



2020年8月31日

投資助言業務の開始に関するお知らせ

SOMPOリスクマネジメント株式会社(本社:東京都新宿区、代表取締役社長:桜井 淳一、以下「SOMPOリスク」)は、2020年10月1日から「投資助言業務」の営業を開始します。

1. 背景・目的

SOMPOリスクでは、従来よりリスクマネジメントの観点から企業のESG^(*)リスク分析や、CAT^(**)ボンドに関する自然災害リスク分析結果を提供してきました。企業のESGリスク分析では、アンケート等で収集した企業の環境経営への取り組み状況をスコアリングし、企業の非財務スコアとして提供してきました。CATボンド分析では、資産運用会社から指定された個々の銘柄について、自然災害リスク評価モデルを用いて期待損失やバリュアットリスクなどの自然災害リスク指標の分析結果を提供してきました。

今回、金融商品取引法に基づく投資助言の登録を行い、ESG投資およびCATボンド投資等に関するリスク評価のみならず、有価証券の価値や金融商品の価値等の分析を通じて、投資判断に関する助言に業務領域を拡大して、営業を開始します。

- *1 「Environment (環境)」「Social (社会)」「Governance (ガバナンス)」の英語の頭文字を合わせた言葉。一般的に環境・社会・ガバナンスに関する幅広い課題解決に向けた取り組みとして用いられる。
- *2 CAT (Catastrophe=大災害) ボンドは、予め定められた要件を満たす災害が期限内に発生しなければ投資家が元利金を受け取れる一方、条件を満たす災害が発生した場合は元利金の一部または全部が失われボンド発行者が資金を受取る仕組みの債券。

2. 投資助言業務の概要

- (1) 企業のESG評価と財務・株式価値との関係性の実証研究の成果を通じて、投資助言を行います。
- (2) 保険会社のグループ会社として世界各国の自然災害リスクに関する調査、研究、分析業務を担ってきた知見に基づいて、CATボンド個別銘柄に関する元本毀損確率や期待リターンを評価します。また、自然災害リスク評価モデルと数理的手法を組み合わせ、自然災害リスクの相関を考慮した最適地域分散を実現するボンドの選定を行い、お客様の運用方針に基づいて、投資リスクに対するリターンが最大となるCATボンドポートフォリオの構築支援の投資助言を行います。
- (3) 金融商品取引法の投資助言業務の登録内容
 - ①金融商品取引業者名: SOMPOリスクマネジメント株式会社
 - ②登録日: 2020年7月29日(営業開始日: 2020年10月1日)
 - ③登録番号: 関東財務局長(金商)第3205号

3. 今後の展開

SOMPOリスクは、これまで提供してきたリスクマネジメントやリスク定量評価の知見を活かし、新たな投資商品の提案や助言等にも取り組んでいきます。また、ESG投資や自然災害に関する債券投資等の投資助言を通じて、持続可能な社会の実現に貢献してまいります。

SOMPOリスクマネジメントについて

SOMPOリスクマネジメント株式会社は、損害保険ジャパン株式会社を中核とするSOMPOホールディングスのグループ会社です。「リスクマネジメント事業」「サイバーセキュリティ事業」を展開し、全社的リスクマネジメント（ERM）、事業継続（BCM・BCP）、サイバー攻撃対策などのソリューション・サービスを提供しています。

サービス内容に関するお問い合わせ先

SOMPOリスクマネジメント株式会社

リスクマネジメント事業本部

事業開発部 [担当：前田]

コーポレート・リスクコンサルティング部 [担当：村形、菊地]

〒160-0023 東京都新宿区西新宿 1-24-1 エステック情報ビル

TEL：03-3349-5469（直通）

アナリティクス本部 アナリティクス第2部 [担当：森、津守]

〒160-0023 東京都新宿区西新宿一丁目 26 番 1 号 損害保険ジャパン本社ビル

TEL：03-3349-9738（直通）

報道機関の方からのお問い合わせ先

SOMPOリスクマネジメント株式会社

総合企画部 [担当：野本]

〒160-0023 東京都新宿区西新宿 1-24-1 エステック情報ビル

TEL：03-3349-3500（直通）

以上