

欧州サステナブルファイナンス開示規制(SFDR)細則に基づく開示について

2021 年 3 月に施行された欧州サステナブルファイナンス開示規制 (Sustainable Finance Disclosure Requirement、以下「SFDR」)は、金融市場参加者における持続可能性に関するルールを標準化することにより持続可能性に係るリスク評価の透明性を高めることを目的にした規制であり、最終投資家が金融商品を比較しやすくすることで「グリーンウォッシング」(環境に配慮しているように装うこと)を防止することが目的の一つです。SFDR のもとで各運用機関は運用ファンドを第6条、第8条、第9条の3つのカテゴリーに分類し、当該カテゴリーにおける条件の遵守とその開示が求められます。

当社が投資顧問会社として運用する欧州籍のインフラストラクチャーデットファンドは、SFDR に基づいて環境・社会的特性を促進する商品を指す第8条ファンドとして分類されています¹。第8条ファンドはサステナビリティリスクの投資プロセスへの統合に加え、環境・社会的特性の促進、計測、モニタリング及びネガティブスクリーニングの実施等が求められます。

2023 年 1 月より SFDR 細則 (Regulatory Technical Standards、以下「RTS」)が適用開始となったことに伴い、当社が運用する欧州籍のインフラストラクチャーデットファンドが促進する環境・社会的特性とその投資比率、具体的な指標と計測手法及びモニタリング手法等について下記ウェブサイトを開示しています。

<https://funds.carnegroup.com/cosmic-blue-funds>

当社は引き続きインフラデットファンドの運用において、投資哲学として「エッセンシャルティー (Essentiality)」をキーワードに国や地域社会に必要なインフラ事業への投資を行うことに専念し、グローバルに分散された良質なポートフォリオの構築に努めていきます。また PRI 署名機関として²引き続き ESG の促進に貢献し、機関投資家の皆さまの運用ニーズに応えるべくさらなる運用プロダクトの開発に注力していく所存です。

以上

【本件に関するお問い合わせ先】
アセットマネジメント One オルタナティブインベストメンツ株式会社
戦略企画部 03-5221-1340

¹ 2021 年 4 月 23 日付当社プレスを参照下さい。

http://www.am-one.co.jp/pdf/amoai/release/19/20210423_2_AMOAI.pdf

² アセットマネジメント One が代表して PRI に署名しており、当社はグループ会社として PRI を遵守しています。