

2024年5月10日

## ESGデータプロバイダーに対するモニタリングについて

三井住友DSアセットマネジメント(以下、「当社」)は、ESGデータプロバイダー(以下、「プロバイダー」)各社が保有するサステナビリティに関連するデータが、適切に収集および提供されていることを確認するため、プロバイダー各社に対するモニタリングを継続的に実施しています。

モニタリングの結果は、社内会議(スチュワードシップ会議/ESG会議)にて定期的に報告され、プロバイダー各社の妥当性の検証や継続是非の検討を行っています。

2024年3月のモニタリングの結果、プロバイダー各社に重大な疑義は確認されませんでした。より有効性の高いデータを取得するため、プロバイダー各社に対するエンゲージメントを引き続き実施してまいります。

### プロバイダー各社に対するモニタリング内容

#### 1. 当社が利用しているプロバイダー各社の概要

プロバイダー名	概要	備考
Morningstar Sustainalytics	ESG レーティング、ESG データ、投資不適切等のスクリーニングデータを提供	金融庁「ESG 評価・データ提供機関に係る行動規範」受入表明済み
RepRisk	ESG データを提供	
MSCI ESG Research	ESG データを提供	
GRESB	不動産・インフラの会社・ファンド単位の ESG データを提供	約 150 の投資機関が主体となり運営
CSRHUB	ESG コンセンサスデータの提供	全 929 データソースを公開

#### 2. データの正確性の確認

プロバイダー各社が正確なデータを提供しているかを確認する目的で、各社のESG評価について、評価手法の違いを考慮しながら、相関性の検証を行っています。

また、GHG排出量データについて、投資先企業等の開示内容と提供データが合致しているか、サンプルチェックを実施しています。

### 3. 過誤データ発生時の対応

ファンドマネージャーおよびアナリストのエンゲージメント活動における事前調査等で、データの疑義が確認された場合には、プロバイダー各社に照会します。

過誤が確認された場合は適宜修正を要請し、その後データ修正が適切になされていることを確認しています。

### 4. セルフ・アセスメントの要請

データの妥当性について、プロバイダー側からも積極的に発信することを要請しています。

当社は、投資先企業等の安定性・持続性や、中長期的な企業価値向上もしくは毀損回避を洞察する上でESG情報が重要な要素と考えます。ESGを含む非財務情報の多面的な活用を通じ、お客さまに良質な投資リターンをご提供するため、投資先企業等にESGデータの開示を促し、サステナビリティ向上に向けたエンゲージメント活動を実施しています。

また、当社はプロバイダーに対するモニタリングと合わせ、企業の社会及び環境への影響を適切に評価し、改善に向かうよう取り組んでまいります。

#### 重要な注意事項

- 当資料は、情報提供を目的として、三井住友DSアセットマネジメントが作成したものです。特定の投資信託、生命保険、株式、債券等の売買を推奨・勧誘するものではありません。
- 当資料に基づいて取られた投資行動の結果については、当社は責任を負いません。
- 当資料の内容は作成基準日現在のものであり、将来予告なく変更されることがあります。
- 当資料に市場環境等についてのデータ・分析等が含まれる場合、それらは過去の実績および将来の予想であり、今後の市場環境等を保証するものではありません。
- 当資料は当社が信頼性が高いと判断した情報等に基づき作成しておりますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。
- 当資料にインデックス・統計資料等が記載される場合、それらの知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。
- 当資料に掲載されている写真がある場合、写真はイメージであり、本文とは関係ない場合があります。

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第399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、一般社団法人第二種金融商品取引業協会