

三井住友アセットマネジメント株式会社 企画部
東京都港区愛宕 2-5-1 愛宕グリーンヒルズ MORI タワー 28 階 〒105-6228
Tel. 03-5405-0555 Fax. 03-5405-0666 <http://www.smam-jp.com>

フィデューシャリー・アクションプランの実施状況、更新（含む KPI） および FD 第三者委員会の提言について

三井住友アセットマネジメント株式会社（代表取締役社長 松下隆史）は、2017 年 5 月に「FD2.0」として公表した新しいフィデューシャリー・アクションプラン（以下、「アクションプラン」）の実施状況、およびアクションプランの更新等について、FD 第三者委員会の提言とあわせ、下記のとおりご報告いたします。内容の詳細につきましては、当社ホームページの FD 専用ページ（下記 URL）をご参照ください。

<http://www.smam-jp.com/company/fiduciary/index.html>

なお、2018 年 5 月 11 日付プレスリリース「三井住友アセットマネジメント株式会社と大和住銀投信投資顧問株式会社の合併に関する主要株主間での基本合意について」でお知らせしましたとおり、当社は大和住銀投信投資顧問株式会社と、合併に関する統合準備委員会を設置しました。業界トップクラスの業務基盤および運用力を有し、業界最高水準のフィデューシャリー・デューティーを実践する、お客さま第一主義の資産運用会社の実現を目指し、同委員会にて具体的な検討、協議を進めてまいります。

記

1. アクションプランの実施状況について

2018 年 6 月時点でのアクションプランの実施状況は以下のとおりです。

(1) 運用

運用分野では、2017 年 8 月に開始した、議決権行使結果の個別開示を四半期ごとに実施するとともに「主な反対理由」の記載を追加いたしました。また、調査・運用業務の飛躍的レベルアップを目指し、スマートデータの新プラットフォームの試験利用も開始しております。

企業価値向上を促すエンゲージメント運用では、プロアクティブに企業価値向上に繋がる対話・提案を実施することで、実際の企業行動に変化が生じ、株式市場からの評価が高まる事例が出てきています。ESG の取り組みでは、独自スコアによる評価対象企業を拡充するとともに、当該スコアリングを活用した運用を行う公募投信を 2018 年 2 月に設定しました。社会のサステナビリティに貢献するインフラ投資では、海外有力先と提携し、2018 年 1 月に大手公的年金よりグローバル・インフラストラクチャーの運用受託機関に選定されました。

アジア運用では、発注機能を含む香港現法のフルライン化を進め、現地での運用を本格的に開始するとともに、2017 年 7 月にアジアリサーチセンターを香港に新設し、マクロリサーチの充実を通じて運用力を強化し、日本向けにアジアに関する情報発信を開始しました。

(2) 商品開発

商品開発では、「つみたて NISA」を通じた長期資産形成志向のお客さま向けに、3 商品を加えた 10 商品の提供を開始しました。また、金融ジェントロジー※を意識し、長寿命化の時代に必要となる資産寿命を伸ばすことを考慮した商品を開発するなど、様々なライフステージのニーズに応えることでお客さまの QOL 向上に貢献する、「ライフステージ対応型ファンド」の開発を進めています。

※金融ジェントロジー：老齢期及び老齢化のプロセスの研究であるジェントロジー(老年学)と金融(資産運用・資産管理)研究とを組み合わせた学際研究

また、日興グローバルラップ社と共同で、低リスクのマルチアセット型 (株・債券・リート等、複数資産間で戦略的・機動的に資産配分を行う運用戦略) 商品の開発、マーケティングを実施中です。

(3) お客さまサービス

お客さまサービスにおいては、デジタルブックや AR (拡張現実) 動画を活用した情報提供や Web セミナー等を通じて、非対面でのお客さまへのデジタルサポートの拡充に取り組んでいます。また、当社ホームページで、ファンドマネージャーによる運用状況等の説明を拡充するとともに、資産形成初心者の皆さまに十分にご納得いただける Web コンテンツ「インフォグラフィックでわかる!」シリーズを 2017 年 11 月より当社 HP で公開を開始しました。フォントを大きくしてスマートフォンでご覧いただきやすくするとともに、全体を複数パートに分割し、各パートを短い時間で気軽にご覧いただけるようにしています。

対面における取組みでは、年金・機関投資家のお客さまに、増強したプロダクトスペシャリストが中心となり、お客さま毎の個別の分析結果を踏まえた新しいポートフォリオ構築や、お客さまのごニーズに沿ったプロダクトミックス (商品の最適な組み合わせ) のご提案に努めています。

(4) 経営インフラ

経営インフラにおいては、運用部門向けにスマートデータを活用するユーザーインターフェイスをリリースし、分析結果をリアルタイムで同部門に配信しています。また、Web 会議・研修システムの導入、文書決裁・管理システムの導入を実施しました。

また、国立情報学研究所 (NII) 金融スマートデータ研究センターとの共同研究の成果の一つについて、2018 年 2 月に共同で特許出願を行いました。今後も本件を含む先端技術に関する研究を進めるとともに、成果を当社業務に早期に実装できるよう取組みます。

2. アクションプランの更新および成果指標（KPI）について

アクションプランについて、新たに1項目を追加するとともに、実施済、他項目との統合等によって6項目を削除し、全35項目としました。併せて、継続項目についても、アクションプランの内容と実施時期をアップデートしております。今後はこの更新後の項目に沿って実施状況をご報告いたします。

① 運用成績について

『モーニングスター総合レーティング4ツ星以上のファンド数』（純資産10億円以上）

② 長期運用商品について

『設定来10年以上のファンド数（公募株式投信）』（純資産100億円以上）

③ お客さまのQOLへの貢献について

『ライフステージ対応型ファンドの増加額』

3. FD 第三者委員会の提言について

第10回および第11回のFD第三者委員会を開催しました。各回の開催日、テーマおよび外部委員から提言の概要は以下のとおりです。

（1）第10回

開催日：2018年1月23日

テーマ：2018年度経営計画策定について

概要：わかりやすい計画策定、投資未経験者への対応、経営と社員との認識ギャップ、ガバナンス強化等について提言をいただきました。

（2）第11回

開催日：2018年4月16日

テーマ：フィデューシャリー・アクションプラン実施状況、更新およびFD第三者委員会提言の公表について

概要：運用会社のステータス向上、自社商品の信頼性のアピール、アロケーション機能の強化、KPIの設定等について、提言をいただきました。

以上

上記内容の詳細につきましては、当社ホームページのFD専用ページ（下記URL）をご参照ください。

<http://www.smam-jp.com/company/fiduciary/index.html>

本件に関するお問い合わせ先

三井住友アセットマネジメント株式会社 企画部

新保 Tel.03-5405-3239

鈴木 Tel.03-5405-0583

三井住友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