

2020年10月30日

**HSBC 投信、日本で初となる
米国株式に ESG 要素を取り入れたインデックスファンドを
個人投資家向けに設定**

HSBC 投信株式会社は、「HSBC ESG 米国株式インデックスファンド」を 11 月 27 日に設定することを発表しました。

近年、ESG 投資は、機関投資家のみならず個人投資家からも注目されており、ESG に着目した投資信託の人気が高まっていますが、ESG 要素を取り入れた米国株式のインデックスファンドは日本初となります。販売は、株式会社 SBI 証券が 11 月 17 日から開始します。今後、取扱販売会社の拡大を予定しています。

当ファンドは、ファンド名のとおり「米国株式」、「ESG」、「インデックス」の 3 本の柱があります。まさに、これら 3 本の柱により、高い成長を続ける「米国株式」に「ESG」要素を加えることで持続可能な成長への投資を可能とし、さらに「インデックス」運用により低コストを実現しました。

米国は、幾度となく危機を経験しながらも、技術革新や新たなビジネスモデルが世界をリードする原動力となり、株式市場もまた成長を続けています。そして、成長を続ける企業は、ESG（環境、社会、ガバナンス）に配慮した経営を行っており、技術革新や生産性向上、事業リスクの軽減が企業価値の向上に繋がっています。当ファンドは、ESG への取組みを考慮し、構成銘柄および組入比率を決定する FTSE USA ESG Low Carbon Select Index（円換算ベース）に連動することを目指すインデックス運用を行うため、一般的な投資信託より低い信託報酬率となっています。

運用を行う HSBC グローバル・アセット・マネジメントは、ESG 投資において約 20 年の経験を有するパイオニアです。また、HSBC は、ユーロマネー誌の「2020 年アワード・フォー・エクセレンス」において、持続可能な経済活動への投資や社会問題の改善に向けた金融面での取り組みが評価され、サステイナブル・ファイナンス部門で昨年に続き 2 年連続で「ワールド・ベスト・バンク」に選出されました。

HSBC 投信は、今後もお客様の需要に応じた投資信託やサービスをご提供して参ります。

次頁に続く

ファンドの特色

1. 対象指数となる「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めざして運用を行います。

- ▶ FTSE USA ESG Low Carbon Select Index (円換算ベース)をベンチマークとします。

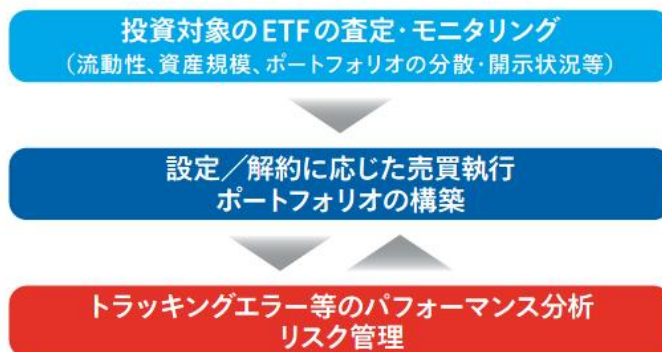
FTSE USA ESG Low Carbon Select Indexについて

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]・企業統治[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。

当ファンドのベンチマークとしては、同指数を委託会社が円換算した数値を使用しています。

2. 「HSBC ESG米国株式インデックスマザーファンド」[※]への投資を通じて、主として米国の株式を実質的な投資対象資産とする上場投資信託証券(ETF)に投資を行い、対象指数に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

- ▶ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ▶ 投資プロセス



- ▶ ファンド設定時における主な投資対象ETFは「HSBC USA Sustainable Equity UCITS ETF」とします。なお、投資対象ETFは、委託会社の判断により今後変更となる場合があります。

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。

分配方針

年1回の決算時(毎年11月6日、休業日の場合は翌営業日)に、以下の方針に基づき、分配を行います。

- ▶ 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ▶ 分配金額は、委託会社が基準価額の水準・市況動向などを勘案して決定します。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。
- ▶ 留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

(注)将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

市場動向やファンドの資金動向等によっては、上記のような運用ができないことがあります。

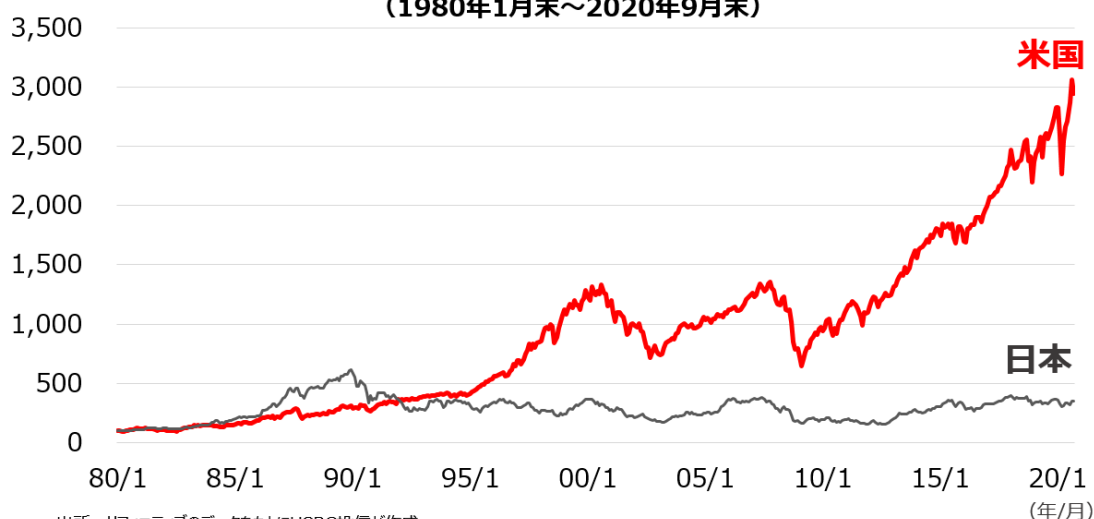
次頁に続く

当ファンドの3本の柱



- ◆ 米国は幾度となく危機を経験しながらも、技術革新や新たなビジネスモデルが世界をリードする原動力となり、株式市場もまた成長を続けています。

日米の長期株価推移の比較
(1980年1月末～2020年9月末)



出所：リフィニティブのデータをもとにHSBC投信が作成
※使用した指数（現地通貨建て、月次）：米国株式はS&P500株価指数、日本株式はTOPIX（東証株価指数）
1980年1月末を100として指数化

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。市況動向やファンドの資金動向等によっては、上記のような運用ができないことがあります。

- ◆ 成長を続ける企業は、ESGに配慮した経営を行っており、技術革新や生産性向上、事業リスクの軽減が企業価値の向上に繋がっています。ESGの取組みが、企業価値向上と投資促進の両面から、長期的な投資リターンの上昇に貢献すると期待されます。

主要市場の
サステナブル投資の
資産残高※1
3,200兆円

世界の投資家の
86%
が投資判断において
ESGを重視※2

ESGインデックスの
7割以上
が一般的なインデックスを
アウトパフォーム※3

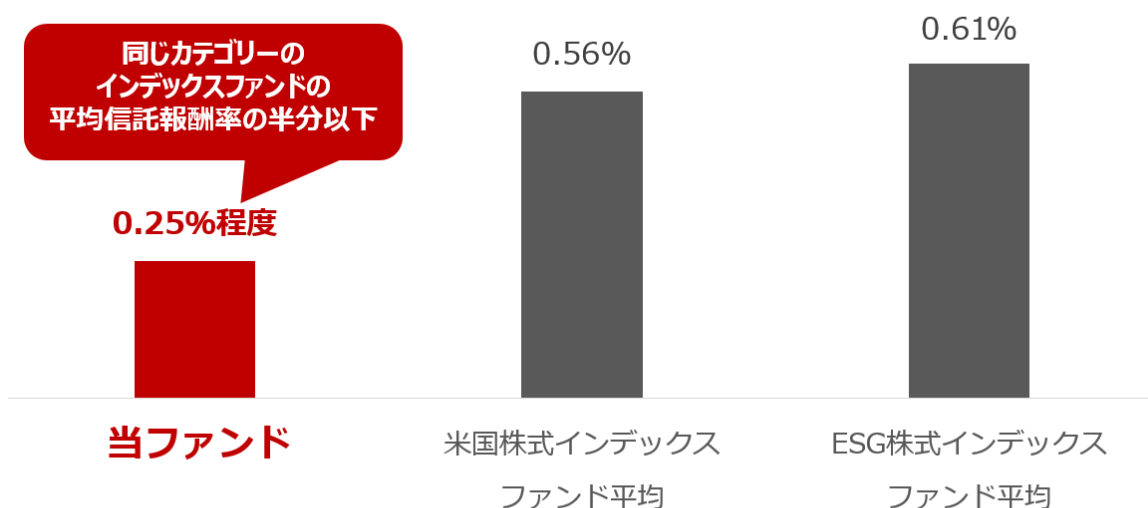
※1 出所：Global Sustainable Investment Review 2018 数値は、欧州、米国、日本、カナダ、オーストラリアにおけるサステナブル投資の資産残高（2018年年初現在）1米ドル=105円で換算

※2 出所：HSBC Sustainable Financing and Investing Survey 2020

※3 出所：モーニングスターによる分析 ESGインデックス56本のうち、非ESGインデックスをアウトパフォームした本数

- ◆ 当ファンドは、指数に連動する投資成果を目指すインデックスファンドの中でも、低コスト運用を実現しています。また、国内公募投資信託における米国株式インデックスファンド、ESG 株式インデックスファンドそれぞれの平均信託報酬率と比べても、半分以下の水準です。

【信託報酬率比較】



比較対象ファンドは国内公募投資信託より、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少数第3位を四捨五入して算出。当ファンドの信託報酬率は、本書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（2020年9月末現在）

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。市況動向やファンドの資金動向等によっては、上記のような運用ができないことがあります。

当ファンドの費用

〈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	購入時にご負担いただけます。購入金額に、 3.30%(税込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
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
実質的な負担	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	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。 ・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 [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。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。] ・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 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。	

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。

次頁に続く

注記：**HSBC グループ**

HSBC グループの持株会社である HSBC ホールディングス plc は英国・ロンドンに本部を置いています。HSBC グループは、ヨーロッパ、アジア・太平洋、南北アメリカ、中東、北アフリカにまたがる 64 の国と地域でお客様にサービスを提供し、2兆 9,230 億米ドル（2020 年 6 月末現在）の総資産を持つ、世界有数の金融グループです。

HSBC グローバル・アセット・マネジメント

HSBC 投信株式会社が属する HSBC グローバル・アセット・マネジメントは、個人・事業法人・機関投資家に投資ソリューションを提供する、HSBC グループにおける資産運用部門の総称です。HSBC グローバル・アセット・マネジメントは 25 の国と地域に拠点を持ち、それぞれのマーケットを深く理解している国際的なネットワークを活かして、お客さまにグローバルな投資機会を提供しています。HSBC グローバル・アセット・マネジメント全体の運用資産は約 5,250 億米ドル（2020 年 6 月末現在）です。

関連するファンドに関わる事項

投資信託は、主に国内外の株式や公社債等の値動きのある証券を投資対象としており、当該資産の市場における取引価格の変動や為替の変動等により、基準価額が変動し損失が生じる可能性があります。従いまして、投資元本が保証されているものではありません。投資信託は、預金または保険契約ではなく、預金保険機構または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。購入の申込みにあたりましては「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（目論見書補完書面等）」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。

当ファンドの主なリスク

当ファンドは、主に値動きのある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。当ファンドの主なリスクには、①株価変動リスク、②信用リスク、③為替変動リスク、④流動性リスク、⑤カントリーリスク等があります。ただし、基準価額の変動要因は、これらに限定されるものではありません。

<当資料のお取扱いにおけるご注意事項>

当資料は、HSBC 投信株式会社（以下、当社）が情報提供を行う目的で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。当資料は信頼に足ると判断する情報に基づき作成していますが、その正確性を保証するものではありません。また、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を一切負いません。

以上

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