



KRMA

 グローバルX  
 ESG経営企業 ETF

## ✓当ETFのポイント

1. ステークホルダーを重視した事業運営を行う企業に着目
2. ステークホルダーは顧客、従業員、サプライヤー、株式・債券保有者、コミュニティ
3. ESGの観点を含めたスクリーニングにより企業のスコアリングを実施
4. 年1回（10月）銘柄入れ替え+リバランス  
年3回（1月、4月、7月）不適格銘柄の削除

## ✓パフォーマンスと純資産推移

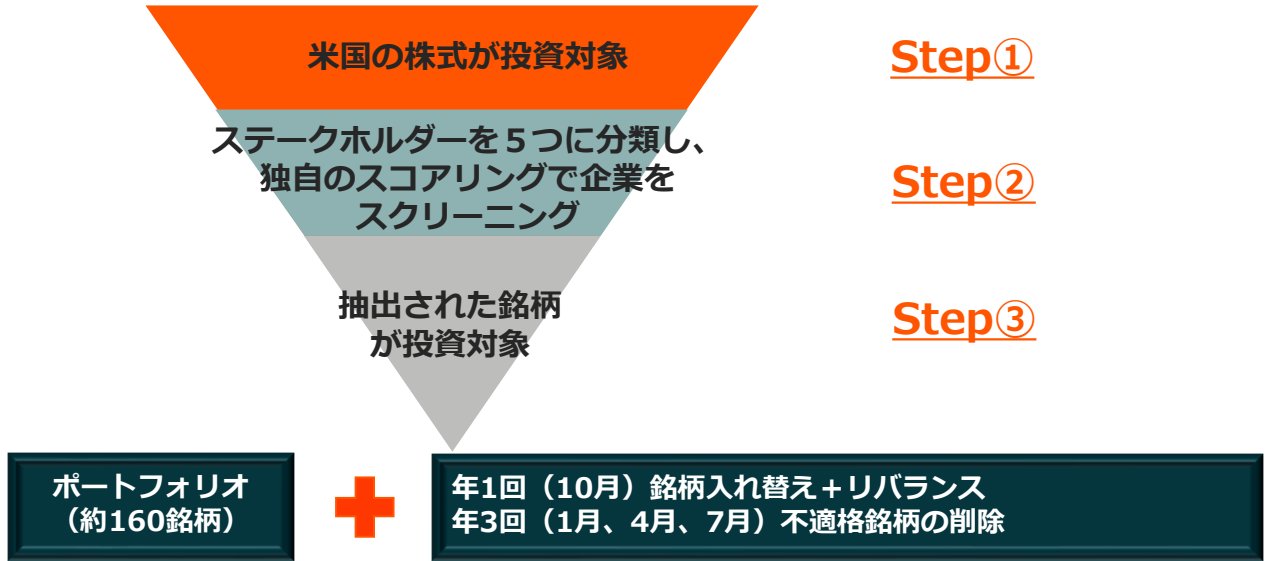
パフォーマンスは2016年7月11日を100として指数化、  
 トータルリターン価格（グロス）から算出。



(出所) ブルームバーグよりGlobal X Japan作成。表示されているパフォーマンスデータは過去のパフォーマンスを示しており、将来の成果を保証するものではありません。



✓対象インデックスの銘柄構築プロセス



Step①

時価総額20億ドル以上の米国の株式が投資対象

Step②

ステークホルダーを「顧客、従業員、サプライヤー、株式・債券保有者、コミュニティ」に分類し、それら重視して事業運営を行っている企業をスクリーニング

Step③

選ばれた銘柄は等ウェイトを原則とし、Solactive US Large Cap Index における比率を参照して組入比率を決定。

独自のスクリーニング・システム

1 段階目	2 段階目	3 段階目
<p><b>約40の情報源や公表されるランキングを使用 (Forbes等)</b></p> <p>5つのステークホルダーを重要し、良好な成果を上げている企業を抽出 (従業員の生産性やコーポレートガバナンス等) を評価)</p> <p>1,100~1,400銘柄 ↓ <b>600~700銘柄</b></p>	<p><b>複数の調査機関のデータを元に、様々な基準で複合的分析を実施</b></p> <p>1段階目で選定された銘柄に対し、複合的分析を実施 (経営陣の品位、顧客関係の質、財務報告の質等を評価)</p> <p>600~700銘柄 ↓ <b>300~350銘柄</b></p>	<p><b>3年以上連続して選定基準を達成しているか銘柄を確認し投資対象とする</b></p> <p>絞り込まれた銘柄の中から、3年以上連続して選定基準を達成している銘柄を投資対象とする (原則、全ての主要な業界が投資対象)</p> <p>300~350銘柄 ↓ <b>約160銘柄</b></p>

当資料は、Global X Japanが本邦の居住者への証券投資一般等に関する情報提供を目的として作成したものであり、海外ファンド等 (本邦での募集の取扱等に係る金融庁への届出等がされていないものを含みます。) についての勧誘を目的としたものではありません。また、当資料は金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。当資料に記載されている内容、数値、図表、意見等は資料作成時点のものであり、信頼できると考えられる情報源から作成していますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。運用実績などの記載内容は過去の実績であり、将来の成果を示唆・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ので、投資者のみなさまの実質的な投資成果を示すものではありません。また、当資料の内容についての著作権は、当社その他当該情報の提供元に帰属しています。電子的または、機械的方法を問わず、いかなる目的であれ、無断で複製、引用、転載または転送等を禁じます。個別の商品に関して、より詳細な情報が現地のウェブサイトに掲載されていることがありますので、必要に応じてご参照ください。当資料の内容につきましては、設定又は上場されている国、地域の事情により、変更又は更新作業が遅れている場合があります。海外の証券取引所に上場されている商品の購入を希望される場合は、本邦の取扱い金融商品取引業者へお問い合わせいただき、上場有価証券等書面またはその他の開示資料の内容を必ずご確認の上、ご自身でご判断ください。投資信託は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は大きく変動します。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ありません。信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。投資信託は預貯金とは異なります。GLOBAL Xは、Global X社の登録商標です。電子的または、機械的方法を問わず、いかなる目的であれ、無断で複製、引用、転載または転送等を禁じます。Global X社は、米国証券取引委員会に登録されている投資顧問業者です。