

外部運用領域での ESG の取組みについて

2024 年 12 月

ニッセイアセットマネジメント株式会社

私たちニッセイアセットマネジメント(以下、「当社」という)は、外部運用会社・商品の選定、モニタリングにあたり、次の通り、外部運用会社による ESG の取組み状況の確認を行っています。

- (1) 選定時 : 面談や現地での調査等を通じて ESG の取組みにつき確認。
- (2) 採用後のモニタリング : 定期的に受領するレポートや現地での視察等を通じて、選定時に確認した項目を継続的に確認。

【主な確認項目】

- ・ ESG を考慮した投資判断がなされているか
- ・ 議決権行使の取組み状況
- ・ とくにマネジャーが重大な ESG 課題だと認識する項目について、投資先企業と積極的に「建設的な対話」(エンゲージメント)を実施しているか
- ・ ESG 推進に係る業界での活動等

<既存運用会社のモニタリング実績(2023 年度)>

- ・ 伝統的資産(上場株、債券など)の運用会社 : 94 社
- ・ 非伝統的資産(プライベートエクイティなど)の運用会社 : 117 社

<ESG 推進に係る業界での活動等>

当社の外部運用会社は、ESG に関する取組みの推進や相互理解のために、国連責任投資原則(PRI)に加え、様々な業界団体に積極的に参画しています。

(1) Net Zero Asset Managers Initiative

パリ協定において合意された「1.5°C」目標の達成に向けて、2050 年までに温室効果ガス排出量をネットゼロ(全体としてゼロ)にすることへの貢献を目的として活動するイニシアチブで、2020 年 12 月に発足しました。

(2) International Corporate Governance Network(ICGN)

1995年に設立されたコーポレート・ガバナンスの強化等に対して様々な支援や助言を行う国際的な機関投資家団体。

その他、外部運用会社が参画する主な業界団体は以下のとおりです。

- ・ Task Force on Climate-related Financial Disclosures(TCFD)
- ・ CDP
- ・ Climate Action 100+
- ・ Coalition for Environmentally Responsible Economies(CERES)
- ・ UK Sustainable Investment and Finance Association(UKSIF)
- ・ Asian Corporate Governance Association(ACGA)

【その他の取組み】

<1. ESG ファンドに係る情報開示について>

外部運用の公募投信の ESG ファンドにつき、運用会社との連携の上で、お客様向け資料(目論見書、運用報告書、月報)での情報開示の拡充を進めています。

<2. 温室効果ガス排出削減に向けた取組み>

温室効果ガス排出削減に向け、当社の取組み方針を外部運用会社と共有するとともに、外部運用各社の取組み状況を確認しています。

<3. 運用委託先との契約書への ESG 要件の織込み>

「運用委託」の形態のファンドにおいては、外部運用会社との投資一任契約書に ESG 要件を織り込むことにより、各社の ESG の取組みを促しています。