

## 株主・投資家

▶ **さまざまな環境問題の解決を目指した取組み**

▶ **事業を通じたコミュニティ・社会への貢献**

## さまざまな環境問題の解決を目指した取り組み

### 日本の「エコファンド」の先駆けとして、SRI（社会的責任投資）ファンド普及・拡大へ取り組み

#### 商品・サービス

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメントは、環境対策に積極的に取り組む企業に投資を行う投資信託「エコファンド」を提供しています。『損保ジャパン・グリーンオープン（愛称：ぶなの森）』は、1999年9月に運用を開始した国内エコファンドの先駆的な存在です。その純資産残高は約273億円（2018年4月末時点）と国内のSRI公募投信では最大級の残高水準を有しています。環境問題に積極的に取り組む企業に投資することにより、投資家の資金が間接的に環境保全に貢献することが期待されます。また、『ぶなの森』では、投資家への環境情報の発信や、投資対象企業への環境経営度調査のフィードバックを通じて、環境コミュニケーションの充実を図っています。

エコファンドに加えて、「ESG（環境・社会・ガバナンス）」面の評価の高い企業に投資するSRIファンドも、個人投資家、適格機関投資家のニーズに合わせてながら提供しています。





## エコファンド・SRIファンドを通じたCSRコミュニケーションの充実、社会のESGに対する理解促進

### 商品・サービス

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメントでは、SRIファンドを通じた企業とのCSRコミュニケーションを推進しています。

SRIファンド『ぶなの森』では、約800社の対象企業に対して、毎年アンケートを実施し、環境経営度を調査しています。また、回答企業に対してはアンケートの分析結果をフィードバックしています。

投資家向けレポートのうち、「月次運用レポート」では、組入企業の環境への取組みを紹介、また、四半期ごとに発行している「ぶなの森ニュース」では、「ECOトレンド・ECOインフォメーション・ECOワード」と最新の環境トピックスを紹介しています。また毎年決算時には、組入全銘柄の環境への取組みをレポートにまとめて公表しています。

このように『ぶなの森』では運用実績のみならず、投資家や企業に対する環境関連情報の提供にも力を入れています。

当社の『SNAM日本ESG投資ファンド（適格機関投資家専用）』においては、同ファンドに採用された企業などに対し、SOMPOリスクアマネジメントと協働でESG評価を作成し、送付しています。ESG評価には送付先企業のスコアのほか、評価平均値などを記載し、企業の参考情報として活用いただいています。また、『未来のちから』の月次運用レポートでは組入銘柄の「環境・社会・ガバナンス」への取組みを紹介、『損保ジャパン・エコ・オープン』では環境コメントを掲載するなど、他のSRIファンドにおいても同様の取組みを拡大しています。

当社ではこれからも投資家や企業との対話を通じて責任投資についての理解を促進することで、CSR金融を推進していきます。



投資家向けに情報発信を行う「ふなの森ニュース」(左) 『未来のちから』月次運用レポート(右)

## 企業の環境経営分析の実施

### 商品・サービス

SOMPO リスクアマネジメントは、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメントが販売しているSRI(社会的責任投資)ファンドにおいて、環境経営分析を実施しています。

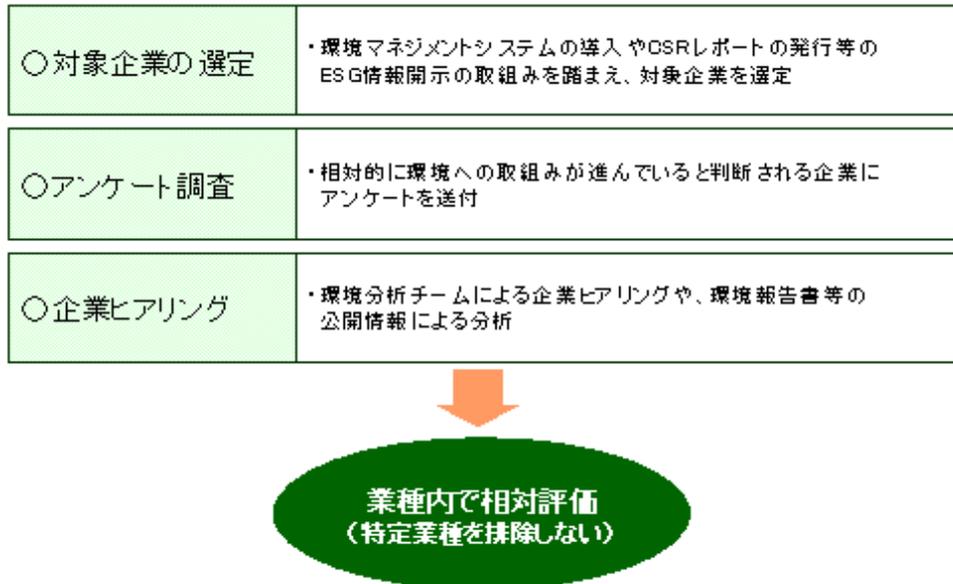
ISO14001を取得している企業や、ISO14001と同等の環境マネジメントシステムを構築している企業、環境報告書やCSRレポート等を定期的に発行している企業など、相対的に環境経営への取り組みが進んでいると判断される上場企業に、アンケート調査への協力を依頼しています。回答者の負担を減らすため、郵送によりログインID、パスワードを通知し、Web上で回答して頂くシステムを採用しています。

このようにして収集したアンケート調査の回答内容を軸に、企業へのヒアリング結果や、環境報告書・CSRレポート等の各種公開情報をもとに分析を行い、環境経営への取り組み状況を評価しています。

そのうえで、アンケート回答企業に対して、アンケートの集計結果や質問項目ごとの自社の取り組みの業界内での相対的なレベルなど、環境経営を推進する上で参考となる分析資料を提供しています。

また、投資家へ環境情報を提供する環境コミュニケーションの取組みを行っています。SRIファンドの一つである「損保ジャパン・グリーン・オープン（愛称 ぶなの森）」の月次レポートでは、組入銘柄企業の優れた環境への取組みを紹介するとともに、環境に関する最新情報を掲載したニュースを年4回発行する業務を担っています。

環境経営分析や、企業や投資家とのエンゲージメントを通じて、企業の環境やCSRの取組みの普及・促進を図っています。



## 日本版スチュワードシップ・コードに沿ってエンゲージメントを実施

損保ジャパン日本興亜および損保ジャパン日本興亜アセットマネジメントは、「責任ある機関投資家」の諸原則として公表された日本版スチュワードシップ・コードの趣旨に賛同し、具体的対応方針をホームページに公表しています。

日本版スチュワードシップ・コードでは、投資先企業の企業価値の向上や持続的成長を促すことが求められており、その取組みの意義や重要性を十分に認識したうえで、投資先企業とのエンゲージメントを行っています。

- ▶ [日本版スチュワードシップ・コードに関する対応方針（損保ジャパン日本興亜）](#) 
- ▶ [日本版スチュワードシップ・コードに関する対応方針（損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント）](#) 

## 事業を通じたコミュニティ・社会への貢献

### ビジネスのグローバルな展開

#### 連携

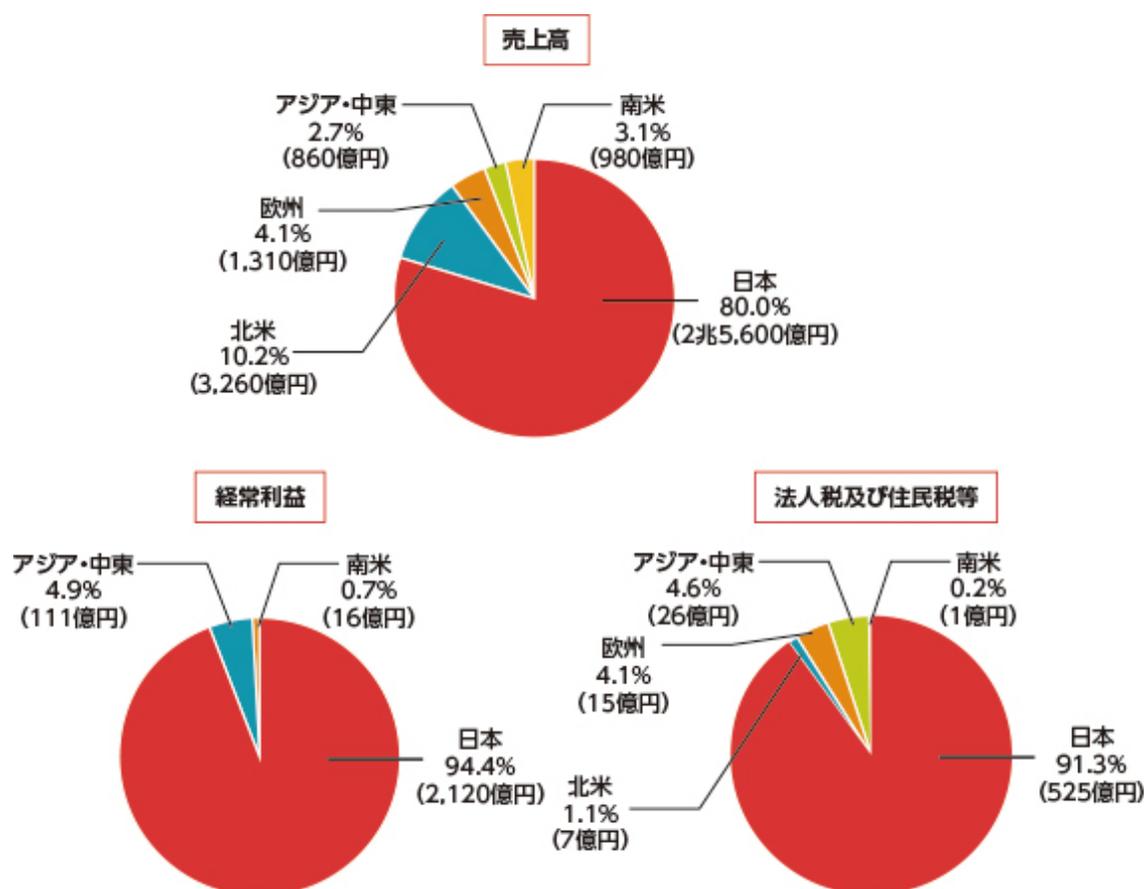
SOMPOホールディングスグループは、以下方針のとおり、正当な利潤を追求すると共に適正な納税を実施しています。

<適切な納税を通じた社会的責任の遂行>

当社は、あらゆるステークホルダーの立場を尊重し、事業活動を展開する国・地域に適用される税法を遵守の上、適正な税負担の実現に努めることで、企業としての社会的責任を果たしてまいります。

また、欧州、中東、北米、中南米、アジア、オセアニア、アフリカの32カ国・地域、211都市をカバーするネットワークを有しており、保険引受業務のほか、事故対応、リスクエンジニアリングなどのサービスを幅広く提供しています。

オーガニックな成長に加え、規律ある投資を行うことで、持続的な成長と株主価値向上を両立することを目指しています。



(注) HD連結財務諸表の公表数値をベースに算出。売上高は正味収入保険料と生命保険料の合計値としている。介護・ヘルスケアは含んでいない。