



ダウ・ジョーンズ・サステナビリティ・インデックス 2019 年レビュー結果

アムステルダム、ニューヨーク、チューリッヒ、2019 年 9 月 13 日:世界有数の金融市場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」という)は本日、**環境・社会・ガバナンス(ESG)**に関するデータ、評価、及びベンチマークを提供する SAM(RobecoSAM の一部門)と共同で、**ダウ・ジョーンズ・サステナビリティ・インデックス**(以下、「DJSI」という)に関する年次のレビュー結果を発表しました。DJSI ワールドは、企業の ESG 行動を測定及び促進するためのグローバル・スタンダードであり、今年で 20 周年を迎えます。

今年、DJSI ワールドに追加、及び DJSI ワールドから除外される、浮動株調整後時価総額が最も大きな 3 銘柄は以下になります。

追加: Alphabet Inc、CVS Health Corp、Reckitt Benckiser Group PLC

除外: Citigroup Inc¹、Royal Dutch Shell PLC、3M Co

全ての DJSI に含まれる新たな構成銘柄のレビュー結果については、[RobecoSAM のウェブサイト](#)をご覧ください。全ての変更は、2019 年 9 月 23 日(月曜日)に有効となります。

DJSI ワールドは 1999 年から ESG 評価のパイオニア的存在であり、ESG 行動を促進している

DJSI ワールドは今年で 20 周年を迎えます。1999 年に算出を開始した DJSI ワールドは、企業の ESG 行動を測定及び促進するためのグローバル・スタンダードとして広く認められており、持続可能性を重視する大手市場企業のパフォーマンスに連動する最初のグローバル指数となっています。

SAM は、財務的に重要な ESG 要因の分析に基づいたコーポレート・サステナビリティ評価(CSA)を毎年実施しており、この CSA の結果と、S&P DJI の堅固な指数メソドロジーは、DJSI シリーズ全体を構築及び維持する上での基礎となっています。CSA は、ルールに基づく厳格なメソドロジーに従って実施されています。財務的に重要かつ業界固有の様々な ESG 基準を適用した後、各企業にトータル・サステナビリティ・スコアが割り当てられます。このトータル・サステナビリティ・スコアに基づき、ベスト・イン・クラスのアプローチに従って各業界で上位 10%以内に入った企業が DJSI ワールドに採用されます。

CSA は進化を続けている

CSA では毎年、評価基準を引き上げており、調査や報告が十分に行われていない重要な ESG 要因を特定及び測定するために改善を重ねています。こうした取り組みにより、持続可能性に関する将来の課題や機会に適切に対応できる企業を見つけることが可能となります。CSA では現在、各企業につき約 1,000 のデータ・ポイントを作成しており、CSA は DJSI への採用を判断する際の重要な基礎となっています。

CSA では、現時点で重要な持続可能性テーマと、企業に対して財務的に重要な影響を及ぼす可能性のある将来的な持続可能性問題の両方に関して、一貫した情報開示を行うように企業に働きかけています。

¹引き続き DJSI 北米の構成銘柄となっています。



ESG Data,
Ratings &
Benchmarking

例えば今年、「情報セキュリティ、サイバーセキュリティ、及びシステムの利用可能性」や、「個人情報保護」、「生活賃金」に関する既存の CSA 基準が、経営管理や開示の向上に対するニーズに基づいて、さらに強化されました。

CSA における [認知されているクオリティや頑健性](#) は、サステナビリティ・パフォーマンスを測定し、改善することを目指している企業から大きな関心を集めています。このことは、主流の投資家の期待を満たす上で、企業の ESG パフォーマンスの開示が必要になっていることを示しています。ここ数年において、DJSI のパイオニアが描いていた通り、投資コミュニティは ESG 要因を投資判断に統合することにますます重点を置いています。

###

以下に関する追加情報をお求めの方は以下のリンクをご覧ください。

- DJSI やその構成銘柄の変更に関する詳しい情報については、[DJSI review page](#) または [DJSI World product page](#) をご覧ください。
- 業種ごとの上位パフォーマンス企業に関する詳しい情報については、[Industry Leader Reports 2019](#) をご覧ください。
- 今年の CSA に関する詳しい情報については、[Annual Methodology & Scoring Review](#) (または当社の [webcasts](#) に登録)
- CSA メソドロジーに関する詳しい情報については、[CSA Resource Center](#) 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、指数ベースのコンセプトやデータ、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、S&P 500® 及びダウ・ジョーンズ工業株平均® といった金融市場の代表的指標を算出しています。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、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、広範なアセット・クラスをカバーする指数を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。

ROBECOSAMについて

RobecoSAMは、1995年設立のサステナビリティ投資に特化した投資専門会社です。同社では、資産運用、インパクト分析と投資、サステナビリティ評価、ベンチマーキング・サービス、ESGデータ等を提供しています。資産運用サービスとして、世界の機関投資家、アセットオーナーや金融仲介業者向けに、サステナビリティや資源有効活用のテーマ戦略や、国連の持続可能な開発目標(SDGs)に注目した運用戦略を提供し、優れた実績を残しています。RobecoSAMは、SAMスマートESGメソドロジーを使用し、ESGを単独のファクターとして初めて取り扱いました。RobecoSAMは1999年以降、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスと提携し、世界的に認知されているダウ・ジョーンズ・サステナビリティ・インデックス(DJSI)を公表しています。同社は、コーポレート・サステナビリティ評価(CSA、4,700社を超える上場企業の年次の分析)に基づき、世界最大級の財務上重要なサステナビリティ情報の包括的なデータベースを構築しています。また、Robecoの運用資産のうち1,360億米ドルは、運用プロセスにデータの活用が組み入れられています。



ESG Data,
Ratings &
Benchmarking

RobecoSAMは1929年にオランダで設立された資産運用会社Robecoの関連会社です。両社は共同ミッション（優れた投資リターンとソリューションを提供することによりお客様が財務目標とサステナビリティ目標を達成することができること）を共有しています。Robecoは、オリックス・コーポレーションの子会社であるオリックス・コーポレーション・ヨーロッパN.V.の100%子会社です。

Robecoはサステナビリティ投資実現へのコミットメントの反映として、国連責任投資原則（UNPRI）や国連グローバル・コンパクト、クライメート・アクション100+の署名機関となっており、気候関連財務情報開示タスクフォース（TCFD）を支持し、Eurosif、スイス・サステナブル・ファイナンス、カーボン・ディスクロージャー・プロジェクト（CDP）、ポートフォリオ脱炭素化連合（PDC）に加盟しています。2019年6月30日時点で、Robecoの顧客資産（運用、投資助言、ライセンス）は約243億米ドルにのぼります。

Important legal information:

S&P® is a registered trademark of Standard & Poor's Financial Services LLC ("S&P"), a division of S&P Global, Inc. Dow Jones® is a registered trademark of Dow Jones Trademark Holdings LLC ("Dow Jones"). These trademarks have been licensed to S&P Dow Jones Indices LLC ("S&P DJI"), a division of S&P Global, Inc. The Global Industry Classification Standard (GICS®) was developed by, and is the exclusive property and a trademark of, S&P and MSCI Inc.

The details given on these pages do not constitute an offer. They are given for information purposes only. No liability is assumed for the correctness and accuracy of the details given. It is not possible to invest directly in an index. S&P DJI, Dow Jones, S&P and their respective affiliates do not sponsor, endorse, sell or promote any investment fund or other investment product that is offered by third parties and that seeks to provide an investment return based on the performance of any index. S&P DJI does not make investment recommendations, and inclusion of a security within an index, and CSA results, are not recommendations by S&P DJI for the purchase or sale of any security or other asset or to pursue any investment strategy. This document is for information purposes only and does not constitute an offer of services in jurisdictions where S&P DJI does not have the necessary licenses. S&P DJI receives compensation for licensing its indices to third parties.

**SAM is a registered trademark of RobecoSAM AG. SAM is used to market services and products of business units within RobecoSAM, which specialize in providing ESG data, ratings, and benchmarking. Operating under SAM are two specialist business areas: "ESG Ratings", which is responsible for the Corporate Sustainability Assessment (CSA), from the methodology behind the assessment, to the annual data collection, through to the evaluation and scoring of individual companies, and also contributing the data to S&P Dow Jones Indices for their indices. "ESG Benchmarking" provides to companies, experts, and practitioners a range of unique services to evaluate companies' sustainability performance, based on CSA results and by comparing it to best practice. SAM is not to be considered as a separate legal entity. **Robeco has both functional oversight on RobecoSAM and majority representation in its Board of Directors.*

The details given on these pages do not constitute an offer. They are given for information purposes only. No liability is assumed for the correctness and accuracy of the details given. The securities identified and described may or may not be purchased, sold, or recommended for advisory clients of RobecoSAM. It should not be assumed that an investment in these securities was or will be profitable. Copyright© 2019 RobecoSAM – all rights reserved.

お問い合わせ

**S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス
クライアント・サービス:**

(日本語) IndexServicesTokyo@spglobal.com

03-4550-8564

(英語) spdji.comms@spglobal.com

RobecoSAM

Corporate Communications:

com@robecosam.com

www.robecosam.com