



# 「FD・サステナビリティ原則」の取り組み実績（2021年度）

---

2022年6月



# 「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2021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月に制定しております。この「FD・サステナビリティ原則」におきましては、資産運用会社としての責務を原則 1 [(1)～(5)]および原則 2 [(1)～(3)]として、また一企業市民としての責務を原則3[(1)～(2)]および原則 4 [(1)～(2)]として定めており、当社はこれらに取り組み、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。

※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致しません。

[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）」](#)

[一般社団法人 投資信託協会「資産運用業宣言2020」](#)

[一般社団法人 日本投資顧問業協会「資産運用業宣言2020」](#)

# 【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材の育成に注力し、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》

### 2021年度の取り組み

方針

- ✓ 従来から取り組んできた若手運用担当者の育成施策をプログラムとして整理・体系化します。また、グローバル展開を視野に入れたCFA等の国際的な資格の取得促進を含め、運用人材の育成にこれまで以上に注力します。
- ✓ 引き続き当社の自己資金によるパイロットファンドの設定・運用に積極的に取り組み、商品化に結び付けていくよう努めます。

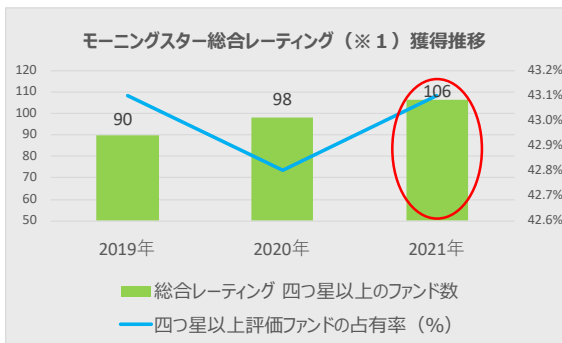
実績

- ① 運用プロフェッショナルに相応しい処遇制度として、2021年4月から運用専門職制度を導入しました。この制度を活用して、運用人材のレベルアップを図ります。また、新卒の運用コース採用(2023年4月入社より)を決定しました。
- ② 戦略分野である絶対リターン型やハイイールド債券のパイロットファンド立ち上げ、アジアのリサーチカバレッジを拡大し、夜間取引等の体制も整備しました。
- ③ 自社オリジナルのAIエンジンを開発し、国内株式運用銘柄選択等で活用を開始しました。
- ④ パフォーマンス不芳ファンドのモニタリングおよび運用リスク管理状況評価を行う運用評価会議、運用成績不芳ファンドの改善を討議するレビュー会議を通して、アクティブ運用商品のパフォーマンス改善に向けた取り組みを実施しました。

### 今後の方針

- ✓ 2023年度4月入社から運用コース新卒採用を開始し、運用人材の育成を一層推進します。
- ✓ 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ラダクトガバナンスについて一體的な見直しを行います。

《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 (※2)

2019年	2020年	2021年
35件	31件	31件

※1 モーニングスター株式会社 (以下、モーニングスター) がカテゴリー分類内のファンドのリスク調整後パフォーマンスを5段階の星印で表示したもので、5つ星が最高評価、1つ星が最低評価となります。詳細はP14の重要な注意事項をご覧ください。集計の対象は純資産総額が10億以上の公募投資信託。  
 ※2 モーニングスターアワード ファンドオブザイヤー、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	
	計画	実績	計画	実績
相対順位10%以上の占率	15%	5%	15%	11%
相対順位25%以上の占率	35%	20%	35%	26%
相対順位50%以上の占率	65%	50%	70%	68%

《関連指標3》運用人材の専門性

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

**91名 (2022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

(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》
-----------------	---	-----------------	------------

### 2021年度の取り組み

方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ 当社独自のESG評価の対象企業を拡大するとともに、すべてのアクティブ運用商品に、より明確な形でサステナビリティの要素を運用プロセスに取り込むよう努めます。</li> <li>✓ 新型コロナウイルスの影響を考慮した弾力的な議決権行使基準の適用、対象企業の環境問題・社会課題への取り組みやコーポレートガバナンス・コード再改訂の基準に反映します。</li> </ul>
実績	<p>① アクティブ運用商品をサステナビリティ要素の考慮の方法を基に分類を行いました。明確なインテグレーションを行っている運用資産残高（単体、2022年3月末）は10.2兆円です。</p> <p>② 2021年度に2,725件の単独エンゲージメントを実施しました。詳細は<a href="#">当社ホームページ</a>をご覧ください。</p> <p>③ 2022年1月、株主総利回り（TSR）基準やサステナビリティ・多様性基準の導入など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<a href="#">当社ホームページ</a>をご覧ください。</p> <p>④ 「サステナブルな社会の実現における重要性」と「長期的な運用パフォーマンスにおける重要性」の二つの視点から、「資産運用業務におけるマテリアリティ」を特定しました。</p>

### 今後の方針

- ✓ 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。

### 【当社の国内株式議決権行使基準改定のポイント】

1. 取締役会における独立社外取締役の構成基準の更新、厳格化。特に、東京証券取引所プライム市場上場企業は独立社外取締役2名以上もしくは構成比1/3以上を求める。
2. 株主総利回り（TSR）基準を新たに導入
3. サステナビリティ・多様性基準を新たに導入
4. 政策保有株式基準の更新、厳格化
5. 特定譲渡制限付き株式の付与対象として社外取締役（監査等委員会設置会社における監査委員等の取締役を除く）を追加
6. サステナビリティの情報開示に関する株主提案における賛成条件を新たに導入

### 【2021年度制定の当社マテリアリティ（資産運用業務）】

資産運用業務におけるマテリアリティ		エンゲージメント・議決権行使の方針
環境問題：生命の安全	気候変動	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
	自然資本	
社会課題：生活の質の向上	サプライチェーンの人権	中長期的な経営戦略と総合的な人財戦略策定による人材の採用・育成や社員が能力を発揮できる職場環境づくりに取り組みを働きかけ
	人的資本	
ガバナンス	コーポレートガバナンスの実効性	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基準を追加し、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
	企業倫理・組織文化	

### 《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	
	順位	満足度	順位	満足度
	12位	3.35 (+0.07)	2位	3.61 (+0.26)

※ 格付投資情報センター発行「年金情報」2022年1月3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》
-----------------	--	-----------------	-------------------

### 2021年度の取り組み

方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ 急速なデジタル化の進展を踏まえ、新たにB2C戦略を検討します。外部コンサルタントによる分析結果を活用した施策の具体化にあたり、若手社員を起用したB2Cプロジェクトを設置します。</li> <li>✓ 様々なお客さまのニーズに対応するため、外国籍投信、投資事業有限責任組合、トータルリターンズワップ、ETF等のスキームによるサービス提供能力向上を図ります。</li> </ul>
	実績
①	個人投資家の皆さまに資産運用をもっと身近に感じてもらうことを目的としたサービスブランド「Be Active.」(プロジェクト)を立ち上げました。このプロジェクトを通じて、当社の投資信託の運用に対する理念や哲学をより理解していただき、個人投資家の皆さまが資産形成を始め、長期にわたり継続することの一助になるよう情報発信やサービスの提供を行ってまいります。
②	お客さまのニーズに合わせ、分かりやすい映像コンテンツ(個別商品紹介含む)を230本以上作成し配信しております。
③	DC(確定拠出年金)・つみたてNISA等のライフステージ対応型の公募投信等、お客さまの長期資産形成のニーズに合う商品のご提供に注力しております。
④	同一チャネルで販売されてい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向け、社内関連部署で協議する体制を構築しました。

### 今後の方針

- ✓ 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。
- ✓ 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。

《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	2019年度末	2020年度末	2021年度末
純資産300億円以上	19	24	26
純資産100~300億円	26	23	25

《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	
	順位	満足度	順位	満足度
	4位	3.68 (+0.03)	4位	3.78 (+0.1)

※ 格付投資情報センター発行「ファンド情報」2021年10月11日号 第15回「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	2019年度末		2020年度末		2021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	94	6,482	102	9,635	104	12,725

定率取崩し型公募投信※	2019年度末	2020年度末	2021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	494	681	1,034

※ 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

(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》
-----------------	---	-----------------	------------

### 2021年度の取り組み

方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ 2022年1月に施行される公募投信の流動性リスク管理規制に対応できるよう社内体制を構築しモニタリングを実施してまいります。</li> <li>✓ 繰上償還候補ファンドについて、関係者と協議しながら繰上償還手続きを行ってまいります。</li> <li>✓ 当社自身の気候変動リスクへの対応を明確化するため、2021年度中に気候関連財務情報タスクフォース（TCFD）に基づく情報開示を行います。</li> </ul>
	<p>実績</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>① TCFDに基づく情報開示を開始しました。</li> <li>② 公募投信の流動性リスク管理規制に対応する為、流動性リスク管理規制会議を中心とする管理態勢を構築し、2022年1月からのモニタリングを開始</li> <li>③ コンプライアンスカルチャーの浸透・醸成を図るべく、全社員向けのコンプライアンス研修を実施するとともに、管理者向け研修等でコンダクトリスク等についても事例研究を行い、役職員への意識づけを強化しております。</li> <li>④ 運用方針に沿った運用の継続が難しくなる恐れのある商品を選定し、純資産総額が少額の公募投信を中心に繰上償還（35本）しました。</li> </ul>

### 今後の方針

<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ 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。</li> <li>✓ 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。</li> <li>✓ 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。</li> </ul>
---

### 【当社のTCFDに基づく情報開示（抜粋）】

	GHG排出量（スコープ1&2） （千tCO <sub>2</sub> e）		カーボンフットプリント （tCO <sub>2</sub> e/百万USD）		炭素強度 （tCO <sub>2</sub> e/百万USD）		加重平均炭素強度 （tCO <sub>2</sub> e/百万USD）		データカバレッジ （%）	
	当社	BM比（%）	当社	BM比（%）	当社	BM比（%）	当社	BM比（%）	当社	BM
国内株式	3,510	126	97	121	143	115	143	145	94	98
外国株式	347	89	41	89	183	103	177	114	98	100
国内債券	583	85	193	85	308	87	285	81	86	82
外国債券	115	74	59	74	172	77	225	86	85	90

ベンチマーク：国内株式 TOPIX、外国株式 MSCI KOKUSAJ、国内債券 Nomura BPI（事業債）、外国債券 Bloomberg Global Aggregate Ex-Japan - Corporate Total Return  
指標算出上の留意点（対象は2021年6月末時点の当社が運用するポートフォリオ。国内債券および外国債券は国債を除く。）

2021年度より、気候変動問題に係る当社の方針ならびに当社が運用する国内株式、外国株式、国内債券、外国債券を対象にGHG排出量関連指標の開示を開始しました。詳細は[当社ホームページ](#)をご覧ください。

### 【純資産少額ファンド数の推移】

	2019年度	2020年度	2021年度
公募投信繰上償還ファンド数	19本	24本	35本
純資産10億円未満の公募投信ファンド数 （年度末）	208本	176本	153本

# 【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	—
-----------------	---	--------------	---

### 2021年度の取り組み

方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ 「人生100年時代」における資産形成の重要性はますます高まっており、資産運用に関する正しい知識の普及、個人投資家の裾野拡大のために、金融教育に係る出張授業やセミナーに今後も積極的に取り組んでまいります。</li> </ul>
実績	<ol style="list-style-type: none"> <li>① 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、社会人向けには資産形成の重要性に関するセミナー、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。2021年度も、複数の小中学校での開催を予定していましたが、新型コロナウイルス感染拡大の影響によりすべて中止となりました。</li> <li>② SMBCグループ各社が協働で行った、高校生を対象としたキャリア形成に関する出張授業に当社も参加しました。</li> <li>③ 年金問題について娘に問われて答えにつまるサラリーマンと、資産運用会社の社員たちが主人公の当社紹介マンガを制作する等、資産運用に関する正しい知識の普及に取り組んでおります。</li> </ol>

### 今後の方針

- ✓ 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。

《関連指標 1》 金融教育啓蒙を目的とするセミナー等の実施回数

当社主催のセミナー実施回数	2020年度		2021年度	
	回数	参加人数	回数	参加人数
	15	815	12	736



### 当社紹介マンガ

個人の投資家に、まだまだ知られていない資産運用会社の役割を知ってもらうとともに、人生100年時代における資産形成の大切さや、投資を通じて社会に貢献する面白さを伝える内容の当社紹介マンガを製作いたしました。



# 【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》
-----------------	---	-----------------	------------

### 2021年度の取り組み

方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ エンゲージメントを通して投資先企業の環境問題、社会課題への取り組みならびに情報開示の改善を促すとともに、今後、議決権行使の判断基準にも環境問題・社会課題への取り組み状況を反映してまいります。</li> <li>✓ 国際的なイニシアティブであるCDP※1の元で行われるSBT（Science Based Targets）協働エンゲージメント※2に積極的に参加します。</li> </ul>
実績	<ul style="list-style-type: none"> <li>① 2021年7月に国内主要企業約150社を対象にレターを送付し、気候変動への対応および情報開示の充実を求めるエンゲージメントを開始しました。2022年3月末までに、レター送付対象外の企業を含め、気候変動をテーマに累計244件の対話を行いました。</li> <li>② 2050年までに温室効果ガスの排出量実質ゼロ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であるNet Zero Asset Managers Initiativeに2022年3月に加盟しました。</li> <li>③ 2021年10月、投資先企業に対して人権方針の策定ならびに人権デューデリジェンスの実施を求めることを定めた人権方針を制定しました。</li> </ul>

### 今後の方針

- ✓ 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 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。

### 【当社の人権方針（骨子）】

- 1. 基本的な考え**  
当社は、人権に関する国際規範を支持し、事業活動を行う国・地域における法令等を遵守するとともに、当該国・地域の法令等が国際的に認められた人権の原則と相反する場合は、当該国・地域の事情も勘案しつつ、国際的な人権の原則を尊重します。
- 2. 人権の尊重**  
当社は、基本的人権を尊重し、差別およびハラスメントを禁止するとともに、個人のプライバシーの保護に最大限の努力を行います。また、当社は、いかなる形態の児童労働、強制労働その他不当な労働慣行を容認しません。
- 3. 生き生きと働ける職場づくり**  
当社は、心身ともに健康で、ワークライフバランスを維持し、安全かつ安心して働くことができる職場環境を築くとともに、社員一人ひとりが能力を最大限発揮し、生き生きと働くことができる企業文化を醸成します。
- 4. バリューチェーンにおける人権**  
当社は、運用業務において、投資先企業等の人権問題への取り組みを重要な非財務情報として考慮するとともに、改善すべき点がある場合にはエンゲージメントを通して適切な対応を促します。また、運用およびその他の業務に係る主要な委託先に対しては、人権を尊重し、人権侵害を防ぐための適切な行動を求めることにより、バリューチェーンを通じた人権尊重に向けて責任を果たします。
- 5. 教育**  
当社は、すべての役職員が人権に関する国内外の課題について理解を深め、事業活動において人権を尊重するよう、適切な教育・研修を行います。
- 6. 影響評価**  
当社は、人権デューデリジェンスの仕組みを構築し、当社の事業活動がもたらし得る人権に対する負の影響を特定し、その未然防止および軽減を図るプロセスを継続的に実施します。
- 7. 苦情対応**  
当社は、事業活動が人権に対する負の影響を引き起こした場合、適切な手続きを通じてその救済や是正を行い、再発防止に取り組みます。また、バリューチェーンを通じてこれに関与したことが明らかになった場合、誠意をもって対話を行います。

※1 CDP：2000年に発足したロンドンに本部を置く国際的な非営利団体。機関投資家が連携し世界主要企業に対して環境戦略や温室効果ガス排出量などの開示を求めているプロジェクト。

※2 SBT協働エンゲージメント：CDPがプラットフォームとなり、世界で最も影響力のある1700の企業に対し、「1.5℃」に沿った排出削減目標を設定し、2050年までにバリューチェーンの排出量「ネット・ゼロ」達成を促進するための協働エンゲージメント。CDP署名機関のみが参加可能。

# 【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》
-----------------	--	-----------------	---------

#### 2021年度の取り組み

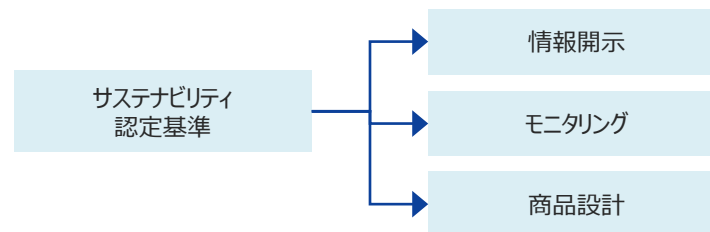
方針	✓ 当社ESGインテグレーション類型で「スタンダード」に分類されるプロダクトに関しては、サステナビリティ関連プロダクトとしての要件を満たせるよう、より明確な方法によりサステナビリティの要素を取り入れるよう運用プロセスの見直しを行います。
実績	<ol style="list-style-type: none"> <li>2021年3月のEUにおけるSFDR施行を踏まえ、すべての欧州向けプロダクトは原則としてArticle8（環境・社会的な特性を促進する商品）またはArticle9（サステナブルな投資目的を持つ商品）とする方針としました。</li> <li>信託財産の中長期的な成長を目指すとともに、サステナブルな社会の実現への貢献を目指すテーマ型ファンドの商品ラインナップ拡大に注力しました。</li> <li>当社は、運用プロセスへのESG要素のインテグレーションに応じた運用プロダクトのサステナビリティ認定を2020年度から行っております。これに加えて認定基準の年次レビュー、同基準の認定ファンドのモニタリングを社内規程に定めました。サステナビリティ認定基準に基づく分類は<a href="#">当社ホームページ</a>をご覧ください。</li> </ol>

#### 今後の方針

- ✓ 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。

#### 「ESG/サステナビリティ関連ファンド」の運営管理フレームワーク

2022年度中に、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。



- **サステナビリティ認定基準**の適切性について、国内外の市場参加者や規制の動向を踏まえて年次レビューを実施し、必要な見直しを行います。
- サステナビリティ認定基準で定めるESG要素のインテグレーションの手法および運用プロセスにおける重要度に応じて、ESG/サステナビリティ**情報開示ガイドライン**を策定します。
- サステナビリティ認定基準により認定されたファンドが、認定根拠とした運用手法やプロセスに則って運用されていることを確保する**モニタリングの仕組み**を構築します。
- ESG/サステナビリティ関連ファンドを新規に組成する際に、サステナビリティ認定基準による分類、運用内容および情報開示ガイドラインに基づく運営の実現性等を**チェックリスト**で確認のうえ、ファンド名称、信託期間、目論見書等の記載事項等の商品性を決定します。

# 【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	—
-----------------	-------------------------	--------------	---

### 2021年度の取り組み

方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ 2021年度から新たに以下の活動を行ってまいります。</li> <li>• できるだけ多くの社員が手軽に参加できるよう、毎月の給与から300円を募金する寄付基金を設立し、集めた資金を原資に幅広い社会貢献活動を行ってまいります。</li> <li>• 主として脱炭素化社会実現に向けた取り組みやイノベーションに貢献する研究等の支援を目的に、2021年3月30日に設定したイノベティブ・カーボンニュートラル戦略ファンドの信託報酬の一部を寄付する予定です。</li> </ul>
実績	<ol style="list-style-type: none"> <li>① 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2021年6月に設立しました。QOL基金および会社からの寄付金（QOL基金と同金額）を社会課題の解決を目指して活動する団体に寄付しました。</li> <li>② QOL基金の支援先団体との協業により、社内セミナーの開催、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。</li> <li>③ 2021年に設定したイノベティブ・カーボンニュートラル戦略ファンドなどにおいて、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しました。これまでにファンドの信託報酬の中から寄付した金額の累計は約38百万円（2022年3月末現在）となりました。</li> </ol> <p><a href="#">『イノベティブ・カーボンニュートラル戦略ファンド』に関する寄付の実施について</a></p>

### 今後の方針

- ✓ 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。
- ✓ QOL基金を中心に、社員参加型の活動に注力します。

《関連指標 1》社員のボランティア参加人数

2021年度 282名

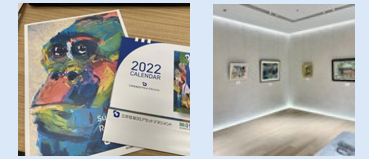
### 「三井住友DSアセットQOL基金」の支援先団体と主な活動

#### 公益財団法人日本チャリティ協会

目的：障がい者アートの支援

主な活動：

- 展覧会への協賛、IR誌へのアート作品採用
- 本社オフィスでのパラアート作品展の開催



#### 認定NPO法人JUON NETWORK

目的：森林保全活動の支援

主な活動：

- 間伐材を使った割り箸を社内カフェテリアで採用
- 森林保全活動へのボランティア参加

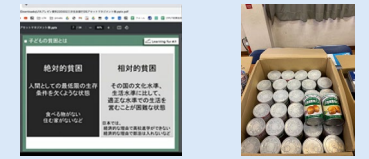


#### NPO法人 Learning for All

目的：貧困家庭の子ども支援

主な活動：

- 社内セミナーの開催
- 災害備蓄食料品の寄贈



# 【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。

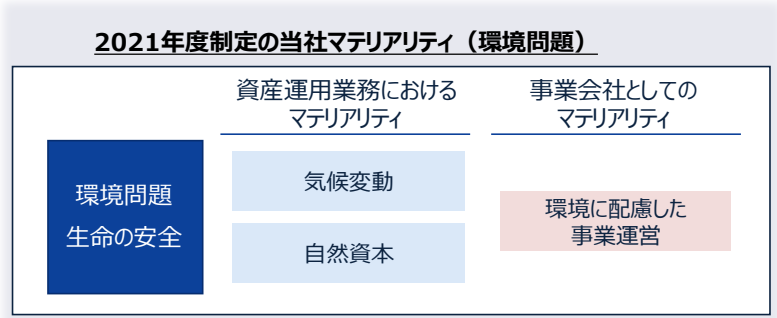
顧客本位の業務運営に関する原則	原則7：従業員に対する適切な働きかけの枠組み等	資産運用業宣言 2020	—
-----------------	-------------------------	-----------------	---

### 2021年度の取り組み

方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ エネルギー消費量削減の努力を継続的に行うほか、商品やサービスの購入にあたっては環境への影響や相手方の人権や労務管理の状況を考慮するサステナブル調達方針を2021年度中に策定します。</li> <li>✓ 温室効果ガス排出量に係る日本政府の削減目標を踏まえ、当社自身の排出削減ロードマップを2021年度中に策定します。</li> </ul>
	<p>① FD・サステナビリティ原則に基づき、自社の企業活動においてもサステナブル調達方針として環境への対応と人権尊重について2021年度に決めました。</p> <p>② 事業会社としての当社マテリアリティに『環境に配慮した事業運営』を選定し、今後の方針を公表致しました</p> <p>③ 経営会議傘下にサステナビリティ推進部会を設置し、部門横断でサステナビリティにかかわる取り組みを議論するとともに、社員にも取り組み方針や活動内容を周知させる体制を整えました</p>
実績	

### 今後の方針

- ✓ 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。



《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	
		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%
紙使用量（購入枚数）		4,040 千枚	39.2%	2,608 千枚	25.4%

# 【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》
-----------------	---	-----------------	--------------

### 2021年度の取り組み

方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ 2021年4月にフルフレックス勤務制度を導入し、社員がそれぞれの事情にあわせてより柔軟な働き方が選択できる環境を整えます。</li> <li>✓ 女性管理職比率向上のため、女性管理職およびその候補者に対するサポートを引き続き行います。</li> </ul>
----	---

実績	<ol style="list-style-type: none"> <li>① フルフレックス制度やテレワーク制度を導入し、社員がそれぞれのライフスタイルに合わせた柔軟な働き方を選択できるよう、環境を整備しております。</li> <li>② 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おります。</li> <li>③ 同時に第二新卒採用やリファラル採用を開始し、採用する社員の多様化も推進しております。</li> </ol>
----	---

### 今後の方針

✓	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。
---	---

【当社のダイバーシティ推進体制(会議体)】



《関連指標1》DE&Iおよび健康経営に関するKPI

K P I	2020年度	2021年度	2022年度
	実績	実績	計画
女性管理職比率	11.3%	13.7%	15%
有給休暇取得率	59.3%	61.4%	75%
時間外労働時間 (月間平均)	26.3時間	25.2時間	20.0時間
障がい者雇用率	1.8%	2.1%	2.3%
男性育児休業取得率	108.0%	108.3%	100%
喫煙率	15.6%	15%	12%

# 【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》
-----------------	-------------------------	-----------------	--------------

### 2021年度の取り組み

方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>シニア社員を対象にキャリア研修を実施します。</li> <li>1on1ミーティングの浸透・定着を図るとともに、主要部門における人材開発を現場で推進するHRBP（HRビジネス・パートナー）制度の導入を予定しています。</li> <li>グローバルビジネスの展開を加速させるため、原則全社員を対象に語学研修などを実施します。</li> </ul>
実績	<ol style="list-style-type: none"> <li>語学活用能力向上に向けた全社員のTOEIC受験によりレベル別研修の実施や階層別研修の導入等、プロフェッショナル性を高めるための諸研修を新たに導入しました。</li> <li>また、中堅のマネジメント能力やパフォーマンスを上げるために、従来の若手に集中していた研修対象者を拡大し、スキルアップやキャリア支援を行っております。</li> </ol>

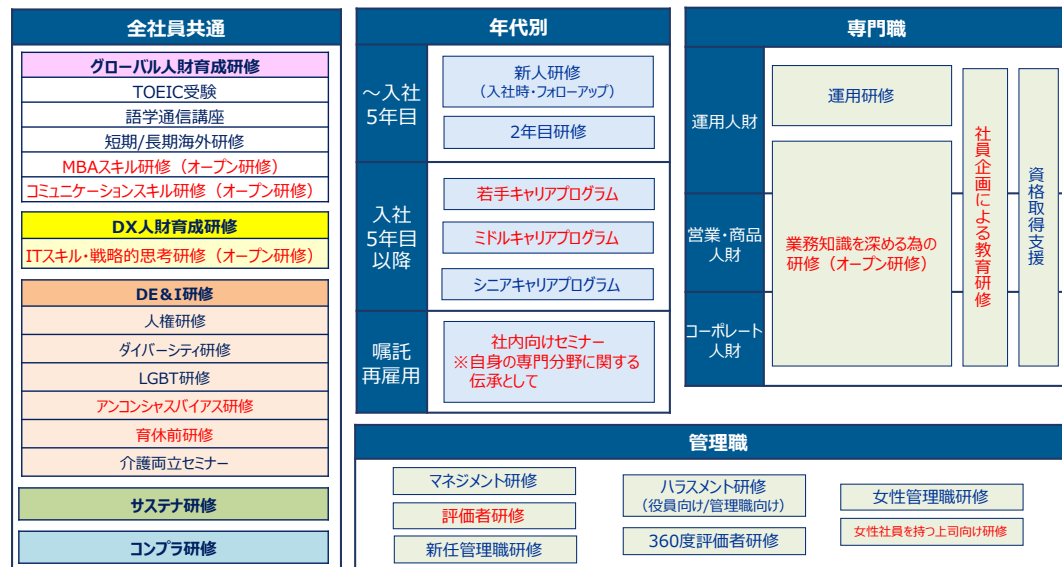
### 今後の方針

- 当社が求める人財像を明確化し、体系的な教育機会を提供します。また、これとは別に、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。
- グローバルレベルのプロフェッショナルを目指したDX研修やヒューマンスキル・コンベンチュアルスキルアップの研修や、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の意識醸成研修を行います。
- 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の運行見直しを行い、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。また、従来のシニアに加え若手やミドル社員へもキャリア研修を実施します。

### 【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。

モーニングスターのレーティング情報は、過去のパフォーマンスにもとづくものであり、将来のパフォーマンスを保証するものではありません。毎月ファンドのパフォーマンスをリスク調整したうえで総合評価しています。また、モーニングスターが信頼できると判断したデータにより評価しましたが、その正確性、完全性等について保証するものではありません。著作権等の知的所有権その他一切の権利は、モーニングスター株式会社並びにMorningstar, Inc. に帰属し、許可なく複製、転載、引用することを禁じます。当資料に記載されているレーティングは、当年の3月31日基準のレーティングとなっております。モーニングスターレーティングは、過去3年間、5年間、10年間のファンドのリスク調整後パフォーマンスが、カテゴリ分類内のファンド群の中で相対的にどのランクに位置するかを5段階の星印で表示します。

## 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

