

2023年6月27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7,124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：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）」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。2023 年は全国 3 か所にて 7,124 本、2022 年とあわせて計 15,266 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。

### ■2022 年と 2023 年の植樹地の様子（山梨県笛吹市芦川町、東京都西多摩郡檜原村）



(2022 年山梨県)



(2023 年東京都)



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	7,085 本	8,181 本
2023 年植樹本数	3,305 本	3,819 本
2022 年植樹本数	3,780 本	4,362 本
寄付金額	¥16,525,693	¥19,331,174
寄付実施年月	2023 年 3 月	2023 年 3 月
植樹地	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](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。（ <a href="https://presenttree.jp/ptforests/index.php#sec02">https://presenttree.jp/ptforests/index.php#sec02</a> ）
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"> <li>・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</li> <li>・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</li> </ul>

※今回の寄付は、本スキームにおいて、本ファンドの 2023 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、2024 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…

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

## 【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、カントリー・エス・シー・エーから助言を受けます。

カントリー・エス・シー・エーは、米田最大級の生命保険相互会社のニュークリア・インシュアランス・カンパニー傘下の運用会社です。創業時よりESG投資に積極的に取り組んでいます。

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、ファンドの特色1、および2、の運用が行われかねないことがあります。

#### 3. 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ファンド

◆ 毎年11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。

◆ 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。

##### 脱炭素テクノロジー株式ファンド（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。

◆ 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、分配対象額の範囲内で、下記に基づき分配します。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。

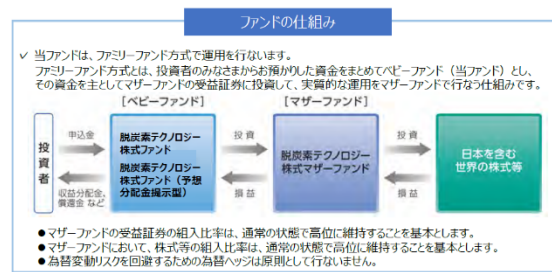
● 計算期末の前営業日の基準価額の水準に応じ、右記の金額の分配をめざします。

計算期末の前営業日の基準価額	分配金額（1万口当たり、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

● 基準価額は1万口当たりとし、既払分配金を加算しません。  
 ● 当該計算期末に向けて基準価額が急激に変動した場合等には、右記の分配を行わないことがあります。  
 ● 計算期末の前営業日の基準価額が10,000円未満の場合、原則として、分配を行いません。

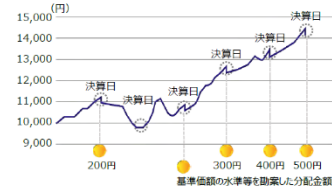
※ 基準価額に応じて、分配金額が変動します。基準価額が上記の一定水準に一度でも到達すればその水準に応じた分配を続ける、というものではありません。  
 ※ 分配により基準価額は下落します。そのため、基準価額に影響を与え、次期以降の分配金額は変動する場合があります。

『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）』の間でスイッチング（乗換え）を行なうことができます。



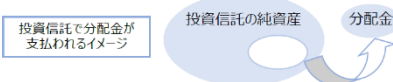
基準価額の上昇に応じて、支払われる分配金額が増加します。  
 分配水準をあらかじめ提示しているため、受取額を見積もることができます。

基準価額の上昇に応じて、支払われる分配金額が増加



### 収益分配金に関する留意事項

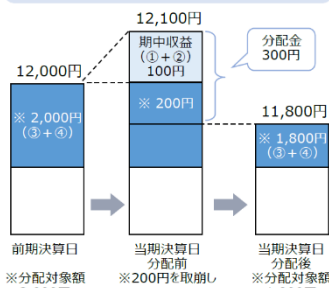
◆ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



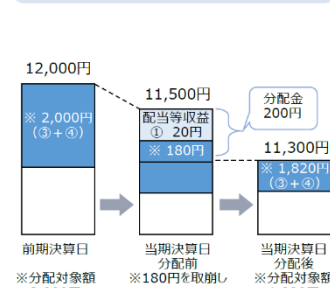
◆ 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

#### 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



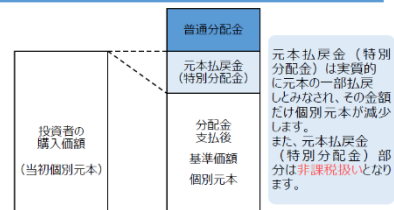
##### 前期決算日から基準価額が下落した場合



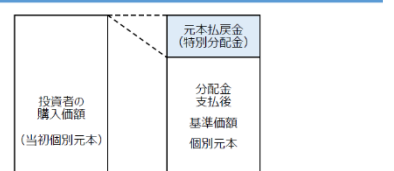
（注） 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

◆ 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あ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



#### 分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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（交付目録見書）」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、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	外資建資産については、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。組入外資建資産について、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%
信託財産留保額	ありません。	-	2,000万円以上5,000万円未満	2.20%
スイッチング手数料	ありません。	-	5,000万円以上1億円未満	1.65%
			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100万口ご購入いただく場合は、次のように計算します。 購入金額 = (10,000円 / 1万円) × 100万口 = 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。

※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負担いただきます。

※運用管理費用の信託財産からの支払いは、毎計算期末または信託終了時に行なわれます。  
※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

※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で）	
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、換金の申込みの受付を中止すること、すでに受付した購入、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）』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	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られたときは、受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られたときは、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30億口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）	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。 (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。 「分配金再投資コース」をご利用の場合：収益分配金は、税金を差引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。 「分配金支払いコース」をご利用の場合：収益分配金は、税金を差引いた後、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いします。	
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に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	受託会社 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