



大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

発行

大和アセットマネジメント株式会社
経営企画部・責任投資部

〒100-6753 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
グラントウキョウ ノースタワー
damssc@daiwa-am.co.jp

2024年3月発行



Printed in Japan

Sustainability Report 2023

Sustainability Report 2023

サステナビリティレポート 2023



大和アセットマネジメント株式会社

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

わたしたちがめざす未来 Vision

All Challenges *for* All Investors

“未来へ挑み続ける地球上のすべて=Investors”にチャンス

投資には未来をつくるチカラがあります。

わたしたちの“すべての挑戦”は“すべてのInvestors”のためにあり

共に挑戦し続けるパートナーとして投資を通じチャンスある未来を実現します。

羅針盤 Value

わたしたちの行動指針

1. 革新を起こす
Create Innovation

2. 論理的に考え行動する
Consider and Act Logically

3. 持続可能な社会に貢献する
Enhance Global Sustainability

4. 誠実であり続ける
Have Integrity

5. 相手の立場に立って考える
Image Yourself in Their Place

6. 一致団結する
Unite As One Team

根幹を成すグループ企業理念

目次

▶ 01 企業理念

▶ 03 当社の歩み

▶ 05 社長メッセージ

▶ 07 Part1 スチュワードシップ活動

07 イントロダクション

11 エンゲージメント

37 議決権行使

46 スチュワードシップ委員会

48 サステナブルインベストメント

57 イニシアティブへの参画

64 活動報告

▶ 69 Part2 コーポレート
サステナビリティ経営

70 コーポレートのサステナビリティ経営

71 コーポレートのマテリアリティ

75 コーポレートのマテリアリティに基づく
取り組み

▶ 86 巻末

86 会社情報

86 会社概要

86 財務データ

86 運用資産残高の推移

87 データ集

87 温室効果ガス(GHG)排出量

87 従業員1人当たりコピー用紙使用量

87 人材関連

当社の歩み

大和アセットマネジメント

- 1951**
 - 証券投資信託法制定
大和証券投資信託運用会社として登録
 - 大和証券より分離
大和証券投資信託委託株式会社として設立
- 1973**
 - わが国初の
ファンドマネージャー制を導入
- 1984**
 - ニューヨーク駐在員事務所開設
- 1987**
 - 英国現地法人設立
- 1990**
 - ニューヨーク現地法人設立
- 1994**
 - シンガポール現地法人設立
- 1995**
 - 投資一任業務認可
- 1998**
 - 投信の銀行窓口販売開始
- 1999**
 - 持株会社体制のもと、
大和証券グループの主要会社となる
- 2006**
 - 国連責任投資原則 (PRI) に署名

- 2011**
 - 「持続可能な社会の形成に向けた
金融行動原則 (21世紀金融行動原則)」に署名
- 2012**
 - 本社を東京都千代田区丸の内一丁目9番1号に移転
- 2014**
 - 日本版スチュワードシップ・コードの受け入れ表明
■Statement on Fiduciary Duty and
Climate Change Disclosureに署名
- 2015**
 - エンゲージメント・チームの立ち上げ
- 2018**
 - スチュワードシップ・ESG推進課を新設
- 2019**
 - Global X Japan設立
- 2020**
 - 大和アセットマネジメント株式会社に商号変更
 - 30% Club Japan Investor Groupに参画
 - 気候関連財務情報開示タスクフォース (TCFD) 賛同
 - スチュワードシップ・ESG推進部を創設
 - ダイワ・キャピタル・マネジメント シリコンバレー設立
- 2021**
 - 国際コーポレートガバナンスネットワーク (ICGN) に参画
 - Climate Action 100+に参画
 - COP26開催に向けた Investor Agendaに署名
 - Net Zero Asset Managers initiative (NZAMi) に署名
- 2022**
 - 「脱炭素テクノロジー株式ファンド」と
植樹プロジェクトの取り組みが評価され、
東京金融賞2021 ESG投資部門
グリーンファイナンス知事特別賞を受賞*
- 2023**
 - NZAMi中間目標を公表
 - GIG Supportersへ登録
 - グラスゴー金融同盟 (GFANZ) 日本支部に参画
 - TNFDに参画
 - Springにエンドーサーとして参加
- 2024**
 - 環境省「ESGファイナンス・
アワード・ジャパン」受賞
(詳細はP.54をご覧ください)

商品・サービス関連

- 1951**
 - ユニット型投資信託設定開始
- 1952**
 - わが国初のオープン型投資信託設定
- 1961**
 - 現存する日本最古の株式投資信託
「インカムファンド(現「大型株ファンド)」を設定
- 1987**
 - 給与天引き型「ミリオン」を設定
- 1992**
 - 追加型公社債投信「ダイワMMF」を設定
- 2001**
 - わが国初、目録見書の電子交付を実施
 - ETF「ダイワ上場投信-日経225」、
「ダイワ上場投信-トピックス」を設定
- 2002**
 - わが国初の「地域応援ファンド」を設定
- 2003**
 - 「ダイワJ-REITオープン」を設定
- 2004**
 - CSRに取り組む日本企業を応援する
「ダイワSRIファンド」を設定
- 2005**
 - 投信の郵便局での販売開始
「ダイワストックインデックス
225ファンド」が採用される

- 2013**
 - バーゼル3に対応したETF
「ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials」を
わが国で初めて設定
 - NISA向け商品を豊富に設定
- 2014**
 - 「JJPX日経インデックス400」指数への
連動を目指す「ダイワJPX日経400ファンド」、
ETF「ダイワ上場投信-JPX日経400」を設定
- 2015**
 - 海外販売ファンドの日本株運用受託や
UCITSファンドでの共同運用を韓国大手運用会社
ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ
との間で開始
- 2016**
 - 「iFree」(インデックスファンドシリーズ)を設定
- 2017**
 - ESG関連指数に連動するETF3本を設定
- 2022**
 - 「脱炭素テクノロジー株式ファンド」と
植樹プロジェクトの取り組みが評価され、
東京金融賞2021 ESG投資部門
グリーンファイナンス知事特別賞を受賞*
- 2023**
 - 新NISAに向けた商品と販売会社
向けのサポートを拡充

* 東京都は、「国際金融都市・東京」構想2.0の取り組みの一つとして、都民および都内事業者のニーズや課題の解決に資する画期的な金融商品・サービスの開発・提供を行う金融事業者等や、ESG投資の普及活動を実践する金融事業者およびSDGs経営の取り組みを実践する事業者を表彰する「東京金融賞」を実施しています。東京金融賞「ESG投資部門」は、ESG投資カテゴリとSDGsカテゴリに分かれており、ESG投資カテゴリではESG投資の普及と実践している金融事業者を募集し、審査委員会によりテーマとの合致度合い、取り組みの独自性や成果等の観点から審査し表彰します。その中で特にグリーンファイナンスの取り組みにおいて優れた事業者1者を「グリーンファイナンス知事特別賞」として表彰します。東京都ならびに東京金融賞は特定商品の購入、売却、保有を推奨、または将来のパフォーマンスを保証するものではありません。東京金融賞に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は東京都に帰属しており、無断複製・転載等を禁じます。

1920 1950 1960 1970 1980 1990 2000 2010 2015 2020 2021 2022 2023 2024

サステナブル投資の歴史

- 1920年代**
 - 米国でキリスト教的倫理の観点から
ネガティブスクリーニングが開始
- 1960年代**
 - 社会運動の手法としてSRIが目目される

- 1990年代**
 - 環境問題、コーポレート・ガバナンスが
SRIの対象になる
- 2006**
 - 責任投資原則 (PRI) の制定

- 2014**
 - 日本版スチュワードシップ・コード制定
- 2020**
 - 日本版スチュワードシップ・コード改定
 - 2025年温室効果ガス排出量のネットゼロ宣言
 - ビジネスと人権に関する行動計画策定

- 2015**
 - コーポレートガバナンス・コード制定
 - パリ協定採択 (COP21)
 - SDGs (持続可能な開発目標) が国連で採択
 - GPIFが責任投資原則 (PRI) に署名
- 2021**
 - コーポレートガバナンス・コード改定
 - グラスゴー気候合意 (COP26)
 - グラスゴー金融同盟 (GFANZ) 発足

- 2017**
 - 日本版スチュワードシップ・コード改定
 - TCFD提言
- 2018**
 - コーポレートガバナンス・コード改定
- 2019**
 - 米経営者団体が「ステークホルダー資本主義」へ転換

- 2022**
 - 東京証券取引所の新市場区分発表
 - 昆明・モントリオール生物多様性枠組み採択
- 2023**
 - 東京証券取引所が「資本コストや株目を
意識した経営の実現に向けた対応」を要請
 - サステナビリティ開示情報の法定開示開始
 - TNFD 最終提言
 - PRI in Person 2023 東京開催