



- 高ROEでかつその持続性が見込まれる企業で構成した「iSTOXX MUTB ジャパンクオリティ150インデックス」のうち、将来のESGRiskを定量化した「ESGRiskレーティングスコア」の高い上位30銘柄(グローバル・スタンダード・スクリーニング(GSS)の基準を満たしていない企業又は「問題性のある兵器」に関連する活動に従事している企業を対象外とする)で構成される「iSTOXX MUTB ジャパンESG 30インデックス(ネットリターン)」との連動を目指すETN(指標連動証券)です。
- JDR形式(ETNを信託財産とする受益証券)での上場のため、内国株式と同様にお取引いただけます。(外国証券取引口座の開設は不要です。)

1. スマートESG30総合(ネットリターン)ETNの概要

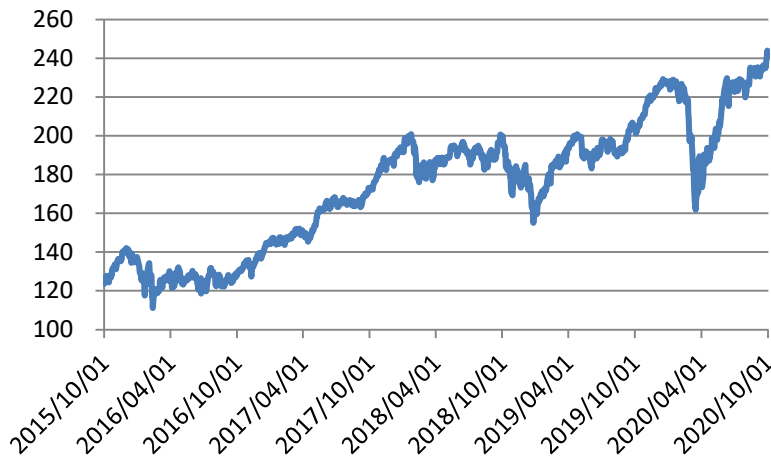
(2020年11月4日 現在)

銘柄名	スマートESG30総合(ネットリターン)ETN		
銘柄コード	2071		
対象指標	iSTOXX MUTB ジャパンESG 30インデックス(ネットリターン)		
信託の計算期日	毎年10月31日		
ETNの発行者	三菱UFJ証券ホールディングス株式会社		
信託委託者	三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社		
信託受託者	三菱UFJ信託銀行株式会社		
上場取引所	東京証券取引所	貸借銘柄選定	なし
売買単位	1口単位	Indicative NAV/PCFの開示	なし(※2)
分配金支払基準日	分配金の支払いは行われません。	上場日	2020年11月26日(予定)
管理費用	0.85%(年率)(※1)	ETNの償還日	2040年9月10日

※1 投資信託の信託報酬に相当する手数料であり、指標のパフォーマンスから控除されます。

※2 Indicative NAVとは、PCF情報に現時点の株価を乗じることによって算出されるリアルタイムの推定純資産額(1口あたり)、PCFとは、管理会社よりご提供をいただいたポートフォリオ構成銘柄情報ファイルのことを指します。ここでは東証を通じて開示しているIndicative NAV/PCF情報の有無を記載しています。

2. 対象指標の推移 (2015年10月1日 ~ 2020年10月1日)



■ 対象指標の騰落率

期間	対象指標
過去1ヶ月	3.81%
過去3ヶ月	8.21%
過去6ヶ月	36.06%
過去1年	17.50%
過去3年	39.21%

3. 対象指標の概要

「iSTOXX MUTB ジャパンESG 30インデックス(ネットリターン)」は、高ROEでかつその持続性が見込まれる企業で構成した「iSTOXX MUTB ジャパンクオリティ150インデックス」のうち、将来のESGRiskを定量化した「ESGRiskレーティングスコア」の高い上位30銘柄(グローバル・スタンダード・スクリーニング(GSS)の基準を満たしていない企業又は「問題性のある兵器」に関連する活動に従事している企業を対象外とする)で構成される、課税後配当込みの株価指数です。2014年6月23日を指数の基準日とし、同日の数値を100としています。

4. ETNとは？

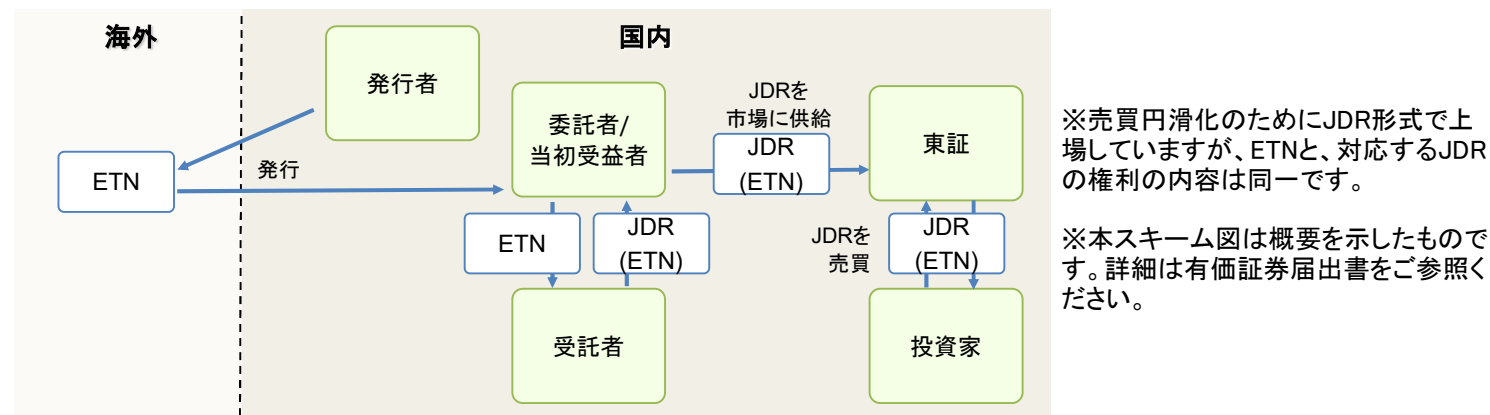
ETNとは「Exchange Traded Note」の略で、「上場投資証券」または「指標連動証券」と呼ばれる上場商品です。ETF (Exchange Traded Fund: 上場投資信託)と同様に、価格が株価指数や商品価格等の「特定の指標」に連動し、小額で購入可能、一般的に低コスト、株式と同じようにリアルタイム売買が可能という特徴を持っています。

また、「Note(債券)」の単語が示すように、金融機関(発行体)がその信用力をもとに、価格が特定の指標に連動することを保証する債券であるため、ETFとは異なり証券に対する裏付資産を持たない(必要としない)という点も特徴の一つです。

<ETNの詳しい説明はこちら>

<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etns/outline/01.html>

5. スキーム図



6. ETN情報入手一覧

- 償還価額(一証券あたりの償還価額)等に関する情報

<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etns/redemption-price/index.html>

- 情報ベンダーコード

情報ベンダー名	QUICK	Bloomberg	Refinitiv
ETNコード	2071/T	2071 JP Equity	2071.T
対象指数	-	IMJESGYN Index	.IMJESGYN

- iSTOXX MUTB ジャパンESG 30インデックス(ネットリターン)の算出要領及び指数値など

<https://www.stoxx.com/index-details?symbol=IMJESGYN>

7. 免責事項

- 当資料は、作成時におけるETNの概要説明のみを目的としており、投資勧誘を目的としているものではなく、また金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。
- ETNは発行会社の倒産や財務状況等の悪化、その他の市場要因の影響等により、市場取引価格又は基準価額が値下がりし、それにより損失が生じることがあります。したがって、投資元本が保証されているものではありません。また、信用取引を利用する場合には、差し入れた保証金以上の損失が生ずるおそれがあります。
- ETNの売買を行われるに際しては、あらかじめお取引先の金融商品取引業者等より交付される契約締結前交付書面等の書面の内容を十分にお読みいただき、商品の性質、取引の仕組み、リスクの存在、販売手数料、信託報酬などの手数料等を十分に御理解いただいたうえで、御自身の判断と責任で行っていただきますよう、お願い申し上げます。
- 当資料は、2020年11月現在の内容です。その後、制度の改正等により、当資料に掲載した内容が予告なく変更される場合があります。また、この資料に掲載されている情報の作成には万全を期していますが、当該情報の完全性を保証するものではありません。当社は、当資料及び当資料から得た情報を利用したことにより発生するいかなる費用又は損害等の一切について責任を負いません。
- 本資料の一切の権利は当社に属しており、いかなる目的を問わず、無断複製・転載を禁じます。

<お問い合わせ>

株式会社東京証券取引所 上場推進部 〒103-8220 東京都中央区日本橋兜町2-1 Tel:03-3666-0141(代)