

FTSE Russell が中国と日本でサステナブル投資の分析対象を拡大

- 気候変動リスク、スクリーニング、ESG レーティングなどを含むサステナブル投資の分析対象に約 800 銘柄の中国 A 株式を追加
- 小型株のカバレッジ拡大により日本株のサステナブル投資分析対象が約 1,300 銘柄に
- アジア太平洋地域では 4,300 以上の銘柄がサステナブル投資分析の対象に

インデックスおよびデータの世界的なプロバイダーである FTSE Russell は本日、アジア太平洋地域でのサステナブル投資分析対象を更に拡大することを発表しました。FTSE Russell の ESG レーティングとデータモデルにおける中国 A 株のカバレッジを拡大し、今回約 800 の銘柄が追加されました。これにより中国株式（※1）のカバレッジは約 1,800 銘柄となります。またレーティング対象となる小型株の拡大により、日本株のサステナブル投資分析対象は約 1,300 銘柄となります。アジア太平洋地域全体では、4,300 以上の銘柄（※2）が FTSE Russell の気候変動リスク、スクリーニング、ESG レーティングを含むサステナブル投資の詳細な分析対象となっています。全世界でのサステナブル投資分析カバレッジは現在総計 7,200 銘柄に及び、投資家によるスチュワードシップやグローバルなアクティブ戦略およびパッシブ戦略への ESG 統合を可能にします。

FTSE Russell サステナブル投資のデータモデルは多様なアプローチに対応する幅広い基準を提供し、気候変動リスクの考慮、ESG レーティングの提供、国連の持続可能な開発目標（SDGs）に沿った投資のサポートなどに利用できます。

中国 A 株は世界第 2 位の中国経済の成長原動力であり、金融サービスプロバイダーからテクノロジーイノベーターまで様々な株式をカバーしています。近年の中国による政策見直しやオペレーション課題の進展も市場参加者に歓迎されています。2018 年の FTSE Global Equity 国分類レビューの一部として発表されているように、中国 A 株は 2019 年 6 月よりセカンダリー新興国市場として FTSE Global Equity インデックス・シリーズ（FTSE GEIS）に段階的に組み込まれており、2020 年 3 月にフェーズ 1 の組み入れが完了します（※3）。



日本は引き続きロンドン証券取引所グループにとって重要な市場であり、FTSE Russell は、サステナブル投資の資産運用への取り込みという日本の投資家からの高まる需要に対応した多くの提案を行ってきました。それには FTSE Russell の革新的な ESG レーティングデータモデルを活用した FTSE Blossom Japan Index も含まれています。当インデックスは主力ファンドに適用される中核的 ESG ベンチマークとして、日本の年金積立金管理運用独立行政法人（GPIF）に選定されています。

ロンドン証券取引所グループ アジア太平洋地域・情報サービス部門ヘッドで、マネージングディレクターであるジェシー・パク氏のコメント：

『中国および日本でのカバレッジ拡大は、アジア太平洋地域における FTSE Russell の継続的コミットメントの印であり、たいへん喜ばしく思っております。世界の市場参加者はサステナブル投資のアプローチを投資哲学やアクティブ戦略およびパッシブ戦略に取り込むことを益々検討しています。FTSE Russell の詳細で体系だてられた透明性ある ESG レーティングとデータモデルは、市場参加者や企業が ESG スチュワードシップやエンゲージメントの取組みに活用するにあたって明確な基準を提示するものです。』

今年に入って FTSE Russell は、オーストラリア小型株銘柄を FTSE Russell の ESG 分析対象に追加することも既に発表しており、それにより約 280 銘柄のオーストラリア株式をカバーしています。

FTSE Russell の ESG レーティングは、基礎となるピラー（柱）、テーマエクスポージャー、スコアから構成される総体的なレーティングで構成されています。ピラーとテーマには各企業の特性に適用する 300 を超す個別の評価項目が設定されています。調査対象企業は 0 から 5 を範囲とする ESG レーティングを付与され、最高レーティングが 5 となります。FTSE Russell の ESG レーティングは国連の持続可能な開発目標（SDGs）と整合的であり、SDGs による 17 目標の全てが ESG フレームワーク内の 14 テーマに反映されています。

詳細は FTSE Russell のオンライン [ESG Ratings data page](#) でご覧頂けます。

（※1）中国株は A 株、B 株、H 株に区分される人民元建て株式であるが、それぞれ上場されている国、取引通貨が異なる。中華人民共和国外で設立、上場される銘柄は通常「レッドチップ」、「P チップ」、「S チップ」、「N 株式」と呼ばれる。

（※2）銘柄は全て株式銘柄を指す。

（※3）中国 A 株のフェーズ 1 組み入れでは、各銘柄浮動株全体の 25% が 3 回のトランシェに分けて追加される。

- 以上 -

詳細お問合せ先:

メディア担当コンタクト

ルーシー・ホロウェイ (Lucie Holloway) /ナンディーブ・ループレイ (Nandeeep Roopray)	電話番号 +44 (0)20 7797 1222 電子メール newsroom@lseg.com
ソフィー・モウ (Sophie Mou) ティナ・ワング (Tina Wang)	電話番号 +852 2164 3267 電話番号 +886 2 8979 4868

エディター向け注記 :

FTSE Russell について:

FTSE Russell は革新的なベンチマーク、アナリティクス、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リーダーです。FTSE Russell は何千ものインデックスを算出し、70 カ国以上の市場や資産クラスを測定、ベンチマーク化し、そのカバー率は世界の投資市場の 98%に及んでいます。

FTSE Russellのインデックスの専門知識とプロダクトは、世界中の機関投資家や個人投資家によって幅広く使用されています。現在、約15兆ドルの資産がFTSE Russellのインデックスをベンチマークとして利用しています。30年以上にわたり、主要な資産保有者、資産運用会社、ETFプロバイダー、投資銀行などが、投資パフォーマンスのベンチマークとし、投資ファンド、ETF、ストラクチャード商品、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のインデックスを選択しています。

一連の中核となる普遍的原理が、FTSE Russellインデックスの設計と管理の指針となっています。透明性が高くルールに基づいた手法は、主要市場参加者で構成される独立委員会から得られた情報が裏付けとなっています。FTSE Russellは、業界最高レベルの基準をインデックス組成やガバナンスに適用することにフォーカスし、IOSCOの原則を取り入れています。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注力し、提供物の幅、深さや到達度を強化しています。

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 ftserussell.com をご覧ください。

© 2019 London Stock Exchange Group plc および関連グループ事業体 (「LSE グループ」)。LSE グループには、(1) FTSE International Limited (「FTSE」)、(2) Frank Russell Company (「Russell」)、(3) FTSE Global Debt Capital Markets Inc. および FTSE Global Debt Capital Markets Limited (総称して「FTSE Canada」)、(4) MTSNext Limited (「MTSNext」)、(5) Mergent, Inc. (「Mergent」)、(6) FTSE Fixed Income LLC (「FTSE FI」) ならびに(7) The Yield Book Inc (「YB」) が含まれます。無断複写・転載を禁じます。

FTSE Russell®は、FTSE、Russell、FTSE Canada、MTS Next Limited、Mergent、FTSE FI および YB の商号です。「FTSE®」、「Russell®」、「FTSE Russell®」、「MTS®」、「FTSE4Good®」、「ICB®」、「Mergent®」、「The Yield Book®」ならびに本文書で使用するその他すべての商標およびサービスマーク (登録の有無を問いません) は、LSE グループの関連メンバーまたはそれぞれのライセンサーが所有またはライセンスを許諾する商標および/またはサービスマークであり、FTSE、Russell、MTSNext、FTSE Canada、Mergent、FTSE FI または YB が所有またはライセンスの下で使用しています。FTSE International Limited は、ベンチマーク管理者として、金融行動監視機構の認可を受け、その規制下にあります。

