

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

プレスリリース

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス、主要な国・地域のベンチマークに基づくグローバル ESG 指数シリーズの算出を開始

ニューヨーク、2019年5月21日：世界有数の指数プロバイダーの1つである S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス（以下「S&P DJI」という）は本日、グローバル環境・社会・ガバナンス（ESG）指数ファミリーに最新の指数を追加したことを発表しました。新たな一連の指数は、ESG 指数に関する 20 年間にわたる先駆者的なイノベーションに基づいて開発されたものであり、いくつかのヘッドライン指数（S&P グローバル 1200 指数、S&P 欧州 350 指数、S&P/ASX 200 指数、及び S&P 日本 500 指数など）に沿ったパフォーマンス・プロファイルを提供します。

新たな指数には、S&P DJI の国別及び地域別中大型株ベンチマークの ESG バージョンも含まれており、南北アメリカ、欧州・中東・アフリカ（EMEA）、及びアジア太平洋（APAC）をカバーしています。これらのグローバル ESG 指数では、改良済みの ESG スコアや、企業の追加及び除外を決定するメソッドロジーの根拠となる詳細なデータを使用します

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスの最高経営責任者（CEO）である Alex Matturri は以下のように述べています。「当社は S&P 500 ESG 指数及び ESG スコアを 4 月に導入しており、これに続いて新たな ESG 指数シリーズの算出を開始できることを嬉しく思います。当社は ESG 要因に基づく幅広い商品を開発しており、これによりお客様に様々な洞察を提供しています。これらの新たな指数は、市場参加者にそれぞれの価値観に沿った投資ツールを提供するとともに、長年にわたり運用成果の指標となっている主要ベンチマークと同等のリターン・プロファイルを有しています。」

S&P DJI の ESG スコアは、指数構成銘柄の適格性を評価し、指数構成銘柄を選択する上での基礎となります。ESG スコアは、S&P DJI の指数ガバナンス・グループにより監視されており、SAM により算出されています。SAM とは、ESG データの作成に特化した RobecoSAM の一部門です。S&P DJI の ESG スコアは、広範囲に及ぶリサーチや投資目的の単独ツールとしても利用することができます。

これらのグローバル ESG 指数は、企業のビジネス活動、国連グローバル・コンパクト原則（UNGC）、及び ESG スコアに基づく適格性基準に従っています。これらの指数では、タバコを製造している企業や、タバコの販売及びタバコ関連の商品とサービスが売上高全体の 10%以上を占めている企業が除外されます。また、論争の的になっている兵器に直接関与している企業、またはこれらの兵器に関与している別の企業の持分を 25%以上保有している企業も除外されます。UNGC に準拠していない企業や、UNGC スコアが低い企業、さらに S&P DJI の ESG スコアが世界産業分類基準（GICS®）の各産業グループ内の世界の企業の中で下位 25%に入っている企業も指数には採用されません。このように、メソッドロジーでは様々な企業を除外することが規定されていますが、ESG 指数バージョンのリスク・リターン・プロファイルは各地域または国の親指数のリスク・リターン・プロファイルに非常に近いものとなっています。

S&P DJI の ESG 指数のグローバル・ヘッドである Reid Steadman は以下のように述べています。「当社では主要な地域及び国の ESG 指数ファミリーを設計する上で徹底したリサーチと厳密な分析を行っており、このことを非常に光榮に思っています。ESG は長年にわたり投資家の強い関心を集めており、ESG 要因を投資に統合する上で、市場参加者はますます高度になっています。当社は SAM と

プレスリリース

の協力を通じて優れた ESG スコアリング・メソドロジーを開発しており、このメソドロジーを指数に統合しています。」

今回算出を開始するグローバル ESG 指数シリーズは、以下の 22 の地域別及び国別 ESG 指数です：

- S&P/ASX 200 ESG 指数
- S&P 欧州 350 ESG 指数
- S&P 日本 500 ESG 指数
- S&P グローバル 1200 ESG 指数
- S&P 米国中大型株 ESG 指数
- S&P カナダ中大型株 ESG 指数
- S&P 韓国中大型株 ESG 指数
- S&P 北米中大型株 ESG 指数
- S&P 欧州先進國中大型株 ESG 指数
- S&P 中東及びアフリカ先進國中大型株 ESG 指数
- S&P アジア太平洋先進國中大型株 ESG 指数
- S&P 先進國中大型株 ESG 指数
- S&P 欧州新興國中大型株 ESG 指数
- S&P ラテンアメリカ新興國中大型株 ESG 指数
- S&P 中東及びアフリカ新興國中大型株 ESG 指数
- S&P アジア太平洋新興國中大型株 ESG 指数
- S&P 新興國中大型株 ESG 指数
- S&P グローバル中大型株 ESG 指数
- S&P アジア太平洋先進国（韓国を除く）ESG 指数
- S&P アジア太平洋新興国プラス中大型株 ESG 指数
- S&P 先進国総合指数（韓国を除く）中大型株 ESG 指数
- S&P 新興国プラス中大型株 ESG 指数

S&P DJI は 1999 年に初のサステナビリティ・ベンチマークであるダウ・ジョーンズ・サステナビリティ指数 (DJSI) の算出を開始して以降、20 年間にわたり ESG の指数化においてリーダー的存在となっています。S&P DJI は現在、2018 年に算出を開始したカーボン・エフィシエント指数など、幅広い ESG 指数ソリューションを提供しています。S&P DJI は 2019 年 4 月、S&P 500®に基づく S&P 500 ESG 指数の算出を開始しました。

ESG 指数のグローバル・ファミリーのメソドロジーに関する詳細については、www.spdji.com をご覧ください。

S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスについて

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、指数ベースのコンセプトやデータ、リサーチを提供する世界最大のグローバル・リソース企業であり、S&P 500®及びダウ・ジョーンズ工業株平均®といった金融市場の代表的指標を算出しています。当社の指数に基づく金融商品に投資される資産額は、世界の指数プロバイダーの中で最大規模となっています。チャールズ・ダウが1884年に初めて指数を発明して以降、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、広範なアセット・クラスをカバーする指数を開発しており、これにより投資家が市場を測定し、売買する方法を定義することが可能となっています。S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P グローバル (NYSE: SPGI) のグループ会社であり、個人や企業、政府が確信を持って意思決定を行う上で不可欠な情報を提供しています。詳しい情報については、www.spdji.com をご覧ください。

詳しい情報については、以下にお問い合わせください。

spdji.comms@spglobal.com