

年金基金による社会的責任の推進

年金基金のSRI・PRIに関する認識・取組状況について

平成21年1月29日

株式会社日本総合研究所

足達英一郎

SRI資産の国際比較

- SRI資産の国際比較で、日本は欧州の500分の1の規模に過ぎない。

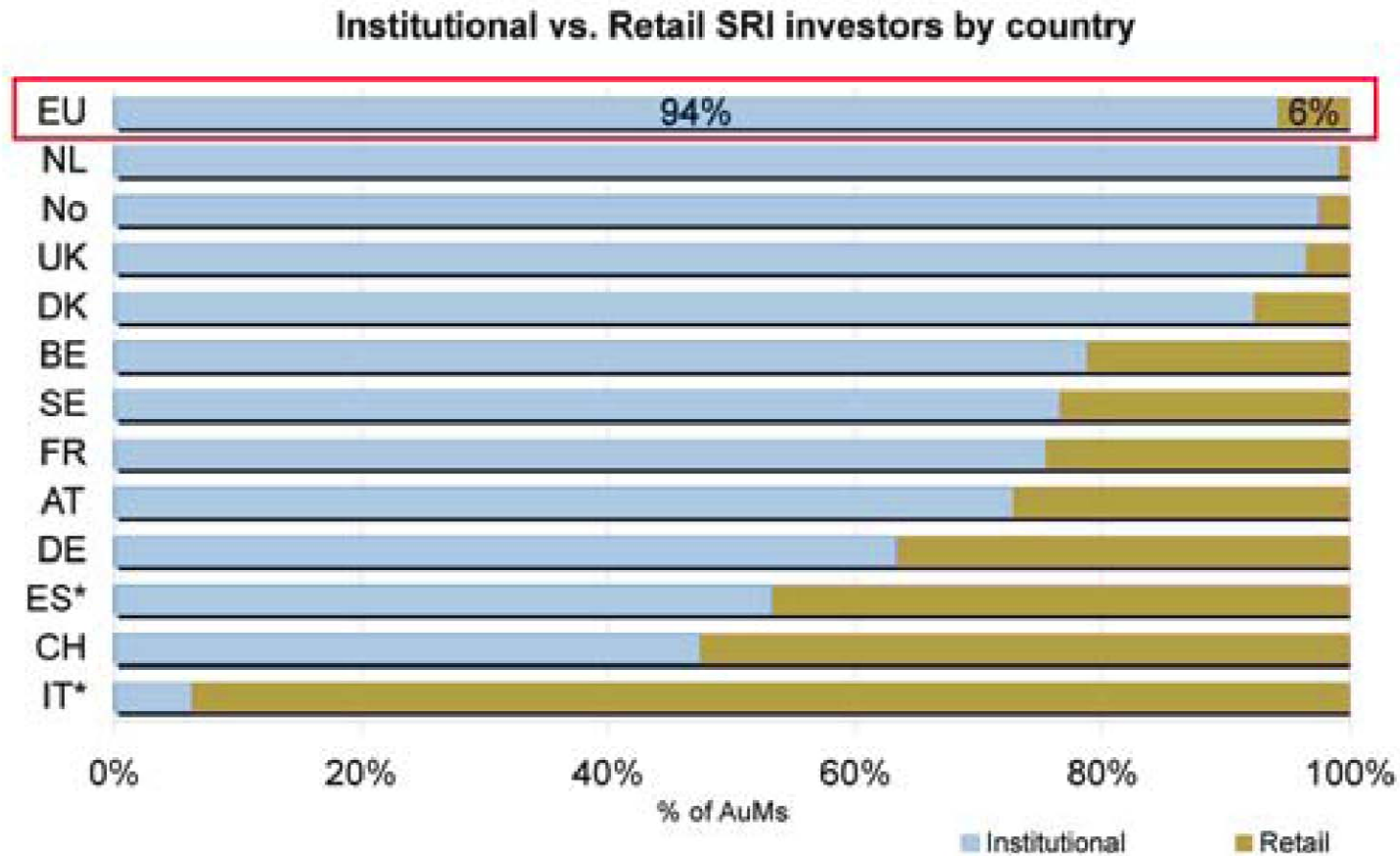
In Billions		2007	Total SRI	Total SRI in Euros
United States (2007)	Social Screening	US\$2098	US\$2710	€1917.3
	Shareholder Advocacy	US\$739		
	Screening and Shareholder*	(US\$151)		
	Community investing	US\$26		
Canada (2006)	Core SRI	Cnd\$57.4	Cnd\$503.6	€333.6
	Broad SR	Cnd\$446		
Australia / NZ (2007)	Core SRI	Au\$19.4	Au\$72.2	€41.4
	Broad SRI	Au\$52.8		
Japan (30/09/2007)		Y840	Y 840	€5.5
Europe (2007)	Core SRI	€511.7	€2665.4	€2665.4
	Broad SRI	€2153.7		
TOTAL WORLD				€4963.2

Source: Social Investment Forum, RIAA, SIO, Eurosif, SIF-Japan.

Note: Exchange rate as of 10/09/2008.

* negative number to avoid double-counting

欧州SRIの大半は機関投資家資産が占める

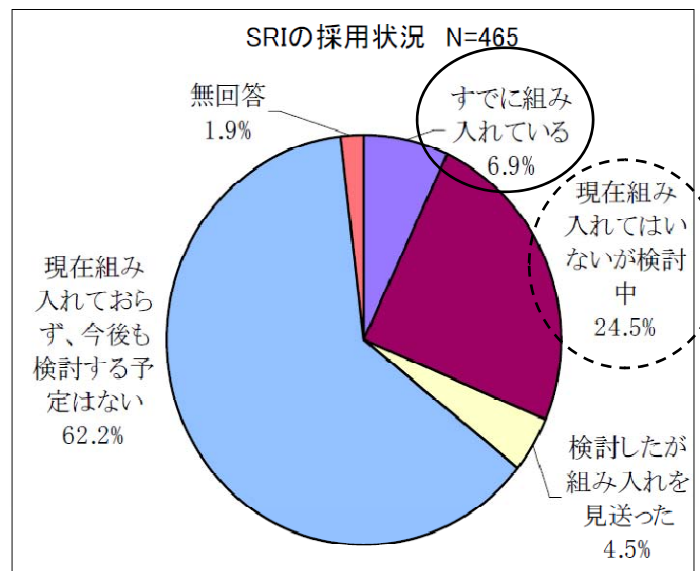
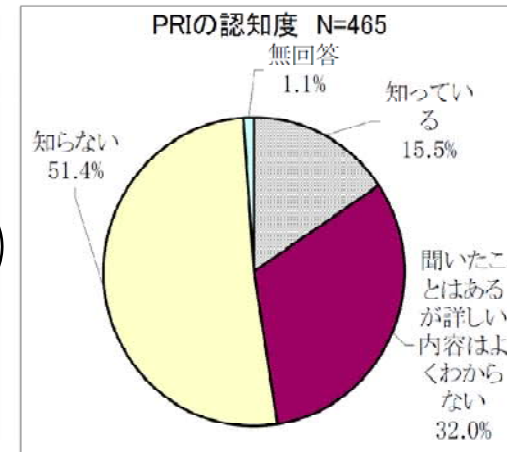
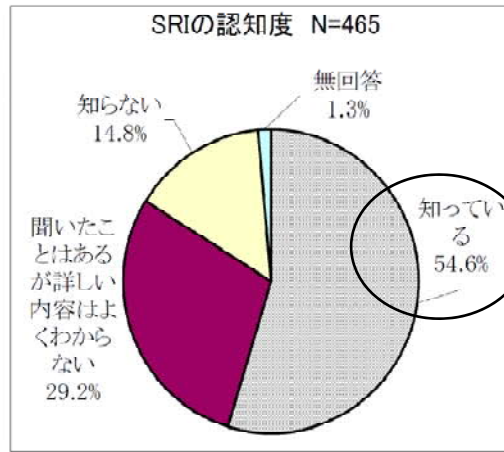
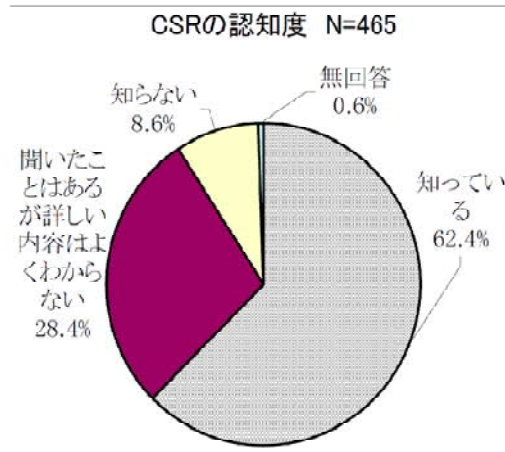


Source: Eurosif European SRI Survey, 2008
* based on Core SRI only.

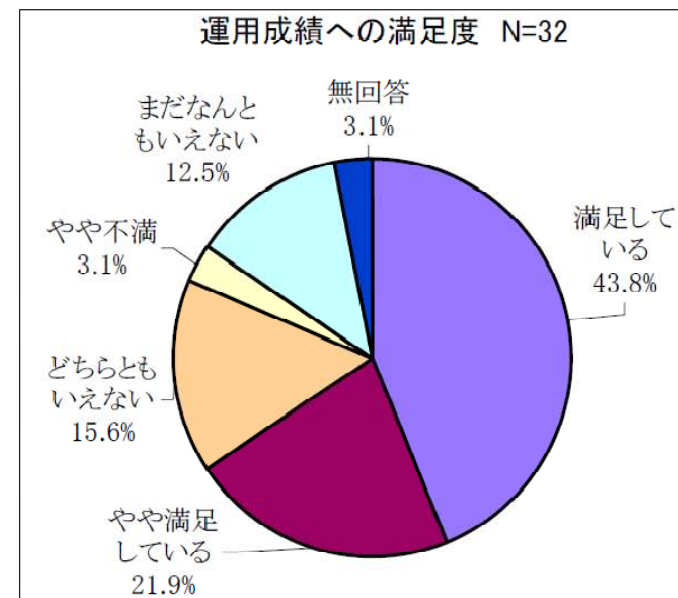
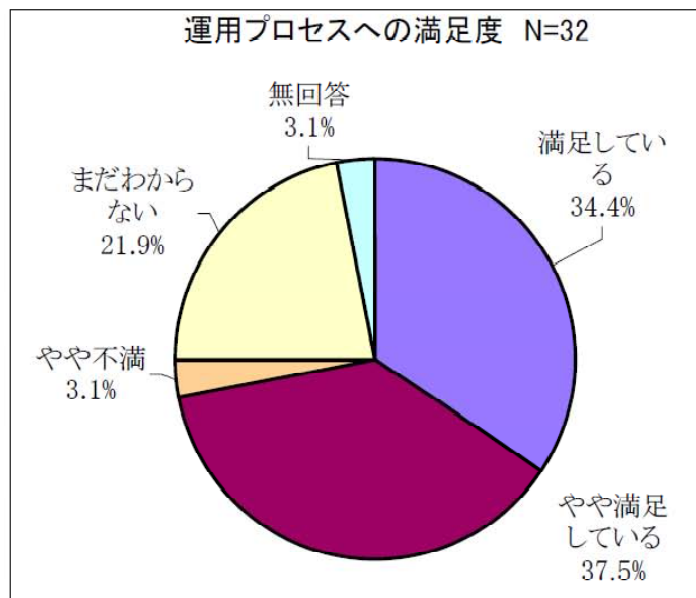
(財)年金シニアプラン総合研究機構の調査

調査目的	わが国の年金基金が SRI・PRI についてどのように考え、実践しているかを客観的に明らかにすること。
調査実施時期	調査票送付 2007年7月12日 回答締め切り 2007年8月24日
調査対象	厚生年金基金、確定給付企業年金基金型、確定給付企業年金規約型 税制適格退職年金、公的年金等
アンケート送付数	1432
回答数	465
有効回答率	<u>32.5%</u>
調査方法	配布は郵送、回収は郵送、FAX、電子メールによる 自記入アンケート方式

SRIの認知度は5割で、採用は7%に過ぎない

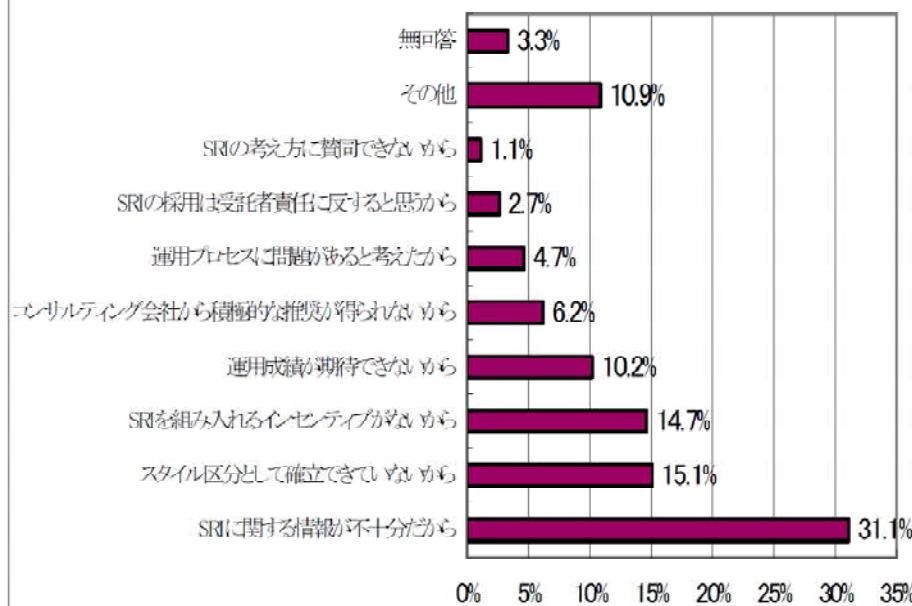


既に採用している基金の満足度は高い

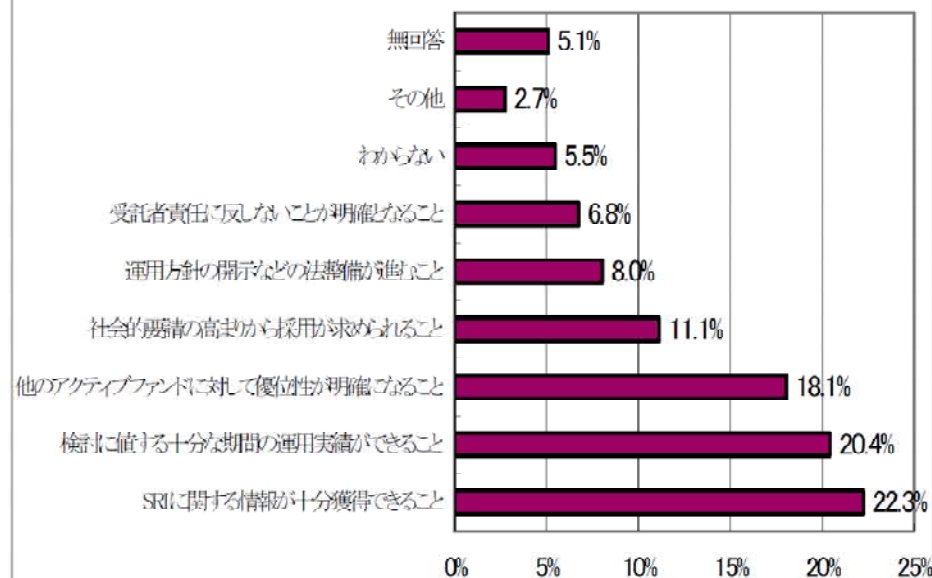


「情報がない」、「実績がない」がネガティブな理由

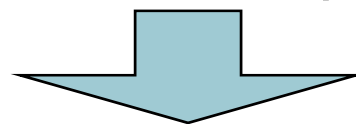
SRIを現在組み入れておらず、今後も検討する予定のない回答者(289)
がSRIの組み入れを検討しない理由 N=450(重複回答あり)



SRIを現在組み入れておらず、今後も検討する予定のない回答者(289)
がSRIの組み入れを検討するために必要な条件 N=548(重複回答あり)



政府への提言



SRIに関する情報普及

実績づくりのための公的年金等の率先取組の実現