

HSBC ESG米国株式インデックスファンド

追加型投信／海外／株式／インデックス型

－アメリカの成長にESG投資－

守るために、攻める
サステナブルなアメリカの成長へ

**The Asset
Management
AWARDS 2020**

WINNER

PASSIVE MANAGER OF THE YEAR



ファンドの詳細・
動画はQRコード
または[こちらから](#)



HSBC
Asset Management

委託会社

HSBC投信株式会社

[金融商品取引業者]

関東財務局長（金商）第308号

[加入協会]

一般社団法人投資信託協会、日本証券業協会

一般社団法人日本投資顧問業協会

ESGの視点から米国の成長に低コストで投資するインデックスファンド。 それが『HSBC ESG米国株式インデックスファンド』です

(※ESGについては4ページ以降をご参照ください。)

<ファンドのポイント>

- ◆HSBC ESG米国株式インデックス・マザーファンド受益証券への投資を通じて、米国企業においてESGや低炭素への取組み等を評価する指数「FTSE USA ESG Low Carbon Select Index（円換算ベース）」に概ね連動する投資成果を目指します。
- ◆原則として、為替ヘッジは行いません。

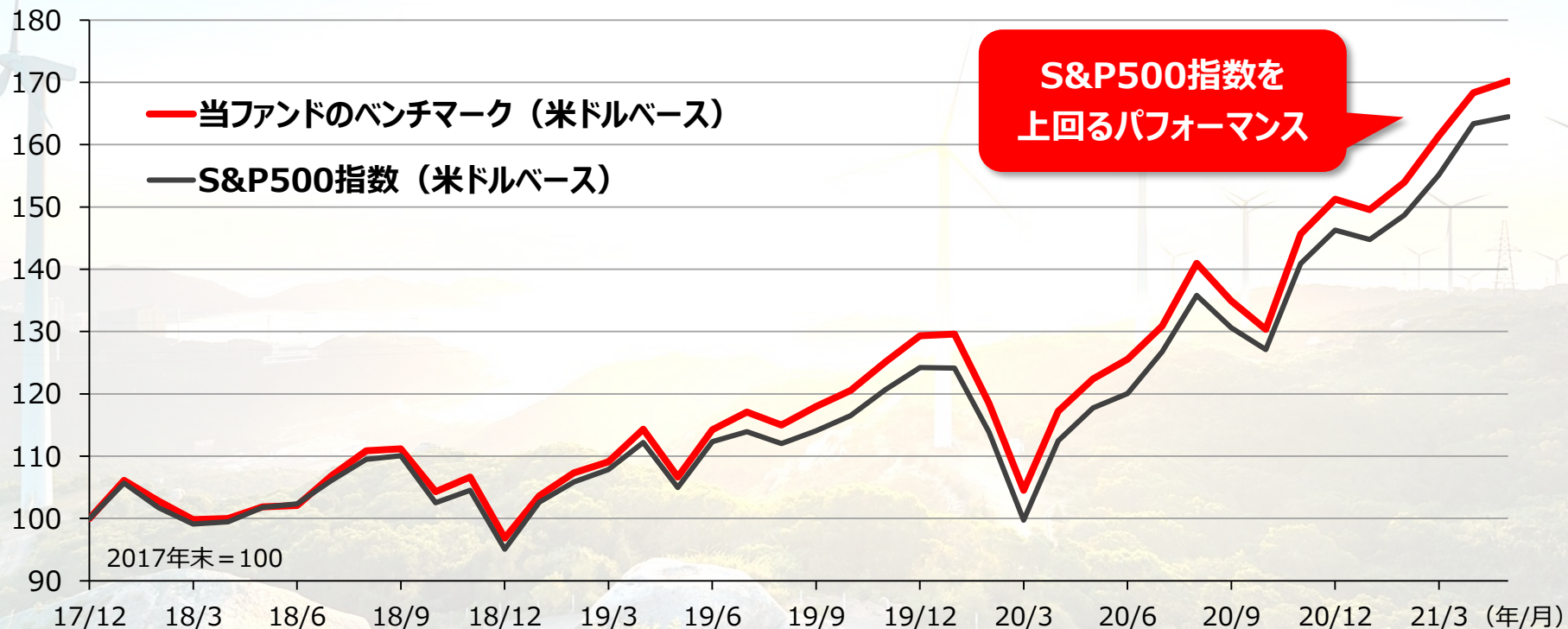


FTSE USA ESG Low Carbon Select Indexとは

米国の大型・中型株で構成される親指数FTSE USA Indexから、米国企業における、ESG（環境[E]・社会[S]・ガバナンス[G]）の取組評価、および温室効果ガス排出量や化石燃料埋蔵量に基づき、構成銘柄の組入比率をFTSE Russell社が決定し公表する株価指数です。FTSE USA ESG Low Carbon Select Index（円換算ベース）は、同指数を委託会社が独自に円換算する指数です。

脱炭素社会実現や格差是正を政策の柱とするバイデン政権のもと、
米国ではESG機運が急速に高まっており、ESG投資によるリターン向上が期待できます

当ファンドのベンチマークの推移（米ドルベース）

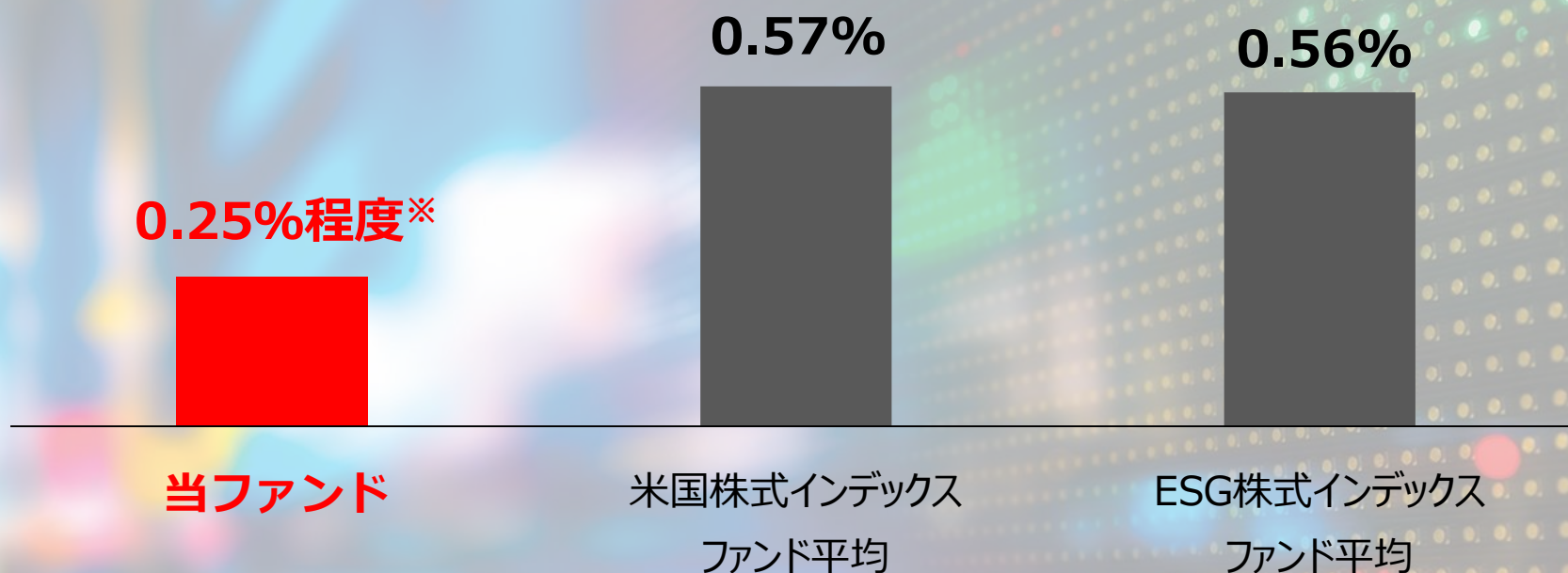


S&P500指数を上回るパフォーマンス

※当ファンドは、FTSE USA ESG ローカーボン・セレクト・インデックス（円換算ベース）に概ね連動する投資成果を目指します。
上記指数は2017年末～2021年5月末の税引き後配当込みのトータル・リターン指数の月次データ（米ドルベース）。2017年末を100として指数化。
上記は過去の指数データであり、将来を示唆・保証するものではありません。またファンドの実績ではありません。
出所：リフィニティブ、ブルームバーグのデータをもとにHSBC投信作成

インデックス運用により、
低コストで『米国株投資×ESG投資』を実践できます

信託報酬率の比較



比較対象ファンドは国内公募投資信託（ETF、DC専用ファンドおよびラップ専用ファンド除く）より、モーニングスター社の分類に基づき選定。

各ファンドの税込み信託報酬率の小数第3位を四捨五入して算出。

※当ファンドの信託報酬率は、当資料作成日時時点で投資対象とする上場投資信託証券において適用されている報酬率（0.12%程度）をもとに算出。

出所：モーニングスター社のデータをもとに、HSBC投信が作成（2021年5月末現在）

ESG投資を考える3つの質問 その① ESGの「E」について

Q. あなたならどちらの企業を応援しますか？

- 利益最優先で業績を伸ばす一方、温室効果ガス（CO2）を大量に排出する企業
- 再生エネルギーの利用など脱炭素の取組みに積極的な企業

A. ESG投資ならこちらの企業を応援します

『再生エネルギーの利用など脱炭素の取組みに積極的な企業』

気候変動が身近な脅威となる中、脱炭素社会に適応できる企業が長期的に成長可能です。ESG投資は、気候変動や生態系保護といった環境問題に積極的に取り組む企業を応援します。

Environment
(環境)

具体的には…

気候変動（脱炭素）・エネルギー効率・
生態系保護・水資源・廃棄物処理など

ESG投資を考える3つの質問 その② ESGの「S」について

Q. あなたならどちらの企業を応援しますか？

- 利益最優先で業績を伸ばす一方、労働者の人権を軽視している企業
- 人種や性別にかかわらず、能力のある人材が活躍している企業

A. ESG投資ならこちらの企業を応援します

『人種や性別にかかわらず、能力のある人材が活躍している企業』

企業の競争力の源泉は人材です。

ESG投資は、労働環境改善や差別・格差是正など社会問題に積極的に取り組む企業を応援します。

Social
(社会)

具体的には・・・

人権・ジェンダー平等・
職業上の安全と健康・製造者責任など

ESG投資を考える3つの質問 その③ ESGの「G」について

Q. あなたならどちらの企業を応援しますか？

- 利益最優先で業績を伸ばす一方、不都合な事実から目をそむける企業
- 不都合な事実も受け入れ、改善策を徹底することでリスク管理強化を図る企業

A. ESG投資ならこちらの企業を応援します

- 『不都合な事実も受け入れ、改善策を徹底することでリスク管理強化を図る企業』

リスクへの対応は企業の存続に関わります。

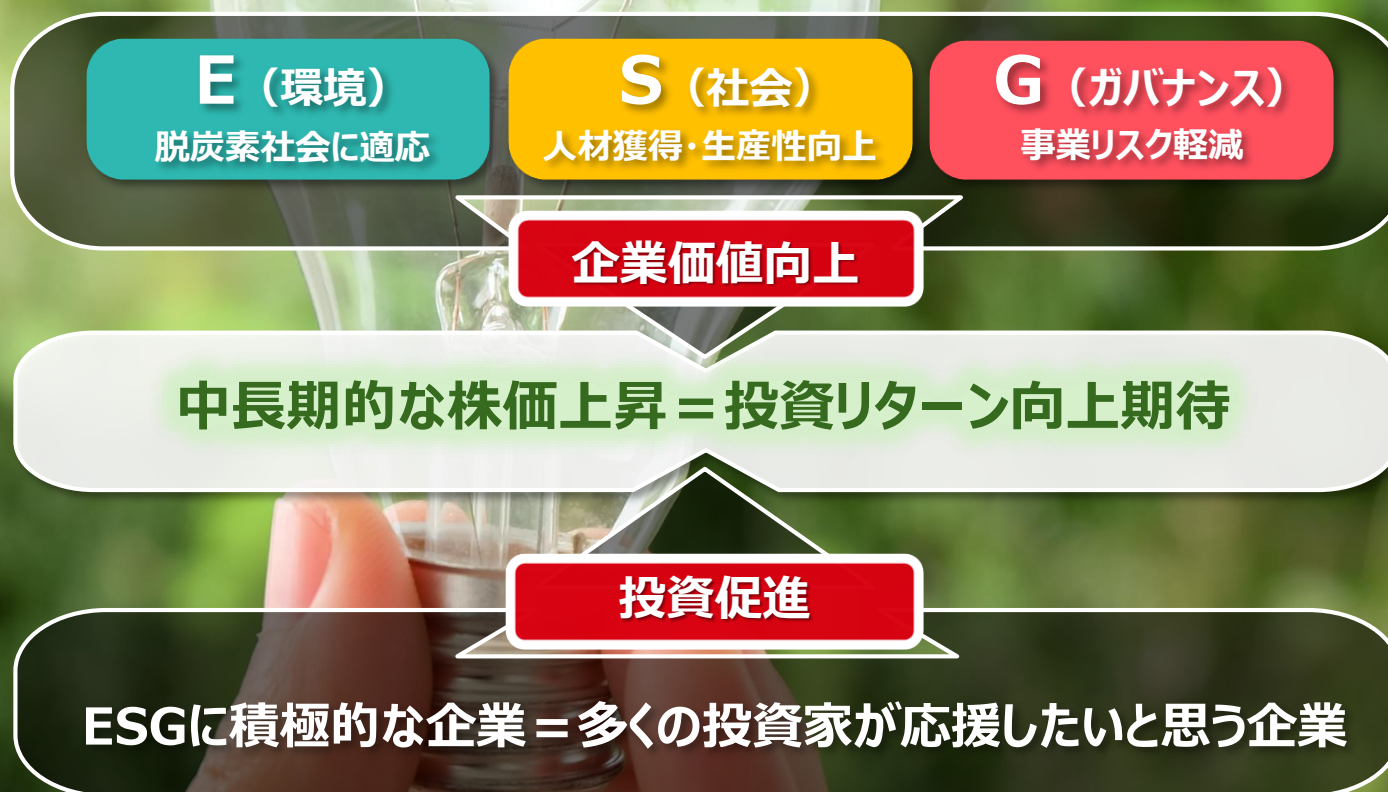
ESG投資は、**ガバナンス（企業統治）強化に積極的に取り組む企業を応援します。**

Governance
(ガバナンス)

具体的には…

取締役会の構成・企業の所有権・
役員報酬・サイバーセキュリティなど

資産運用において魅力的な投資先とは何でしょうか。
それは、企業価値を高め、多くの投資家が応援したいと思う企業です。
ESG投資は、そのような企業への投資を通じて中長期的なリターンの向上が期待できます



注) ESG投資により必ずリターンが向上することを示唆・保証するものではありません。

最近よく目にするようになったSDGs (Sustainable Development Goals)。
 これは、17の項目で構成される、持続可能でよりよい世界を目指す国際目標です

ESGはSDGsという目的を達成する手段です。

ESG投資によって、資産運用を通じてSDGsの達成に貢献することができます

手段

ESGに積極的に取り組むことによって・・・

Environment (環境)

気候変動（脱炭素）・
 エネルギー効率・
 生態系保護・水資源・
 廃棄物処理など

Social (社会)

人権・ジェンダー平等・
 職業上の安全と健康・
 製造者責任など

Governance (ガバナンス)

取締役会の構成・
 企業の所有権・
 役員報酬・
 サイバーセキュリティなど

目的

2030年までに
 SDGs(持続可能な開発目標)を達成する



当ファンドのベンチマークは、米国企業のESGおよび低炭素に対する取組みを評価する指数で、設定目標を満たすように構成銘柄と比率が決定されます

<FTSE USA ESG ローカーボン・セレクト・インデックスの構成銘柄および比率の決定プロセスのポイント>



持続可能性の観点から好ましくない企業（問題兵器等）を除外
国連グローバル・コンパクト原則に違反している企業を除外

構成銘柄および比率の決定

時価総額ベースの指数（FTSE USA Index）に対し、以下の目標を満たすように構成銘柄と比率を決定



ESGスコア^{※1} : **20%改善**



売上高に対するCO2排出量^{※2} : **50%削減**



化石燃料由来のCO2排出量^{※3} : **50%削減**

※1 FTSE Russell社の独自調査に基づき、各企業のESGの取組み評価を点数化したもの

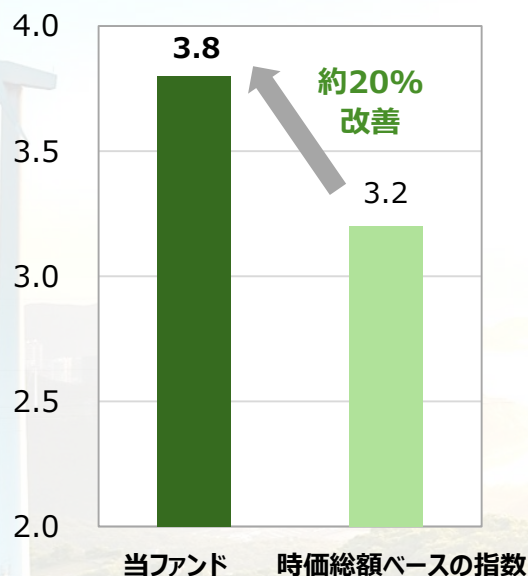
※2 年間売上高当たりの年間温室効果ガス排出量のCO2換算重量

※3 時価総額当たりの化石燃料備蓄の燃焼による年間温室効果ガス排出量のCO2換算重量

当ファンドに投資することで、多くの投資家が応援したいと思う企業、
そしてSGDs達成に貢献度合いの高い企業に重点的に投資できます

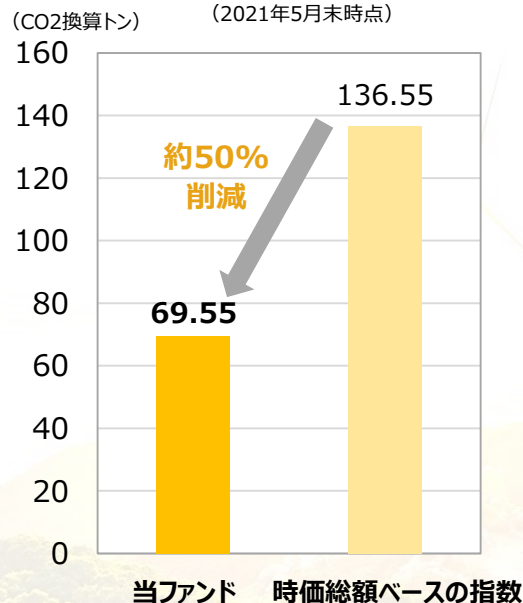
ESGスコア※1

(2021年5月末時点)



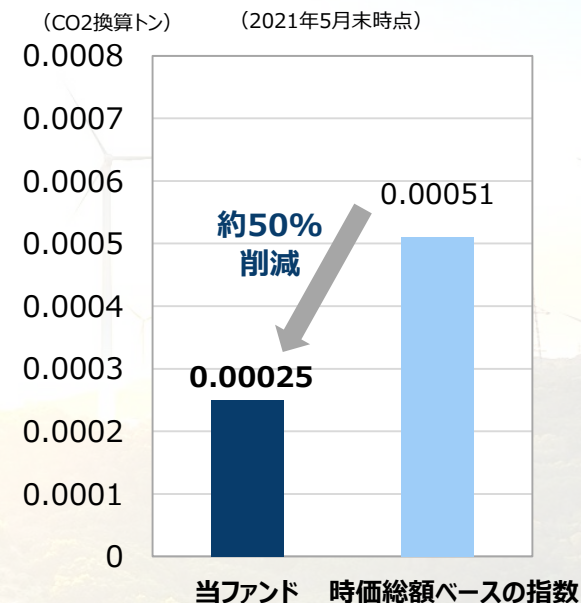
CO2排出量①※2

(2021年5月末時点)



CO2排出量②※3

(2021年5月末時点)



時価総額ベースの一般的なインデックス運用と比べて、
ESGおよび低炭素に積極的に取り組む企業に重点的に投資しています

※1 FTSE Russell社の独自調査に基づき、各企業のESGの取組み評価を点数化したもの（スコアは0～5） ※2 年間売上高百万米ドル当たりの年間温室効果ガス排出量のCO2換算重量

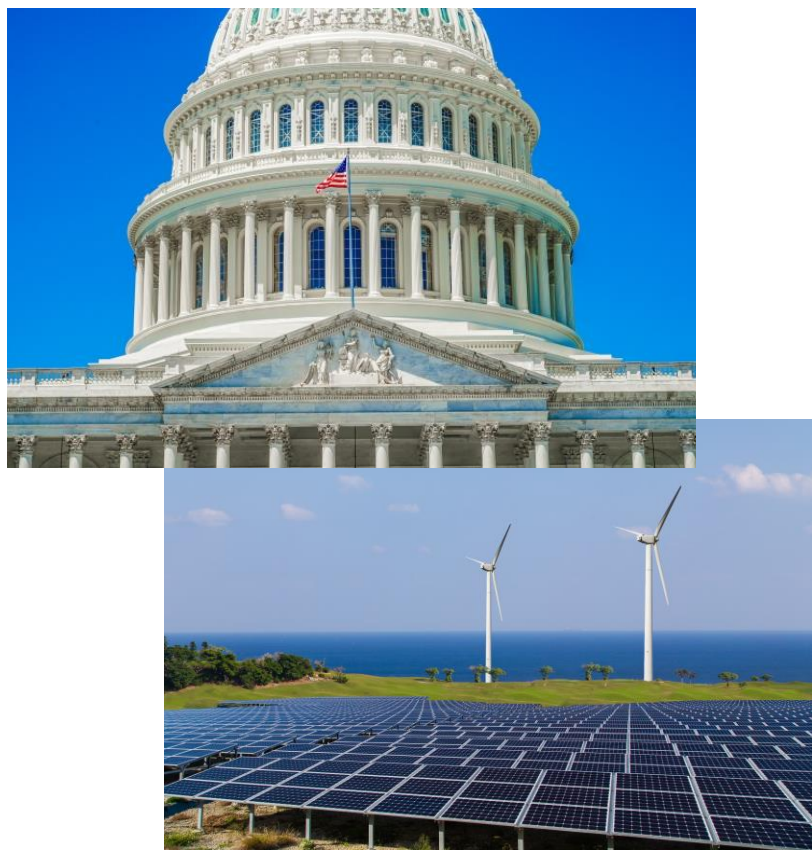
※3 時価総額百万米ドル当たりの化石燃料備蓄の燃焼による年間温室効果ガス排出量のCO2換算重量

当ファンド：当ファンドのマザーファンドが主要投資対象とする上場投資信託証券「HSBC USA Sustainable Equity UCITS ETF」のデータ、時価総額ベースの指数：FTSE USA Indexのデータ

出所：HSBCグローバル・アセット・マネジメントUK

世界のCO₂排出量の15%を占める米国が脱炭素に向けて動き出したことで、新たなイノベーション、投資機会が生まれることが期待されます

＜米国の脱炭素社会実現に向けた取組み＞



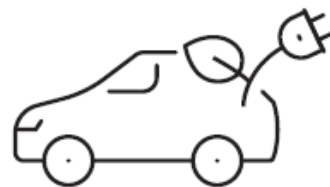
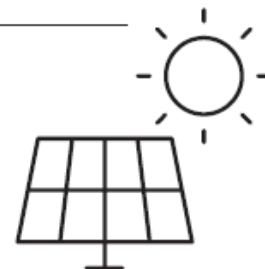
気候変動の国際的枠組み「**パリ協定**」に復帰

2050年までに**CO₂ネット・ゼロ**達成



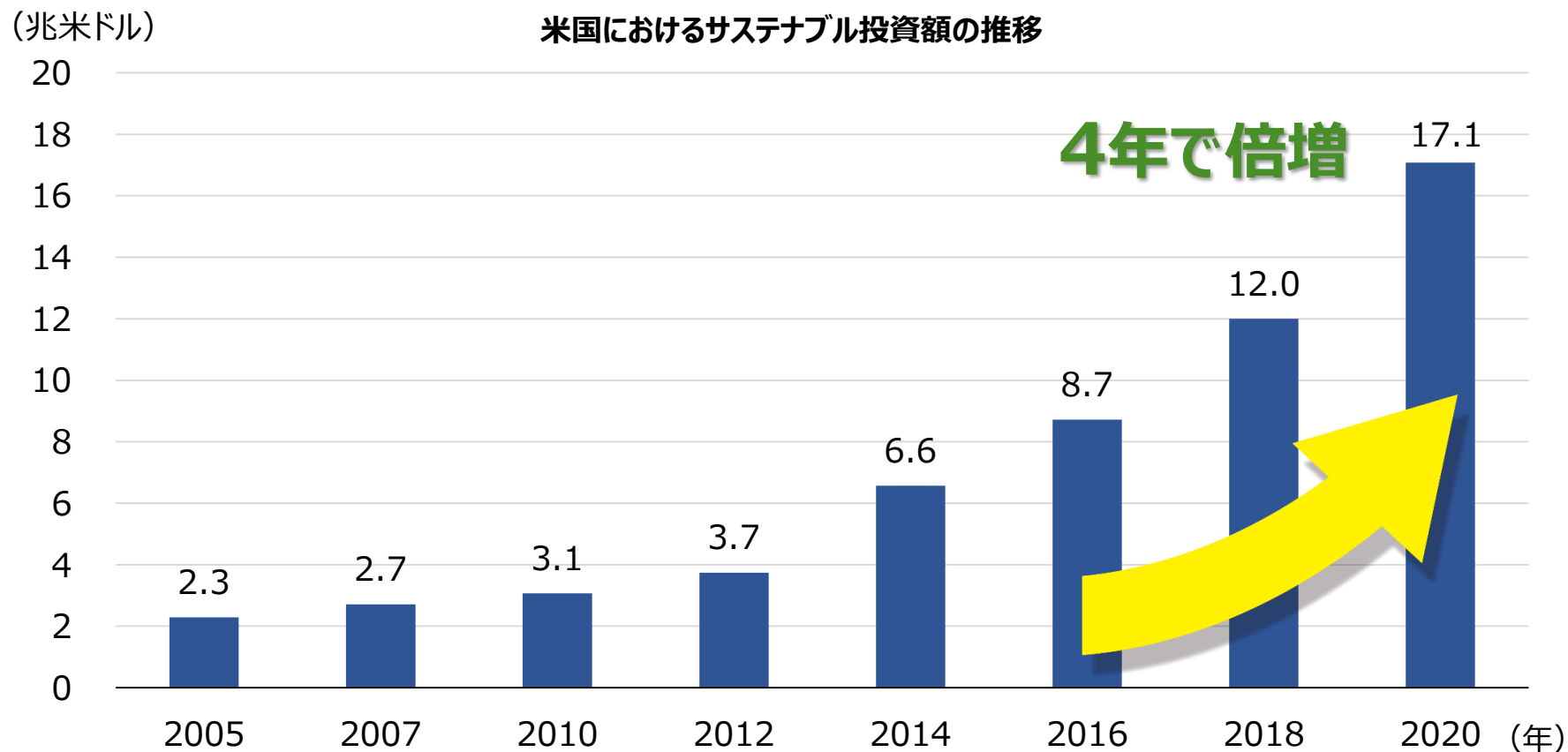
4000億米ドルのクリーンエネルギー投資
2035年までに**CO₂ゼロ発電への完全移行**

2035年までにエネルギーセクターの
CO₂排出量を半減



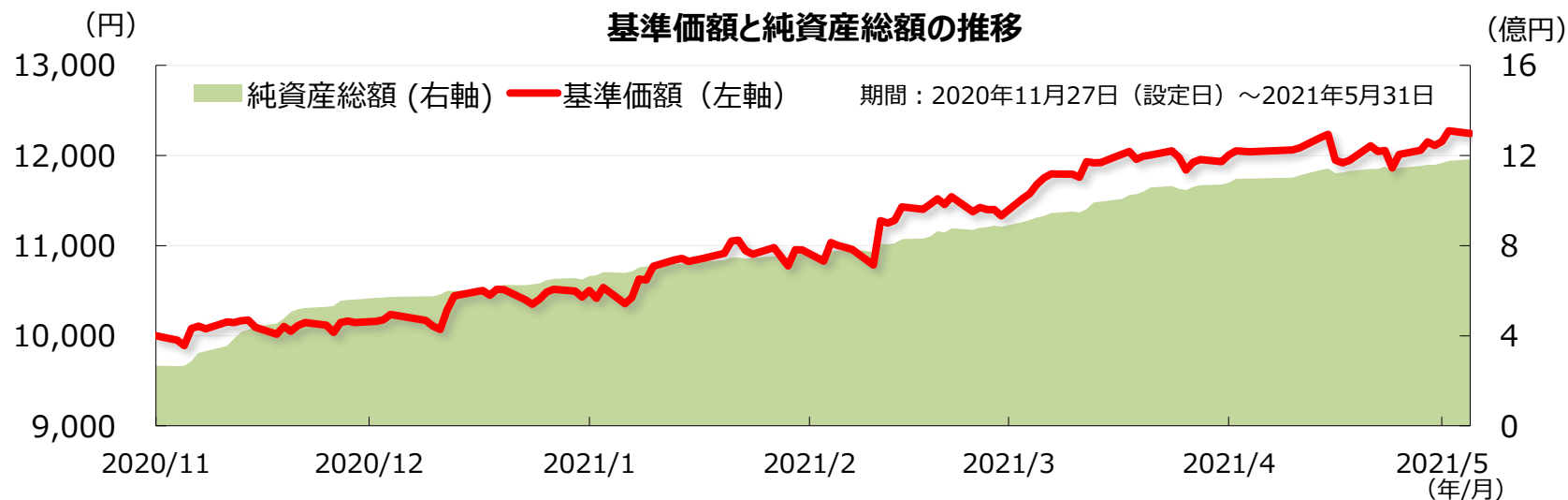
脱炭素イノベーション推進
CO₂排出ゼロ自動車、クリーン鉄道、
バイオ燃料、クリーン航空燃料

米国におけるESG投資を含むサステナブル投資額は急速に増加しています。
ESG投資が資産運用の常識となりつつあります



出所：US SIFのデータをもとにHSBC投信作成

HSBC ESG米国株式インデックスファンドの運用実績 (2021年5月末現在)



期間別騰落率

期間	ファンド
1ヶ月	1.7%
3ヶ月	11.8%
6ヶ月	23.1%
1年	—
3年	—
設定来	22.5%

組入上位銘柄と組入比率※

順位	銘柄名	比率
1	マイクロソフト・コーポレーション	9.1%
2	アップル・インク	5.4%
3	シティグループ・インク	3.7%
4	インテル・コーポレーション	2.6%
5	JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	2.5%
6	ビザ・インク	2.3%
7	プロクター・アンド・ギャンブル・カンパニー	2.1%
8	マスターカード	1.9%
9	シスコ・システムズ・インク	1.9%
10	アクセンチュア	1.8%

基準価額は信託報酬控除後のものです。

銘柄名は、報道等の表記を参考にHSBC投信が翻訳しており、発行体の公式名称やその和文訳と異なる場合があります。

※組入上位銘柄と組入比率は、当ファンドのマザーファンドが主要投資対象とする上場投資信託証券「HSBC USA Sustainable Equity UCITS ETF」のデータです。

HSBCグループについて

サステナブル・ファイナンスにおける世界最高の銀行※



315兆円
の総資産

64の
国・地域

HSBCグループのサステナビリティへの取組みハイライト

- 2007 HSBC気候変動センター・オブ・エクセレンスが、気候変動のリスクと機会に関するリサーチを発表
- 2011 従業員当たりのCO2排出量を2020年に3.5トンから2.5トンに削減すると公約
- 2012 国連の持続可能な保険原則に署名
- 2014 赤道原則3を導入
- 2015 グリーンボンド原則の創設メンバーとなる
- 2016 持続可能な開発投資パートナーシップ(SDIP)に加入
- 2017 サステナブル・ファイナンス部門創設
- 2020 2030年までのCO2排出量「ネット・ゼロ達成」を宣言

HSBCはESG投資のパイオニア

HSBCアセットマネジメントは責任投資で20年の歴史



当ファンドの主なリスク

投資信託は元本保証のない金融商品です。また、投資信託は預貯金とは異なることにご注意ください。当ファンドは、主に値動きのある外国の有価証券を実質的な投資対象としますので、組入有価証券の価格変動あるいは外国為替の相場変動次第では、当ファンドの基準価額が下落し、投資者の皆さまの投資元本を割り込むことがあります。当ファンドの運用による損益はすべて投資者の皆さまに帰属します。

株価変動リスク	株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は短期的または長期的に大きく下落することがあります。株式市場には株価の上昇と下落の波があり、現時点で価格が上昇傾向であっても、その傾向が今後も継続する保証はありません。
信用リスク	株式および債券等の有価証券の発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなる可能性があります。債券等への投資を行う場合には、発行体の債務不履行や支払遅延等が発生する場合があります。
為替変動リスク	外貨建資産の円換算価値は、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。
流動性リスク	急激かつ多量の売買により市場が大きな影響を受けた場合、または市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、機動的に有価証券等を売買できないことがあります。
カントリーリスク	投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または資本取引等に関する規制の変更や新たな規制が設けられた場合には、投資方針に沿った運用が困難になることがあります。

※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。

※上記のリスクをご理解いただき、投資の判断はご自身でなさいますようお願い申し上げます。

お申込みメモ（詳しくは投資信託説明書（交付目論見書）をご覧ください。）

購入単位	販売会社が個別に定める単位とします。
購入価額	当初申込期間：1口当たり1円 継続申込期間：購入申込受付日の翌営業日の基準価額
購入代金	購入代金は、販売会社が個別に定める期日までに、販売会社に支払うものとします。 購入代金とは、購入金額（購入価額×購入口数）に購入時手数料（税込）を加えた金額です。
換金単位	販売会社が個別に定める単位とします。
換金価額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額
換金代金	原則として、換金申込受付日から起算して5営業日目以降に販売会社でお支払いします。
申込締切時間	原則として午後3時までとします。
購入の申込期間	当初申込期間：2020年11月17日から2020年11月26日まで 継続申込期間：2020年11月27日から2022年2月3日まで （継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）
申込受付不可日	日本国内の営業日であっても、ロンドン、ニューヨークの証券取引所の休場日または銀行休業日のいずれかに該当する場合には、購入および換金の申込受付は行いません。
購入・換金の申込受付の中止および取消し	取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は購入・換金の申込受付の中止および取消しを行う場合があります。
信託期間	無期限（信託設定日：2020年11月27日）
繰上償還	ファンドの残存口数が10億口を下回った場合等には、信託を終了させる場合があります。
決算日	毎年11月6日（休業日の場合は翌営業日） ※初回決算日は2021年11月8日
収益分配	年1回の決算時に収益分配方針に基づき分配します。ただし、分配対象額が少額の場合等には分配を行わないことがあります。 分配金の受取方法により、分配金を受取る「一般コース」と分配金を再投資する「自動けいぞく投資コース」の2つのコースがあります。
課税関係	課税上は株式投資信託として取り扱われます。原則として、収益分配金、換金時および償還時の差益に対して課税されます。 公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度および未成年者少額投資非課税制度の適用対象です。 益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

当ファンドの費用（詳しくは投資信託説明書（交付目論見書）をご覧ください。）

投資者が直接的に負担する費用

購入時手数料	購入時にご負担いただきます。 購入金額に、3.30%（税抜3.00%）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とします。	商品内容の説明ならびに購入手続き等にかかる費用
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

運用管理費用 （信託報酬）	年0.1265% （税抜年0.115%）	ファンドの日々の純資産総額に信託報酬率を乗じて得た額とします。ファンドの信託報酬は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日、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）	税抜年0.05%	ファンドの運用等の対価
	（販売会社）	税抜年0.05%	分配金・換金代金の支払い、運用報告書等の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
	（受託会社）	税抜年0.015%	運用財産の管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
実質的な負担	投資対象とする 投資信託証券	年0.15%（上限）	投資対象とする投資信託証券の運用および管理等にかかる費用で、当該投資信託証券の純資産総額に乘じて得た額
		年0.2765% （税抜年0.265%）以内	マザーファンドが投資対象とする投資信託証券の運用管理費用を加味して、投資者が実質的に負担する運用管理費用について算出したものです。
その他費用・手数料	<p>ファンドの保有期間中、その都度ファンドから支払われます。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・有価証券売買委託手数料／保管銀行等に支払う外貨建資産の保管費用／信託財産に関する租税、信託事務処理に要する費用等 ・振替制度にかかる費用／印刷業者等に支払う法定書類の作成、印刷、交付および届出にかかる費用／監査法人等に支払う監査報酬等 <p>純資産総額に対し上限年0.20%として日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。</p> <p>なお、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日、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。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・投資先投資信託証券における売買にかかる手数料、租税、カストディーフィー、監査報酬等 <p>その他費用・手数料は、運用状況等により変動するため、事前に料率等を記載することができません。</p>		

ファンドの費用の総額については、投資者のファンドの保有期間に応じて異なるため、表記できません。

留意事項

<当資料に関する留意点>

- 当資料はHSBC投信株式会社が作成した販売用資料です。当資料は信頼に足ると判断した情報に基づき作成しておりますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。
- 当資料の記載内容等は作成時点のものであり、今後変更されることがあります。また、データ等は過去の実績あるいは予想を示したものであり、将来の成果を示唆するものではありません。当社は、当資料に含まれている情報について更新する義務、情報の根拠となるデータなどについて公開する義務を一切負いません。
- 当ファンドは預金保険・貯金保険の対象ではありません。また、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関でご購入の投資信託は投資者保護基金の保護の対象ではありません。当ファンドの購入のお申込みに関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（クーリング・オフ）の適用はありません。
- 当資料は、法令に基づく開示資料ではありません。購入の申込みにあたっては、「投資信託説明書(交付目論見書)」および「契約締結前交付書面（目論見書保管書面等）」を販売会社からお受け取りの上、十分にその内容をご確認いただき、ご自身でご判断ください。

<分配金に関する留意点>

分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託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払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がかさった場合も同様です。

<指数の著作権について>

HSBC ESG米国株式インデックスファンド（以下、「ファンド」）はHSBC投信株式会社が設定、運用するファンドです。ファンドは、ロンドン証券取引所およびロンドン証券取引所グループ各社（以下、「LSE Group」）のいずれによっても、後援、推薦、販売または販売促進されるものではありません。FTSE RussellはLSE Group 各社の商号です。FTSE USA ESG Low Carbon Select Index（以下「本指数」）のすべての権利はLSE Groupに帰属します。「FTSE®」はLSE Groupの商標であり、ライセンスに基づきFTSEによって使用されます。本指数はFTSEまたはその代理人により編集、算出されますが、LSE Groupは本指数の誤差脱漏について何人に対しても責任を負わず（過失の有無を問わず）、かつ本指数の誤差脱漏に関して通知する義務を負いません。LSE Groupは、本指数の使用およびいかなる時点における本指数値の利用から生じうるいかなる結果に対しても、明示的か黙示的かを問わず、何ら表明や保証を行うものではありません。

設定・運用は

HSBC投信株式会社

金融商品取引業者：関東財務局長（金商）第308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／
日本証券業協会

照会先



電話番号 03-3548-5690
(受付時間は営業日の午前9時～午後5時)

www.assetmanagement.hsbc.co.jp

