

はじめに

「損保ジャパン日本興亜アセットマネジメントの現状2019」を作成しました。
当社の経営方針、事業内容、事業概況などを分かりやすく説明しています。
本誌が当社をご理解いただくうえで、皆さまのお役に立てば幸いと存じます。

経営基本方針

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメントは、資産運用を通じてお客様の将来の安心と豊かさを実現するとともに、社会・経済全体の持続的発展に貢献していくことが、当社の社会的使命と考えます。

当社は、アクティブ・バリュー投資を主体とするマネージャーとして、お客様の中長期的な資産形成に資する最高品質の商品・サービスを提案・提供し、「日本一お客様のことを考える資産運用会社」になることを目指します。

1. 社会的責任の遂行

- ・投資先や資本市場、社会・経済全体の持続的発展に寄与する責任投資に取り組み、機関投資家としてのスチュワードシップ責任を果たします。
- ・ESG(環境・社会・ガバナンス)要素を考慮した中長期視点の投資を通じて投資リターンの拡大を図り、投資先や社会の課題解決に貢献します。

2. サービス品質の追求

- ・優れた人材の継続的な育成に努め、最高水準のチーム運用力の実現と超過収益の獲得を目指します。
- ・お客様の運用ニーズに対し、最高のソリューションを提供します。
- ・お客様の中長期的な資産形成に貢献する商品の提案・提供に取り組みます。
- ・お客様に安心して資産をお預けいただくための有益な情報提供・資料作成を行うことで、説明責任を果たします。

3. 事業効率の追求

- ・事業効率・生産性の向上を追求し続け、お客様の中長期的な資産形成に貢献するサービスを拡充します。

4. 活力ある風土の実現

- ・社員一人ひとりが、プロフェッショナルとしての成長を実感できるような、オープンで活力溢れる組織風土を実現します。
- ・多様な人材登用(ダイバーシティ)によって、社員が個性を發揮し互いに刺激し合いながら、価値を創造し続けることを目指します。

5. 持続的な成長による企業価値の拡大

- ・お客様の中長期にわたる資産形成の信頼にお応えすべく、戦略的な経営資源の投入により、持続的な成長を実現し、企業価値の増大を目指します。

6. 透明性の高いガバナンス態勢

- ・社外の目を経営に取り入れ、お客様第一の視点からのガバナンス体制を強化します。
- ・効果的・効率的なリスク管理態勢を目指すとともに、実効性のあるコンプライアンスを推進します。

2020年4月、SOMPOアセットマネジメントに商号を変更いたします

当社は、お客様にとり短く分かりやすく、グループベースで統一感のあるブランドイメージを醸成していくため、2020年4月、「SOMPOアセットマネジメント」に商号を変更いたします。



SOMPOアセットマネジメント

安心・安全・健康のテーマパーク



SOMPO ASSET MANAGEMENT

A Theme Park for Security, Health & Wellbeing

目次

▶トップメッセージ	2	▶商品・サービスの提供に関する取組み	16
▶お客さま第一宣言／会社概要	4	カテゴリ別の取組み方針	16
▶当社の運用について	5	投資信託の販売チャネル別の 資産残高の内訳	16
一貫した投資哲学と運用スタイル	5	運用商品の提供に関する基本方針	17
アクティブ・バリュー投資 (国内株式運用の場合)	6	ユニバーサルデザイン化の取組み	17
ESG／スチュワードシップ方針	7	つみたてNISAの対象商品	18
		ファンド賞 受賞歴	18
▶事業概況	8	▶人材育成の取組み	19
受託資産残高	8	従業員の状況	19
投資一任契約の受託資産残高の推移	9	人材育成	19
投資信託の資産残高の推移	9	組織活性化への取組み	21
海外のお客さまの受託資産残高の推移	9		
▶運用力強化の取組み	10	▶ガバナンスに関する取組み	22
運用プロフェッショナル人材	10	社外取締役の選任	22
公募投信パフォーマンス	11	お客さま第一委員会	23
投資顧問ビジネスにおけるパフォーマンス	11	利益相反管理に関する取組み	23
▶責任投資の取組み	12	▶損保ジャパン日本興亜アセットマネジメントの歴史	24
当社のESG投資	13	▶データ集	25
社会課題解決のための エンゲージメント活動	14	財務ハイライト	25
当社の責任投資／ スチュワードシップ活動に対する外部評価	15	財務データ	26
議決権行使	15	貸借対照表	27
		損益計算書	28
		議案別議決権行使状況 (2018年1月～12月総会開催企業)	29
		▶「お客さま第一の実践に向けた アクションプラン」の取組状況	30
		▶投資信託およびプロダクトに関わるご注意事項	32
		▶当社業務に関する一般的なご留意事項	33

日本一お客さまのことを考える 資産運用会社を目指して

当社は、1986年に年金等の機関投資家向けの資産運用を行う投資顧問会社として設立されました。その後1998年に投資信託ビジネスにも進出し、会社創立以来、「資産をお預けいただいたお客さまにベンチマーク以上の運用成果をもたらし、中長期の資産形成に貢献すること」を目指して、常に運用成績の向上に取り組んでまいりました。

2016年3月「日本一お客さまのことを考える資産運用会社」を目指し、「お客さま第一宣言」を公表し、顧客本位の業務運営、「お客さま第一」の取組みを実践しています。また、責任ある投資家として国際的なイニシアティブへの参画を積極化するなどESG/スチュワードシップ活動を強化しています。

当社が持続的に、お客さまからの信頼を高めていくには、運用成績を向上させるだけでなく、当社という運用会社を理解していただくための取組み（情報発信の強化）も、重要になってくると考え、当社の経営方針やその取組状況等を幅広いお客さまに報告する手段として、昨年に引き続きアニュアルレポートを刊行いたします。

本レポートの前半では、当社のコア商品であるアクティブバリュー運用の特長をまとめています。すべての資産が持っている本来の投資価値を長期的に分析し、投資を行うという当社の運用スタイルは、中長期的により安定した運用パフォーマンスをお客さまにお届けできると確信しています。この運用スタイルを可能な限り、分かりやすく説明しようと試みました。お客さまのご理解をいただくための一助となれば幸いです。

また、レポートの後半では、事業ハイライトとして、当社事業の取組状況をまとめています。受託資産残高の推移など、事業面の説明に加えて、お客さま第一の具体的な取組み等についても、記載していますので、ご覧ください。

当社は、これからも、「お客さま第一」の取組みを推進し、「責任ある投資家」としての責務を果たしていくことで、お客さまからの信頼を得られるよう、ますます努力してまいります。

今後とも、皆さまの変わらぬご支援とご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

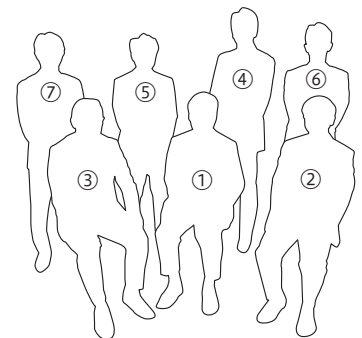
2019年10月

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社
代表取締役社長

小嶋 信弘



- ① 代表取締役社長 小嶋 信弘
- ② 副社長執行役員 吉川 佳彦
- ③ 取締役 常務執行役員 CIO (チーフ・インベストメント・オフィサー) 木谷 徹
- ④ 取締役 常務執行役員 CCO (チーフ・コンプライアンス・オフィサー) 大沼 豊実
- ⑤ 常務執行役員 重田 恭宏
- ⑥ 常務執行役員 八田 真
- ⑦ 常務執行役員 中尾 剛也



お客さま第一宣言／会社概要

当社は2016年3月、「日本一お客さまのことを考える資産運用会社」を目指す企業像として掲げ、「お客さま第一宣言」を策定、公表いたしました。

同宣言で掲げる「3つの実現」に取り組むことで、「お客さま第一」を実践してまいります。

お客さま第一宣言 ～フィデューシャリー・デューティーの実践に向けて～

<目指す企業像>

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメントは、お客さまの中長期的な資産形成に資する最高品質の商品・サービスを提案・提供し、
「日本一お客さまのことを考える資産運用会社」
になることを目指します。

<3つの実現>

当社では、お客さま第一（フィデューシャリー・デューティー）を、
「プロフェッショナルとしてお客さまのことを第一に考える責務」
と考えており、その実践として、以下の3つの実現に取り組んで参ります。

1. お客さまの資産形成に一層貢献できる運用力の実現

- ・優れた運用人材の継続的な育成に努め、最高水準のチーム運用力を目指します。
- ・お客さまの運用ニーズに対し、最善のソリューションを提供します。
- ・エコファンドのパイオニアとして、社会・経済の好循環を促進する責任投資に取り組みます。

2. 真にお客さまの視点にたった商品・サービスの実現

- ・お客さまの中長期的な資産形成に貢献する商品の提案・提供に取り組みます。
- ・お客さまに安心してファンドを保有していただくための有益な情報提供・資料作成を行います。
- ・お客さまへのサービスを拡充しつつ、運用報酬の引き下げを目指します。

3. 上記を実現するガバナンス体制・業務基盤の実現

- ・社外の目を経営に取り入れ、お客さま第一の視点からのガバナンス体制を強化します。
- ・効果的・効率的な最高水準のリスク管理態勢・事務対応力を目指します。

会社概要

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

設立	1986年2月25日	資本金	15億5千万円
金融商品		運用資産残高	投資顧問(助言含む)3兆1,030億円
取引業者登録番号	関東財務局長(金商)第351号	(2019年3月末現在)	投資信託 7,568億円
加入協会	一般社団法人投資信託協会	代表取締役社長	小嶋 信弘
	一般社団法人日本投資顧問業協会	役職員数	164名(2019年4月1日現在)
確定拠出年金運営		株主構成	SOMPOホールディングス株式会社 100%
管理機関登録番号	777	所在地	〒103-0027東京都中央区日本橋2-2-16
事業内容	(1)投資運用業に係る業務		共立日本橋ビル3階(受付)
	(2)投資助言・代理業に係る業務	TEL	03-5290-3400(代表)
	(3)第二種金融商品取引業に係る業務	URL	https://www.sjnk-am.co.jp/
	(4)確定拠出年金運営管理業務		