

2024年6月20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3か所で5,010本を植樹「みんなで育む明日への森」のご報告 ～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～

株式会社大和証券グループ本社傘下（以下「大和証券グループ本社」）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：荻野 明彦、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）」および「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）」（以下総称して「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いたしました。2024年は全国3か所にて5,010本、プロジェクト開始以来、累計20,276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（山梨県笛吹市芦川町）

(2022年山梨県)



植樹から2年が経過
少しずつ苗木が成長し
山肌が緑になりました

(2024年山梨県)



■今年の植樹の様子（山梨県笛吹市芦川町）



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株式に投資される投資家の皆様と想いを共にすることを目的とした、サステナビリティ活動の一環です。苗木は植樹した年から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。

■寄付による植樹本数内訳

| | 大和証券 | 大和アセットマネジメント |
|-----------|---|---|
| 累計植樹本数 | 9,469本 | 10,807本 |
| 2024年植樹本数 | 2,384本 | 2,626本 |
| 寄付金額 | ¥10,731,186 | ¥13,070,224 |
| 寄付実施年月 | 2024年3月 | 2024年3月 |
| 植樹地 | <ul style="list-style-type: none"> 北海道大学研究林（天塩郡幌延町・中川郡音威子府村）：9～10月植樹予定 | <ul style="list-style-type: none"> 山梨県笛吹市芦川町：5月植樹完了 北海道大学研究林（雨竜郡幌加内町）：9～10月植樹予定 岐阜県高山市清見町：10～11月植樹予定 |



大和証券グループは、経営ビジョン「2030Vision」のもと、引き続きステークホルダーの皆様と共に、金融・資本市場を通じた豊かな未来の創造および企業価値の向上に努めてまいります。

以上

【ご参考】

大和証券グループのサステナビリティに関する取組み：

https://www.daiwa-grp.jp/sustainability/?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） 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）） |
| 寄付主体 | 大和証券と大和アセットマネジメント （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 2024 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、2025 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/>）

【環境省 第5回「ESG ファイナンス・アワード・ジャパン」選定委員長賞（銅賞）受賞】



・ESG ファイナンス・アワード・ジャパンとは
環境省は ESG 金融または環境・社会事業に取り組み、インパクトを与えた金融機関、企業等について、その取組を表彰し、広く社会で共有し、ESG 金融の普及・拡大につなげることを目的に、令和元年度より環境大臣が表彰する ESG ファイナンス・アワード・ジャパンを実施しています。

・投資家部門で選定委員長賞（銅賞）受賞

海外の運用会社であるカンドリアム・エス・シー・エーから助言を受けて運用している、GHG を削減し気候変動の緩和に資する企業に投資を行なう ESG ファンド「カーボン ZERO」のコンセプトが明確で、かつ信託期間が 2050 年までと長期投資であり社会的意義があると評価されました。また、両社の連携ではそれぞれの強みを最大限に生かそうとする工夫がある点や、発行しているインパクトレポートが国内の個人投資家にも ESG 投資への参加を促す内容で、市場の拡大に貢献する姿勢が明確である点も評価されました。今後、カンドリアム・エス・シー・エーとのさらなるシナジー効果の発現が期待され、選定委員長賞（銅賞）受賞に至りました。

「投資信託説明書(交付目論見書)」のご請求・お申込みは…

設定・運用は…

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

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

【本ファンドの概要】



ファンドの特色

※くわしくは「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。



当ファンドは、「ESGファンド（インパクトファンド）」です。
 * ESGファンドとは、ESGを投資対象選定の主要な要素としており、その内容に関する開示が可能なファンドです。
 * ESGファンドのうち、経済的リターンと並行して社会や環境にポジティブなインパクトをもたらす、いわゆる「社会的リターン」の獲得をめざすファンドを特に「インパクトファンド」と定義しています。
 * ESGに関する情報は、現状、投資先企業等による開示が必ずしも十分ではないことから、入手が制約される、品質が一定でないなど、運用上の制約要因となる可能性があります。
 * 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。

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、カンダリアム・エス・シー・エーから助言を受けます。**
3. **ファンド全体としてカーボンゼロをめざします。**
 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場合、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。
 脱炭素テクノロジー株式会社
 テリ(ティ)取引（法人税法第61条の5で定めるものをいいます）は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
4. **分配方針の異なる2つのファンドがあります。**
 - ◆ 脱炭素テクノロジー株式会社ファンド
 - ◆ 毎月11日および7月11日（休業日の場合、翌営業日）に決算を行い、収益分配方針に基づいて収益の分配を行います。
 - ◆ 脱炭素テクノロジー株式会社ファンド（予想分配金提示型）
 - ◆ 毎月11日（休業日の場合、翌営業日）に決算を行い、収益分配方針に基づいて収益の分配を行います。

| 計算期末の前営業日の基準価額 | 分配金額（1万円当たり、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 |

『脱炭素テクノロジー株式会社ファンド』と『脱炭素テクノロジー株式会社ファンド（予想分配金提示型）』との間でスイッチング（乗換え）を行なうことができます。



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

※ 2,000円 (③+④)

※ 分配対象額 2,000円

中期決算日

12,100円

期中収益 (①+②) 100円

※ 200円

※ 200円を取崩し

当期決算日

11,800円

※ 1,800円 (③+④)

※ 分配対象額 1,800円

分配金 300円

前期決算日から基準価額が下落した場合

前期決算日

※ 2,000円 (③+④)

※ 分配対象額 2,000円

中期決算日

11,500円

配当等収益 (①) 20円

※ 180円

※ 180円を取崩し

当期決算日

11,300円

※ 1,820円 (③+④)

※ 分配対象額 1,820円

分配金 200円

(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がか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

投資者の購入価額 (当初個別元本)

普通分配金

元本払戻金 (特別分配金)

分配金支払後 基準価額 個別元本

元本払戻金（特別分配金）は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金（特別分配金）部分は非課税扱いとなります。

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合

投資者の購入価額 (当初個別元本)

元本払戻金 (特別分配金)

分配金支払後 基準価額 個別元本

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（特別分配金）個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。
 (注) 普通分配金に対する課税については、「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。



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場合があります。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生じた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、換金の申込みの受け付け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

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 | |
|-----------|--|--|--------------------|----------|
| | | | 購入金額 | 手数料率（税込） |
| 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。 | 2,000万円未満 | 3.30% |
| | | | 2,000万円以上5,000万円未満 | 2.20% |
| 信託財産留保額 | ありません。 | - | 5,000万円以上1億円未満 | 1.65% |
| スイッチング手数料 | ありません。 | - | 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100万円を100口購入した場合は、次のように計算します。 購入金額 = (10,000円 / 1万円) × 100万円 = 100万円 購入時手数料 = 購入金額 (100万円) × 3.30% (税込) = 33,000円となり、 購入金額に購入時手数料を加えた合計額103万3,000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、100万円の金額指定で購入する場合、指定金額の100万円の中から購入時手数料（税込）をいただきますので、100万円全額が当該投資信託の購入金額とはなりません。 |

◆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、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。 |
| 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。 |

※購入時手数料について、くわしくは販売会社にお問い合わせください。

※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

※大和証券でお申込みの場合

Carbon ZERO

| | 脱炭素テクノロジー株式ファンド | 脱炭素テクノロジー株式ファンド（予想分配金提示型） |
|--------------------|---|--|
| 購入単位 | 100円以上1円単位*または100口以上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、左記単位でご購入いただけます。 |
| 購入・換金価額 | 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 | 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。 | |
| スイッチング（乗換え） | 『脱炭素テクノロジー株式ファンド』と『脱炭素テクノロジー株式ファンド（予想分配金提示型）』との間でスイッチング（乗換え）を行なうことができます。 | |
| 信託期間 | 2050年7月11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、委託会社と合意のうえ、信託期間を延長できます。 | 2026年7月10日まで（2022年4月5日当初設定） 受益者に有利であると認めるときは、委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、委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） | 毎月11日（休業日の場合、翌営業日） |
| 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ないます。 | 年12回、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。 |
| 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。 公算株式投資信託は税法上、NISA（少額投資非課税制度）の適用対象であり、2024年1月1日以降は一定の要件を満たした場合にNISAの適用対象となります。当ファンドは、2024年1月1日以降のNISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象となる予定ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。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。 | 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。 公算株式投資信託は税法上、NISA（少額投資非課税制度）の適用対象であり、2024年1月1日以降は一定の要件を満たした場合にNISAの適用対象となります。 ※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 | 委託会社 三井住友信託銀行株式会社 |
| | | 販売会社 大和証券株式会社 ほか |