

2022年1月18日

各位

株式会社大和証券グループ本社
大和アセットマネジメント株式会社

「カーボンゼロを目指す新しい投資の普及」が「東京金融賞 2021」受賞
「ESG 投資部門 グリーンファイナンス知事特別賞」を受賞

東京金融賞 TOKYO FINANCIAL AWARD

大和証券グループの資産運用会社である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、この度、東京都主催の「東京金融賞 2021」において、「ESG 投資部門 グリーンファイナンス知事特別賞」を受賞いたしました。

東京都は「国際金融都市・東京」構想 2.0 の取組みのひとつとして、都民のニーズや課題の解決に資する画期的な金融商品やサービスの開発・提供を行う金融事業者、および ESG 投資の普及を实践する金融事業者を表彰する「東京金融賞」を実施しています。

今回、大和アセットマネジメントは「カーボンゼロを目指す新しい投資の普及」と題して「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」）と「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「東京金融賞 2021」に応募し、ESG 投資の普及を实践している金融事業者の取組みの独自性や成果等の観点から、大和アセットマネジメントを含む 3 社が優れた事業者として「ESG 投資部門」を受賞いたしました。その中でも、大和アセットマネジメントはグリーンファイナンスの観点から優れた事業者として「グリーンファイナンス知事特別賞」を受賞いたしました。

大和アセットマネジメントは2021年7月12日に「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」ことを目的として本ファンドを設定いたしました。

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^{※1}のファンドです。

また、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^{※2}であります。

本ファンドおよび本プロジェクトは大和証券グループの取組み^{※3}の一環であり、大和証券グループは今後も資金循環の仕組みづくりを通じたSDGsの実現を目指すとともに、グリーンファイナンス市場の発展に寄与すべく、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。

※1 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。（2021年7月時点）

※2 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。

※3 大和証券グループは、2021年5月、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。また同年8月には、「大和証券グループカーボンニュートラル宣言」を策定・公表し、カーボンニュートラル社会の早期の実現に向け、2030年までの自社（自社の範囲は、連結ベースで算出予定）の温室効果ガス排出量（Scope1・2）のネットゼロ、および2050年までの投融资ポートフォリオの温室効果ガス排出量等（Scope3）のネットゼロ達成を目指しています。

以上

本件に関する報道関係者からのお問い合わせ先

大和アセットマネジメント株式会社 プロモーション戦略部 プロモーション戦略課
広瀬真吾 小松亮太

TEL : 03-5555-4872、MAIL : shingo.hirose@daiwa-am.co.jp

【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)PR動画:<https://youtu.be/V3bjU3Mz7uo>

みんなで育む明日への森 カーボンZERO植樹プロジェクトのご紹介:<https://youtu.be/8wDARiq0xLE>



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。

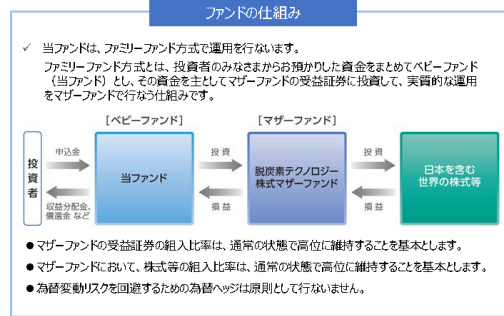
※1 当ファンドにおいて「ソリューション」とは、温室効果ガスの排出を削減するテクノロジーやサービス等を指します。
 ※2 株式等にはDR（預託証券）およびリート（不動産投資信託証券）を含みます。

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行っています。



当初設定日直後、大量の追加取次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うちがあります。

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、価値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、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ないます。



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	申込受付日の翌営業日の基準価額（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、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。 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
------	------------------	------	--------------

【東京金融賞 ESG 投資部門について】

東京都は、「国際金融都市・東京」構想 2.0 の取組の 1 つとして、都民及び都内事業者のニーズや課題の解決に資する画期的な金融商品・サービスの開発・提供を行う金融事業者等や ESG 投資の普及活動を実践する金融事業者及び SDGs 経営の取組を実践する事業者を表彰する「東京金融賞」を実施しています。

東京金融賞「ESG 投資部門」は、ESG 投資カテゴリと SDGs カテゴリに分かれており、ESG 投資カテゴリでは ESG 投資の普及を実践している金融事業者を募集し、審査委員会によりテーマとの合致度合い、取組の独自性や成果等の観点から審査し表彰します。その中で特にグリーンファイナンスの取組において優れた事業者 1 者を「グリーンファイナンス知事特別賞」として表彰します。

東京都並びに東京金融賞は特定商品の購入、売却、保有を推奨、又は将来のパフォーマンスを保証するものではありません。

東京金融賞に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は東京都に帰属しており、無断複製・転載等を禁じます。