

2011 年 12 月末現在の SRI 残高は、7,881 億円となりました。

(内訳)

- ・投資信託 2,435 億円
- ・社会貢献型債券
  - 個人向け 5,203 億円
  - 機関投資家向け 243 億円



今回の集計より下記の点を変更いたしました。

#### 1.投資信託の純資産残高について集計方法の変更

- ・運用資産が 100%が SRI 運用されていないものについては、目論見書に記載の SRI 比率を純資産残高に乗じた金額を SRI 残高としました。
- ・これにともない過去のデータとの連続性がなくなってしまうため、現時点では推移グラフの掲載は見送りしました。
- ・過去分の集計し直しを行った上で再掲載します。
- ・再集計に時間を要する見込みのため、以前の基準での 2011 年 9 月末までの推移グラフを別途掲載します。

#### 2.債権残高について償還分を反映

- ・個人向けの債券について、償還分を差し引いて純額を表記することにしました。

**特定非営利活動法人社会的責任投資フォーラム(SIF-Japan)**

## 公募SRI投信一覧 2011年12月末

:新規追加ファンド

## 100%SRIファンド

| 設定年月日           | ファンド名称     | ファンド別称                                      | 運用会社           | 評価項目                 | 純資産総額    | 調査・助言             |                                    |
|-----------------|------------|---------------------------------------------|----------------|----------------------|----------|-------------------|------------------------------------|
| <b>国内株式型</b>    |            |                                             |                |                      |          |                   |                                    |
| 1               | 1999/8/20  | <a href="#">日興エコファンド</a>                    |                | 日興アセットマネジメント         | 環境       | 10,821            | グッドバンカー                            |
| 2               | 2001/10/31 | <a href="#">年金積立エコファンド</a>                  | DCエコファンド       | 日興アセットマネジメント         | 環境       | 299               | グッドバンカー                            |
| 3               | 1999/9/30  | <a href="#">損保ジャパン・グリーン・オープン</a>            | ぶなの森           | 損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント | 環境       | 13,653            | NKSJリスクマネジメント                      |
|                 | 1999/10/22 | エコ・ファンド                                     |                | DIAMアセットマネジメント       | 環境       | 0(09/10/15<br>償還) | グッドバンカー                            |
|                 | 1999/10/29 | UBS日本株式エコ・ファンド                              | エコ博士           | UBSグローバル・アセット・マネジメント | 環境       | 0(08/19/5<br>償還)  | 日本総合研究所                            |
| 4               | 2000/1/28  | エコ・パートナーズ                                   | みどりの翼          | 三菱UFJ投信              | 環境       | 860               | 三菱UFJリサーチ & コンサルティング               |
| 5               | 2000/9/28  | 朝日ライフSRI社会貢献ファンド                            | あすのはね          | 朝日ライフ アセットマネジメント     | CSR      | 2,554             | ヴィジオ・ベルギー                          |
| 6               | 2003/12/26 | <a href="#">住信SRI・ジャパン・オープン</a>             | グッドカンパニー       | 住信アセットマネジメント         | CSR      | 10,764            | 日本総合研究所                            |
| 7               | 2004/2/27  | <a href="#">すみしんDCグッドカンパニー</a>              |                | 住信アセットマネジメント         | CSR      | 3,315             | 日本総合研究所                            |
| 8               | 2004/4/27  | フコクスRI(社会的責任投資)ファンド                         |                | しんきんアセットマネジメント投信     | CSR      | 2,159             | 富国生命投資顧問                           |
| 9               | 2004/5/20  | <a href="#">ダイワSRIファンド</a>                  |                | 大和証券投資信託委託           | CSR      | 1,846             | インテグレックス                           |
| 10              | 2004/7/20  | <a href="#">DC・ダイワSRIファンド</a>               |                | 大和証券投資信託委託           | CSR      | 138               | インテグレックス                           |
|                 | 2004/7/30  | モーニングスターSRIインデックス・オープン                      | つながり           | 野村アセットマネジメント         | CSR      | 0(10/7/5<br>償還)   | モーニングスター<br>社会的責任投資株価指数            |
| 11              | 2004/12/3  | 三菱UFJ SRIファンド                               | ファミリー・フレンドリー   | 三菱UFJ投信              | 雇用       | 1,446             | グッドバンカー                            |
| 12              | 2005/3/18  | SAIKYO 日本株式CSRファンド                          | すいれん           | バイブリッジ・インベストメンツ      | CSR      | 615               | Institutional Shareholder Services |
| 13              | 2005/3/18  | りそなジャパンCSRファンド                              | 誠実の社           | バイブリッジ・インベストメンツ      | CSR      | 2,749             | Institutional Shareholder Services |
| 14              | 2005/3/25  | <a href="#">損保ジャパン・SRIオープン</a>              | 未来のちから         | 損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント | CSR      | 874               | インテグレックス                           |
| 15              | 2005/4/28  | バイブリッジひろぎん 日本株式CSRファンド                      | クラスG           | バイブリッジ・インベストメンツ      | CSR      | 179               | Institutional Shareholder Services |
| 16              | 2005/8/12  | 日本SRIオープン                                   | 絆              | 岡三アセットマネジメント         | CSR      | 880               | 富国生命投資顧問                           |
| 17              | 2006/2/6   | インベスコ日本株式フォーカスアルファ                          | プラスアングル        | インベスコ投信投資顧問          |          | 3,545             |                                    |
| 18              | 2006/3/9   | <a href="#">ダイワ・エコ・ファンド</a>                 |                | 大和証券投資信託委託           | 環境       | 5,985             | 日本総合研究所                            |
| 19              | 2006/6/12  | <a href="#">住信日本株式SRIファンド</a>               |                | 住信アセットマネジメント         | CSR      | 3,392             | 日本総合研究所                            |
| 20              | 2006/6/30  | アムンディ・リソナウーマンJファンド                          | LoveMe!PREMIUM | アムンディ・ジャパン           | ウーマン/シス  | 421               |                                    |
| 21              | 2006/11/30 | 中央三井社会的責任ファンド                               | SRI計画          | 中央三井アセットマネジメント       | CSR      | 521               | インテグレックス                           |
| 22              | 2006/12/8  | しんきんSRIファンド                                 |                | しんきんアセットマネジメント投信     | CSR      | 313               | 富国生命投資顧問                           |
| 23              | 2007/2/16  | <a href="#">STAM SRI・ジャパン・オープン (SMA専用)</a>  |                | 住信アセットマネジメント         | CSR      | 1,481             | 日本総合研究所                            |
| 24              | 2007/12/20 | バイブリッジ日本株式SRIファンド                           |                | バイブリッジ・インベストメンツ      | CSR      | 14                | Institutional Shareholder Services |
| 25              | 2008/4/18  | <a href="#">損保ジャパン・エコ・オープン (配当利回り重視型)</a>   |                | 損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント | 環境       | 347               | NKSJリスクマネジメント                      |
| 26              | 2008/4/25  | <a href="#">ニッセイ健康応援ファンド</a>                |                | ニッセイアセットマネジメント       | 健康       | 43                | ニッセイアセットマネジメント                     |
| 27              | 2008/6/27  | 環境立国日本株オープン                                 |                | 国際投信投資顧問株式会社         | 環境       | 663               | 株式会社三菱総合研究所                        |
| 28              | 2008/12/25 | <a href="#">ダイワ・エネルギーテクノロジー・ファンド (固定追加)</a> |                | 大和証券投資信託委託           | エネルギー    | 2,300             |                                    |
| 29              | 2009/2/27  | <a href="#">次世代環境ビジネスファンド</a>               |                | 大和住銀投信投資顧問           | 環境       | 806               |                                    |
| 30              | 2009/4/27  | <a href="#">上場インデックスFTSE日本グリーンチャップ35</a>    | 上場日本グリーンチャップ35 | 日興アセットマネジメント         | 環境       | 914               |                                    |
| 31              | 2009/6/26  | <a href="#">環境ビジネス日本株オープン</a>               |                | 大和住銀投信投資顧問           | 環境       | 167               |                                    |
| 32              | 2009/7/24  | <a href="#">環境ニューデールファンド</a>                |                | 住信アセットマネジメント         | 環境       | 876               |                                    |
| 33              | 2009/9/30  | DIAMジャパングリーンファンド(単位型)                       | 新三種の神器         | DIAMアセットマネジメント       | 環境       | 898               |                                    |
| 34              | 2010/11/29 | 中央三井環境関連日本株ファンド                             | エコの声           | 中央三井アセットマネジメント       | 環境       | 41                | インテグレックス                           |
| 35              | 2010/3/29  | 結い12101                                     |                | 鎌倉投信                 | 経済・環境・社会 | 1,029             |                                    |
| 36              | 2010/8/2   | <a href="#">生物多様性企業応援ファンド</a>               | 生きものがたり        | 住信アセットマネジメント         | 環境       | 85                |                                    |
| <b>国内株式型 小計</b> |            |                                             |                |                      |          | <b>76,993</b>     |                                    |

## 公募SRI投信一覧 2011年12月末

新規追加ファンド

## 100%SRIファンド

| 設定年月日               | ファンド名称                                           | ファンド愛称           | 運用会社                   | 評価項目           | 純資産総高              | 調査・助言                            |
|---------------------|--------------------------------------------------|------------------|------------------------|----------------|--------------------|----------------------------------|
| <b>国際株式型</b>        |                                                  |                  |                        |                |                    |                                  |
| 2000/11/17          | 日興グローバル・サステナビリティ・ファンドA(ヘッジなし)                    | globe            | 日興アセットマネジメント           | CSR            | 0(10/8/20<br>償還)   | Sustainable Asset Management     |
| 2001/10/25          | 年益積立グローバル・サステナビリティ(ヘッジなし)                        | DCグループ(ヘッジなし)    | 日興アセットマネジメント           | 経済・環境・社会       | 0(10/8/20<br>償還)   | Sustainable Asset Management     |
| 2000/11/17          | 日興グローバル・サステナビリティ・ファンドB(ヘッジあり)                    | globe            | 日興アセットマネジメント           | CSR            | 0(10/8/20<br>償還)   | Sustainable Asset Management     |
| 2001/10/25          | 年益積立グローバル・サステナビリティ(ヘッジあり)                        | DCグループ(ヘッジあり)    | 日興アセットマネジメント           | 経済・環境・社会       | 0(10/8/20<br>償還)   | Sustainable Asset Management     |
| 2001/6/15           | グローバル・エコ・グロース・ファンドAコース(為替ヘッジあり)                  | Mi:グリーン          | 大和住銀投信投資顧問             | 環境             | 0(08/9/5<br>償還)    | 1.ロウ・プライス・グローバルアセットマネジメント        |
| 2001/6/15           | グローバル・エコ・グロース・ファンドBコース(為替ヘッジなし)                  | Mi:グリーン          | 大和住銀投信投資顧問             | 環境             | 0(08/9/5<br>償還)    | 1.ロウ・プライス・グローバルアセットマネジメント        |
| 2003/11/7           | UBSグローバル株式40                                     |                  | UBSグローバル・アセット・マネジメント   | CSR            | 0(08/12/18<br>償還)  | UBS AG                           |
| 37 2004/3/26        | ワールド・ウォーター・ファンドAコース(為替ヘッジあり)                     |                  | 野村アセットマネジメント           | 環境(水)          | 2,702              | ビクテアセットマネジメントほか                  |
| 38 2004/3/26        | ワールド・ウォーター・ファンドBコース(為替ヘッジなし)                     |                  | 野村アセットマネジメント           | 環境(水)          | 9,980              | ビクテアセットマネジメントほか                  |
| 39 2004/5/28        | 野村グローバルSRI100                                    | 野村世界社会的責任投資      | 野村アセットマネジメント           | CSR            | 1,546              | FTSE4Good Global100 Index        |
| 40 2004/7/30        | 野村世界SRIインデックスファンド(確定拠出年金向け)                      |                  | 野村アセットマネジメント           |                | 58                 | FTSE                             |
| 2005/11/11          | アジアSRIファンド                                       |                  | フォルティス・アセットマネジメント      | CSR            | 0(08/11/23<br>償還)  | モーニングスターアセットマネジメント               |
| 41 2006/6/30        | 地球温暖化防止関連株ファンド                                   | 地球力              | 新光投信                   | 環境             | 3,327              | KLD Global Climate 100 Index     |
| 42 2006/12/20       | 日興・DWSニュー・リソース・ファンド                              | ライジング・トゥモロー      | ドイチェ・アセットマネジメント        |                | 17,615             | -                                |
| 43 2007/6/15        | <a href="#">グローバルウォーター・ファンド</a>                  |                  | 日興アセットマネジメント           | 環境(水)          | 1,260              | Sustainable Asset Management     |
| 44 2007/6/29        | ニュージェネレーション世界環境                                  | 水と太陽             | ユナイテッド投信投資顧問           | 環境(水)<br>エネルギー | 39                 | ニュージェネレーション指数                    |
| 45 2007/7/25        | 地球温暖化防止関連株ファンド(3ヵ月決算型)                           | 地球力              | 新光投信                   | 環境             | 1,412              | KLD Global Climate 100 Index     |
| 46 2007/7/26        | DWS地球温暖化対策関連株投信(単位型)                             |                  | ドイチェ・アセット・マネジメント       | 環境             | 13,100             | -                                |
| 47 2007/7/27        | 三菱UFJグローバル・エコ・ウォーター                              | ブルー・ゴールド         | 三菱UFJ投信                | 環境(水)          | 9,506              | KBCアセット・マネジメント・エヌビ               |
| 48 2007/8/29        | 野村アクア投資Aコース(為替ヘッジあり)                             |                  | 野村アセットマネジメント           | 環境(水)          | 1,210              | SAMサステナブルアセット・マネジメントAG           |
| 49 2007/8/29        | 野村アクア投資Bコース(為替ヘッジなし)                             |                  | 野村アセットマネジメント           | 環境(水)          | 12,743             | SAMサステナブルアセット・マネジメントAG           |
| 50 2007/8/31        | UBS地球温暖化対応関連株ファンド                                | クールアース           | UBSグローバル・アセット・マネジメント   | 環境             | 5,605              | -                                |
| 51 2007/8/31        | 温暖化対策株式オ・ブン                                      | グリーン・プラネット       | 国際投信投資顧問               | 環境             | 2,039              | シュローダー・インベストメント・マネジメント・リミテッド     |
| 52 2007/8/31        | 地球温暖化対策株式オ・ブン                                    | 地球愛              | 国際投信投資顧問               | 環境             | 594                | シュローダー・インベストメント・マネジメント・リミテッド     |
| 53 2007/8/31        | <a href="#">地球環境株ファンド</a>                        | 環境くん             | 大和証券投資信託委託             | 環境             | 518                | FTSE                             |
| 54 2007/8/31        | DWS新資源テクノロジー・ファンド                                | グローバル・シフト        | ドイチェ・アセットマネジメント        |                | 2,816              | -                                |
| 55 2007/9/19        | DIAM世界環境ビジネスファンド                                 | シロクマ             | DIAMアセットマネジメント         |                | 1,416              |                                  |
| 56 2007/9/27        | 温暖化防止環境関連株オ・ブン                                   | 緑の地球             | 岡三アセットマネジメント           | 環境             | 303                | エヌコー知財フィナンシャルサービス、DWSフィナンシャルサービス |
| 2007/9/28           | 世界サステナビリティ株式ファンド                                 | 環境博士             | T&Dアセットマネジメント          | CSR            | 0(10/4/16<br>繰上償還) | サステイナブルアセットマネジメント                |
| 57 2007/10/29       | フィデリティ・スリー・ベースックF                                | 水と大地とエネルギー       | フィデリティ投信               | エネルギー          | 4,177              | (インデックス運用)<br>ジオード・キャピタル         |
| 58 2007/12/6        | <a href="#">東京海上セレクト世界株式ファンド</a>                 | プレミアムワールド        | 東京海上アセットマネジメント         | 環境             | 1,870              | 現地法人<br>(英・米・シンガポール)             |
| 2007/12/17          | アムンディ世界水関連株式F                                    | ブルーマリン           | アムンディ・ジャパン             | 環境(水)          | 0(10/12/1<br>償還)   | イデアム、インスパイア・インベスト                |
| 59 2007/12/20       | TAクリン・エネルギー・ファンド                                 | 地球の健康            | トヨタアセットマネジメント          | 環境             | 436                | ロンバー・オデュー・グループ・ハンチントン・カンパニー      |
| 60 2007/12/21       | アムンディ世界環境力株式F                                    | グリーン・ワールド        | アムンディ・ジャパン             | 環境             | 103                | イデアム                             |
| 61 2008/3/12        | 地球温暖化対策株式F                                       | 青い地球             | 三菱UFJ投信                | 環境             | 1,162              | KBCアセット・マネジメント(ダブリン)             |
| 62 2008/3/25        | グローバル・アンブレラUBSエコ                                 | グローバル・アンブレラUBSエコ | UBSグローバル・アセット・マネジメント   | 環境             | 138                | (インデックス運用)<br>UBSグローバルIAM        |
| 63 2008/5/1         | ラッセル世界環境テクノロジー・ファンド                              |                  | ラッセルインベストメント           | 環境             | 7,881              | インバックス・アセット・マネジメント、FTSE<br>他2社   |
| 64 2008/6/27        | 中国環境関連ビジネスファンド                                   | グリーンチャイナ         | T&Dアセットマネジメント          | 環境             | 283                | 国泰君安アセット(アジア)                    |
| 65 2008/7/31        | 三菱UFJ地球環境ビジネス株ファンド                               | フューチャー・ビジョン      | 三菱UFJ投信                | 環境             | 233                | ピー・エヌ・ビー・パリバアセットマネジメント・エス・エイ・エス  |
| 66 2009/6/24        | 野村RCMグリーンテクノロジー・ファンド                             |                  | 野村アセットマネジメント           | 環境             | 4,730              | RCM                              |
| 67 2009/8/26        | <a href="#">ダイワブティック<br/>グリーン・ニュー・エネルギー・ファンド</a> |                  | 大和証券投資信託委託             | 環境             | 5,514              | -                                |
| 68 2009/12/18       | フォルティス中国環境関連株式投信                                 |                  | BNPパリバ インベストメント・パートナーズ | 環境             | 11,527             | -                                |
| 69 2010/2/26        | アジア環境関連株オープン                                     | グリーンドラゴン         | 岡三アセットマネジメント           | 環境             | 183                | RCM                              |
| 70 2010/3/26        | <a href="#">チャイナ・グッドカンパニー</a>                    |                  | 住信アセットマネジメント           | 環境             | 5,665              | 日本総合研究所、RCM                      |
| 71 2010/4/28        | DWS鉄道関連株式ファンド                                    |                  | ドイチェ・アセット・マネジメント       | 環境             | 1,142              | -                                |
| 72 2010/4/28        | DWS次世代自動車関連株式ファンド                                |                  | ドイチェ・アセット・マネジメント       | 環境             | 999                | -                                |
| <b>国際株式型 小計</b>     |                                                  |                  |                        |                | <b>133,632</b>     |                                  |
| <b>国際債券型</b>        |                                                  |                  |                        |                |                    |                                  |
| 73 2008/11/10       | <a href="#">ニッセイ環境先進国債券ファンド</a>                  | エコインカム           | ニッセイアセットマネジメント         | 環境             | 443                |                                  |
| <b>100%SRIファンド計</b> |                                                  |                  |                        |                | <b>211,268</b>     |                                  |

\*各データにつきましては、モーニングスター社ほか運用会社のホームページを参照しました。

注) は新規に追加したファンド

掲載ファンドは、評価項目がCSR、環境の他、水、エネルギー関連を対象としている。

公募SRI投信一覧 2011年12月末

新規追加ファンド

## 運用資産の一部にESGを配慮しているファンド

(百万円)

| 設定年月日                      | ファンド名称     | ファンド愛称                                             | 運用会社           | 評価項目                     | 純資産残高          | SRI比率  | SRI純資産残高 | 調査・助言             |                               |
|----------------------------|------------|----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|----------------|--------|----------|-------------------|-------------------------------|
| <b>国内ハイブリッド型</b>           |            |                                                    |                |                          |                |        |          |                   |                               |
| 74                         | 2000/10/31 | <a href="#">エコ・バランス</a>                            | 海と空            | 三井住友アセットマネジメント株式会社       | 環境             | 792    | 50%      | 396               | 株式会社インターリスク総研                 |
| 75                         | 2007/1/19  | ウーマノミクスバランス株式70<br>(積極成長)                          | KIRARIきらり Bコース | アムンディ・ジャパン               | カーマックス         | 478    | 70%      | 335               |                               |
| <b>国内ハイブリッド型 小計</b>        |            |                                                    |                |                          |                |        |          | <b>731</b>        |                               |
| <b>国際ハイブリッド型</b>           |            |                                                    |                |                          |                |        |          |                   |                               |
| 76                         | 2005/12/22 | DIAM高格付インカム・オープンSRI<br>(毎月決算コース)                   | ハッピークローバーSRI   | DIAMアセットマネジメント           | CSR            | 635    | 25%      | 159               | インテグレックス                      |
| 77                         | 2006/3/14  | <a href="#">6資産バランスファンド<br/>(分配型)</a>              | ダブルウィング        | 大和証券投資信託委託               | CSR            | 8,769  | 20%      | 1,754             | oekom research AG,<br>日本総合研究所 |
| 78                         | 2006/3/14  | <a href="#">6資産バランスファンド<br/>(成長型)</a>              | ダブルウィング        | 大和証券投資信託委託               | CSR            | 6,086  | 50%      | 3,043             | oekom research AG,<br>日本総合研究所 |
| 79                         | 2006/5/26  | 自然環境保護ファンド                                         | 尾瀬紀行           | DIAMアセットマネジメント           | CSR            | 2,504  | 50%      | 1,252             | インテグレックス                      |
| 80                         | 2006/6/28  | <a href="#">世界6資産均等分散ファンド<br/>(毎月分配型)</a>          | ベストシックス        | 大和証券投資信託委託               | CSR            | 3,021  | 32%      | 967               | oekom research AG,<br>日本総合研究所 |
| 81                         | 2006/9/27  | <a href="#">「しがきん」SRI三資産バランス・<br/>オープン(奇数月分配型)</a> | OHみらい          | 大和証券投資信託委託               | CSR            | 251    | 45%      | 113               | インテグレックス                      |
| 82                         | 2007/1/19  | ウーマノミクスバランス株式30<br>(毎月分配)                          | KIRARIきらり Aコース | アムンディ・ジャパン               | カーマックス         | 593    | 30%      | 178               |                               |
| 83                         | 2007/8/31  | <a href="#">地球環境株・外債バランス・ファンド</a>                  | 地球くん           | 大和証券投資信託委託               | 環境             | 634    | 30%      | 190               | FTSE                          |
| 84                         | 2007/12/14 | 環境保全・グローバルバランス                                     | 地球カプラス         | 新光投信                     | 環境             | 382    | 30%      | 115               | (インデックス運用)                    |
|                            | 2007/12/21 | アムンディ・リソナ世界グリーン・バ<br>ランスF                          | あしたの地球         | アムンディ・ジャパン               | 環境             |        |          | 0(11/10/11<br>償還) |                               |
| 85                         | 2008/4/18  | <a href="#">イオン好配当グリーン・バランス・<br/>オープン</a>          | みどりのふたば        | 損保ジャパン日本興亜アセットマネ<br>ジメント | 環境             | 186    | 50%      | 93                | NKSJリスクマネジメント                 |
| 86                         | 2008/8/27  | 環境未来バランス・オープン                                      | 環境宣言           | 岡三アセットマネジメント             | 環境             | 21     | 50%      | 11                |                               |
| 87                         | 2010/7/30  | <a href="#">グリーンバランスファンド</a>                       | グリーングリーン       | 日興アセットマネジメント             | 環境             | 3,042  | 51%      | 1,551             |                               |
| 88                         | 2011/3/1   | <a href="#">大和マイクロファイナンス・ファンド</a>                  |                | 東京海上アセットマネジメント           | マイクロファイ<br>ナンス | 15,550 | 50%      | 7,775             |                               |
| <b>国際ハイブリッド型 小計</b>        |            |                                                    |                |                          |                |        |          | <b>17,200</b>     |                               |
| <b>国際債券型</b>               |            |                                                    |                |                          |                |        |          |                   |                               |
| 89                         | 2010/6/24  | <a href="#">グリーン世銀債ファンド</a>                        |                | 日興アセットマネジメント             |                | 47,839 | 30%      | 14,352            |                               |
| <b>SRI比率ファンド計</b>          |            |                                                    |                |                          |                |        |          | <b>32,282</b>     |                               |
| <b>11年12月末公募SRI純資産残高合計</b> |            |                                                    |                |                          |                |        |          | <b>243,550</b>    |                               |

\*各データにつきましては、モーニングスター社ほか運用会社のホームページを参照しました。

注) は新規に追加したファンド

SRI比率は各ファンドの目録見書に記載の比率を参照しました。  
掲載ファンドは、評価項目がCSR、環境の他、水、エネルギー関連を対象としている。

## 【免責事項】

当一覧に記載されている情報は、

1. 情報提供のみを目的とするものであり、有価証券の取引等の勧誘等を行うものでも、証券投資に関する助言等を提供するものでもなく、

2. 正確性や完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。

さらに、記載の内容や統計数値につきましては、正確性を期すための努力を行いました。情報の漏れや誤りについて、またこの情報に基いて下されたいかなる判断や行動によって

生じた間接的・直接的損害に対して、当法人は何らの責任を負うものではありません。

個人向けインパクトインベストメント債券の国内販売実績

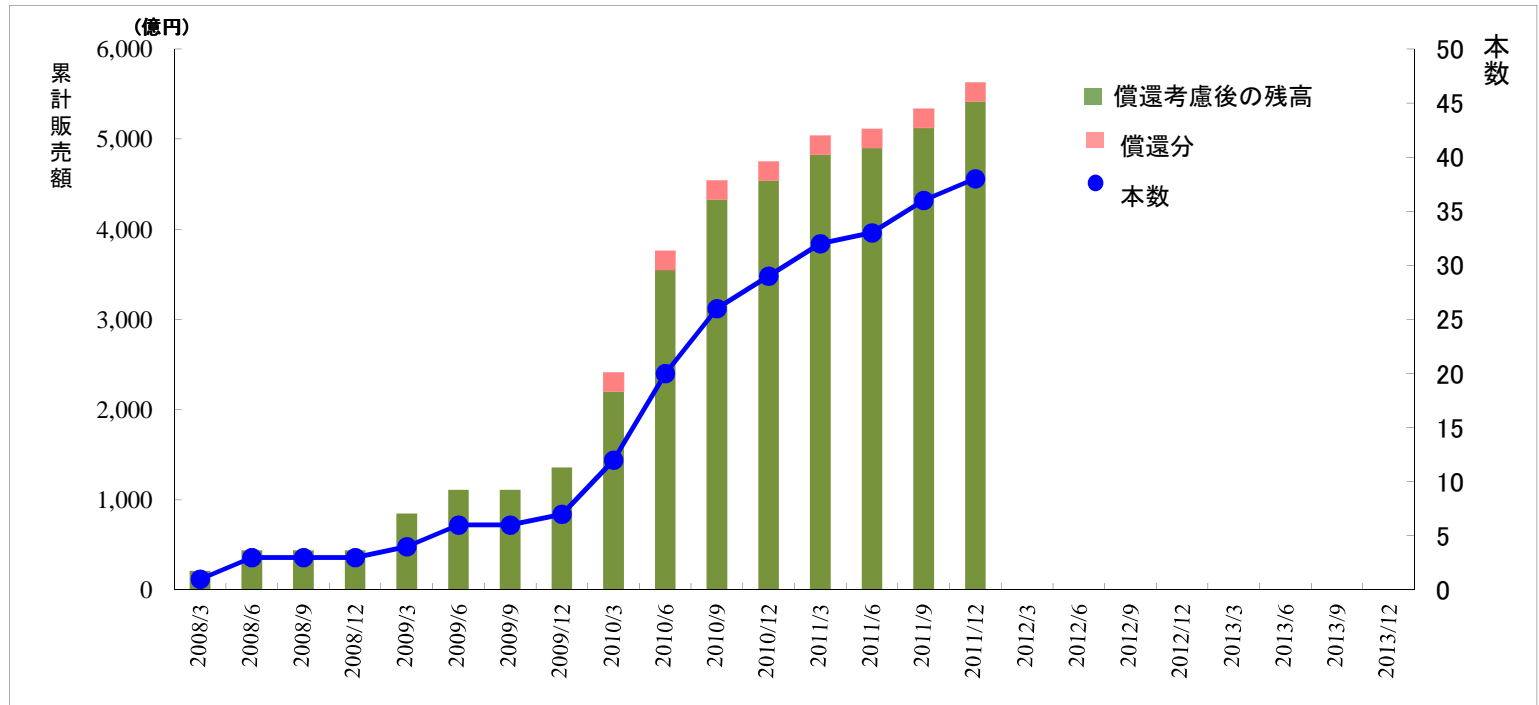
|       | 商品名                          | 発行体                | 資金使途                             | 引受証券会社 | 発行通貨  | 利率                 | 年限    | 受渡日         | 販売額(概算) |
|-------|------------------------------|--------------------|----------------------------------|--------|-------|--------------------|-------|-------------|---------|
| 2008年 | ワクチン債                        | 予防接種のための国際金融ファンリティ | 開発途上国の子供達にワクチンを提供                | 大和     | ZAR   | 9.90%              | 2年    | 2008年3月19日  | 213億円   |
|       | ワールドワールボンド(World CO2L™ Bond) | 世界銀行               | 中国の水力発電事業が発行する排出権に利率が連動          | 大和     | USD   | 排出権価格連動            | 5年3ヶ月 | 2008年6月27日  | 27億円    |
| 2009年 | ワクチン債                        | 予防接種のための国際金融ファンリティ | 開発途上国の子供達にワクチンを提供                | 大和     | ZAR   | 6.26%              | 3年    | 2009年2月20日  | 295億円   |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 2.60%              |       |             | 27億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | NZD   | 2.65%              |       |             | 86億円    |
| 2009年 | ワクチン債                        | 予防接種のための国際金融ファンリティ | 開発途上国の子供達にワクチンを提供                | 三菱UFJ  | USD   | 1.00%              | 3年    | 2009年5月28日  | 101億円   |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 3.51%              |       |             | 37億円    |
| 2009年 | ワクチン債                        | 予防接種のための国際金融ファンリティ | 開発途上国の子供達にワクチンを提供                | HSBC   | AUD   | 4.36%              | 4年    | 2009年6月25日  | 54億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | ZAR   | 6.85%              |       |             | 28億円    |
| 2009年 | マイクロファイナンス・ボンド               | 国際金融公社             | マイクロファイナンス機関への投融資                | 大和     | AUD   | 5.10%              | 3年    | 2009年11月20日 | 246億円   |
| 2010年 | グリーン世銀債                      | 世界銀行               | 地球温暖化対策事業を支援                     | 大和     | NZD   | 5.23%              | 5年    | 2010年2月3日   | 97億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | ZAR   | 7.43%              |       |             | 28億円    |
| 2010年 | 環境支援債                        | 北欧投資銀行             | 環境関連プロジェクトに融資                    | 野村     | NZD   | 4.49%              | 3年    | 2010年2月3日   | 161億円   |
|       |                              |                    |                                  |        | ZAR   | 7.43%              |       |             | 28億円    |
| 2010年 | みらいの地球債                      | 欧州投資銀行             | 再生可能エネルギーやエネルギー効率化プロジェクトを支援      | HSBC   | BRL   | 8.00%              | 5年    | 2010年3月16日  | 150億円   |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 4.83%              |       |             | 14億円    |
| 2010年 | ワクチン債                        | 予防接種のための国際金融ファンリティ | 開発途上国の子供達にワクチンを提供                | 大和     | ZAR   | 7.15%              | 3年    | 2010年3月24日  | 309億円   |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 4.36%              |       |             | 54億円    |
| 2010年 | クリーンエネルギーボンド                 | アフリカ開発銀行           | クリーンエネルギー開発事業                    | みずほ    | NZD   | 4.52%              | 4年    | 2010年3月30日  | 72億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 4.68%              |       |             | 69億円    |
| 2010年 | ウォーター・ボンド                    | アジア開発銀行            | アジア・太平洋地域における水関連事業を支援            | 大和     | ZAR   | 7.18%              | 3年    | 2010年4月16日  | 265億円   |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 4.40%              |       |             | 339億円   |
| 2010年 | エコロジー・ボンド                    | 欧州投資銀行             | 再生可能エネルギーやエネルギー効率化プロジェクトを支援      | 大和     | ZAR   | 6.68%              | 3年    | 2010年5月21日  | 156億円   |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 4.27%              |       |             | 170億円   |
| 2010年 | クリーンエネルギーボンド                 | アフリカ開発銀行           | クリーンエネルギー開発事業                    | みずほ    | AUD   | 4.68%              | 3年6ヶ月 | 2010年5月28日  | 309億円   |
|       |                              |                    |                                  |        | NZD   | 4.35%              |       |             | 309億円   |
| 2010年 | グリーンボンド                      | ノルウェー地方金融公社        | 消費エネルギーの削減および温室効果ガス排出の削減を支援      | 日興     | ZAR   | 7.08%              | 3年    | 2010年5月28日  | 28億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 5.23%              |       |             | 66億円    |
| 2010年 | グリーン世銀債                      | 世界銀行               | 地球温暖化対策事業を支援                     | SBI    | ZAR   | 7.20%              | 5年    | 2010年6月9日   | 3億円     |
|       |                              |                    |                                  |        | MXN   | 6.15%              |       |             | 3億円     |
| 2010年 | マイクロファイナンス・ボンド               | 欧州復興開発銀行           | MSEへ金融サービスを提供するマイクロファイナンス機関への投融資 | 大和     | ZAR   | 6.70%              | 3年    | 2010年6月15日  | 87億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 4.00%              |       |             | 115億円   |
| 2010年 | グリーンボンド                      | ノルウェー地方金融公社        | 消費エネルギーの削減および温室効果ガス排出の削減を支援      | 日興     | ZAR   | 6.60%              | 3年    | 2010年6月29日  | 9億円     |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 5.00%              |       |             | 19億円    |
| 2010年 | ワクチン債                        | 予防接種のための国際金融ファンリティ | 開発途上国の子供達にワクチンを提供                | HSBC   | ZAR   | 0.5% (最終利回り7.048%) | 10年   | 2010年6月29日  | 27億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 4.77%              |       |             | 4年      |
| 2010年 | 中南米 子育て支援債                   | 米州開発銀行             | 中南米における貧困対策事業を支援                 | 大和     | BRL   | 8.12%              | 4年    | 2010年7月15日  | 139億円   |
|       |                              |                    |                                  |        | NZD   | 3.70%              |       |             | 12億円    |
| 2010年 | クリーンエネルギーボンド                 | アフリカ開発銀行           | クリーンエネルギー開発事業                    | HSBC   | BRL   | 0.5% (最終利回り10.52%) | 7年    | 2010年7月29日  | 11億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 4.42%              |       |             | 13億円    |
| 2010年 | グリーンボンド                      | アフリカ開発銀行           | クリーンエネルギー開発事業                    | 日興     | AUD   | 4.42%              | 3年    | 2010年8月27日  | 13億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | NZD   | 3.70%              |       |             | 12億円    |
| 2010年 | アフリカ教育ボンド                    | アフリカ開発銀行           | アフリカにおける教育関連プロジェクトを支援            | 大和     | ZAR   | 5.95%              | 3年    | 2010年8月30日  | 118億円   |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 4.35%              |       |             | 89億円    |
| 2010年 | マイクロファイナンス・ボンド               | 国際金融公社             | マイクロファイナンス機関への投融資                | 大和     | ZAR   | 5.70%              | 3年    | 2010年9月22日  | 175億円   |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 4.00%              |       |             | 115億円   |
| 2010年 | クリーンエナジー・ボンド                 | アジア開発銀行            | アジア・太平洋地域におけるクリーンエネルギー関連事業       | HSBC   | AUD   | 4.35%              | 4年    | 2010年9月30日  | 37億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | TRY   | 0.5% (最終利回り6.363%) |       |             | 7年      |
| 2010年 | クリーンエネルギーボンド                 | アフリカ開発銀行           | クリーンエネルギー開発事業                    | HSBC   | BRL   | 7.02%              | 4年    | 2010年9月30日  | 57億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | BRL   | 0.5% (最終利回り8.222%) |       |             | 7年      |
| 2010年 | クリーンエネルギーボンド                 | アフリカ開発銀行           | クリーンエネルギー開発事業                    | HSBC   | BRL   | 0.5% (最終利回り18.32%) | 6年    | 2010年10月29日 | 57億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 4.80%              |       |             | 4年      |
| 2010年 | クリーンエネルギーボンド                 | アフリカ開発銀行           | クリーンエネルギー開発事業                    | みずほ    | NZD   | 3.71%              | 4年    | 2010年10月29日 | 12億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | ZAR   | 5.68%              |       |             | 3年6ヶ月   |
| 2010年 | エコロジー・ボンド                    | 欧州投資銀行             | 再生可能エネルギーやエネルギー効率化プロジェクトを支援      | 大和     | TRY   | 6.62%              | 3年    | 2010年11月12日 | 98億円    |
| 2011年 | 中南米 子育て支援債                   | 米州開発銀行             | 中南米における貧困対策事業を支援                 | 大和     | BRL   | 7.05%              | 3年    | 2011年2月2日   | 196億円   |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 4.86%              |       |             | 3年      |
| 2011年 | グリーンIFC債                     | 国際金融公社             | 環境関連プロジェクトに融資                    | 野村     | AUD   | 5.00%              | 4年    | 2011年3月29日  | 6億円     |
|       |                              |                    |                                  |        | ZAR   | 7.00%              |       |             | 4年      |
| 2011年 | クリーンエナジー・ボンド                 | ノルウェー地方金融公社        | 消費エネルギーの削減および温室効果ガス排出の削減を支援      | HSBC   | INR   | 5.00%              | 4年    | 2011年3月29日  | 1億円     |
|       |                              |                    |                                  |        | BRL   | 8.00%              |       |             | 3年      |
| 2011年 | ワクチン債                        | 予防接種のための国際金融ファンリティ | 開発途上国の子供達にワクチンを提供                | 大和     | BRL   | 0.5% (最終利回り7.50%)  | 4年    | 2011年3月30日  | 8億円     |
|       |                              |                    |                                  |        | JPY   | 1%or10%            |       |             | 1年      |
| 2011年 | グリーンIFC債                     | 国際金融公社             | 環境関連プロジェクトに融資                    | 野村     | AUD   | 4.75%              | 3年    | 2011年5月20日  | 36億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | ZAR   | 6.10%              |       |             | 3年      |
| 2011年 | グリーンIFC債                     | 国際金融公社             | 環境関連プロジェクトに融資                    | 野村     | EUR   | 1.43%              | 3年    | 2011年5月20日  | 18億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | BRL   | 0.5% (最終利回り)       |       |             | 3年      |
| 2011年 | クリーンエナジー・ボンド                 | ノルウェー地方金融公社        | 消費エネルギーの削減および温室効果ガス排出の削減を支援      | HSBC   | BRL   | 0.5% (最終利回り)       | 3年    | 2011年8月31日  | 20億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 3.40%              |       |             | 4年      |
| 2011年 | ワクチン債                        | 予防接種のための国際金融ファンリティ | 開発途上国の子供達にワクチンを提供                | JPモルガン | ZAR   | 6.10%              | 5年    | 2011年9月30日  |         |
|       |                              |                    |                                  |        | BRL   | 6.00%              |       |             | 3年      |
| 2011年 | グリーンIFC債                     | 国際金融公社             | 環境関連プロジェクトに融資                    | 野村     | AUD   | 3.69%              | 4年    | 2011年9月30日  |         |
|       |                              |                    |                                  |        | TRY   | 4.92%              |       |             | 4年      |
| 2011年 | エコロジー・ボンド                    | 北欧投資銀行             | 大気汚染や水質汚染の防止など環境改善のためのプロジェクトを支援  | 大和     | ZAR   | 4.90%              | 4年    | 2011年11月25日 |         |
|       |                              |                    |                                  |        | AUD   | 4.80%              |       |             | 4年      |
| 2011年 | JICA債(第10回国際協力機構債券)          | JICA               | 日本政府による開発途上国向け有償資金協力(円借款)に全額充当   | 大和     | JPY   | 0.38%              | 4年    | 2011年12月20日 | 65億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | 三菱UFJ | 野村                 |       |             | 5億円     |
| 2011年 | JICA債(第11回国際協力機構債券)          | JICA               | 日本政府による開発途上国向け有償資金協力(円借款)に全額充当   | 大和     | JPY   | 1.14%              | 10年   | 2011年12月20日 | 65億円    |
|       |                              |                    |                                  |        | 三菱UFJ | 野村                 |       |             | 5億円     |

大和証券商品企画部調べ(2011年12月30日現在)

累計販売額 5,416億円  
償還考慮後の残高 5,203億円

## 社会貢献型債券の累計販売額と債券本数推移

| (億円)     |       |          |    |
|----------|-------|----------|----|
| 年月(末)    | 累計販売額 | 償還考慮後の残高 | 本数 |
| 2008年3月  | 213   |          | 1  |
| 2008年6月  | 440   |          | 3  |
| 2008年9月  | 440   |          | 3  |
| 2008年12月 | 440   |          | 3  |
| 2009年3月  | 848   |          | 4  |
| 2009年6月  | 1,111 |          | 6  |
| 2009年9月  | 1,111 |          | 6  |
| 2009年12月 | 1,357 |          | 7  |
| 2010年3月  | 2,198 | 1,985    | 12 |
| 2010年6月  | 3,548 | 3,335    | 20 |
| 2010年9月  | 4,328 | 4,115    | 26 |
| 2010年12月 | 4,537 | 4,324    | 29 |
| 2011年3月  | 4,824 | 4,611    | 32 |
| 2011年6月  | 4,899 | 4,686    | 33 |
| 2011年9月  | 5,124 | 4,911    | 36 |
| 2011年12月 | 5,416 | 5,203    | 38 |
| 2012年3月  |       |          |    |
| 2012年6月  |       |          |    |
| 2012年9月  |       |          |    |
| 2012年12月 |       |          |    |
| 2013年3月  |       |          |    |
| 2013年6月  |       |          |    |
| 2013年9月  |       |          |    |
| 2013年12月 |       |          |    |



NPO法人 社会的責任投資フォーラム(SIF-Japan)

2011年12月末日

特定投資家向けインパクトインベストメント債券の起債事例(公表ベース)

(百万円)

| 投資家      | 発行体     | 通貨  | 年限    | 銘柄       | 金額       | 日本円    | 払込日(受渡日)   | 主幹事             | プレスリリース     |
|----------|---------|-----|-------|----------|----------|--------|------------|-----------------|-------------|
| 伊予銀行     | 世界銀行    | 米ドル | 5年    | グリーンボンド  | 50 百万米ドル | ¥4,214 | 2010/9/1   | JPモルガン          | 平成22年9月1日   |
| 山陰合同銀行   | 世界銀行    | 豪ドル | 5年    | グリーンボンド  | 30 百万豪ドル | ¥2,456 | 2010/11/16 | JPモルガン          | 平成22年11月16日 |
| 岩手銀行     | 世界銀行    | 米ドル | 5年    | グリーンボンド  | 10 百万米ドル | ¥837   | 2010/12/1  | 大和証券キャピタル・マーケット | 平成22年12月1日  |
| 紀陽銀行     | 世界銀行    | 米ドル | 5年    | グリーンボンド  | 10 百万米ドル | ¥838   | 2010/12/22 | 大和証券キャピタル・マーケット | 平成22年12月24日 |
| 愛知銀行     | 世界銀行    | 米ドル | 5年3ヶ月 | グリーンボンド  | 30 百万米ドル | ¥2,479 | 2011/1/25  | JPモルガン          | 平成23年1月14日  |
| 香川銀行     | 世界銀行    | 米ドル | 10年   | グリーンボンド  | 5 百万米ドル  | ¥413   | 2011/1/19  | 大和証券キャピタル・マーケット | 平成23年1月19日  |
| 福井銀行     | 世界銀行    | 米ドル | 5年    | グリーンボンド  | 10 百万米ドル | ¥831   | 2011/1/21  | 大和証券キャピタル・マーケット | 平成23年1月24日  |
| 第四銀行     | 世界銀行    | 米ドル | 5年    | グリーンボンド  | 10 百万米ドル | ¥831   | 2011/1/21  | 大和証券キャピタル・マーケット | 平成23年1月24日  |
| 西日本シティ銀行 | アジア開発銀行 | 米ドル | 5年    | ウォーターボンド | 30 百万米ドル | ¥2,466 | 2011/1/26  | 大和証券キャピタル・マーケット | 平成23年1月26日  |
| 山陰合同銀行   | 世界銀行    | 米ドル | 5年    | グリーンボンド  | 30 百万米ドル | ¥2,507 | 2011/2/17  | JPモルガン          | 平成23年2月17日  |
| 北洋銀行     | 世界銀行    | 米ドル | 5年    | グリーンボンド  | 10 百万米ドル | ¥834   | 2011/2/18  | 大和証券キャピタル・マーケット | 平成23年2月18日  |
| 南都銀行     | 世界銀行    | 米ドル | 5年    | グリーンボンド  | 20 百万米ドル | ¥1,639 | 2011/2/25  | 大和証券キャピタル・マーケット | 平成23年2月25日  |
| 大分銀行     | 世界銀行    | 米ドル | 5年    | グリーンボンド  | 10 百万米ドル | ¥793   | 2011/3/17  | 大和証券キャピタル・マーケット | 平成23年4月25日  |
| 武蔵野銀行    | 世界銀行    | 米ドル | 5年    | グリーンボンド  | 10 百万米ドル | ¥837   | 2011/4/15  | 大和証券キャピタル・マーケット | 平成23年4月19日  |
| 大垣共立銀行   | 世界銀行    | 米ドル | 5年    | グリーンボンド  | 10 百万米ドル | ¥802   | 2011/6/14  | 大和証券キャピタル・マーケット | 平成23年6月14日  |
| 鹿児島銀行    | アジア開発銀行 | 米ドル | 5年    | ウォーターボンド | 10 百万米ドル | ¥810   | 2011/6/29  | 大和証券キャピタル・マーケット | 平成23年6月30日  |
| 早稲田大学    | 世界銀行    | 豪ドル | 10年   | グリーンボンド  | 10 百万豪ドル | ¥742   | 2011/10/6  | 大和証券キャピタル・マーケット | 平成23年11月8日  |

大和証券商品企画部調べ(2011年12月30日現在)

※払込日のTTMで円換算