

報道発表資料

モーニングスター・サステイナリティクス、上場企業の気候変動物理メトリクスを拡充

気候変動物理メトリクスにより、投資家は投資先企業の直接・間接的な気候変動リスクが財務に与える影響を評価することができます。

2023年6月22日、トロント発

環境・社会・ガバナンス（ESG）の調査、レーティング、データで業界を代表する**モーニングスター・サステイナリティクス**は、気候変動物理リスクに関する企業のエクスポージャー、損失、財務抵抗力についてより深い見解を提供する2つのレポートの新規追加を含む、**気候変動物理メトリクス**製品の拡充を発表しました。これらのレポートには、気候関連財務情報開示タスクフォース（TCFD）が推奨する、直接のおよび間接的な物理的リスクの開示に対応し、ビジネス・バリューチェーン全体にわたる洞察を提供するために、新たに間接リスク指標が追加されています。

気候変動に関する政策の取り組みが地球温暖化を食い止めるのに不十分で、気候変動が不可逆的になり、関連する物理的リスクによって深刻な影響を受ける温暖化進行（Hot House World）シナリオでは、**気候変動物理メトリクス**の対象ユニバース内で、平均的な気候変動物理リスクのエクスポージャーを持つ企業は、現時点から2050年の間に**累積営業キャッシュフロー1ドルにつき0.45ドル**相当の損失を被る可能性が示唆されています。サステイナリティクスの投資家向け気候変動対策ソリューションの一環として提供する包括的な気候変動物理メトリクスのデータセットは、企業の収益、物理的な資産価値、営業キャッシュフローを考慮し、気候変動物理リスクの財務的影響を可視化するものです。

モーニングスター・サステイナリティクスの気候変動対策ソリューション担当のシニア・バイスプレジデントであるアザデ・サブールは、次のように述べています。

「脱炭素化を加速させるため、また地球温暖化の影響を緩和するための限られた時間の中で、気候変動関連の規制の導入が世界中で進むにつれ、投資家は、ますます頻発し被害も大きい気候現象から生じる財務リスクへのエクスポージャーを理解するためのデータと洞察を必要としています。最近発表した**低炭素移行レーティング(Low Carbon Transition Ratings)**によるネット・ゼロの公約達成への洞察、及び気候変動物理メトリクスによる資産レベルのデータに基づく洞察によって、TCFDのガイダンスに沿った一連の気候変動対策ソリューションを提供し投資家を支援します。」

気候変動物理メトリクスは甚大な被害をもたらす暴風・豪雨、山火事、洪水などを含む物理的災害による気候変動に関連する悪影響をボトムアップで評価するものです。このデータセットは、投資家がTCFDの推奨に沿った行動をとることを支援し、現時点から2050年の間に予想される企業の財務的損失について透明性を提供することができます。気候変動物理リスク分析のリーダー的存在として数々の賞を受賞しているXDI（Cross Dependency Initiative）と共同で開発されたこれらの指標は、12,000社以上、1,200万個の資産、135分野、235カ国にまたがる企業をカバーしています。

大量の資産レベルと気候データの収集と解析には、多くの投資家が利用できないような膨大な技術的リソースが必要です。また、エクスポージャーを定義するための資産レベルのデータは、これまで利用可能なものが限られていました。気候変動物理メトリクスにより、投資家は投資先企業が直面する気候変動物理リスクを定量化し、特定の災害、国、推定される資産被害、推定される収益減少、時系列、気候シナリオなど、複数の評価の視点を利用することができます。

モーニングスター・サステナビリティの**気候変動物理メトリクス**は、現在、データサービスを通じて5つのレポートの標準パッケージとして提供されており、会社レベルのレポートは、今年後半にオンラインクライアントポータル「グローバルアクセス」を通じて提供される予定です。モーニングスター・サステナビリティの気候変動物理メトリクスおよび気候変動対策ソリューションの詳細については、[こちら](#)をご覧ください。

モーニングスター・サステナビリティについて

モーニングスター・サステナビリティは、ESG データ、調査、レーティングで業界を代表する企業として、世界中の投資家の責任投資戦略の策定と実行をサポートしています。30年以上にわたり、世界の投資家の変わりゆくニーズに応えるため、高品質かつ革新的なソリューションの開発により業界の先駆者であり続けています。現在、モーニングスター・サステナビリティは、ESG 情報や評価を投資プロセスに組み込んでいる世界有数の資産運用会社や年金基金向けにサービスを提供しており、また数百の企業や金融仲介業者と連携し、政策、実務、資本プロジェクトにおいてサステナビリティを考慮できるよう支援しています。モーニングスター・サステナビリティには、40以上の業界グループにわたるさまざまな学際的な専門知識を持つアナリストが世界中にいます。詳細については、www.sustainalytics.com をご覧ください。

モーニングスター・サステナビリティは、様々なレーティング、評価、指標を作成していますが、これには将来の事象に関する仮定が含まれており、これらの事象は発生する可能性もあれば発生しない可能性もあり、また仮定と大きく異なる可能性もあります。これらのレーティング、評価、指標は意見を述べたものであり、今後変更される可能性があり、いかなる将来を保証するものではなく、また、投資判断の唯一の根拠として使用されるべきものではありません。モーニングスター・サステナビリティは、投資助言やその他の（金融）助言を提供するものではなく、本プレスリリース内のいかなるものも、そのような助言に該当するものではありません。

「将来の見通しに関する記述」に関する注意事項

本プレスリリースには、米国の「1995年私的証券訴訟改革法（Private Securities Litigation Reform Act of 1995）」において使われている用語「将来の見通しに関する記述」が含まれています。これらの記述は、将来の事象または将来の業績に関する当社の現時点における予想に基づくものです。

「将来の見通しに関する記述」は本質的に、程度の差はあるもの、不確実である事柄に対処するものであり、同記述には多くの場合、「ありうる（may）」、「可能性がある（could）」、「予想している（expect）」、「意図している（intend）」、「計画している（Plan）」、「追及している（seek）」、「期待している（anticipate）」、「確信している（believe）」、「推測している（estimate）」、「予測している（predict）」、「潜在的な（potential）」、「継続する（continue）」、という文言が含まれています。これらの記述には、既知及び未知のリスク及び不

確実性が含まれており、当社が議論している事象が発生しない、あるいは当社が期待する事象と大きく異なる可能性があります。当社にとって、これらのリスクおよび不確実性には、特に、当社の製品およびサービス提供の刷新や顧客のニーズの変化を予測することに失敗することが含まれます。これらのリスクおよび不確実性の詳細な説明は、当社の最新の年次報告書（Form 10-K）を含む、米証券取引委員会（SEC）に提出した書類に記載されています。これらのリスクや不確実性が顕在化した場合、当社の実際の将来における業績やその他の将来における事象は、当社の期待するものと大きく異なる可能性があります。当社は、新たな情報または将来の事象により、将来予想に関する記述を更新する義務を負いません。

###

©2023 Morningstar, Inc. All Rights Reserved.

メディアのお問い合わせ先：

Lee Reisch, +1 647 264-3775 or lee.reisch@morningstar.com

Ruqayyah Mohammed, +1 647 646-6487 or ruqayyah.mohammed@morningstar.com