

# サステナビリティ方針

2022年9月28日制定  
大和アセットマネジメント株式会社

## 基本的な考え方

当社の社会的使命は、資産運用業を通じて、人々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。そのため、当社は受託者責任（フィデューシャリー・デューティ）を全うし、長期的に良質なリターンやサービスを提供するよう努めています。時代の変化に対応しながら長期的にこれらを提供し続けるためには、持続可能性（サステナビリティ）を重視した経営を行う必要があると考えています。

社会経済活動は持続可能な社会を基盤として継続できるものであるため、当社はその実現を事業運営の大前提と位置づけます。同時に、資産運用業を営む当社は、資本市場の維持発展に対して担っている責任の大きさを常に自覚し、その責務を果たす必要があります。だからこそ私たちは、事業活動を通じて、社会のサステナビリティ確保に関する重要事項の解決に取り組み、ステークホルダーからの信頼を獲得することで、更なる企業価値の向上をめざします。

## 取組指針

1. 当社は資産運用会社として、経済の好循環を促す役割の大きさを認識し、事業活動を通じて地球環境や社会のサステナビリティの維持・向上に貢献する企業を支援するとともに、受託者責任を全うします。
2. あらゆるステークホルダーにとってのベストパートナーをめざします。
3. 健全で透明性の高い経営を通じて、当社の持続的な企業価値向上に努めます。
4. 当社が優先すべき重要事項（マテリアリティ）を明確にし、定期的に見直しを行います。
5. 上記指針に基づき、サステナビリティ経営を推進するにあたっての具体的方針を定め、これを実行します。

## マテリアリティ

様々な事項のリスクと機会を検討し、当社のマテリアリティを下記のとおり特定しました。

### 事業活動に関わるマテリアリティ

スチュワードシップ活動  
及び責任投資の推進

資産形成に資する  
サービスクオリティの向上

事業領域の拡大

フィデューシャリー・デューティの徹底

### 事業基盤に関わるマテリアリティ

従業員のウェルビーイング  
の向上

人権と多様性の尊重

コーポレート・ガバナンス  
の強化

ステークホルダーからの信頼獲得

# (別紙1)

各マテリアリティ項目に対する当社の考えは、以下のとおりです。

## 事業活動に関わるマテリアリティ

重点分野	重要であると考え理由	当社の取り組み
<b>フィデューシャリー・デューティの徹底</b>	<p>フィデューシャリー・デューティを徹底し、お客様の利益を最大化することは、資産運用業を営む当社にとって事業の根幹を成すものであり、社会的使命だと考えています。</p>	<p><b>【継続的な取り組み】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>フィデューシャリー・デューティ、すなわち「お客様の利益を第一に考えた業務運営」を社内に浸透させるべく、継続して研修を行っています。</li> </ul> <p><b>【重点的な取り組み】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>お客様の最善の利益に適った商品を提供するために、長期視点に基づいてパフォーマンスを検証し、商品組成後の体系的な品質管理を行います（プロダクトガバナンスの実効性向上）。</li> </ul>
<b>スチュワードシップ活動及び責任投資の推進</b>	<p>責任投資を推進し、投資先企業等の環境・社会・ガバナンスのESG要因を企業評価に織り込むことにより、投資先企業等の中長期的なリスクと機会を的確に捉えることができると考えています。</p> <p>また、スチュワードシップ活動を通じて、企業等の価値向上、持続的成長に寄与することにより、資産運用会社としての社会的責任を果たしたいと考えています。</p> <p>スチュワードシップ活動及び責任投資は受託者責任の一部であり、ファンドのパフォーマンス向上にも繋がるため、最終的にお客様の利益の維持・向上に寄与すると考えています。</p>	<p><b>【継続的な取り組み】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>2006年5月に「国連責任投資原則 (PRI)」に署名後、一貫して責任投資に取り組んでいます。</li> <li>ESG投資方針を定め、投資先企業等のESGに対する取り組みを、中長期的な成長力拡大とリスク低減の両面につながるものと捉え、投資判断に活用しています。</li> </ul> <p><b>【重点的な取り組み】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>スチュワードシップ活動及び責任投資における、当社独自の特色ある取り組みを推進します。</li> <li>ESG専門人材の継続的な育成に取り組めます。</li> </ul>
<b>資産形成に資するサービスクオリティの向上</b>	<p>投資家のすそ野の拡大に取り組み、ニーズに沿った商品を開発・提供することは、当社の持続的な成長のために必要であると考えています。</p> <p>また、運用クオリティを向上させることは、ステークホルダーからの信頼獲得のために重要であると考えています。</p>	<p><b>【継続的な取り組み】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>組織的な運用力の向上を目的に、学術アドバイザーを活用すると共に、運用担当者の投資戦略・行動の可視化や共有等に取り組んでいます。</li> <li>資産形成が基礎から分かるコンテンツを幅広く提供し、あらゆる人の資産形成のサポートに取り組んでいます。</li> </ul> <p><b>【重点的な取り組み】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>社会変化や顧客ニーズに対応した金融商品を迅速に提供できる体制を構築します。</li> <li>学校教育における金融経済教育プログラムへの貢献や、社会全体の金融リテラシー向上に資する取り組みを推進します。</li> </ul>
<b>事業領域の拡大</b>	<p>フィデューシャリー・デューティを前提として新たな事業領域を模索することは、お客様の安定的な資産形成にも繋がっており、当社の持続的な成長のために必要であると考えています。</p>	<p><b>【継続的な取り組み】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>ETF専門の関連会社を設立し、協働を進めています。</li> <li>非伝統的資産を組み入れた商品の開発等に取り組んでいます。</li> </ul> <p><b>【重点的な取り組み】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>投資運用業のノウハウを活かし、事業領域の拡大をめざします。</li> </ul>

事業基盤に関わるマテリアリティ

重点分野	重要であると考え理由	当社の取り組み
ステークホルダーからの信頼獲得	ステークホルダーからの信頼を獲得することは、当社が持続可能な企業としてあり続けるための基盤であると考えています。	<p>【継続的な取り組み】</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 私たちの行動指針として「誠実であり続ける」、「相手の立場に立って考える」を掲げており、信頼の構築に努めています。</li> </ul> <p>【重点的な取り組み】</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 情報開示を充実し、社会からの声やニーズの把握に努めます。</li> </ul>
従業員のウェルビーイングの向上	当社の企業価値の源泉は人的資本であり、従業員のウェルビーイング向上なしには当社の持続的成長も実現できないと考えています。	<p>【継続的な取り組み】</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• より専門性の高い人材に対する評価・報酬体系の整備や、キャリア支援研修等を実施しています。</li> <li>• 短時間勤務制度やフレックスタイム制を導入するなど、柔軟な働き方を支援しています。</li> <li>• 定期的にストレスチェックを行うなど、従業員の健康状態の把握に努めています。</li> </ul> <p>【重点的な取り組み】</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 従業員エンゲージメントにつながるモチベーション向上策の導入など、従業員が継続して活躍できる環境を整えます。</li> <li>• 部署や役職を超えて交流できる仕組みを導入し、組織内のコミュニケーションを活性化させます。</li> </ul>
人権と多様性の尊重	当社のバリューチェーンにおけるステークホルダーの人権を尊重し、多様な人材を受け入れ活躍を推進することは、当社の持続的な成長のために重要であると考えています。	<p>【継続的な取り組み】</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 継続的かつ定期的な人権研修を実施し、多様な人材が活躍できるためのマインド育成に取り組んでいます。</li> <li>• 女性活躍に関する行動計画を策定し、実行しています。</li> <li>• 障がいのある従業員がより一層活躍できるよう、それぞれの事情に配慮しながらその能力を引き出し、働きやすい環境を整備するための制度を導入しています。</li> </ul> <p>【重点的な取り組み】</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• ダイバーシティ、エクイティ&amp;インクルージョン推進体制を強化し、多様な人材が活躍できる、公平で差別のない職場を作ります。</li> <li>• 社長が委員長を務めるダイバーシティ&amp;インクルージョン推進委員会を設置し、専任担当部署が全社的な推進を主導します。</li> <li>• バリューチェーンにおけるステークホルダーの人権デューデリジェンスに取り組み、誰一人取り残さない社会の実現に貢献します。</li> </ul>
コーポレート・ガバナンスの強化	健全で強固なガバナンス体制を維持・強化することは、ステークホルダーの信頼獲得にも繋がり、当社の企業価値向上と持続的な成長も実現できると考えています。	<p>【継続的な取り組み】</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• より高度なガバナンスの実現に向けて、取締役会は3名の社外取締役を含む構成としています。</li> <li>• 社外取締役を構成員とした会議体を設け、ファンド運営やスチュワードシップ活動における利益相反を牽制する機能を有したガバナンス体制を構築しています。</li> <li>• 定期的にコンプライアンス研修を行うなど、高い倫理観とコンプライアンス意識の醸成に努めています。</li> </ul> <p>【重点的な取り組み】</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 取締役会及び監査機能の実効性向上に努めます。</li> </ul>

## (別紙 2)

サステナビリティ経営を推進するにあたっての具体的方針（取組指針 5）は、以下のとおりです。



## (参考)

マテリアリティの特定プロセスは、以下のとおりです。

### STEP 1

#### 社会課題の把握・整理

- 各種国際的なフレームワーク（GRI、ISO26000、SASB等）、国連グローバル・コンパクト等の国際的な取り組み、ESG評価機関の指標、政府や経済団体で認識される課題などを勘案し、当社にとって機会・リスクとなり得る重要な社会課題をピックアップ
- 約60項目のロングリストを作成

### STEP 2

#### 社内外のステークホルダーの視点の取り入れ

- ロングリストの項目について、社内外のステークホルダーの視点を取り入れ、当社が社会に与えるインパクトおよび重要性を評価し、当社事業に関係が深いと考えられる項目を抽出
- 約30項目を「当社が取り組むべき課題」として、当社役職員にアンケートを実施

### STEP 3

#### マテリアリティ（案）の策定

- アンケート結果や社外有識者の意見等を基に、ビジネスを通じて取り組むべき項目を特定
- 策定した「マテリアリティ」（案）に対する、当社にとっての機会・リスクを検討

### STEP 4

#### 経営陣による議論・決定

- サステナビリティ会議で検討した上で、取締役会において社外取締役を含む経営陣により決定

### 今後

#### 会社全体でマテリアリティに取り組み、サステナビリティ経営を推進

- 長期ビジョンやマテリアリティの取り組みの進捗を管理するKPIを設定
- 各本部・各部の責任者等による進捗管理と、課題の把握、およびそれに対する施策を実施
- サステナビリティ会議や取締役会等の会議体にて、経営陣が定期的に進捗状況をモニタリング
- 今後も国際的な社会課題の動向や、事業環境の変化、および社内外のステークホルダーの意見を取り入れながら、マテリアリティの継続的な見直しを実施