

2022年7月6日

各位

会社名 株式会社大和証券グループ本社
代表者名 執行役社長 中田 誠司
(コード番号 8601 東証プライム・名証プレミア)

日本電気株式会社 サステナビリティ・リンク・ボンド発行のお知らせ

このたび、株式会社大和証券グループ本社傘下の大和証券株式会社は、日本電気株式会社(以下、「NEC」という)が発行する日本電気株式会社第59・60・61回無担保社債(社債間限定同順位特約付)(サステナビリティ・リンク・ボンド^{※1})(以下、「本社債」という。)の引き受けにおける主幹事証券会社および Structuring Agent^{※2}を務めましたので、その概要についてお知らせいたします。

NECは、サステナビリティ経営の基本方針として「事業をととした社会課題解決への貢献」「リスク管理・コンプライアンスの徹底」「ステークホルダー・コミュニケーションの推進」を掲げ、デジタル技術が社会に与える負の影響の防止や低減と、気候変動等の環境課題をはじめとした社会課題解決に取り組んでおります。

この基本方針のもと、NECはESG視点の経営優先テーマ「マテリアリティ」を設定しており、「2025中期経営計画」においては、次の7項目を特定しております。

- ① 気候変動(脱炭素)を核とした環境課題への対応
- ② ICTの可能性を最大限に広げるセキュリティ
- ③ 人権尊重を最優先にしたAI提供と利活用(AIと人権)
- ④ 多様な人材の育成とカルチャーの変革
- ⑤ コーポレート・ガバナンス
- ⑥ サプライチェーンサステナビリティ
- ⑦ コンプライアンス

本社債発行は「気候変動(脱炭素)を核とした環境課題への対応」に資金調達を通じて強くコミットするものとなっており、その着実な進捗を計測するためにKPI/SPTs^{※1}が設定されております。

本社債発行を通じて、NECグループの存在意義「Purpose」(NECは、安全・安心・公平・効率という社会価値を創造し、誰もが人間性を十分に発揮できる持続可能な社会の実現を目指します)を実践するとともに、NECのサステナビリティ経営の取組みについて、さまざまなステークホルダーのみなさまと対話・共創することを企図しております。

大和証券グループ

NECは、本社債の発行にあたり、国際資本市場協会（ICMA）の定める「サステナビリティ・リンク・ボンド原則 2020」に則したサステナビリティ・リンク・ボンド・フレームワークを策定しました。また、本フレームワークの原則との適合性に関し、株式会社格付投資情報センター（以下、「R&I」という。）よりセカンドオピニオンを取得しています。

（詳細は下記ホームページをご覧ください）

URL：https://www.r-i.co.jp/news_release_suf/2022/06/news_release_suf_20220603_jpn_01.pdf

（※1）サステナビリティ・リンク・ボンド

あらかじめ定められたサステナビリティ/ESGの目標を達成するか否かによって条件が変化する債券。サステナビリティ・リンク・ボンドの発行体は、あらかじめ定めた時間軸の中で、将来の持続可能性に関する成果の改善にコミットする。具体的には、サステナビリティ・リンク・ボンドは、発行体があらかじめ定めた重要な評価指標（以下、KPI）とサステナビリティ・パフォーマンス・ターゲット（以下、SPTs）による将来のパフォーマンスの評価に基づいた金融商品であり、KPIに関して達成すべき目標数値として設定されたSPTsを達成したかどうかによって、債券の条件が変化する

（※2）Structuring Agent

サステナビリティ・リンク・ボンド・フレームワークの策定およびセカンドパーティーオピニオン等外部の第三者評価の取得に関する助言等を通じて、サステナビリティ・リンク・ボンドの発行支援を行う者

大和証券グループ

■ 本社債の概要

社債の名称	日本電気株式会社第 59・60・61 回無担保社債（社債間限定同順位特約付）（サステナビリティ・リンク・ボンド）										
発行年限	5 年	7 年	10 年								
発行額	600 億円	200 億円	300 億円								
利率	0.460%	0.584%	0.749%								
払込金額	各社債の金額 100 円につき 100 円										
償還金額	各社債の金額 100 円につき 100 円										
償還期日	2027 年 7 月 12 日	2029 年 7 月 12 日	2032 年 7 月 12 日								
償還方法	満期一括償還										
利払日	毎年 1 月 12 日および 7 月 12 日										
募集方法	一般募集										
募集期間	2022 年 7 月 6 日										
払込期日	2022 年 7 月 12 日										
担保・保証の有無	無担保										
主幹事証券会社	大和証券株式会社、みずほ証券株式会社、三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社、ゴールドマン・サックス証券株式会社、野村証券株式会社										
Structuring Agent（※2）	大和証券株式会社、SMB C日興証券株式会社										
SPTs	SPT 1：Scope1 および Scope2 の各年度における CO2 排出量削減率（基準年度である 2017 年度比） SPT 2：CDP 気候変動の最終スコア「A」の維持 【5 年債】（判定日：2026 年 7 月末） <table border="1"><tr><td>SPT 1</td><td>2025 年度における Scope1 および Scope2 の CO2 排出量を 33.6% 削減（2017 年度比） 参照期間：2025 年 4 月～2026 年 3 月</td></tr><tr><td>SPT 2</td><td>CDP 気候変動の最終スコア「A」の維持</td></tr></table> 【7 年債】（判定日：2028 年 7 月末） <table border="1"><tr><td>SPT 1</td><td>2027 年度における Scope1 および Scope2 の CO2 排出量を 42.0% 削減（2017 年度比） 参照期間：2027 年 4 月～2028 年 3 月</td></tr><tr><td>SPT 2</td><td>CDP 気候変動の最終スコア「A」の維持</td></tr></table>			SPT 1	2025 年度における Scope1 および Scope2 の CO2 排出量を 33.6% 削減（2017 年度比） 参照期間：2025 年 4 月～2026 年 3 月	SPT 2	CDP 気候変動の最終スコア「A」の維持	SPT 1	2027 年度における Scope1 および Scope2 の CO2 排出量を 42.0% 削減（2017 年度比） 参照期間：2027 年 4 月～2028 年 3 月	SPT 2	CDP 気候変動の最終スコア「A」の維持
SPT 1	2025 年度における Scope1 および Scope2 の CO2 排出量を 33.6% 削減（2017 年度比） 参照期間：2025 年 4 月～2026 年 3 月										
SPT 2	CDP 気候変動の最終スコア「A」の維持										
SPT 1	2027 年度における Scope1 および Scope2 の CO2 排出量を 42.0% 削減（2017 年度比） 参照期間：2027 年 4 月～2028 年 3 月										
SPT 2	CDP 気候変動の最終スコア「A」の維持										

大和証券グループ

	【10年債】(判定日：2031年7月末)		
	SPT 1	2030年度における Scope1 および Scope2 の CO2 排出量を 54.6% 削減 (2017 年度比) 参照期間：2030 年 4 月～2031 年 3 月	
	SPT 2	CDP 気候変動の最終スコア「A」の維持	
債券の特性	<p>SPTs の達成状況により、本社債の債券特性は変動します。変動内容については、本社債の判定日以降、①または②のいずれにするかを決定します。</p> <p>① いずれの SPT も未達成の場合、本社債の償還までに、社債発行額の 0.1%相当額の排出権 (CO2 削減価値をクレジット・証書化したもの) を購入します。なお、SPT 1 が未達成の場合は、社債発行額の 0.1%相当額の 10 分の 7 の、SPT 2 が未達成の場合は、社債発行額の 0.1%相当額の 10 分の 3 の排出権を購入します。</p> <p>② いずれの SPT も未達成の場合、本社債の償還までに、社債発行額の 0.1%相当額を、環境保全活動を目的とする公益社団法人、公益財団法人、国際機関、自治体認定 NPO 法人、地方自治体やそれに準じた組織に対して寄付します。なお、SPT 1 が未達成の場合は、社債発行額の 0.1%相当額の 10 分の 7 を、SPT 2 が未達成の場合は、社債発行額の 0.1%相当額の 10 分の 3 を寄付します。</p>		
財務・発行・支払代理人	株式会社三井住友銀行	株式会社三井住友銀行	三井住友信託銀行株式会社
振替機関	株式会社証券保管振替機構		
取得格付	株式会社格付投資情報センター：A		

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

お取引にあたっての手数料等およびリスクについて

手数料等およびリスクについて

- 株式等の売買等にあたっては、「ダイワ・コンサルティング」コースの店舗（支店担当者）経由で国内委託取引を行う場合、約定代金に対して最大1.26500%（但し、最低2,750円）の委託手数料（税込）が必要となります。また、外国株式等の外国取引にあたっては約定代金に対して最大0.99000%の国内取次手数料（税込）に加え、現地情勢等に応じて決定される現地手数料および税金等が必要となります。
- 株式等の売買等にあたっては、価格等の変動（裏付け資産の価格や収益力の変動を含みます）による損失が生じるおそれがあります。また、外国株式等の売買等にあたっては価格変動のほか、為替相場の変動等による損失が生じるおそれがあります。
- 信用取引を行うにあたっては、売買代金の30%以上で、かつ30万円以上の委託保証金が事前に必要です。信用取引は、少額の委託保証金で多額の取引を行うことができることから、損失の額が差し入れた委託保証金の額を上回るおそれがあります。
- 債券を募集・売出し等により、又は当社との相対取引により売買する場合は、その対価（購入対価・売却対価）のみを受払いいただきます。円貨建て債券は、金利水準の変動等により価格が上下し、損失が生じるおそれがあります。外貨建て債券は、金利水準の変動に加え、為替相場の変動等により損失が生じるおそれがあります。また、債券の発行者または元利金の支払いを保証する者の財務状況等の変化、およびそれらに関する外部評価の変化等により、損失が生じるおそれがあります。
- 投資信託をお取引していただく際に、銘柄ごとに設定された販売手数料および運用管理費用（信託報酬）等の諸経費、等をご負担いただきます。また、各商品等には価格の変動等による損失を生じるおそれがあります。

ご投資にあたっての留意点

- 取引コースや商品毎に手数料等およびリスクは異なりますので、上場有価証券等書面、契約締結前交付書面、目論見書、等をよくお読みください。
- 外国株式、外国債券の銘柄には、我が国の金融商品取引法に基づく企業内容の開示が行われていないものもあります。

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