



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ご紹介

追加型投信／海外／株式／インデックス型



■設定・運用は

三菱UFJアセットマネジメント

三菱UFJ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

ESG投資とは



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。

企業が事業活動を行う上で、ESGの各課題に対してきちんと配慮、対応を行うことで長期的に企業の発展や成長に繋がると考えられています。



ESG投資とは

財務情報だけでなく、環境・社会・企業統治 (ガバナンス) といった要素も考慮した投資のことをさします。

◆当ファンドは「サステナブル・ファンド」です。サステナブル・ファンドとは、ファンドの投資判断プロセスにおいてESG要素を主要とし、環境や社会の課題解決・改善に寄与する企業等への投資を行い、お客さまの資産形成および持続可能な社会の実現に貢献するファンドとして、三菱UFJアセットマネジメントが定めたファンドをいいます。サステナブル・ファンドへの認定および除外は今後見直す場合があります。

詳細については、委託会社のホームページ (<https://www.am.mufg.jp/corp/sustainability/sustainability.html>) でご覧いただけます。

本資料は「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」の概略を記載したものです。このため、ファンドの商品性、リスク、お申込みメモ等については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) をご確認ください。

【本資料に関するご注意事項等】の内容を必ずご覧ください。



1.当ファンドについて

2.「MSCIコクサイESGリーダーズ指数」について

3.運用状況

1. 当ファンドについて



- 当ファンドは、主として日本を除く先進国の株式に投資を行い、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、これに連動する投資成果をめざして運用を行います。

「MSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）」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 ESG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（配当込み、円換算ベース）」をファンドの連動対象指数とした理由

MSCIコクサイESGリーダーズ指数は、MSCIコクサイ・インデックスを構成する日本を除く先進国の株式の中から、各業種内において相対的にESG評価の高い銘柄をその業種の時価総額50%をカバーするよう構築されています。相対的にESG評価の高い銘柄を抽出しながらも、特定のテーマ・地域および業種の偏りがでないような指数の構築プロセスが取られており、日本を除く先進国の株式市場の値動きを概ねとらえつつ、ESG投資に関心のある投資家に向けて幅広く提供可能なファンドの連動対象指数として選定しました。

2. 「MSCIコクサイESGリーダーズ指数」について①

MSCIコクサイESGリーダーズ指数の構築プロセス

<ユニバース>

MSCI Inc.が算出する主要先進国および新興国の各地域株価指数を構成する銘柄

ESG適格基準

MSCI ESG格付け

不祥事スコア

ビジネス関与スクリーニング

ESG適格基準を満たさない企業を除外し、適格ユニバースを作成

各地域指数における各業種分類の時価総額50%を目標に、
MSCI ESG格付けが業種内で相対的に高い企業を選定

MSCI ACWI ESGリーダーズ指数*

日本を除く先進国の企業を採用し、時価総額に応じて比率調整

MSCIコクサイESGリーダーズ指数

◆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

（出所）MSCI Inc.の資料を基に三菱UFJアセットマネジメント作成

※MSCI ACWI ESGリーダーズ指数とは、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。

【本資料に関するご注意事項等】の内容を必ずご覧ください。

2. 「MSCIコクサイESGリーダーズ指数」について②

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	- 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 - 各企業に係る主要な問題への対応力を同業他社と比較 - AAA～CCCの7段階で各企業を評価（BBは最上位から5番目）	BB以上	BB以上
不祥事スコア	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）	3以上	1以上
ビジネス関与スクリーニング	- 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 - 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		

MSCI ESG格付けの評価項目

●環境(Environment)

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

●社会(Social)

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

●ガバナンス(Governance)

コーポレートガバナンス	企業行動
取締役会構成、報酬など	企業倫理、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。

【本資料に関するご注意事項等】の内容を必ずご覧ください。

（出所）MSCI Inc.の資料を基に三菱UFJアセットマネジメント作成 5

3. 運用状況 ①



基準価額・純資産総額

基準価額	15,796円
純資産総額	13.82億円

資産構成比率

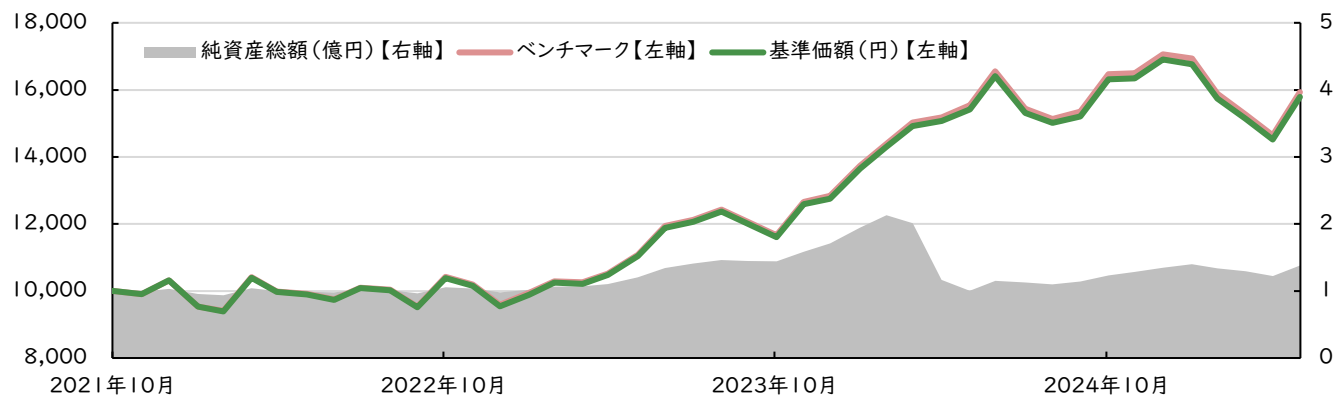
株式	96.70%
株式先物	3.25%
株式実質	99.95%
現金等	0.05%

(2025年5月末時点)

(注) 投資信託証券(REITを含む)の組み入れがある場合、株式に含めて表示しています。

基準価額等の推移

(期間: 2021年10月29日(設定日)~2025年5月30日)



基準価額は設定日(2021年10月29日)、ベンチマークは設定日翌営業日(2021年11月1日)を10,000として指数化しています。

ファンド(分配金再投資)とベンチマークの収益率とリスク(標準偏差)

	3ヵ月間	6ヵ月間	1年間	3年間	5年間	10年間	設定来
ファンド収益率	0.30%	-3.35%	2.45%	16.88%	—	—	13.61%
ベンチマーク収益率	0.31%	-3.38%	2.52%	17.14%	—	—	13.89%
差異	-0.02%	0.04%	-0.07%	-0.26%	—	—	-0.28%
ファンドリスク	—	—	18.15%	15.68%	—	—	16.38%
ベンチマークリスク	—	—	18.28%	15.74%	—	—	16.43%

基準価額(分配金再投資)は、1万口当たりで運用管理費用(信託報酬)控除後の値です。信託報酬率は、後記の「ファンドの費用」に記載しています。基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものとして計算しています。ベンチマークは、MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)です。ファンド(分配金再投資)の収益率とは、当ファンドの決算時に収益の分配金があった場合に、その分配金で当ファンドを購入(再投資)した場合の収益率です。収益率・リスクともに月次収益率より算出。なお設定日が月中の場合、設定日が属する月の月次収益率は含んでいません。(設定来は設定月末を起点として算出) 収益率は期間が1年以上の場合は年率、期間が1年未満のものについては年率換算していません。計測期間が異なる場合は、結果も異なる点にご注意ください。比率は純資産総額に対する割合です。表示桁未満の数値がある場合、四捨五入しています。

上記は、過去の実績・状況または作成時点での見通し・分析であり、将来の市場環境の変動や運用状況・成果を示唆・保証するものではありません。また、税金・手数料等を考慮していません。【本資料に関するご注意事項等】の内容を必ずご覧ください。

3. 運用状況 ②



株式国別配分上位

	国名	ファンドのウェイト
1	アメリカ	75.00%
2	イギリス	3.68%
3	カナダ	3.49%
4	フランス	2.83%
5	スイス	2.37%
6	オランダ	1.69%
7	オーストラリア	1.43%
8	ドイツ	1.39%
9	デンマーク	1.04%
10	スウェーデン	0.89%

株式業種配分上位

(2025年5月末時点)

	業種名	ファンドのウェイト
1	ソフトウェア・サービス	14.96%
2	半導体・半導体製造装置	12.54%
3	金融サービス	8.63%
4	医薬品・バイオテクノ・ライフ	7.56%
5	メディア・娯楽	7.07%
6	資本財	6.51%
7	保険	3.84%
8	銀行	3.68%
9	一般消費財・サービス流通・小売り	3.35%
10	素材	3.34%

株式組入上位10銘柄

(組入銘柄数: 574銘柄)

	銘柄名	ファンドのウェイト	国名
1	NVIDIA CORP	9.34%	アメリカ
2	MICROSOFT CORP	8.88%	アメリカ
3	TESLA INC	2.85%	アメリカ
4	ALPHABET INC-CL A	2.76%	アメリカ
5	ALPHABET INC-CL C	2.37%	アメリカ
6	VISA INC-CLASS A SHARES	1.72%	アメリカ
7	ELI LILLY & CO	1.60%	アメリカ
8	MASTERCARD INC - A	1.30%	アメリカ
9	PROCTER & GAMBLE CO/THE	1.09%	アメリカ
10	JOHNSON & JOHNSON	1.02%	アメリカ

(注) 投資信託証券 (REITを含む) の組み入れがある場合、株式に含めて表示しています。

比率は純資産総額に対する割合です。

上記は、過去の実績・状況または作成時点での見通し・分析であり、将来の市場環境の変動や運用状況・成果を示唆・保証するものではありません。【本資料に関するご注意事項等】の内容を必ずご覧ください。

ファンドの目的・特色



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。

- 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。

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。

■海外株式投資におけるスチュワードシップ方針

委託会社はスチュワードシップ活動において、投資先企業の長期的な企業価値の向上や持続的な成長に向け、社会・環境の問題や企業のカバナンス体制の観点を含む明確な方針のもとで議決権を行使します。

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。

■ファンドの仕組み

ファミリーファンド方式により運用を行います。先進国株式ESGインデックスマザーファンドを通じて実質的な運用を行います。

ファンドのリスク・費用



【投資リスクについて】

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、為替相場の変動等により上下します。
また、組入株式の発行者等の経営・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、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)をご覧ください。

【費用について】

■お客さまが直接的に負担する費用

購入時	購入時手数料	ありません。
換金時	信託財産留保額	ありません。

■お客さまが信託財産で間接的に負担する費用

保有期間中	運用管理費用 (信託報酬)	日々の純資産総額に対して、 年率0.253% (税抜 年率0.230%) をかけた額
保有期間中	その他の費用・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。 ・監査法人に支払われるファンドの監査費用 ・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 ・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 ・マザーファンドの換金に伴う信託財産留保額 ・その他信託事務の処理にかかる諸費用 等 ※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。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。

※ファンドの費用(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。

ご注意事項等



【本資料に関するご注意事項等】

- 本資料は三菱UFJアセットマネジメントが作成した情報提供資料であり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。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。
- 本資料は特定の商品への投資について指図を行うこと、または指図を行わないことを勧めるものではありません。
- 掲載されている各コンテンツは、運用方法に係る情報の提供を目的としており、投資その他の行動を勧誘する目的で作成したものではありません。
- 本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。
- 本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。



三菱UFJアセットマネジメント