

「アセットオーナー・プリンシプル」の受入れ表明について

そくりょう&デザイン企業年金基金は、アセットオーナーとして加入者・受給権者皆様の最善の利益を追求するため、令和6年8月28日に「内閣官房新しい資本主義実現本部事務局」が策定・公表した「アセットオーナー・プリンシプル」の趣旨に賛同し、これを受入れることを表明します。

原則1. アセットオーナーは、受益者等の最善の利益を勘案し、何のために運用を行うのかという運用目的を定め、適切な手続きに基づく意思決定の下、経済・金融環境等を踏まえつつ、運用目的に合った運用目標及び運用方針を定めるべきである。また、これらは状況変化に応じて適切に見直すべきである。

当基金は、老後の所得確保という目的を達成するため、加入者及び受給権者の受給権保護の観点から、安全かつ効率的に資産の運用を行います。

運用にあたっては、理事会・代議員会における意思決定の手続きに従って運用方針を策定し、当基金の状況や環境の変化に応じて定期的に見直しを行います。

原則2. 受益者等の最善の利益を追求する上では、アセットオーナーにおいて専門的知見に基づいて行動することが求められる。そこで、アセットオーナーは、原則1の運用目標・運用方針に照らして必要な人材確保などの体制整備を行い、その体制を適切に機能させるとともに、知見の補充・充実のために必要な場合には、外部知見の活用や外部委託を検討すべきである。

当基金は、運用目標の達成に向けて運用担当責任者を設置するとともに、運用の基本方針、運用ガイドラインや政策的資産構成割合の策定、運用受託機関の評価等、資産運用に関わる事項の決定に際し、審議するため資産運用委員会を設置しています。

また、知見の補充・充実のため、運用受託機関や外部コンサルティング機関を活用し、報告・分析・助言等を受けています。

原則 3. アセットオーナーは、運用目標の実現のため、運用方針に基づき、自己又は第三者ではなく受益者等の利益の観点から運用方法の選択を適切に行うほか、投資先の分散をはじめとするリスク管理を適切に行うべきである。特に、運用を金融機関等に委託する場合は、利益相反を適切に管理しつつ最適な運用委託先を選定するとともに、定期的な見直しを行うべきである。

当基金は、運用受託機関の選任にあたっては、運用受託機関の得意とする運用方法を考慮し、定量評価だけでなく、定性評価を加えた総合評価により行います。また、リスク管理の観点から複数の運用方法による分散投資に努め、運用実績を定期的に評価し必要に応じて見直しを行います。

なお、その際には、従来から委託している金融機関であることや、運用委託先及びそのグループ金融機関との取引関係があるということだけで判断せず、適切な運用委託先の選定を行います。

原則 4. アセットオーナーは、ステークホルダーへの説明責任を果たすため、運用状況についての情報提供（「見える化」）を行い、ステークホルダーとの対話に役立てるべきである。

当基金は、年金資産の運用方針、資産構成割合、運用状況等について、事業主並びに加入者・受給権者に対し、当基金のホームページ及び年2回発行の「基金だより」に掲載して周知します。

原則 5. アセットオーナーは、受益者等のために運用目標の実現を図るに当たり、自ら又は運用委託先の行動を通じてスチュワードシップ活動を実施するなど、投資先企業の持続的成長に資するよう必要な工夫をすべきである。

当基金は、企業年金連合会の「企業年金スチュワードシップ推進協議会」へ加入し、協働モニタリング活動を通して、投資先企業の企業価値の向上に寄与し、中長期的な投資リターンの拡大に努めます。

以上