

「アセットオーナー・プリンシプル」の受け入れ表明について

全国信用金庫厚生年金基金（以下、当基金という）は、アセットオーナー（資産保有者としての機関投資家）として、アセットオーナーの運用・ガバナンス・リスク管理に係る共通の原則であるアセットオーナー・プリンシプルの各原則に賛同し、受け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、年金たる給付および一時金たる給付に充てるべき積立金（以下、年金資産という）の運用にあたり、「年金資産運用の基本方針」を策定し、運用目標および政策資産配分を含む運用方針を定め、長期的な観点から安全かつ効率的に年金資産の運用を行います。また、運用目標等は、年金制度の状況や経済・金融環境の変化に適切に対応するため、資産運用委員会での審議を経て、理事会で承認されており、定期的に検証し見直しを行っています。

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、資産運用に関する知識と経験を有する運用執行理事や担当者を配置する等、必要な人材確保などの体制整備を継続的に行っています。また、外部コンサルティング会社を採用しているほか、資産運用委員会や理事会等を定期的で開催し、監督と執行それぞれが機能する適切なガバナンスの構築に努めています。

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、長期的な運用目標の実現のため、運用方針に基づき、投資対象資産や運用方法の多様化を進めるとともに、モニタリングと適切なリスク管理を行います。運用委託先の選定では、外部コンサルティング会社による評価情報等を参照しつつ最適な委託先の選定に努め、継続的なモニタリングの結果を踏まえた定期的な見直しを行います。

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、基金ホームページに年金資産の運用状況、運用目標や運用方針、財政状況等の情報を掲載するほか、加入者等の受益者に対し、基金広報誌を発行することで運用状況を開示し周知しています。

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、長期的な運用目標の実現を図るため、運用委託先に対し、投資先企業やその事業環境等に関する深い理解に基づく建設的な「目的を持った対話」(エンゲージメント)等の実施を促し、投資先企業の企業価値の向上やその持続的成長を促す責任(スチュワードシップ責任)を果たします。そのため、当基金は日本版スチュワードシップ・コードの受け入れ表明を行うと同時に、「企業年金スチュワードシップ推進協議会」における活動を通じ、当基金における効果的なスチュワードシップ活動の在り方について検討を継続していきます。

以 上