

2022年9月30日

News Release

UBS アセット・マネジメント、ESG 特性の向上とバリュエーション妙味に注目した 公募株式投信を届出

『UBS サステナブル向上・コアバリュー株式ファンド 愛称:ツイン・アセンダーズ』

UBS アセット・マネジメント株式会社(所在地:東京都千代田区、代表取締役社長:三木桂一)は本日、追加型投資信託、「UBS サステナブル向上・コアバリュー株式ファンド 愛称:ツイン・アセンダーズ」の届出を行いました。当ファンドは、ESG 特性の改善が株式市場におけるバリュエーション上昇の契機となる傾向が世界的に見られていることを踏まえ、主として世界の上場株式の中から、将来に向けた ESG 特性の改善が期待され、かつ長期的な業績見通しとの対比で、バリュエーション妙味に優れると判断される銘柄に投資を行う、次世代型のサステナブル株式ファンドです。

成長の持続性に注目が集まる昨今、ESG 面で課題を抱えつつも、積極的にその解消に取り組む企業が世界の投資家の注目を集めています。当ファンドは、長期的成長を加味した株価の割安度に優れ、かつ、様々な ESG 課題解決への取り組みによって市場における評価の高まりが期待される、未来のリーダー企業に投資機会を見出します。UBS は、サステナブル投資において先行する欧州を代表する総合金融機関として、エンゲージメントを通じた、投資先企業の後押しを活用しつつ、投資リターンの最大化を主眼とする新たなサステナブル投資の形を追求するとともに、投資家の皆様に、当ファンドを通じたサステナブルな社会の実現に貢献する機会を提供します。

【ファンドの特徴】

(1) 「イン플ューバー企業」が持つ株価評価の上昇ポテンシャルへの期待

既に高い ESG 特性を備える企業ではなく、将来に向けて ESG 特性の改善が期待される企業群(「イン플ューバー企業」)に注目します。ESG の観点で課題を抱える企業が、真摯な取り組みによってその改善を実現していく過程で、市場における評価(株価バリュエーション)が上昇するという傾向を、投資リターン獲得の機会として捉えます。

(2) 「コアバリュー銘柄」への厳選投資

「イン플ューバー企業」のうち、長期の業績成長見通しに対する割安度に優れる「コアバリュー銘柄」を厳選します。ボトムアップ調査を通じてアナリストが予想する個別企業の長期的な将来

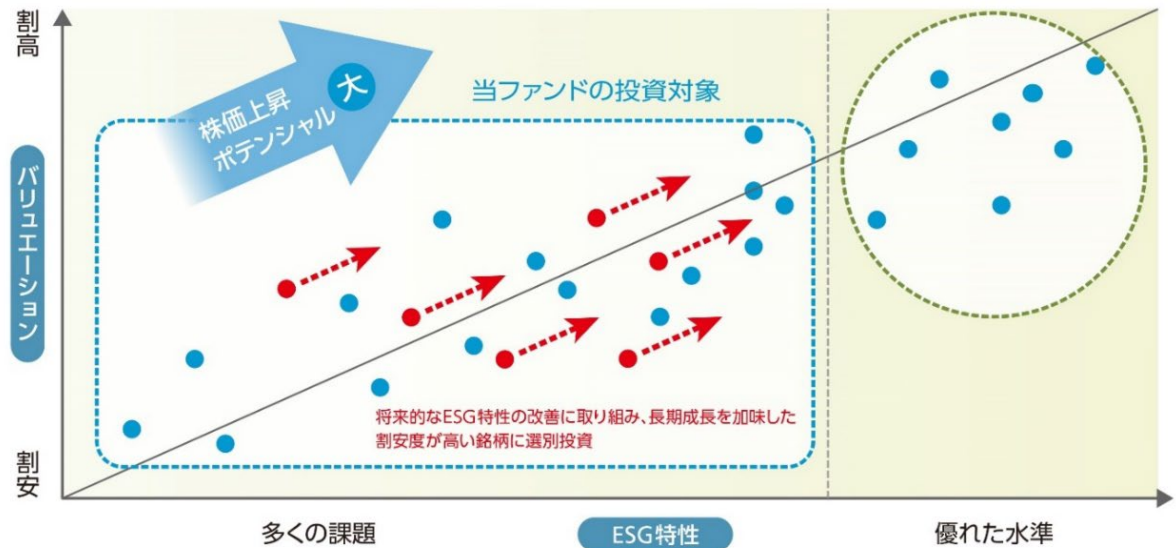
キャッシュフローを UBS 独自のバリュエーション分析システムで本源的価値に引き直し、これと実際の株価との乖離を割安度として捉えます。

(3) 「データサイエンス手法」と「エンゲージメント(企業との対話)」の活用

「イン플ューバー企業」の絞り込みに当たっては、社内のデータサイエンス専任チームが環境 (Environment)、社会 (Social)、ガバナンス (Governance) の各領域で最も有効性が高いと判断するデータ、モデルで構築したフレームワークを活用します。

また、業界のベスト・プラクティス(最良慣行)に精通するアナリストが行う継続的なエンゲージメントによって、投資先企業が抱える ESG 面の課題の解決を後押しします。長期的視点に基づく投資先企業との建設的な対話は、当ファンドの大きな特徴の一つです。

<当ファンド投資対象のイメージ>



出所:UBS アセット・マネジメント。上記はイメージです。

【当ファンドの販売会社】

播陽証券株式会社、株式会社SBI証券、楽天証券株式会社(10月31日より取扱開始予定)

UBS について

UBS は人々とアイデアが結び付き機会が生まれるグローバルな投資のエコシステムを生成するべく力を尽くしています。UBS は、世界中の富裕層、機関投資家及び企業の顧客、そしてスイスの個人顧客に投資にかかるソリューション、金融商品、そして深い知見に基づいた情報を提供する世界トップクラスのウェルス・マネージャーであり、幅広い資産クラスの多岐な運用ソリューションを提供する世界最大級のアセット・マネージャーです。専門的な証券事業を擁し、スイスでは個人や企業顧客に対して銀行サービスを提供しています。UBS の事業戦略は、対象とする市場において特に競争力があり、資本効率が高く、長期で構造的な成長/利益を見込むことができる事業に経営資源を集中することです。

スイスのチューリッヒに本拠を置く UBS は、世界の主要金融センターを含む 50 以上の市場で事業を展開し、72,000 名超の従業員を擁します。内 30%が米州、30%がスイス、19%がスイス以外の欧州・中東・アフリカ地域、21%が太平洋地域に在籍しています。UBS グループ AG の株式はスイスおよびニューヨークの各証券取引所に上場されています。日本においては UBS 証券株式会社、UBS 銀行東京支店、UBS アセット・マネジメント株式会社、UBS ジャパン・アドバイザーズ株式会社、UBS SuMi TRUST ウェルス・マネジメント株式会社、UBS SuMi TRUST ウェルス・アドバイザーズ株式会社の 6 法人を通じて、法人/機関投資家および富裕層個人のお客様向けに様々な金融商品とサービスを提供しています。

UBS アセット・マネジメントについて

UBS アセット・マネジメントは、UBS グループの資産運用部門として、世界の 23 の市場において事業を展開するグローバルな資産運用会社です。主要な伝統的資産からオルタナティブ資産に至るまで、幅広いアセットクラスにおける深い専門知識を通じて、世界中の年金基金、機関投資家、個人投資家向けに幅広い資産運用ソリューションや関連サービスをご提供し、2022 年 6 月末現在の運用資産残高は約 139 兆円を有します。また、20 年以上の実績があるサステナブル投資の分野においても、国連責任投資原則における戦略とガバナンスにて A+の評価を得る(2020 年 7 月末)など、資産運用業界を率いる運用会社の一つです。

メディアお問い合わせ先

広報部

電話: 03 5208 6600

sh-ubs-japan-media-relations@ubs.com

投資リスク

当ファンドの基準価額は、組入れられる有価証券等の値動きによる影響（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）を受けますが、これら運用による損益はすべて投資者の皆様に帰属します。したがって、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。また、投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドにかかる主なリスクには、■株式の価格変動リスク、■為替変動リスク、■カントリー・リスク、■流動性リスク、■解約によるファンドの資金流出に伴うリスク、などがあります。

【お申込みメモ】

詳しくは、投資信託説明書（交付目論見書）をご覧ください。

< 信託期間 >	無期限（2022年10月31日設定）
< 購入の申込期間 >	当初申込期間：2022年10月17日から2022年10月28日まで 継続申込期間：2022年10月31日から2024年1月5日まで
< 購入単位 >	販売会社が独自に定める単位
< 購入価額 >	購入申込受付日の翌々営業日の基準価額（当初申込期間においては1口当たり1円）とします。（基準価額は1万口当たりで表示、当初元本1口＝1円）
< 換金単位 >	販売会社が独自に定める単位
< 換金価額 >	換金申込受付日の翌々営業日の基準価額
< 換金制限 >	信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口換金には制限を設ける場合があります。
< 購入・換金不可日 >	ニューヨーク証券取引所の休業日もしくはルクセンブルクの銀行およびニューヨークの銀行の休業日と同日の場合または12月24日（以下「海外市場の休業日等」といいます。）および12月30日ならびに購入および換金の申込日の翌営業日が海外市場の休業日等と同日の場合には原則として購入および換金の申込の受け付けは行いません。
< 決算日 >	原則として毎年4月5日（休業日の場合翌営業日）とします。第1期決算日は、2023年4月5日とします。
< 収益分配 >	年1回の決算時に収益分配方針に基づいて分配を行います。（再投資可能）

【ファンドの費用】

詳しくは、投資信託説明書（交付目論見書）をご覧ください。

当ファンドの購入時や保有期間中には以下の費用がかかります。

■ 投資者が直接的に負担する費用

- < 購入時、購入時手数料 > 購入申込受付日の翌々営業日の基準価額（当初申込期間においては1口当たり1円）に、3.3%（税抜3.0%）以内で販売会社が定める率を乗じて得た額を、販売会社が独自に定める方法により支払うものとします。
- < 換金時、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） > 当ファンド：
日々の純資産総額に年率1.793%（税抜年率1.63%）を乗じて得た額とします。
運用管理費用（信託報酬）は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。

なお、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日、毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

投資対象とする投資信託証券：

ファンドの純資産総額に対して年率0.065%程度(委託会社が試算した概算値)

実質的な負担：

当ファンドの純資産総額に対して年率1.858%程度

<その他の費用・手数料>

- 諸費用(日々の純資産総額に対して上限年率0.1%)として、監査費用・印刷費用等が、日々計上され、原則毎計算期間の最初の6ヵ月終了日、毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。実費として、売買委託手数料・保管費用等が、原則発生の都度ファンドから支払われます。
- ※ 投資先ファンドの運営に係る実費は、当該投資先ファンドにおいて発生の都度支払われます。
- ※ 信託財産の規模、取引量等により変動しますので、事前に金額および計算方法を表示することができません。

※ 投資者の皆様にご負担いただく手数料等の合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異なりますので、表示することはできません。

本資料は、UBSアセット・マネジメント株式会社によって作成された、お客様ならびに報道機関の皆様に向けた資料です。本資料は各種の信頼できると考えられる情報源から作成されておりますが、その正確性・完全性が保証されているものではありません。本資料に記載されている内容・数値・図表・意見・予測等は、本資料作成時点のものであり、将来の市場動向、運用成果等を示唆・保証するものではなく、また今後予告なく変更されることがあります。購入のお申込にあたっては、販売会社より投資信託説明書(交付目論見書)等をお渡しますので、必ず内容をご確認の上、ご自身でご判断くださいますようお願いいたします。

商 号：UBS 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 412 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／一般社団法人第二種金融商品取引業協会

©UBS 2022. キーシンボル及び UBS の各標章は、UBS の登録又は未登録商標です。UBS は全ての権利を留保します。