

2024年責任投資原則（PRI）の年次評価の結果について

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社（所在地：東京都港区、代表取締役社長 兼 CEO：猿田隆、以下「当社」）は、責任投資原則（PRI※、Principles for Responsible Investment）による2024年の年次評価において、12項目中8項目において最高評価である「5つ星」を獲得しましたのでお知らせします。

PRIの年次評価は、ESG運用に対する取り組みの質や網羅性を測るうえで重要なメルクマールになるものと考えています。今回の評価では、全体方針となる「ポリシー・ガバナンス・戦略」のほか、インハウス運用の上場株式3項目、同運用の債券2項目、外部委託運用2項目で最高評価である「5つ星」を獲得しました。特に外部委託の評価が過去と比較し向上しており、理由は外部の運用会社との契約時やモニタリングにおいて、責任投資の観点を強化したことと考えています。

当社は2010年3月にPRIに署名し、ESG投資全般の実効性向上に取り組んでいます。責任ある機関投資家として、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したいと考えています。同時に、気候変動や環境保全などの環境問題、人権や高齢化などの社会課題、およびそれらを適切に経営等に活かす体制構築などがガバナンス関連等のESG課題の解決により、サステナブルな社会の実現に貢献してまいります。

今後も、機関投資家としての社会的責任を果たすため、スチュワードシップ活動・ESG活動等を含む責任投資に積極的に取り組み、多くのお客さまから選ばれる運用会社になることを目指します。

※PRI:Principles for Responsible Investmentの略。国連の提唱により2006年に策定された、環境・社会・企業統治（ESG）における諸課題を投資の意思決定プロセスに反映させること等を定めた原則。当社は2006年に同原則に署名。

Module	Module score / Star score		コメント
	2024 (今回)	2023 (前回)	
Policy Governance and Strategy	95 / ★★★★★	95 / ★★★★★	
Direct (社内運用)			
Listed equity - Passive equity	100 / ★★★★★	100 / ★★★★★	
Listed equity - Active quantitative	100 / ★★★★★	100 / ★★★★★	
Listed equity - Active fundamental	100 / ★★★★★	100 / ★★★★★	
Fixed income - SSA	100 / ★★★★★	100 / ★★★★★	
Fixed income - Corporate	100 / ★★★★★	100 / ★★★★★	
Fixed income - Private dept	90 / ★★★★★☆	90 / ★★★★★☆	
Indirect (外部委託運用)			
Listed equity - Passive	82 🏠 / ★★★★★☆	74 / ★★★★★☆	Module score上昇
Listed equity - Active	82 🏠 / ★★★★★☆	74 / ★★★★★☆	Module score上昇
Fixed income - Active	91 🏠 / ★★★★★ 🏠	84 / ★★★★★☆	Star score上昇
Infrastructure	93 🏠 / ★★★★★ 🏠	88 / ★★★★★☆	Star score上昇
Confidence building measures	79 / ★★★★★☆	79 / ★★★★★☆	

【ご参考（英語のみ）】

[PRI アセスメントレポート 2024](#)

[PRI パブリック・トランスパレンシーレポート 2024](#)

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及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。

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社

住所：〒105-6426 東京都港区虎ノ門 1-17-1 虎ノ門ヒルズビジネスタワー 26 階

HP：<https://www.smd-am.co.jp/>

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

【本件に関するお問い合わせ先】

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社

プロダクトマネジメント部ブランドマネジメント室 E-Mail：pr@smd-am.co.jp

松嶋（03-6205-1539）／永澤（03-6205-1862）