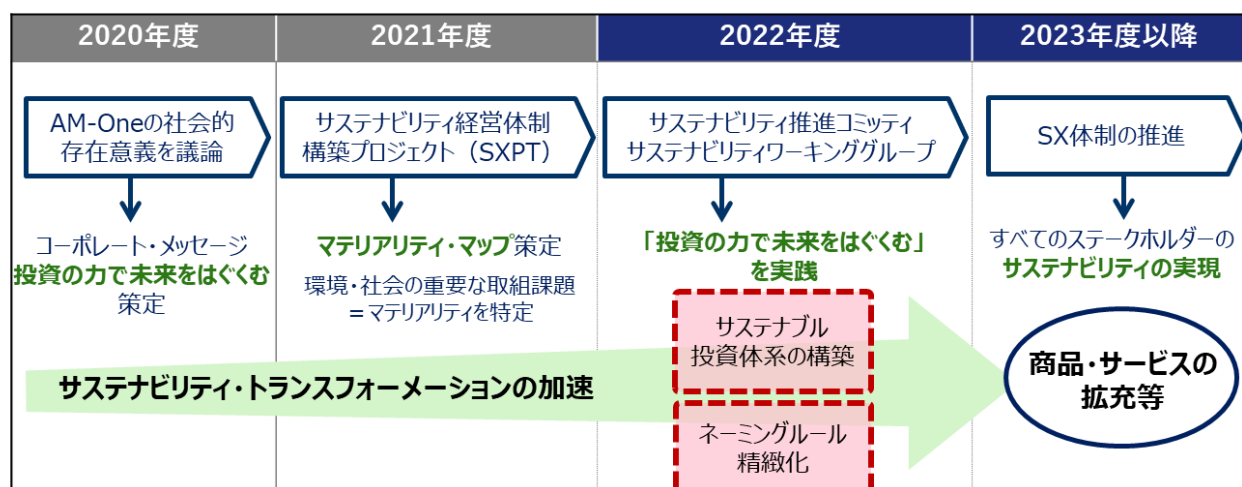


サステナブル投資体系の構築と ESG 関連ネーミングルールについて

アセットマネジメントOne株式会社（東京都千代田区、取締役社長 菅野 暁、以下「AM-One」）は、2021年1月にコーポレート・メッセージ「投資の力で未来をはぐくむ」を制定して以降、サステナビリティ推進体制の強化、ESG投資の更なる高度化、コーポレート・メッセージを体現する商品・サービスの拡充等、「投資の力で未来をはぐくむ」資産運用会社としてサステナビリティ・トランスフォーメーション（SX）を加速させております。

今般、お客さまが従来から重視されるフィナンシャルリターンに加え、ソーシャルリターンの重視度合いを踏まえたサステナブル投資体系を新たに構築するとともに、ESG等の名称を付すプロダクトに対するルールを精緻化しましたのでお知らせいたします。

<AM-OneのSXロードマップ>



<サステナブル投資体系>

新しいサステナブル投資体系のもとでは、ソーシャルリターン、社会や環境の課題解決を主要投資目的に据え、優れた企業に積極的に投資する「インパクト投資」や、フィナンシャルリターンを重視するものの、サステナブルな社会の達成に資する「エクセレントカンパニー」に投資する「ESGリーダー」のほか、自己変革に取り組む途上の企業を支援する「トランジション」、運用プロセス上でESGリスクや機会を考慮する「ESGインテグレーション」等、様々なカテゴリを設けました。

AM-Oneはこうした商品体系を通じ、様々な価値観をお持ちのお客さまの意見を取り入れ、フィナンシャルリターンとソーシャルリターンの双方の観点を踏まえた投資サービスをお客さまと共創していく所存です。

カテゴリー	サブカテゴリー	ファンドの特徴
インパクト投資	インパクト・ジェネレーティング	・フィナンシャルリターンを目指しつつ、ソーシャルリターン（インパクト）創出目標を設定し、持続可能な社会に向けた課題解決に直接的に貢献する
	インパクト・アライン	・フィナンシャルリターンを目指しつつ、企業の取組や事業を通じて持続可能な社会に向けたポジティブなインパクトを与える
ESGリーダー		・持続可能な社会に資するエクセレントカンパニーに投資
トランジション		・持続可能な社会に向けたトランジションに積極的な企業に投資 ・ESG取組の改善が期待できる企業に投資
ESGインテグレーション		・ESGリスクと機会（もしくはどちらか）が特定され、運用プロセスに考慮されている

<ESG関連ネーミングルール>

ファンドにESGやサステナビリティに類する名称を付与する際には、社内のESG関連ネーミングルールが適用されます。このネーミングルールは、お客さまのESG関連投資に対する期待値と実際のファンド運営との乖離を極力小さくすることを目的とし、ESG要素を考慮することが投資目的の達成にどのように資することとなるのかを、適切なレベルでお客さまに説明可能なファンドのみにESG関連名称の付与を認めています。

ESG等の名称を付すファンドは、AM-Oneにおけるサステナブル投資体系上、インパクト投資、ESGリーダー、トランジション（条件付き）に該当する事が前提となり、更にSFDR[※]をはじめとする国際イニシアティブを参考にAM-One独自の確認事項を設け、その商品組成に際してその開示に関する要件を具備するように求めています。

本ルールのポイントは、①投資目的や投資ポリシー・戦略、ポートフォリオ特性の全てにおけるESG/サステナビリティに係る一貫性とその明示、②ESG目的を達成するためのリソースの明示、投資戦略が採用する手法等の継続性の明示、③投資家が意思決定し易いESG/サステナビリティに係る情報開示（入手が容易で、明確・簡潔）です。これらの視点を軸とする確認事項を定めています。今後、更なる開示の充実も図ってまいります。

※SFDR（Sustainable Finance Disclosure Regulation）・・・欧州のサステナブルファイナンス開示規則

AM-Oneは今後も、国内外の動向も取り入れ、サステナブル投資体系及びESG関連ネーミングルールを適時適切にアップデートし、お客さまと共にサステナブル投資を実践してまいります。

【アセットマネジメントOneについて】

アセットマネジメントOne株式会社は、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社の資産運用部門、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社（以下、総称して「統合4社」）が統合し、2016年10月1日に発足した資産運用会社です。「投資顧問事業」と「投資信託事業」の双方の事業領域における運用資産残高は約60兆円と国内有数の規模を誇ります。統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、資産運用のプロフェッショナルとして、グローバル運用リサーチ体制に支えられた伝統的資産のアクティブ運用や金融工学を駆使した最先端の運用戦略等、個人投資家や機関投資家の多様な運用ニーズに対し、最高水準のソリューションの提供をめざします。

HP : <http://www.am-one.co.jp/> ※運用資産残高は2022年3月末時点。

商号等 / アセットマネジメントOne株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第324号

加入協会 / 一般社団法人投資信託協会、一般社団法人日本投資顧問業協会