

世界最大級の年金基金 GPIF が日本を対象とした MSCI の新しい ESG 指数を採用、ESG 統合を加速

- MSCI は日本株を対象に 2 つの新しい ESG 指数をローンチ

東京 – 2017 年 7 月 3 日 – 本日、リサーチ・ベースのインデックスやポートフォリオ分析ツールを提供し、ESG（環境／社会／ガバナンス）指数の世界最大手¹である MSCI 社（NYSE:MSCI）は、**MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数**と **MSCI 日本株女性活躍指数（WIN²）**という 2 つの新しい ESG 指数をローンチしました。

世界最大級の年金基金である年金積立金管理運用独立行政法人（以下、GPIF）は、その ESG 投資戦略におけるベンチマークとして、これら 2 つの先進的 ESG 指数を採用しました。このことは、機関投資家の投資プロセスにおいて MSCI の ESG 指数を活用する動きがますます増えていることを表しています。

MSCI 日本株女性活躍指数（WIN）は、より多くの女性が職場に進出又は復帰しやすくなるような女性活躍への取組みを推進する企業で構成されます。最近の調査によると、より多くの女性が職場で活躍することにより、日本経済は大きな恩恵を受ける可能性があることが示唆されています。そのため、日本政府は企業社会における女性参加と昇進を促すための明確な目標を設定しています。

<女性の雇用状態に関する日本の現状>

| 性別多様性を図る指標 | 中央値 | 最大値 | 指標を公開している企業の比率 |
|-----------------------|------|-----|----------------|
| 1. 新規採用者における女性比率 | 25% | 85% | 62% |
| 2. 全従業員における女性比率 | 17% | 94% | 69% |
| 3. 女性従業員の平均雇用年数の男性との差 | -17% | 41% | 70% |
| 4. 管理職における女性比率 | 4% | 57% | 73% |
| 5. 取締役会における女性比率 | 10% | 38% | 100% |

MSCI ジャパン IMI 指数における時価総額上位 500 銘柄を対象。2016 年 12 月 1 日現在時点の開示データ。MSCI ESG リサーチ調べ。

MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数は、業種内において ESG 評価の高い企業で構成されます。MSCI の ESG 格付けを活用し、親指数である MSCI ジャパン IMI 指数における時価総額上位 500 銘柄の各業種の中から ESG パフォーマンスに優れた企業を選定することで、機関投資家が投資プロセスに ESG を統合することを可能とします。

¹FTSE と S&P ダウ・ジョーンズの公開情報によるインデックスとインデックス連動型アセットにおいて。

²WIN は Women's Index の略称です。

インデックス部門のグローバル・ヘッドであるダイアナ・ティッドは、次のように述べています。

「MSCI は、投資家がアセット・アロケーションや投資戦略を構築する際に利用可能な ESG 指数のリーディング・プロバイダーです。本日ローンチされた MSCI 日本株女性活躍指数（WIN）と MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数は、世界最大の年金投資家に対して、彼らが ESG を投資プロセスに統合するためにベンチマーク選定をする中で、我々が提供したソートリーダーシップとイノベーションを良く反映したものとなっています。」

MSCI の日本におけるインデックスと ESG ビジネスヘッドである内 誠一郎は、次のように述べています。「GPIF が ESG 投資を始めるにあたり、MSCI が新たに開発した 2 指数が採用されたことを大変喜ばしく思います。今回 MSCI がローンチした 2 指数は、ESG インテグレーションがますます重要になっている中、職場の多様化が日本の持続的経済発展の重要な要素となってきている今、時宜にかなったものとなっています。」

700 を超える様々な ESG 指数を算出する MSCI は、ESG 指数及び ESG リサーチにおけるリーダーです。MSCI の ESG 指数をベンチマークとする運用資産額は世界で 580 億米ドル（およそ 5.8 兆円）以上³に上ります。MSCI は、投資プロセス全体において ESG を統合するための完全な商品群を持っています。MSCI は、ESG リサーチと指数、ポートフォリオ分析について高い専門性を有しています。

以上

MSCI について

MSCI は、40 年以上にわたって、リサーチに基づく指数やポートフォリオ分析を提供することで、世界の主要な投資家がより良くポートフォリオを構築し管理することを支援してきました。MSCI のクライアントは、ポートフォリオのパフォーマンスとリスクの源泉に関する深い洞察と広い資産クラスカバレッジ、先進的リサーチを提供する MSCI のサービスを信頼しています。

MSCI の商品サービスには、指数やポートフォリオ分析ツール、データ、不動産ベンチマーク、ESG 分析が含まれます。

最新の P&I ランキングによると、MSCI はトップ 100 の資産運用会社のうち 97 社にサービスを提供しています。

詳細については、www.msci.com をご参照ください。

報道関係者からのお問合せ

Americas: Jennifer Compton jennifer@jandlcommunications.com

EMEA: MHP Communications MSCI@mhpc.com

Asia Pacific: FTI Consulting yasunori.fukuda@fticonsulting.com

投資家向け情報

Stephen Davidson +1 212 981 1090 stephen.davidson@msci.com

³ 2016 年 12 月時点のブルームバーグとモーニングスターおよび MSCI データに基づく。アクティブ運用資産残高は、2016 年 12 月 31 日時点の eVestment による 2017 年 3 月 31 日公表データ。

MSCI グローバルクライアントサービス

EMEA Client Service

+ 44 20 7618.2222

Americas Client Service

1 888 588 4567 (toll free)

Asia Pacific Client Service

+ 852 2844 9333

This document and all of the information contained in it, including without limitation all text, data, graphs, charts (collectively, the “Information”) is the property of MSCI Inc. or its subsidiaries (collectively, “MSCI”), or MSCI’s licensors, direct or indirect suppliers or any third party involved in making or compiling any information (collectively, with MSCI, the “Information Providers”) and is provided for informational purposes only. The Information may not be modified, reverse-engineered, reproduced or disseminated in whole or in part without prior written permission from MSCI.

The Information may not be used to create derivative works or to verify or correct other data or information. For example (but without limitation), the Information may not be used to create indexes, databases, risk models, analytics, software, or in connection with the issuing, offering, sponsoring, managing or marketing of any securities, portfolios, financial products or other investment vehicles utilizing or based on, linked to, tracking or otherwise derived from the Information or any other MSCI data, information, products or services.

The user of the Information assumes the entire risk of any use it may make or permit to be made of the Information. NONE OF THE INFORMATION PROVIDERS MAKES ANY EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES OR REPRESENTATIONS WITH RESPECT TO THE INFORMATION (OR THE RESULTS TO BE OBTAINED BY THE USE THEREOF), AND TO THE MAXIMUM EXTENT PERMITTED BY APPLICABLE LAW, EACH INFORMATION PROVIDER EXPRESSLY DISCLAIMS ALL IMPLIED WARRANTIES (INCLUDING, WITHOUT LIMITATION, ANY IMPLIED WARRANTIES OF ORIGINALITY, ACCURACY, TIMELINESS, NON-INFRINGEMENT, COMPLETENESS, MERCHANTABILITY AND FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE) WITH RESPECT TO ANY OF THE INFORMATION.

Without limiting any of the foregoing and to the maximum extent permitted by applicable law, in no event shall any Information Provider have any liability regarding any of the Information for any direct, indirect, special, punitive, consequential (including lost profits) or any other damages even if notified of the possibility of such damages. The foregoing shall not exclude or limit any liability that may not be excluded or limited, including without limitation (as applicable), any liability for death or personal injury to the extent that such injury results from the negligence or willful default of itself, its servants, agents or sub-contractors.

Information containing any historical information, data or analysis should not be taken as an indication or guarantee of any future performance, analysis, forecast or prediction. Past performance does not guarantee future results.

The Information should not be relied on and is not a substitute for the skill, judgment and experience of the user, its management, employees, advisors and/or clients when making investment and other business decisions. All Information is impersonal and not tailored to the needs of any person, entity or group of persons.

None of the Information constitutes an offer to sell (or a solicitation of an offer to buy), any security, financial product or other investment vehicle or any trading strategy.

It is not possible to invest directly in an index. Exposure to an asset class or trading strategy or other category represented by an index is only available through third party investable instruments (if any) based on that index. MSCI does not issue, sponsor, endorse, market, offer, review or otherwise express any opinion regarding any fund, ETF, derivative or other security, investment, financial product or trading strategy that is based on, linked to or seeks to provide an investment return related to the performance of any MSCI index (collectively, “Index Linked Investments”). MSCI makes no assurance that any Index Linked Investments will accurately track index performance or provide positive investment returns. MSCI Inc. is not an investment adviser or fiduciary and MSCI makes no representation regarding the advisability of investing in any Index Linked Investments.

Index returns do not represent the results of actual trading of investible assets/securities. MSCI maintains and calculates indexes, but does not manage actual assets. Index returns do not reflect payment of any sales charges or fees an investor may pay to purchase the securities underlying the index or Index Linked Investments. The imposition of these fees and charges would cause the performance of an Index Linked Investment to be different than the MSCI index performance.

The Information may contain back tested data. Back-tested performance is not actual performance, but is hypothetical. There are frequently material differences between back tested performance results and actual results subsequently achieved by any investment strategy.

Constituents of MSCI equity indexes are listed companies, which are included in or excluded from the indexes according to the application of the relevant index methodologies. Accordingly, constituents in MSCI equity indexes may include MSCI Inc., clients of MSCI or suppliers to MSCI. Inclusion of a security within an MSCI index is not a recommendation by MSCI to buy, sell, or hold such security, nor is it considered to be investment advice.

Data and information produced by various affiliates of MSCI Inc., including MSCI ESG Research LLC and Barra LLC, may be used in calculating certain MSCI indexes. More information can be found in the relevant index methodologies on www.msci.com.

MSCI receives compensation in connection with licensing its indexes to third parties. MSCI Inc.’s revenue includes fees based on assets in Index Linked Investments. Information can be found in MSCI Inc.’s company filings on the Investor Relations section of www.msci.com.

MSCI ESG Research LLC is a Registered Investment Adviser under the Investment Advisers Act of 1940 and a subsidiary of MSCI Inc. Except with respect to any applicable products or services from MSCI ESG Research, neither MSCI nor any of its products or services recommends, endorses, approves or otherwise expresses any opinion regarding any issuer, securities, financial products or instruments or trading strategies and MSCI’s products or services are not intended to constitute investment advice or a recommendation to make (or refrain from making) any kind of investment decision and may not be relied on as such. Issuers mentioned or included in any MSCI ESG Research materials may include MSCI Inc., clients of MSCI or suppliers to MSCI, and may also purchase research or other products or services from MSCI ESG Research. MSCI ESG Research materials, including materials utilized in any MSCI ESG indexes or other products, have not been submitted to, nor received approval from, the United States Securities and Exchange Commission or any other regulatory body.

Any use of or access to products, services or information of MSCI requires a license from MSCI. MSCI, Barra, RiskMetrics, IPD, FEA, InvestorForce, and other MSCI brands and product names are the trademarks, service marks, or registered trademarks of MSCI or its subsidiaries in the United States and other jurisdictions. The Global Industry Classification Standard (GICS) was developed by and is the exclusive property of MSCI and Standard & Poor’s. “Global Industry Classification Standard (GICS)” is a service mark of MSCI and Standard & Poor’s.