

ESG プロダクトの定義とサステナブルプロダクトの運営管理フレームワークについて

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社（CEO 兼代表取締役社長：猿田 隆、以下「当社」）は、当社が運営するすべてのファンドおよびプロダクトを対象に「サステナブルプロダクト認定基準（以下「認定基準」）」に基づく分類を2020年3月から行っています。このたび、認定基準の見直しを行い、当社における「ESG プロダクト」を定義するとともに、新商品検討段階での適切性確認からその後の情報開示、モニタリングを含む包括的なサステナブルプロダクトの運営管理フレームワークを定めたことをご知らせします。

1. 当社の ESG プロダクトについて

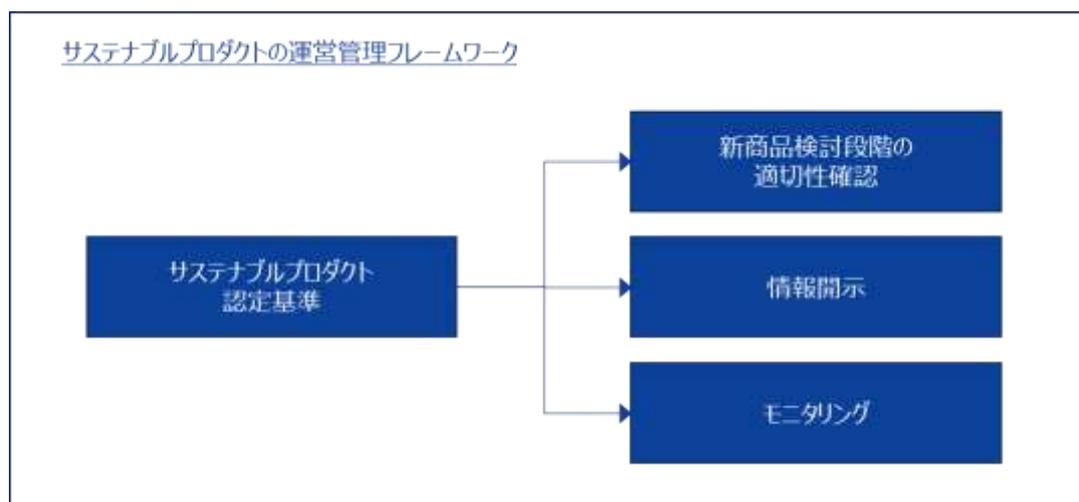
今般のサステナブルプロダクト認定基準の見直しにあたっては、従来基準がサステナビリティ要素を考慮する「手法」に軸足を置いていたのに対し、新基準では「投資判断におけるサステナビリティ要素の重要度」の視点を加えました。また、この認定基準の見直しを機に、当該基準のうち「ポジティブスクリーニング」、「ESG テーマ型」および「インパクト」を「ESG プロダクト」と定義しました。

「ESG プロダクト」の2022年3月末時点の運用残高（単体ベース）は5,579億円、「ESG プロダクト」に該当する国内公募投信は別紙記載の通りです。

分類	概要	ESG プロダクト
スタンダード	全社共通で取り組むスチュワードシップ活動、ネガティブスクリーニングを適用している	
インテグレーション	サステナビリティを考慮し、ESG評価を投資判断プロセスに組み込んでいる	
インテグレーションプラス	サステナビリティを重要な超過収益源の一つと位置付け、ESG評価を定量的、体系的に活用している	
エンゲージメントプラス	運用担当者が、企業価値の向上に資するESGテーマに係る対話を主体的に行っている	
ポジティブスクリーニング	優れたESG要素を備える企業等に投資する特定の定量的なスクリーニング基準を組み込んでいる	○
ESGテーマ型	特定のサステナビリティ課題・テーマを設定し、それらに貢献する企業等を投資対象としている	○
インパクト	投資リターンに加え、サステナビリティ課題解決への貢献を目的に投資先企業等を選定している	○

2. サステナブルプロダクトの運営管理フレームワーク

サステナブルプロダクト認定基準の見直しを機に、当該プロダクトのガバナンス強化の観点から、新商品の検討段階から情報開示やモニタリングなどの運営管理のあり方について議論を行い、包括的なフレームワークの構築に着手しました。今後は以下のフレームワークの実践を通して、実際の運用が認定基準に基づく分類と齟齬がないかをモニタリングするとともに、ファンド受益者やお客さまにわかりやすく伝えるよう情報開示の充実を図ります。



なお現在、サステナブル投資のあり方については、制度化や開示ルールの制定に向けた議論が国内外で行われており、お客さまの資産運用会社に対する期待も刻々と変化しています。こうした点を踏まえ、当社では投資先企業の情報開示の充実に伴い、ESG データを活用した運用の高度化に日々取り組んでいます。また、個々の認定プロダクトのレビューに加えて、認定基準自体のレビューを毎年実施し、必要があれば適宜見直しを行います。

サステナブルプロダクト認定基準見直しの背景、新旧基準の比較、運営管理フレームワークの詳細等については、サステナビリティレポート 2022-2023 の P39-40 をご覧ください。

サステナビリティレポート

<https://www.smd-am.co.jp/corporate/vision/fiduciary/report/>

【本件に関するお問合せ先】

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社

サステナビリティ推進室 丸山 (Tel.03-6205-1908)、小林 (Tel.03-6205-1900)

ESG プロダクトに該当する国内公募投信（2022 年 11 月 21 日時点）

当社独自のサステナブルプロダクト認定基準に基づき、以下の何れかに分類される商品を「ESG プロダクト」と定義しています。

ポジティブスクリーニング	優れた ESG 要素を備える企業等に投資する特定の定量的なスクリーニング基準を組み込んでいる
ESG テーマ型	特定のサステナビリティ課題・テーマを設定し、それらに貢献する企業等を投資対象としている
インパクト	投資リターンに加え、サステナビリティ課題解決への貢献を目的に投資先企業等を選定している

現在、対象となる以下の国内公募投信について、それぞれの分類に応じた開示文書の改定を順次行っています。

<ポジティブスクリーニング>

[三井住友・日本株式 ESG ファンド](#)

[<七十七> ESG 日本株オープン](#)

<ESG テーマ型>

[イノベティブ・カーボンニュートラル戦略ファンド](#)

[クライメート・ソリューション・ファンド](#)

[グローバル EV 関連株ファンド（為替ヘッジなし）](#)

[グローバル EV 関連株ファンド（為替ヘッジあり）](#)

[グローバル SDGs 株式ファンド](#)

[グローバルGX 関連株式ファンド](#)

[アジアGX 関連株式ファンド](#)

[フード・イノベーション厳選株式ファンド](#)

<インパクト>

[世界インパクト投資ファンド](#)

[世界インパクト投資ファンド（資産成長型）](#)