

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス

プレス・リリース

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスが新たに開発した環境指数を世界最大の年金基金である年金積立金管理運用独立行政法人(GPIF)が採用

新たに開発した「カーボン・エフィシエント指数」は企業の炭素排出量に関する情報開示と関連情報の透明性の改善を促進するように設計されています

東京、2018年9月25日: S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス(以下、「S&P DJI」といいます。)は本日、世界最大の年金基金である年金積立金管理運用独立行政法人(GPIF)が、同法人の ESG 投資戦略のベンチマークとして、S&P DJI が新たに開発した環境指数 2 指数を選定したことを発表しました。GPIF は 2018 年第 1 四半期現在で約 158 兆 5,800 億円の資産を運用しています。

採用された指数は、「[S&P グローバル大中型株カーボン・エフィシエント指数\(除く日本\)](#)」、および TOPIX をベンチマークとする、株式会社日本取引所グループ(以下、「JPX」といいます)との共同ブランドの「[S&P/JPX カーボン・エフィシエント指数](#)」です。それ以外にも S&P DJI は、日本を含むグローバル株を対象とした「[S&P グローバル大中型株カーボン・エフィシエント指数](#)」を算出しています。

これらのカーボン・エフィシエント指数は、ベンチマークのリスク・リターン特性を維持したまま、炭素効率性が高く(売上高当たりの炭素排出量が少なく)、炭素排出量に関する情報開示を十分に行っている企業のウェイトを引き上げ、炭素効率性が低く(売上高当たりの炭素排出量が多く)、情報開示を十分に行っていない企業のウェイトを引き下げるものです。これにより、指数全体の炭素排出量を減らしたい投資家のニーズを満たす設計となっています。具体的には、同指数は、S&P グループ (NYSE: SPGI) の一部門として ESG データの分析を専門とする Trucost が算出する炭素効率性(売上高当たりの炭素排出量)に応じて構成銘柄のウェイトを調整します。またカーボン・エフィシエント指数のウェイト調整の計算では、S&P 独自のグローバル炭素基準が用いられています。

S&P DJI 最高経営責任者(CEO)のアレックス・マトゥーリ(Alex Matturri)は次のように述べています。「このたびは ESG データの透明性と開示についての市場の認識を高めるために GPIF 及び JPX と協力できることをうれしく思います。GPIF が採用する唯一のカーボン指数である S&P カーボン・エフィシエント指数は簡潔で効果的な加重方式で算出されていますので、日本の上場企業によるカーボン・プラクティス(低炭素経営)の推進とデータの透明性の強化への取り組みの促進に資するものです。大規模な年金基金及び機関投資家はそれぞれの資産運用が環境に与える影響の把握、計測、管理の必要性を強く認識しています。ESG 投資の推進に貢献する S&P DJI が提供する指数はそうした必要性に引き続き応えとともに、持続可能な経済成長にも貢献してまいります。」

PRESS RELEASE

S&P グローバル最高経営責任者のダグラス・ピーターソン (Douglas Peterson)は次のように述べています。「市場の発展に尽くす S&P グローバルにとって、持続可能な投資を支えることはその企業戦略の要です。企業及び機関投資家の間で ESG ファクターが金融リスクとパフォーマンスの管理の根源とする考えが強まる中で、自信を持って経営及び投資判断を行う上で欠かせない革新的なデータ、アナリティクス及びベンチマークが求められています。S&P グループが提供する ESG に関連するデータとサービスを通して世界経済の持続可能な発展に向けた S&P グローバルのコミットメントは不動です。それらのデータとサービスには、本日発表された先駆的な環境指数を支える Trucost の先進的な環境分析データが含まれています。」

S&P グローバル・カーボン・エフィシエント指数について詳しい情報をお求めの方は、[S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスのホームページ](#)をご覧ください。

S&P グローバルについて

S&P グローバルは、世界の資本市場およびコモディティ市場にておいて、独立した立場から透明性が高い信用等级付け、ベンチマーク、データおよび分析情報を提供する世界有数の企業です。S&P グローバルの傘下には、S&P グローバル・レーティング、S&P グローバル・マーケット・インテリジェンス、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス、S&P グローバル・プラッツがあり、世界 31 カ国で訳 2 万人の社員が従事しています。詳細は www.spglobal.com をご覧下さい。

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスについて

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、指数ベースの重要なコンセプト、データ及びリサーチを提供する世界最大のグローバル・リソース企業であり、金融市場の代表的指標である S&P500[®]及びダウ・ジョーンズ工業株平均[®]を算出しています。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ます。チャールズ・ダウが 1884 年に初めて指数を発明して以降、広範なアセット・クラスをカバーする指数を刷新・開発することにより、投資家が市場を測定し、売買する方法を定義しています。S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P グローバル (NYSE:SPGI) のグループ会社であり、個人や企業、政府が自信を持って投資判断を行う上で不可欠な情報を提供しています。詳細については、www.spdji.com をご覧ください。

お問い合わせ先 (S&Pダウ・ジョーンズ・インデックス)

Soogyung Jordan

Global Head of Communications

New York, USA

(+1) 212 438 2297

soogyung.jordan@spglobal.com

Nadja Jiang

APAC Communications

Hong Kong, CHINA

(+852) 2841 1017

nadja.jiang@spglobal.com

Asti Michou

EMEA Communications

London, UK

(+44) 0 20 7176 0311

asti.michou@spglobal.com

日本オフィス

03-4550-8564

index.tokyo@spglobal.com