

OneグローバルESG厳選株ファンド＜DC年金＞

一般社団法人投資信託協会分類：追加型投信／内外／株式

本商品は元本確保型の商品ではありません

1.投資方針

1.基本方針

信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。

2.投資態度

①主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場する株式(上場予定を含みます。)*※1※2に実質的に投資を行い、長期的な値上り益の獲得をめざして運用を行います。

・日本を含む世界の株式への投資は、OneグローバルESG厳選株マザーファンドを通じて行います。マザーファンドの組入比率は、原則として高位を維持します。また、株式の実質組入比率は、原則として高位を維持します。

・実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

※1 DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。

※2 株式のほかに、日本を含む世界の不動産投資信託(REIT)にも実質的に投資する場合があります。

②投資ユニバース構築にあたっては、企業のESG(*)への取り組み、財務面での安定性等について定量・定性の両面からスクリーニングを行います。銘柄選定にあたっては、中長期的な成長期待を背景に良好なリターンが見込める銘柄を、株価面での割安性および市場環境を勘案しつつ、厳選して投資を行います。

・企業のESGへの取り組み、キャッシュフロー創出力の高さ、収益性、財務面での安定性等について定量・定性の両面からスクリーニングし、組入候補銘柄群を選定します。

・当ファンドは、組入銘柄のうちESGを主要な要素として選定する銘柄の組入比率を合計100%とすることを目標としています。

・組入候補銘柄群の中から、中長期的な成長期待を背景に良好なリターンが見込める銘柄を、適切な株価バリュエーションおよび市場環境を勘案して、厳選して投資を行います。

(*)「ESG」とは、環境(Environment)、社会(Social)、企業統治(Governance)の略称です。

(参考)「OneグローバルESG厳選株マザーファンド」の投資方針

1.基本方針

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。

2.投資態度

①主として、日本を含む世界の株式に投資します。また、日本を含む世界の不動産投資信託(REIT)にも投資する場合があります。

②企業のESG(*)への取り組み、キャッシュフロー創出力の高さ、収益性、財務面での安定性等について定量・定性の両面からスクリーニングし、組入候補銘柄群を選定します。

(*)「ESG」とは、環境(Environment)、社会(Social)、企業統治(Governance)の略称です。

③ポートフォリオの構築にあたっては、組入候補銘柄群の中から、中長期的な成長期待を背景に良好なリターンが見込める銘柄を、株価面での割安性および市場環境を勘案しつつ、厳選して投資を行います。

④株式の組入比率は、原則として高位を維持します。

⑤組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

2.主要投資対象

OneグローバルESG厳選株マザーファンド

(マザーファンドは、日本を含む世界の金融商品取引所に上場する株式(上場予定を含みます。)(*)を主要投資対象とします。

(*)DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。

3.主な投資制限

- ・マザーファンドへの投資割合には、制限を設けません。
- ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ・マザーファンド以外の投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)*への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ・デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。
- ・1発行体等あたりの株式等、債券等およびデリバティブ等の信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とします。

4.ベンチマーク

特定しておりません。

5.信託設定日

2020/6/5

6.信託期間

無期限

7.償還条項

次のいずれかに該当する場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し、当該信託を終了(繰上償還)することがあります。

- ・信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合
- ・純資産総額が30億円を下回ることとなった場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

8.決算日

毎年6月5日(休業日の場合は翌営業日)

9.信託報酬

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.353%(税抜1.23%)

内訳(税抜)

委託会社:年率 0.70%

販売会社:年率 0.50%

受託会社:年率 0.03%

※委託会社の信託報酬には、OneグローバルESG厳選株マザーファンドの投資顧問会社(アセットマネジメントOne U. S. A. ・インク)に対する報酬(当ファンドの信託財産に属する当該マザーファンドの組入評価額平均に対して年率0.226%を乗じて得た額)が含まれます。

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。■「OneグローバルESG厳選株ファンド＜DC年金＞」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。■当資料は、確定拠出年金法第24条および関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。■投資信託は、債券、株式、不動産投資信託証券(リート)など値動きのある有価証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。))に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元本および運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、投資信託をご購入のお客様に帰属します。

OneグローバルESG厳選株ファンド＜DC年金＞

一般社団法人投資信託協会分類：追加型投信／内外／株式

本商品は元本確保型の商品ではありません

10.信託報酬以外のコスト

その他の費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。

- ・組入有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料
- ・信託事務の処理に要する諸費用
- ・外国での資産の保管等に要する費用
- ・監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 等

監査費用は毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のとき、その他の費用等はその都度ファンドから支払われます。

※これらの費用等は、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。

※上場不動産投資信託(REIT)は市場の需給により価格形成されるため、上場不動産投資信託(REIT)の費用は表示しておりません。

11.お申込単位

1円以上1円単位

12.お申込価額

購入申込受付日の翌営業日の基準価額

13.お申込手数料

ありません。

14.ご解約価額

換金申込受付日の翌営業日の基準価額

15.信託財産留保額

ありません。

16.収益分配

毎決算日に、収益分配方針に基づいて収益分配を行います。

※収益分配金は自動的に全額再投資されます。

17.申込不可日

以下のいずれかに該当する日には、購入・換金のお申込みの受付を行いません。

- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
- ・ロンドン証券取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日
- ・ロンドンの銀行の休業日

金融商品取引所等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、購入・換金のお申込みの受付を中止することおよびすでに受けた購入・換金のお申込みの受付を取り消す場合があります。

また、確定拠出年金制度上、購入・換金のお申込みができない場合がありますので運営管理機関にお問い合わせください。

18.課税関係

確定拠出年金の加入者におかれましては、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

19.損失の可能性

当ファンドは、値動きのある有価証券等(外貨建資産には為替変動リスクもあります。)に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

20.セーフティネットの有無

投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

21.持分の計算

解約価額×保有口数

注：解約価額が10,000口あたりで表示されている場合は10,000で除して下さい。

22.委託会社

アセットマネジメントOne株式会社
(ファンドの運用の指図を行う者)

23.受託会社

みずほ信託銀行株式会社
(ファンドの財産の保管および管理を行う者)

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。■「OneグローバルESG厳選株ファンド＜DC年金＞」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。■当資料は、確定拠出年金法第24条および関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。■投資信託は、債券、株式、不動産投資信託証券(リート)など値動きのある有価証券等(外貨建資産に投資する場合)には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元本および運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、投資信託をご購入のお客様に帰属します。

OneグローバルESG厳選株ファンド＜DC年金＞

一般社団法人投資信託協会分類：追加型投信／内外／株式

本商品は元本確保型の商品ではありません

24.基準価額の主な変動要因

1. 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。株式の価格は、国内外の政治・経済・社会情勢の変化、発行企業の業績・経営状況の変化、市場の需給関係等の影響を受け変動します。株式市場や当ファンドが実質的に投資する企業の株価が下落した場合には、その影響を受け、基準価額が下落する要因となります。また、当ファンドは実質的に企業のESGへの取組みを考慮した投資を行うことから、投資対象が株式市場全体と比べて特定の銘柄や業種に偏ることがあり、このため基準価額の変動が株式市場全体の動向から乖離することや、株式市場が上昇する場合でも基準価額が下落する場合があります。

2. 為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には、実質保有外貨建資産が現地通貨ベースで値上がりした場合でも基準価額が下落する可能性があります。

3. 信用リスク

投資する有価証券の発行者の財政難・経営不安・倒産等の発生は、基準価額の下落要因となります。有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。当ファンドが実質的に投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合、信用格付けが格下げされた場合等には、株式の価格が下落したり、その価値がなくなることがあり、基準価額が下落する要因となります。

4. 流動性リスク

投資資産の市場規模が小さいことなどで希望する価格で売買できない場合は、基準価額の下落要因となります。有価証券等を売却または取得する際に市場規模や取引量、取引規制等により、その取引価格に影響を受ける場合があります。一般に市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす要因となります。

5. カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制、また取引規制等の要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。海外に投資する場合には、これらの影響を受け、基準価額が下落する要因となります。当ファンドは実質的に新興国の株式にも投資を行う場合があります。新興国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化等が株式市場や為替市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制や課徴的な税制、海外への送金規制等の種々な規制の導入や政策の変更等の要因も株式市場や為替市場に著しい影響をおよぼす可能性があります。

6. ESG情報・評価に関連する制約

ESG情報や評価の入手・収集の制約は、運用に影響を及ぼす要因となる場合があります。当ファンドで勘案するESG情報は、委託会社が独自調査で入手した情報だけでなく、第三者のESG情報ベンダーによる情報や評価が含まれている場合があります。これらのESG情報は、企業開示や企業アンケート、取材等により入手・収集されますが、ESG情報ベンダーからの提供情報は、当該情報ベンダーの情報収集力により情報量が制限されることがあります。また、企業によって開示された情報やメディアによって報道される情報は、タイムリーに評価結果に反映されないことがあります。また、委託会社および情報ベンダーによる評価基準の変更により、過去からの情報継続性が失われることがあります。

<その他の留意点>

○当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

○当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

○有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。

○当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。

○当ファンドの収益分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により、分配を行わないことがあります。

○資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしがたった運用ができない場合があります。

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。■「OneグローバルESG厳選株ファンド＜DC年金＞」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。■当資料は、確定拠出年金法第24条および関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。■投資信託は、債券、株式、不動産投資信託証券（リート）など値動きのある有価証券等（外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元本および運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、投資信託をご購入のお客様に帰属します。