



NISSAY
ASSET MANAGEMENT

News Release

ニッセイアセットマネジメント株式会社

2020年9月29日

ESG・SDGs関連ファンドの設定について

ニッセイ日本株ESGフォーカスファンド（適格機関投資家限定）

ニッセイSDGs北米クレジットファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）

ニッセイアセットマネジメント株式会社（社長：大関 洋、以下：ニッセイアセットマネジメント）は、追加型の株式投資信託「ニッセイ日本株ESGフォーカスファンド（適格機関投資家限定）」（2020年7月28日）と「ニッセイSDGs北米クレジットファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）」（2020年9月9日）の設定・運用開始をいたしました。

- 「ニッセイ日本株ESGフォーカスファンド（適格機関投資家限定）」は、独自の徹底した調査・分析に基づき、ESGに対する取組みに優れ、持続的な企業価値の向上が期待される銘柄を厳選したポートフォリオから中長期的に高い超過収益率の獲得を目指します。
- 「ニッセイSDGs北米クレジットファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）」は、日本生命グループの米国資産運用会社（Nippon Life Global Investors Americas, Inc.）とニッセイアセットマネジメントが連携し、ESG評価のノウハウを活用しつつSDGsの観点で評価が高い企業の社債を厳選することによって、長期・安定的な収益機会を獲得するとともに、SDGs達成に貢献するものです。

また、他にも様々なESG・SDGs関連の運用戦略を取り揃えております。

- ・（国内株式）ESGジャパンセレクト
- ・（外国株式）グローバルESGフォーカス
- ・（外国株式）SDGsグローバルセレクト
- ・（外国債券）SDGs欧州クレジット

系統金融機関・生命保険会社等の長期運用の投資家様をはじめ、社会的責任投資を志向する多くの金融機関様にご活用いただけます。

ニッセイアセットマネジメントは、「企業価値の向上」、「持続可能な社会の実現」、「資本市場の健全な発展」に向けて責任ある投資家としての社会的使命を全うするため、10年以上にわたり、ESGに関する取組みを行ってまいりました。ESGは企業のあらゆる活動に関わってくるという考えから、ESG分析を企業価値評価に反映させる独自のノウハウを築き上げており、各種運用戦略に活用しています。

今後も、蓄積された経験・ノウハウを活かし、お客様の資産形成と持続的な社会の構築・発展のためにこれからも全力で取り組んでまいります。

商品名	ニッセイ日本株ESGフォーカスファンド（適格機関投資家限定）
設定日	2020年7月28日（火）

当ファンドの特色

- ① **独自のESG評価に基づいた銘柄ユニバース**
 - 社内アナリストによる独自のESG評価での高評価銘柄をユニバースとするESG特化型戦略
 - 当戦略では、ESG総合レーティングに加え、「S（社会）」と「G（ガバナンス）」の評価も重視
 - ニッセイアセットマネジメントのESG高評価銘柄は長期的に良好なパフォーマンスを達成
- ② **ESG評価を活用し確信度を高めた企業価値評価**
 - ESG高評価銘柄の中から、自社アナリストの長期業績予測に基づき、中長期の視点でのCFROI®(注)（投下資本収益率）の改善、投下資本の拡大が期待される銘柄を投資対象とします
 - 更に、ポートフォリオマネジャー独自銘柄として新規投資対象となる銘柄の発掘にも注力
- ③ **集中したポートフォリオから中長期的に高い超過収益率の獲得を目指します**
 - 30～40銘柄で構成される集中したポートフォリオから中長期的に高い超過収益率の獲得を目指します
 - 銘柄への確信度と時価総額を加味したポートフォリオ構築
 - 明確で一貫した基準に基づいた売買執行
- ④ **年2回決算を行い、分配金をお支払いすることを目指します**
 - 毎年5月、11月の各25日（ただし、休日の場合は翌営業日）に決算を行います
 - 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して決定します
ただし、委託会社の判断により、分配を行わないことがあります

(注) CFROIはクレディ・スイスグループの登録商標です

! 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。

商品名	ニッセイSDGs北米クレジットファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）
設定日	2020年9月9日（水）

当ファンドの特色

- ① **持続的な成長が見込まれるSDGs関連銘柄に投資します**
 - SDGsの達成に向け、2030年までに年間12兆米ドルの新たな市場が生まれると予想されています
※ダボス会議で発足した「ビジネス&持続可能開発委員会」が、SDGsの達成に向け成長が期待される60の市場を特定、それぞれの市場規模の拡大幅を予測・合算して算出
 - 金融市場では債券発行体である企業や債券投資家においても企業の持続可能性評価のフレームワークとしてSDGsを活用した取組みを推進することが見込まれます
- ② **投資可能年限が最長15年までのラダー型運用を行います**
- ③ **原則として為替ヘッジ取引を行い、対円での為替変動リスクの低減を図ることを基本とします**
- ④ **年2回決算を行い、分配金をお支払いすることを目指します**
 - 毎年5月、11月の各25日（ただし、休日の場合は翌営業日）に決算を行います
 - 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して決定します
ただし、委託会社の判断により、分配を行わないことがあります

! 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。

■商品概要（ニッセイ日本株ESGフォーカスファンド（適格機関投資家限定））

商品分類	追加型株式投資信託／国内株式型（一般型）（追加型投信／国内／株式）
ファンド名	ニッセイ日本株ESGフォーカスファンド（適格機関投資家限定）
設定日	2020年7月28日（火）
信託期間	約10年（2020年7月28日（火）～2030年11月25日（月））
償還条項	受益権の残存口数が10億口を下回っている場合、信託期間の途中で信託を終了させることがあります。
信託金限度額	1,000億円
主要投資対象	ニッセイ日本株ESGフォーカスマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。 なお直接、株式等に投資を行う場合があります。
収益分配時期および分配方法	決算日：年2回（5月25日及び11月25日。ただし、休日の場合は翌営業日。） 初回決算日：2021年5月25日（火） ①分配対象額の範囲 経費控除後の配当等収益（ニッセイ日本株ESGフォーカスマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）および売買益（評価益を含みます。ただし、ニッセイ日本株ESGフォーカスマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を除きます。）等の全額とします。 ②分配対象額についての分配方針 委託者が基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して決定します。ただし、委託者の判断により、分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用方針 留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し年率0.6930%（税抜：0.630%）の率を乗じた金額。 ・委託会社：0.6600%（税抜：0.600%） ・取扱販売会社：0.0011%（税抜：0.001%） ・受託会社：0.0319%（税抜：0.029%）
ファンド監査	①監査機関：有限責任監査法人トーマツ ②監査費用：信託財産の純資産総額に対し、毎日下記の料率（税抜）を乗じた金額 1000億円超の部分：年率0.00110%（税抜0.0010%） 500億円超1000億円以下の部分：年率0.00165%（税抜0.0015%） 100億円超500億円以下の部分：年率0.00220%（税抜0.0020%） 50億円超100億円以下の部分：年率0.00330%（税抜0.0030%） 10億円超50億円以下の部分：年率0.00550%（税抜0.0050%） 10億円以下の部分：年率0.01100%（税抜0.0100%） ③費用負担：信託財産より支弁
追加設定	毎営業日可能。午後3：00までに取扱販売会社の手続きが完了したものを当日受け分とします。
販売単位	販売会社自由設定
販売価額	当初申込期間：1口当たり1円 継続申込期間：取得申込受付日の基準価額
一部解約	毎営業日可能。午後3：00までに取扱販売会社の手続きが完了したものを当日受け分とします。
解約単位	1口単位
解約価額	解約請求受付日の基準価額
信託財産留保額	なし
解約受渡日	原則として解約請求受付日から起算して5営業日目

❶ 信託報酬をはじめとする受益者が負担する手数料等の合計額、その上限額および計算方法は、運用状況および受益者の保有期間等により異なるため、事前に記載することはできません。

■商品概要（ニッセイSDGs北米クレジットファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定））

商品分類	追加型株式投資信託／バランス型（追加型投信／海外／債券）
ファンド名	ニッセイSDGs北米クレジットファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）
設定日	2020年9月9日（水）
信託期間	約10年（2020年9月9日（水）～2030年11月25日（月））
償還条項	受益権の口数が10億口を下回っている場合、信託期間の途中で信託を終了させることがあります。
信託金限度額	5,000億円
主要投資対象	ニッセイSDGs北米クレジット マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 なお直接、公社債等に投資を行う場合があります。
収益分配時期 および分配方法	決算日：年2回（5月、11月の各25日。ただし、休日の場合は翌営業日。） 初回決算日：2021年5月25日（火） ①分配対象額の範囲 経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）および売買益（評価益を含みます。ただし、マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を除きます。）等の全額とします。 ②分配対象額についての分配方針 委託者が基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して決定します。ただし、委託者の判断により、分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用方針 留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し年率0.286%（税抜0.260%）の率を乗じた金額とします。 ・委託会社：0.2640%（税抜0.240%） ・販売会社：0.0011%（税抜0.001%） ・受託会社：0.0209%（税抜0.019%）
ファンド監査	①監査機関：有限責任監査法人トーマツ ②監査費用：信託財産の純資産総額に対し、毎日下記の料率を乗じた金額 2,000億円超 の部分：年率0.0011%（税抜0.001%） 1,000億円超2,000億円以下 の部分：年率0.0022%（税抜0.002%） 500億円超1,000億円以下 の部分：年率0.0033%（税抜0.003%） 100億円超500億円以下 の部分：年率0.0044%（税抜0.004%） 50億円超100億円以下 の部分：年率0.0055%（税抜0.005%） 10億円超50億円以下 の部分：年率0.0077%（税抜0.007%） 10億円以下 の部分：年率0.0110%（税抜0.010%） ③費用負担：信託財産より支弁
追加設定	毎営業日可能。午後3:00までに取扱販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。ただし、申込日がニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、取得申込みの受付を行いません。
販売単位	販売会社自由設定
販売価額	当初申込期間：1口当たり1円 継続申込期間：取得申込受付日の翌営業日の基準価額
一部解約	毎営業日可能。午後3:00までに取扱販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。ただし、請求日がニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、解約請求の受付を行いません。
解約単位	1口単位
解約価額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した価額
信託財産留保額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.05%の率を乗じて得た額
解約受渡日	原則として解約請求受付日から起算して5営業日目

■ファンドが有するリスク

「ニッセイ日本株ESGフォーカスファンド（適格機関投資家限定）」は値動きのある有価証券等に投資しますので、有価証券の値動きにより、ファンドの基準価額が下落し、損失を被ることがあります。「ニッセイSDGs北米クレジットファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）」は国外の社債を投資対象としますので、金利変動等による組入社債の価格の下落、組入社債の発行体の倒産や財務状況の悪化等の影響により、ファンドの基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、これらに加え、為替の変動により損失を被ることがあります。

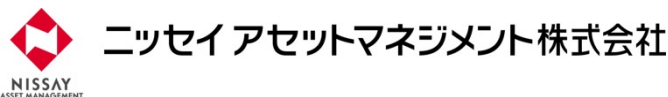
●主な変動要因

- 国内株式は、国内およびグローバルな景気・経済動向、社会情勢の変化、産業動向、発行企業の実績並びに予想ベースでの業績、投資家による企業評価、さらにそれらを踏まえた投資行動等によって価格が下落し、この結果、損失を被り、投資元本を割り込むおそれがあります。（価格変動リスク）
- 国内株式は、市場での株式流動性が売買量に比べて著しく低い場合や、発行企業の経営・財務状況の悪化やその見通しを背景に市場需給が著しく偏った場合、換金できないリスクがあるほか、換金できた場合でも直前の価格に比べて不利な価格で売買せざるを得ないことがあります。後者についてはその結果、損失を被り、投資元本を割り込むおそれがあります。（流動性リスク）
- 金利は景気や経済の状況等の影響を受けて変化し、それに伴い債券価格も変動します。金利が上昇する環境下では、一般に、組入れを行っている債券の価格は下落し、この結果、損失を被り、投資元本を割り込むおそれがあります。（金利リスク）
- 為替レートは、国内およびグローバルな景気・経済動向、社会情勢の変化、市場参加者の投資行動による需給の変化等を受けて変動します。為替相場の変動等により損失を被り、投資元本を割り込むおそれがあります。（為替リスク）
- 債券の発行体の財務状況や資金繰りが悪化し、債券の利息や償還金をあらかじめ定められた条件で支払うことができなくなる（債務不履行）場合、もしくは債務不履行に陥ると予想される場合には当該債券の価格が下落し、この結果、損失を被り、投資元本を割り込むおそれがあります。（信用リスク）
- 組入れた債券について、市場における流動性が低い時には、換金が困難な状況に陥るか、換金できた場合でも、直前の市場価格より不利な価格で売買せざるを得ないことがあります。後者についてはその結果、損失を被り、投資元本を割り込むおそれがあります。（債券の流動性リスク）
- 債券の発行体が満期前償還の権利を行使する場合に、当初予定されていた運用収益が得られない可能性が生じ、この結果、損失を被り、投資元本を割り込むおそれがあります。（期限前償還リスク）
- 原則として対円での為替リスクはヘッジを行い、為替リスクの低減を図りますが、為替リスクのヘッジを行うに当たりヘッジコストがかかります。なお、ヘッジコストとは、為替ヘッジを行う通貨の金利と円金利との差で、この金利差分収益が低下または上昇します。（為替ヘッジコスト上昇に関するリスク）
- 投資対象国の政治・経済情勢、外国為替規制、および資本規制等による影響を受け、損失を被り、投資元本を割り込むおそれがあります。（カントリーリスク）

■ご留意いただきたい事項

- その他のESG・SDGs関連の運用戦略については、情報提供を目的として掲載しており、投資家に対する投資勧誘を目的とするものではありません。具体的な商品を勧誘するものではないので、手数料や報酬等の種類ごとの金額及びその合計額については、表示することができません。リスク及び手数料等は商品説明資料でご確認ください。
- 当プレスリリースは投資の判断を行って頂く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、運用実績は市場環境等により変動し、運用成果（損益）はすべて投資者の皆様のものとなります。投資元本および利回りが保証された商品ではありません。ご購入に際しては、ご自身でご判断ください。
- 投資信託は保険契約や金融機関の預金ではなく、保険契約者保護機構、預金保険の対象とはなりません。証券会社以外の金融機関で購入された投資信託は、投資者保護基金の支払対象にはなりません。

設定・運用は



金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第369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

審査確認番号：2020-法企273