

The background of the slide is a photograph of a mountain range, likely the Japanese Alps, with multiple peaks visible under a hazy, misty sky. The mountains are layered, creating a sense of depth. The overall color palette is muted, with various shades of teal, blue, and grey.

FTSE
Russell

FTSE Russellのご紹介

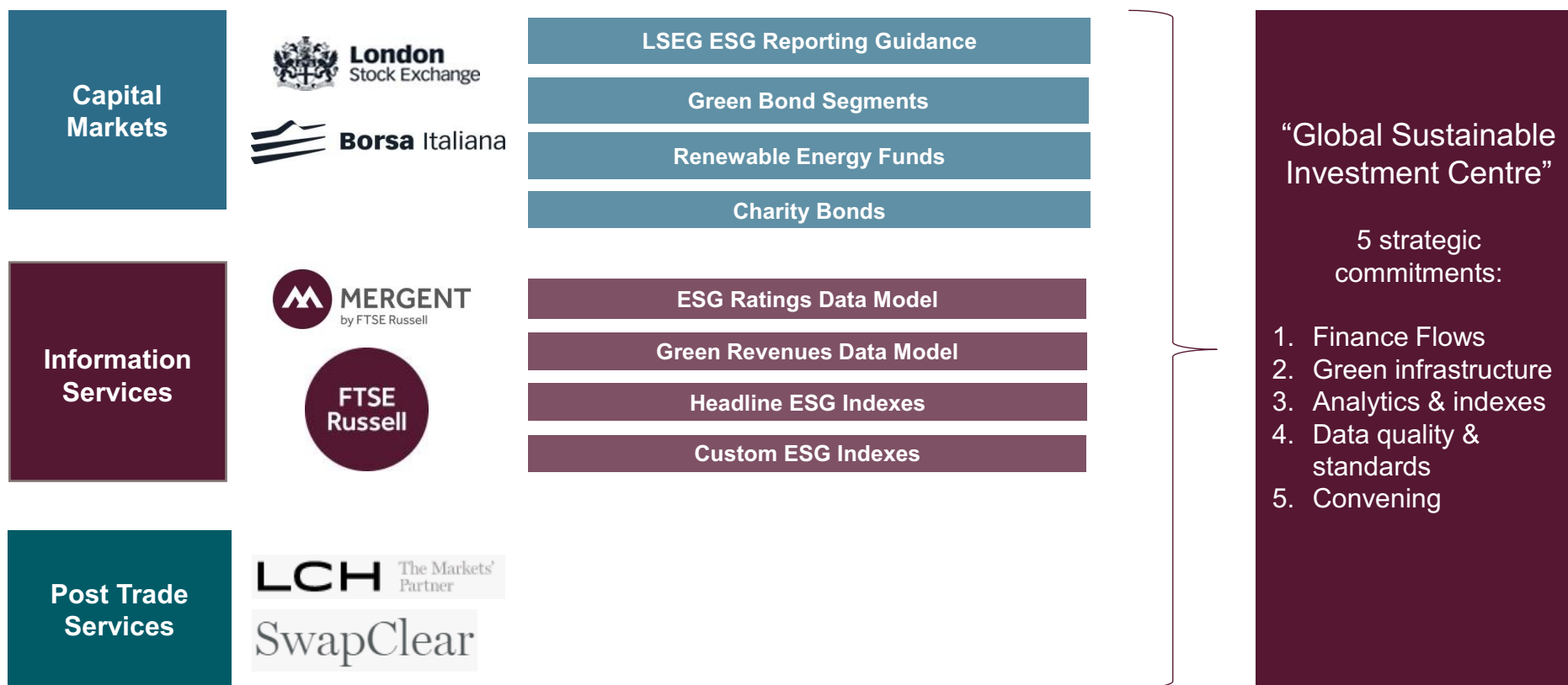
Important information

FTSE Russell is not an investment firm and this presentation is not advice about any investment activity. None of the information in this presentation or reference to a FTSE Russell index constitutes an offer to buy or sell, or a promotion of, a security. This presentation is solely for informational purposes. Accordingly, nothing contained in this presentation is intended to constitute legal, tax, securities, or investment advice, nor an opinion regarding the appropriateness of making any investment through our indexes.

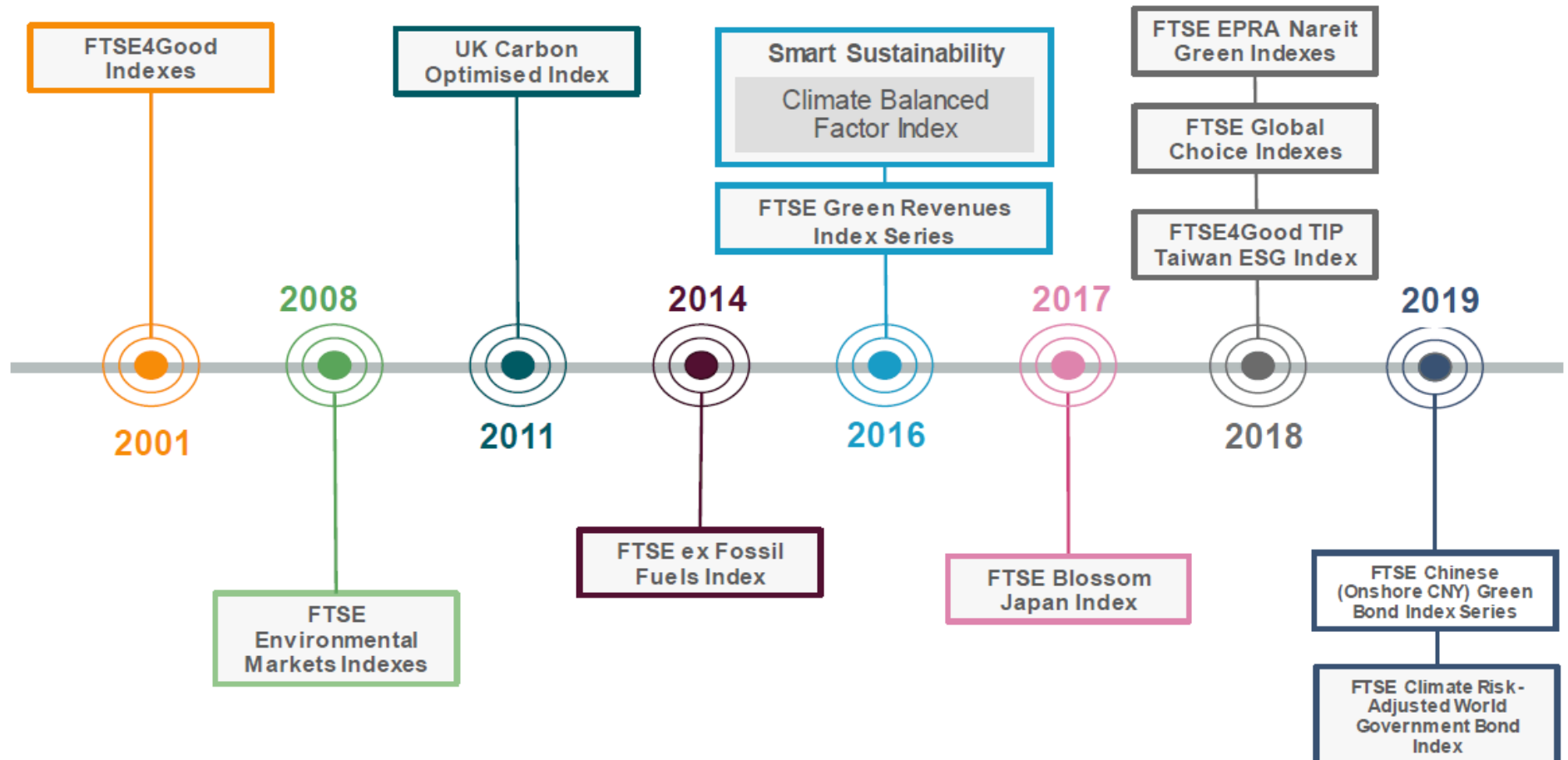
FTSE Russell / ロンドン証券取引所グループ とサステナブル投資

FTSE Russell と London Stock Exchange Group (LSEG) ESG投資：LSEGの業務全般における重要分野

今日、資本市場においては、サステナブルな社会及び低炭素経済への移行が進行しつつあります。この潮流がLSEGのあらゆるお客様、発行体、投資家、その他の仲介者に影響を与えるとの認識から、LSEGでは「Global Sustainable Investment Centre」を設立し、対応を行っています。

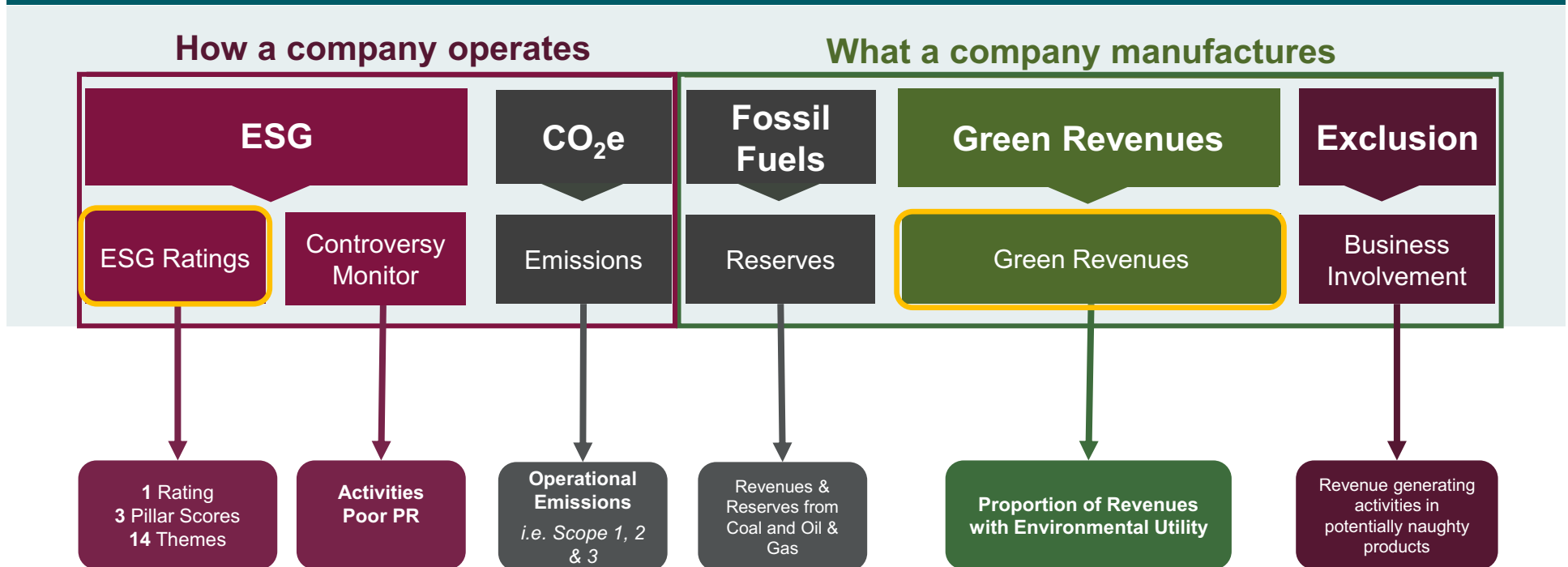


FTSE Russellのサステナブル投資の歩み



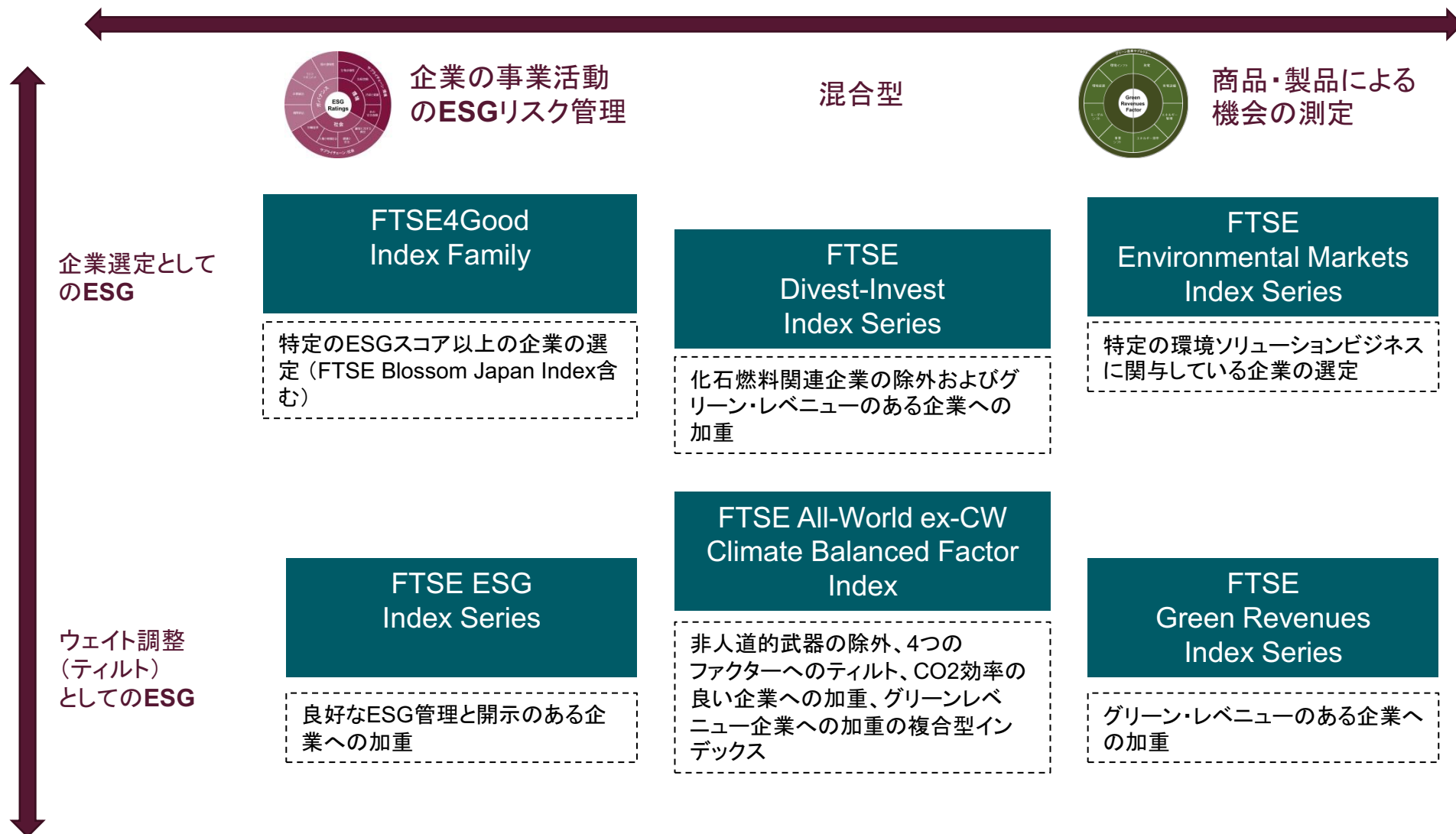
FTSE Russellのサステナビリティ・データのラインアップ

Six Data Models



ESGインデックス

インデックスへのESG インテグレーション: 多様なニーズへの対応



Source: FTSE Russell.

FTSE Blossom Japan Index

FTSE Japan Index

銘柄選定 (総合ESG評価にて3.3以上)*

E (気候変動、汚染と資源、生物多様性、水の安全保障、
サプライチェーン:環境)

S (顧客に対する責任、健康と安全、人権と地域社会、労働基準、
サプライチェーン:社会)

G (腐敗防止、コーポレートガバナンス、リスクマネジメント、税の透明性)

対FTSE Japan業種ニュートラル

親インデックス (FTSE Japan) と10業種の時価総額加重を同じウェイトに**

FTSE Blossom Japan Index

- ESGレーティングのモデルが2014年9月に改訂され、バッファーが導入されています。3.3以上が新規組み入れ、2.9未満が除外対象となります。

** 当インデックス内での一銘柄のウェイトは15%、およびFTSE Japan Indexの構成比の20倍を上限とする。

ESG を考慮したインデックス運用

Vanguard Australia selects new FTSE Russell index for values-aligned ETF and index fund

- FTSE Russell launches new values-aligned index for two ESG-related investment products
- Indexes help investors align with 'building block' approach to ESG
- Clear and simple exclusion of weapons, tobacco, and fossil fuels
- FTSE Developed ex Australia Products/Weapons Index selected
- Tracked by the Vanguard ESG Index Fund and ETF
- c.\$650 billion ETF AuM link

FTSE Russell, the global index provider, is delighted to launch a new values-aligned index for two ESG-related investment products. The first FTSE Russell standard index family to its design. Increasingly, investors are looking to 'embed' ESG considerations into their companies' products and conduct on society and the environment. FTSE Russell can construct bespoke 'Choice' indexes using an industry-recognized ESG inclusion standards used by the FTSE Russell.

Taiwan Bureau of Labor Funds selects FTSE4Good TIP Taiwan ESG Index for \$1.4 billion mandate

- BLF first fund to track FTSE4Good TIP Taiwan ESG Index
- BLF has issued a 5-year portfolio mandate of USD \$1.4 billion
- Growing demand for sustainable investment in the domestic market
- FTSE4Good TIP Taiwan ESG Index is part of FTSE4Good TIP Taiwan ESG Index

FTSE Russell, the global index and data provider, today announces the creation of a new index, the FTSE4Good TIP Taiwan ESG Index, for a significant new equity mandate. BLF has issued a 5-year portfolio mandate of USD \$1.4 billion.

The FTSE4Good TIP Taiwan ESG Index was launched with Taiwan Stock Exchange's (TWSE) wholly owned FTSE4Good TIP Taiwan ESG Index is part of FTSE4Good TIP Taiwan ESG Index offering and reflects the performance of companies recognised ESG inclusion standards used by the FTSE Russell.

Asset Management One selects FTSE Blossom Japan index for ESG ETF

- ESG ETF listed on Tokyo Stock Exchange
- Asset Management One (AM-One) selects FTSE Blossom Japan index for ESG ETF
- FTSE Blossom Japan index data model

FTSE Russell, the global index and data provider, today announces the creation of a new index, the FTSE Blossom Japan index. The Government Pension Investment Fund (GPIF) of Japan has selected the index as a core ESG benchmark through its flagship fund. GPIF is the largest pension fund in the world with over \$1.3tn* in assets.

ESG is becoming an increasingly popular investment theme. AM-One will offer an investment opportunity to investors.

The FTSE Blossom Japan Index is constructed using FTSE Russell's ESG Ratings data model, which draws on existing international ESG standards, including the UN Sustainable Development Goals. The inclusion thresholds are aligned with the globally established FTSE4Good Index Series. The index can be used to assist in the integration of ESG considerations into a diversified strategy. The index does not deviate significantly from the index characteristics of its traditional market capitalization weighted benchmark. To minimise industry bias, the index has been designed using an industry-neutral weighting approach to match the industry weights in the underlying FTSE Japan Index.

World's largest pension fund selects new FTSE Russell ESG index

- FTSE Russell launches new FTSE Blossom Japan Index
- The Government Pension Investment Fund (GPIF) of Japan selects FTSE Blossom Japan Index
- FTSE Russell collaborating with GPIF to promote stewardship and high standards of corporate ESG performance and disclosure
- Growing trend among asset owners to integrate ESG considerations into passive investment strategies

FTSE Russell, the global index provider, today announces the creation of a new index, the FTSE Blossom Japan index. The Government Pension Investment Fund (GPIF) of Japan has selected the index as a core ESG benchmark through its flagship fund. GPIF is the largest pension fund in the world with over \$1.3tn* in assets.

The new FTSE Blossom Japan Index is constructed using FTSE Russell's ESG Ratings data model, which draws on existing international ESG standards, including the UN Sustainable Development Goals. The inclusion thresholds are aligned with the globally established FTSE4Good Index Series. The index can be used to assist in the integration of ESG considerations into a diversified strategy. The index does not deviate significantly from the index characteristics of its traditional market capitalization weighted benchmark. To minimise industry bias, the index has been designed using an industry-neutral weighting approach to match the industry weights in the underlying FTSE Japan Index.

FTSE Russell is responding to a growing trend among asset owners to integrate ESG considerations into passive investments, with GPIF the latest pension fund to select a FTSE Russell index. This trend is increasing transparency and disclosure in the capital markets with investors collaborating to improve company engagement and corporate performance.

Source: FTSE Russell

気候変動における投資家の協働イニシアチブ



In partnership with:






[About](#) ▾
 [TPI Tool](#) ▾
 [Methodology](#) ▾
 [Publications](#) ▾
 [News](#)

[Sign-up](#) ▾
 [Contact us](#)

Overview of the TPI

The Transition Pathway Initiative (TPI) is a global initiative led by asset owners and supported by asset managers. Aimed at investors and free to use, it assesses companies' preparedness for the transition to a low-carbon economy, supporting efforts to address climate change.

Using publicly disclosed company information sourced and provided by TPI's data partner, [FTSE Russell](#), it:

- Evaluates and tracks the quality of companies' management of their greenhouse gas emissions and of risks and opportunities related to the low-carbon transition;
- Evaluates how companies' planned or expected future carbon performance compares to international targets and national pledges made as part of the Paris Agreement;
- Publishes online the results of this analysis through a publicly-available tool hosted by its academic partner, the [Grantham Research Institute on Climate Change and the Environment](#) at the [London School of Economics and Political Science \(LSE\)](#).

Launched January 2017, the TPI is already supported by asset owners with over £7 / \$9.3 trillion* assets under management. They have committed to using it in a range of ways, including to inform their investment research, in engagement with companies and in tracking managers' holdings.

The TPI complements existing initiatives and frameworks, by aligning with prevailing disclosure initiatives and with investors climate change and sustainability expectations. It is also being aligned with the requirements of the [Task Force on Climate-related Financial Disclosures](#) (TCFD).



Launch of the Transition Pathway Initiative at the London Stock Exchange

Management Quality: Oil & Gas

Level 0	Level 1	Level 2	Level 3	Level 4
Unaware	Awareness	Building capacity	Integrating into operational decision making	Strategic assessment
No companies	Andeavor Concho Resources Diamondback Energy Petrochina Rosneft Oil TATNEFT	Anadarko Petroleum ↑ Apache Chevron China Petroleum & Chemical CNOOC Encana EOG Resources ↑	Canadian Natural Resources ↑ ConocoPhillips ↑ Devon Energy ↑ Ecopetrol Hess JXTG Lukoil OMV	BP ↑ Cenovus Energy Eni Equinor Repsol Royal Dutch Shell Total ↑ Woodside Petroleum

Source: Grantham Institute website as of August 2018 <http://www.lse.ac.uk/GranthamInstitute/tpi>

企業のESG戦略支援

Press Release

08 March 2017

FTSE
Russell



FTSE Russell ESG selected by KPMG

- KPMG AZSA Sustainability client communication on E
- FTSE Russell sees growing

FTSE Russell today announces that its ESG R Sustainability Co. Ltd, a member firm of KPMG J Japanese companies. FTSE Russell launched its environmental, social and governance (ESG) data indicators, in December 2016.

FTSE Russell's ESG Ratings data model is part of the Green Revenues (LCE) data model and susta Series and FTSE Russell's 'Smart Sustainability' ind

FTSE Russell has been a pioneer in the developm launching the FTSE4Good Index Series in 2001. F investors with a transparent and objective benchma criteria. FTSE Russell's Green Revenues (LCE) d model that tracks companies that generate grea sustainability models.

インサイト インダストリー サービス セミナー KPMGにつ

ホーム > ニュースリリース/お知らせ > ニュースリリース > FTSE RussellのESGデータベース使用ライセンスを取得

FTSE RussellのESGデータベース使用ライセンス を取得

2017-03-08

KPMGあずさサステナビリティ株式会社（本社：東京都千代田区、代表取締役：斎藤和彦、船越義武、以下KPMGあずさサステナビリティ）は、コンサルティングファームとして世界で初めてロンドン証券取引所グループ傘下の世界的指数会社、FTSE Russell（本社：ロンドン、代表：Mark Makepeace、以下、FTSE Russell）のESG Module & Ratingsの使用ライセンスを取得し、従来から提供しているSRIコミュニケーションサービスを拡充します。

関連するコンテンツ



昨今、投資家の間では財務情報に加え、環境・社会・ガバナンス（ESG）などの非財務情報の要素を考慮する社会的責任投資（SRI）が拡大しています。こうした背景を踏まえ、企業が持続可能性に関する自社課題を認識するにあたり、ESG投資を行う投資家との直接的・間接的なコミュニケーションを通じて情報を把握することが有効な手段となっています。

サステナビリティ領域でのリスク管理や取組に対するパフォーマンスの改善、さらにはその情報開示に強みをもつKPMGあずさサステナビリティでは、インデッ

ESG評価型のシンジケート・ローン

Press Release

31 August 2018

FTSE
Russell

SMBC and Japan Research Institute select FTSE Russell ESG Ratings data model

- Sumitomo Mitsui Banking Corporation (SMBC) launches ESG evaluated syndicated loans and ESG evaluated loans



SMBCグループ

【NEWS RELEASE】

2018年8月28日

各位

株式会社三井住友銀行

「ESG/SDGs評価シンジケーション」取扱開始および「ESG/SDGs評価型資金調達」
におけるFTSE RussellのESG評価結果に関する情報提供開始について

株式会社三井住友銀行（頭取 CEO：高島 誠）は、本邦金融機関初の取組として、お客さまの資金調達におけるシンジケートローン組成時に、お客さまご自身のESG（※1）やSDGs（※2）（以下「ESG/SDGs」）の取組・情報開示の状況を、株式会社日本総合研究所（代表取締役：洲崎 正弘）と弊行が作成した基準に基づく評価も合わせて行う「ESG/SDGs評価シンジケーション」の取扱を開始します。なお、第一号案件として、東証一部上場の住友化学株式会社に対するシンジケートローンの組成を行う予定です。

住友化学 News Release

2018年10月1日

ESG/SDGs 評価型シンジケート・ローンの第1号案件として資金調達を実施

住友化学は、このたび、株式会社三井住友銀行（以下、「SMBC」）が提供する「ESG/SDGs 評価シンジケーション」の第1号案件として、計222.8億円の資金調達を実施しました。本シンジケート・ローンは、SMBCと株式会社日本総合研究所（以下、「日本総研」）が作成した基準に基づき、組成時に顧客のESGやSDGsの取り組みや情報開示の状況を評価する国内初の商品であり、今回、当社のESG/SDGs評価の結果に賛同いただいた金融機関によって組成されました。

<シンジケート・ローンの概要>

契約締結日	2018年9月26日	
アレンジャー	株式会社三井住友銀行	
エージェント	株式会社三井住友銀行	
組成金額	222.8億円	
貸出人	株式会社伊予銀行 株式会社京葉銀行 株式会社滋賀銀行 株式会社静岡銀行 株式会社七十七銀行 株式会社十六銀行 株式会社常陽銀行 株式会社長野銀行 株式会社南都銀行 株式会社八十二銀行 株式会社百五銀行	株式会社百十四銀行 株式会社武蔵野銀行 株式会社もみじ銀行 株式会社山梨中央銀行 信金中央金庫 全国信用協同組合連合会 茨城県信用農業協同組合連合会 岐阜県信用農業協同組合連合会 兵庫県信用農業協同組合連合会 大同生命保険株式会社

Source: FTSE Russell, SMBC (http://www.smbc.co.jp/news/j601687_01.html), Sumitomo Chemical (https://www.sumitomo-chem.co.jp/newsreleases/docs/20181001_1.pdf)

Disclaimer

© 2019 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 Canada」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。無断複写・転載を禁じます。

FTSE Russell®はFTSE Russell、FTSE Canada、MTSNext、Mergent、FTSE FI、YBの商標です。ここで使用される「FTSE®」、「Russell®」、「FTSE Russell®」、「MTS®」、「FTSE4Good®」、「ICB®」、「Mergent®」、「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。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。

全ての情報は情報提供のみを目的として提供されています。本資料に記載されている全ての情報及びデータは、LSEグループが正確かつ信頼できると考える情報源から入手したものです。ただし、人的ミスや機械の誤作動、その他の要因による誤りの可能性があるため、当該情報及びデータはすべて“現状のまま”提供されており、これらの誤りに対していかなる保証もいたしません。LSEグループのメンバーまたは各取締役、役員、従業員、パートナーまたはライセンサーのいずれも、情報の正確性、適時性、完全性、市場性、または関連する金融商品の使用から得られる結果の正確性、適時性、完全性、市場性、あるいは特定の目的に対する金融商品の適切性または適合性に関して、明示または黙示を問わず、いかなる主張、予想、保証、表明も行いません。金融商品またはサービス等を通じてアクセス可能な過去のデータの表示は、情報提供のみを目的として提供されており、将来のパフォーマンスを示唆するものではありません。

LSEグループのメンバーまたは各取締役、役員、従業員、パートナーまたはライセンサーは、(a) エラーの全部または一部に起因する、またはその結果に起因する損失または損害これらの情報またはデータの使用、または本資料または本資料へのリンクの使用、または(b) 本資料に記載されている情報の使用、または使用に起因する(過失またはその他の)たとえLSEグループのメンバーがそのような情報の使用または使用に起因するそのような損害の可能性を事前に知らされている場合であっても、直接、間接、特別、派生的または偶発的な損害については一切責任を負いません。

LSEグループのメンバーまたはその役員、役員、従業員、パートナー、またはライセンサーのいずれも、投資勧誘を提供しておらず、この資料に記載されている情報や関連する金融商品を通じて入手可能な情報(統計データおよび業界レポートを含む)は、財務または投資に関するアドバイスや財政的なプロモーションを構成するものとみなすべきではありません。

過去のパフォーマンスは将来の結果を保証するものではありません。チャートやグラフは説明目的のためだけに提示されています。提示されているインデックスのリターンは投資可能な資産における実際の取引の結果を表しているとは限りません。提示されている特定のリターンはバックテストされたパフォーマンスを反映している場合があります。インデックス算出開始日以前の全てのパフォーマンスはバックテストされたパフォーマンスです。バックテストされたパフォーマンスは実際のパフォーマンスではなく、仮説に基づいたものです。バックテストの計算は、インデックスの算出が正式に開始されたときに有効であったものと同じメソドロジーに基づいています。ただし、バックテストされたデータは、インデックスのメソドロジーの適用による後講釈のメリットを反映している場合があり、インデックスの過去の計算は、インデックスの計算に使用される元の経済データの改訂に基づいて月によって変化する可能性があります。

本資料には将来的な評価が含まれている場合があります。これらは将来の状況に関する多くの前提に基づいており、こうした前提は最終的に正確ではないことが判明する場合もあります。このような将来的な評価はリスクや不確実性を内包しており、様々な要因による影響を受ける可能性があるため、実際の結果と大きく異なる場合があります。LSEグループのメンバーまたはそのライセンサーは、将来的な評価をアップデートする義務または責任を負うものではありません。

この情報のいかなる部分も、LSEグループの適切なメンバーの書面による許可なしに、いかなる形式、またはいかなる方法、電子媒体、機械的な方法、複写、記録、または別の方法であっても、複製、保存(検索システムによる保存)、または送信されることはできません。LSEグループのデータの使用及び配布には、FTSE、Russell、FTSE Canada、MTSNext、Mergent、FTSE FI、YB、及び(または)それぞれのライセンサーからのライセンスが必要です。