

報道機関のお問い合わせ先：

川崎 華奈 +81 3 5511 7539 または Kana.Kawasaki@morningstar.com

Morningstar 指数、EU 気候指数を新たに開発

この新しい指数は、EU の規制要件を満たしながら低炭素で気候変動に負けない世界への移行を進める投資家の皆様に役立つものです。急速にグローバル展開する米国 Morningstar の指数事業の新たな一歩です。

ロンドン発、2021 年 10 月 27 日

大手独立系投資調査会社である米国 Morningstar (ナスダック: MORN) の一事業である Morningstar 指数部門は、本日、Morningstar EU 気候指数の算出を開始しました。EU 気候移行ベンチマーク (CTB) およびパリ協定適合ベンチマーク (PAB) の要件を満たす方向へと投資家の皆様が進んでいくのに役立つ指標となります。米国 Morningstar が提供するこの新しい [気候指数シリーズ](#) は、親指数に対するトラッキング・エラーを最小化しつつ、対象地域の大中型株式指数の構成銘柄の中でパリ協定の目標に沿って脱炭素化に向けて順調に進んでいる銘柄で構成されています。当指数シリーズは、Morningstar の指数に、米国 Morningstar グループの一員である、環境・社会・ガバナンス (ESG) のレーティングと調査で業界を代表するサステナリティクス社による炭素排出量データおよびカーボン・リスク・レーティングを組み合わせたものです。

米国 Morningstar では、世界の投資家の役に立つために、市場ベンチマークおよびデータへの投資を拡大中ですが、この気候指数シリーズが新たに加わりました。9 月には、米国 Morningstar は、欧州に拠点を置く、指数の設計、算出、管理を手掛ける世界的な指数プロバイダーである [Moorgate Benchmarks の買収](#) を発表しました。Moorgate Benchmarks の最高経営責任者であるトビアス・シュプローンレは、米国 Morningstar 指数部門の欧州ヘッドを兼任し、米国 Morningstar 指数部門のグローバルヘッドであるロン・バンディの直属となりました。

トビアス・シュプローンレは、次のように述べています。

「COP26 の開催が近づき、世界の投資家は、いまだかつてなく気候変動に焦点を合わせており、カーボンニュートラル (温室効果ガスの排出が実質ゼロ) の実現 に向かって進んでいるかを把握するための高度な評価基準を求めています。我々の新しい EU 気候指数には、Moorgate Benchmarks の指数からサステナリティクスのチームに至るまで、米国 Morningstar の力が結集され、[Morningstar EU サステナブル・ファイナンス・アクション・プラン・リソース](#) でご提供している ESG に焦点を絞った知識や分析 が組み合わされています。規制要件を満たし、より焦点を絞った投資戦略を創出するために、顧客が気候政策の複雑さに対処するのに役立つものです。」

最近行われた、指数業界団体 (Index Industry Association) による世界の資産運用会社の ESG に関する調査では、投資会社の 63% が、ESG 投資の導入にあたって定量データの不足を主要あるいは中程度の課題として挙げています。また、64% が投資対象となる企業の ESG に関する活動について、透明性が欠如しているあるいは企業情報の開示が不十分であるとしています。米国 Morningstar は、同社のポリシー、調

査、サステナリティクスや指数チームによる幅広いリソースを通じて、お客様がこのような課題に取り組み、日々進化する EU のアクション・プランに対応するお手伝いをするすることで、欧州におけるこのような課題に対処することを支援します。

EU 気候指数を算出開始するにあたり、米国 Morningstar 指数部門のストラテジストであるダン・レフコビッツは、米国 Morningstar 指数部門、米国 Morningstar EU ポリシー・チーム、サステナリティクスの同僚と共著で「[「ビヨンド“ネットゼロ”：気候変動に負けない惑星への移行を支える \(Beyond “Net Zero”: Supporting the Transition to a Climate-Resilient Planet\)](#)」と題するリサーチペーパーを新たに発表しました。このリサーチペーパーは、気候に関する主要なデータやリサーチを活用して、グローバル企業の“ネットゼロ”（温室効果ガスの排出が実質ゼロ）の誓約を検証するように、投資家に提案するものです。ダン・レフコビッツは次のように述べています。

「投資家は、今日、企業の“ネットゼロ”の誓約のその先を見る必要があります。温室効果ガスの排出量を削減し、気候変動に立ち向かえるようにビジネスモデルを適応させる測定可能な措置を講じる企業と、リップサービスだけの企業を識別しなければなりません。」

米国 Morningstar について

米国 Morningstar は、北米、欧州、オーストラリア、およびアジアで事業を展開する独立系大手投資調査会社です。米国 Morningstar は、個人投資家、ファイナンシャル・アドバイザー、資産運用会社およびアセットオーナー、退職プランのプロバイダーやスポンサー、および債券市場やプライベート資本市場の機関投資家の皆様に、多岐にわたる商品やサービスを提供しています。商品やサービスには、資産運用商品、上場企業、プライベート資本市場、債券など幅広い投資対象を網羅するデータや調査・分析、リアルタイムで配信する世界のマーケットデータなどがあります。また、投資アドバイザリーを専門とする子会社を通じて資産運用サービスも手掛け、2021 年 6 月 30 日現在の助言・運用資産残高はおよそ 2,510 億ドルに上ります。米国 Morningstar は、世界 29 カ国に事業拠点を展開しています。米国 Morningstar の更なる情報は、www.morningstar.com/company をご覧ください。また、ツイッターのアカウントは @MorningstarInc です。

当プレスリリースは英語の原文を元に作成しています。原文は[こちら](#)をご参照ください

###

©2021 Morningstar, Inc. All Rights Reserved.

MORN-R