

インパクトレポート

# IMPACT REPORT

クリーンテック株式&グリーンボンド・ファンド(資産成長型)

愛称:みらいEarth成長型

追加型投信/内外/資産複合

クリーンテック株式&グリーンボンド・ファンド(予想分配金提示型)

愛称:みらいEarth分配型

追加型投信/内外/資産複合



投資対象

アクサIMグリーンボンド・マザーファンド

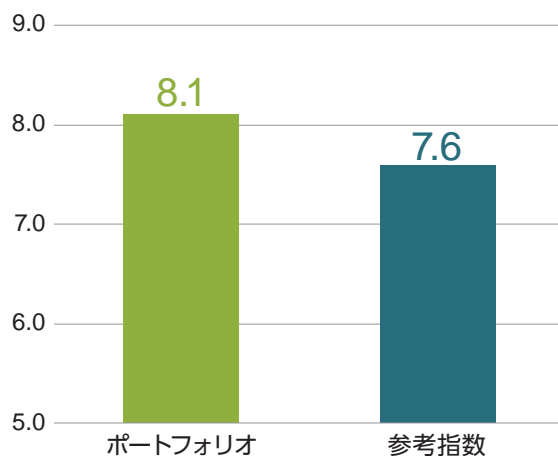
# ESG情報

## ●ポートフォリオのESGスコア

ESGに関して0～10で評価しています。ESGスコアは、企業の産業特性などを考慮して調整のうえ算出しています。

当ファンドでは、Environment（環境）、Social（社会）、Governance（企業統治）の3つの観点  
を投資プロセスに組み込むことで、持続可能な社会の実現に役立つような企業に投資することを  
目指しています。当ファンドのESGスコアの比較は右記の通りです。

ESGスコア



ポートフォリオ



参考指数



ポートフォリオ

8.9

参考指数

7.8



ポートフォリオ

6.0

参考指数

6.4



ポートフォリオ

6.1

参考指数

6.4

※参考指数はICE BofA Green Bond Index を使用しています。同指数は当ファンドのベンチマークではありません。

※上記における参考指数の数値は、指数構成銘柄のうち、アクサIMがカバーしている銘柄(カバー率100%)の数値を示しています。

出所:アクサIM、2023年3月31日時点

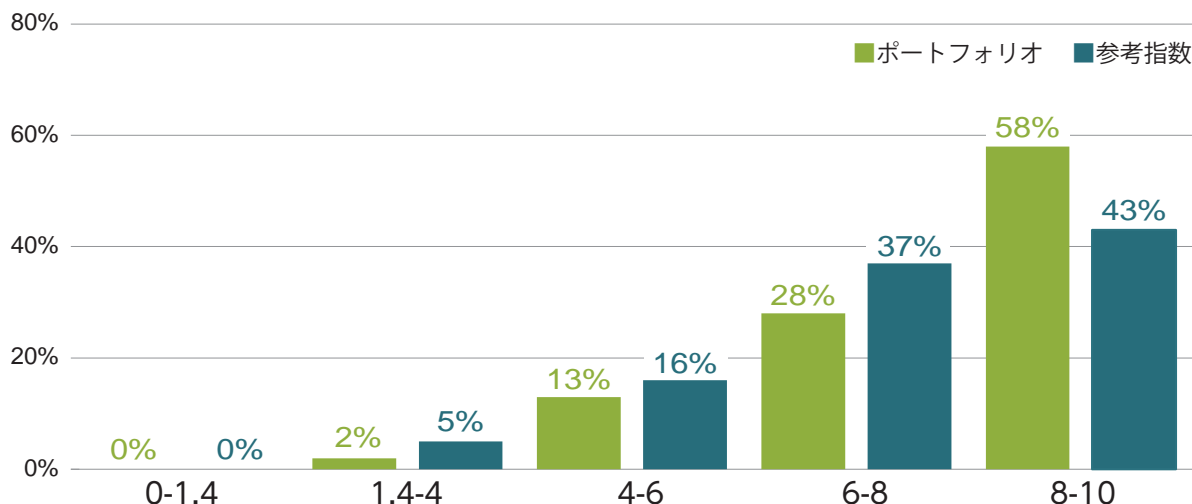
※ESGはEnvironment(環境)、Social(社会)、Governance(企業統治)の略称

注記:記載の数値は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

※当資料は、アクサ・インベストメント・マネージャーズ(以下、アクサIM)が提供するコメントを基に大和アセットマネジメントが作成したものです。

当ポートフォリオは、ESGスコアが8-10の高スコア銘柄の割合が相対的に高水準(58%)となっています。

ESGスコアの分布



※参考指数はICE BofA Green Bond Index を使用しています。同指数は当ファンドのベンチマークではありません。  
 ※上記における参考指数の数値は、指数構成銘柄のうち、アクサIMがカバーしている銘柄(カバー率100%)の数値を示しています。



アクサIMグリーンボンド・マザーファンドへの  
100万ユーロの投資は、

**年間あたり131トンの**  
**CO<sub>2</sub>排出削減効果<sup>(1)</sup>** をもたらしました。

(1)外部機関が算定した投資先債券のCO<sub>2</sub>削減量をもとに、保有ウエイトで加重平均して算出しています。



乗用車の台数に換算すると、  
**29台相当**が年間に  
排出するCO<sub>2</sub>を削減



**266 (メガワット時)再生可能エネルギー**

投資百万ユーロ当たり(年間)

出所:アクサIM、2023年3月31日時点

※ESGはEnvironment(環境)、Social(社会)、Governance(企業統治)の略称

注記:記載の数値は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

※当資料は、アクサ・インベストメント・マネージャーズ(以下、アクサIM)が提供するコメントを基に大和アセットマネジメントが作成したものです。

# インパクト情報

当ポートフォリオは、スコープ1+2およびスコープ3においてカーボンフットプリントが相対的に低水準となっています。

企業	スコープ1+2		スコープ3	
	ポートフォリオ	参考指数	ポートフォリオ	参考指数
<b>売上による炭素強度</b> 売上百万ドルあたりの大気中に放出される二酸化炭素排出トン量。	145	306	90	103
<b>絶対排出量</b> 企業が直接保有・管理するビジネスから排出される温室効果ガス排出量、及び直接のサプライヤーから排出される温室効果ガス。	1,929	2,867	1,657	1,488
<b>カーボンフットプリント</b> 総炭素排出量をポートフォリオ時価で割った割合。投資百万ユーロあたりの総炭素排出量で表される。	74	129	64	74

サブリン	ポートフォリオ	参考指数
<b>GDPによる炭素強度</b> 購買力平価GDP(国内総生産)百万ドルあたりの二酸化炭素排出トン量	157	154

### スコープ1

事業者自らにより直接排出される温室効果ガス(燃料の燃焼、工業プロセス等)

### スコープ2

他社から供給された電気、熱、蒸気などの使用に伴う間接排出される温室効果ガス

### スコープ3

スコープ1,2以外の間接排出(事業者の活動に関連する他社の排出(上流での排出のみ))

出所:アクサIM、2023年3月31日時点

※炭素強度は炭素スコープ1と第一段階の間接関係(発行体企業とその関連する供給企業が保有・管理する事業より排出される温暖化ガス(GHG))を考慮しています。

※売上による炭素強度と絶対排出量はスコープ1+2に基づきます。

※カバー率(関連するESG指標の計算が測定可能な、ファンドまたは参考指数内での割合)は下記の通りです。

売上による炭素強度:94%、絶対排出量:82%、カーボンフットプリント:82%、GDPによる炭素強度:90%

注記:記載の数値は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

※当資料は、アクサ・インベストメント・マネージャーズ(以下、アクサIM)が提供するコメントを基に大和アセットマネジメントが作成したものです。

### ●温度スコア

現在のポートフォリオにおいて企業が行うと予想される事業活動によって、2100年までに世界の平均気温がどの程度上昇するかを表します。



ポートフォリオ	2.2°C
参考指数	2.3°C

### ●売上における適格グリーン割合

EUタクソノミーで適格と判断される環境に配慮した商品・サービスから得られる収益の割合です。



ポートフォリオ	24%
参考指数	23%

### ●売上におけるブラウン割合

化石燃料の発電から得られる収益の割合です。



ポートフォリオ	6%
参考指数	8%

### ●水強度 社債

様々な水源から使用した水の総計であり、地表水、地下水、塩水、都市用水を含む水源や冷却水など。売上百万ドルあたり立方メートルで表示されます。



ポートフォリオ	19,945
参考指数	22,396

### ●水ストレス ソブリン

利用可能な淡水資源量に対する水使用量の割合。数値が高いほど水需給がひっ迫していることを表します。



ポートフォリオ	23%
参考指数	27%

### ●SBT認証を受けた企業の割合

SBT (Science Based Target: 科学と整合した削減目標イニシアティブ) が行う認証で、企業は世界の平均気温の上昇を1.5°C未満に抑えるため、科学的な知見と整合した削減目標を設定します。



ポートフォリオ	42%
参考指数	26%

出所:アクサIM、2023年3月31日時点

※カバー率 (関連するESG指標の計算が測定可能な、ファンドまたは参考指数内での割合) は下記の通りです。

温度スコア:82%、売上における適格グリーン割合:84%、売上におけるブラウン割合:84%、

水強度:社債96%、水ストレス:ソブリン90%

注記:記載の数値は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

※当資料は、アクサ・インベストメント・マネージャーズ (以下、アクサIM) が提供するコメントを基に大和アセットマネジメントが作成したものです。

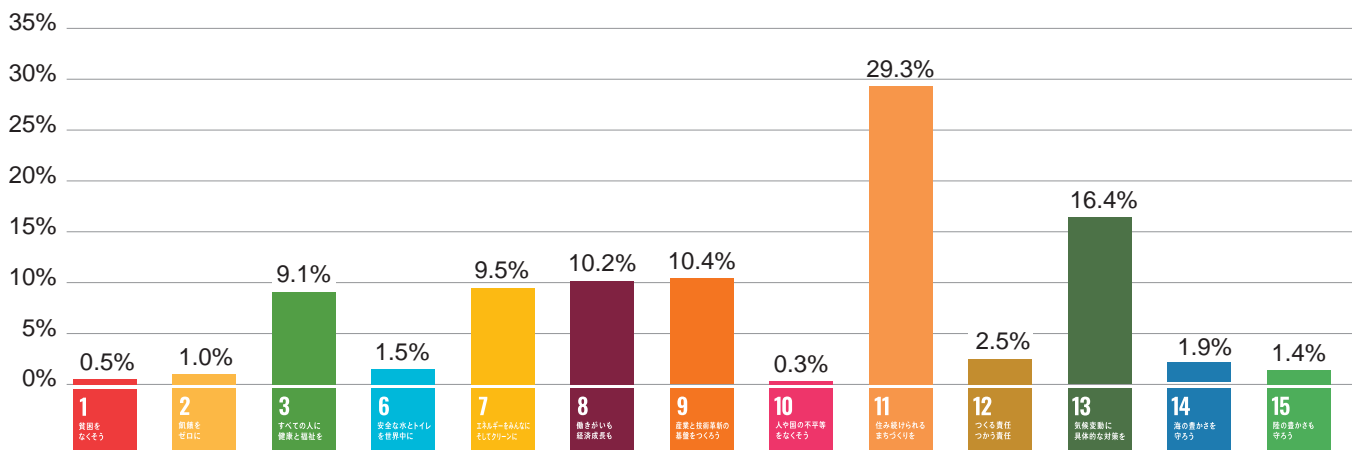
# SDGsへの寄与

## 持続可能な開発目標 (SDGs) への寄与

ポートフォリオは、多くのSDGsに寄与する中、「11 住み続けられるまちづくりを」および「13 気候変動に具体的な対策を」に特に大きく寄与しています。

### ● 持続可能な開発目標 (SDGs) とは

全ての国連加盟国が2015年に採用した17の持続可能な開発目標。現在および将来の人々や地球の平和と繁栄のために共有する計画。世界的な協力の下で、先進国、新興国すべての国の行動を求める緊急の呼びかけである。



SDGs寄与手法: 持続可能な開発目標 (SDGs) 寄与度は、それぞれの保有銘柄が一つないし複数のSDGsに寄与する個々の事例に基づく。銘柄ごとの寄与度は、ポートフォリオに対する組入比率に基づいて総計される。

### ● SDGsについて



持続可能な開発目標 (SDGs) とは、2001年に策定されたミレニアム開発目標 (MDGs) の後継として、2015年9月の国連サミットで採択された「持続可能な開発のための2030アジェンダ」にて記載された2016年から2030年までの国際目標です。持続可能な世界を実現するための17のゴール・169のターゲットから構成されています。

出所: 国連広報センター、アクサIM、2023年3月31日時点

注記: 記載の数値は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

※当資料は、アクサ・インベストメント・マネージャーズ(以下、アクサIM)が提供するコメントを基に大和アセットマネジメントが作成したものです。

# インパクトテーマ

## サステナブル債券配分

### ●グリーンボンド 92%



調達資金又はその相当額の全てが、新規又は既存の適格なグリーンプロジェクト(ネットゼロエミッション経済の促進と環境保全に繋がる、環境的に健全かつ持続可能なプロジェクト)の一部又は全部の初期投資又はリファイナンスのみに充当され、かつ、グリーンボンド原則の4つの核となる要素<sup>(1)</sup>に適合している様々な種類の債券

### ●ソーシャルボンド 0%



調達資金又はその相当額の全てが、新規又は既存の適格なソーシャルプロジェクト(より大きな社会的利益の達成に繋がる社会的に健全かつ持続可能なプロジェクト)の一部又は全部の初期投資又はリファイナンスのみに充当され、かつ、ソーシャルボンド原則の4つの核となる要素<sup>(1)</sup>に適合している様々な種類の債券

### ●サステナビリティボンド 3%



調達資金の全額がグリーンプロジェクト及びソーシャルプロジェクト双方への融資または再融資に充当され、かつ、グリーンボンド原則とソーシャルボンド原則の両方に共通する4つの核となる要素<sup>(1)</sup>に適合している債券

### ●トランジションボンド 0%



温室効果ガス排出量が多い産業の企業や十分なグリーン資産を持たない企業により、温室効果ガス排出量の削減を目的として発行され、かつ、グリーンボンド原則の4つの核と同様の要素に適合している債券

(1)4つの核となる要素:1. 調達資金の用途、2. プロジェクトの評価と選定のプロセス、3. 調達資金の管理、4. レポートニング

出所:アクサIM、2023年3月31日時点

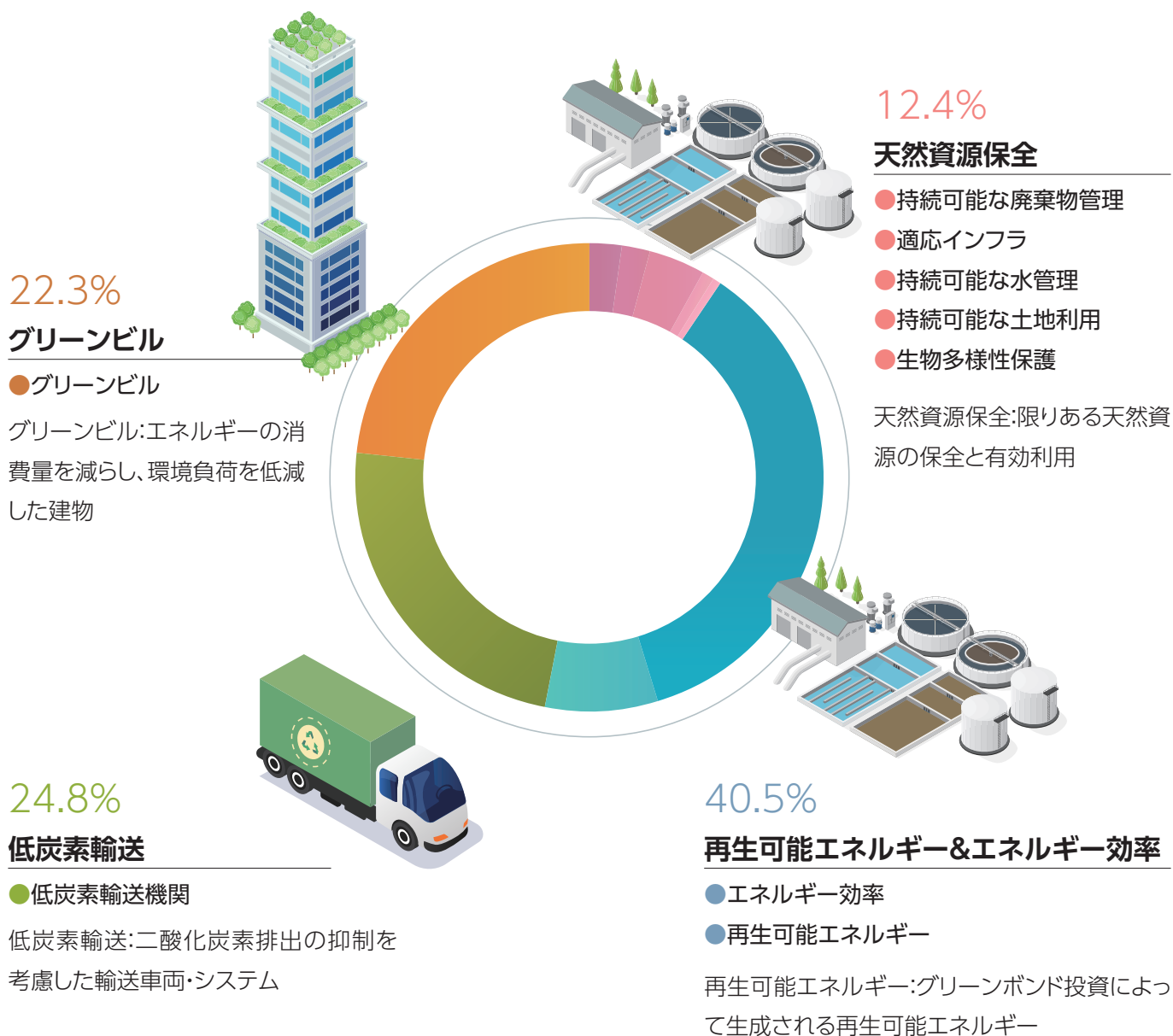
注記:記載の数値は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

※当資料は、アクサ・インベストメント・マネージャーズ(以下、アクサIM)が提供するコメントを基に大和アセットマネジメントが作成したものです。

## 環境テーマ別の内訳

グリーンボンドは一つないしは複数のプロジェクトに資金を提供します。

ファンドが投資を行うグリーンボンドのプロジェクトのグリーン比率に基づき再計算した割合です。



出所:アクサIM、2023年3月31日時点

注記:記載の数値は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

※当資料は、アクサ・インベストメント・マネージャーズ(以下、アクサIM)が提供するコメントを基に大和アセットマネジメントが作成したものです。



## ■ ファンドの目的・特色

### ファンドの目的

- 日本を含む世界のクリーンテック関連企業の株式およびグリーンボンドに投資し、信託財産の成長をめざします。

### ファンドの特色

1. 日本を含む世界のクリーンテック関連企業の株式およびグリーンボンドに投資します。
  - ◆ クリーンテック関連企業の株式の組入比率とグリーンボンドの組入比率については、下記の組入比率をめざします。

クリーンテック関連企業の株式 50%程度	グリーンボンド 50%程度
-------------------------	------------------

※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。

2. 運用は、アクサ・インベストメント・マネージャーズが担当します。
3. 分配方針の異なる2つのファンドがあります。
  - 資産成長型**
    - ◆毎年5月11日および11月11日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。
    - （注）第1計算期間は、2020年5月11日（休業日の場合翌営業日）までとします。
  - 予想分配金提示型**
    - ◆毎年5月11日および11月11日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。
    - （注）第1計算期間は、2020年5月11日（休業日の場合翌営業日）までとします。
    - ◆計算期末の前営業日の基準価額の水準に応じ、下記の金額の分配をめざします。
    - \*基準価額は1万口当たりとし、既払分配金を加算しません。
    - 当該計算期末に向けて基準価額が急激に変動した場合等には、下記の分配を行なわないことがあります。

計算期末の前営業日の基準価額	分配金額(1万口当たり、税引前)
10,500円未満	基準価額の水準等を勘案した分配金額
10,500円以上 11,000円未満	300円
11,000円以上 11,500円未満	350円
11,500円以上 12,000円未満	400円
12,000円以上 12,500円未満	450円
12,500円以上	500円

※基準価額に応じて、分配金額が変動します。基準価額が上記の一定の水準に一度でも到達すればその水準に応じた分配を続ける、というものではありません。

※分配により基準価額は下落します。そのため、基準価額に影響を与え、次期以降の分配金額は変動する場合があります。

販売会社によっては「資産成長型」または「予想分配金提示型」のどちらか一方のみのお取扱いとなる場合があります。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

- 4 当ファンドは、以下の2本の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。  
投資対象とする投資信託証券への投資を通じて、クリーンテック関連企業の株式およびグリーンボンドに投資します。



- ◆ 各ファンドの略称としてそれぞれ次を用いることがあります。  
クリーンテック株式&グリーンボンド・ファンド（資産成長型）（愛称：みらいEarth 成長型）：資産成長型  
クリーンテック株式&グリーンボンド・ファンド（予想分配金提示型）（愛称：みらいEarth 分配型）：予想分配金提示型
- ◆ 各ファンドの総称を「クリーンテック株式&グリーンボンド・ファンド（愛称：みらいEarth）」とします。

※くわしくは「投資信託説明書（交付目論見書）」の「ファンドの目的・特色」をご覧ください。

## 投資リスク

- 当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。投資信託は預貯金とは異なります。基準価額の変動要因は、以下のとおりです。

「価格変動リスク・信用リスク（株価の変動、公社債の価格変動）」、「特定の業種への集中投資リスク」、「為替変動リスク」、「カントリー・リスク」、「その他（解約申込みに伴うリスク等）」

※新興国には先進国とは異なる新興国市場のリスクなどがあります。

※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。

※くわしくは「投資信託説明書（交付目論見書）」の「投資リスク」をご覧ください。

## ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用		
	料率等	費用の内容
購入時手数料	販売会社が別に定める率 <上限> 2.2% (税抜 2.0%)	購入時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。
信託財産留保額	ありません。	—
投資者が信託財産で間接的に負担する費用		
	料率等	費用の内容
運用管理費用 (信託報酬)	年率 1.144% (税抜 1.04%)	運用管理費用の総額は、日々の信託財産の純資産総額に対して左記の率を乗じて得た額とします。
投資対象とする 投資信託証券	年率 0.4631% (税抜 0.421%) ~0.5731% (税抜 0.521%)	投資対象ファンドにおける運用管理費用等です。
実質的に負担する 運用管理費用	年率 1.6621% (税込) 程度	
その他の費用・ 手数料	(注)	監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を信託財産でご負担いただきます。

(注)「その他の費用・手数料」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※購入時手数料について、くわしくは販売会社にお問合わせください。

※運用管理費用の信託財産からの支払いは、毎計算期末または信託終了時に行なわれます。

※手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

※くわしくは「投資信託説明書(交付目論見書)」の「手続・手数料等」をご覧ください。

設定・運用:

**大和アセットマネジメント**

Daiwa Asset Management

商号等

大和アセットマネジメント株式会社

加入協会

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第352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

一般社団法人第二種金融商品取引業協会

## 当資料のお取扱いにおけるご注意

- 当資料は、ファンドの状況や関連する情報等をお知らせするために大和アセットマネジメント株式会社が作成したものです。
- 当ファンドのお申込みにあたっては、販売会社よりお渡しする「投資信託説明書（交付目論見書）」の内容を必ずご確認くださいのうえ、ご自身でご判断ください。
- 投資信託は値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではありません。信託財産に生じた利益および損失はすべて投資者に帰属します。投資信託は預貯金とは異なります。
- 投資信託は預金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。証券会社以外でご購入いただいた投資信託は投資者保護基金の対象ではありません。
- 当資料は信頼できると考えられる情報源から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。運用実績などの記載内容は過去の実績であり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。記載する指数・統計資料等の知的所有権、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。また、税金、手数料等を考慮しておりませんので、投資者の皆さまの実質的な投資成果を示すものではありません。記載内容は資料作成時点のものであり、予告なく変更されることがあります。記載する投資判断は現時点のものであり、将来の市況環境の変動等を保証するものではありません。
- 当資料中で個別企業名が記載されている場合、あくまでも参考のために掲載したものであり、各企業の推奨を目的とするものではありません。また、ファンドに今後組み入れることを、示唆・保証するものではありません。
- 分配金は収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

クリーンテック株式&グリーンボンド・ファンド（資産成長型）（愛称：みらいEarth成長型）

販売会社名（業態別、50音順） （金融商品取引業者名）		登録番号	加入協会			
			日本証券業協会	一般社団法人 金融先物 取引業協会	一般社団法人 日本投資 顧問業協会	一般社団法人 第二種金融商 品取引業協会
大垣西濃信用金庫	登録金融機関	東海財務局長(登金)第29号				
沖縄県労働金庫	登録金融機関	沖縄総合事務局長(登金)第8号				
九州労働金庫	登録金融機関	福岡財務支局長(登金)第39号				
京都中央信用金庫	登録金融機関	近畿財務局長(登金)第53号	○			
近畿労働金庫	登録金融機関	近畿財務局長(登金)第90号				
埼玉縣信用金庫	登録金融機関	関東財務局長(登金)第202号	○			
株式会社埼玉りそな銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第593号	○	○		
四国労働金庫	登録金融機関	四国財務局長(登金)第26号				
静岡県労働金庫	登録金融機関	東海財務局長(登金)第72号				
株式会社十六銀行	登録金融機関	東海財務局長(登金)第7号	○	○		
多摩信用金庫	登録金融機関	関東財務局長(登金)第169号	○			
中央労働金庫	登録金融機関	関東財務局長(登金)第259号				
中国労働金庫	登録金融機関	中国財務局長(登金)第53号				
東海労働金庫	登録金融機関	東海財務局長(登金)第70号				
東北労働金庫	登録金融機関	東北財務局長(登金)第68号				
長岡信用金庫	登録金融機関	関東財務局長(登金)第248号				
長野県労働金庫	登録金融機関	関東財務局長(登金)第268号				
長野信用金庫	登録金融機関	関東財務局長(登金)第256号	○			
新潟県労働金庫	登録金融機関	関東財務局長(登金)第267号				
飯能信用金庫	登録金融機関	関東財務局長(登金)第203号				
平塚信用金庫	登録金融機関	関東財務局長(登金)第196号				
福井信用金庫	登録金融機関	北陸財務局長(登金)第32号				
北陸労働金庫	登録金融機関	北陸財務局長(登金)第36号				
北海道労働金庫	登録金融機関	北海道財務局長(登金)第38号				
株式会社りそな銀行	登録金融機関	近畿財務局長(登金)第3号	○	○	○	
岡安証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長(金商)第8号	○			

クリーンテック株式&グリーンボンド・ファンド（予想分配金提示型）（愛称：みらいEarth分配型）

販売会社名（業態別、50音順） （金融商品取引業者名）		登録番号	加入協会			
			日本証券業協会	一般社団法人 金融先物 取引業協会	一般社団法人 日本投資 顧問業協会	一般社団法人 第二種金融商 品取引業協会
株式会社埼玉りそな銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第593号	○	○		
株式会社りそな銀行	登録金融機関	近畿財務局長(登金)第3号	○	○	○	
西村証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長(金商)第26号	○			

上記の販売会社は今後変更となる場合があります。また、販売会社によって、新規のご購入の取扱いを行っていない場合や、お申込み方法・条件等が異なります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。