

H S B C アセットマネジメント、 「米ドル建 ESG マネー・マーケット・ファンド」を設定

10月13日 – H S B C アセットマネジメントは ESG マネー・マーケット・ファンド (MMF) の「H S B C 米ドル建 ESG リクイディティ・ファンド」を設定することを発表しました。これは 2021 年 10 月に設定した H S B C 英ポンド建 ESG ファンドが、10 億英ポンドを超える規模へと急拡大した成功に続くものです¹。

当ファンドは、A1、P1、F1 あるいはそれに相当する長期格付を有し、H S B C アセットマネジメントが投資可能ユニバース内で ESG リスクへの対応が優れていると認めた発行体で構成するポートフォリオに投資します。これを実現するために、マネー・マーケット市場の投資可能ユニバースに適した強固な ESG スコアリングシステムならびに相対的 ESG フィルターを適用します。当ファンドによって大企業、年金基金、保険会社、その他の機関投資家は、サステナビリティ目標に沿ったソリューションに軸足を定めるキャッシュ運用が可能になります。

発行体エンゲージメントは当ファンドのアプローチにおいて重要な要素であり、顧客投資家の要望に対応するエンゲージメント・プログラムもその一環です。H S B C アセットマネジメントは、ESG リスク管理が不十分であると判断した発行体に対して、その対応を働きかけます。それによって各企業は、自社の短期債券がファンドの投資対象として適格かどうかの判断材料に ESG パフォーマンスが考慮されることを確実に意識するようになります。このような取り組みを通じて、H S B C アセットマネジメントは ESG リスク管理へ一段と注力し、よりサステナブルな成果を実現していくことを目指しています。

気候変動問題に係るエンゲージメント・プログラムは、銀行発行体の炭素排出量を焦点としています。銀行に対してネットゼロ・バンキング・アライアンスへの参加を促し、銀行事業に関わる他社の温室効果ガス排出量である「スコープ 3」排出データの質と可用性の改善を推奨しています。このような取り組みは、最終的にはポートフォリオに付随する気候変動リスクの算定の向上につながります。

H S B C アセットマネジメントの グローバル・リクイディティ部門統括最高投資責任者 (CIO) ジョナサン・カリーは「お客さまの責任投資への要望に応じるために、われわれは市場をリードするソリューションを提供していくことにコミットしています。H S B C アセットマネジメントの英ポンド建 ESG マネー・マーケット・ファンドは、キャッシュ運用を自らの組織全体のサステナビリティ目標に整合させるという投資家の考えに一致したものです」と述べました。

またさらに「H S B C アセットマネジメントの ESG マネー・マーケット・ファンド戦略に米ドル建ファンドを加えて戦略を拡大すれば、世界の幅広い投資家グループを顧客として迎えることが可能になり、それらの投資家も ESG リスク管理に優れた発行体に投資することができるようになります。最終的にはこうした投資の波及効果として、短期債券の発行体が ESG に係る行動を改善することが見込めます」と付け加えました。

H S B C アセットマネジメントは 10 通貨でリクイディティ戦略を提供しており、運用資産残高は約 1,460 億米ドルにのびります（2022 年 6 月末時点）。

注 1：2022 年 10 月時点。

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63の国と地域でお客さまにサービスを提供し、2兆9,850億米ドル（2022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。

H S B C アセットマネジメント

H S B C アセットマネジメント株式会社は、HSBC グループの資産運用部門として個人・事業法人・機関投資家に投資ソリューションを提供する、H S B C アセットマネジメントに属しています。H S B C アセットマネジメントは 24 の国と地域に拠点をもち、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。H S B C アセットマネジメント全体の運用資産は約 5,950 億米ドル（2022 年 6 月末現在）です。

<当資料のお取扱いにおけるご注意事項>

当資料は、H S B C アセットマネジメント株式会社（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。

当資料でご紹介する運用戦略は、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。

当戦略のご紹介においては、運用に係る具体的な手数料・費用等の金額および計算方法を予め示すことはできませんが、一般的には、以下のような手数料がかかります。

投資信託にて運用する場合：一般的には、購入時には購入時手数料、保有期間中は運用管理費用（信託報酬）と監査費用、換金時に換金手数料、信託財産留保額がかかります。監査費用は、信託財産の中から日々控除され、間接的に受益者（投資者）の負担となります。その他に有価証券売買時の売買委託手数料、外貨建資産の保管費用、信託財産における租税費用等が実費としてかかります。詳しくは「投資信託説明書（交付目論見書）」等をご覧ください。

投資一任契約や投資顧問契約の場合：個別契約毎に運用報酬や投資信託への投資に係る費用が発生します。詳しくは「契約締結前交付書面」をご覧ください。

H S B C 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 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