

プレス・リリース

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスと日本取引所グループが 共同開発した新たな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

新たな「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: 世界有数の指数プロバイダーの 1 つである 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、「[S&P グローバル・カーボン・エフィシエント指数シリーズ](#)」(S&P Global Carbon Efficient Index Series) と株式会社日本取引所グループ (以下、「JPX」といいます。) との共同ブランドであり、TOPIX をベンチマークとする「[S&P/JPX カーボン・エフィシエント指数](#)」(S&P/JPX Carbon Efficient Index) (以下、これらを総称して「カーボン・エフィシエント指数」といいます。) の導入を発表しました。

また本日、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) は、同法人の ESG 投資戦略のベンチマークとして、「S&P/JPX カーボン・エフィシエント指数」及び「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)」(S&P Global Ex-Japan LargeMidCap Carbon Efficient Index) の 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。

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。

日本取引所グループ取締役兼代表執行役グループ CEO の清田瞭は次のように述べています。「日本取引所グループでは、これまでコーポレートガバナンス・コードの策定、インフラファンド市場の開設、女性活躍や健康経営を推進する企業の選定など、サステナビリティ関連の取組みを積極的に推進してきました。この度、S&P DJI との協力関係により、市場の持続可能な発展に向けて、指数の分野において

も ESG 投資を一層後押しできることをうれしく思います。今後も、弊社として、持続可能性の高い社会の実現に向けて一層貢献できるよう取り組んでまいります。」

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。」

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 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、[東京証券取引所ホームページ](#)または[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。

日本取引所グループについて

日本取引所グループは、東京証券取引所グループと大阪証券取引所が 2013 年 1 月に経営統合して誕生しました。市場利用者の皆様がいっつも安心して有価証券の取引ができるよう、子会社・関連会社を含めたグループ全体で、取引所金融商品市場の開設・運営に係る事業を行っています。

具体的には、株券等有価証券の売買、デリバティブ商品の取引を行うための市場施設の提供、相場の公表、売買等の公正性の確保に係る業務、有価証券債務引受業等を行う体制を整えています。グループ一丸となり、有価証券等の上場、売買、清算・決済から情報配信に至るまで総合的なサービス提供を行うことで、市場利用者の方々にとって、より安全で利便性の高い取引の場を提供できるよう努めています。

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格付け、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 2 万人の社員が従事しています。詳細はwww.spglobal.comをご覧ください。

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

お問い合わせ先（東京証券取引所）

情報サービス部 指数グループ
050-3377-7754
index@jpx.co.jp