情報提供用資料

2023.9.6

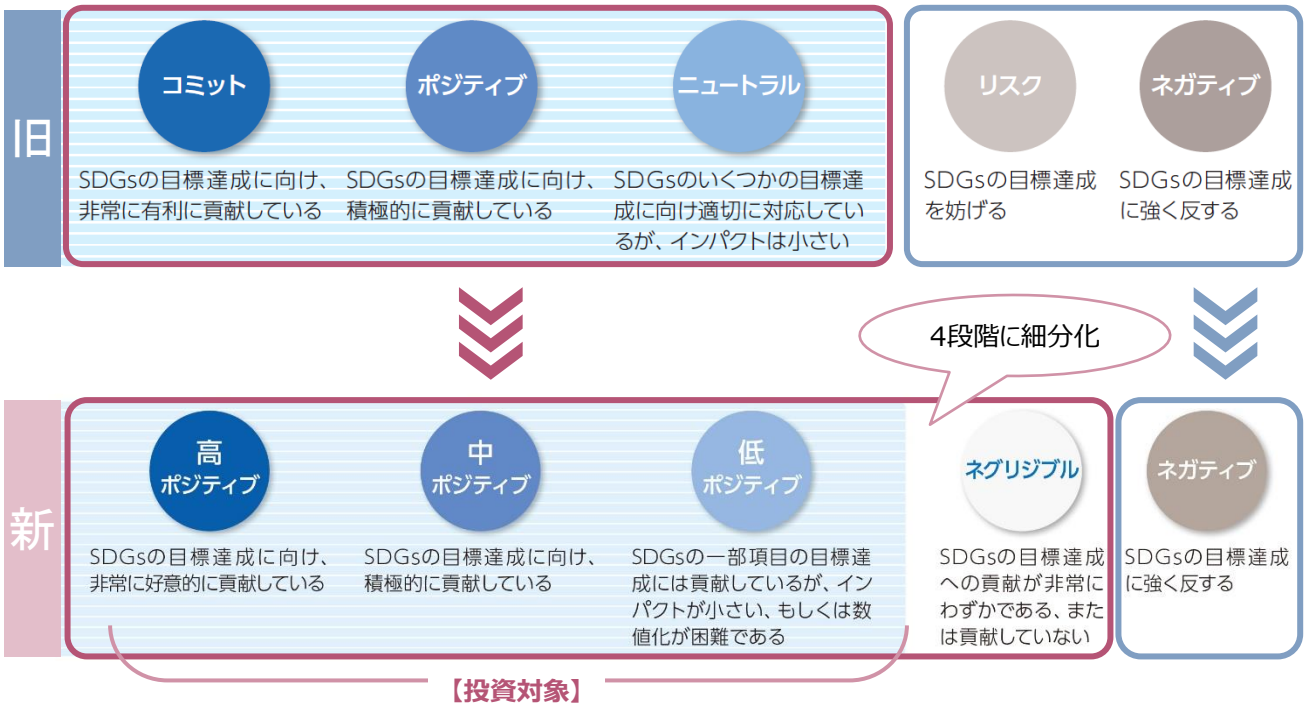
ミローバ グローバル・サステナブル株式ファンド

一歩先へ、ESG評価方法の見直し

ミローバ グローバル・サステナブル株式ファンドの運用を委託しているミローバUS社では、これまで以上に**SDGs達成**へ向けた企業活動のインパクトへ焦点を当てるため、 **ESG評価手法**の見直しを行いました。ファンドの運用やミローバ社におけるESG評価手法の大枠は変わりません。

❶ ESG分析におけるサステナブル・インパクト評価

- これまで同様、ESG分析では、環境・社会の観点から6つの項目に分類し、ポジティブ・インパクトとリスク（ガバナンス面の評価も含む）の両面から各企業を評価します。
- ポジティブ・インパクトのある銘柄の評価を、これまで以上に重視するため、**「高ポジティブ」**から**「ネグリジブル」**の**4**段階へ拡大して細分化しました。**上位3段階**の銘柄を**投資対象**とします。
- この見直しによって運用するポートフォリオから除外された銘柄はなく、実態として影響は受けておりません。



※ 上記は作成時の内容であり、今後、予告なく変更する場合があります。また、将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

※この資料の最終ページに重要な注意事項を記載しております。
必ずご確認ください。

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社
Asahi Life Asset Management Co.,Ltd.

② ESG分析のイメージ

■ 6つの各項目はSDGsの1つ以上の項目に対応しています。 ※ガバナンス面の評価も勘案します。

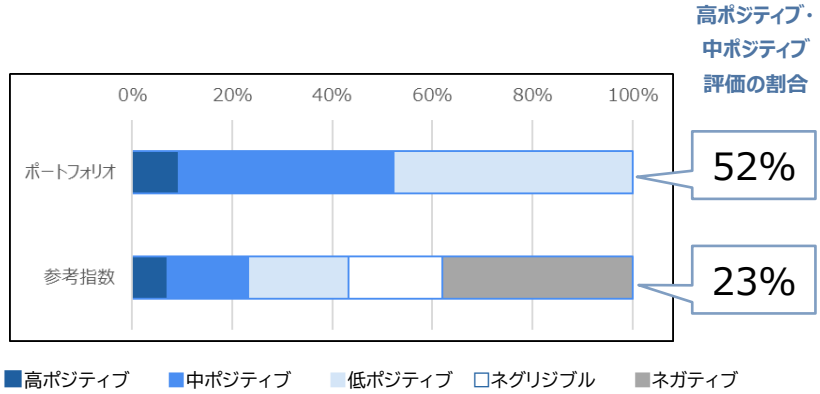
■ 6つの項目の評価では、高ポジティブからネグリジブルまで評価しますが、最終評価では、**高・中・低ポジティブ**銘柄が**投資対象**となります。

	6つの項目		5段階評価
環境	気候の安定	温室効果ガスの排出を制限し、世界の気温上昇を2℃未満に安定化させる	中ポジティブ
環境	生物多様性	自然と人間のために、陸と海における望ましい自然環境を維持	中ポジティブ
環境	サーキュラー・エコノミー	天然資源の効率的利用、循環利用することによる資源保全	低ポジティブ
社会	社会経済的発展	基本的なサービス(生活水準を高めるサービス等)へのアクセス、地域振興へのサポート、職場における人材開発の推進	低ポジティブ
社会	健康とウェルビーイング	安全・健康的な生活環境の推進、質の高い教育の推進	ネグリジブル
社会	多様性とインクルージョン	インクルーシブ・ソリューションの提供、全ての人への公平な労働環境の推進	低ポジティブ

最終評価
中ポジティブ

③ ご参考 ～ESG評価の内訳～

2023年7月末時点



■高ポジティブ
SDGsの目標達成に向け、非常に好意的に貢献している

■中ポジティブ
SDGsの目標達成に向け、積極的に貢献している

■低ポジティブ
SDGsの一部項目の目標達成には貢献しているが、インパクトが小さい、もしくは数値化が困難である

□ネグリジブル
SDGsの目標達成への貢献が非常にわずかである、または貢献していない

■ネガティブ
SDGsの目標達成に強く反する

※参考指数はMSCI KOKUSAI INDEX（ドルベース）です。（以下同様）
※上記グラフにおける参考指数は、INDEX構成銘柄のうち、ミローバ社がカバーしている銘柄（ミローバ・カバー率99%）の内訳を示しています。

※ミローバについて（ミローバ社並びにミローバUS社等の子会社を合わせて、ミローバといいます）

- ミローバ社（在フランス）は、1984年に前身であるオストラム社の運用チームの１つとしてサステナブル投資を開始し、同分野では高い評価を得ています。
- ミローバUS社は、ミローバ社の米国子会社であり、グローバル・サステナブル株式運用を担当しています。
- ESG分析については、ミローバ内のESG専門のリサーチチームがリスクと機会・インパクトを分析しています。
- ミローバ運用資産総額　325億米ドル（2023年6月末現在）

※ 上記は作成時の内容であり、今後、予告なく変更する場合があります。また、将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

■ミローバ グローバル・サステナブル株式ファンドの特色

1. 将来の世界を形成する４つの長期的なトレンドに伴う課題に解決策を提供できる企業へ投資し、中長期的な運用成果の向上とサステナブル（持続可能）な社会の実現に資することを目指します。
2. 個別企業の戦略的ポジショニング、財務構造、経営者の資質、ESG分析等による質的評価、企業価値評価に基づき、個別銘柄選択を通じてポートフォリオを構築します。
3. ミローバ・ユーエス・エルエルシー（ミローバUS社）に運用を委託します。
サステナブル投資に特化した運用会社であるミローバ社の米国子会社であるミローバUS社に、マザーファンドの外貨建資産の運用指図に関する権限を委託します。
4. 実質組入外貨建資産については、原則として、対円での為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

■投資リスク

ファンドは値動きのある有価証券等を投資対象としますので、組入有価証券等の値動きなどの影響により、基準価額が下落することがあります。したがって、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、これを割り込むことがあります。ファンドは預貯金と異なります。
信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

ファンドの基準価額の変動要因としては、主に「株価変動リスク」、「為替変動リスク」、「信用リスク」、「カントリーリスク」、「流動性リスク」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。

※詳しくは投資信託説明書（交付目論見書）をご覧下さい。

■ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用

購入時手数料	購入価額に**3.3%（税抜3.0%）**を上限として販売会社が個別に定める率を乗じて得た額※詳しくは、販売会社へお問い合わせください。
信託財産留保額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額に**0.1%**の率を乗じて得た額

投資者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）	ファンドの日々の純資産総額に年**1.804%（税抜1.64%）**の率を乗じて得た額
その他の費用・手数料	以下の費用などがファンドから支払われます。これらの費用は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。 ・ファンドの監査費用（ファンドの日々の純資産総額に年0.011%（税抜0.01%）の率を乗じて得た額。ただし年44万円（税抜40万円）を上限とします。） ・有価証券売買時の売買委託手数料 ・先物・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

※ファンドの費用（手数料等）の合計額については、投資者がファンドを保有される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。

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社
Asahi Life Asset Management Co.,Ltd.

金融商品取引業者　関東財務局長（金商）第301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

■本資料は、朝日ライフ アセットマネジメント（以下、「当社」といいます。）が、「ミローバ グローバル・サステナブル株式ファンド」に関する情報提供を目的として作成したものであり、勧誘を目的としたものではありません。■当ファンドは価格変動リスクや流動性リスク等を伴う証券等に投資します（外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。）ので、市場環境等によって基準価額は変動します。したがって投資元本は保証されているものではありません。運用による損益はすべて投資家のみなさまに帰属します。■本資料は当社が信頼できると判断した情報を元に、十分な注意を払い作成しておりますが、当社はその正確性や完全性をお約束するものではありません。■本資料中のグラフ、数値等は過去のものであり、将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。■本資料に記載されている内容は、今後予告なしに変更することがあります。■ファンドの取得の申し込みにあたっては、投資信託説明書（交付目論見書）をお渡ししますので、必ず内容についてご確認の上、お客様ご自身でご判断ください。■当ファンドは、金融機関の預金または保険契約ではありませんので、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関でご購入いただいた場合は、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。

2023-08-128