

2022年7月1日
住友生命保険相互会社

海外事業債運用のグループ投資顧問会社への運用委託の開始

住友生命保険相互会社（取締役 代表執行役社長 高田 幸徳、以下「住友生命」）は、本日、住友生命グループの海外投資顧問会社である Symetra Investment Management Company (Director & Chairman of the Board: Mark E. Hunt、以下「S I M」) への海外事業債の運用委託（以下「本委託」）^{※1}を開始しました。なお、本委託は4月に設立した住友生命グループの国内投資顧問会社であるスミセイ・アセット・マネジメント株式会社（代表取締役社長 宮原 広文、以下「S A M」）^{※2}を通じて行います。

※1 2021年10月18日付ニュースリリース「住友生命グループの資産運用態勢の高度化に向けた資産運用のグループ内委託の実施について」(<https://www.sumitomolife.co.jp/about/newsrelease/pdf/2021/211018.pdf>) 参照。

※2 2022年4月1日付ニュースリリース「海外事業債運用のグループ投資顧問会社への運用委託に伴う国内投資顧問子会社の設立」(<https://www.sumitomolife.co.jp/about/newsrelease/pdf/2022/220401a.pdf>) 参照。

1. 本委託実施の背景

低金利環境が継続する中、住友生命は「一定の信用リスクをとることにより収益向上が見込める資産」として海外事業債への投資を拡大させてきています。海外事業債は今後もさらに残高を拡大させる予定であり、その安定収益確保とパフォーマンス向上は、資産運用における重要な課題でした。

S I Mは、住友生命グループの米国生命保険会社であるシメトラ社の資産運用を担っており、同社 CEO 兼 CIO である Mark Hunt のもと、投資経験豊富なメンバーから構成され、運用実績は良好であり、特に市場悪化局面におけるダウンサイド抑制に強みがあります。

S I Mおよび住友生命の人財や知見等のリソースを有効活用し、グループ全体のシナジー効果を発揮することにより、住友生命の資産運用収益力向上を実現するため、本委託を決定しました。なお、S I Mに委託する資産規模は、現時点で3兆円程度です。

2. 本委託のスキーム

S I Mへの委託は、S A Mを通じて行います。2021年度より1年以上かけて、日米3社間のシステム連携の開発、リスク管理・モニタリング体制の構築等を行い、委託スキームを整えました^{※3}。

S I Mには、これまで住友生命で海外事業債運用に携わってきた職員を派遣しており、現地では両社の統合チーム(One Team)を作り、グループ全体の運用パフォーマンス向上・効率性向上を図っていくことを想定しています。

※3 S A Mは、5月31日付で金融商品取引法に基づく投資運用業の登録を行い、6月15日付で日本投資顧問業協会に加入しました。

<本委託のスキーム>



■SAMの概要

名 称	スミセイ・アセット・マネジメント株式会社
本社所在地	東京都中央区築地 7-18-24
代 表 者	代表取締役社長 宮原 広文
株 主	住友生命保険相互会社 100%出資

■SIMの概要

名 称	Symetra Investment Management Company
本社所在地	米国 コネチカット州 ファーミントン市 ファーミントン通り 308
代 表 者	Director & Chairman of the Board Mark E. Hunt
株 主	Symetra Financial Corporation (SFC ^{※4}) (100%出資) <small>※4 SFC は住友生命の 100%出資子会社。SFC は生命保険子会社を通じて、全米全 50 州およびワシントン DC で年金および生命保険商品を販売。</small>

以上