

2022年6月14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

全国4か所で8,142本を植樹「みんなで育む明日への森」がスタート

～ファンドの残高に応じて植樹活動へ寄付するプロジェクト～

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：小松 幹太、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法人環境リレーションズ研究所の植樹活動に寄付いたしました。全国4か所にて8,142本の植樹を支援することができましたのでお知らせいたします。

■植樹地の様子（山梨県笛吹市）



本ファンドの植樹プロジェクト「みんなで育む明日への森」は、脱炭素社会の実現に貢献する世界の株式に投資される投資家の皆様と想いを共にするため始動し、この度8,142本の植樹を支援することができました。苗木は今後10年間地元の森林組合により保育管理されます。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ながら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てまいります。

	大和証券	大和アセットマネジメント
寄付金額	¥18,904,407	¥21,132,192
寄付実施日	2022年3月24日	2022年3月31日
寄付による植樹本数	3,780本	4,362本
植樹地	山梨県笛吹市芦川町	東京都西多摩郡檜原村、熊本県上益城郡山都町、北海道中川郡中川町（9～10月植樹予定）



■本ファンドの植樹プロジェクト「みんなで育む明日への森」について

本ファンドの信託報酬の一部を、認定 NPO 法人環境リレーションズ研究所の植樹活動に寄付を実施する「みんなで育む明日への森」プロジェクトが始動しています。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ながら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、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。



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より寄付を行い、伐採跡地などに樹を植えてまいります。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
- 目標 12 : つくる責任つかう責任
- 目標 13 : 気候変動に具体的な対策を
- 目標 14 : 海の豊かさを守ろう
- 目標 15 : 陸の豊かさも守ろう
- 目標 17 : パートナリーシップで目標を達成しよう

大和証券グループは、経営ビジョン「2030Vision」に掲げる「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の実現を目指します。ステークホルダーの皆様と共に、SDGsやESGに資する取組みを通じた中長期的な企業価値の向上およびサステナブルで豊かな社会の創造に努めてまいります。

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)特集ページ:

<https://www.daiwa-am.co.jp/special/carbonzero/>

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、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	原則毎年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	<ul style="list-style-type: none"> ・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

※今回の寄付は、本スキームにおいて、本ファンドの2022年2月末時点の純資産総額に応じて算出した金額の寄付です。次回の寄付は、2023年3月下旬を予定しております。

環境リレーションズ研究所について

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/>)

「投資信託説明書(交付目論見書)」のご請求・お申込みは…

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

設定・運用は…

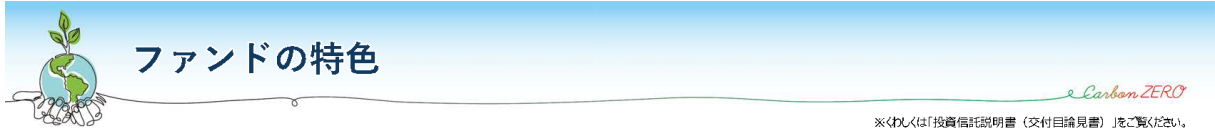
大和アセットマネジメント

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

【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

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。

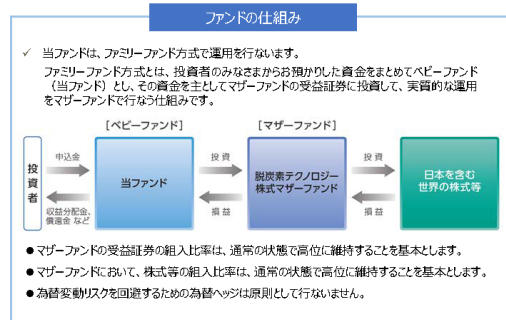
- ※1 当ファンドにおいて「ソリューション」とは、温室効果ガスの排出を削減するテクノロジーやサービス等を指します。
- ※2 株式等にはDR（預託証券）およびリート（不動産投資信託証券）を含みます。

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担っています。

当初既定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市場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、分配を行わないことがあります。



投資リスク

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、市場の需給等が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もあります。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、不動産市場の変動、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し下げ、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。
- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

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。
- 委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行います。
- 取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。



ファンドの費用（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。

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	販売会社が別に定める率 <上限> 3.3% (税込)	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。	-

※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	最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位
購入・換金価額	申込受付日の登営業日の基準価額（1万口当たり）
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たします。
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	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を）
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るときは、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30億円を下回るようになった場合 ・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、登営業日） (注) 第1計算期間は、2022年1月11日（休業日の場合、登営業日）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。 なお、お取扱い可能なコースおよびコース名については異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせください。
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は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
------	------------------	------	--------------