

2021年10月15日

HSBC 投信、パリ協定に準拠する指数をベンチマークとする グローバル株式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 気候パリ協定準拠株式インデックスファンド」を11月18日に設定することを発表しました。11月2日から株式会社 SBI 証券が販売を開始し、今後は取扱販売会社の拡大を予定しています。

地球温暖化がもたらす脅威は、世界中の人々の身近に迫っています。明るい未来を繋ぐためにも、世界規模で脱炭素社会（カーボンニュートラル）の実現に取り組む必要があります。世界各国は地球温暖化防止の国際的な枠組みであるパリ協定に合意し、世界の平均気温上昇を1.5℃以内に抑えることを目標に掲げ、動き始めました。

パリ協定をきっかけとして、カーボンニュートラルに向けた取り組みが世界の企業や私たち一人ひとりにも広がる中で、政策サポート、規制緩和、環境技術革新、グリーン関連投資や消費の拡大等により、グローバル市場に新たな投資機会が生まれると考えられます。

当ファンドは、パリ協定に準拠した低炭素経済への移行に伴うリスク抑制、市場機会の獲得を目指す世界の企業で構成される「MSCI World 気候パリ協定準拠指数（円換算ベース）」をベンチマークとし、この指数に概ね連動する投資成果を目指します。また、信託報酬率を相対的に低くすることで、より多くの投資家の皆さまに長期資産形成を通じた環境保護投資を実践する機会を提供します。

当ファンドの運用は、ESG 投資において約20年の経験を有する HSBC アセットマネジメントが行います。HSBC アセットマネジメントが属する HSBC グループは、パリ協定の目標に合わせ、2050年までの「ネットゼロ達成」を宣言し取組んでおり、その一環として、世界資源研究所及び世界自然保護基金と協働で気候変動対策を支援しています。また、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、持続可能な経済社会の実現に向けた投資や金融商品開発への積極的な取り組みが評価され、サステナブル・ファイナンス部門において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、今後もお客様のニーズ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「MSCI World 気候パリ協定準拠指数(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。

- ▶ MSCI World 気候パリ協定準拠指数(円換算ベース)をベンチマークとします。

MSCI World 気候パリ協定準拠指数について

MSCI World 気候パリ協定準拠指数は、主に先進国の大型・中型株で構成される親指数 MSCI World Index から、気候変動やパリ協定の要件に沿った低炭素経済への移行に伴うリスクを抑制し、市場機会を獲得することを目指し、構成銘柄の組入比率を MSCI 社が決定の上、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 気候変動適応株式インデックスマザーファンド」[※]への投資を通じて、主として世界各国の企業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)に投資を行います。

※以下「マザーファンド」といいます。

- ▶ 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投資対象ETFは「HSBC MSCI World Climate Paris Aligned 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

MSCI World 気候パリ協定準拠指数は、MSCI社(MSCI Inc.)が開発、計算する指数で、同指数に関する著作権、知的財産その他の一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

分配方針

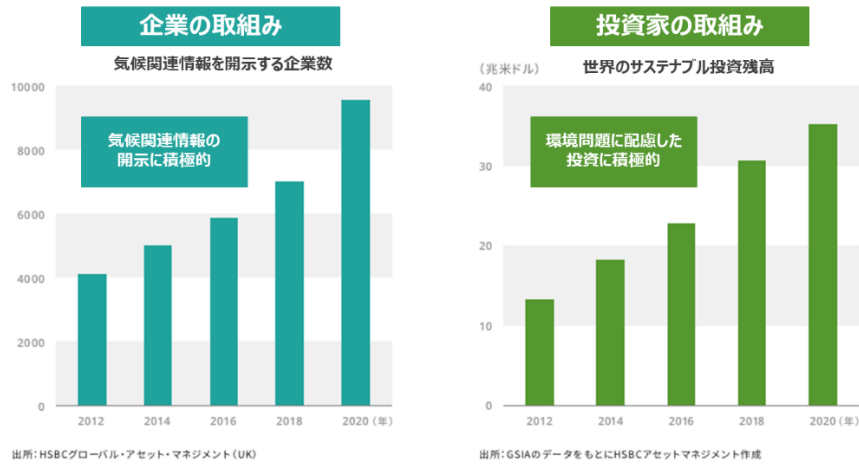
年1回の決算時(毎年11月18日、休業日の場合は翌営業日)に、以下の方針に基づき、分配を行います。

- ▶ 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。

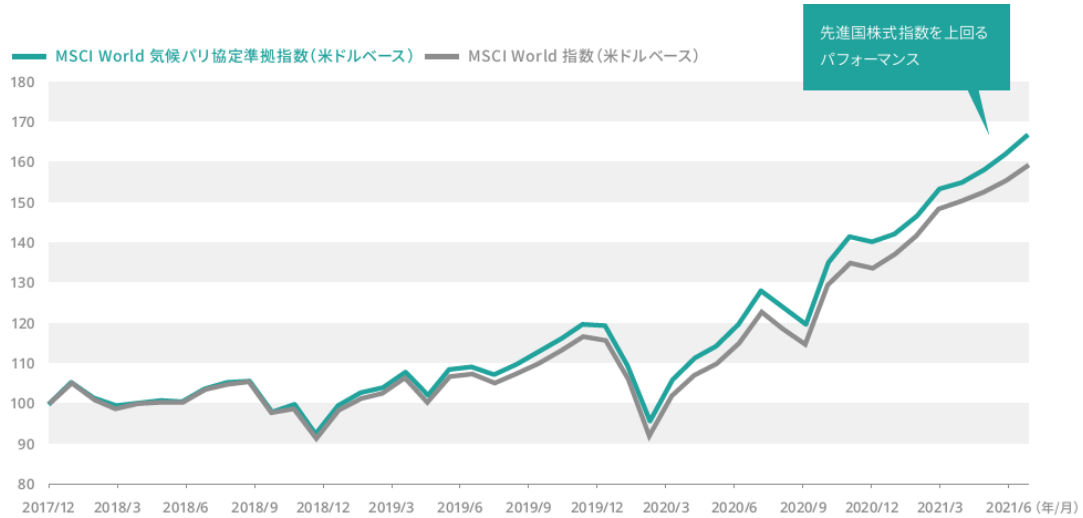
市場動向やファンドの資金動向等によっては、上記のような運用ができないことがあります。

拡大する気候関連投資



気候変動課題に積極的に取り組む企業への投資による長期的なリターンが期待できる

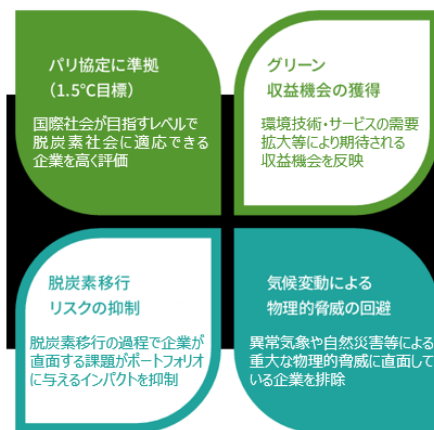
当ファンドのベンチマークの推移 (米ドルベース)



※当ファンドは、MSCI World気候パリ協定準拠指数(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8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。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

当ファンドのベンチマークの特徴



気候変動と脱炭素への移行にともなう投資リスクの回避と収益機会の獲得が期待できる

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
投資対象とする 投資信託証券	年0.18%(上限)	投資対象とする投資信託証券の運用および管理にかかる費用で、当該投資信託証券の純資産総額に乗じて得た額
実質的な負担	年0.3065%(税抜年0.295%) 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。

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 9,760 億米ドル（2021 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 アセットマネジメント

HSBC 投信株式会社が属する HSBC 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 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、お客様にグローバルな投資機会を提供しています。HSBC アセットマネジメント全体の運用資産は約 6,250 億米ドル（2021 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

※HSBC 投信株式会社は 2021 年 11 月 1 日付で HSBC アセットマネジメント株式会社に社名変更いたします。