

## Press Release

各位

三菱UFJ国際投信株式会社  
 東京都千代田区有楽町一丁目12番1号  
 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第404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

## 『三菱UFJ DC世界ESGバランスファンド 〈愛称:ソーシャル・インパクト〉』の設定について

この度、三菱UFJ国際投信株式会社(取締役社長 <sup>まつだ とおる</sup> 松田 通)は『三菱UFJ DC世界ESGバランスファンド〈愛称:ソーシャル・インパクト〉』を2021年3月25日(木)に設定、運用を開始いたしますので、ファンドの特色等についてお知らせいたします。

当ファンドは、「国内株式」25%、「世界株式(国内株式を含む。)」25%、「世界債券(国内債券を含む。)」50%を基本投資割合とし、Environment(環境)、Social(社会)、Governance(ガバナンス)を投資の視点に組み込んで運用を行います。

- ・『三菱UFJ DC世界ESGバランスファンド〈愛称:ソーシャル・インパクト〉』の有価証券届出書を2021年3月9日(火)に関東財務局長に提出しておりますが、届出の効力は生じておりません。したがって、当該届出の効力が発生するまでに、当資料の記載内容が訂正される場合があります。
- ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

商品分類			属性区分				
単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産(収益の源泉)	投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
追加型	内外	資産複合	その他資産	年1回	グローバル(日本を含む)	ファンド・オブ・ファンズ	あり(部分ヘッジ)

※属性区分の「投資対象資産」に記載されている「その他資産」とは、投資信託証券(資産複合(株式、債券))です。

※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

※商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

- 委託会社(ファンドの運用の指図等)
- 受託会社(ファンドの財産の保管・管理等)
- 販売会社(購入・換金の取扱い等)

三菱UFJ国際投信株式会社  
 三菱UFJ信託銀行株式会社  
 (再信託:日本マスタートラスト信託銀行株式会社)  
 弊社コールセンターまでお問い合わせください。  
 (お問い合わせ先:0120-151034) 受付時間/9:00~17:00(土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)  
 ※確定拠出年金制度を利用する場合の購入のお申込みに限ります。

## ファンドの目的

日本を含む世界各国(新興国を含みます。以下同じ。)の株式等および公社債を実質的な主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。

## ファンドの特色

特色1

ESGに着目した運用手法を用いる投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式等(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)および公社債に投資を行います。

- ESGとは、環境(Environment)、社会(Social)、ガバナンス(Governance)の頭文字を取ったものです。
- DR(預託証券)とは、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。

特色2

原則として、「国内株式」、「世界株式(国内株式を含む。)\*」、「世界債券(国内債券を含む。)\*」の区分ごとに投資信託証券を組入れます。

※以下、それぞれ「世界株式」、「世界債券」といいます。

- 「国内株式」25%、「世界株式」25%、「世界債券」50%を基本投資割合とします。  
※経済環境の大きな変化などが生じ、必要と判断した場合には、当該基本投資割合を見直します。
- 投資信託証券の組入比率は高位に維持することを基本とします。

<各資産区分の基本投資割合および投資対象とする投資信託証券>

資産区分	基本投資割合	投資対象とする投資信託証券
国内株式	25%	日本株ESGアクティブマザーファンド
世界株式	25%	ベイリー・ギフォード・ワールドワイド・ポジティブ・チェンジ・ファンドークラスC・JPY・アキュムレーション(円建)
世界債券	50%	ヘッジ付気候リスク調整世界国債インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家限定)

\*2021年3月25日時点の投資対象であり、投資する投資信託証券は今後変更する場合があります。

- ☞ 委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<https://www.am.mufig.jp/corp/operation/fm.html>)でご覧いただけます。

特色3

「世界債券」の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為替変動リスクの低減をはかります。その他の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。

- 「世界債券」の運用目的達成のために、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げることがあります。

為替ヘッジの活用

為替予約取引を活用し為替ヘッジを行うことにより、為替ヘッジをしなかった場合と比較して安定した値動きが期待されます。ただし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。

なお、為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨の金利より低いときには、これらの金利差相当分のヘッジコストがかかります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

- 「世界株式」の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ので、為替相場の変動による影響を受けます。

特色4

年1回の決算時(6月25日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

- 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

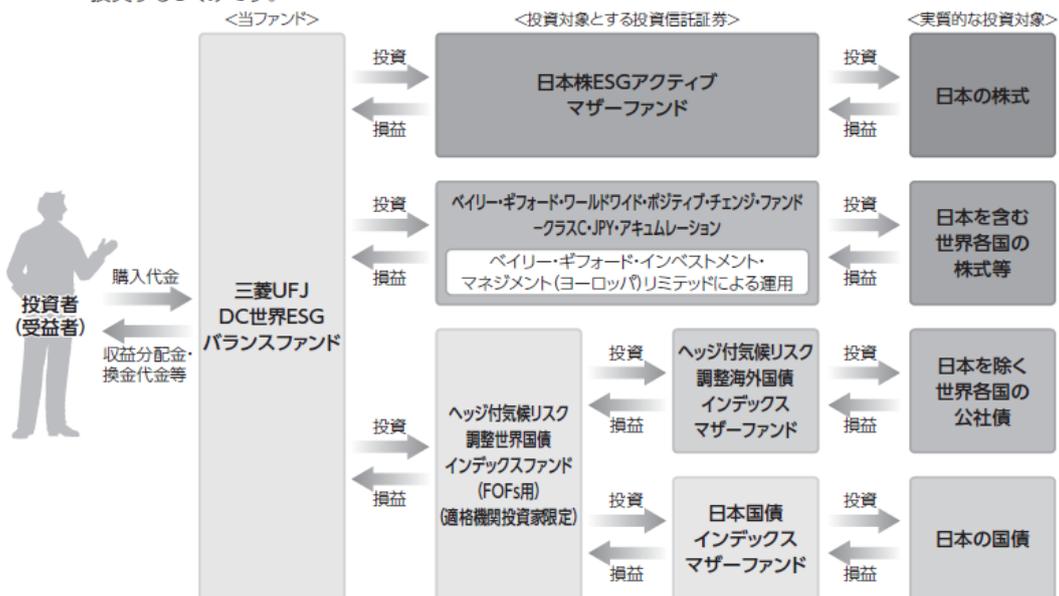
分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

将来の分配金の支払いおよび金額について保証するものではありません。  
(初回決算日は、2021年6月25日です。)

■ファンドの仕組み

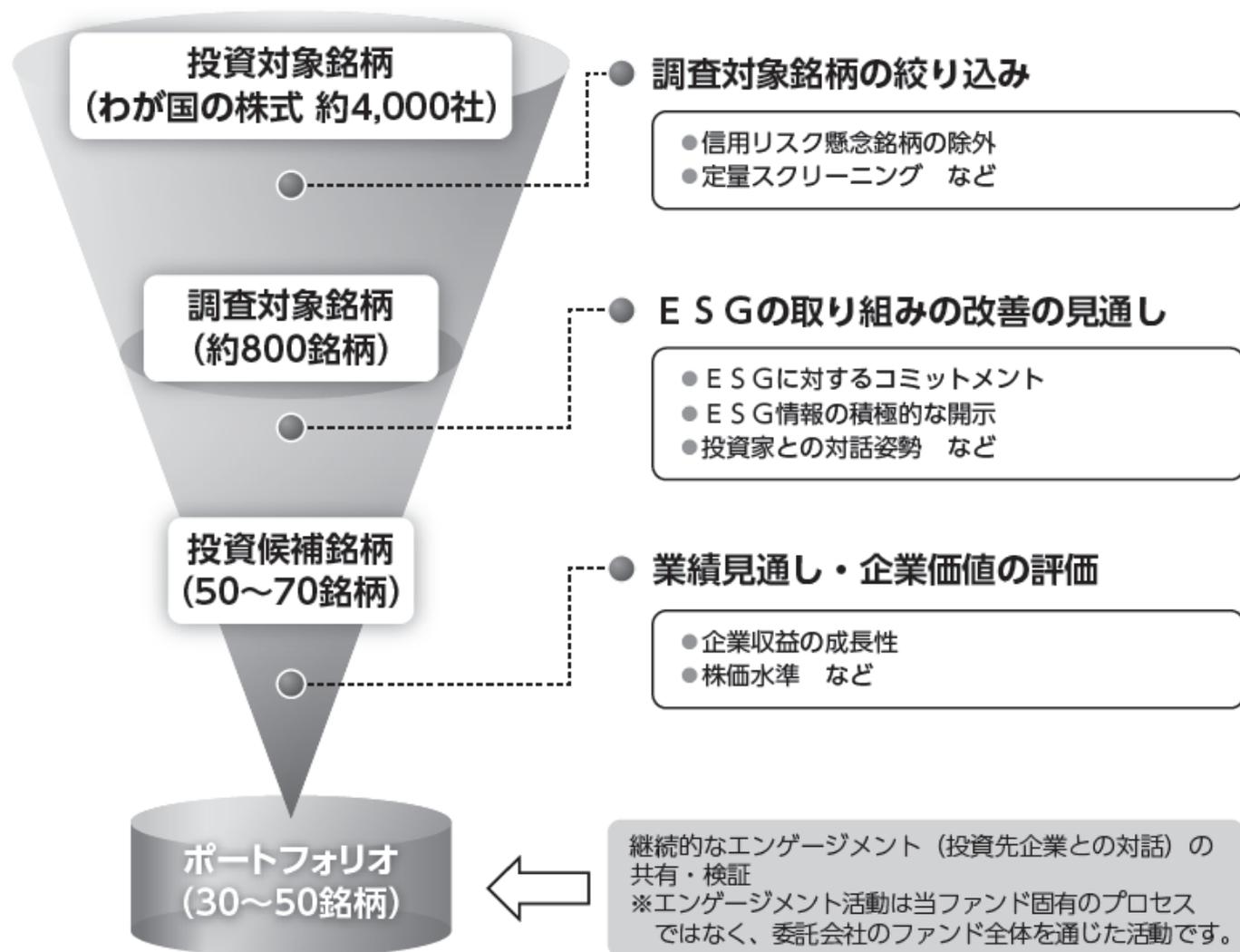
ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。

・ファンド・オブ・ファンズ方式とは、株式や債券などに直接投資するのではなく、複数の他の投資信託証券に投資するしくみです。



市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

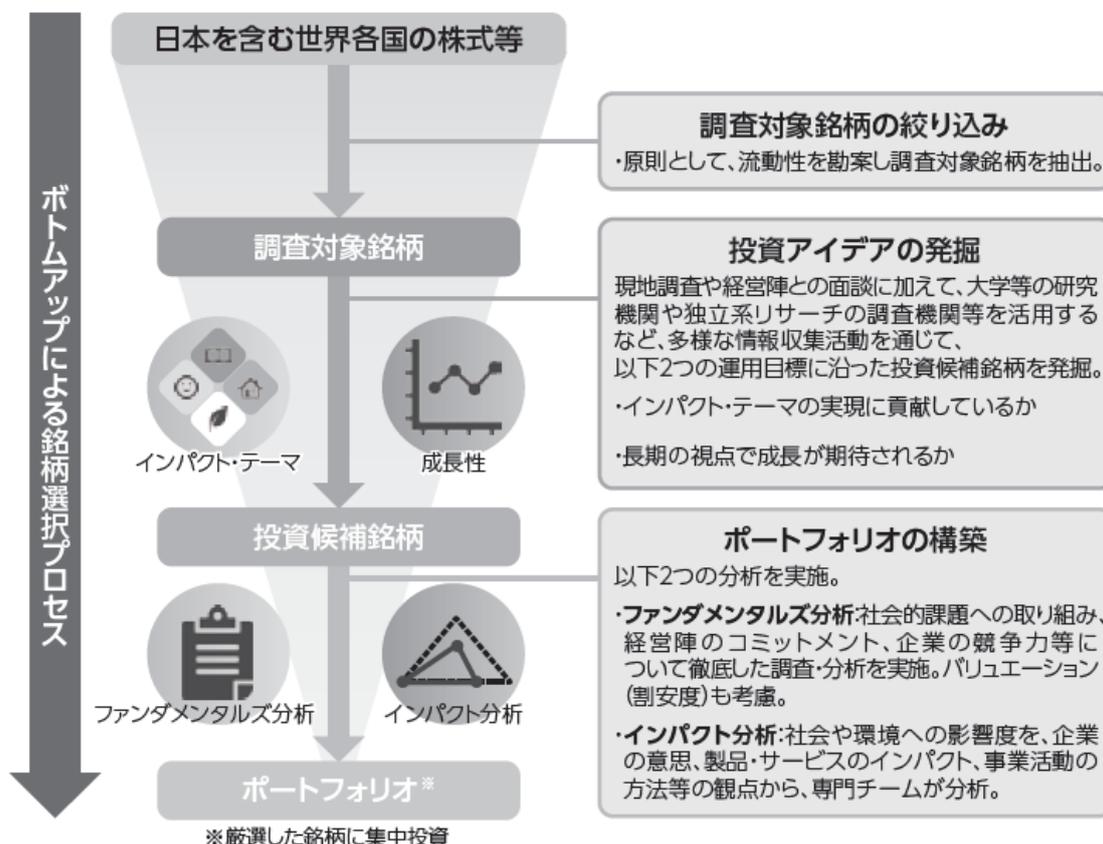
■各投資信託証券の運用プロセス  
 <日本株ESGアクティブマザーファンド>



❗ 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、すべてを網羅するものではありません。また、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。上記プロセスは、今後変更されることがあります。

<ご参考>委託会社のエンゲージメント活動について

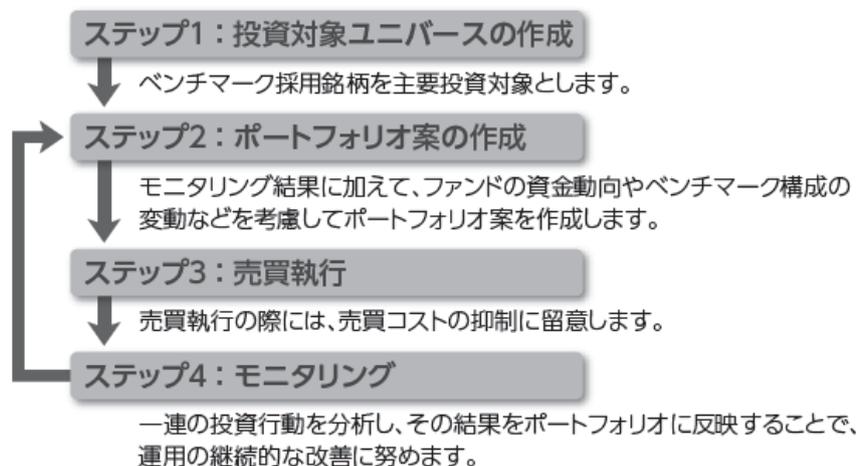
- 当社は、投資先企業との「目的を持った対話」を通じて、投資先企業の様々な問題についての認識共有化や改善への取組みが図られ、ひいては資本効率改善や持続的成長に結びつくと考えています。こうした考えの下、ファンドの運用方針やファンドにおける投資先企業の重要性等を勘案しつつアクティブ運用及びパッシブ運用共に「目的を持った対話」を実施します。  
 ※三菱UFJ国際投信のステewardシップ・コードへの対応方針より抜粋



❗ 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、すべてを網羅するものではありません。また、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。上記プロセスは、今後変更されることがあります。

【出所】ベイリー・ギフォード・インベストメント・マネジメント(ヨーロッパ)リミテッドの情報に基づき三菱UFJ国際投信作成

<ヘッジ付気候リスク調整世界国債インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)>



❗ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

📌 FTSE気候リスク調整世界国債インデックスとは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券指数である「FTSE世界国債インデックス」をベースとし、各国が直面する気候リスクを将来予測的に評価し、各国の組入比率を相対的に調整する指数です。

FTSE日本国債インデックスとは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本国債の総合収益率を指数化した債券インデックスです。

FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

基準価額の変動要因：基準価額は、株式市場の相場変動による組入株式の価格変動や金利変動による組入公社債の価格変動、為替相場の変動等により上下します。また、組入有価証券等の発行者等の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の影響を受けます。これらの運用により信託財産に生じた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が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。投資信託は預貯金と異なります。主な変動要因は、価格変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性リスク、カントリー・リスクです。上記は主なりリスクであり、これらに限定されるものではありません。くわしくは、投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。



## 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	ありません。												
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)	<p>日々の純資産総額に対して、<u>年率0.594%(税抜 年率0.540%)</u>をかけた額</p> <p>1万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (保有日数 / 365)</p> <p>※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。</p> <p>各支払先への配分(税抜)は、次の通りです。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>支払先</th> <th>配分(税抜)</th> <th>対価として提供する役務の内容</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>委託会社</td> <td>0.275%</td> <td>ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等</td> </tr> <tr> <td>販売会社</td> <td>0.225%</td> <td>交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等</td> </tr> <tr> <td>受託会社</td> <td>0.040%</td> <td>ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の発行等</td> </tr> </tbody> </table> <p>※上記各支払先への配分には、別途消費税等相当額がかかります。</p> <p>●投資対象とする外国投資証券の投資運用会社報酬 ・委託会社が受ける報酬から、当該外国投資証券のファンド組入額の年率0.40%以内が支払われます。</p>	支払先	配分(税抜)	対価として提供する役務の内容	委託会社	0.275%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等	販売会社	0.225%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等	受託会社	0.040%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の発行等
	支払先	配分(税抜)	対価として提供する役務の内容										
	委託会社	0.275%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等										
販売会社	0.225%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等											
受託会社	0.040%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の発行等											
投資対象とする投資信託証券	<p>投資対象ファンドの純資産総額に対して<u>年率0.07425%程度(税抜 年率0.06875%程度)</u>(運用および管理等にかかる費用)</p> <p>(*)ファンドが投資対象とする投資信託証券の信託報酬は最大年率0.121%(税込)です。</p>												
実質的な負担	<p>ファンドの純資産総額に対して<u>年率0.66825%程度(税抜 年率0.60875%程度)</u></p> <p>※投資対象とする投資信託証券の信託(管理)報酬率を合わせた実質的な信託報酬率(概算値)を算出したものです(2021年3月25日現在)。各投資信託証券への投資比率が変動する可能性や投資信託証券の変更の可能性があることから、実質的な料率は変動します。したがって事前に固定の料率、上限額等を表示することはできません。</p>												
その他の費用・手数料	<p>以下の費用・手数料についてもファンドが負担します。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・監査法人に支払われるファンドの監査費用</li> <li>・有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料</li> <li>・投資対象とする投資信託証券における諸費用および税金等</li> <li>・有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用</li> <li>・その他信託事務の処理にかかる諸費用 等</li> </ul> <p>※上記の費用・手数料については、売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。</p>												

※運用管理費用(信託報酬)および監査費用は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。毎計算期間の6ヵ月終了時、毎決算時または償還時にファンドから支払われます。

※上記の費用(手数料等)については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。なお、ファンドが負担する費用(手数料等)の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

■当資料は、プレスリリースとして三菱UFJ国際投信が作成したものであり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。当資料は投資勧誘を目的とするものではありません。■当資料の内容は作成時点のものであり、将来予告なく変更されることがあります。■当資料は信頼できると判断した情報等に基づき作成しておりますが、その正確性・完全性等を保証するものではありません。■投資信託は、預金等や保険契約とは異なり、預金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。銀行等の登録金融機関でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の補償の対象ではありません。■投資信託は、販売会社がお申込みの取扱いを行い委託会社が運用を行います。■委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を2021年3月9日に関東財務局長に提出しておりますが、届出の効力は生じておりません。したがって、当該届出の効力が発生するまでに、当資料の記載内容が訂正される場合があります。

以上