

2021 年 6 月 28 日

各 位

株式会社大和証券グループ本社
大和証券株式会社
大和アセットマネジメント株式会社

樹を育て未来を託す「みんなで育む明日への森」植樹プロジェクト始動 ～ファンドの残高に応じて植樹活動へ寄付～



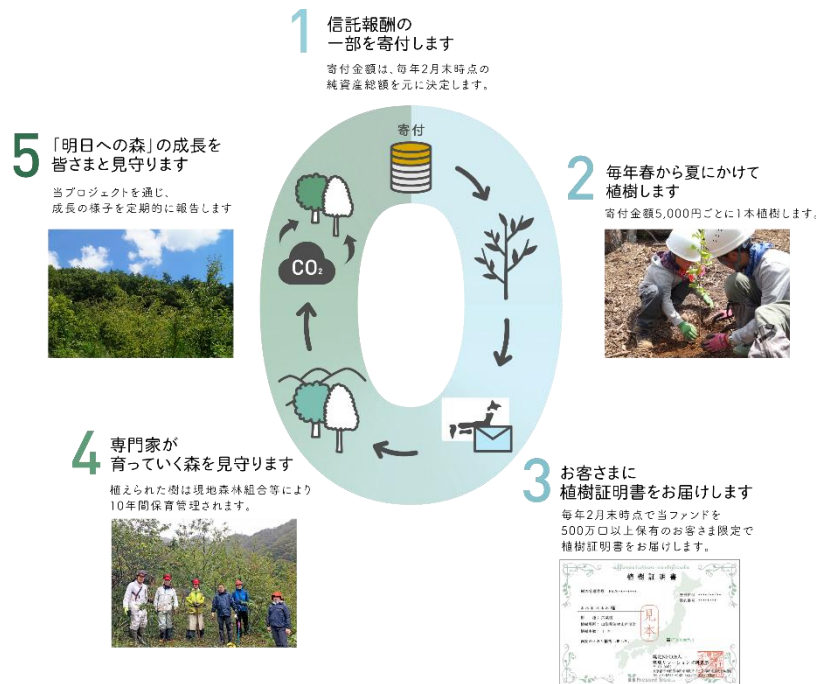
大和証券グループの大和証券株式会社（本社：東京都千代田区、代表取締役社長 中田 誠司、以下「大和証券」）と大和アセットマネジメント株式会社（本社：東京都千代田区、代表取締役社長：松下 浩一、以下「大和アセットマネジメント」）は、「脱炭素テクノロジー株式ファンド（愛称：カーボン ZERO）」（以下「本ファンド」）の信託報酬の一部を、認定 NPO 法人環境リレーシオンズ研究所が運営する植樹プロジェクト「Present Tree（プレゼントツリー）」に寄付をすることを決定し、「みんなで育む明日への森」植樹プロジェクト（以下「本プロジェクト」）を始動いたしました。

本プロジェクトは、植樹した樹が育ち自然の森に成長する過程をお客様と共に見守り、継続して植樹活動を支援し、中長期的な環境課題の解決への貢献を目指します。また、ファンドへの投資活動を通じ植樹を行う取組み※1 であります。

※1 投資信託の純資産総額に応じて寄付金額を算出し、寄付が植樹に繋がるプロジェクトです。

環境リレーシオンズ研究所は、全国各地の被災林や開発跡地、皆伐放棄地など、森をつくるべき場所に樹を植える活動を行っている認定 NPO 法人です。同社が運営する植樹プロジェクト「Present Tree」は、2005 年 1 月より開始しており、森林再生と地域振興に貢献しています。
(<https://presenttree.jp/>)

大和証券グループ



大和証券と大和アセットマネジメントは、毎年1回、本ファンドの信託報酬の一部で「Present Tree」に寄付を行い、5,000円ごとに1本の樹を、伐採跡地などに植えてまいります。植樹証明書の発行やファンドレターを通じて、植えられた樹がどのように成長し森となっていくか、お客様と一緒に見守ってまいります。

本ファンドは、「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す」ことを目的としています。

今、世界は目前に迫った危機を回避するためにカーボンゼロという共通目標を掲げ、脱炭素社会の実現に舵を切りました。本ファンドは、脱炭素社会実現に貢献するソリューション企業に厳選投資し、ファンドとしてカーボンゼロを目指す、日本初※2のファンドです。

※2 投資先企業のCO₂排出量を算出して、投資助言会社（カンドリアム社）がグリーンプロジェクトに資金拠出することでファンドとしてカーボンゼロを目指す。

大和証券グループは、2018年にSDGs推進委員会を設置し、経営戦略の根底にSDGsの観点を取り入れると共に、持続可能な社会の実現に資する商品・サービスの提供に努めてまいりました。本年5月には、経営ビジョン“2030Vision”を策定・公表し、「貯蓄からSDGsへ」をコアコンセプトに、資金循環の仕組みづくりを通じたSDGsの実現を目指しています。

本プロジェクトはそうした取組みの一環であり、今後も当社グループは、サステナブルで豊かな社会の創造に向けて貢献してまいります。

■ 本取組みにより達成を目指すSDGsの目標

目標6：安全な水とトイレを世界中に

目標11：住み続けられるまちづくりを

大和証券グループ

目標 1 2 : つくる責任つかう責任

目標 1 3 : 気候変動に具体的な対策を

目標 1 4 : 海の豊かさを守ろう

目標 1 5 : 陸の豊かさを守ろう

【植樹プロジェクト概要】

対象ファンド	脱炭素テクノロジー株式ファンド（愛称：カーボン ZERO）
寄付主体	大和証券株式会社と大和アセットマネジメント株式会社 （対象ファンドから直接寄付は行わない）
寄付先	認定 NPO 法人環境リレーションズ研究所
植樹活動	認定 NPO 法人環境リレーションズ研究所が運営する植樹プロジェクト「Present Tree」を通じて、寄付金額の 5,000 円ごとに 1 本、各植林地の森林組合等が実施
植樹予定地	「Present Tree」が植樹を受け付けている国内の植栽地。植栽地に関する情報は日々更新されます。（ https://presenttree.jp/ptforests/index.php#sec02 ）
寄付額	対象ファンドの毎年 2 月末時点の純資産総額に応じて算出
寄付時期	原則年一回、毎年 2 月末を算定基準日とし、翌月 3 月に寄付を予定
植樹証明書	毎年 2 月末時点で 500 万口以上保有するお客様限定に植樹証明書を発送
開示	・大和証券グループ本社と大和アセットマネジメントの HP 上で、寄付の実績（日付、寄付額）をご報告 ・大和アセットマネジメントが発行する対象ファンドのファンドレターで植樹活動や森が育つ過程をご報告

以 上

【ご参考】大和証券グループの SDGs に関する取組み:

https://www.daiwa-grp.jp/sdgs/?cid=ad_eir_sdgspress

【脱炭素テクノロジー株式ファンド（愛称：カーボン ZERO）概要】



ファンドの特色

Carbon ZERO

※くわしくは「投資信託説明書（交付目録見書）」をご覧ください。

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。

- ※1 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。
 ※2 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。

当ファンドは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への投資であり、投資先企業が温室効果ガスを排出しないことを保証するものではありません。また、当該企業が削減した温室効果ガスが当該企業が排出した温室効果ガスを上回ることを保証するものではありません。

2. 運用にあたっては、カンドリアム・ベルギー・エス・エーから助言を受けます。

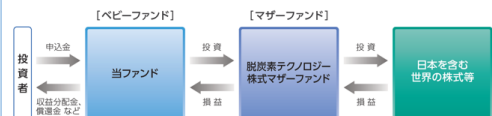
カンドリアム・ベルギー・エス・エーについて

- ◆ 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「カンドリアム・インベスターズ・グループ」の一員です。創業時よりESG投資に積極的に取り組んでいます。
- ◆ 「カンドリアム・インベスターズ・グループ」が強みを持つグローバルチーム・ファンダメンタルチーム、そしてESGチームが協業して当戦略の運用を行っています。



ファンドの仕組み

- ✓ 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。
 ファミリーファンド方式とは、投資者のみならずあらかじめ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。



- マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。
- マザーファンドにおいて、株式等の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。
- 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

3. 毎年1月11日および7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ないます。

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

- 分配方針**
- ◆ 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます）等とします。
 - ◆ 原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。



投資リスク

Carbon ZERO

基準価額の変動要因

- 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。

（主な変動要因） ※基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

価格変動リスク・信用リスク	組入資産の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。
株価の変動	株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることがあります。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。新興国の証券市場は、先進国の証券市場に比べ、一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低いことにより本来想定される投資価値とは乖離した価格水準で取引される場合もあるなど、価格の変動性が大きくなる傾向が考えられます。
リートの価格変動	リートの価格は、不動産市況の変動、リートの収益や財務内容の変動、リートに関する法制度の変更等の影響を受けます。
為替変動リスク	外貨建資産については、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。組入外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。特に、新興国の為替レートは短期間に大幅に変動することがあり、先進国と比較して、相対的に高い為替変動リスクがあります。
カントリー・リスク	投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。新興国への投資には、先進国と比べて大きなカントリー・リスクが伴います。
その他	解約資金を手当てするため組入証券を売却する際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

その他の留意点

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

リスクの管理体制

委託会社では、取締役会が決定した運用リスク管理に関する基本方針に基づき、運用本部から独立した部署および会議体が直接的または間接的に運用本部へのモニタリング・監視を通じ、運用リスクの管理を行います。

大和証券グループ



ファンドの費用

当ファンドのご購入時や運用期間中には以下の費用がかかります。（消費税率10%の場合）
※くわしくは、「投資信託説明書（交付目録見書）」をご覧ください。
※大和証券でお申込みの場合

Carbon ZERO

◆お客さまが直接的に負担する費用

料率等		費用の内容	購入時手数料率	
購入時手数料	購入金額に右記の購入時手数料率を乗じて得た額とします。 購入金額：（申込受付日の翌営業日の基準価額／1万円） ×購入口数	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。	購入金額	手数料率（税込）
			2,000万円未満	3.30%
信託財産留保額	ありません。	—	2,000万円以上5,000万円未満	2.20%
			5,000万円以上1億円未満	1.65%
			1億円以上5億円未満	1.10%
			5億円以上	0.55%

（ご参考）

口数指定で購入する場合	金額指定で購入する場合
例えば、基準価額10,000円の時に300万円ご購入いただく場合は、次のように計算します。 購入金額＝（10,000円／1万円）×300万円＝300万円 購入時手数料＝購入金額（300万円）×3.30%（税込）＝99,000円 となり、 購入金額に購入時手数料を加えた合計額309万9,000円をお支払いいただくこととなります。	購入金額に購入時手数料を加えた合計額が指定金額（お支払いいただく金額）となるよう購入口数を計算します。 例えば、300万円の金額指定で購入する場合、指定金額の300万円の中から購入時手数料（税込）をいただきますので、300万円全額が当該投資信託の購入金額とはなりません。

※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。

◆お客さま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%（税込）	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。運用管理費用は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。
その他の費用・手数料	「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。	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。

※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。



お申込みメモ

Carbon ZERO

購入単位	当初申込期間：300万円以上1円単位*または300万円以上1口単位 継続申込期間：100円以上1円単位*または100円以上1口単位 *購入時手数料および購入時手数料に対する消費税等に相当する金額を含めて、上記単位でご購入いただけます。
購入価額	当初申込期間：1万円当たり1万円 継続申込期間：購入申込受付日の翌営業日の基準価額（1万円当たり）
換金価額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額（1万円当たり）
換金代金	原則として換金申込受付日から起算して5営業日目からお支払いします。
申込受付中止日	① ニューヨーク証券取引所またはロンドン証券取引所の休業日 ② ①のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日 （注）申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合わせください。
申込締切時間	① 当初申込期間 当初申込期間最終日の販売会社所定の時間まで（販売会社所定の事務手続きが完了したもの） ② 継続申込期間 午後3時まで（販売会社所定の事務手続きが完了したもの）
購入の申込期間	当初申込期間：2021年7月1日から2021年7月9日まで 継続申込期間：2021年7月12日以降
換金制限	信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の換金申込みには制限があります。
購入・換金申込受付の中止および取消し	金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生した場合には、購入、換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けた購入、換金の申込みを取消すことがあります。
信託期間	2026年7月10日まで（2021年7月12日当初設定） 受益者に有利であると認めたときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長できます。
繰上償還	次のいずれかの場合には、委託会社は、事前に受益者の意向を確認し、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了（繰上償還）できます。 ・受益権の口数が300億円を下回ることとなった場合 ・信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき ・やむを得ない事情が発生したとき
決算日	毎年1月11日および7月11日（休業日の場合、翌営業日） （注）第1計算期間は、2022年1月11日（休業日の場合、翌営業日）までとします。
収益分配	年2回、収益分配方針に基づいて収益の分配を行います。 （注）当ファンドには、「分配金再投資コース」と「分配金支払いコース」があります。 「分配金再投資コース」をご利用の場合：収益分配金は、税金を差引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。 「分配金支払いコース」をご利用の場合：収益分配金は、税金を差引いた後、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いします。
当初募集額	1,050億円を上限とします。
信託金の限度額	4,000億円
課税関係	課税上は株式投資信託として取扱われます。配当控除、益金不算入制度の適用はありません。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。なお、当ファンドの非課税口座における取扱いが販売会社により異なる場合がありますので、くわしくは、販売会社にお問合わせください。 ※税法が改正された場合等には変更される場合があります。

委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	受託会社	三井住友信託銀行株式会社	販売会社	大和証券株式会社
------	------------------	------	--------------	------	----------

「投資信託説明書（交付目録見書）」のご請求・お申込みは…

設定・運用は…

大和証券
Daio 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

大和アセットマネジメント
Daio 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