

FTSE Blossom Japan Index で小型株組み 入れ可能に

- 2020年12月に行われる半年ごとの定期的見直しによって、FTSE Blossom Japan Index に小型株が初めて追加されます。
- 小型株の組み入れに関するマーケット・コンサルテーションを踏まえ、ベンチマークを FTSE Japan All Cap Index に切り替えます。
- FTSE Russell はこれに先立ち、日本株を対象とした ESG Ratings のカバレッジを、小型株を含む 1,300 銘柄へと広げています。

インデックス、データおよびアナリティクスの世界的なプロバイダーである FTSE Russell は 2020 年 12 月から、日本株の主要 ESG インデックスである FTSE Blossom Japan Index に小型株を追加します。FTSE Blossom Japan Index の構成銘柄は、環境・社会・ガバナンス（ESG）について一定の基準を満たさなければなりません。

今回の決定は、マーケット・コンサルテーションの結果を踏まえたものです。小型株の組み入れについて投資家からのご賛同をいただき、日本における ESG カバレッジに対する需要の高まりが浮き彫りになりました。

こうした変更の実施にあたり、2020年12月の定期見直しから、FTSE Blossom Japan Index の親インデックスについて FTSE Japan Index から FTSE Japan All Cap Index に切り替えます。FTSE Blossom Japan Index の採用基準を満たすと見込まれるのは、FTSE Japan All Cap Index 構成銘柄のおよそ 15%です。ただし、投資可能時価総額に基づくと、FTSE Blossom Japan Index の構成銘柄は FTSE Japan All Cap Index の 55%を占めます。



2017年に導入された FTSE Blossom Japan Index は、FTSE Russell の ESG Ratings データモデルを使って構築されています。このモデルは、国連の持続可能な開発目標（SDGs）を含む既存の数々の国際的な ESG 基準に依拠しています。FTSE Blossom Japan Index の採用基準は、グローバルに確立された FTSE4Good Index Series に沿うものです。日本を含む先進国株式の場合、インデックス組み入れには、ESG Ratings のスコア（5 が最高）で 3.3 以上が必要になります。FTSE Blossom Japan Index に連動するパッシブ運用資産の総額は、2020 年 3 月 31 日時点で約 9,400 億円に上りました。

FTSE Russell は、7,200 銘柄を超える上場企業の ESG Ratings をはじめ、広範な資産にわたるサステナブル投資インデックスおよびデータを提供しており、FTSE Blossom Japan Index もその一部です。

ロンドン証券取引所グループ情報サービス部門の日本代表である多湖理は、以下のように述べています。

「FTSE Blossom Japan Index は日本企業に対し、ESG の実践と情報開示をより良いものにすることで採用基準の達成を目指す強い動機を提供しています。マーケット・コンサルテーションを通じ、日本の小型株を組み入れられることが投資家から支持を得ました。既に採用基準を満たす小型株企業が存在するのはもちろん、まだ採用基準を満たしていない企業に対して強い動機を提供するという意味もあります。小型株に分類される企業の多くは、日本株式市場で重要な部分を占めています。こうした理由から弊社では最近、日本企業での ESG Ratings のカバレッジをダイナミックかつ成長中の小型株まで拡大し、対象企業は約 1,300 銘柄となりました。」

FTSE Russell サステナブル投資部門アジア太平洋地域責任者の Helena Fung は、以下のように述べています。

「日本の投資家は、アジア太平洋地域におけるサステナブル投資の先頭に立つことが珍しくありません。FTSE Russell がアジア太平洋地域で旗艦とする ESG 株式インデックスに小型株を追加するという決断は、サイズにかかわらず、環境・社会・ガバナンスの面でパフォーマンスが良好な企業を求める投資家の需要を反映しています。」

- 以上 -



Press Release

FTSE
Russell

詳細お問合せ先:

メディア担当コンタクト

Oliver Mann/ Lucie Holloway

電話番号 +44 (0)20 7797 1222

電子メール newsroom@lseg.com

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 16 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。

© 2020 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 TMX Global Debt Capital Markets Inc および FTSE TMX Global Debt Capital Markets Limited (合わせて「FTSE Canada」と表示します)、(4) MTSNext Limited (「MTSNext」)、(5) Mergent, Inc. (「Mergent」)、(6) FTSE Fixed Income LLC (「FTSE FI」)、(7) The Yield Book Inc. (「YB」)、(8) Beyond Ratings S.A.S. (「BR」) が含まれます。無断複写・転載を禁じます。

FTSE Russell®は FTSE Russell、FTSE Canada、MTSNext、Mergent、FTSE FI、YB、BR の商標です。ここで使用される「FTSE®」、「Russell®」、「FTSE Russell®」、「MTS®」、「FTSE4Good®」、「ICB®」、「Mergent®」、「The Yield Book®」、「Beyond Ratings®」、およびその他の商標ならびにサービスマーク（登録されているか否かは問いません）はすべて、LSE グループの該当メンバー会社またはそのそれぞれのライセンサーによって所有またはライセンスを供与されているか、FTSE、Russell、MTSNext、FTSE TMX、Mergent、FTSE FI、YB、BR が所有、またはそのライセンスに基づいて使用されています。FTSE International Limited は、ベンチマーク管理者として金融行為監督機構により認可され規制を受けます。

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、人的ミスや機械の誤作動、その他の要因による誤りの可能性があるため、当該情報及びデータはすべて“現状のまま”提供されており、これらの誤りに対していかなる保証もいたしません。LSE グループのメンバーまたは各取締役、役員、従業員、パートナーまたはライセンサーのいずれも、情報の正確性、適時性、完全性、市場性、または 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るものではない）の使用から得られる結果の正確性、適時性、完全性、市場性、あるいは特定の目的に対する FTSE Russell 商品の適切性または適合性に関して、明示または黙示を問わず、いかなる主張、予想、保証、表明も行いません。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。



London
Stock Exchange Group

Press Release

FTSE
Russell

LSE グループのメンバーまたは各取締役、役員、従業員、パートナーまたはライセンサーは、(a) エラーの全部または一部に起因する、またはその結果に起因する損失または損害 これらの情報またはデータの使用、または本資料または本資料へのリンクの使用、または (b) 本資料に記載されている情報の使用、または使用に起因する (過失またはその他の) たとえ LSE グループのメンバーがそのような情報の使用または使用に起因するそのような損害の可能性を事前に知らされている場合であっても、直接、間接、特別、派生的または偶発的な損害については一切責任を負いません。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、投資勧誘を提供してならず、本資料に記載されている情報や FTSE Russell の商品を通じて入手可能な情報 (統計データおよび業界レポートを含む) は、財務または投資に関するアドバイスや財政的なプロモーションを構成するものとみなす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ッ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ッドロジーの適用による後講釈のメリットを反映している場合があり、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。本資料には将来的な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前提に基づいており、こうした前提は最終的に正確ではないことが判明する場合があります。このような将来的な評価はリスクや不確実性を内包しており、様々な要因による影響を受ける可能性があるため、実際の結果と大きく異なる場合があります。LSE グループのメンバーまたはそのライセンサーは、将来的な評価をアップデートする義務または責任を負う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許可なしに、いかなる形式、またはいかなる方法、電子媒体、機械的な方法、複写、記録、または別の方法であっても、複製、保存 (検索システムによる保存)、または送信されることはできません。LSE グループのデータの使用及び配布には、FTSE、Russell、FTSE Canada、MTSNext、Mergent、FTSE FI、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。



London
Stock Exchange Group