

脱炭素テクノロジー株式ファンド（予想分配金提示型）

愛称：カーボンZERO（予想分配金提示型）

全国3か所に7,588本を植樹、累計16,104本を植樹

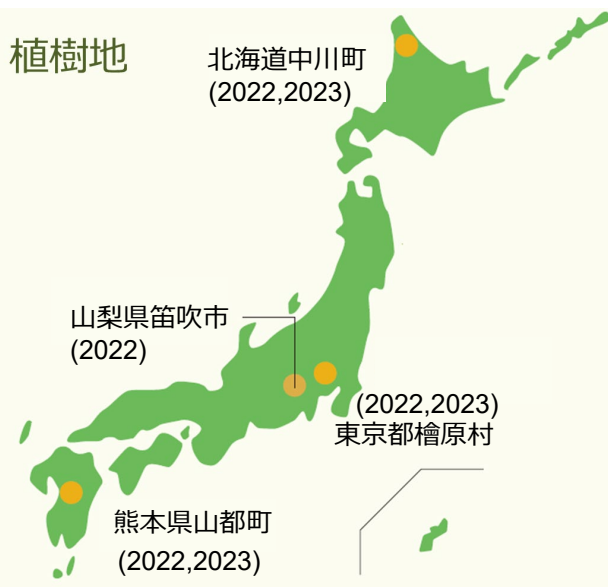
～樹を育て 未来を託す みんなで育む 明日への森～

2023年6月30日



累計植樹本数 **16,104本**

2022年	8,516本
2023年	7,588本



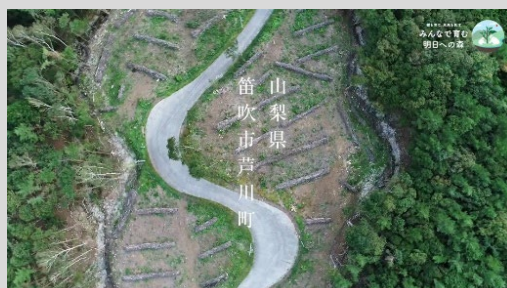
この度、皆さまのお力添えのもと、「みんなで育む明日への森」プロジェクトとして、「脱炭素テクノロジー株式ファンド（愛称：カーボンZERO）」シリーズの信託報酬の一部を認定NPO法人環境リレーションズ研究所へ寄付し、今年度は全国3か所に7,588本、昨年度とあわせて全国4か所に16,104本植樹いたしました。

当プロジェクトは、ファンドが存続する限り毎年2月の純資産総額を基に寄付額を算出し、環境リレーションズ研究所を通じて、現地森林組合と協働のうえ植樹を行います。

今年の植樹は、全国3か所「北海道」「東京都」「熊本県」で実施しました。

当レターでは、ご報告として「東京都西多摩郡檜原村」での植樹風景を次頁にてお届けいたします。

植樹プロジェクトのご紹介



植樹のご報告（東京都西多摩郡檜原村）

東京都西多摩郡檜原村の植樹地をご紹介します。

カタクリやフクジュソウなど希少な植物の自生地も多く、森林生態系の豊かさの象徴であるクマタカをはじめ大型の野生動物も数多く生息している檜原村。都内であることを忘れるほど、美しい山々と清流に育まれた豊かな自然が残されています。

植樹地は、日本の滝百選に選ばれた「払沢（ほっさわ）の滝」にほど近い人工林の伐採跡地です。この伐採跡地に、この地の風土に適したヤマザクラ・コナラ・イロハモミジなどの広葉樹を植樹しました。地元植生の広葉樹の森を育てることで「山笑う（のどかで明るい山を表す季語）」美しい里山を再生します。

植えられた樹々は、現地の森林組合等によって10年間保育管理され、豊かな森へと育っていきます。



All Challenges for ESG Investment

インパクトレポート第2弾発行 ～充実したESGに関する情報開示～

カーボンZEROとして第2弾のインパクトレポートを作成しました。

インパクトレポートでは、ESG投資やSDGsの観点からカーボンZEROが世の中に与えるインパクトを分かりやすく見える化し、皆さまにお届けします。

インパクトレポートを通じて、カーボンZEROへ投資をする意義を皆さまにお伝えできれば幸いです。

年1回発行

インパクトレポート



情報提供資料 2023.5
脱炭素テクノロジー株式会社
カーボンZERO
脱炭素テクノロジー株式会社
カーボンZERO
発行所: 東京都中央区
印刷: 株式会社印刷

こちらより全編ご覧いただけます



当ファンドの過去の保有銘柄

銘柄	保有期間	ESGスコア
エス・エス・エス	2021年10月 - 2022年12月	85
エス・エス・エス	2021年10月 - 2022年12月	85
エス・エス・エス	2021年10月 - 2022年12月	85
エス・エス・エス	2021年10月 - 2022年12月	85
エス・エス・エス	2021年10月 - 2022年12月	85

組入銘柄のインパクト紹介 | オーステッド(デンマーク)

オーステッドは、海上風力発電のグローバルリーダーとして世界的に知られています。風力発電は、再生可能エネルギーの中でも、最も環境負荷が低いエネルギーの一つです。オーステッドは、風力発電の生産から廃棄物の処理まで、環境に配慮した取り組みを行っています。また、オーステッドは、社会貢献活動にも積極的に取り組んでいます。

「カーボンZERO」の投資が生むインパクト

ESGスコア

ESGスコアは、各銘柄のESGに関するリスクと機会を評価するための指標です。カーボンZEROは、ESGスコアが高い銘柄に積極的に投資を行っています。また、ESGスコアが低い銘柄は、ポートフォリオから除外されています。

ESGスコアの推移

カーボンZEROのESGスコアは、2021年から2022年にかけて、全体的に向上しています。これは、カーボンZEROのESG投資戦略が効果を発揮していることを示しています。

ESGスコア

ESGスコアは、各銘柄のESGに関するリスクと機会を評価するための指標です。カーボンZEROは、ESGスコアが高い銘柄に積極的に投資を行っています。また、ESGスコアが低い銘柄は、ポートフォリオから除外されています。

ESGスコアの推移

カーボンZEROのESGスコアは、2021年から2022年にかけて、全体的に向上しています。これは、カーボンZEROのESG投資戦略が効果を発揮していることを示しています。

Pick up

- ファンドの仕組み
- 投資が生むインパクトが見える化
- 投資先の企業のインパクト紹介
- ESG投資の中でもより厳正なルールであるSFDR9条の解説と、それに準拠したファンドである根拠 (ESG投資の実現に関わる運用体制について)

毎月発行

ESG関連レポート



環境への貢献

カーボンZEROは、環境に優しいエネルギーの生産を通じて、環境への貢献を行っています。また、社会貢献活動にも積極的に取り組んでいます。

ESGスコア

ESGスコアは、各銘柄のESGに関するリスクと機会を評価するための指標です。カーボンZEROは、ESGスコアが高い銘柄に積極的に投資を行っています。また、ESGスコアが低い銘柄は、ポートフォリオから除外されています。

ESGスコアの推移

カーボンZEROのESGスコアは、2021年から2022年にかけて、全体的に向上しています。これは、カーボンZEROのESG投資戦略が効果を発揮していることを示しています。

収益分配金に関する留意事項

- ◆ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が支払われるイメージ

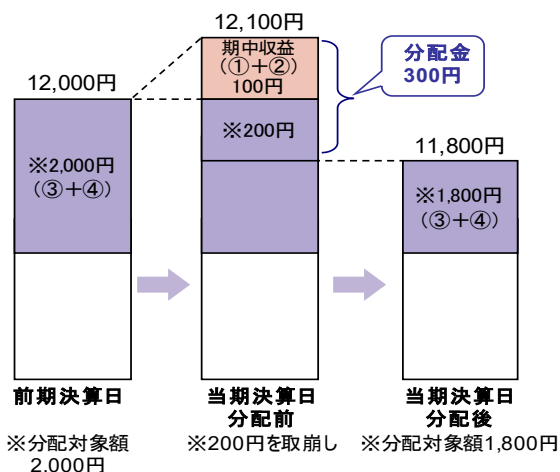
投資信託の純資産

分配金

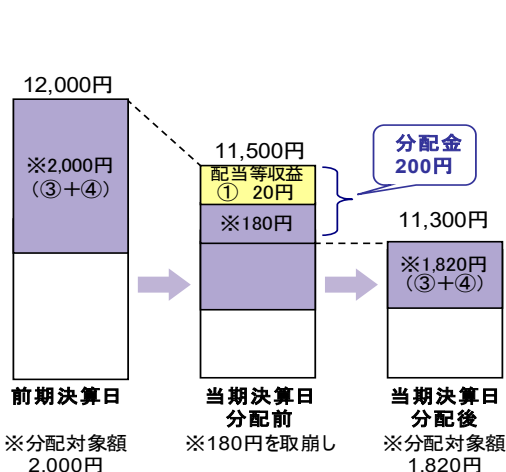
- ◆ 分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算日から基準価額が上昇した場合



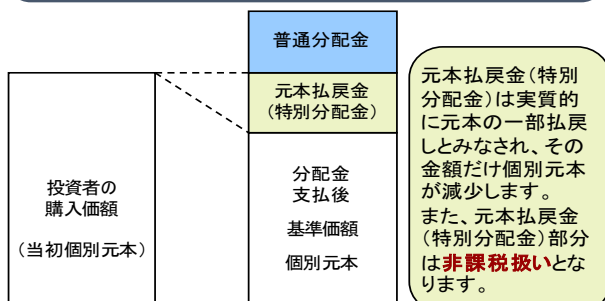
前期決算日から基準価額が下落した場合



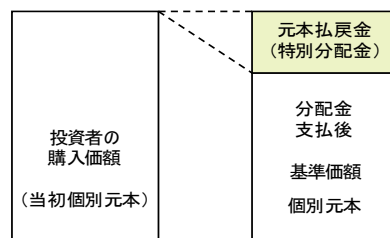
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

- ◆ 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金 : 個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金 : 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の(特別分配金)額だけ減少します。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

ファンドの目的・特色

ファンドの目的

日本を含む世界の株式等の中から、脱炭素社会の実現に向けたソリューションを提供する企業に投資し、信託財産の成長をめざします。

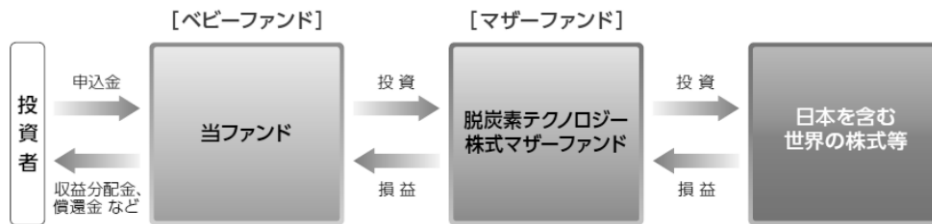
ファンドの特色

1. 日本を含む世界の株式等の中から、脱炭素社会の実現に向けたソリューションを提供する企業に投資します。
※当ファンドにおいて「ソリューション」とは、温室効果ガスの排出を削減するテクノロジーやサービス等を指します。
※株式等にはDR（預託証券）およびリート（不動産投資信託証券）を含みます。
2. 運用にあたっては、カンドリアム・エス・シー・エーから助言を受けます。

カンドリアム・エス・シー・エーについて

- 米国最大級の生命保険相互会社のニューヨークライフ・インシュアランス・カンパニー傘下の運用会社です。創業時よりESG投資に積極的に取り組んでいます。
グローバルテーマ株チーム、ファンダメンタル株チーム、そしてESGチームが協業して当戦略の運用を担っています。

3. 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。
ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。



4. 毎月11日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行いません。

（注）第1計算期間は、2022年5月11日（休業日の場合翌営業日）までとします。

- 計算期末の前営業日の基準価額に応じ、下記の金額の分配をめざします。
※ 基準価額は1万口当たりとし、既払分配金を加算しません。
※ 当該計算期末に向けて基準価額が急激に変動した場合等には、下記の分配を行わないことがあります。

計算期末の前営業日の基準価額	分配金額(1万口当たり、税引前)
10,000円以上 11,000円未満	基準価額の水準等を勘案した分配金額
11,000円以上 12,000円未満	200円
12,000円以上 13,000円未満	300円
13,000円以上 14,000円未満	400円
14,000円以上	500円

- ※ 計算期末の前営業日の基準価額が10,000円未満の場合、原則として、分配を行いません。
- ※ 基準価額に応じて、分配金額が変動します。基準価額が上記の一定の水準に一度でも到達すればその水準に応じた分配を続ける、というものではありません。
- ※ 分配により基準価額は下落します。そのため、基準価額に影響を与え、次期以降の分配金額は変動する場合があります。

※くわしくは「投資信託説明書（交付目論見書）」の「ファンドの目的・特色」をご覧ください。

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、リートの価格変動）」、「為替変動リスク」、「カントリー・リスク」、「その他（解約申込みに伴うリスク等）」

※当ファンドは、特定の業種への投資比率が高くなるため、市場動向にかかわらず基準価額の変動が大きくなる可能性があります。

※新興国には先進国とは異なる新興国市場のリスクなどがあります。

※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		
	料率等	費用の内容
購入時手数料	販売会社が別に定める率 〈上限〉3.3% (税抜3.0%)	購入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。	—
投資者が信託財産で間接的に負担する費用		
	料率等	費用の内容
運用管理費用 (信託報酬)	年率 1.837% (税抜 1.67%)	運用管理費用の総額は、日々の信託財産の純資産総額に対して左記の率を乗じて得た額とします。
その他の費用・ 手数料	(注)	監査報酬、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、資産を外国で保管する場合の費用等を信託財産でご負担いただきます。

(注)「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。

※購入時手数料について、くわしくは販売会社にお問合わせください。

※運用管理費用の信託財産からの支払いは、毎計算期末または信託終了時に行なわれます。

※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。また、上場不動産投資信託は市場価格により取引されており、費用を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。

大和証券

Daiwa Securities

〈販売会社〉

商号等 大和証券株式会社
金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第108号
加入協会 日本証券業協会
一般社団法人日本投資顧問業協会
一般社団法人金融先物取引業協会
一般社団法人第二種金融商品取引業協会
一般社団法人日本STO協会

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

〈委託会社〉

商号等 大和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352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

当資料のお取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大和アセットマネジメント株式会社が作成したものです。
- 当ファンドのお申込みにあたっては、販売会社よりお渡しする「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。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おりますが、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。記載する指数・統計資料等の知的所有権、その他一切の権利はその発行者および許諾者に帰属します。また、税金、手数料等を考慮しておりませんので、投資者の皆さまの実質的な投資成果を示すものではありません。記載内容は資料作成時点のものであり、予告なく変更されることがあります。記載する投資判断は現時点のものであり、将来の市況環境の変動等を保証するものではありません。
- 当資料中で個別企業名が記載されている場合、あくまでも参考のために掲載したものであり、各企業の推奨を目的とするものではありません。また、ファンドに今後組み入れることを、示唆・保証するものではありません。
- 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。