

Press release

2020年7月16日

リフィニティブ・ジャパン株式会社

リフィニティブ、サステナブル投資への移行を支援するリップパー・ファンド ESG スコアを提供 ファンドの ESG パフォーマンス評価・比較を可能にする透明性と客観性を示すデータ指標

世界有数の金融データ・プロバイダーであるリフィニティブは、データと分析を通じて世界の金融コミュニティに貢献するとのコミットメントの下、持続可能な投資への移行において重要なデータ指標となる「リフィニティブ・リップパー・ファンド ESG スコア」の提供を開始いたします。本データは、ファンドマネージャーやアドバイザー、投資家をはじめとする多くの皆様にファンドレベルでの ESG (環境・社会・ガバナンス) への取り組みを評価・比較するための指標で、Refinitiv Workspace、Eikon または API フィードを通じてご利用いただけます。

リフィニティブ・リップパー・ファンド ESG スコアは、33 万以上のファンドをカバーするリフィニティブ・リップパーのグローバルファンドデータベースと、グローバル時価総額の 80% に相当する ESG スコア対象企業から成る適格ファンドユニバース、株式型、債券型およびミックス型ファンドの純資産総額 15.7 兆米ドルに相当する 19,000 以上の各ポートフォリオの透明性のある客観的なファンドスコアを算出しています。

リフィニティブの ESG スコアは、環境、社会、ガバナンスの三つの柱にまたがる 10 の主要テーマ (排出量、環境製品の革新性、多様性と受容性、人権、株主など) について、企業の相対的な ESG パフォーマンス、コミットメント、効果を透過的かつ客観的に算出するように設計されています。

リフィニティブの **デイビッド・クレイグ** 最高経営責任者 (CEO) は次のように述べています。「世界全体が新型コロナウイルスの課題に取り組んでいる局面でも、気候変動がコミュニティ、食糧供給、生物多様性、経済に影響を与える世界で最も重大な問題の一つであることに変わりはありません。社会的課題の解決に向けて高炭素産業やそれに相当する業界から距離を置くことができるようにするため、また、さらなる規制上の義務を順守する上で、金融市場がこの問題に取り組むのは不可欠です。サステナブル・ファイナンスは単なる政治的・社会的な選択ではなく、ビジネスにおけるスマートな判断です。投資家、トレーダー、アドバイザーが ESG パフォーマンス評価に基づいて資本配分を行えるように、信頼されたデータと分析を提供することで、こうした動きを促す役割を果たせるのはリフィニティブにとって光栄なことです」。

Press release

「ESG スコアは、重要性や透明性の向上などの問題を考慮して、業界全体のパフォーマンスを評価するためのユニークで効果的な方法であり、異なる産業におけるそれぞれの ESG への取り組みの重要性を客観的かつ公平に評価します」と付け加えました。

リフィニティブのデータによると、ESG に焦点を絞った運用資産は増え続けています。しかし、ESG を組み込むその多様性とスタイルに一貫性があるとは言えません。現時点では、ネガティブスクリーニングとして適用するものから、リスク管理を目的とした ESG 統合を行うもの、また、特定の ESG 指標とアルファ生成を相関させるモデルからインパクトの測定に重点を置いたものまで様々です。企業への規制の圧力が高まる中で、ESG を考慮に入れることはますます重要です。リフィニティブは、この新しいファンドスコア機能が、持続可能な成果をもたらす資本を最適化するための優れた道筋を示し、差別化された資産を投資家に提供できるものと考えています。

リフィニティブ・リップパー・ファンド ESG スコアには、下記の二つの総合的な ESG スコアが組み込まれています。

- ESGスコア - 公表済みの検証可能なレポートのデータに基づき企業やファンドのESGパフォーマンスを測定
- ESG複合スコア - ESGスコアとESG論争(ネガティブイベントの影響)を重ね合わせることで、企業の持続可能性への影響や行動をほぼリアルタイムで総合的に評価

10の主要テーマで構成されるE、S、Gの個別の柱に従い、ファンドや企業がどのように企業活動を行ったかを検証する三つの柱の合計スコアがあります。リフィニティブ採用のアプローチでは、当社の企業ESGデータとスコアを活用し、それをリップパーのグローバル・ファンド・ユニバースの保有銘柄に関するデータと組み合わせることで、構成要素の属性に基づいたボトムアップ方式によるファンドのスコア付けを行います。

リフィニティブのサステナブル・ファイナンス、Lipper、I&Aインサイト責任者であるレオン・サンダース・カルバートは次のように述べています。「リフィニティブは市場への透明性提供に注力しているほか、リップパーのファンドに関する保有銘柄情報、リフィニティブのESGに関する広範な企業カバレッジ、そして独自のスコアリング手法などを独自の資産とみなしています。ESGの専門家コミュニティへのサービス提供にとどまらず、金融専門家に対する有意義なデータ、分析、ツールの提供によってESG要素を投資プロセスにより容易に組み込めるようにすること

Press release

で、金融市場で持続可能性を主流にする取り組みに貢献できると考えています。ファンドESGスコアの提供開始は、こうしたプロセスへの重要なステップです」。

リフィニティブは18年以上にわたりESGのデータとソリューションに関連したサービスを金融業界に提供しています。また、ポジティブな影響と総合的な分析を供与することで投資家や企業の皆さまから信頼されている業界で最も豊富なESGデータベースの一つです。国連グローバル・コンパクトのメンバーであるリフィニティブは、責任あるビジネスの実践を核とした事業活動に取り組んでいる135カ国の9,000社以上が参加しているコミュニティの一員でもあります。リフィニティブESGデータに関する詳細は以下をご参照ください。

<https://www.refinitiv.com/ja/sustainable-finance/esg-investing>

リップパーは、ミューチュアルファンド、年金基金、ヘッジファンドなどのグローバルな合同投資ファンドや、ファンドの手数料と費用に関して、資産運用会社や機関投資家に対して独立した見解を提供しています。リップパーは、高品質のデータ、ファンドの格付け、分析ツールおよびグローバルにわたるコメントを、専門的なプロダクトを通じて提供しています。40年以上にわたり投資家から信頼を得ているリップパーは、比類のない知見とインサイトをファンド業界に提供しています。

以上

注) 本稿は、2020年7月7日発表された英文プレスリリースの抄訳です。内容に相違がある場合にはリフィニティブのグローバルサイトに掲載されている**原文**が優先します。

リフィニティブについて

Refinitiv(リフィニティブ)は世界有数の金融市場データのプロバイダーで、約190カ国で4万社を超える企業・機関にサービスを提供しています。全世界をカバーするデータとインサイト、トレーディング・プラットフォーム、市場データ・インフラストラクチャー、オープン・テクノロジー・プラットフォームを通じて、世界の金融コミュニティを相互に結び付け、発展を支えます。それによりトレーディング、投資、ウェルスマネジメント、規制およびマーケットデータ管理、企業が抱えるリスク、金融犯罪追対策などの分野においてイノベーションをもたらす先駆者としての役割を果たしています。詳しくはウェブサイトをご参照ください。

<https://www.refinitiv.com/ja>

Press release

本件に関する連絡先:

藤森 英明

PR 部門

電話番号: (03) 6441-1504

携帯番号: (070) 4373-1566

JapanPR@refinitiv.com