

# 2849

グローバルX 高配当 ESG-日本株式 ETF

## ファンドの目的

信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を「Morningstar®日本株式サステナビリティ配当利回りフォーカス指数<sup>SM</sup>」の変動率に一致させることを目的とします。

当資料は情報提供を目的として作成しています。当資料は、指数会社が構成銘柄を公表する際に使用する基準の一部の要約が記載されており、全体版ではありません。\*

ETF カテゴリー:

インカム

3/22/2022 時点

指数会社: Morningstar

主な特徴



高い潜在  
インカム



ESG投資



四半期分配

## Morningstar®日本株式サステナビリティ配当利回りフォーカス指数<sup>SM</sup>

### ユニバース

- ユニバースとなる企業は以下の条件を満たす:
  - Morningstar Japan Indexの構成銘柄
  - 現在のESGリスク評価とコントロールシー（企業不祥事）スコアが4以下である
  - 売上高が50%以上のタバコ製品への関与、および問題のある武器の製造への関与がない
  - 過去12ヶ月間に配当の支払実績がある
  - 3ヶ月間の平均売買代金が100万ドル以上である
  - Morningstarの株式調査チームによる「モート（堀）」の評価が「狭い」または「広い」であり、かつ、Distance to Default（デフォルトまでの距離）スコアが新規採用銘柄で上位50%、既存構成銘柄で上位60%である
  - モート（堀）評価のない企業は、モーニングスター社のDistance to Default（デフォルトまでの距離）スコアが、新規採用銘柄の場合はMorningstarの日本株コーホート内で上位30%、既存構成銘柄では上位36%である

### 銘柄選択

- 過去12か月配当利回りによりランク付けを行い、上位25銘柄を選定
- 既存採用銘柄は上位33位以内33位までにランクインしていれば引き続き採用される
- ESGリスク評価のスコアが最も悪い下位25%の証券を削除し、ポートフォリオがMorningstarサステナビリティ・レーティングで5グロープのスコアを満たしているかどうかを確認する
- ESGリスク評価のスコアが最も悪い5%の証券を、ポートフォリオがスコアを満たすまで、または下位50%の証券を取り除くまで、追加で除外する
- 改めて配当利回りによる銘柄選定を行う

### ウェイト付け

- 12ヶ月間の配当金額で加重平均
- 1銘柄当たりの上限は10%
- セクターのウェイトの上限は、40%か親指数のセクターウェイトの5倍のいずれか小さいほう

### リバランス・レビュー

- 半期ごと(6月と12月)に銘柄入替、リバランスを実施
- 上記に加えて3月と9月にもレビュー(コントロールシースクリーニング)を実施し不適格銘柄を削除

詳細はMorningstar社のサイトをご参照ください。

※最新の全体版のメソッドロジーについては、指数会社のウェブサイトを参照してください。当資料の情報は発行時点のものであり、その後のいかなる時点においても最新であることを保証するものではありません。指数の構成銘柄の選択とウェイト付けは、指数会社が独自に行います。

GLOBAL X

Global X Japan株式会社 金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第3174号  
一般社団法人日本投資顧問業協会会員 一般社団法人投資信託協会会員



#### 投資リスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。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。基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

「価格変動リスク・信用リスク（株価の変動）」、「その他」

※基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

※基準価額の変動要因は、上記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）」の「投資リスク」をご覧ください。

#### ファンドの費用

<投資者が直接的に負担する費用>

取得時手数料：販売会社が定めるものとします。（取得時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。）

信託財産留保額：ありません。

交換時手数料：販売会社が定めるものとします。（受益権の交換に関する事務等の対価です。）

<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）：

毎日、次の1. の額に2. の額を加算して得た額

1. 信託財産の純資産総額に年率 0.3025%（税抜 0.275%）以内を乗じて得た額

2. 信託財産に属する株式の貸付けにかかる品賃料に 55%（税抜 50%）以内の率を乗じて得た額

その他の費用・手数料

受益権の上場にかかる費用および対象指数の商標の使用料（商標使用料）ならびにこれらにかかる消費税等に相当する金額を、受益者の負担として信託財産から支払うことができます。

有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、監査報酬等を信託財産でご負担いただきます。

※売買委託手数料などの「その他の費用・手数料」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

※くわしくは「投資信託説明書（交付目論見書）」の「手続・手数料等」をご覧ください。

#### インデックスの著作権について

Morningstar®日本株式サステナビリティ配当利回りフォーカス指数<sup>SM</sup>は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社またはMorningstar, Inc.を含むその関連会社（これらの法人全てを総称して「Morningstarグループ」と言います）の商標またはサービスマークであり、Global X Japan株式会社による特定の目的での使用が許可されています。グローバル X Morningstar 高配当 ESG-日本株式 ETFはMorningstarグループが組成、推薦、販売または宣伝するものではなく、Morningstarグループはグローバル X Morningstar 高配当 ESG-日本株式 ETFへの投資の当否について何らの表明保証も行いません。Morningstarグループはグローバル X Morningstar 高配当 ESG-日本株式 ETFまたはそこに含まれるデータの正確性、完全性、適時性に関する保証を明示的に否認し、Morningstarグループはその誤謬、脱漏、中断についていかなる責任も負いません。

#### 当資料のお取り扱いにおけるご注意

当資料は、ファンドの状況や関連する情報等をお知らせするために Global X Japan 株式会社により作成されたものです。

当ファンドのお申込みにあたっては、「投資信託説明書（交付目論見書）」の内容を必ずご確認ください。

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。

投資信託は、預金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。証券会社以外でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。

当資料は、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。

当資料の中で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、今後予告なく変更されることがあります。

分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

GLOBAL X は、GLOBAL X MANAGEMENT COMPANY LLC 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。