

組入上位10銘柄のESG評価とテーマ/取り組み

(2023年8月末)

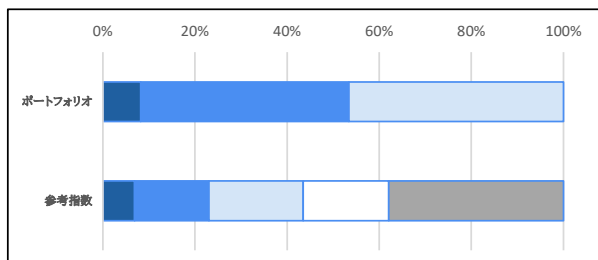
| 銘柄名 | 国 | 業種 | 構成比 (%) | ESG評価 | テーマ/取り組み | | |
|-----|-----------------------|-------|------------------------|-------|----------|--------------------|---|
| 1 | イーライリリー | アメリカ | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 5.4 | 中ポジティブ | 人口動態 医療ニーズ | 業界をリードする医薬品と強力な新薬開発パイプラインを持ち、同社は明らかに世界の人々の健康と福祉にプラスに貢献している。また、同社はサステナビリティ問題を担当する独立委員会を社内を設置している。 |
| 2 | ノボ・ノルディスク | デンマーク | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 5.3 | 中ポジティブ | 人口動態 医療ニーズ | 糖尿病は、重大な疾患につながる慢性疾患であり、同業界の主要企業として糖尿病治療に関するソリューションを提供。低・中所得国における糖尿病ケアへのアクセスを促進する取り組みも行っている。 |
| 3 | マスターカード | アメリカ | 金融サービス | 5.2 | 低ポジティブ | テクノロジー デジタル化 | 他の企業、政府機関、非政府組織などと協力して金融包摂を促進し、金融包摂を企業戦略の一つに位置付けている。事業活動における気候変動問題やエネルギー消費に対する取り組みも行っている。 |
| 4 | アドビ | アメリカ | ソフトウェア・サービス | 5.0 | 低ポジティブ | テクノロジー デジタル化 | サイバー・セキュリティ対策では全社的なセキュリティ管理システムが構築され、専任のチームが商品のライフサイクルを通じてセキュリティ対策をチェックしている。また、2035年までに同社データ・センターの電力の全てを再生可能エネルギーに切り替える目標を設定している。 |
| 5 | マイクロソフト | アメリカ | ソフトウェア・サービス | 4.9 | 低ポジティブ | テクノロジー デジタル化 | クラウドコンピューティングと人工知能分野で強力なイノベーションを起こしている。データのセキュリティとプライバシーに関し広範な戦略を持ち、データ・センターの高いエネルギー効率などから堅実なリスク管理を行っている。 |
| 6 | エヌビディア | アメリカ | 半導体・半導体製造装置 | 4.8 | 低ポジティブ | テクノロジー デジタル化&AI | 電子廃棄物、エネルギー、水などの環境への配慮をサプライヤーのトレーニングに統合するなど、サプライチェーン管理を徹底し、サステナビリティのリスクを適切に管理するための重要な措置を講じている。 |
| 7 | サーモ・フィッシャー・サイエンティフィック | アメリカ | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 4.6 | 中ポジティブ | 人口動態 医療ニーズ | 製薬業界やヘルスケア業界向け製品を通じて社会的便益を提供するとともに、環境テストの技術・サービスを通じて環境上の便益も提供している。 |
| 8 | イーベイ | アメリカ | 一般消費財・サービス流通・小売り | 4.4 | 中ポジティブ | テクノロジー デジタル化 | eコマースのプラットフォームを提供することで、製品のリサイクルを促し、持続可能な消費を促進している。また、同社は事業活動に関連する社会的および環境的課題に適切に取り組んでいる。 |
| 9 | ローパー・テクノロジーズ | アメリカ | ソフトウェア・サービス | 3.9 | 低ポジティブ | テクノロジー デジタル化 | 医療・科学のデジタル画像製品、医療診断、がん治療装置などの医療・科学イメージング事業や、水道メーター、液体処理ポンプなどの産業技術事業、エネルギーシステム・制御事業などニッチな市場でビジネス展開し、テクノロジーの観点から持続可能なソリューションを提供。 |
| 10 | エコラボ | アメリカ | 素材 | 3.8 | 中ポジティブ | 環境 資源の効率的な使用 | 同社の提供するソリューションは水やエネルギーの節約を可能にし、食品供給のサプライチェーンにおける食品廃棄物の削減にも貢献している。 |

※構成比はマザーファンドの現物株式ポートフォリオに占める比率。 ※業種はGICS(世界産業分類基準)に基づくものです。

※ESG評価は、ミローバがESGに関して5段階(高ポジティブ、中ポジティブ、低ポジティブ、ネグリジブル、ネガティブ)で評価しています。ESG最終評価がネグリジブルとネガティブの銘柄は投資対象外になります。

ESG評価の内訳

(2023年8月末)



■ 高ポジティブ ■ 中ポジティブ ■ 低ポジティブ
□ ネグリジブル ■ ネガティブ

※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。

お申込みに当たっては、必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」をご覧ください。

当ファンドの取扱い販売会社は巻末の販売会社一覧をご覧ください。

高ポジティブ・中ポジティブ
評価の割合

53%

23%

SDGsへの取り組み - ミローバの評価

■ 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

■ 設定・運用

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.

商号等 / 朝日ライフ アセットマネジメント株式会社
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

■ 外貨建資産の運用

mirova
Investing in sustainability

ミローバ・ユー・エス・エルエルシー

SDGsへの貢献 - 高ポジティブ/中ポジティブの評価

(2023年8月末)

| | | 高ポジティブ/中ポジティブ 評価の割合 | | SDGsに対応する項目 |
|----|---|---------------------|------|---|
| | | ポートフォリオ | 参考指数 | |
| 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 | 34% | 25% | 9 産業と技術革新の基盤をつくろう 13 気候変動に具体的な対策を |
| | 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 | 26% | 13% | 6 安全な水とトイレを世界中に 11 住み続けられるまちづくりを 12 つくる責任 14 海の豊かさを守ろう 15 陸の豊かさを守ろう |
| | 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 | 14% | 1% | 12 つくる責任 12 つくる責任 |
| 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 | 31% | 19% | 1 貧困をなくそう 2 飢餓をゼロに 6 安全な水とトイレを世界中に 7 エネルギーをみんなにそしてクリーンに 8 働きがいも経済成長も 10 人や国の不平等をなくそう |
| | 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 | 33% | 17% | 3 すべての人に健康と福祉を 4 質の高い教育をみんなに 11 住み続けられるまちづくりを 16 平和と公正をすべての人に |
| | 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 | 49% | 31% | 5 ジェンダー平等を実現しよう 10 人や国の不平等をなくそう |

※ミローバ提供の情報を基に当社にて作成。

※上表の数字(%)は、各銘柄について、上表6項目毎にミローバのESG5段階評価を付与し、各項目において上位評価である「高ポジティブ」あるいは「中ポジティブ」が付与された銘柄の割合を示したものです。従いまして、上表数字の合計は100%になりません。

カーボン・フットプリント

<<グローバルな気候温暖化へのインパクト>>

(2023年8月末)

| | ポートフォリオ | 参考指数 |
|------------------------------------|---------|------------|
| (単位:トン) | 2℃未満 | 3.0 - 3.5℃ |
| 投資先のCO2排出量 (投資金額100万ユーロあたりのCO2) | 60.7 | 125.1 |
| 投資先のCO2削減量 (投資金額100万ユーロあたりのCO2) | 14.5 | 7.0 |
| ミローバ・カバー率 | 100% | 98% |

※左表の分析はミローバとカーボンフォー社が共同開発したカーボン・インパクト分析に基づく推計データによるものです。
 ※左表における投資先のCO2排出量とは、対象企業の製品、サービス等の全ライフサイクルを考慮した排出量を分析・計測したものです。
 ※投資先のCO2削減量とは、対象企業の製品、サービス等(エネルギー使用)の効率化による削減効果や各種グリーン・インパクトによる削減効果を分析・計測したものです。
 ※カーボンフォー社は環境課題の評価・分析を専門とするコンサルティング会社であり、気候変動へ積極的に取り組むフランスの金融機関などと共同で分析手法を開発しています。

<<(ご参考)CO2排出量の多い上位5銘柄>>

ポートフォリオ

| | 銘柄名 | CO2排出量 | 構成比 | CO2排出量比率 |
|---|----------------|--------|------|----------|
| 1 | ローパー・テクノロジーズ | 231.98 | 3.8% | 14.6% |
| 2 | アグコ | 412.47 | 1.6% | 10.6% |
| 3 | メルセデス・ベンツ・グループ | 231.20 | 1.7% | 6.3% |
| 4 | ダナハー | 104.42 | 3.5% | 6.1% |
| 5 | シムライズ | 133.56 | 2.4% | 5.2% |

参考指数

| | 銘柄名 | CO2排出量 | 構成比 | CO2排出量比率 |
|---|---------------|---------|------|----------|
| 1 | エクソンモービル | 745.44 | 0.8% | 5.1% |
| 2 | シェル | 901.21 | 0.4% | 2.9% |
| 3 | シェブロン | 594.96 | 0.5% | 2.6% |
| 4 | シーメンス | 997.21 | 0.2% | 1.7% |
| 5 | ウィリアムズ・カンパニーズ | 2632.53 | 0.1% | 1.7% |

※CO2排出量は投資金額100万ユーロ当たり。(単位:トン)
 ※ミローバ提供の情報を基に当社にて作成。



<<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)の表現に資することを旨とします。
世界が①人口動態、②環境、③テクノロジー、④ガバナンスの分野で長期的なトレンド(構造的な変化)に伴う大きな課題に直面しており、そうした課題の解決策を提供できる企業に「投資の機会がある」と同時に、変化に対応できない企業を避けることで「リスクの抑制」に繋がると考えています。
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。

【サステナブル投資】

ESG(環境(Environment)、社会(Social)、企業統治(Governance)の略称)についての考察を投資プロセスに組み込んだ、中長期的な投資アプローチです。

<<当ファンドの投資リスクについて>>

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。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、すべて投資者に帰属します。

◀ ファンドの基準価額の主な変動要因 ▶ 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

◀ その他の留意点 ▶ ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

※ 詳しくは、「投資信託説明書(交付目録見書)」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

・ 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

※ 毎計算期間の最初の6か月終了日および毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

※ 委託会社の報酬には、運用委託先への報酬が含まれています。

・ 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。

<<お申込みメモ>>

| | |
|------------------|---|
| 購入単位 | 販売会社が定める単位 ※販売会社へお問い合わせください。 |
| 購入価額 | 購入申込受付日の翌営業日の基準価額 |
| 購入代金 | 販売会社が定める期日までにお支払いください。 |
| 換金単位 | 販売会社が定める単位 ※販売会社へお問い合わせください。 |
| 換金価額 | 換金申込受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた額 |
| 換金代金 | 原則として、換金申込受付日から起算して6営業日目から支払います。 |
| 換金制限 | 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みを制限する場合があります。 |
| 購入・換金申込不可日 | ニューヨーク証券取引所が休場日の場合は、購入・換金のお申込みができません。 |
| 購入・換金申込受付の中止及び取消 | 金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、購入・換金申込みの受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた購入・換金申込みの受け付けを取り消すことがあります。 |
| 信託期間 | 無期限(2020年12月29日設定) |
| 繰上償還 | 受益権の口数が10億口を下回るようになった場合、受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときなどには、繰上償還されることがあります。 |
| 決算日 | 毎年11月25日(休業日の場合は翌営業日) |
| 収益分配 | 年1回決算を行い、収益分配方針に基づいて分配を行います。 ※収益分配金をそのつど受け取るコースと自動的に再投資するコースがあります。自動的に再投資するコースを選択された場合の収益分配金は、税金が差し引かれた後、決算日の基準価額で再投資されます。 |
| 課税関係 | 課税上は、株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、NISA(少額投資非課税制度)の適用対象であり、2024年1月1日以降は一定の要件を満たした場合にNISAの適用対象となります。当ファンドは、2024年1月1日以降のNISAの「成長投資枠(特定非課税管理勘定)」の対象となる予定ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。 ※上記は税法が改正された場合等には、変更される場合があります。 配当控除および益金不算入制度の適用はありません。 |



<<販売会社一覧>>

お申込み・投資信託説明書(交付目論見書)のご請求

| 販売会社名 | 登録番号 | 加入協会 | | | | |
|---|----------|-----------------|-----------------|-----------------|--------------------|---|
| | | 日本証券業協会 | 一般社団法人日本投資顧問業協会 | 一般社団法人金融先物取引業協会 | 一般社団法人第二種金融商品取引業協会 | |
| 株式会社SBI証券 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第44号 | ○ | | ○ | ○ |
| 極東証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第65号 | ○ | | | ○ |
| 松井証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第164号 | ○ | | ○ | |
| マネックス証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第165号 | ○ | ○ | ○ | ○ |
| 楽天証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第195号 | ○ | ○ | ○ | ○ |
| リテラ・クリア証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第199号 | ○ | | | |
| おかやま信用金庫 | 登録金融機関 | 中国財務局長(登金)第19号 | ○ | | | |
| 株式会社SBI新生銀行 (委託金融商品取引業者:株式会社SBI証券) (委託金融商品取引業者:マネックス証券株式会社) | 登録金融機関 | 関東財務局長(登金)第10号 | ○ | | ○ | |
| 株式会社トマト銀行 | 登録金融機関 | 中国財務局長(登金)第11号 | ○ | | | |

■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、実質的に当ファンドが投資する「ミローバ・グローバル・サステナブル株式マザーファンド受益証券」のESG評価をご参考までに作成したものであり、法令に基づく開示資料ではありません。■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。2023-09-93