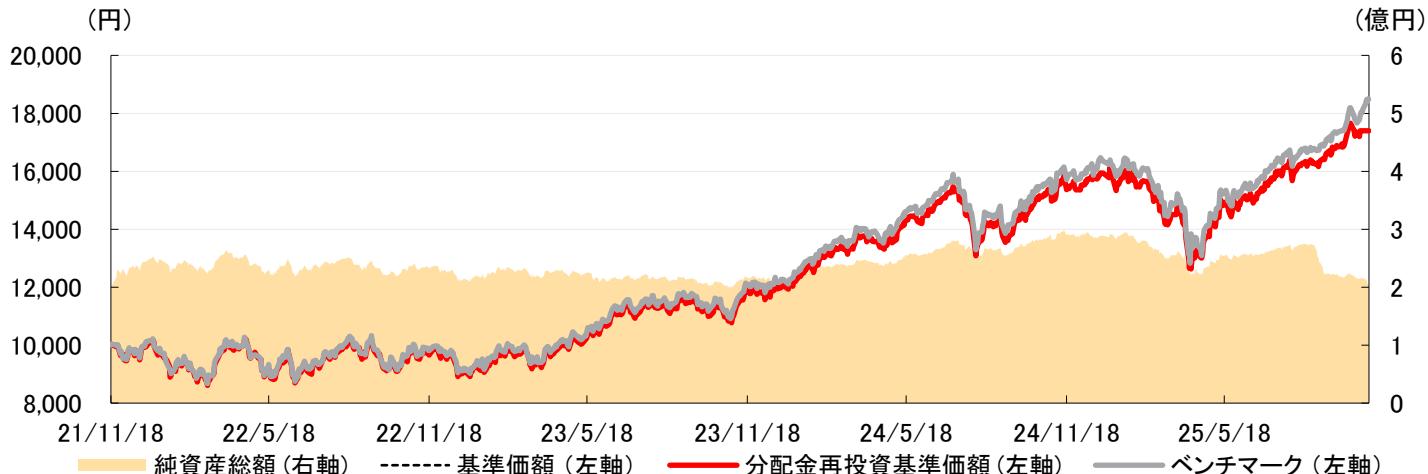


HSBC気候パリ協定準拠株式インデックスファンド

追加型投信／内外／株式／インデックス型

*当資料のデータおよびコメントにつきましては、特に記載がない限り作成基準日時点のものとなります。

基準価額と純資産総額の推移



* 基準価額は信託報酬(後掲の「当ファンドの費用」をご参照ください)控除後のものです。分配金再投資基準価額は税引前分配金を再投資したものです。将来の分配金は、運用状況によって変化します。ベンチマーク(MSCI World気候パリ協定準拠指數、円換算ベース)は、設定日を10,000として指数化しております。

商品概要(当資料発行日現在)

商品分類	追加型投信／内外／株式／インデックス型
設定日	2021年11月18日
信託期間	設定日から2025年11月14日まで
決算日	原則、11月18日/年1回決算
信託報酬	税込年0.3065%以内

基準価額等

1万口当たり基準価額(円)	17,394
設定来高値(2025年10月10日)	17,658
設定来安値(2022年3月9日)	8,609
純資産総額(億円)	2.0

* 基準価額は信託報酬控除後のものです。

税引前分配金の推移(1万口当たり)

決算期	分配金(円)
第1期(22年11月18日)	0
第2期(23年11月20日)	0
第3期(24年11月18日)	0
－	－
－	－
－	－
設定来累計	0

* 将来の分配金は運用状況によって変化します。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。

期間別騰落率(税引前)

	ファンド	ベンチマーク
1ヶ月	2.7%	6.2%
3ヶ月	7.1%	11.0%
6ヶ月	26.2%	30.9%
1年	12.9%	17.7%
3年	76.5%	84.3%
設定来	73.9%	84.9%

* 基準価額の騰落率は税引前分配金を再投資したものとして計算しています。

信託財産の構成



当ファンドは11月14日をもって繰上償還となります。
10月中は信託財産の現金化を進めました。
当ファンドの月次レポートは今回が最後となります。
これまでご愛顧いただきありがとうございました。

設定・運用:HSBCアセットマネジメント株式会社

当ファンドは2025年11月14日をもって繰上償還となります。当資料のお取扱いにつきましては、当資料内「留意点」をご参照ください。

HSBC気候パリ協定準拠株式インデックスファンド

追加型投信／内外／株式／インデックス型

当ファンドの特色

気候変動適応やその国際的な枠組み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す世界各国の企業の株式から構成される指数※に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

※以下「対象指数」または「ベンチマーク」といいます。

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。

パリ協定とは

国連気候変動枠組条約締約国会議(COP21)において採択され、2016年に発効した気候変動問題に関する国際的な枠組みです。世界全体の平均気温の上昇を産業革命前と比べ2°Cよりも十分低く保ちつつ、1.5°C以内に抑える努力を継続すること、そのためには、できるかぎり早く世界の温室効果ガス排出量をピークアウトし、21世紀後半には、温室効果ガス排出量と(森林などによる)吸収量のバランスをとるという世界共通の長期目標を掲げています。(出所:資源エネルギー庁)

「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。

- 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。
- 投資対象 ETF は「HSBC MSCI World Climate Paris Aligned UCITS ETF」とします。同ファンドは HSBC グループによって運営されている上場投資信託証券（ETF）です。パリ協定に沿ったサステナブル投資を重視し、特定の事業活動を行う企業を除外した、MSCI World気候パリ協定準拠指数に連動する投資成果を目指します。

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。

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。

<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小さかった場合も同様です。

当ファンドは円換算したMSCI World 気候パリ協定準拠指数に概ね連動することをめざして運用を行いますが、当ファンドの基準価額の騰落率と対象指数の騰落率は一致するものではありません。この要因は、実際にマザーファンドへの投資を通じて投資をする上場投資信託証券（ETF）の値動きが当該インデックスの値動きと一致するものではないことのほかに、信用リスクの顕在化等が起こると ETF が当該インデックスの騰落率に概ね連動しなくなる可能性があること、資金流出入と実際に ETF を売買するタイミングのずれ、ETF を日本時間で円換算することによる為替評価タイミングのずれ、ETF の売買・評価価格と当該インデックスとのずれ、売買コスト・信託報酬・監査報酬等の費用を当ファンドで負担すること等によるものです。また、当ファンドの投資効果が対象指数と連動することを保証するものではありません。

設定・運用:HSBCアセットマネジメント株式会社

当ファンドは2025年11月14日をもって繰上償還となります。当資料のお取扱いにつきましては、当資料内「留意点」をご参照ください。

HSBC気候パリ協定準拠株式インデックスファンド

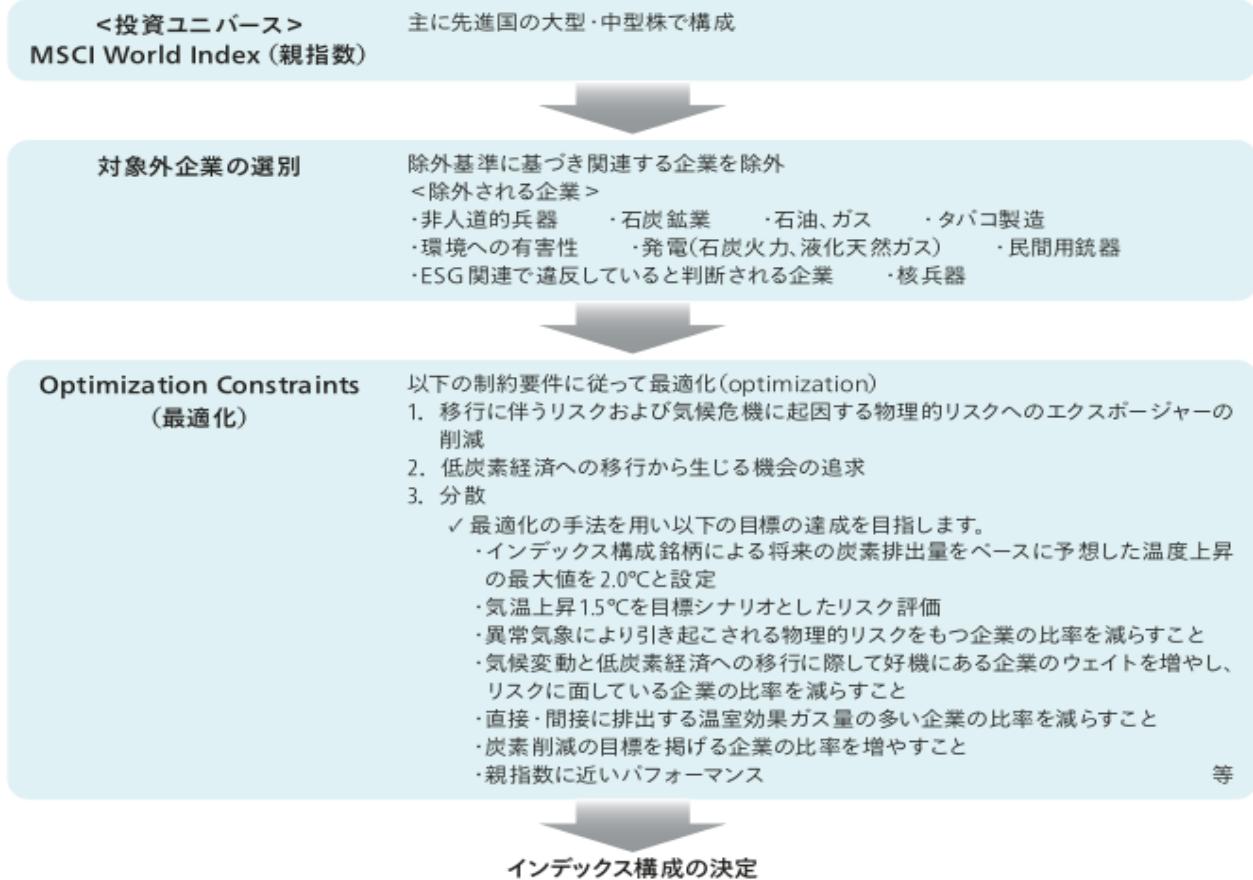
追加型投信／内外／株式／インデックス型

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、TCFD（気候関連財務情報開示タスクフォース）提言を取り入れ、EUが定める気候ベンチマークの基準（PAB基準*）よりも厳しく気候変動のリスクと機会に対応するように設計されています。

* 欧州で合意されたパリ協定に基づく気候原則に沿って、最低限の排出削減基準を設定し、サステナブル投資を促すために制定されたインデックスの算出基準。

- MSCI World 気候パリ協定準拠指数がベンチマークとして選定された理由
 - ・気候変動に関連したリスクを減らす厳しい基準を適用する一方、低炭素経済への移行から生じる投資機会の追及についても考慮していること。
 - ・当指数に関するメソドロジーがMSCI社から公表され、定量的な気候関連分析手法を用いた透明性の高い指数であること。
- MSCI World 気候パリ協定準拠指数の構築プロセス



- ・ESGスコアに関して第三者である情報提供会社のデータを用いていますが、提供されるESGデータが必ずしも信頼性、一貫性を保っているとは限らず、ファンドのサステナビリティリスクを適切に評価することに支障をきたし、環境[E]・社会[S]の特性を促進できない場合があります。

- ・気候変動対応への枠組みの変更に伴い、パリ協定が気候変動適応として最適ではなくなる場合があります。また、それに伴い当ファンドのベンチマークが変更される場合があります。

※MSCI社の資料を基にHSBCアセットマネジメント株式会社が作成。なお、上記は本書作成時現在知りうる情報であり、今後変更される可能性があります。

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。

設定・運用:HSBCアセットマネジメント株式会社

当ファンドは2025年11月14日をもって繰上償還となります。当資料のお取扱いにつきましては、当資料内「留意点」をご参照ください。

HSBC気候パリ協定準拠株式インデックスファンド

追加型投信／内外／株式／インデックス型

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。

当ファンドは、特定の有価証券等への投資にかかるリスクを伴いますが、複数銘柄に分散する場合に比べ、分散投資効果が得られないことから、特定の有価証券等が受けるリスクの影響をほぼ直接に受けます。

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や税制の変更、新たな規制が設けられた場合には、基準価額が影響を受けることや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。

【留意点】

- 当資料は委託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。
- 投資信託はリスクを含む商品であり、主に値動きのある有価証券（外国証券には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は組入有価証券の値動き、為替変動による影響を受けます。したがいまして、元本が保証されるものではありません。投資信託の運用成果（損益）はすべて投資者の皆さまに帰属します。
- 投資信託は預金保険・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。
- 購入のお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。

委託会社、その他関係法人

委託会社：HSBCアセットマネジメント株式会社

＜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)ホームページ  www.assetmanagement.hsbc.co.jp

受託会社：株式会社SMB信託銀行

販売会社：委託会社の＜照会先＞でご確認いただけます。

※ 販売会社固有情報（金融商品取引業者（登録番号）、加入協会等）については、当資料内「販売会社一覧」をご覧ください。

設定・運用：HSBCアセットマネジメント株式会社

当ファンドは2025年11月14日をもって繰上償還となります。当資料のお取扱いにつきましては、当資料内「留意点」をご参照ください。

HSBC気候パリ協定準拠株式インデックスファンド

追加型投信／内外／株式／インデックス型

お申込みに関する要項

お申込みメモ

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	購入申込受付日の翌営業日の基準価額
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。
換金制限	信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口換金には制限を設ける場合があります。
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	2021年11月18日（信託設定日）から2025年11月14日（償還日）まで
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18日（休業日の場合は翌営業日）
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扱われます。 公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。 当ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、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。 益金不算入制度、配当控除の適用はありません。
その他の	基準価額（1万口当たり）は、翌日の日本経済新聞朝刊に「気候パリ株i」の略称で掲載されます。 委託会社の判断により購入申込の受付を中止した場合等において、販売会社が定める定時定額による受付を継続することがあります。

設定・運用:HSBCアセットマネジメント株式会社

当ファンドは2025年11月14日をもって繰上償還となります。当資料のお取扱いにつきましては、当資料内「留意点」をご参照ください。

HSBC気候パリ協定準拠株式インデックスファンド

追加型投信／内外／株式／インデックス型

当ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用	
購入時手数料	購入金額に、 <u>3.30%（税抜3.00%）</u> 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を購入時にご負担いただきます。 詳しくは販売会社にお問い合わせください。 (購入時手数料は、商品内容の説明ならびに購入手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。)
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)	<u>年0.1265% (税抜年0.115%)</u> ファンドの日々の純資産総額に対して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) 投資対象とする 投資信託証券	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乗じて得た額
実質的な負担	<u>年0.3065%（税抜年0.295%）</u> 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%（税込）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。

設定・運用:HSBC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

当ファンドは2025年11月14日をもって繰上償還となります。当資料のお取扱いにつきましては、当資料内「留意点」をご参照ください。

月次レポート

HSBC気候パリ協定準拠株式インデックスファンド

追加型投信／内外／株式／インデックス型

販売会社一覧

(商号・金融商品取引業者の登録番号・加入協会の順に表示、証券・銀行・保険毎 五十音順、2025年11月7日現在)

設定・運用:HSBCアセットマネジメント株式会社

当ファンドは2025年11月14日をもって繰上償還となります。当資料のお取扱いにつきましては、当資料内「留意点」をご参照ください。