

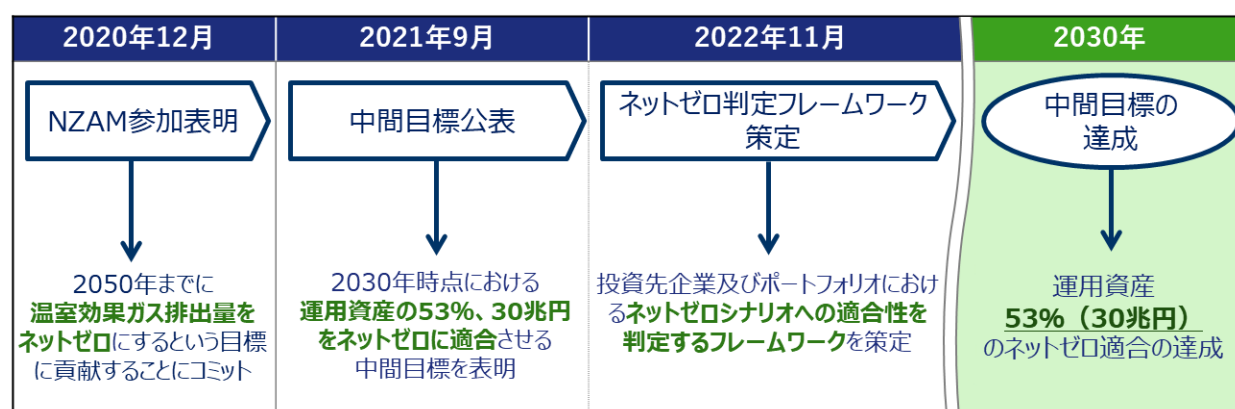
2022年11月18日

アセットマネジメントOne株式会社

ネットゼロ判定フレームワークの策定について

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、温室効果ガス（以下、「GHG」）排出量のネットゼロを目指す、グローバルの資産運用会社によるイニシアティブ「Net Zero Asset Managers initiative」（以下「NZAM」）に、発足当初から参画しております。2021年9月には、2030年時点における運用資産の53%、30兆円（※1）をネットゼロに適合させる中間目標を表明し、社会のネットゼロへの移行を資産運用会社としての立場で後押しする取組みを進めてきました。

このたび、投資先企業及びポートフォリオにおけるネットゼロシナリオへの適合性を判定する当社としてのフレームワーク（以下「ネットゼロ判定フレームワーク」）を策定しましたので、お知らせいたします。



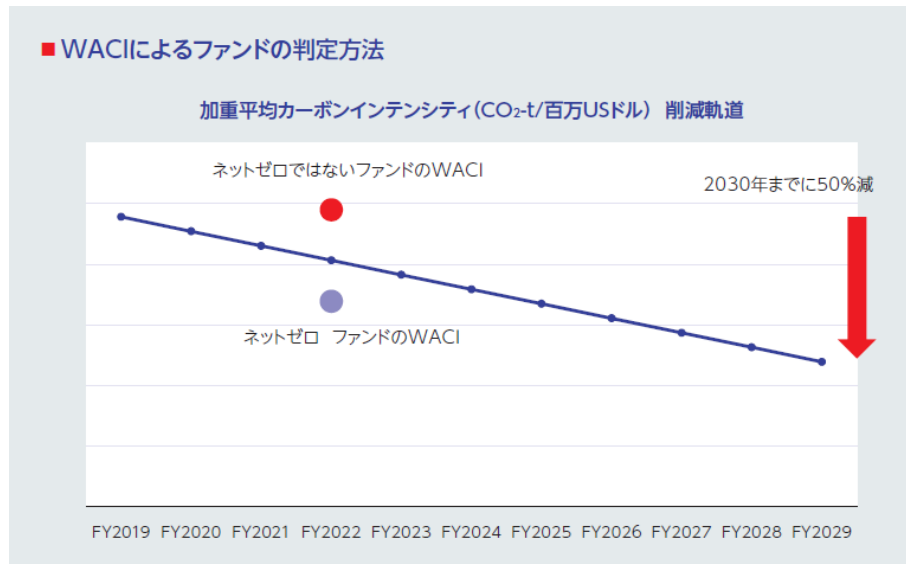
今回策定したネットゼロ判定フレームワークでは、ポートフォリオレベルのネットゼロシナリオへの適合性は、投資先企業のネットゼロシナリオへの適合性（※2）を基に判定する方法とポートフォリオレベルの加重平均カーボンインテンシティ（Weighted Average Carbon Intensity : WACI）を使用する判定方法のいずれかを用います。

※1 2021年3月末時点の運用資産額で算出。

※2 NZAMが推奨する方法論の一つであるPAII（Paris Aligned Investment Initiative）のNet Zero Investment Frameworkを基に判定。評価項目は、ネットゼロ達成への野心、GHG削減目標、排出量の実績、情報開示、脱炭素化戦略、資本配分の6項目で判定する。

投資先企業のネットゼロシナリオへの適合性判定を基準とする場合は、ポートフォリオのファイナンスドエミッションの95%を排出する銘柄がネットゼロシナリオ適合企業である場合において、ネットゼロ適合ポートフォリオと判定します。この方法は、エンゲージメント活動を通じて、投資先のネットゼロ適合を促すことによってファンドのネットゼロ達成を目指すファンド（主にパッシブファンド）を判定の対象とします。WACIを判定の基準とする場合は、判定対象のファンドのWACIと資産クラスと投資ユニバースによってあらかじめ定められたネットゼロ判定基準指数のWACIとの比較によって、ネットゼロ適合性判

定が実施されます。具体的には、ネットゼロ判定基準指数の2019年時点のWACIから2030年時点でのWACIが50%減となるよう削減軌道を算出し、当該軌道より判定対象のアクティブファンドのWACIが低ければ、そのファンドはネットゼロ適合ファンドと判定されます。この方法は主にアクティブファンドとWACIによって構成銘柄をウェイト調整したパッシブファンドを対象とします。



今後は、このたび策定したフレームワークに則り、既存ファンドのネットゼロラインに向けた対応を進めていくと共に、新規プロダクトの開発に取組み、お客さまへ提供すること等を通じて、「投資の力で未来をはぐくむ」資産運用会社として、社会のネットゼロへのトランジションを後押しする取組みを続け、サステナビリティレポート等で公表してまいります。

【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