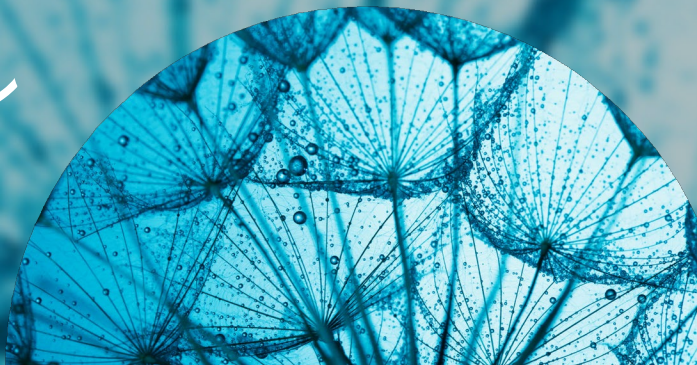


ESGスコアとデータモデル

ESGを投資に組み込む



概要

投資家は、環境・社会・ガバナンス(ESG)への考慮をコアなベンチマークやパッシブ投資にますます組み込んでいます。FTSE Russellは、約20年にわたるESGの経験を活かし、世界数千の企業をカバーした、ESGスコア、インデックス、データ分析を提供しています。

FTSE RussellのESGスコアとデータモデルは、柔軟性のあるデータドリブンな、次のようなソリューションを必要とする投資家向けのツールです:

- ESG側面へのエクスポージャー管理の支援
- スチュワードシップの義務化への対応
- ESGデータを株式や債券・ポートフォリオ分析に統合
- ESGを意識した投資戦略の実施

透明性のある客観的なESGスコア



特徴

包括的

スコアはオンラインデータモデルを通じてアクセスでき、FTSE All-World Index、FTSE All-Share Index、Russell 1000® Indexの構成銘柄で構成される47の先進国および新興市場の約8,000銘柄が含まれます。

柔軟性とカスタマイズ

データモデルを介して複数のレベルでESGデータを簡単に抽出し、さまざまな方法で評価および適用できます。

マテリアリティを強調

エクスポージャーの指標を別途設定することで、ユーザーは特定の企業にとって最も関連性のあるESG課題を特定することができます。

国連の持続可能な開発目標 (SDGs) と整合

国連の持続可能な開発目標(SDGs)との整合性をサポートします。SDGsの17項目全てがESGフレームワークの14テーマに反映されています。

明確なルールとデータフォーカス

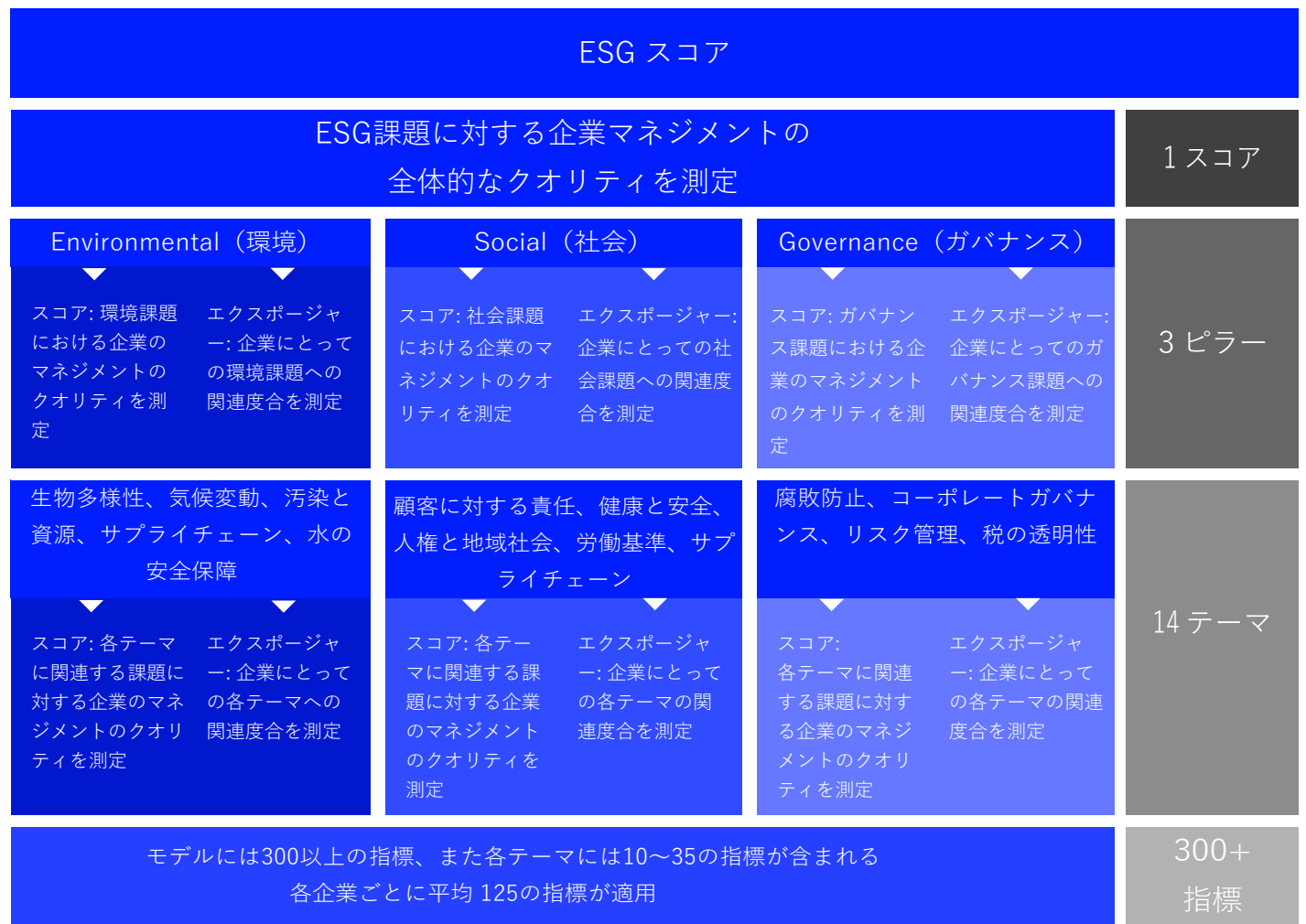
企業の評価と採点のための非常に明確に定義されたルールを持つことにより、主観性を最小限に抑えます。ESGスコアは開示資料をベースにしています。

強力なガバナンス

投資コミュニティ、ビジネス、NGO、労働組合、学界の専門家で構成される独立した外部委員会が監督しています。

ESG スコア: データストラクチャー

ESGスコアとデータモデルは、投資家が、企業のESG課題に対するエクスポージャーとマネジメントを多面的に理解するのに役立ちます。ESGスコアは、総合スコア、その基礎となる（3つの）ピラー、及びそれを構成するテーマ別のエクスポージャーとスコアに分類されます。ピラーとテーマは、各企業の固有の状況によって適用される300以上の個別の指標評価に基づいています。



ESGスコアの実践における活用

ESGスコアは、アクティブ・ポートフォリオ管理、ベンチマークの構築、企業エンゲージメントなど、さまざまな方法でESGを投資に統合するための構成要素として使用できます。

ポートフォリオ評価とマネージャーのデューデリジェンス

資産運用会社を選定・評価する際、機関投資家はESGの側面を自社のプロセスにどのように組み込んでいるかを評価する傾向が強まっています。ESGスコアは、ESGインテグレーションに関する資産運用会社ポートフォリオの範囲、平均、分散を評価するのに役立ちます。

リスクマネジメント

ESGスコアは、投資家がESGエクスポージャーが最も大きい企業を特定することを可能にし、従来のリスク指標と併用することで補完的な視点を提供することができます。

カスタムベンチマーク

多くの投資家は、ESG嗜好を反映したカスタマイズされたベンチマークを求めています。ESGスコアは、オーダーメイドのインデックスを作成するための包括的で柔軟なツールを提供し、ファンダメンタルまたはスマートベータの方法論と併用することもできます。

エンゲージメントとスチュワードシップ

スチュワードシップ責任の一環として、投資先企業にESGの実践についてエンゲージするファンドマネージャーや年金基金が増えています。ESGスコアは、エンゲージメントの対象となる企業を特定し、進捗状況を追跡するための独立した客観的な尺度を提供します。

リサーチと分析

ESGの側面によって、リスクとリターンとの関係は異なります。ESGスコアは、調査と分析のためのきめ細かく包括的なデータセットを提供し、ユーザーがESGデータをどのように統合するか、または統合しないかについて独自の見解を持てるようにします。

アクティブ・ポートフォリオ・マネジメント

ESGスコアは、投資ユニバースのESG適格基準を定義するために使用したり、適切なクオンツモデルやファンダメンタルズモデルに適用したりできます。

About FTSE Russell

FTSE Russell is a leading global provider of index and benchmark solutions, spanning diverse asset classes and investment objectives. As a trusted investment partner we help investors make better-informed investment decisions, manage risk, and seize opportunities.

Market participants look to us for our expertise in developing and managing global index solutions across asset classes. Asset owners, asset managers, ETF providers and investment banks choose FTSE Russell solutions to benchmark their investment performance and create investment funds, ETFs, structured products, and index-based derivatives. Our clients use our solutions for asset allocation, investment strategy analysis and risk management, and value us for our robust governance process and operational integrity.

For over 35 years we have been at the forefront of driving change for the investor, always innovating to shape the next generation of benchmarks and investment solutions that open up new opportunities for the global investment community.

To learn more, visit lseg.com/ftse-russell; email info@ftserussell.com; or call your regional Client Service team office:

EMEA +44 (0) 20 7866 1810	Asia-Pacific
North America +1 877 503 6437	Hong Kong +852 2164 3333
	Tokyo +81 (3) 6441 1430
	Sydney +61 (0)2 7228 5659

Disclaimer

© 2025 London Stock Exchange Group plc and its applicable group undertakings ("LSEG"). LSEG includes (1) FTSE International Limited ("FTSE"), (2) Frank Russell Company ("Russell"), (3) FTSE Global Debt Capital Markets Inc. "FTSE Canada", (4) FTSE Fixed Income LLC ("FTSE FI"), (5) FTSE (Beijing) Consulting Limited ("WOFE"). All rights reserved.

FTSE Russell® is a trading name of FTSE, Russell, FTSE Canada, FTSE FI, WOFE, and other LSEG entities providing LSEG Benchmark and Index services. "FTSE®", "Russell®", "FTSE Russell®", "FTSE4Good®", "ICB®", "Refinitiv", "Beyond Ratings®", "WMR™", "FR™" and all other trademarks and service marks used herein (whether registered or unregistered) are trademarks and/or service marks owned or licensed by the applicable member of LSEG or their respective licensors.

FTSE International Limited is authorised and regulated by the Financial Conduct Authority as a benchmark administrator.

All information is provided for information purposes only. All information and data contained in this publication is obtained by LSEG, from sources believed by it to be accurate and reliable. Because of the possibility of human and mechanical inaccuracy as well as other factors, however, such information and data is provided "as is" without warranty of any kind. No member of LSEG nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors make any claim, prediction, warranty or representation whatsoever, expressly or impliedly, either as to the accuracy, timeliness, completeness, merchantability of any information or LSEG Products, or of results to be obtained from the use of LSEG products, including but not limited to indices, rates, data and analytics, or the fitness or suitability of the LSEG products for any particular purpose to which they might be put. The user of the information assumes the entire risk of any use it may make or permit to be made of the information.

No responsibility or liability can be accepted by any member of LSEG nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors for (a) any loss or damage in whole or in part caused by, resulting from, or relating to any inaccuracy (negligent or otherwise) or other circumstance involved in procuring, collecting, compiling, interpreting, analysing, editing, transcribing, transmitting, communicating or delivering any such information or data or from use of this document or links to this document or (b) any direct, indirect, special, consequential or incidental damages whatsoever, even if any member of LSEG is advised in advance of the possibility of such damages, resulting from the use of, or inability to use, such information.

No member of LSEG nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors provide investment advice and nothing in this document should be taken as constituting financial or investment advice. No member of LSEG nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors make any representation regarding the advisability of investing in any asset or whether such investment creates any legal or compliance risks for the investor. A decision to invest in any such asset should not be made in reliance on any information herein. Indices and rates cannot be invested in directly. Inclusion of an asset in an index or rate is not a recommendation to buy, sell or hold that asset nor confirmation that any particular investor may lawfully buy, sell or hold the asset or an index or rate containing the asset. The general information contained in this publication should not be acted upon without obtaining specific legal, tax, and investment advice from a licensed professional.

Past performance is no guarantee of future results. Charts and graphs are provided for illustrative purposes only. Index and/or rate returns shown may not represent the results of the actual trading of investable assets. Certain returns shown may reflect back-tested performance. All performance presented prior to the index or rate inception date is back-tested performance. Back-tested performance is not actual performance, but is hypothetical. The back-test calculations are based on the same methodology that was in effect when the index or rate was officially launched. However, back-tested data may reflect the application of the index or rate methodology with the benefit of hindsight, and the historic calculations of an index or rate may change from month to month based on revisions to the underlying economic data used in the calculation of the index or rate.

This document may contain forward-looking assessments. These are based upon a number of assumptions concerning future conditions that ultimately may prove to be inaccurate. Such forward-looking assessments are subject to risks and uncertainties and may be affected by various factors that may cause actual results to differ materially. No member of LSEG nor their licensors assume FTSE Russell 6 CORPORATE any duty to and do not undertake to update forward-looking assessments.

No part of this information may be reproduced, stored in a retrieval system or transmitted in any form or by any means, electronic, mechanical, photocopying, recording or otherwise, without prior written permission of the applicable member of LSEG. Use and distribution of LSEG data requires a licence from LSEG and/or its licensors.