

2024年2月1日

アセットマネジメントOne株式会社

「AMOneオールジャパン・カーボンニュートラル戦略 ファンド（適格機関投資家限定）」の新規設定について

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 杉原 規之、以下「AM-One」）は、本日、新たな国内株式ファンド「AMOneオールジャパン・カーボンニュートラル戦略ファンド（適格機関投資家限定）」（以下「本ファンド」）を設定しましたので、お知らせします。

本ファンドは、環境・社会の持続可能性に対する関心がグローバルに高まるなか、カーボンニュートラルに向けた取組みを広く日本の株式市場に働きかけることによって、市場全体の成長力の底上げを目指します。以下に特徴として記載した通り、カーボンニュートラルに向けた取組みが進んでいる企業に投資の力を厚く結集させる一方、更なる取組みを期待できる企業についてはエンゲージメント等を通じて取組みを後押しし、カーボンニュートラルへの移行を加速させることで、中長期的な企業価値向上を支援します。

本ファンドの特徴① カーボンニュートラルに向けた各企業の取組みをウェイトに反映

AM-Oneでは、投資先企業のカーボンニュートラルに向けた取組みを定期的に評価しており、本ファンドでは、評価の高い企業の保有ウェイトを高めるポートフォリオ構築ルールを採用します。このルールによって、より多くの企業がカーボンニュートラルの実現に向けた目標や戦略を立てることを促し、投資の面から企業のカーボンニュートラルへの取組みを力強く後押ししていきます。

本ファンドの特徴② エンゲージメントによりカーボンニュートラルに向けた企業の取組みを後押し

本ファンドは、ポートフォリオの加重平均カーボンインテンシティ（※1）をAM-Oneが定めるネットゼロシナリオ（※2）に整合するように保有ウェイトを調整しながら、日本の株式市場に上場する企業に幅広く投資します。AM-Oneの経験豊富なアナリストによるエンゲージメントを通じて、カーボンニュートラルの実現に向けて積極的に取組む企業や現状ネットゼロシナリオに整合していない企業の取組みを後押しし、企業価値の持続的成長を通じた日本の株式市場全体の成長力の底上げを目指します。

低炭素社会への移行を実現&日本株式市場全体を底上げ

AM-Oneのリサーチ力

カーボンニュートラルに向けた
企業の取組みを**評価**

- 国内随一のアナリスト陣容
- 企業の財務面だけでなく、サステナビリティの取組みも統合的に評価・分析

AM-Oneのエンゲージメント力

カーボンニュートラルに向けた
企業の取組みを**後押し**

- 5期連続最高水準の評価*
- 大手公的年金からの「エンゲージメント強化型パッシブファンド」の受託実績

*みずほリサーチ&テクノロジーズ株式会社のアンケート結果に基づく

- ※1 各企業の「温室効果ガス（Green House Gas、GHG）排出原単位」（GHG 排出量÷売上高）をポートフォリオにおける各企業の保有ウェイトで加重平均した値
- ※2 2050年までにGHG排出量をネットゼロにするためのGHG排出量の削減軌道

本ファンドの概要

名称	AM One オールジャパン・カーボンニュートラル戦略ファンド（適格機関投資家限定）
ベンチマーク	なし（参考指数：TOPIX）
投資対象	日本の株式市場に上場する（上場予定も含む）株式
ポートフォリオ構築方法	以下の事項を考慮に入れ、最適化を実施 <ul style="list-style-type: none"> ● ポートフォリオの加重平均カーボンインテンシティを AM-One が定めるネットゼロシナリオに整合する様に保有銘柄のウェイトを調整 ● AM-One が実施する企業に対するネットゼロ適合判定の結果及びエンゲージメント活動の進捗状況に基づき、保有銘柄のウェイトを調整

AM-Oneは、「投資の力で未来をはぐくむ」資産運用会社として、今後も新商品の開発や既存運用戦略の高度化等を通じて、サステナブルな社会の実現を目指してまいります。

以上

【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は、2016年10月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64兆円と国内有数の規模を誇ります。AM-Oneがこれまで培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、「投資の力で未来をはぐくむ」をコーポレート・メッセージに掲げる資産運用会社として、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。

※運用資産残高は2023年9月末時点。

公式HP <https://www.am-one.co.jp/>

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