシップ活動」を推進し、投資先企業の中長期的な企業価値向上を導く活動を積み上げることで市場全体のサステナブルな成長に貢献したいと考えています。

また、ESG投資の商品としては、2017年8月には国内初のESG投資による国内公社債ファンドを設定し、同11月には「FTSE Blossom Japan Index」への連動を目指すETFである「One ETF ESG」を上場予定です。

AM-Oneはこれからも、めまぐるしく変化する外部環境を察知し、ESG投資を含めた商品ラインナップを拡充することによって、お客さまのさまざまなニーズにお応えしてまいります。

以上

<投資信託のリスクとお客さまにご負担いただく費用について>

投資信託に係るリスクについて

投資信託は、株式、債券および不動産投資信託証券（リート）などの値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資をしますので、市場環境、組入有価証券の発行者に係る信用状況等の変化により基準価額は変動します。このため、投資者の皆さま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。ファンドの運用による損益はすべて投資者の皆さまに帰属します。また、投資信託は預貯金とは異なります。

投資信託に係る費用について

[ご投資いただくお客さまには以下の費用をご負担いただきます。]

お客さまが直接的に負担する費用

購入時手数料：上限 3.78%（税込）

換金時手数料：換金の価額の水準等により変動する場合があるため、あらかじめ上限の料率等を示すことができません。

信託財産留保額：上限 0.5%

お客さま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）：上限 年率 2.6824%（税込）

上記は基本的な料率の状況を示したものであり、成功報酬制を採用するファンドについては、成功報酬額の加算によってご負担いただく費用が上記の上限を超過する場合があります。成功報酬額は基準価額の水準等により変動するため、あらかじめ上限の額等を示すことができません。

その他費用・手数料：上記以外に保有期間等に応じてご負担いただく費用があります。投資信託説明書（交付目論見書）等でご確認ください。その他費用・手数料については定期的に見直されるものや売買条件等により異なるため、あらかじめ当該費用（上限額等を含む）を表示することはできません。

手数料等の合計額については、購入金額や保有期間等に応じて異なりますので、あらかじめ表示することはできません。

上記に記載しているリスクや費用項目につきましては、一般的な投資信託を想定しております。費用の料率につきましては、アセットマネジメントOne 株式会社が運用するすべての投資信託のうち、徴収するそれぞれの費用における最高の料率を記載しております。

投資信託は、個別の投資信託ごとに投資対象資産の種類や投資制限、取引市場、投資対象国が異なることから、リスクの内容や性質、費用が異なります。投資信託をお申し込みの際は、販売会社から投資信託説明書（交付目論見書）をあらかじめ、または同時にお渡ししますので、必ずお受け取りになり、内容をよくお読みいただきご確認のうえ、お客さまご自身が投資に関してご判断ください。

税法が改正された場合等には、税込手数料等が変更となることがあります。

【指数の著作権等について】

FTSE Blossom Japan インデックス（以下、「本インデックス」）に関するすべての権利はFTSEに帰属します。FTSE®はLondon Stock Exchange Group企業の商標でありライセンスに基づきFTSEによって使用されています。One ETF ESG（以下、「本商品」）はアセットマネジメントOne株式会社によって設定予定です。本インデックスはFTSEまたはその代理人によって計算されます。FTSEおよびライセンサ各社は本商品とは無関係であり、出資、助言、推奨、保証または販売促進も行いません。また(a)インデックスの使用、信頼性、または瑕疵 (b)本商品への投資または本商品の運営業務から生じる如何なる責任も負いません。本商品から得られる成果、またはアセットマネジメントOne 株式会社によって設定予定の本商品の商品性に対するインデックスの適合性のいずれに関しても、FTSEは請求、予測、保証、または表明を一切行いません。

"All rights in the FTSE Blossom Japan Index (the "Index") vest in FTSE International Limited ("FTSE"). "FTSE®" is a trade mark of the London Stock Exchange Group companies and is used by FTSE under licence. The One ETF ESG (the "Fund") will developed solely by Asset Management One co., Ltd.. The Index is calculated by FTSE or its agent. FTSE and its licensors are not connected to and do not sponsor, advise, recommend, endorse or promote the Fund and do not accept any liability whatsoever to any person arising out of (a) the use of, reliance on or any error in the Index or (b) investment in or operation of the Fund. FTSE makes no claim, prediction, warranty or representation either as to the results to be obtained from the Fund or the suitability of the Index for the purpose to which it is being put by Asset Management One co., Ltd.."

MSCI Japan ESG Select Leaders指数は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

【ご注意事項】

・当資料は、アセットマネジメントOne株式会社が作成したものです。・ファンドは、実質的に株式等の値動きのある有価証券に投資をしますので、市場環境、組入有価証券の発行者に係る信用状況等の変化により基準価額は変動します。このため、投資者の皆さま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。ファンドの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。また、投資信託は預貯金とは異なります。・当資料における内容は作成時点（2017年11月13日）のものであり、今後予告なく変更される場合があります。投資信託は1．預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構及び保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。2．購入金額については元本保証及び利回り保証のいずれもありません。3．投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合がありますが、これによる損失は購入者が負担することとなります。

【アセットマネジメント One について】

アセットマネジメントOne株式会社は、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社の資産運用部門、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社（以下、総称して「統合4社」）が統合し、2016年10月1日に発足した資産運用会社です。「投資顧問事業」と「投資信託事業」の双方の事業領域における運用資産残高は約54兆円とアジアトップクラスの規模を誇ります。

統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、資産運用のプロフェッショナルとして、グローバル運用リサーチ体制に支えられた伝統的資産のアクティブ運用や金融工学を駆使した最先端の運用戦略等、個人投資家や機関投資家の多様な運用ニーズに対し、最高水準のソリューションの提供をめざします。HP：<http://www.am-one.co.jp/>
運用資産残高は2017年6月末時点。

商号等 / アセットマネジメントOne株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第324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