

2021年11月16日

「資産運用業宣言 2020」に関する当社取り組み状況について

ニッセイアセットマネジメント株式会社（社長：大関 洋）は、2020年11月16日に投資信託協会と日本投資顧問業協会との共催で開催された資産運用業フォーラムにおいて採択された「資産運用業宣言 2020」に賛同し、この目指す姿の実現に向けた取り組みを（別紙）の通り進めています。

今後も、常にお客様に誠実かつ真摯に向き合い、お客様の長期的な資産形成や社会の発展に貢献するべく、取り組んでまいります。

以上



この件に関するお問い合わせは
広報室／〒100-8219 東京都千代田区丸の内1-6-6 日本生命丸の内ビル
Tel. 03-5533-4037
<https://www.nam.co.jp/>

「資産運用業宣言 2020」に関する取り組み状況

【社会的使命】

- ・ 資産運用会社の使命は、皆さまの安定的な資産形成に向けて最善を尽くすと共に、そのための投資活動を通じて社会課題の解決を図り、皆さまの豊かな暮らしと持続可能な社会の実現に貢献することです。

＜経営理念の浸透＞

- 当社は、「お客様のご満足のために」「プロフェッショナリズムの追求」「公正で誠実な企業文化の醸成」を経営理念に掲げ、資産運用サービスの各場面において、プロフェッショナルとして、お客様に最高の付加価値を提供することを使命とし、継続的に最高の付加価値をご提供すること、そしてお客様にご満足頂くことで、お客様との長い信頼関係を築きます。
- 経営理念の浸透・定着を図るため、半年に一度、全社員に対し社長及び担当役員から足もとの経営課題や経営目標について語り掛けを行う経営課題ミーティングの場では、毎回必ず経営ビジョンや経営理念についての共有化を図り、社員一人ひとりへの理念・哲学の浸透を図っています。

経営理念：<https://www.nam.co.jp/company/info/philosophy.html>

＜サステナビリティ経営の推進＞

- 当社ビジネスを通じた社会課題の解決、サステナブル社会実現への貢献を目的として、2021 年度からサステナビリティ委員会を設立し、当社としての取り組みの方向性につき、議論を行っています。
- サステナブルな社会の実現に向けた役割を果たしていくとの当社の意志を表すスローガンとして、「A Good Investment for the Future」を定めました。

【目指すべき姿：専門性と創造性の追求】

- ・ 最良の運用成果と付加価値の高いサービスを提供するために、皆さまから大切な資産を託されていることを役職員ひとり一人がしっかりと自覚し、その責任と誇りを持ち、常に高い専門性と多様な創造性を追求します。
-

<専門人材の育成>

- 当社では専門人材の育成は、特に若手層の段階での成長が重要と考え、その成長を促進するために様々な取り組みを行っています。CMA や CFA など専門性を高めるための資格取得に対する報奨金制度を設けているほか、若手 PM が提案した良い運用アイデアを実践する仕組みとして自己資金を活用したインキュベーション・ファンドの立ち上げなども行っています。また、グローバルな競争環境で活躍できるよう英会話スキル向上についても推進し、海外運用会社へのトレーニー派遣も積極的に実施しています。
- 能力・スキルに秀でた専門人材の獲得のために、中途採用を積極的に実施しており、業界を牽引するような優秀人材の獲得にも努めることで、チーム全体の専門性やダイバーシティの向上に繋がるよう、取り組みを進めています。

<運用強化領域への取り組み>

- ESG 領域では、ESG 運用の更なる高度化や推進を担う ESG 推進部を拡充。また、投資工学開発部も強化し、AI の運用への活用やオルタナティブデータ分析の強化など、最新の投資理論を活用した運用手法の研究・開発を強力に進めてまいります。
- 運用力の強化に向けてはひとり一人の不断の努力が必要と認識しています。毎月の投資政策委員会での PDCA を継続しつつ、パフォーマンスの再現性を高め、また、規律ある運用プロセスを確立し実践していくことで、更に良好なパフォーマンスの実現に繋げていけるよう日々努めてまいります。
- また、運用クオリティを維持するためのリスク管理については、ファンドのパフォーマンスやリスク特性をモニタリングし、主にパフォーマンスの安定・改善を目的として部門で行うものと、ファンドの全般的な品質管理を重視しフロント部門から独立したミドル部門（社内リスク管理部門）で行うものとの二段階で行います。

<グループ運用態勢強化>

- 今年度より、グループ資産運用態勢の高度化を目的に、日本生命のクレジット投資及びオルタナティブ投資の機能を当社に移管しました。これに伴い当社は、クレジット投資、オルタナティブ投資で本邦有数の運用体制を有する資産運用会社となりました。
- 生命保険一般勘定資産の長期・安定運用のノウハウ等を活用することで、一層質の高い資産運用サービスをお客様に提供し、更なる信頼獲得を目指しています。
- また、グループの大樹生命の同機能の移管につきましても、引き続き日本生命、大樹生命、ニッセイアセットの3社で協議・準備を進め、絶え間ない資産運用態勢高度化に向けた取り組みを続けてまいります。

【目指すべき姿：顧客利益の最優先】

- ・ 皆さまの資産の長期的利益を最優先することは、運用を託される我々資産運用業の拠って立つところであり、その徹底のために様々な取り組みを常に追求め、皆さまからのご期待にお応えします。
-

<お客様本位の業務運営>

- 当社は、「お客様本位の業務運営に係る方針」に基づき、日本生命グループの一員として、長期的な視野に立ち、健全な経営に徹するとともに、高い倫理観と良き企業市民意識を持ち、業務運営において、常にお客様本位で考え抜き、お客様に誠実かつ真摯に向き合っております。

お客様本位の業務運営に係る方針：<https://www.nam.co.jp/company/policy/fiduciary.html>

- 「お客様本位の業務運営に係る方針」に基づく、2020年度の主な取り組みは以下の通りです。

- ・商品説明動画や運用報告動画の充実
- ・ESG 投融資等の推進（国連責任投資原則（PRI）の年次評価で「A+」を6年連続獲得）
- ・KPI 達成ファンドの投資対象資産を国内株式のみから全資産へ拡大

詳細につきましては、プレスリリースに記載しております。

https://www.nam.co.jp/news/ipdf/210621_press.pdf

- 当社の「お客様本位の業務運営に係る方針」に従い、各種取り組み項目について具体的な行動計画や担当所管を定めた、「フィデューシャリー・デューティー推進プログラム」を毎年度策定し、全常勤取締役がメンバーの「フィデューシャリー・デューティー委員会」においてPDCAを実施しております。

- 社外の有識者を中心に構成される「アドバイザリー・コミッティ」を年4回開催しており、フィデューシャリー・デューティーに関する議論を行い、業務運営に反映させています。2020年度の主な意見交換のテーマは以下の通りです。

- ・好パフォーマンス商品を増やす取り組み／品質管理の枠組み強化に向けて
- ・公募投資信託営業におけるCS改善取り組み
- ・運用力 KPI について
- ・ファンドガバナンスの取り組みについて

【目指すべき姿：責任ある投資行動】

- ・ 専門的な調査活動や投資先の企業などとの積極的な対話といった責任ある投資活動を通じ、運用資産の価値向上を図り、豊かで持続可能な社会の実現に貢献します。
-

<ESG 運用の実践>

- 当社は、資産運用の調査・投資判断において、E（環境）・S（社会）・G（企業統治）にかかわる課題を適切に考慮することが、長期的な投資収益の改善のみならず、社会的責任を果たすことに繋がるものと考えています。
- 投資先企業の企業価値評価においては、財務情報のみの分析ではなく、企業の持続的成長力把握の軸として ESG 視点からの分析・評価を行うことが重要であると認識しており、ESG 活用の充実やエンゲージメントのノウハウ蓄積、進化に努めています。

<スチュワードシップ活動の実践>

- スチュワードシップ責任を果たし、投資先企業の価値向上に繋げることでお客様と投資先企業との共創（Co-Creation）が果たされるよう努めています。
- 当社では、「投資先企業の状況把握」、「目的を持った建設的対話」、「議決権行使」の各活動について、国内株式のセクターアナリスト約 20 名が中心となり、各担当企業に対して一貫して実施する体制としています。

<サステナブル社会実現に向けた取り組み>

- 当社はネット・ゼロ・アセット・マネージャーズ・イニシアチブに参画しており、資産運用会社の立場からアセットオーナーと協業し、2050 年までの「温室効果ガス排出量実質ゼロ」の実現に向けて努力します。
- また、スチュワードシップレポート等において、ポートフォリオのカーボンフットプリントやカーボンインテンシティ等の開示を行います。

スチュワードシップレポート：<https://www.nam.co.jp/company/responsibleinvestor/report.html>

【目指すべき姿：信認の獲得】

- ・ 運用哲学をはじめ自らの強みを明らかにし、切磋琢磨しながら、運用力や提供する商品・サービスの更なる向上を図ることで、今まで以上に皆さまにご信認いただき、より多くの資産の運用を託されることを目指します。
-

<ガバナンス体制の強化>

- 取締役会には独立した社外取締役を3名招聘しています。当社から独立した立場にある取締役を加えることで、ガバナンス体制の独立性・透明性を向上させ、お客様の利益を最優先する体制の構築に努めています。
- 当社スチュワードシップ活動を行うに当たって、独立社外取締役を過半数とする「責任投資監督委員会」の監督のもと、利益相反管理の徹底を行っています。

<お客様ニーズに合った商品開発の取り組み・ファンドガバナンス強化>

- 当社では毎年お客様ニーズの動向も踏まえつつ、領域別の商品戦略を定めており、ニーズに即した商品の開発に努めています。ニーズの把握に当たっては、機関投資家のお客様に対し毎年アンケートを行うことで、お客様の声を商品開発に活かす仕組みとしています。
- ファンドガバナンスの強化を目的として、定期的に少額ファンドやパフォーマンスに問題があるファンドについての確認を行い、その対応について検討を行っています。