

## S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス S&P 500に基づく環境及び社会的責任指数の算出を開始

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメントにこの指数のライセンスを供与

ニューヨーク、2015年6月24日：世界有数の金融市場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 (S&P DJI) は本日、**S&P 環境及び社会的責任指数**の算出を開始したと発表しました。この指数は、サステナビリティ投資基準を満たす一方で、そのベース指数となる「S&P 500<sup>®</sup>」および「S&P 先進国総合指数 (米国及び韓国大中型株を除く)」の各指数と同様のリスク及びパフォーマンス・プロファイルを投資家に提供するように設計されています。この指数はゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント (GSAM) にライセンス供与されました。同社は、これらの指数に用いられているサステナビリティ基準をS&P DJIと共同開発しました。

S&P環境及び社会的責任指数は、S&P DJIの環境・社会・ガバナンス (ESG) 指数の指数ファミリーを拡張するものです。本日、以下の指数の算出を開始しました。

- ・ [S&P 500 環境及び社会的責任指数](#)
- ・ [S&P インターナショナル環境及び社会的責任指数](#)

指数の構成銘柄については、ルールに基づいた透明なメソッドロジーを用いて選択されています。化石燃料重工業、またはタバコやクラスター爆弾、地雷、核兵器、その他兵器の製造や販売に従事している銘柄は除外されます。基準を満たす企業には、RobecoSAMが提供する環境及び社会的ディメンション・スコア (E&Sスコア) が割り当てられます。各セクターにおいてE&Sスコアが最も高い上位75%の銘柄が指数の構成銘柄として選択されます。

**S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスのマネージング・ディレクターであるAlka Banerjee**は次のように述べています。「環境及び社会的責任を意識している投資家や、国連の責任投資原則を遵守している投資家を中心に、長期サステナビリティ戦略をポートフォリオに組み入れることに対する需要が高まっています。S&P 500やS&P グローバル総合指数のように、広範な市場の動きを示す、広く利用されている指数を用いることで、環境問題や社会的問題に真剣に取り組んでいる企業のパフォーマンスに関する独自の見通しを市場に提供することができます。」

**ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメントの定量運用戦略チームのマネージング・ディレクターである Monali Vora** は次のように述べています。「弊社のお客様の間では、本源的価値に即して投資を行うことに対する関心が高まっています。このことを踏まえ、弊社は環境及び社会的責任指数を S&P DJI と共同開発しました。これらの指数は、幅広いセクターをカバーする分散された指数である一方、親指数に対するトラッキングエラーを小さく抑えることを目指しています。」

詳しい情報をお求めの方は、[www.spdji.com](http://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

マグロウヒル・フィナンシャルのグループ会社である 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、データおよびリサーチを提供する世界最大のグローバル・リソース企業である。金融市場の代表的指標である S&P 500<sup>®</sup> 株価指数およびダウ・ジョーンズ工業株平均<sup>™</sup>をはじめとして、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、機関投資家や個人投資家のニーズを満たす革新的で透明性のあるソリューションを 115 年以上にわたり構築してきた。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る。広範なアセット・クラスをカバーする1,000,000超の指数により、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、投資家が市場を測定し売買する方法を定義している。当社についての詳細は [www.spdji.com](http://www.spdji.com) まで。

「Standard & Poor's」および「S&P」は、マグロウヒル・ファイナンシャルの子会社であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービスズ LLC(以下、「S&P」)の登録商標である。「Dow Jones」は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングス LLC(以下、「ダウ・ジョーンズ」)の登録商標である。これらの商標は、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス LLC がライセンス許諾を受けている。指数に直接投資することはできない。S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス LLC、ダウ・ジョーンズ、S&P およびそれぞれの関連会社(総称して、「S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス」)は、第三者が提供する、いかなる指数のパフォーマンスにもとづく投資リターンを提供を目的とした投資ファンドまたは投資ビークルも、提供、保証、販売、または宣伝することはない。本資料は、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスがライセンスを有していない法域におけるサービス提供を意図するものではない。S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、第三者への指数ライセンス供与に関連して報酬を得ている。指数に直接投資することはできません。S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス LLC、ダウ・ジョーンズ、S&P 及び各々の関連会社(これらを合わせて「S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス」という)は、第三者が提供し、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスの指数のリターンに基づく投資リターンを提供することを目指す投資ファンド、或いはその他のビークルを提供、推奨、販売、或いは宣伝することはありません。本資料は、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスが必要なライセンスを持たない地域におけるサービスの提供を行うものではありません。S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、その指数を第三者にライセンス供与することに関連した報酬を受けています。

## お問合せ先

牧野 義之  
S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス  
[yoshiyuki.makino@spdji.com](mailto:yoshiyuki.makino@spdji.com)  
電話: 03 4550 8563

David R. Guarino  
Communications  
S&P Dow Jones Indices  
[dave.guarino@spdji.com](mailto:dave.guarino@spdji.com)  
電話: (+1) 212 438 1471

Alex Yang  
Communications, Asia Pacific  
S&P Dow Jones Indices  
[alex.yang@spdji.com](mailto:alex.yang@spdji.com)  
電話: (+852) 2532 8001