

## CONTENTS

- 02 | 経営理念
- 03 | 運用哲学
- 04 | トップメッセージ
- 06 | 数字でみるニッセイアセットマネジメント

### 1 サステナビリティ経営

- 08 | サステナビリティ経営基本方針
- 10 | 各種ポリシー制定(人権方針・環境方針)
- 11 | サステナビリティ経営の推進体制
- 12 | ニッセイアセットの重要課題
- 14 | 環境への取り組み
- 15 | 社会貢献活動
- 16 | 金融教育の推進
- 18 | 働きやすい職場環境・風土醸成に向けて
- 22 | 人材育成への取り組み
- 23 | 健康経営に向けた取り組み
- 24 | 責任投資原則(PRI)と「PRI in Person 2023」東京開催について

### 2 ESG運用

- 26 | CIOメッセージ
- 27 | ハイライト
- 28 | ESGへのコミットメントの歴史
- 30 | “ESG”レター from ニッセイアセットマネジメント
- 32 | 安心感のあるESGファンドのご提供に向けて
- 36 | ESG評価とパフォーマンス
- 38 | ESGインテグレーションの考え方と対話との関係
- 48 | スチュワードシップ活動の全体像・活動体制
- 50 | 責任投資監督委員会とチーフ・コーポレートガバナンス・オフィサーとの対話2023
- 54 | リターンも生むインパクト投資に向けた取り組み
- 56 | 人権とESG運用
- 57 | 生物の多様性が失われる問題とESG運用
- 58 | 気候変動への取り組み
- 68 | 外部運用の取り組み
- 70 | 2022年度トピック
- 72 | 主なグローバルイニシアティブ
- 73 | 運用体制

### 3 2022年度 スチュワードシップ活動の 振り返りと自己評価

- 75 | I スチュワードシップ活動の振り返り
- 95 | II スチュワードシップ活動の自己評価

#### 巻末

- 96 | 会社概要/役員
- 97 | 当社財務状況/組織図
- 98 | コーポレートガバナンス体制の高度化に向けた取り組み/コンプライアンス・利益相反管理への取り組み

最高の付加価値をご提供すること、  
そしてお客様にご満足頂くことで、  
お客様との長い信頼関係を築きます。

## 経営理念

私達は、資産運用サービスの各場面において、プロフェッショナルとして、お客様に最高の付加価値をご提供することを使命としています。継続的に最高の付加価値をご提供すること、そしてお客様にご満足頂くことで、お客様との長い信頼関係を築きます。

### 1 お客様の ご満足のために

- お客様の将来の計画や夢の実現に必要な、高品質な運用商品とサービスをご提供するとともに、長い期間にわたってご満足頂けるよう不断の努力をいたします。
- お客様の健全な資産形成には、正しい知識と正しい理解に裏付けられた投資判断が不可欠であると考えます。この考えを尊重し、お客様の最良のパートナーとして投資のお手伝いをします。



### 2 プロフェッショナリズム の追求

- 役職員一人一人が、お客様の資産を運用するものとしての責任と誇りを持ち、各分野におけるプロフェッショナルとしてたゆまぬ努力を続けます。



### 3 公正で誠実な 企業文化の醸成

- 資産運用サービスの社会的使命に鑑み、公正で誠実な企業文化の維持に努めます。
- グローバルな企業市民として法令等を遵守し、一人一人がその使命と責任を認識して社会貢献に努めます。
- 市民社会の秩序や安全に脅威を与える暴力団や総会屋などの反社会的勢力に対しては、毅然とした態度を貫きます。

## 運用哲学

組織的で一貫性のある意思決定プロセスを継続し、ニッセイアセットとして責任ある運用を行います。

### アクティブ運用

市場の非効率性を発見し、資産の市場価格と適正価格の乖離を捉えることにより、超過収益を獲得します。



### 徹底したリサーチ

徹底した調査・分析と洞察力を収益機会の源泉とします。



### 規律ある運用



継続性・一貫性のある運用と徹底したリスク管理により、安定的に運用目的を達成します。

お客様にとって  
世界一信頼できる、  
世界一頼れる運用会社を  
目指します。

ニッセイアセットマネジメント株式会社  
代表取締役社長

大関 洋

今年も集中豪雨等による被害が日本各地で発生しています。地球温暖化の影響は年々顕著となり、IPCCの統合報告書にもあるように、気候危機を日常に感じるようになってきています。スウェーデンのレジリエンス研究所で提唱された、「環境」「社会」「経済」の3層構造のSDGsウエディングケーキの土台にあたる、「環境」が揺らいでいると言えます。

加えて、米中関係の緊張や、ロシア・ウクライナ情勢などの地政学リスクの高まりから、世界の分断化が進展しています。これらの構造変化を受け、世界的にインフレ傾向が強まり、欧米での高インフレに対する急激な金融引き締めが、世界の金融経済に大きな影響を及ぼしています。また、デジタル・トランスフォーメーショ

ンについても、生成型AIの登場によって、想像を超えたスピードでAIが世界を変える姿が、具体的にイメージされるところまで来ています。

企業もこのような環境変化に対して、大胆なパラダイムシフトが必要になっています。地政学リスクや世界構造の変化に対応するだけでも大仕事ですが、その土台となる「環境」の変動に対する対応も待たなしの状況です。土台となる「環境」「社会」の大きな変化の中で、経済を成長させていくサステナブルな企業経営はかつてないチャレンジに直面しています。

ニッセイアセットではESG投資の際、良いESGの取り組みをしているだけでなく、企業収益に有機的に結び付く取り組みになってはじめて高い評価をする、いわば“現金なESG評価”

をしてきましたが、それは真のサステナブル経営を追求する企業を見極めようとする営みでもあります。

日本は、2024年からスタートする新NISA制度を追い風として、資産運用立国を目指そうとしています。“貯蓄から投資へ”のパラダイムシフトが起こり、国民全体の投資が増えることは、資産運用会社にとってチャンスと言えます。同時に、顧客本位の本質を踏まえた商品提供や、その前提となる個々人の金融リテラシーを高める教育に取り組むなど、これまで以上にお客様の中長期の資産形成を支援する、資産運用業の社会的責務が増してきていると感じています。

ニッセイアセットは、「A Good Investment for the Future」をスローガンに、ビジネスを通

じた社会課題の解決、サステナブルな社会の実現に貢献したいと考えています。「Good」には、お客様の運用パフォーマンスはもちろんのこと、環境や社会、当社従業員にとっても価値のある投資という意味を込めており、「Future」には、『お客様の未来』『地球の未来』『当社自身の未来』との意味を込めています。お客様をはじめとしたステークホルダーの皆様に対するフィデューシャリー・デューティー（受託者責任）を果たす中で、サステナブルな社会の実現に貢献し、ニッセイアセットがお客様にとって世界一信頼できる、世界一頼れる資産運用会社となることを目指して参ります。

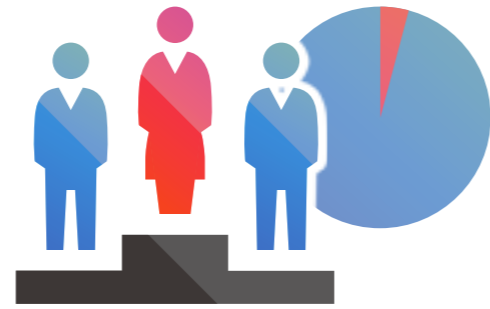
運用資産残高

34.0 兆円



女性管理職比率

10.2%



運用業務従事者の平均経験年数

約12年

(2023年3月末時点)



国内株式議決権  
行使議案件数

15,342 議案

(子議案ベース、2023年5・6月)

反対行使比率

13.5%

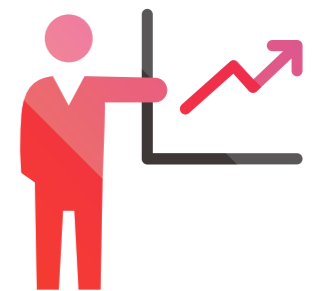
(子議案ベース、2023年5・6月)

ESG ファンド残高

8,098 億円



(2023年3月末時点の ESG ファンド残高。2022年度より  
パッシブファンド込みの数値 (2022年度 9.9 億円))



在籍アナリスト、  
エコノミスト数

36名

(2023年3月末時点)

# 数字で見る ニッセイアセットマネジメント

運用ポートフォリオの  
カーボンフットプリント

68.8t-CO<sub>2</sub>e/ \$ mil

(株式・社債のみを対象。2021年12月時点)



CO<sub>2</sub> 排出量削減



1,864t-CO<sub>2</sub>e

有給休暇取得日数

18.2 日



企業との個別対話件数

1,678 件

(2022年度)



第1部

# サステナビリティ経営

## サステナビリティ経営基本方針

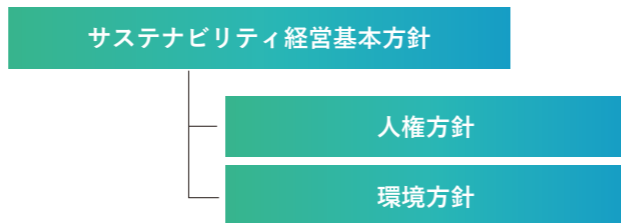
- 人権や多様な価値観の尊重、地球環境問題などに積極的に取り組み、持続可能な社会の実現に貢献します。
- 当社に関わる全てのステークホルダーとの協働・共栄に励み、全員の明るい未来の創出に挑み続けます。



- 社会の持続的成長に繋がるビジネスに取り組みます。
- サステナビリティの推進に向けた、社員意識の醸成、教育・啓発活動に努めます。

### 具体的方針

サステナビリティ経営の推進に当たり、当社では、具体的な主な方針を右記の通り定めています。



### サステナビリティ推進に向けたスローガン「A Good Investment for the Future」

当社では、全社員が一体となってサステナビリティ経営推進に向けて取り組みを進めることができるよう、会社全体として分かり易いスローガン「A Good Investment for the Future (グッド・インベストメント・フォー・ザ・フューチャー)」を掲げました。

このスローガンにおいて「Good Investment」には、『環境や社会に良い投資』『パフォーマンスの良い投資』『従業

員のために良い投資』と複数の意味を含め、単なる経済的リターンの追求にとどまらない「良い投資」の実現に向けて取り組んでいく当社の意志を示しています。また、「for the Future」にも、『お客様の将来』『地球の未来、次世代』『当社自身の成長』と様々な意味を含め、未来に向けた責任を有していることを強く認識し、サステナブルな社会の実現に向けた役割を果たして参ります。

## サステナビリティの考え方の変遷

サステナビリティ 1.0 (2000年代頃まで) では、経済、社会、環境は相互に関連性のあるものとしてではなく、個別性の高い要素として見なされていました。特に経済・収益重視が企業経営の根幹にあり、経済活動から生まれた利益を社会や環境面への支援に活用するというCSRの考え方でした。CSRは企業活動において、社会的公正や環境などへの配慮を組み込み、従業員、投資家、地域社会などのステークホルダーに対して責任ある行動をとるとともに、説明責任を果たしていくことを求める考え方でした。

サステナビリティ 2.0 (2010年代頃まで) では、CSV (Creating Shared Value) の考え方も登場しました。以前は、経済、社会、環境を個別の事象として捉えていましたが、3側面を統合し、相互に補完関係があることが意識されてきました。この補完関係が少し進歩し、これらの3つの要素(経済、環境、社会)には重なる部分があることが認識され始めました。経済、社会、環境に関する課題の統合的取り組みによる、トレードオフの緩和及びシナジー効果の創出を期待するものではありませんが、環境面・社会面に比べ経済活動に占める比重は依然高いものでした。

サステナビリティ 3.0 では、環境価値の上に社会価値が乗り、さらにその上に経済価値が乗っている考え方が普及してきました。経済活動は環境・社会を前提としていて、事業活動全体が環境・社会と両立しなければならないという考え方です。サステナビリティ経営は「単に、手当たり次第に環境や社会に良いことをする」ということではなく、環境・社会・経済の3層構造を認識・理解し、長期的な視点から環境・社会のサステナビリティを展望した上で、環境・社会に対し持続的に価値を提供し企業価値を高めることが求められる時代に入ってきました。

当社では、こうしたサステナビリティの変遷に対応すべく、サステナビリティ重要課題を特定し、事業活動や運用に反映しています。



### Good の意味合い

- 環境・社会に良い投資
- パフォーマンスの良い投資
- 従業員のために良い投資

### Future の意味合い

- お客様の将来のために
- 地球の未来・次世代のために
- ニッセイアセットの成長のために



# 各種ポリシー制定（人権方針・環境方針）

## 人権方針

当社は、経営理念で掲げる「お客様に最高の付加価値をご提供し、お客様との長い信頼関係を築く」ためには、資産運用ビジネスが様々な形で影響を与えることを認識し、サステナビリティ経営基本方針にも掲げるように、人権や多様な価値観の尊重等により持続可能な社会の実現に貢献することや、当社に関わる全てのステークホルダーとの協働・共栄に励む必要があると考えています。

このような考えに基づき、当社の事業活動において影響を受けるステークホルダーの人権を尊重し、バリューチェーン全体を通じて持続可能な社会の実現に貢献していくため、人権方針を定め、人権の尊重に取り組んで参ります。

なお、当方針は、定期的に見直しの要否を検討し、必要に応じて見直しを図って参ります。



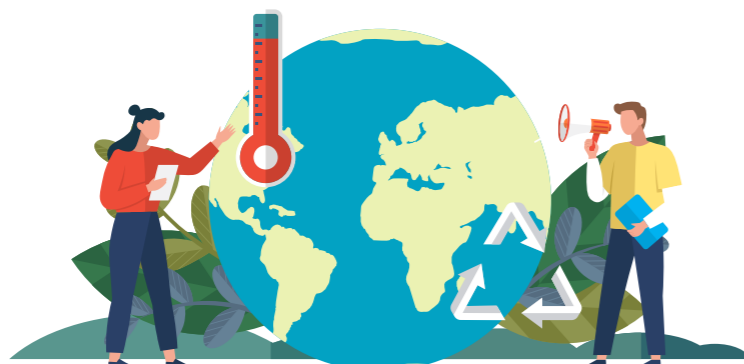
### 人権啓発に向けた取り組み

当社では、従業員一人一人が、人権尊重の理念に対する理解を深め、様々な差別をなくすことが企業の社会的責任であることを自覚し、『差別を排除し、これをさせない・許さない』という企業体質の確立を目指し、意識付けを実施しています。人事部より、全役職員向けに、毎月人権啓発メールの配信や、年1回人権標語の募集を行うなどの取り組みを通じて、今後も人権教育・啓発に取り組んで参ります。

## 環境方針

当社は、経営理念で「グローバルな企業市民として法令等を遵守し、一人一人がその使命と責任を認識して社会貢献に努めること」を掲げています。また、資産運用ビジネスは様々な形で影響を与えることを認識し、サステナビリティ経営基本方針にも掲げるように「地球環境問題などに積極的に取り組み、持続可能な社会の実現に貢献すること」が必要であると考えています。

このような考えに基づき、環境方針を定め、環境に配慮した行動に努めます。

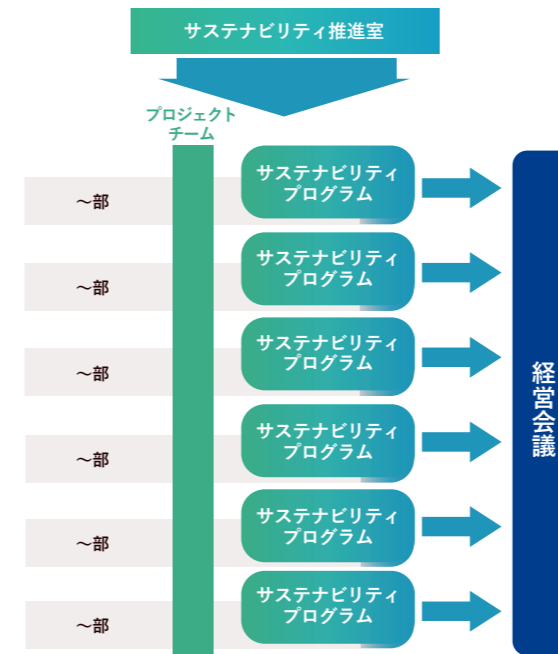


# サステナビリティ経営の推進体制

当社はサステナビリティ経営の着実な推進をリードすることを目的として、2022年度より「サステナビリティ推進室」を設置しました。サステナビリティ推進室長を中心に具体的な取り組みを推進するとともに、各部に対しても独自の「サステナビリティ推進プログラム」の設定を依頼し、各担当領域にてサステナビリティ向上に向けた取り組みを進める体制としています。

また、サステナビリティ経営をさらに強化すべく、本部横断での取り組みを推進するプロジェクトチームも設置しています。

## サステナビリティ経営推進体制の全体像

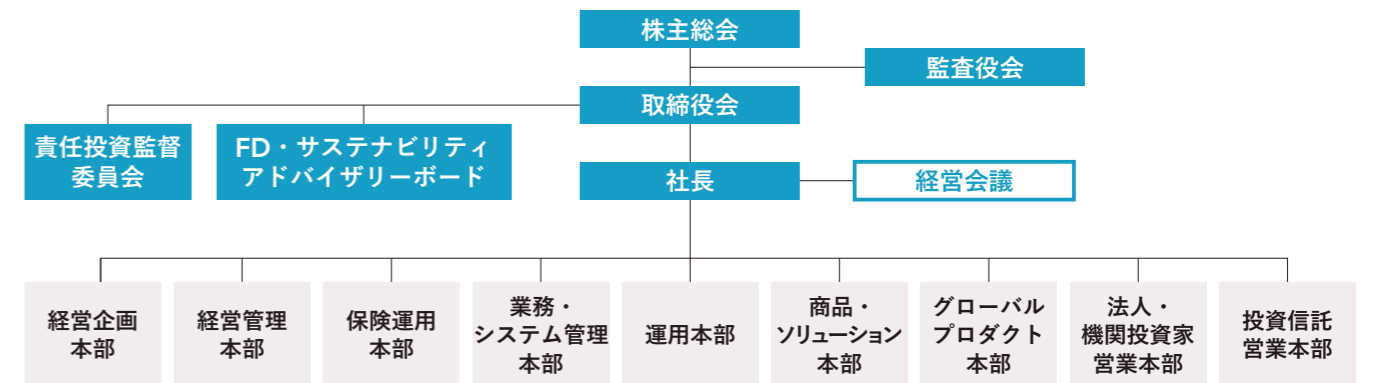


## 2023年度サステナビリティ経営推進PT（プロジェクトチーム）

人材戦略	金融教育
<ul style="list-style-type: none"> <li>次期中計に向けた人材戦略の確立</li> <li>バーパスの策定</li> <li>コミュニケーション活性化施策の実施・検討</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>次期中計に向けた金融教育方針の検討</li> <li>金融・投資教育冊子やSDGs人生ゲームを活用した授業を教育機関にて実施</li> <li>大学等での講義の実施</li> </ul>
ESG投資拡充	低環境負荷ビジネス
<ul style="list-style-type: none"> <li>ESG バランスファンドの開発</li> <li>ESG 債券ファンドの開発</li> <li>インパクト／トランジションファンドの横展開</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>一人当たりコピー用紙使用量・ゴミ排出量の2019年度比50%減</li> <li>CO<sub>2</sub> 排出量抑制</li> </ul>
サステナビリティブランディング	ポート CO <sub>2</sub> 削減
<ul style="list-style-type: none"> <li>当社のサステナビリティ広報戦略・開示項目の検討</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>企業に頼られるエンゲージメントの実践</li> <li>外部運用者におけるネットゼロの推進</li> <li>ソブリン等運用資産での削減目標設定</li> <li>ネットゼロに資する商品の検討</li> </ul>

当社を取り巻く環境が大きく変化するなか、透明で公正、かつ迅速で果敢な意思決定を行うための体制整備を行うことを目的に、2023年度にガバナンス体制の見直しを行いました。

資産運用業界におけるFD（フィデューシャリー・デューティー）やサステナビリティ経営の重要性は年々高まっており、絶え間なく高度化を続けていくことが運用会社としての使命と捉えています。こうしたなか、取締役会での審議をより実効的なものにする観点から、外部有識者を中心に構成するFD・サステナビリティアドバイザリーボードを取締役会の諮問会議として新設しました。当アドバイザリーボードには、当社独立社外取締役のほか、複数の外部有識者を招聘し、幅広い見地から当社経営へのアドバイスを受領しています。



# ニッセイアセットの重要課題

当社では、サステナビリティ経営の推進にあたり、グローバルなSDGs目標の達成に向け「当社が社会から期待されている役割は何か」、そして「当社の成長に繋がる取り組みは何か」という2軸で社会の様々な課題を捉え、「ニッセイアセットが優先的に取り組むべき課題は何か」についての議論を重ね、重要課題を下記の通り特定しています。全社員一丸となって、サステナブルな社会の実現に向け貢献できるよう、取り組みを進めて参ります。



## 重要課題 1

### 多くの人がアクセス可能な運用サービスの実現



#### 目指す姿

預金や保険などと同様に、資産運用を誰もが身近に感じることのできるような金融サービスへと進化させ、一人一人の資産形成に貢献します。そのためにお客様本位の業務運営を徹底し、全てのお客様とともに成長することができる企業を目指します。

## 重要課題 2

### ESG投資の高度化・充実



#### 目指す姿

ESG運用のフロントランナーを標榜する企業として、常に最新のESG評価手法を研究し、当社ESG運用の絶え間ない高度化に努めます。また、運用リターンと持続社会の実現の両立を目指すESG運用の実践を通じて、絶えずESG運用の高度化、商品の積極的な開発、お客様への提案に取り組みます。

## 重要課題 3

### サステナブル社会の実現に向けたインベストメント・チェーン構築



#### 目指す姿

当社はインベストメント・チェーンの一翼を担う立場として、社会資源を適切に分配することで、社会全体の富を増やす役割を有しています。お客様の大切な資金の投資を通じ、投資先企業と社会のサステナブルな成長へと結び付く、社会の好循環を生み出すことのできる運用サービスの拡大を目指して参ります。

## 重要課題 4

### 低環境負荷ビジネスの実現



#### 目指す姿

気候変動問題をはじめとする種々の環境問題は人類の生存をも脅かす重大な問題であるとの認識に立ち、当社ビジネスのオペレーションが環境に与える負荷を最小限にすべく、業務プロセスの見直し、及び職場環境の整備に努めます。

## 重要課題 5

### 社員の社会貢献活動の積極推進



#### 目指す姿

当社は、健全な社会形成を前提にビジネスが成立しているとの認識のもと、社員に積極的な社会への貢献・還元を推奨し、社会とともに成長する企業であり続けます。

## 重要課題 6

### あらゆる人々が活躍する社会の実現



#### 目指す姿

「人財」こそが競争力の源泉である資産運用会社にとって、性別も国籍も年齢もバックグラウンドも異なる多種多様な社員が活躍できる環境を整えることこそが激しさを増す競争を勝ち抜く「鍵」です。様々な個性を持ち、個々の事情を抱えた社員それぞれが最大限能力を発揮できる職場環境の整備、職場風土の醸成を目指します。

## 重要課題 7

### ガバナンス・リスク管理の高度化



#### 目指す姿

コーポレートガバナンスは、健全な企業経営を行う上で最重要課題の一つであり、絶え間ない高度化を目指して参ります。また、法令遵守の徹底等、社員の規範意識の向上にも努め、社会・お客様との信頼関係の構築に繋げて参ります。

重要課題	KPI	目標	2020年度	2021年度	2022年度
多くの人がアクセス可能な運用サービスの実現	公募投信残高	幅広い顧客からの投資資金受け入れ	24,519億円	27,420億円	27,085億円
	確定拠出年金残高	幅広い顧客からの投資資金受け入れ	5,494億円	6,598億円	7,390億円
サステナブル社会の実現に向けたインベストメント・チェーン構築	ESGファンド残高	ESGファンドの普及推進	6,553億円	8,195億円	8,098億円 <sup>(注1)</sup>
	運用ポートフォリオカーボンフットプリント	2030年度：50%削減(2019年度対比) 2050年度：ネットゼロ	75.7 t-CO <sub>2</sub> e/ \$mil	68.8 t-CO <sub>2</sub> e/ \$mil	— <sup>(注2)</sup>
低環境負荷ビジネスの実現	従業員一人当たりコピー用紙使用量	2030年度：50%削減(2019年度対比)	4,691枚	3,987枚	3,422枚
	CO <sub>2</sub> 排出量削減	2030年度排出量：50%削減(2019年度対比)	1,991 t-CO <sub>2</sub> e	1,409 t-CO <sub>2</sub> e	1,864 t-CO <sub>2</sub> e
あらゆる人々が活躍する社会の実現	女性管理職比率	2030年度：20%以上	6.2%	7.4%	10.2%
	健康経営等の認定取得	2025年度 くるみん・えるぼし認定取得 健康経営優良法人認定取得	未取得	未取得	くるみん・えるぼし未取得 健康経営優良法人認定取得
ガバナンス・リスク管理の高度化	取締役会の実効性強化	2025年度までに 独立社外取締役比率：1/3以上	25%	25%	37.5%
	ROE	資本効率を意識した経営	16.5%	14.9%	13.1%

(注1) ESGファンド残高は、2022年度よりパッシブファンド込みの数値(2022年度9.9億円)。

(注2) 本レポート作成時点においては、各投資先の2022年度の温室効果ガス排出量関連データが十分に得られないため、算出していません。

# 環境への取り組み

## 脱炭素に向けた活動目標

当社は事業活動領域におけるCO<sub>2</sub>実質排出量を2030年度までに2019年度対比で50%の削減を目指します。さらにCO<sub>2</sub>排出量削減を実施しているプロジェクトへ寄付を行い、環境負荷への軽減を支援します。

### CO<sub>2</sub>実質排出量の推移

(t-CO <sub>2</sub> e)	2013年度	2017年度	2018年度	2019年度	2020年度	2021年度	2022年度
全社排出量	2,114	2,992	3,540	3,164	1,991	1,409	1,864
スコープ1	19	8	5	6	6	5	5
スコープ2	616	622	713	572	653	79	11
スコープ3*	1,480	2,362	2,821	2,586	1,332	1,325	1,848

※スコープ3につきましては、カテゴリ1・3・5・6・7・8・9の排出量を算定しています。投資先のポートフォリオCO<sub>2</sub>排出量（カテゴリ15）につきましてはP59に記載の通りです。

### 2022年度スコープの概要・算定対象活動項目

区分	概要	算定対象活動	排出量 (t-CO <sub>2</sub> e)
スコープ1	自社での燃料の使用などによる直接排出	社用車の燃料	5
スコープ2	自社で購入した電気の使用などによる間接排出	自社使用する電力使用量	11
スコープ3	サプライチェーンにおける自社以外の間接排出	—	—
カテゴリ1	自社で購入した物品・サービス	紙使用量	1,084
カテゴリ6	従業員の出張に伴う排出	出張	657
カテゴリ7	従業員の通勤に伴う排出	通勤	83
カテゴリ8	従業員による自宅等での在宅勤務に伴う排出	在宅勤務	20
その他計	一般廃棄物の排出等	—	4

## Jクレジット

当社はCO<sub>2</sub>排出量の削減を行っている企業・個人の活動を支援すべく、プロジェクト等への資金提供に繋がることを目的に省エネ由来のJ-クレジット<sup>※</sup>を購入しています。

※国が認証している省エネルギー設備の導入や再生可能エネルギーの利用によるCO<sub>2</sub>等の排出削減量や、適切な森林管理によるCO<sub>2</sub>等の吸収量をクレジット化したもの。

## 環境負荷軽減に向けた取り組み

当社では、環境負荷軽減に向けた取り組みとしてプラスチック製品の利用見直しを進めており、社外者とのミーティング時に提供する飲料をペットボトルからアルミ缶へ切り替え、販促ツールとして間伐材を使用したマグネットや非プラスチック製透明クリアファイルの活用を始めています。さらに社内にウォーターサーバーを設置し、ゴミの削減にも努めています。加えて、当社ロゴ入りの置き傘も製作し、リサイクルが難しいと言われている傘の購入を減らす取り組みを行っています。

なお、ウォーターサーバー設置等により当社ペットボトルのゴミは、2019年度（設置前）と比較し、約60%削減しています。



# 社会貢献活動

当社はサステナビリティ経営の重要課題として「社員の社会貢献活動の積極推進」を掲げています。当社が行うアセットマネジメントビジネスは、健全な「環境」「社会」が永続してこそ成立するものであり、社員一人一人が社会への貢献・還元を意識することにより、社会とともに成長することができ、当社のサステナビリティ経営に繋がると考えています。

## ボランティア活動の推進

当社では、従業員による自発的かつ積極的なボランティア活動（社会貢献活動）の推進を行っています。

2022年度より、こうした取り組みを後押しすることを目的に、ボランティア休暇を設けています。また、従業員のボランティア活動推進に向けて、社内でボランティア関係のホームページを開設し、実際に参加した従業員の声やボランティア情報の紹介等を行っています。



ビーチクリーン



援農

## チャリティーリレーを通じた寄付

当社有志社員により、走ったマイルが寄付に繋がる外部のチャリティーリレーに参加しました。本リレーをきっかけに社内で寄付を募り、「特定非営利活動法人ジャパンハート」へ寄付しました。

コロナにより、多くの社内コミュニケーションがオンライン化され、コロナ前まで定期的に開催されていた対面での忘年会・新年会や、社内イベントなどの社員交流活動が大幅に制限されました。社員同士の一体感の醸成やモチベーションの向上、ミスコミュニケーションの防止に向けた取り組みとしても有意義なものとなりました。



チャリティーリレー

## 医療機関への寄付

当社と株式会社名古屋銀行は、SDGs関連投資信託商品「ニッセイSDGsグローバルセレクトファンド（資産成長型・為替ヘッジなし）」からそれぞれ収受した収益の一部を、医療従事者への支援のため、医療機関へ寄付いたしました。

寄付先	寄付者	寄付金額
・愛知県がんセンター ・愛知県精神医療センター ・あいち小児保健医療総合センター ・愛知県医療療育総合センター中央病院	名古屋銀行	1,000,000円 (各250,000円)
	ニッセイアセットマネジメント	1,000,000円 (各250,000円)

# 金融教育の推進

## 小学校高学年以上を対象とした金融・投資教育冊子の制作

小学校高学年以上を対象とした金融・投資教育冊子「投資を学ぼう！」を独自に制作しました。

金融教育については、2022年4月から高等学校の家庭科の授業で必須となったほか、政府が掲げる「新しい資本主義」においても、「資産所得倍増プラン」として、個人金融資産を「貯蓄から投資」へシフトさせる政策が検討されるなど、重要性が増している分野と認識しています。

そうしたなか、当社としても、金融教育を当社のサステナビリティ経営における重要課題と位置づけ、取り組みを行って参りました。今般制作した金融・投資教育冊子「投資を学ぼう！」では、若年層にも金融や投資を身近に感じてもらうため、トピックの導入部分を漫画仕立てとし、さらに若者に馴染みの深いソーシャルメディアの対話形式を活用することで、より興味を持って学習できるように工夫しました。

本書では、まず「会社」について学び、会社に関わる株式と債券（社債）に関する「投資」を学習し、それらを活用した「実践編」として実際の投資手法を紹介していくことで、長期資産形成の考え方や手法を無理なく習得できるような構成としています。

当社は、持続可能でより良い社会の実現を目指し、「A Good Investment for the Future」というスローガンを掲げ、会社一体となってサステナビリティへの取り組みを進めています。当金融・投資教育冊子が教育現場などでの活用を通じ、より多くの子供達の金融リテラシーの向上に寄与し、将来の長期的な資産形成、より良い社会の実現に貢献することを目指しています。



## 京都大学経済学部「SDGsと金融・経済・社会」寄付講義の実施

国立大学法人京都大学経済学部において、当社社員が担当者となり学部生を対象とした寄付講義「SDGsと金融・経済・社会」（毎週火曜日、全15回）を2022年度後期に実施しました。

講義では、当社社員だけでなく、SDGsに携わり社会で活躍する多様なゲストを迎え、SDGsを単なる理念にとどめず、金融・経済・社会など現実世界との望ましい関係構築のためのビジョンについて学生と共有しました。

当社が金融業界においてグローバルに培ったSDGs・ESG投資への視点や、様々な企業における実践的な取り組みについて、スピーカーの講演をもとにディスカッションを取り入れた双方向のコミュニケーションを重視した授業を実施しました。

## 出張授業の実施

品川区の小学生に『Beyond SDGs 人生ゲーム』と金融・投資教育冊子「投資を学ぼう！」を用いて金融教育を行いました。

授業に参加した生徒からは、「自分のお金が会社などを通じて環境と関わっていることが分かりました。SDGsの目標が達成できるように高い意識を持って環境に良い活動をしたい」等の感想を頂きました。より多くの子供達の金融リテラシーの向上に寄与し、将来の長期的な資産形成、より良い社会の実現に貢献したいと考えています。



## 金融教育セミナーの実施

2022年度から高等学校の家庭科と公共の授業において、金融機関の役割や金融商品の特徴、資産形成について学ぶことになりました。当社代表取締役社長が講師となり、高校生にとって必要な金融リテラシーを養うため、高校教職員の皆様の授業に役立つオンラインセミナーを開催しました。

『将来を明るく快適に暮らすためにやるべきこととは』をテーマに、資産形成に必要な知識をどのように身に付けるか、より実践的な学びを提供するセミナーになりました。



## SDGs川柳コンクール

当社は、持続可能でより良い未来にしていきたいため、将来を担う小学生を対象に川柳作りを通じてSDGsについて考えてもらう「5・7・5でめざすよりよい未来 小学生「SDGs川柳」コンクール」を実施します。

より良い未来をつかっていくために、「自分ができること」や「まわりの人達に伝えたいこと」などSDGsで取り組むことを5・7・5の川柳で表現頂き、世界の未来を作る主役である小学生の皆さんによる、自由な発想でつくられた作品を募集しています。





# 働きやすい職場環境・風土醸成に向けて

産業構造の急激な変化、少子高齢化や人生100年時代の到来、個人の価値観の変化など、企業を取り巻く環境は大きな変化を迎えています。

当社は、「A Good Investment for the Future」をスローガンとして掲げ、企業価値の向上に向けたダイバーシティ

推進、人材育成への取り組みを進めています。

社員一人一人が、「Good Investment」に繋がるかを自問自答し、企業の成長のみならず、持続可能な社会の実現に向けた取り組みを推進しています。

## 人事室長からのメッセージ

当社は、「人財」が競争力の源泉である資産運用会社にとって、あらゆる人々が活躍できる環境を整えることが、激しさを増す競争を勝ち抜くカギだと考えています。

そのために、性別・年齢・国籍・障がいの有無・働き方等による違いを尊重するダイバーシティは、新たなアイデアの創出やお客様視点に立ったソリューションの創出に繋がる可能性があり、競争力の源泉です。

一人一人の活力・熱意・没頭を高めることは生産性を向上させます。出社と在宅勤務、フルタイムと短時間勤務・フレックス勤務など、多様な働き方の選択肢を効果的に組み合わせ、従業員一人一人のラ

イフイベントや職務特性に対応した柔軟で効率的な働き方を実現することはそのための前提条件です。昨年度より導入しました「2週間連続休暇取得」の取り組みのように、柔軟な休暇取得ができる組織風土作りも進めていく必要があります。また、多様な視点・個性を持った一人一人が自分のキャリアにオーナーシップを持てるような、育成体系を整えることもエンゲージメントを高める上で重要と考えています。



土石川 雅一  
人事室室長

## ダイバーシティへの取り組み

様々な個性を持ち、個々の事情を抱えた社員それぞれが最大限能力を発揮できる職場環境の整備、職場風土の醸成を目指します。

女性活躍推進に向けて、女性従業員を対象としたメンター制度や、女性管理職が主体となって、施策の検討を実施する「ダイバーシティ推進会議」の開催、女性管理職候補層への集合研修等を実施しています。こうした取り組みを踏まえ、女性管理職比率については、昨年度7.4%から10.2%へと進展しています。

また、国際女性デーには、社外から講師を招き、経営層とのセッションを実施し、セッション内容を従業員がリアルタイムやオンデマンド配信で視聴することにより、DEI (Diversity, Equity & Inclusion) への理解を深めています。



ダイバーシティ推進会議



ダイバーシティ推進会議メンバー

## Best Place to Work の取り組み

### 従業員エンゲージメント調査

当社では2021年度までは「従業員満足度調査」を実施していましたが、2022年度より、従業員のエンゲージメントの状況を測定する「従業員エンゲージメント調査」を実施し、従業員一人一人の一層の成長、生産的な職場環境、心身の健康を実現し、持続的なエンゲージメントの向上を目指しています。

「従業員エンゲージメント調査」の結果をもとに、当社ならびに各本部の強みや課題を把握し、組織の一層の改善

を行い、また従業員一人一人の成長へと繋げていきます。

なお、2022年度実施の「従業員エンゲージメント調査」結果について、納得感や透明性を高め、従業員エンゲージメントを向上させるべく、全役職員向けの説明会を開催しました。

2021年度「従業員満足度調査」、2022年度「従業員エンゲージメント調査結果」を踏まえ、Best Place to Workの実現に向けた各種取り組みを実施しています。

## 2022

### 人事制度

- 一般職制度について、**月例給与と賞与のリバランス**を実施

### 休暇制度

- “誰もが休む必要のあるときに休める”職場を作ることを目指し、「**2週間連続休暇取得**」を推進
- 1年間で最大3日取得可能な**ボランティア休暇**の新設

### 在宅勤務制度

- コロナ禍後も「**全員**」が月8日ペースで在宅勤務を可能に（ライフステージに応じた在宅勤務日数の特認運営あり）

### 環境整備

- コミュニケーション活性化を目的に、課長補佐以下を対象にランチ会施策を実施
- レイアウト変更・ブースの設置等、オフィス環境の整備を実施

## 2023

### 人事制度

- 物価高や報酬調査等を踏まえた**報酬制度改革**を実施

### 休暇制度

- 2022年度に引き続き、「2週間連続休暇取得」を推進

### 在宅勤務制度

- 従業員からの声を踏まえ、育児に関する特認運営をより柔軟化（「未就学児」から「**小学4年生までの子**」に）

### 環境整備

- 2022年度に引き続き、コミュニケーション活性化やオフィス環境の整備を継続実施

## 「2週間連続休暇取得」の推進

当社では、サステナビリティ経営を推進する観点から、全従業員に対して連続2週間の休暇取得を推進しています。お互いに協力し合って“誰もが休む必要のあるときに休める”職場を作るために、働き方の変革と持続可能な組織体制の構築を目指しています。

### （導入の狙い）

- 全従業員による、連続休暇取得に向けた生産性・効率性向上に資する働き方の追求
- 所属長による、管下所属員の休暇を見据えた業務・組織マネジメント力の向上（業務の“見える化”の推進）
- 緊急時の業務継続を見据えたBCP対応や、従業員が長期不在となった場合にも柔軟に対応できる“レジリエント”（強靱）な所属作り

推進に向けた取り組みの一つとして、従業員の2週間連続休暇取得計画・事例を収集し、その中でも素晴らしい取り組みについては、経営層も参加したミーティングの中で紹介しました。

## 取組紹介

### 身近な場所で新たな発見 取組事例

長期休暇や週末等も使い、都内・近郊の散策や未踏の地だった東北地方へ旅行。行った先の神社仏閣も巡り、御朱印を集めた。お勧めは、その場で御朱印帳に墨書してくれる所。ある所では、御朱印帳の持ち主を見て、その人に相応しい言葉を個々に書き込んでくれた。必ずしも長期休暇で遠出をせずとも身近な場所で新たな発見・知見を得られる小旅行はいかが？



### 大自然の中で生命を間近に触れる 取組事例

都心から1,000キロ離れた太平洋に位置する絶海の孤島、小笠原に行ってきた。アクセスは週に1便のみ（夏は増便）で、滞在中に船が欠航した場合、1週間で帰れないため、2週間休暇ができたからこそ出会えた場所。滞在中は、イルカと一緒に泳いだり、生まれたばかりのウミガメの赤ちゃんを見たりした。



### 子供が主語で生きている 取組計画

小学5年生の娘が小学2年生の2月から通塾して中学受験に向けて勉強を頑張っている。4年間の成果をかけた中学受験に挑む娘のため休暇を取得し、入試直前期の復習の手伝いや入試会場への送り迎えなどを行いたい。



### ウミガメさん お久しぶり！ 取組計画

学生時代、ウミガメの研究をしており、指導教官とモルディブ共和国に滞在し、タイマイという絶滅危惧種のカメの調査を実施。休暇を利用して、指導教官やサポートをしてくれた人達と会い、自分が放流したタイマイを探して成長度合いを計測しに行きたい。



## 在宅勤務制度

出社勤務の良さ、在宅勤務の良さを上手く使い分けられるよう、ハイブリッドでの在宅勤務を実施しています。また、個別ライフステージに応じ、在宅勤務日数に制限を設けない形での柔軟な在宅勤務運営としています。

さらに、2023年度からは、従業員からの声を踏まえ、育児に関する特認運営を柔軟化（小学4年生までの子を養育する者）して実施しています。

育児については、在宅勤務のみならず、保育所利用に関する費用の補助等、会社として様々なサポートを実施しています。



### 社員間のコミュニケーション

本部の垣根を超えたコミュニケーション促進に向け、従業員が経営課題についてディスカッションを行う「オフサイトミーティング」や、従業員間でのランチ会、クリスマスの時期には全役職員とその家族が参加可能な「イヤーエンドパーティー」を実施しています。



### 経営層とのコミュニケーション

経営層と従業員の間では、年2回、経営課題ミーティングを開催し、従業員から直接経営層に対して質問・意見を届ける場を設けています。



### 家族とのコミュニケーション

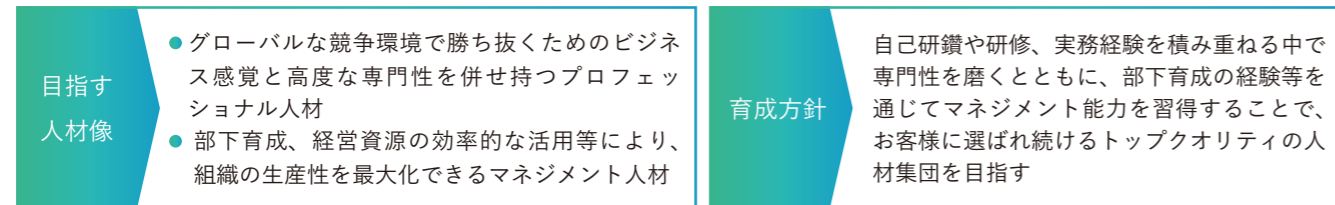
夏休みには親子で『Beyond SDGs 人生ゲーム』を体験できる社内イベントを開催しました！SDGsとは何か簡単にふれ、その後、ゲームの進め方の説明をして、前半25分（2030年までのSDGs）と後半25分（その先2050年までの脱炭素社会構築の目標）に分けて、進行しました。

# 人材育成への取り組み

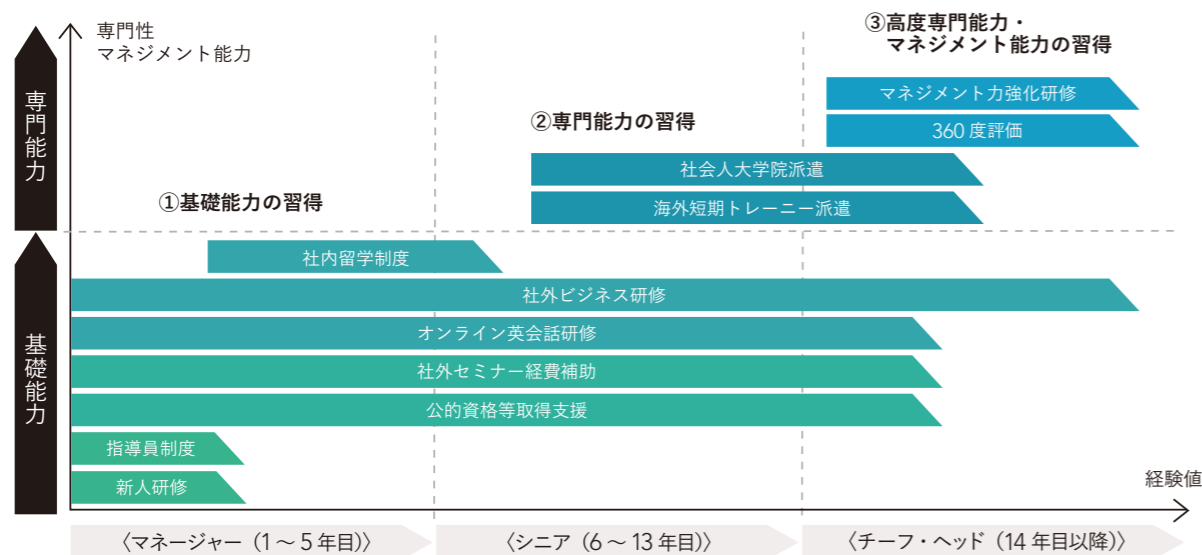
当社では、専門人材の育成に向けて、研修等様々な取り組みを実施しています。

お客様サービスの向上に継続的に取り組むために、日々の業務におけるOJTを中心として各分野におけるプロフェッショナルを育成しています。OJTに加えて、業務遂行に必須となる知識習得や専門強化のために証券アナリスト資格（2023年3月末時点で273名が保有）取得の奨励等、様々な育成支援制度を設け、高度な専門性を有する人材の育成・確保に取り組んでいます。

## 人材育成の全体像



## 人材育成のステップ（イメージ）



### 支援プログラム例

- 公的資格等取得支援（当社が定めた資格を取得した際に、報奨金を支給）
- 社外セミナー参加時の経費補助
- オンライン英会話研修
- 社外ビジネス研修（外部業者による研修をいつでも受講可能）
- 新卒社員向け導入研修、指導員向け研修
- 社内留学制度（自所属以外の業務を体験）
- 海外短期トレーニー派遣
- 社会人大学院派遣



### DX ブートキャンプ

デジタル・トランスフォーメーション（DX）は顧客サービス・体験の向上や生産性アップに不可欠と考え、DX推進を担うリーダー人材の育成、DXプロジェクトの発掘を目的に、「DX ブートキャンプ」と呼ぶプログラムを2021年度より新設しており、2022年度は20名が参加しました。

# 健康経営に向けた取り組み

当社はサステナビリティ経営推進に関するスローガンとして「A Good Investment for the Future」を掲げており、役職員の健康増進、働き方改革に向けたワークライフマネジメントの実践に取り組むとともに、「健康経営方針」に基づき、職場環境の改善、個々の能力発揮、健康の増進・保持に向けた施策を行っています。また、これら取り組みのもと、昨年度は「健康経営優良法人2023（大規模法人部門）」に認定されました。



## 健康経営方針

当社は、従業員を最も重要な資本と捉え、資産運用サービスにおいて、お客様に最高の付加価値をご提供するために、健康経営に取り組めます。

- 従業員一人一人が、心身ともに健康で、明るく、意欲に満ちあふれる職場環境を目指します。
- 多様な人材の意見を尊重し、個々の能力を最大限に発揮できるよう努めます。
- 従業員の健康を増進・保持できる取り組みを推進します。



## 役職員自身の健康増進取組について

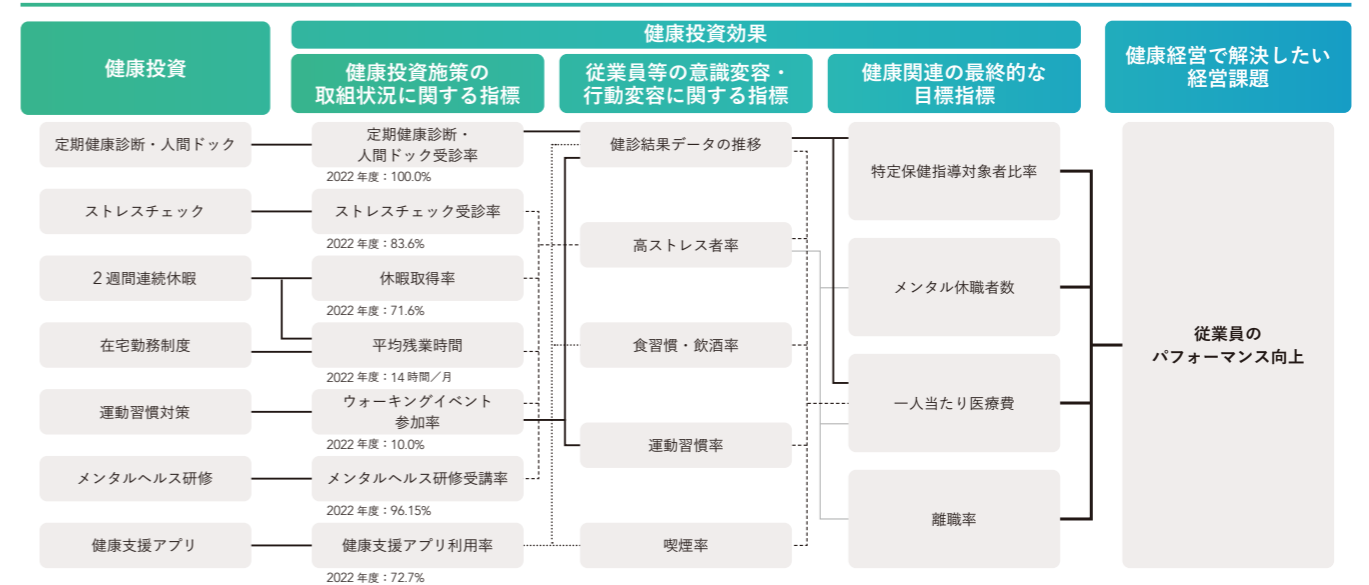
- 役職員向けのウォーキングイベントを開催  
コロナ禍でも参加可能な健康増進取組として、社内ウォーキングイベントを、2022年から定期的に開催。
- 社内サークル活動に奨励金補助  
新型コロナウイルス感染症の5類感染症移行を受けて、テニス同好会、ランニング同好会、スキューバダイビング同好会、大阪街歩き同好会など健康増進と社内コミュニケーション活性化を目指したサークル活動に奨励金補助。
- その他の健康増進取組  
メンタルヘルス研修の実施、食生活改善に向けての野菜摂取レベルの測定、健康支援アプリの利用促進、等

## 運用会社としての取り組みについて【ニッセイ「健康応援ファンド」の運用】

当社では2008年4月に設定したニッセイ「健康応援ファンド」を15年以上にわたって運用しています。健康への貢献に繋がる企業理念・哲学を持つ企業を「健康応援企業」として選定の上、厳選投資しています。健康関連産業は成長拡大が見込まれると判断してファンドの運用を開始しましたが、ESGの観点からも投資銘柄を厳選しています。

※私募投信は2007年10月より運用開始。

## 戦略マップ 健康投資施策の取組状況に関する指標（7項目）



# 責任投資原則（PRI）と「PRI in Person 2023」東京開催について

- PRIは、国連の提唱により2006年に策定された、環境・社会・ガバナンス（ESG）における諸課題を署名機関の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<sup>※</sup>です。<sup>※</sup>ニッセイアセットは2006年に同原則に署名
- 毎年、その年次カンファレンス「PRI in Person」が、世界の主要都市で開催されます。今年、「PRI in Person 2023」は、10月3～5日の予定で初めて東京開催となります。日本生命はリードスポンサー、ニッセイアセットはシルバースポンサーに選出されました。
- グループ一体で持続可能な社会の実現に向け、ESG投資の推進に貢献して参ります。

2022 バルセロナ大会の様様



ニッセイアセットはプロダクトスポンサーとしてバッグを提供



藤井共同 CIO が気候変動対応の課題と展望に関するセッションに登壇

過去の主な PRI in Person 年次カンファレンス開催実績

年	場所	参加者数	リードスポンサー
2017	ベルリン	約 1,000 名	DWS
2018	サンフランシスコ	約 1,200 名	MFS
2019	パリ	約 1,600 名	NATIXIS
2020	東京	(中止)	ニッセイアセット
2021	オンライン	6,000 名超 <sup>※</sup>	ニッセイアセット
2022	バルセロナ	約 2,300 名	Santander AM
2023	東京	—	日本生命

※登録者数

