

2017年12月13日

お客様各位

東京海上アセットマネジメント株式会社

## 低炭素特化型の日本株ファンド設定のお知らせ

「東京海上・低炭素日本株ファンド（適格機関投資家限定）」

東京海上アセットマネジメント株式会社（代表取締役社長 大庭雅志、以下「東京海上アセット」）は11月27日に、業界でも先駆的に温室効果ガス削減に取り組む日本企業の株式を組み入れる「東京海上・低炭素日本株ファンド（適格機関投資家限定）」を設定しました。

東京海上グループにおいて、「国連持続可能な開発目標（サステナブル・デベロップメント・ゴールズ（SDGs））」や国連気候変動枠組条約「パリ協定」の目標達成に貢献することを目指した取組みを進めている中で、当ファンドは低炭素社会づくりに取組んでいる日本企業の株式を組み入れることを通じて、金融面から日本企業の低炭素化に向けた取組みを促していくことを狙いとしています。

国内において ESG 投資への関心が高まる中、当ファンドは社会課題の解決に前向きに取り組んでいる企業に投資するという点では従来の ESG ファンドと同様ですが、低炭素に特化している点、TOPIX と連動することを運用目標とする（ベンチマーク対比の超過収益目標を設定しない）という点で、通常の ESG ファンドとは運用上のコンセプトが異なります。

具体的に、当ファンドの戦略のポイントは以下の通りとなります。

- ① CO2 排出量を公表している企業を投資ユニバースとします。
- ② ポートフォリオのカーボンインテンシティ（CO2 排出の原単位で、CO2 排出量を売上高で除したもの）が、ベンチマークである TOPIX 対比で半分程度となるようなポートフォリオを目指します。
- ③ TOPIX との連動を運用目標としつつ、対 TOPIX でのトラッキングエラーを抑えることを目指します。

当ファンドは、投資家のみなさまが、「追加的リスク負担を抑え、株式資産としての一定のリターンを享受しつつ温室効果ガスの削減・低炭素社会づくりを後押しする投資を行うことができる」というコンセプトのもとで設定されたもので、東京海上アセットが署名を行っている国連責任投資原則（UNPRI）に則した取組みの一環でもあります。

東京海上アセットでは、当ファンドを通じて金融面から安心・安全でサステナブルな低炭素社会づくりに貢献していくとともに、引続きお客様の期待の一步先を行く商品・サービスの提供を目指します。