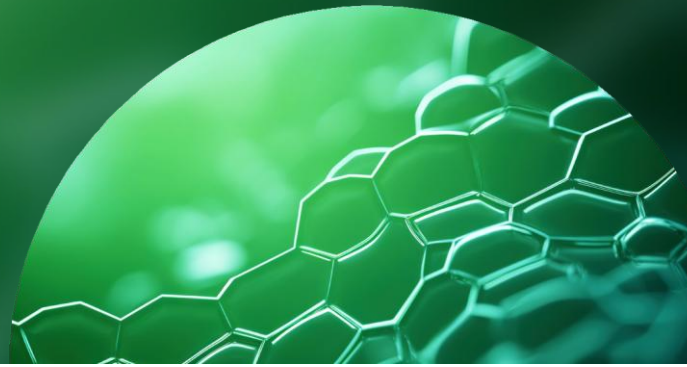


FTSE JPX Blossom Japan Index シリーズ

日本企業の ESG 対応を評価し投資戦略への
スチュワードシップ活動の統合を促進



概要

投資家は、ESG（環境、社会、ガバナンス）の考慮事項の投資のコア・アプローチへの統合を進め、高度な投資戦略が採用されるグローバルな投資戦略を進めています。日本のサステナブル投資市場もこの国際的な傾向に沿う形で ESG 基準をパッシブ運用のコア・ベンチマークに統合するニーズが高まっています。

FTSE JPX Blossom Japan Index シリーズは、FTSE Japan All Cap Index をユニバースとし、日本の株式市場への幅広いエクスポージャーを有しています。インデックスに応じてインダストリーまたはセクター・ニュートラルの手法が用いられ、ESG リスクの管理および対応度合によって構成銘柄がウェイト付けされています。

利点

FTSE JPX Blossom Japan Index シリーズ：

- 日本市場における ESG 統合を促進 - FTSE ESG スコアを使用して、ポートフォリオにおける ESG の成果の改善をサポートし、企業のサステナビリティのパフォーマンスと活動を促進。
- ICB インダストリーまたはセクター・ニュートラル・ウェイト・アプローチを適用 - インダストリー（産業別）またはセクター毎のウェイトを、親指数の FTSE Japan All Cap Index と一致させることにより、インダストリーまたはセクターによる偏重を最小化。
- 企業へのエンゲージメントを改善 - 日本市場における企業開示と透明性を拡大し、企業エンゲージメントと投資スチュワードシップを推進・改善。
- 低炭素経済移行のための気候変動をサポート - Transition Pathway Initiative（TPI）の経営品質スコア（Management Quality Score）を使って、企業による気候リスクと機会に対するマネジメントの質を考慮し、気候移行への取り組みをサポートしつつ、炭素集約度の高い企業を除外。

特徴

FTSE Russell の ESG スコアがベース FTSE Russell は、広範な銘柄ユニバースの ESG パフォーマンスを評価します。FTSE JPX Blossom Japan Index シリーズの選定対象となる FTSE Japan All Cap Index の構成銘柄である約 1300 社の日本企業がカバーされています。

マテリアリティ（重要課題）

企業が活動する業種、地域などの特性に合わせて重点項目を特定します。

国際基準

国連の持続可能な開発目標（SDGs）を含む、既存の国際基準と高い整合性を有しています。

進化する基準

企業行動、投資家のニーズ、ステークホルダーの関心に基づき、ESG 評価基準を定期的に見直します。

独立性

独立委員会による強固なガバナンス構造を有しています。

透明性

公開情報に基づく透明性の高いプロセスを堅持します。

コーポレート・エンゲージメント

企業との積極的な対話によって、企業のグローバルな ESG 経営の更なる向上を促します。¹

¹ 出典: Mackenzie et al (2012), University of Edinburgh; Slager, Catharina Henrike (2012), University of Nottingham

インデックスの構成プロセス

FTSE JPX Blossom Japan Index シリーズは、透明性の高い FTSE Russell の ESG スコアを使用して、ESG 関連リスクへのエクスポージャーおよび各企業の対応・管理状況を評価します。



2 詳細は FTSE JPX Blossom Japan Index 基本ルールおよび FTSE4Good Index シリーズ選定ルールに記載されています。
3 インデックス内の個別銘柄の最大ウェイトは、FTSE JPX Blossom Japan Index 全体の時価総額の 15%、または FTSE All Japan Cap Index 内のウェイトの 20 倍までに制限しています。

インデックス・メソドロジー

FTSE JPX Blossom Japan Index	FTSE JPX Blossom Japan Sector Relative Index
日本株約200銘柄	日本株約500銘柄
インダストリー・ニュートラル。親インデックスに対応したウェイト付けによってインダストリーの偏重を最小化	セクター・ニュートラル。親インデックスに対応したウェイト付けによってセクターの偏重を最小化
ESG スコア 3.3 以上の日本企業を選定	各セクター上位 50% で、 ESG スコア 2.0 以上の日本企業を選定
市場参加者や企業がスチュワードシップやエンゲージメント活動に活用できる明確な ESG 基準 (2017 年以降)	低炭素経済への移行をサポート。TPI 経営品質 (MQ) スコアを用いて各企業の気候ガバナンスと気候変動に関する取り組みを評価

インデックスの詳細については、ftserussell.com をご覧ください。

© 2023 London Stock Exchange Group plc およびその該当するグループ企業（以下「LSE グループ」）。無断複写・転載を禁じます。

LSE グループには、(1) FTSE International Limited（以下「FTSE」）、(2) Frank Russell Company（以下「Russell」）、(3) FTSE Global Debt Capital Markets Inc. および FTSE Global Debt Capital Markets Limited（以下、併せて「FTSE Canada」）、(4) FTSE Fixed Income Europe Limited（以下「FTSE FI Europe」）、(5) FTSE Fixed Income LLC（以下「FTSE FI」）、(6) The Yield Book Inc.（以下「YB」）、(7) Beyond Ratings S.A.S.（以下「BR」）が含まれます。

FTSE Russell® は、FTSE、Russell、FTSE Canada、FTSE FI、FTSE FI Europe、YB および BR の取引名です。「FTSE®」「Russell®」「FTSE Russell®」「FTSE4Good®」「ICB®」「The Yield Book®」、Beyond Ratings®、その他本資料で使用される商標およびサービスマーク（登録されているか否かは問わない）は LSE グループの該当メンバーまたはそのライセンサーが所有または許諾する商標およびサービスマークで、FTSE、Russell、FTSE Canada、FTSE FI、FTSE FI Europe、YB または BR によって保有または許諾に基づいて使用されているものです。

FTSE International Limited は、ベンチマーク管理者として Financial Conduct Authority から認可を受け、規制を受けています。

全ての情報は情報提供のみを目的として提供されています。本資料に記載されている全ての情報及びデータは、LSE グループが正確かつ信頼できると考える情報源から入手したものです。ただし、人的ミスや機械的エラー、その他の要因の可能性があるため、当該情報及びデータについては、如何なる種類の保証も行われず、すべて「現状有姿のまま」提供されています。LSE グループのメンバーまたはその取締役、役員、従業員、パートナー、ライセンサーのいずれも、情報や FTSE Russell の商品（インデックス、データとアナリティクスを含むがこれらに限定されない）の使用から得られる結果について、明示または黙示を問わず、正確性、適時性、完全性、商品性に関し、いかなる主張、予想、保証、表明も行わず、FTSE Russell 商品の特定の目的への適切性または適合性に関しても、明示または黙示を問わず、主張、予想、保証、表明を行いません。FTSE Russell の商品を通じてアクセス可能な過去のデータの表示は、情報提供のみを目的として提供されており、将来のパフォーマンスを示唆するものではありません。

LSE グループのメンバーまたはその取締役、役員、従業員、パートナー、ライセンサーは、以下の事項に関して一切の責任または義務を負いません: (a) 当該情報またはデータの調達、収集、コンパイル、解釈、分析、編集、転記、送付、通信もしくは提供に關するエラー（過失の有無を問わない）、その他の状況、または本資料または本資料へのリンクの使用に関連する損失又は損害（全部又は一部を問わない）および、

(b) (たとえ LSE グループのメンバーがかかる損害の可能性について事前に知らされていた場合であっても) 当該情報の使用または使用不能から生じるいかなる直接的、間接的、特別、派生的または付随的損害

LSE グループのメンバーまたはその役員、役員、従業員、パートナー、またはライセンサーのいずれも、投資アドバイスを提供しておらず、本資料のいかなる部分も、金融または投資アドバイスを構成するものとみなされるべきではありません。LSE グループのメンバー、その取締役、役員、従業員、パートナーまたはライセンサーは、いかなる資産への投資の是非、あるいはいかなる投資が投資家にとっていかなる法的リスクまたはコンプライアンス上のリスクを生じさせるか否かに関しても、いかなる表明も行いません。このような資産への投資を決定する際には、本資料に記載された情報に依拠すべきではありません。インデックスは、直接投資することではありません。インデックスへの資産の組み入れは、当該資産の売買や保有を推奨するものではなく、また、特定の投資家が当該資産や当該資産を含むインデックスを合法的に売買や保有することができると確認するものでもありません。本資料に掲載されている一般的な情報は、法律、税務、投資に関する専門的な助言を得ることなく使用されるべきではありません。

過去のパフォーマンスは将来の結果を保証するものではありません。チャートやグラフは説明目的のためだけに提示されています。提示されているインデックスのリターンは投資可能な資産における実際の取引の結果を表しているとは限りません。提示されている特定のリターンはバックテストされたパフォーマンスを反映している場合があります。インデックス算出開始日以前の全てのパフォーマンスはバックテストされたパフォーマンスです。バックテストされたパフォーマンスは実際のパフォーマンスではなく、仮説に基づいたものです。バックテストの計算は、インデックスの算出が正式に開始されたときに有効であったものと同じメソドロジーに基づいています。ただし、バックテストされたデータは、インデックスのメソドロジーの適用による後講評のメリットを反映している場合があります。インデックスの過去の計算は、インデックスの計算に使用される元の経済データの改訂に基づいて月によって変化する可能性があります。

本資料には将来予測に関する評価が含まれている場合があります。これらは将来の状況に関する多くの仮定に基づいており、最終的には不正確であることが判明する可能性があります。このような将来予測に関する評価は、リスクと不確実性の影響を受け、また、様々な要因の影響により、実際の結果と大きく異なる可能性があります。LSE グループのメンバーおよびそのライセンサーは、将来予測に関する評価を更新する義務を負わず、また更新することを約束するものではありません。

この情報のいかなる部分も、LSE グループの適切なメンバーの書面による事前の許可なしに、電子的、機械的、複写、記録、その他いかなる形式、手段によっても、複製、保存（検索システムによる保存）、または送付することを禁じます。LSE グループのデータの使用及び配布には、FTSE、Russell、FTSE Canada、FTSE FI、FTSE FI Europe、YB、BR 及び/またはそれぞれのライセンサーからのライセンスが必要です。

FTSE Russell について

FTSE Russell は、革新的なベンチマーク、分析、データ・ソリューションを世界中の投資家に提供するグローバル・インデックス・プロバイダーです。FTSE Russell は、70カ国以上の市場や資産クラスを測定・ベンチマークする数千のインデックスを算出し、世界の投資可能な市場の98%をカバーしています。FTSE Russell のインデックスに関する専門知識やプロダクトは、世界中の機関投資家や個人投資家によって幅広く利用されています。現在、約20兆1,000億ドルがFTSE Russell のインデックスをベンチマークとして参照しています。30年以上にわたり、一流のアセット・オーナー、資産運用会社、ETFプロバイダー、および投資銀行が、投資パフォーマンスを計測し、ETF、仕組商品、インデックス・ベースのデリバティブ商品を組成するためにFTSE Russell のインデックスを参考にしてきました。

FTSE Russell のインデックス設計と運用は、普遍的な原則を中核とした指針に基づいており、透明性の高いルールに基づいたメソドロジーは、主要な市場関係者で構成される独立した委員会から得られた知見に裏付けられています。FTSE Russell は、インデックス設計とガバナンスにおいて業界最高の水準の適用を掲げてIOSCO原理を採用しています。また、FTSE Russell は、インデックスのイノベーションとお客様とのパートナーシップに全力を注ぎ、提供するインデックスの拡大と向上を目指しています。

FTSE Russell は、ロンドン証券取引所グループの完全子会社です。詳細は www.ftserussell.com をご覧ください。

詳細については、lseg.com/ftse-russell をご覧ください。ご質問につきましては、info@ftserussell.com に電子メールをお送りいただくか、各地域のクライアント・サービス・チームのオフィスにお電話でお問い合わせください。

欧州・中東・アフリカ +44 (0) 20 7866 1810

アジア太平洋

北米 +1 877 503 6437

香港 +852 2164 3333

東京 +81 (3) 6441 1430

シドニー +61 (0) 2 7228 5659