

FTSE4Good 定期レビュー結果のお知らせ (2018年6月)

- 82 銘柄が FTSE4Good Developed Index に新規組み入れ
- 34 銘柄が FTSE4Good Emerging Index に新規組み入れ
- 日本企業の 8 銘柄が FTSE4Good と FTSE Blossom Japan Index に新規組み入れ
- ESG 要素を投資の重要事項として恒常的に検討している投資家が増加

世界的なインデックス、分析およびデータプロバイダーである FTSE Russell は、FTSE4Good Index シリーズについて 2018 年 6 月の定期レビューを行い、その結果を発表しました。

今年で 17 年目を迎える FTSE4Good Index シリーズは、環境、社会、ガバナンス(ESG)の徹底した実績を示す企業のパフォーマンスを測定するための高い透明性を持つ客観的なベンチマークを投資家に提供します。同 Index シリーズには ESG に関する特定の基準を満たす企業が組み入れられています。企業は評価基準を継続的に満たすべく、年間を通して 300 以上の個別項目に基づいた詳細な評価を受けています。

FTSE4Good Developed Index に今回新たに組み入れられる銘柄のうち、時価総額ベースでの上位 10 銘柄は、アルファベット順(以下、英語表記)に Emerson Electric、Fast Retailing、Fedex Corporation、Las Vegas Sands、Lilly (Eli) & Co、Mitsubishi Corp、Nidec Corp、Sands China、Shin-Etsu Chemical、T-Mobile US Inc です。銘柄入れ替えの詳細については、FTSE Russell の[ウェブサイト](#)をご参照下さい。合計で 82 銘柄が FTSE4Good Developed Index に加わり、34 銘柄が FTSE4Good Emerging Index に組み入れられました。今回新たに加わった銘柄数を国別にみると米国が最も多く(31 銘柄)、また米国は同 Index の中で依然として最大の構成銘柄数を占めています。8*の日本企業と 8 **のオーストラリア企業も同 Index に追加され、それ以外に FTSE4Good Developed Index に 15 カ国の 35 銘柄が追加されました。

FTSE Russell の David Harris (Head of Sustainable Investment) は以下のとおり述べています。:

「2001 年に FTSE4Good Index シリーズを開始して以来、世界と投資環境は劇的に変化し、持続可能な投資、気候変動リスク、低炭素経済への移行、ベンチマークへの ESG の統合が投資家、政策立案者にとって重要なテーマとなっており、これは企業にとっても同様です。ベンチマークは、先日リリースした弊社の「[STEP Change Report](#)」にもあるように、市場全体の変化を促進する強力な手段になります。FTSE4Good は世界中の企業に影響を与えており、より多くの企業がこの基準を満たすべく取り組み、また実際に組み入れられる企業が生まれていることを喜ばしく思っています。」

FTSE Russell は、昨今アセット・オーナーの間で高まりつつある“ESG を投資戦略に統合する動き”を継続的に支援してきました。[FTSE Russell の最近のレポート](#)によると、調査対象のグローバルのアセット・オーナーの約 40%は、今後 18 カ月間に ESG の検討事項をスマート・ベータ戦略に適用すると予想しています。これらのうち、ほぼ半分が投資リスクや運用パフォーマンス上の理由から、これらの投資を検討しています。FTSE4Good Index シリーズは、世界中の多



くの機関投資家により採用されています。新たな採用機関として、初の ESG 投資のために [FTSE Blossom Japan Index](#) を採用した年金積立金管理運用独立行政法人(GPIF)と、新たな株式運用のために [FTSE4Good TIP Taiwan ESG Index](#) を採用した台湾の公的年金基金である労働部労働基金(BLF)が含まれます。

* Nidec Corp, Mitsubishi Corp, Fast Retailing, Shin-Etsu Chemical, JXTG Holdings, Suntory Beverage & Food, Hino Motors and Sojitz

** Fortescue Metals Group, Seek, Xero, Healthscope, Magellan Financial Group, Orora, Bank of Queensland Ltd. and Platinum Asset Mangement Ltd/Australia

- 以上 -

お問い合わせ先:

グローバルメディア

Lucie Holloway
Alex Ritterman

+44 (0)20 7797 1222
newsroom@lseg.com

FTSE Russell について:

インデックス、データ、分析ソリューションを幅広く作成・管理する大手グローバルインデックスプロバイダー、FTSE Russell は、資産クラス、スタイル、戦略全体における顧客ニーズに対応しています。FTSE Russell は、市場および資産クラスを測定およびベンチマークする数千の指標を算出しその対象国は 70 カ国以上、世界の投資可能市場の 98%をカバーしています。

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り幅広く使用されています。現在、約 15 兆米ドルが FTSE Russell インデックスにベンチマークされています。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をベンチマークし、投資ファンド、ETF、ストラクチャード商品、インデックススペースのデリバティブ商品を組成するために、FTSE Russell インデックスを選択しています。FTSE Russell インデックスは、資産配分、投資戦略分析、リスク管理のためのツールもクライアントにご提供しています。

中核となる一連の普遍原理が、FTSE Russell インデックスの設計と管理を駆動しています。透明性がありルールに基づいた方法論は、主要市場参加者の独立した委員会から情報提供を受けています。FTSE Russell は、業界最高レベルの基準を適用し、IOSCO の原則を採用したインデックス・イノベーションおよび顧客パートナーシップに注力しています。FTSE Russell は、ロンドン証券取引所グループの完全子会社です。

詳しくは www.ftserussell.com をご参照ください。

© 2018 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 TMX」と表示します)、(4) MTSNext Limited (「MTSNext」)、(5) Mergent, Inc. (「Mergent」)、(6) The Yield Book Inc. (「YBI」)、(7) FTSE Fixed Income LLC (「FTSE FI」)が含まれます。無断複製・転載を禁じます。

FTSE Russell®は FTSE Russell、FTSE TMX、MTS Next Limited、Mergent、FTSE FI、YB の商標です。ここで使用される「FTSE®」、「Russell®」、「FTSE Russell®」、「MTS®」、「FTSE TMX®」、「FTSE4Good®」、「ICB®」、「Mergent®」、「WorldBIG®」、「USBIG®」、「EuroBIG®」、「AusBIG®」、「The Yield Book®」、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 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。「TMX®」は、TSX Inc. の登録商標です。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。

