

2024年3月11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)

本日、大和証券株式会社よりプレスリリース「ダイワのフューチャー・デザイナー ～未来のカルテ～『資産運用プランニング』へのESG・SDGs分析の導入について」を発表いたしましたので、ご報告申し上げます。

以 上

2024年3月11日

各位

大和証券株式会社

ダイワのフューチャー・デザイナー ～未来のカルテ～ 「資産運用プランニング」への ESG・SDGs 分析の導入について

大和証券株式会社（以下、「当社」）は、2024年3月11日より、ダイワのフューチャー・デザイナー ～未来のカルテ～の「資産運用プランニング¹」の新機能として ESG・SDGs 分析を導入いたします。

気候変動や社会格差といった世界の持続可能性への問題意識が高まる中、金融機関など機関投資家の間では、投融資先の選定時に ESG 格付けをはじめとするサステナビリティ情報を活用し、運用成果の向上を目指す動きが広がっています。

ESG・SDGs 分析のサービスは MSCI によって提供されており、ポートフォリオ・リスク分析ソリューションサービス「WealthBench」を活用した国内での導入は、当社が初めてとなります。

ESG に関する分析では、MSCI が企業の ESG に対する取組み等を調査・評価した指標である「MSCI ESG 格付け²」に基づいて、お客さまのポートフォリオを分析します。また、SDGs の観点では、企業ごとに 17 の持続可能な開発目標に対する取組みを評価³します。さらに、ポートフォリオの推定炭素排出量について、パリ協定で示された温室効果ガス削減に関する世界的な取り決めである「2°C目標（努力目標 1.5°C以内）⁴」との整合性を分析します。これらにより、投資先の選択時に企業の持続可能性を加味することが可能となり、中長期的な運用パフォーマンスの向上が期待できます。

当社は、今後もお客さまのベストパートナーとして、お客さまの期待を超える、より付加価値の高いサービス・ソリューションを提供してまいります。

¹ MSCI が提供するポートフォリオ・リスク分析ソリューションサービス「WealthBenchTM」を国内向けにカスタマイズし、お客さまの金融資産の分析から投資意思決定のサポート、運用状況のモニタリングまで、資産運用のあらゆるシーンでお客さまをサポートさせていただくサービス。

² 企業が財務要因に関連のある ESG リスクと機会をどの程度管理できているかを分析し、最上位ランクの AAA から最下位ランクの CCC まで 7 段階で格付したものを。

³ MSCI SDG Alignment を用いて企業の事業活動及び製品・サービスが SDGs の 17 のゴールについて整合しているかどうかを評価する。

⁴ パリ協定では世界の平均気温上昇を産業革命以前に比べて 2°C 以内に抑制することと併せて 1.5°C に抑える努力を追求すること（1.5°C 目標）が示されている。MSCI の Implied Temperature Rise (ITR) では特に 1.5°C 目標に対する整合性を評価している。

■ MSCI Inc.の概要

MSCI は世界の投資コミュニティに重要な投資判断支援ツールとサービスを提供するリーディングプロバイダーです。50年以上にわたるリサーチ、データ、テクノロジーの専門知識を有する同社は、クライアントがリスクとリターンの重要な要因を理解して分析し、確信を持ってより効果的なポートフォリオを構築できるようにすることで、より良い投資判断を支援します。MSCI は業界をリードするリサーチによって強化されたソリューションを構築し、クライアントはこれを用いて投資プロセス全体を把握し、透明性を高めることができます。

■ 提案書のイメージ

ESG・SDGs 分析サマリー



SDGs に対する取組みの評価



以上

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なう場合、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に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。
- 信用取引を行なうにあたっては、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な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購入時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が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