

## 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先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド』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>よこかわ すなお</sup> 横川 直)は『三菱UFJ DC先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド』を新規に設定いたします。  
 2021年10月29日(金)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、日本を除く先進国の株式から、業種内において相対的に ESG 評価が優れた企業で構成される「MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)」に連動する投資成果をめざします。

- ・『三菱UFJ DC先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド』の有価証券届出書を2021年10月13日(水)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) | 補足分類    | 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 | 対象インデックス                        |
| 追加型     | 海外     | 株式            | インデックス型 | その他資産  | 年1回  | グローバル(日本を除く) | ファミリーファンド | なし    | MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース) |

※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(株式 一般)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/>)でご覧いただけます。

- 委託会社(ファンドの運用の指図等) 三菱UFJ国際投信株式会社
- 受託会社(ファンドの財産の保管・管理等) 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)
- ご購入等に関しては以下にお問い合わせください

三菱UFJ国際投信株式会社  
 (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

MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果をめざします。

## ファンドの特色

特色 1

MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。



ESGとは、環境(**E**nvironment)、社会(**S**ocial)、ガバナンス(**G**overnance)の頭文字をとったものです。

- MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)をベンチマーク(以下「対象インデックス」という場合があります。)とします。

### 「MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)」について

MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)とは、MSCI Inc.が開発したMSCIコクサイESGリーダーズ指数(米ドルベース)をもとに委託会社が計算したものです。MSCIコクサイESGリーダーズ指数(米ドルベース)は、MSCI リサーチが提供する企業格付けと調査を利用し、日本を除く先進国の株式から、業種内において相対的にESG(環境、社会、ガバナンス)評価が優れた企業で構成されています。

MSCIコクサイESGリーダーズ指数(米ドルベース)に対する著作権およびその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

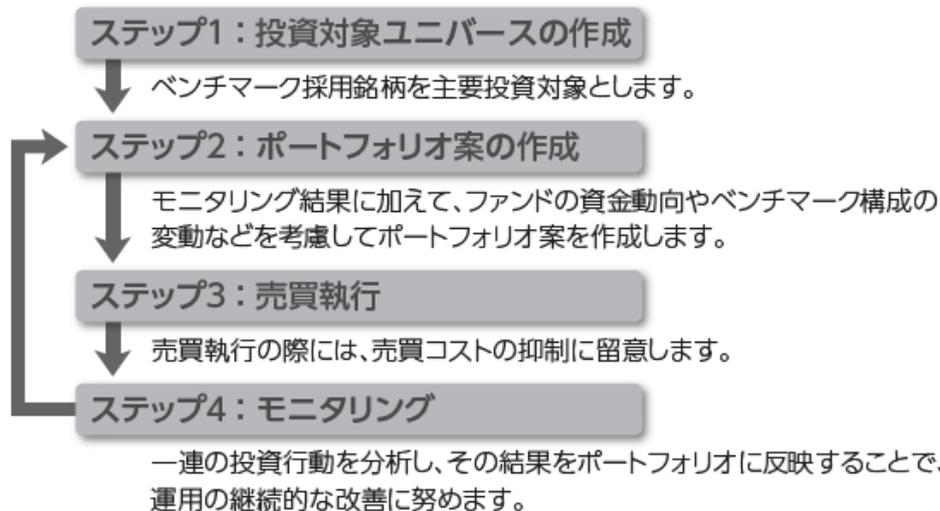
特色 2

主として日本を除く先進国の株式に投資を行います。

- 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。

※実際の運用は先進国株式ESGインデックスマザーファンドを通じて行います。

## <運用プロセスのイメージ>



- ❗ 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。
- 📄 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.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)をご覧ください。

### 特色3

原則として、為替ヘッジを行いません。

- 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(5月20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。

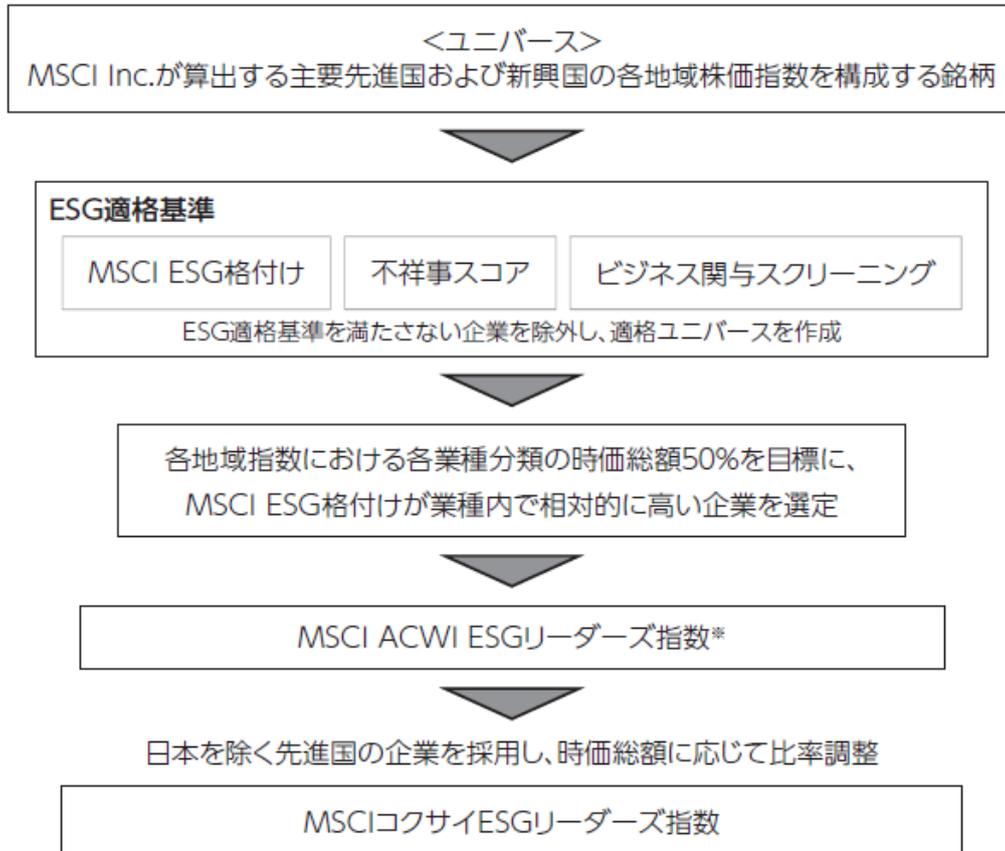
分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

将来の分配金の支払いおよびその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、2022年5月20日です。)

# 「MSCIコクサイESGリーダーズ指数」について

## ■MSCIコクサイESGリーダーズ指数の構築プロセス



- 年次レビュー(毎年5月)において適格ユニバースを更新し、各業種分類時価総額の50%を目標に一定の条件に従って銘柄を選定
- 四半期レビュー(毎年2・8・11月)において、ESG適格基準の継続採用条件を満たしていない既存構成銘柄を除外した上で、各業種分類時価総額の45%未満となる場合、一定の条件に従って50%の目標に達するまで銘柄を新規採用

※MSCI ACWI ESGリーダーズ指数(MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の主要先進国および新興国の大型株・中型株の中から、業種内において、相対的にESG評価が優れた企業で構成されています。

## ■ESG適格基準

| 項目            | 内容                                                                                                                                                                                            | 新規採用条件 | 継続採用条件 |
|---------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|--------|
| MSCI ESG格付け   | <ul style="list-style-type: none"> <li>•各企業のESGに関するリスクと機会への対応力を調査・分析</li> <li>•各企業に係る主要な問題への対応力を同業他社と比較</li> <li>•AAA～CCCの7段階で各企業を評価(BBは最上位から5番目)</li> </ul>                                  | BB以上   | BB以上   |
| 不祥事スコア        | <ul style="list-style-type: none"> <li>•各企業の事業、製品やサービスがESGにネガティブな影響を与え得る不祥事の深刻度やその解決のための対策を0～10で評価(0が最低評価)</li> </ul>                                                                         | 3以上    | 1以上    |
| ビジネス関与スクリーニング | <ul style="list-style-type: none"> <li>•非人道的兵器と関連性を有するすべての企業、核兵器に関する製造やサービスに関連するすべての企業を除外</li> <li>•民間銃器、たばこ、アルコール、通常兵器、ギャンブル、原子力、化石燃料抽出、石炭火力の製造、販売などに関連する事業から一定以上の売上や収益を得ている企業を除外</li> </ul> |        |        |

## ■MSCI ESG格付けの評価項目

### ●環境(Environment)

|                                      |                                       |                                         |                                             |
|--------------------------------------|---------------------------------------|-----------------------------------------|---------------------------------------------|
| <b>地球温暖化</b><br>二酸化炭素排出、<br>環境配慮融資など | <b>自然資源</b><br>水資源枯渇、<br>生物多様性と土地利用など | <b>廃棄物管理</b><br>有害物質と廃棄物管理、<br>包装材廃棄物など | <b>環境市場機会</b><br>クリーンテクノロジー、<br>再生可能エネルギーなど |
|--------------------------------------|---------------------------------------|-----------------------------------------|---------------------------------------------|

### ●社会(Social)

|                                     |                                            |                                                  |                                             |
|-------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------------|---------------------------------------------|
| <b>人的資源</b><br>労働マネジメント<br>労働安全衛生など | <b>製品サービスの安全</b><br>製品安全・品質、<br>製品化学物質安全など | <b>ステークホルダーマネジメント</b><br>透明性のある物資調達、<br>コミュニティ関係 | <b>社会市場機会</b><br>金融へのアクセス、<br>ヘルスケアへのアクセスなど |
|-------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------------|---------------------------------------------|

### ●ガバナンス(Governance)

|                                       |                                |
|---------------------------------------|--------------------------------|
| <b>コーポレートガバナンス</b><br>取締役会構成、<br>報酬など | <b>企業行動</b><br>企業倫理、<br>租税回避など |
|---------------------------------------|--------------------------------|

※産業により重要とされる項目が異なるため、全ての項目で評価するものではありません。

※ESG適格基準やMSCI ESG格付けの評価項目は、今後変更される可能性があります。

※MSCI Inc.の資料を基に三菱UFJ国際投信が作成

📄 MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)は、MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。

当ファンドは、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数は、MSCI Inc.が独占的に所有しています。

MSCI Inc.およびMSCI指数は、MSCI Inc.およびその関係会社のサービスマークであり、委託会社は特定の目的の為にその使用を許諾されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCI Inc.とその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、当ファンドまたは当ファンドの委託会社あるいは受益者に関わらず、MSCI Inc.により決定、作成、および計算されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、当ファンドの委託会社または受益者の要求を考慮に入れる義務は一切ありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの募集等に関する事項の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCI Inc.は、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的にも黙示的にも、被許諾者、その顧客または相手方、当ファンドの委託会社、当ファンドの受益者その他の個人・法人が、契約にもとづき許諾される権利またはその他使用のために許諾される権利に関連してMSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行うものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害(逸失利益を含む。)につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、または受益者あるいはいかなる個人・法人は、MSCI Inc.の許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCI Inc.に問い合わせることなく、当ファンドを保証、推奨、売買、または宣伝するためにいかなるMSCI Inc.のトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCI Inc.の書面による許諾を得ることなくMSCI Inc.との関係を一切主張することはできません。

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。

・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。

・その他の留意点: ファンドは、MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)の動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、委託会社やその親会社に係る資本規制により、特定の銘柄への投資を行わないことがある等の要因によりカイ離を生じることがあります。



## 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<br>(信託報酬) | 日々の純資産総額に対して、 <u>年率0.253%(税抜 年率0.230%)</u> をかけた額                                                                                                                                                                                      |        |                                         |
|                  | 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)                                                                                                                                                                                      |        |                                         |
|                  | ※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。                                                                                                                                                                                                    |        |                                         |
|                  | 各支払先への配分(税抜)は、次の通りです。                                                                                                                                                                                                                 |        |                                         |
|                  | 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                                                                                                                                                                                                                                  | 0.115% | 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                                                                                                                                                                                                                                  | 0.085% | 交付運用報告書等各种書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等       |
|                  | 受託会社                                                                                                                                                                                                                                  | 0.030% | 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実行等         |
|                  | ※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。                                                                                                                                                                                                        |        |                                         |
| その他の費用・<br>手数料   | 以下の費用・手数料についてもファンドが負担します。<br>・監査法人に支払われるファンドの監査費用<br>・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<br>・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<br>・マザーファンドの換金に伴う信託財産留保額<br>・その他信託事務の処理にかかる諸費用 等<br>※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。 |        |                                         |

※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。第2計算期間以降の毎計算期間の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。投資信託をご購入の場合は、運営管理機関よりお渡しする確定拠出年金向け説明資料または投資信託説明書(交付目論見書)をご確認のうえ、ご自身でご判断ください。■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。■確定拠出年金で投資信託をご購入の場合は、運営管理機関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10月13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