

*本プレスリリースはBloomberg LPが2019年9月17日に英語で発表を行ったプレスリリースを日本語に翻訳・再編集したものです。オリジナルのプレスリリースの正式言語は英語であり、この内容および解釈については英語が優先となります。英文オリジナルにつきましては次のサイトをご参照ください。<https://www.bloomberg.com/company/press/bloomberg-launches-equity-benchmarks/>

ブルームバーグ 株式ベンチマーク・インデックスを算出開始

ESG インデックスファミリーのベンチマークとなる ブルームバーグ米国大型株インデックスを開発

【ニューヨーク、2019年9月17日】ブルームバーグは本日、米国株式に関するベンチマーク・インデックスの提供を開始することを発表しました。第一弾は ESG インデックスファミリーのベンチマークとなるブルームバーグ米国大型株インデックス(ティッカー: B500)で、バリュー・インデックス、グロース・インデックス、高配当インデックスなどのスタイル・インデックスを含みます。また同インデックスは同時に提供されるブルームバーグ SASB ESG インデックス(ESG 加重されたバリュー・インデックス、グロース・インデックス、高配当インデックスなど)のベースとなります。

ブルームバーグ・インデックスのグローバル責任者であるスティーブ・バークリーは次のように述べています。「株式インデックスの開発は、債券インデックス、コモディティインデックス、為替インデックスという一連の既存インデックスの延長として自然な流れでした。インデックスを活用するお客様のさまざまな資産クラスにわたる個々のニーズへの対応をサポートするために、包括的かつ競争力の高い株式インデックスソリューションを提供する必要がありました。」

ESG インデックスファミリーには、米国の大型株を対象としたブルームバーグ SASB ESG 株式インデックスや、投資適格社債を対象としたブルームバーグ SASB ESG 債券インデックスが含まれます。このインデックスファミリーでは、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズが開発・提供する ESG スコアリングのソリューションである R ファクター™ が用いられます。

この新たなインデックスファミリーは、企業の業績にもっとも大きな影響を及ぼす可能性がある業界固有の ESG ファクターに焦点を当てています。サステナビリティ会計基準審議会(SASB)が市場情報に基づいて構築したマテリアリティ(重要性)フレームワークをベースとし、アセット・オーナーのための ESG 政策ベンチマークや、R ファクターの ESG スコアを最大化するカスタム・インデックスなどを提供します。これらの新商品は、投資家のベンチマーキングをサポートするとともに、受託者責任の履行をサポートする持続可能な長期的価値を生み出します。

SASB で資本市場政策および普及を担当するジャニーヌ・ギヨー氏は次のように述べています。「ブルームバーグ SASB ESG インデックスファミリーは、重要性に基づく ESG 投資という SASB のビジョンに命を吹き込む画期的なものです。SASB の基準は重要な市場インフラであり、投資決定をするにあたって、緻密でかつ拡張可能な形で ESG ファクターを組み込むための

有益なツールであると考えています。」

R ファクターのスコアは、企業の事業運営パフォーマンスと財務上重要な ESG に関わる問題と関連したガバナンスを反映しています。また一般に広く認められている重要性フレームワークである SASB マテリアリティ・マップと地域固有のコーポレート・ガバナンス・コードに基づいています。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズの ESG 投資およびアセットスチュワードシップの責任者であるラキ・クマール氏は次のように述べています。「ブルームバーグが、ESG インデックスファミリーの強化に R ファクターを選んだことをうれしく思います。私たちは企業や投資家に対し、企業のスコアを左右する財務上重要な ESG に関わる問題についての透明性を向上することを目的として SASB の枠組みに沿って R ファクターを開発しました。結果、企業は業績を改善するために何を管理・開示したらよいのか知ることができます。将来的により良い ESG データが市場にもたらされ、最終的にはより持続可能な市場が構築されるようになるでしょう。」

ブルームバーグ SASB ESG インデックスファミリーに加え、ブルームバーグは気候や ESG に関するデータやツール、そして進化し続ける技術や業界トレンドについての詳細な調査を提供しており、その内容は拡大し続けています。1 万 1,500 社以上の企業に関する ESG 関連データに加え、さまざまな比率や第三者によるランキング、スコアなどが含まれます。

インデックスの手法についての詳細は[こちら](#)をご覧ください。ブルームバーグは世界中のお客様に対し、透明で独立したインデックスのアプローチを提供しています。これらのインデックスは、ブルームバーグ・インデックス・サービスズ・リミテッドにより管理されます。

詳しくは、[こちら](#)をご覧ください。

サステナビリティ会計基準審議会(SASB)について

サステナビリティ会計基準審議会(SASB)は、持続可能性が及ぼす財務的影響という観点で企業と投資家を結び付けています。2011年に設立された独立系の基準設定機関であり、持続可能性に関して投資家が最も重要だと考える問題について、世界中の企業が特定・管理・報告することへの支援をミッションとしています。SASBの基準は、企業や投資家をはじめとするさまざまな市場参加者への徹底的なヒアリングに基づいて開発され、そのプロセスは透明で文書化され、公開されています。77の業種別に、財務上重要な影響を及ぼす可能性が高いとみられる持続可能性ファクターに焦点を当てた SASB 基準により、投資家や企業は同一業種内の企業について各社のパフォーマンスを比較することが可能になります。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズについて

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズは、過去 40 年にわたり、各国政府や機関投資家、金融プロフェッショナルの皆様にご提供しています。厳密なリサーチや分析、厳しいマーケット環境における経験を礎としたリスク考慮型アプローチをもとに、アクティブからインデックス戦略まで幅広く、コスト効率に優れたソリューションを提案いたします。そしてスチュワード(受託者)として、社会、環境への配慮が長期的な成果をもたらすという

ことを、お客様に理解を深めていただくよう努めています。インデックス運用とETF、ESG投資の先駆者として、投資における新しい世界を常に切り拓き、約2.90兆ドル*を運用する世界第3位の資産運用会社へと成長しました。

* 運用資産残高には、約360億ドル(2019年6月末時点)のステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ファンズ・ディストリビューターズ・エルエルシー(以下「SSGA FD」)が営業を行なっているSPDRの残高を含みます。SSGA FDはステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ(SSGA)の関連会社です。

ブルームバーグについて

グローバルビジネス、金融情報、ニュースにおけるリーダーであるブルームバーグは、情報、人、アイデアのダイナミックなネットワークを通じて、影響力のある意思決定者の皆様に決定的な優位性を提供します。ブルームバーグの根幹ビジネスであるブルームバーグターミナルは、革新的テクノロジーを基盤に、データ、ニュース、分析機能を迅速かつ正確に配信します。ブルームバーグのエンタープライズソリューションズは、テクノロジーを活用し、お客さまが効率的、効果的に、データ、情報にアクセスし取り入れ、配信、管理するというブルームバーグの強みに基づいています。詳細に関しては次のリンク先 <http://about.bloomberg.co.jp/> をご覧ください。

報道関係者 お問い合わせ

ブルームバーグ広報代行: アシュトン・コンサルティング 03-5425-7220

ブルームバーグ広報: 03-3201-8900