

2022年11月2日

関係各位

大和アセットマネジメント株式会社

ESG ファンドについて

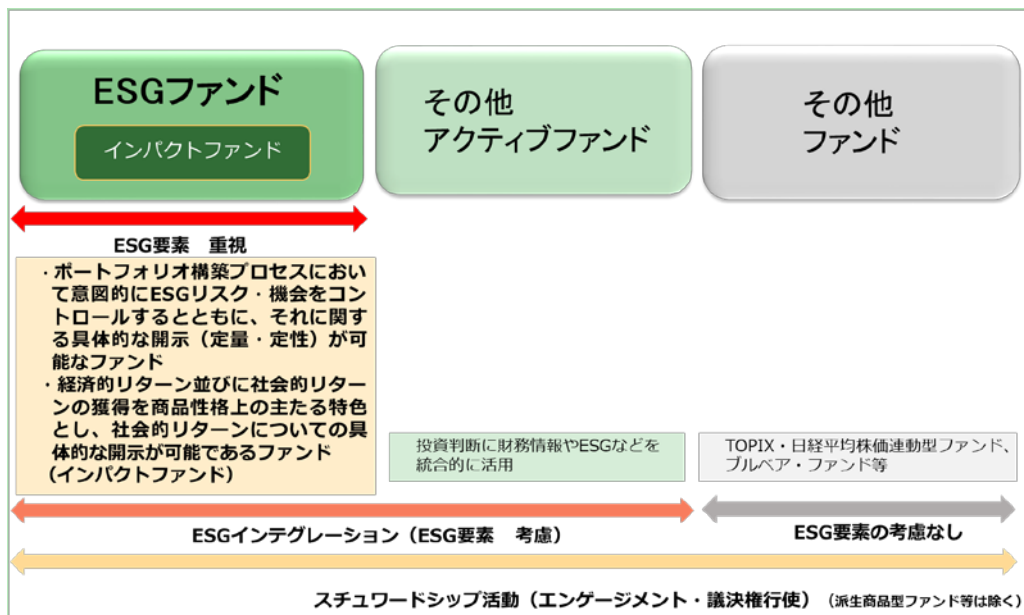
大和アセットマネジメント株式会社（代表取締役社長：小松幹太、以下「当社」）は、この度、当社が設定・運用する公募投資信託において、「ESG ファンド」の定義を策定し、当社の「ESG ファンド」を以下の通り定めましたので、お知らせいたします。

当社の ESG ファンドの定義について

当社は従前より、ESG 要素を投資先企業のリスク及び成長性を評価するために必要不可欠な情報と捉え、アクティブ運用における投資判断や、インデックスファンドの特性として積極的に活用してまいりました。当社の ESG 投資に関する取り組みをこれまで以上に投資家の皆様にご認識いただくこと、情報開示をさらに充実することを目的として、「ESG ファンド」と分類する基準を以下のように策定します。

ESG ファンドの定義

- ・ポートフォリオ構築プロセスにおいて意図的に ESG リスク・機会をコントロールするとともに、それに関する具体的な開示（定量・定性）が可能なファンド。
- ・経済的リターン並びに社会的リターンの獲得を商品性格上の主たる特色とし、社会的リターンについての具体的な開示が可能であるファンド（インパクトファンド）。



当社の ESG ファンドについて

前述の定義に基づく当社の「ESG ファンド」は、以下の公募投資信託 11 本となります。これらのファンドについては、ESG に関する情報開示をこれまで以上に充実させてまいります。

【当社の ESG ファンド (2022 年 11 月 2 日時点)】

| インパクト ファンド該当 | 回次 コード | ファンド名 |
|-----------------|-----------|--|
| ○ | 2785 | 脱炭素テクノロジー株式ファンド (愛称:カーボン ZERO) |
| ○ | 2790 | 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)) |
| ○ | 3410 | クリーンテック株式&グリーンボンド・ファンド (資産成長型) (愛称:みらい Earth 成長型) |
| ○ | 3411 | クリーンテック株式&グリーンボンド・ファンド (予想分配金 提示型) (愛称:みらい Earth 分配型) |
| ○ | 3417 | クリーンテック株式ファンド (資産成長型) (愛称:みらい Earth S 成長型) |
| | 3470 | iFree 全世界株式 ESG リーダーズ・インデックス |
| | 3510 | ダイワ上場投信-MSCI 日本株人材設備投資指数 |
| | 3513 | ダイワ上場投信-FTSE Blossom Japan Index |
| | 3514 | ダイワ上場投信-MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数 |
| | 3515 | ダイワ上場投信-MSCI 日本株女性活躍指数 (WIN) |
| | 3711 | DC・ダイワ SRI ファンド |

なお、ESG ファンドに関する規制や、ESG 投資を取り巻く情勢等に応じて、当社の ESG ファンドの定義や対象ファンドについては、今後見直す場合があります。

以 上

当社の ESG 投資に関する取り組みは、以下の当社ホームページをご参照ください。

「当社のスチュワードシップ活動について」

<https://www.daiwa-am.co.jp/company/managed/result.html>

【本件に関するお問い合わせ先】

大和アセットマネジメント株式会社 経営企画部広報課 TEL : 03-5555-3111 (代表)

投資信託の留意点

お客さまが投資信託をご購入する際には、以下の2つの注意点を十分ご理解いただいた上で、当該投資信託の「投資信託説明書（交付目論見書）」を必ずご覧いただき、ご自身の判断で投資に関する最終決定をなさるようお願いいたします。

投資信託のリスクについて

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。投資信託が投資する有価証券等によりリスクの要因は異なりますので、お申込みにあたっては、投資信託の「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。

お客さまにご負担いただく費用について

投資信託のご購入時や運用期間中には以下の費用がかかります。

直接的にご負担いただく費用

- ◆購入時手数料 料率は、0～3.30%（税込）です。
- ◆信託財産留保額 料率は、0～0.5%です。

信託財産で間接的にご負担いただく費用

- ◆運用管理費用(信託報酬) 料率は、年0～1.98%（税込）です。
- ◆その他の費用・手数料 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。（「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。）

※ 費用の種類や料率等は販売会社や個々の投資信託によって異なります。上記費用の料率は大和アセットマネジメントが運用する一般的な投資信託の料率を表示しております。ファンド・オブ・ファンズでは、ファンドが投資対象とする投資信託の運用管理費用等を別途ご負担いただきます。また投資信託によっては、運用実績に応じた報酬や換金手数料をご負担いただく場合があります。

※ 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。

※ 投資信託により異なりますので、くわしくは販売会社にお問合わせください。また、詳細につきましては「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。

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