

「FD・サステナビリティ原則」の取り組み実績（2022年度）

2023年6月30日

「FD・サステナビリティ原則」の取り組み実績の開示について

三井住友DSアセットマネジメント株式会社（代表取締役社長 兼 CEO 猿田 隆、以下「当社」）は、「FD・サステナビリティ原則」の2022年度の取り組み実績をお知らせいたします。

当社では、経営理念に沿った普遍的な企業活動の基本方針として「FD・サステナビリティ原則」を2020年8月に制定しました。この「FD・サステナビリティ原則」におきましては、資産運用会社の責務を原則 1 [(1)～(5)]および原則 2 [(1)～(3)]として、また一企業市民の責務を原則3[(1)～(2)]および原則 4 [(1)～(2)]として定めています。当社はこれらを実践することにより、サステナブルな社会の実現に貢献してまいります。

また、「FD・サステナビリティ原則」は、金融庁が定める「顧客本位の業務運営に関する原則（令和3年1月15日改訂）」の原則 2～7（※）および一般社団法人投資信託協会と一般社団法人日本投資顧問業協会の理事会で採択された「資産運用業宣言2020」を網羅しており、該当する「FD・サステナビリティ原則」にそれぞれ明記しております。

なお、当社は、「顧客本位の業務運営に関する原則（令和3年1月15日改定）」の原則5（注2）および 原則6（注2）にある複数の金融商品・サービスをパッケージとして販売・推奨等を行う金融事業者には該当いたしません。

「FD・サステナビリティ原則」の対応関係について

当社「FD・サステナビリティ原則」と、金融庁の定める「顧客本位の業務運営に関する原則」ならびに、投資信託協会と日本投資顧問業協会が採択した「資産運用業宣言2020」との対応関係は以下の通りです。

当社 「FD・サステナビリティ原則」		金融庁 顧客本位の業務運営に関する原則 (令和3年1月15日改訂版)	投資信託協会 資産運用業宣言2020 日本投資顧問業協会 資産運用業宣言2020	
原則 1	私たちは、責任ある機関投資家として運用責任を全うします	(1) P.3	原則2：顧客の最善の利益の追求	《専門性と創造性の追求》《顧客利益の最優先》 《信認の獲得》
		(2) P.4	-	《責任ある投資活動》
		(3) P.5	原則2：顧客の最善の利益の追求 原則5：重要な情報の分かりやすい提供 原則6：顧客にふさわしいサービスの提供	《顧客利益の最優先》《信認の獲得》
		(4) P.6	原則3：利益相反の適切な管理 原則4：手数料等の明確化 原則5：重要な情報の分かりやすい提供 原則6：顧客にふさわしいサービスの提供	《顧客利益の最優先》《責任ある投資活動》
		(5) P.7	原則2：顧客の最善の利益の追求、 原則7：従業員に対する適切な動機づけの枠組み等	《顧客利益の最優先》
原則 2	私たちは、資産運用ビジネスを通じて持続可能な社会の実現に取り組みます	(1) P.8	-	-
		(2) P.9	-	《責任ある投資活動》
		(3) P.10	原則5：重要な情報の分かりやすい提供 原則6：顧客にふさわしいサービスの提供	《信認の獲得》
原則 3	私たちは、社会の一員として豊かな社会と地球環境を次世代に継承するための活動に取り組みます	(1) P.11	原則7：従業員に対する適切な動機づけの枠組み等	-
		(2) P.12	原則7：従業員に対する適切な動機づけの枠組み等	-
原則 4	私たちは、お客さま、社会、そして社員自身のQOLに貢献する人財を育成します	(1) P.13	-	《専門性と創造性の追求》
		(2) P.14	原則7：従業員に対する適切な動機づけの枠組み等	《専門性と創造性の追求》

【FD・サステナビリティ原則1】

私たちは、責任ある機関投資家として運用責任を全うします

(1)

お客さまの最善の利益のために、資産運用会社の中核を担う運用人財の育成に注力し、最先端のIT技術と国内外のネットワークの活用等により、運用手法、トレーディングならびにリスク分析の高度化に取り組みます。

顧客本位の業務
運営に関する原則

原則2：顧客の最善の利益の追求

資産運用業宣言
2020

《専門性と創造性の追求》《顧客利益の最優先》《信認の獲得》

2022年度の取り組み

方針

- アジアのネットワークを広げる等、中長期的な視点でのビジネスプランを策定してまいります。
- お客さまの最善の利益の観点から、ファンドの商品性および運用品質に関する評価プロセスのプロダクトガバナンスについて一体的な見直しを行います。
- 2023年4月入社から運用コース新卒採用を開始し、運用人財の育成に注力します。
- リサーチ業務等におけるAIやRPAの活用、各種情報のデータベース化など、ITツール活用による業務効率化を推進します。

実績

- アジアにおける拠点間の連携を強化するために、香港およびシンガポール現地法人ならびに上海駐在員事務所を統括するアジア本部を設置しました。また、成長が期待できる中国本土での資産運用業務、資本市場への参入のため、上海現地法人を設立しました。
- アジア・英国・米国の海外拠点のリサーチ力を活かしたグローバル資産の内外一体運用を行っております。
- お客さまの最善の利益の観点からプロダクトガバナンスを強化するため、ファンドのモニタリングの拡充や評価・改善プロセスの見直しを行いました。
- 2023年4月新入社員より運用コース別採用を開始するなど、運用プロフェッショナル人財の育成に取り組んでおります。（2023年4月新入社員20名中6名が運用コース）
- 自然言語処理による新興国の多言語ニュース解析や投資候補銘柄の抽出など、AI等先進技術を運用の高度化に活用しております。

今後の方針

- グローバルのネットワークを活用し、中長期的な視点からビジネスプランを策定します。
- 国内外の運用・リサーチ体制の強化により、海外資産やマルチアセット資産の自社運用力の向上に取り組みます。
- インフラ・PE・不動産を中心に非伝統的資産の提供商品拡大および運用力の向上に取り組みます。
- 持続的に競争力を維持・向上するためのプロフェッショナル人財の確保・養成に取り組みます。

《関連指標1》当社運用に関する外部評価推移

アワード受賞ファンド数（※）

2020年	2021年	2022年
26件	27件	29件

※ リフィニティブ・リッパ・ファンド・アワード、R&Iファンド大賞、マーサーMPAファンドアワードの受賞ファンドの合計

《関連指標2》アクティブ運用プロダクトのパフォーマンス

年金・機関投資家向け主要自社アクティブ運用プロダクトのパフォーマンス上位割合（3年累積）	2020年度末		2021年度末		2022年度末	
	目標	実績	目標	実績	目標	実績
相対順位10%以上の占率	15%	5%	15%	11%	15%	10.5%
相対順位25%以上の占率	35%	20%	35%	26%	35%	31.6%
相対順位50%以上の占率	65%	50%	70%	68%	75%	63.2%

《関連指標3》運用人財の専門性

米国証券アナリスト(CFA)または国際公認投資アナリスト(CIIA) 資格取得者数

83名（2023年4月1日現在）

【FD・サステナビリティ原則1】

私たちは、責任ある機関投資家として運用責任を全うします

その一歩で、
未来は変えられる。



(2)

ESG要素を運用プロセスに組み込むとともに、投資先企業にサステナビリティに考慮した行動を促し、当該企業の中長期的な企業価値の向上に資するものとなるエンゲージメントおよび議決権行使等のスチュワードシップ活動に積極的に取り組みます。

顧客本位の業務運営に関する原則	—	資産運用業宣言 2020	《責任ある投資活動》
-----------------	---	-----------------	------------

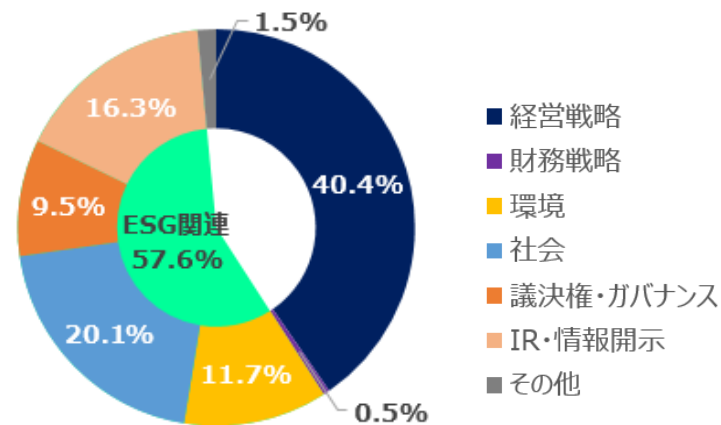
2022年度の取り組み

方針	<ul style="list-style-type: none"> ■ 当社は、エンゲージメント活動等を通じて、投資先企業に対して資源の有効利用や循環経済への貢献等、環境負荷軽減に向けた取り組みを後押しします。投資先企業が人権デューデリジェンスの継続的な実施により、サプライチェーンにおける人権リスクを適切に管理するよう働きかけを行う方針です。 ■ 議決権行使にあたっては、取締役選任への判断に従来のROE基準にTSR（株主総利回り）基準を加味した上で、企業価値向上への意識の向上、具体的な戦略の実行を促す方針です。
実績	<ul style="list-style-type: none"> ➢ 2022年度は2,397件の単独エンゲージメントを実施し、そのうち対話相手が取締役・執行役員以上のエンゲージメントの比率は約73%、ESG関連のトピックをテーマとしたエンゲージメントは約58%となりました。詳細は当社HP「2022年4月-2023年3月のエンゲージメント活動実績」をご覧ください。 ➢ 議決権行使における取締役選任議案では、2022年度より追加したTSR基準によって、業種平均対比で著しく劣位だった約4%の企業に反対行使しました。 ➢ 2023年1月、ガバナンス強化や多様性向上を含む国内株式議決権行使判断基準の改定を行いました。詳細は当社ホームページをご覧ください。

今後の方針

- 当社は責任投資（スチュワードシップ活動およびESG活動）への取り組みを通じて、お客さま・最終受益者の皆さまに良質な投資リターンをご提供することを目指します。
- 議決権行使にあたっては、方針に従って行使するとともに、ESGやサステナビリティに関する戦略やリスク管理、情報開示等に課題がある場合、不正不祥事等の社会的信用に関する行為が生じた場合など、定時株主総会等に向けて必要と判断した場合には、積極的な対話の実施に努めます。
- 当社が開示する投資先企業の議案ごとの議決権行使結果について、従来のPDFに加えてエクセル開示を追加し、データとして活用・分析できるようにします。（2023年5月より実施済）

【活動実績（単独エンゲージメント）】テーマ別内訳



《関連指標1》外部機関調査※

【年金情報】 スチュワードシップ活動 に対する満足度評価	2020年度		2021年度		2022年度	
	順位	満足度	順位	満足度	順位	満足度
	12位	3.35 (+0.07)	2位	3.61 (+0.26)	5位	3.50 (▲0.11)

※ 格付投資情報センター発行「年金情報」2023年1月9日号「運用委託先の年金顧客満足度アンケート」より三井住友DSアセットマネジメント作成

【FD・サステナビリティ原則1】

私たちは、責任ある機関投資家として運用責任を全うします

(3)

資産形成層に向けた長期運用商品をはじめ、さまざまなお客さまの真のニーズを掘り起こし、公正かつ最適な商品・サービスの開発・提供に取り組むとともに、IT技術を活用した運用状況等に関するタイムリーな情報提供を行います。

顧客本位の業務
運営に関する原則

原則2：顧客の最善の利益の追求、原則5：重要な情報の分かりやすい提供、
原則6：顧客にふさわしいサービスの提供

資産運用業宣言
2020

《顧客利益の最優先》《信認の獲得》

2022年度の取り組み

方針

- 販売会社、受託銀行など関係者と協議を行い、同一チャネルにおけるインデックスファンドの信託報酬率の差異の適正化に努めます。

実績

- 販売チャネル区分毎に信託報酬を統一する方針とし、同一区分内で差異のあった「DC」向けの信託報酬を統一しました。
- ゴールベースアプローチ型ファンドラップサービス※の提供を株式会社広島銀行と業務提携いたしました。
※お客さまがアドバイザーに相談しながら、ライフプランに応じて設定する複数の運用目標（ゴール）に対する資産運用プランを提供する投資一任サービス

今後の方針

- インデックスファンドの新規設定時および既存ファンドへの販売会社追加時には、それらを販売するチャネルの既存ファンドとの間で信託報酬に差異が生じない運営に努めます。
- ゴールベースアプローチ型ファンドラップサービスの提供等により、お客さま一人ひとりに寄り添った長期的な資産形成をサポートします。
- プロダクトガバナンスの強化により、運用商品の長寿化に努めます。

《関連指標1》 設定来10年以上のファンド数

設定来10年以上のファンド数	2020年度末	2021年度末	2022年度末
純資産100億円以上	47	51	57

《関連指標2》 外部機関調査

【ファンド情報】 投信会社満足度調査 (総合評価)	2020年度		2021年度		2022年度	
	順位	満足度	順位	満足度	順位	満足度
	4位	3.68 (+0.03)	4位	3.78 (+0.1)	12位	3.49 (▲0.29)

※ 格付投資情報センター発行「ファンド情報」2022年10月10日号「投信会社満足度調査」より三井住友DSアセットマネジメント作成

《関連指標3》 ライフステージ対応型ファンドの運用残高

長期資産向け公募投信	2020年度末		2021年度末		2022年度末	
	本数	残高 (億円)	本数	残高 (億円)	本数	残高 (億円)
DC、iDeCo、つみたてNISA等、長期資産形成向け公募投信の運用残高	102	9,635	104	12,725	109	14,226

定率取崩し型公募投信※	2020年度末		2021年度末		2022年度末	
	残高 (億円)		残高 (億円)		残高 (億円)	
分配を抑制するコースを含む運用残高	681		1,034		1,078	

※ 目標分配率を設定し、目標分配率に応じた分配を行うことを目指す商品

【FD・サステナビリティ原則1】

私たちは、責任ある機関投資家として運用責任を全うします

(4)	利益相反取引の適切な管理や経営の独立性を担保するガバナンス体制を整備するとともに、透明性の高いリスクや手数料の開示に努めてまいります。		
	顧客本位の業務運営に関する原則	原則3：利益相反の適切な管理、原則4：手数料等の明確化、 原則5：重要な情報の分かりやすい提供原則6：顧客にふさわしいサービスの提供	資産運用業宣言 2020

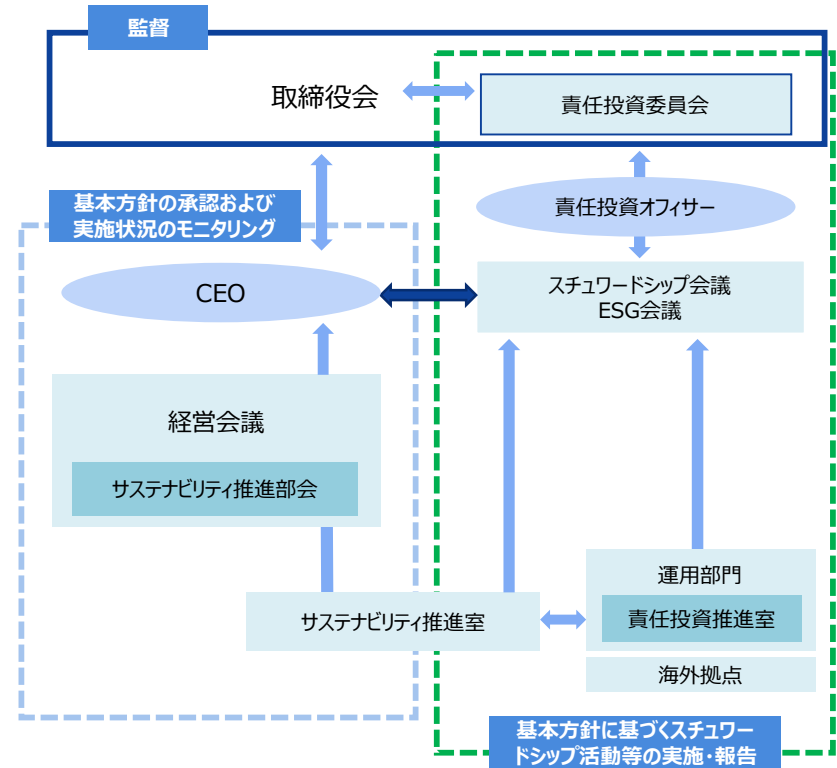
2022年度の取り組み

方針	<ul style="list-style-type: none"> ■ お客さまの大切な資金をお預かりする受託者として、引き続き厳格な利益相反管理を行います。 ■ 社内のESG関連データの情報基盤を整備し、当社が運用するUCITSファンドについてSFDRに準拠した情報開示を拡充します。
実績	<ul style="list-style-type: none"> ➢ 当社では利益相反管理統括部署を法務コンプライアンス部とし、利益相反管理状況を四半期ごとに「コンプライアンス会議」において報告しました。 ➢ 利益相反取引等を含む業務運営は、グループから独立した社外取締役も委員をつとめる責任投資委員会において確認、監督を受けています。 ➢ 「環境・社会のサステナビリティが投資先企業の財務状況に及ぼす影響」および「投資先企業の事業活動が環境・社会に与える影響」に関する当社の方針を2023年1月に公表しました。当社の方針はこちら。 ➢ 販売会社による当社公募投信の「重要情報シート」の作成に必要なデータを目論見書の更新時期にあわせて提供しています。これにより、リスクや手数料に関して透明性の高い開示に販売会社と協働して努めています。

今後の方針

- 当社の「利益相反管理規程」や「利益相反管理方針」に従い、法令等の遵守はもとよりフィデューシャリー・デューティーの観点から利益相反管理態勢を整備し、お客さまの利益を不当に害することを防止します。
- これまで運用報告書に記載していたファンドの「総経費率」を目論見書にも記載し、ファンド購入時における費用開示の透明化に取り組んでまいります。

【当社のサステナビリティ推進体制】



【FD・サステナビリティ原則1】

私たちは、責任ある機関投資家として運用責任を全うします

その一歩で、
未来は変えられる。



(5) 企業としての健全性を維持するとともに、さまざまな危機の発生に備えるべく危機管理体制の強化に取り組みます。

顧客本位の業務
運営に関する原則

原則2：顧客の最善の利益の追求、
原則7：従業員に対する適切な動機づけの枠組み等

資産運用業宣言
2020

《顧客利益の最優先》

2022年度の取り組み

方針

- 全社的なコンプライアンス研修に加え管理者向け研修も活用し、引き続き高い倫理意識を醸成するよう努めます。
- 役職員の環境問題・社会課題に対する理解を深め、当事者意識を高めることを目的とするサステナビリティ研修を実施します。
- 気候変動に係る移行リスクおよび物理リスクのシナリオ分析を2022年度中に開示し、TCFDに基づく情報開示の充実を図ります。

実績

- TCFDに基づく情報開示として、MSCI社が提供する分析ツール「CVaR (Climate Value-at-Risk)」を用いて、当社ポートフォリオの移行リスクおよび物理リスクの分析を行いました。
- 定期的な全社員対象のコンプライアンス研修に加え、各部署長を対象としたコンプライアンス管理者連絡会議により、各部署ごとにコンプライアンスを考える取り組みを行っています。【受講率100%】

今後の方針

- 全社的なコンプライアンス研修ならびに管理者向け研修を通して、引き続き高い倫理意識を醸成するよう努めます。
- 気候変動に係る移行リスクおよび物理リスクのシナリオ分析について、TCFDに基づく情報開示を継続します。

【気候変動に係る移行リスクおよび物理リスクのシナリオ分析 (TCFDに基づく情報開示)】

気温上昇シナリオ別/資産クラス別の潜在的ポートフォリオ価値毀損

(赤色：価値毀損、緑色：価値創造)

資産クラス	シナリオ	全社ポートフォリオ	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券
		1.5℃				
移行リスク + 物理的リスク						
移行リスク						
政策リスク	スコープ1					
	スコープ2					
	スコープ3					
技術機会						
物理的リスク(原因別)						
沿岸洪水						
猛暑						
台風						
河川洪水						
物理的リスク(地域別)						
日本						
中国						
米国						
タイ						
シンガポール						
その他						



【FD・サステナビリティ原則2】

私たちは、資産運用ビジネスを通じて持続可能な社会の実現に取り組みます

(1)

少子高齢社会がますます進展する我が国では資産形成の取り組みが不可欠との認識のもと、幅広い世代を対象に金融リテラシー向上のための教育啓蒙活動に取り組みます。

顧客本位の業務
運営に関する原則

—

資産運用業宣言
2020

—

2022年度の取り組み

方針

- 国内の少子高齢化がますます進むなかで、人生の早い時期から資産形成に取り組むことの重要性を伝える金融教育活動に注力します。
- 当社が目指す「サステナブルな社会」の実現に向けた取り組みを含め、サステナビリティへの理解を深めて頂くための情報発信等も積極的に行ってまいります。

実績

- 当社は、幅広い世代を対象に金融リテラシー向上のための教育啓蒙活動に取り組んでおり、小中高生向けには、まずは金融や経済に関心を持ってもらうためにカードゲーム「エコノミカ」を用いた出張授業を行っています。2022年度は、複数の小学校や、全国各地の予選を勝ち上がった高校生が集うエコノミクス甲子園で開催しました。
- SMBCグループ各社が協働で実施する、高校生や大学生を対象としたお金に関する出張授業に当社も参加しました。
- 当社ウェブサイトやSNSにて、サステナブルプロダクト等の動画や、資産形成に役立つコンテンツを配信しました。

今後の方針

- 学生向けの金融リテラシー向上のための授業を主催し、幅広い世代を対象とした金融教育啓蒙活動に注力します。
- 投資家の方々に環境問題や社会課題を自分事として考えてもらえるように、サステナビリティやESG投資に関する情報を効果的に発信します。

《関連指標1》 出張授業・金融リテラシー向上セミナー等受講者数

2020年度		2021年度		2022年度	
回数	参加人数	回数	参加人数	回数	参加人数
15	815	12	736	14	1,324

【出張授業の様子】



【FD・サステナビリティ原則2】

私たちは、資産運用ビジネスを通じて持続可能な社会の実現に取り組みます

(2)

当社独自のスチュワードシップ活動ならびに国内外のイニシアティブへの参加を通して、気候変動をはじめとする環境問題や人権等の社会問題の解決に取り組みます。

顧客本位の業務運営に関する原則	—	資産運用業宣言 2020	《責任ある投資活動》
-----------------	---	-----------------	------------

2022年度の取り組み

- | | |
|----|--|
| 方針 | <ul style="list-style-type: none"> ■ 資産運用業務におけるマテリアリティを中心に、投資先企業にとって付加価値のあるエンゲージメントを実施するよう努めます。 ■ NZAMI（※1） 2030年中間目標およびその実現のためのアクションプランを策定・公表します。また、気候変動（2050年GHG排出量実質ゼロ）と並ぶ当社全体のインパクト目標の設定とアクションプランの策定を行います。 ■ 国内外の動向をタイムリーに把握するため、人権関連その他のイニシアティブに参加します。 |
|----|--|

- | | |
|----|---|
| 実績 | <ul style="list-style-type: none"> ➢ 当社は、NZAMI加盟時のコミットメントに基づきGHG排出に関する2030年中間目標を右記の通り設定し、2023年7月に公表しました。 ➢ 当社が署名する国連責任投資原則（PRI）が新たに立ち上げた人権関連イニシアティブである「Advance」（※2）にコラボレイティング・インベスターとして2022年12月に署名しました。 |
|----|---|

今後の方針

- 引き続き資産運用業務におけるマテリアリティを中心に、投資先企業にとって付加価値のあるエンゲージメントを実施するよう努めます。
- 「Advance」（人権関連イニシアティブ）が主催する協働エンゲージメントへの参加等を通して、労働者や事業活動を行う地域社会における人権問題の解決に向けた取り組みを投資先企業等に促し、サステナブルな社会の実現に貢献します。

※1 NZAMI (Net Zero Asset Managers Initiative) : 2050年までの温室効果ガス（以下、「GHG」）排出量実質ゼロの達成に向けた国際社会の取り組みに賛同し、同目標の実現を目指すグローバルな資産運用会社によるイニシアティブ。当社は2022年3月に加盟。

※2 Advance : Advanceは、人権およびその他の社会課題の解決を目指す機関投資家による協働イニシアティブとして2022年12月1日に発足しました。発足時の参加機関投資家は220社、運用資産の総額は約30兆ドルに及びます。

【NZAMIへのコミットメントに基づく2030年中間目標設定】

1. 対象運用資産

当社が運用する国内外の株式および事業債を対象とします（2022年3月末時点において全ての運用資産（AUM）の54%相当）。今後、国際的な基準に基づきGHG排出量計算が可能な資産のスコープ拡大に合わせて、対象運用資産を適宜拡大する方針です。

2. 目標

2021年3月末における対象運用資産のカーボンフットプリント（注）を、2030年までに50%削減することを目標とします。（注）カーボンフットプリント＝運用資産金額（米ドルベース）あたりのGHG排出量＝GHG排出量÷運用資産金額 GHG排出量は当面「スコープ1+2」

3. 今後の取り組み

当社は、2020年公表の「当社のESG重点テーマ」、2022年公表の「資産運用業務におけるマテリアリティ」において、気候変動を重要度が高い項目として特定し、さまざまな施策を展開しています。

エンゲージメントにおいては、気候変動に関わる重点セクターやターゲット企業を主な対象として、実質を重視した真にステークホルダーにとって価値のある対話・提言を行っています。また、議決権行使においては、対話結果をより重視したプロセスへの移行することとしており、投資先企業に対して気候変動に関する積極的な情報開示を促し、開示が不十分で改善の意思が見られない場合には取締役選任に反対を行います。

【FD・サステナビリティ原則2】

私たちは、資産運用ビジネスを通じて持続可能な社会の実現に取り組みます

(3) 社会全体のサステナビリティにフォーカスした商品の開発・提供のための取り組みを強化します。

顧客本位の業務運営に関する原則	原則5：重要な情報の分かりやすい提供、原則6：顧客にふさわしいサービスの提供	資産運用業宣言2020	《信認の獲得》
-----------------	--	-------------	---------

2022年度の取り組み

- 方針**
- 既存の欧州向けプロダクトについては、Article6からArticle8に順次移行します。
 - ESG/サステナビリティ関連ファンドの適切な運営、お客さまに誤解を与えない適切な情報開示を行うよう、現状の課題を特定したうえで運営管理フレームワークを構築します。

- 実績**
- UCITSファンドについては、Article8に変更する準備を進めています。
 - 当社が運営するすべてのファンドおよびプロダクトを対象に「サステナブルプロダクト認定基準（以下「認定基準」）」に基づく分類を2020年3月から行いました。2022年11月に認定基準の見直しを行い、当社における「ESGプロダクト」を定義しました。また「サステナブルファンド」の運営管理フレームワークを定めました。

ESGプロダクトに該当する公募投信は以下の通りです（2023年6月30日現在）

分類	公募投信
ポジティブスクリーニング	三井住友・日本株式ESGファンド
ESGテーマ型	イノベティブ・カーボンニュートラル戦略ファンド、 クライメート・ソリューション・ファンド、 グローバルEV関連株ファンド（為替ヘッジなし）/ （為替ヘッジあり）、グローバルSDGs株式ファンド、 グローバルGX関連株ファンド、アジアGX関連株 ファンド、フード・イノベーション厳選株ファンド
インパクト	世界インパクト投資ファンド、世界インパクト投資ファンド （資産成長型）

今後の方針

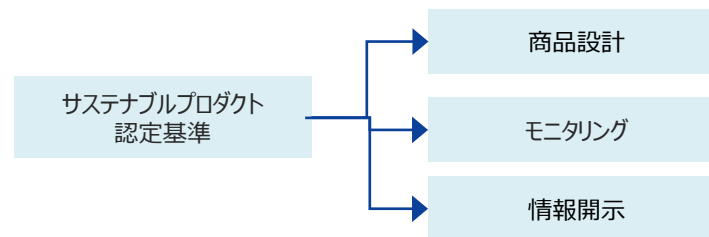
- ✓ 金融庁のESG投信に関する「金融商品取引業者等向けの総合的な監督指針」を踏まえ、ESGプロダクトの定義の見直しおよび同指針に沿った開示を進めてまいります。

当社のESGプロダクト

分類	概要	ESGプロダクト
スタンダード	全社共通で取り組むスチュワードシップ活動、ネガティブスクリーニングを適用している	
インテグレーション	サステナビリティを考慮し、ESG評価を投資判断プロセスに組み込んでいる	
インテグレーションプラス	サステナビリティを重要な超過収益源の一つと位置付け、ESG評価を定量的、体系的に活用している	
エンゲージメントプラス	運用担当者が、企業価値の向上に資するESGテーマに係る対話を主体的に行っている	
ポジティブスクリーニング	優れたESG要素を備える企業等に投資する特定の定量的なスクリーニング基準を組み込んでいる	○
ESGテーマ型	特定のサステナビリティ課題・テーマを設定し、それらに貢献する企業等を投資対象としている	○
インパクト	投資リターンに加え、サステナビリティ課題解決への貢献を目的に投資先企業等を選定している	○

2022年11月より「ポジティブスクリーニング」、「ESGテーマ型」および「インパクト」を「ESGプロダクト」と定義しております。

サステナブルプロダクトの運営管理フレームワーク



当社では、上記のフレームワークの実践を通して、実際の運用が認定基準に基づく分類と齟齬がないかをモニタリングするとともに、受益者やお客さまにわかりやすく伝えるよう情報開示の充実を図ってまいります。

【FD・サステナビリティ原則3】

私たちは、社会の一員として豊かな社会と地球環境を次世代に継承するための活動に取り組みます

(1) 地域の活性化や社会福祉支援等の社会貢献活動に参加します。

顧客本位の業務運営に関する原則	原則7：従業員に対する適切な動機づけの枠組み等	資産運用業宣言 2020	—
-----------------	-------------------------	-----------------	---

2022年度の取り組み

方針	<ul style="list-style-type: none"> ■ 特定の公募投信からの収益の一部を環境問題・社会課題の解決に資する活動を行っている研究機関等の団体に寄付を行ってまいります。 ■ 給与天引きによる「三井住友DSアセットQOL基金（以下、QOL基金）」を中心に、社員参加型の活動に注力します。
実績	<ul style="list-style-type: none"> ➢ 富岡製糸場・絹産業遺産群保護活動応援ファンド、世界新時代株式ファンド、イノベーション・カーボンニュートラル戦略ファンドにおいて、信託報酬の一部を商品コンセプトに則した活動を行っている団体に寄付を行いました。2022年度にファンドの信託報酬の中から寄付した金額は約25百万円となりました。 ➢ QOL基金の支援先団体との協業により、イベントの共催、ボランティア活動への参加など、当社の役職員がサステナビリティへの理解を深める活動を行っています。2021年6月の基金設立以来、会社マッチング分を含めた寄付の累計金額は約2百万円となりました。 ➢ 地域社会への貢献として、オフィス周辺の清掃活動、本社を置く東京都港区が主催する大会「MINATOシティハーフマラソン」でのボランティア等の活動を行っています。

今後の方針

- 引き続き特定の公募投信からの収益の一部を環境問題・社会課題の解決に資する活動を行っている研究機関等の団体に寄付を行います。
- 社員が社会貢献活動に参加できる機会を拡充します。

《関連指標1》社員のボランティア活動参加延べ人数

2020年度	2021年度	2022年度
20	282	433

社員参加型の社会貢献活動の様子



【FD・サステナビリティ原則3】

私たちは、社会の一員として豊かな社会と地球環境を次世代に継承するための活動に取り組みます

(2) 温室効果ガスの排出量削減やプラスチックごみの削減など、環境に配慮した事業経営を行います。

顧客本位の業務運営に関する原則	原則7：従業員に対する適切な動機づけの枠組み等	資産運用業宣言 2020	—
-----------------	-------------------------	-----------------	---

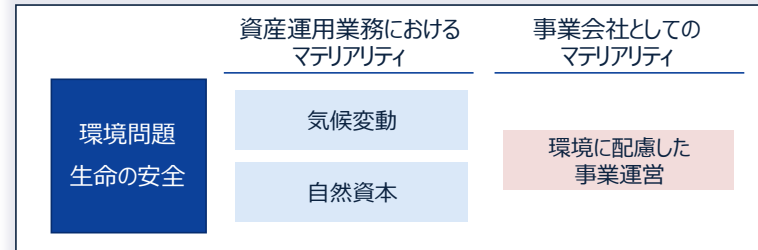
2022年度の取り組み

方針	<ul style="list-style-type: none"> ■ オフィス利用面積の削減やエネルギー効率の高いビルへの移転、再生エネルギー由来の電力への切り替え等により、2030年までの排出量実質ゼロ（スコープ1および2）を目指します。 ■ 従前よりデジタル化によるペーパーレス化を進めていますが、ペーパーレス化が困難な印刷物には、責任ある木質資源を原料とするFSC認証用紙の採用を進めます。
実績	<ul style="list-style-type: none"> ➢ 2022年9月にグループ会社が虎ノ門オフィス内に移転する等、当社グループ全体でのオフィス使用面積を削減し、CO2総排出量を削減しました。 ➢ 本社入居するビルで供給される電力が2022年10月より再生エネルギーに切り替えられたことにより、実質的なCO2排出量は大幅に削減されています。 ➢ 社員のペーパーレス化意識を高め、社内での紙使用削減を推進するとともに、印刷物として必要な公募投信の販売用資料等の一部に関しては、FSC認証用紙への移行を進めています。

今後の方針

- 国内拠点に加えて、海外拠点を含む全社的なGHG（スコープ1および2）を管理し、2030年までの排出量実質ゼロを目指します。
- ESGプロダクトの資料等をFSC認証用紙に変更する等、環境に配慮した資源の使用に努めます。

当社マテリアリティ（環境問題）



《関連指標1》地球環境保全に関するKPI

K P I		2020年度		2021年度		2022年度	
		実績	比率	実績	比率	実績	比率
使用オフィスビルの温室効果ガス（GHG）排出量	2019年度に対する比率	1,139 tCO2e	84.7%	923 tCO2e	68.7%	598 tCO2e	44.5%
紙使用量（購入枚数）		4,040 千枚	39.2%	2,608 千枚	25.4%	2,143 千枚	20.9%

【FD・サステナビリティ原則4】

私たちは、お客さま、社会、そして社員自身のQOLに貢献する人財を育成します

(1)	多様な価値観を持つ社員がそれぞれの能力を十分に発揮できる環境を整備し、女性活躍をはじめとするダイバーシティを推進します。		
	顧客本位の業務運営に関する原則	—	資産運用業宣言 2020 《専門性と創造性の追求》

2022年度の取り組み

方針	<ul style="list-style-type: none"> ライフステージやさまざまな事情に応じて社員が柔軟に働くことのできる制度や、社員が健康でワーク・ライフ・バランスを適切に保ちながら働く職場環境の改善に努めます。
	<ul style="list-style-type: none"> 2023年4月から始まる新人事制度において、一般職を廃止し、総合職に統合することにしました。 女性の活躍をサポートするため、女性管理職コミュニティを各期毎に開催するとともに、21世紀職業財団への派遣等管理職候補者の育成にも取り組んでいます。 男性社員の育休取得を促進するため、有給期間を15日から28日に拡大し、利用方法をわかりやすく解説したハンドブックを作成したり、希望者に対しては面談を実施したり、まとまった期間の取得をサポートしています。 人的資本開示の義務化に先駆けて、男女間賃金格差の公開を開始しました。
実績	

今後の方針

- 既存のダイバーシティ推進会議を人財戦略会議に改組し、DE&Iを含む幅広い人財・サステナビリティ関連テーマについての方針や戦略の方向性を示し、実施状況のモニタリング等を行います。
- ライフステージやさまざまな事情に応じて社員が柔軟に働くことのできる制度や、社員が健康でワーク・ライフ・バランスを適切に保ちながら働く職場環境の改善に努めます。
- 新人事制度をスタートさせ、自律的な能力開発と自発的なチャレンジを促します。

《関連指標 1》 DE & Iに関するKPI

	2020年度	2021年度	2022年度
	実績	実績	実績
有給休暇取得率	59.3%	61.4%	65.5%
時間外労働時間（月間平均）	26.3時間	25.2時間	22.9時間
女性管理職比率	11.3%	13.7%	16.7%
男性育児休業取得率	108.0%	108.3%	76.4%
障がい者雇用率	1.8%	2.1%	2.0%
社員エンゲージメントスコア※	-	-	67.8%

※組織文化調査において「仕事に誇りとやりがいを感じ、熱意をもって生き生きと働くことができている」と回答した社員の割合。

《関連指標 2》 男女間賃金格差

	2021年度	2022年度
	実績	実績
全労働者	56.2%	59.0%
正社員	54.7%	57.4%
有期社員	66.5%	56.1%

付記事項
 ・対象期間：
 2021年度：2021年4月1日～2022年3月31日
 2022年度：2022年4月1日～2023年3月31日
 ・正社員：社外への出向者を含む
 ・有期社員：契約社員、嘱託社員、アルバイト、パートが該当
 ・賃金：通勤手当・住宅手当・昼食手当等を除く

算出方法：
 ①全労働者の比率は、男女各賃金平均から比率を算出
 ②正社員・有期社員の比率は、職種ごとに男女各賃金平均から比率を算出

【FD・サステナビリティ原則4】

私たちは、お客さま、社会、そして社員自身のQOLに貢献する人財を育成します

(2)

すべての社員が、年齢や職責にかかわらず自分の仕事に誇りを持ち、それぞれの仕事において、プロフェッショナルな能力と識見を備えることができるように、さまざまなキャリア支援を行います。

顧客本位の業務運営に関する原則	原則7：従業員に対する適切な動機づけの枠組み等	資産運用業宣言 2020	《専門性と創造性の追求》
-----------------	-------------------------	-----------------	--------------

2022年度の取り組み

方針	<ul style="list-style-type: none"> ■ グローバルレベルのプロフェッショナル人財やDX人財を育成する研修や、多様な人財が活躍するためのチームワークを目的とするDE&Iの意識醸成研修等を体系立てて提供します。 ■ 社員が自ら必要と考える教育・研修を企画し、一定の条件を満たせば会社が予算をつけるプログラムを新たに創設します。 ■ 役職員の環境問題・社会課題に対する理解を深め、当事者意識を高めることを目的とするサステナビリティ研修を実施します。 ■ 従来の社内公募制度を拡充し、より多くの社員が自らの意志でキャリア形成を行う機会を提供します。
実績	<ul style="list-style-type: none"> ➢ 社員向けの教育研修を体系化し、グローバル人財育成、DX人財育成、年代別や専門職、管理職等、階層や習得すべきスキル別の研修を実施しました。 ➢ 社員自ら必要と考える教育・研修に予算を付けるプログラムを設け、動画作成スキルの向上等に関する研修を実施しました。 ➢ 役職員がサステナビリティに係る国内外の動向を理解できるよう、日経ESGアーカイブの提供や外部講師を招いたオンライン研修、e-learningなどの研修機会を提供しました。 ➢ 社内公募を前年の2ポジションから19ポジションに拡大し、10名が希望するポジションに異動しました。

今後の方針

- 当社自身の人的資本の最大化を目指し、人財戦略を策定し、社員の能力開発やキャリア支援、エンゲージメント向上に取り組みます。

【2022年度の社内研修体系】

当社が求める人財を育成するため、体系的な研修機会を提供します。

- ・ 自律的にキャリアを構築できる人財
- ・ 多様性を活かしたチームワークができる人財
- ・ グローバルレベルのプロフェッショナルとして業務を遂行できる人財



赤字は新規もしくはリニューアルした研修

重要な注意事項

- 当資料は、情報提供を目的として、三井住友DS アセットマネジメントが作成したものです。特定の投資信託、生命保険、株式、債券等の売買を推奨・勧誘するものではありません。
- 当資料に基づいて取られた投資行動の結果については、当社は責任を負いません。
- 当資料の内容は作成基準日現在のものであり、将来予告なく変更されることがあります。
- 当資料に市場環境等についてのデータ・分析等が含まれる場合、それらは過去の実績および将来の予想であり、今後の市場環境等を保証するものではありません。
- 当資料は当社が信頼性が高いと判断した情報等に基づき作成しておりますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。
- 当資料にインデックス・統計資料等が記載される場合、それらの知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。
- 当資料に掲載されている写真がある場合、写真はイメージであり、本文とは関係ない場合があります。
- 当資料に評価機関等の評価が掲載されている場合、当該評価は過去の一定期間の実績を分析したものであり、将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

本開示の基礎となる情報の提供者であるMSCI ESG Research LLCおよびその関連会社（以下「ESG関係者」）は、信頼性が高いと判断した情報等（以下「本情報」）を入手していますが、当資料に記載されているデータの独創性、正確性および／または完全性を保証するものではなく、商品性および特定の目的への適合性を含む一切の明示的または黙示的な保証を否認します。本情報は、いかなる形でも複製または再配布することはできません。また、いかなる金融商品の指数や構成要素として使用することはできません。さらに、将来のいかなる投資判断のために本情報自体を使用することはできません。ESG関係者は、本情報に関連する誤記や記載の欠落、または直接的、間接的、特別、懲罰的、結果的、その他の損害（逸失利益を含む）について、たとえその可能性を知らされていた場合でも、一切の責任を負わないものとします。なお、このディスクレーマーは英語版の抄訳であり、日本語版と英語の内容に相違がある場合、英語版が優先されます。 This disclosure was developed using information from MSCI ESG Research LLC or its affiliates or information providers. Although SUMITOMO MITSUI DS ASSET MANAGEMENT COMPANY, LIMITED'S information providers, including without limitation, MSCI ESG Research LLC and its affiliates (the "ESG Parties"), obtain information (the "Information") from sources they consider reliable, none of the ESG Parties warrants or guarantees the originality, accuracy and/or completeness, of any data herein and expressly disclaim all express or implied warranties, including those of merchantability and fitness for a particular purpose. The Information may only be used for your internal use, may not be reproduced or disseminated in any form and may not be used as a basis for, or a component of, any financial instruments or products or indices. Further, none of the Information can in and of itself be used to determine which securities to buy or sell or when to buy or sell them. None of the ESG Parties shall have any liability for any errors or omissions in connection with any data herein, or any liability for any direct, indirect, special, punitive, consequential or any other damages (including lost profits) even if notified of the possibility of such damages.

三井住友DS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399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