

2021年1月25日
ブルムバーグ・エル・ピー

* 本プレスリリースは Bloomberg が 2021 年 1 月 11 日に英語で発表を行ったプレスリリースを日本語に翻訳・再編集したものです。オリジナルのプレスリリースの正式言語は英語であり、この内容および解釈については下記の英語版が優先となります。英文オリジナルにつきましては[こちらのサイト](#)をご参照ください。

ブルームバーグとロックフェラー・アセット・マネジメントが ESG インクルーバース指数の提供を開始

ロックフェラーESG インクルーバース・スコアを組み込むことで、時価総額加重型指数をアウトパフォームする可能性を秘めたマルチファクター指数の提供を実現しました。

【ニューヨーク – 2021 年 1 月 11 日】ブルームバーグとロックフェラー・アセット・マネジメントはブルームバーグの情報端末から、ブルームバーグ・ロックフェラー米国オールキャップ・マルチファクターESG インクルーバース指数を提供開始すると発表しました。当指数は、ブルームバーグの広く認知されたリスクモデル、データ、指数の各機能と、ロックフェラー・アセット・マネジメントが持つ 40 年にわたる ESG 専門知識を融合したものです。企業が ESG において先発か後発かのスクリーニングを重視する他の指数とは異なり、当指数では、ESG における重要事項に対する企業の取り組みがいかに向上しているかを、他社との比較に基づいてランク付けしています。

このマルチファクター指数は、独立性と独自性があるため有益なロックフェラーESG インクルーバース・スコアと品質ファクターおよび低ボラティリティファクターを組み合わせ成り立っています。またそこには、トラッキングエラーを抑えてセクターまたはその他のファクターの偏差を最小限に保ちつつ、従来タイプの時価総額加重型指数をアウトパフォームすることも追及しています。もう 1 つの特徴としては、株主価値を創造しプラスの変化を促進する、株主エンゲージメントの手法を採用していることです。

ロックフェラー・アセット・マネジメントのマネージング・ディレクター兼 ESG 投資部門グローバル責任者のケイシー・クラーク (Casey Clark) 氏は次のように述べています。「投資家はますます ESG の先駆者的企業と ESG のインクルーバース (ESG の取り組みにおいて大きく改善を示す企業) を区別していくと考えられます。そして、後者の方が、他の要素に影響を受けないプラスを長期的に生む可能性があります」

ブルームバーグのインデックス・プロダクト・マネジメント部門責任者のアラン・キャンベル (Alan Campbell) 氏は次のように述べています。「機関投資家は昨今、内在する ESG ファクターやトレンドに注目しています。そのため、ブルームバーグは指数商品を拡張し、ESG の取り組みにおいて大きく改善を示す企業も含めることとしました。ブルームバーグはロックフェラー・アセット・マネジメントと協働し、高品質かつ低ボラティリティの企業を対象とした指数商品を投資家に提供し、ESG 分野にプラスの潮流を生み出していきます」

Bloomberg

ロックフェラー・アセット・マネジメントのマネージング・ディレクター兼ビジネスストラテジー&コーポレート・デベロップメント部門ヘッドのチップ・モントゴメリー(Chip Montgomery)氏は述べています。「マルチアセット指数提供社としてのブルームバーグの実績とESG分野におけるロックフェラー・アセット・マネジメントの経験を考慮すると、ESGの取り組みにおいて大きく改善を示す企業のベンチマークを市場に投入するパートナーシップを築くのは当然のことと言えます」

当指数に関する詳細は、[こちら](#)をご参照ください。ブルームバーグでは、世界中のお客さま向けに指数サービスを提供するため、独立した透明性の高いアプローチを用いています。当指数は、ブルームバーグの英国金融行動監視機構(FCA)が承認したベンチマーク管理者、ブルームバーグ・インデックス・サービスズ・リミテッド(BISL)により管理されています。BISLは、指数の算出、ガバナンス、および提供に責任を負います。

ブルームバーグについて

ブルームバーグは、世界のビジネス・金融情報およびグローバルニュースを提供する情報サービス企業です。情報・人・アイデアをダイナミックなネットワークでつなぎ、有力な意思決定権者にビジネスの勝敗を左右する強力な情報ツールを提供します。ブルームバーグの最大の強みは、迅速かつ正確なデータ、ニュース、分析機能を革新的な技術を用いて提供していることで、これがブルームバーグターミナル・サービスの中核を成しています。ブルームバーグのエンタープライズ・ソリューションは、この中核となる情報・技術の上に構築されており、組織全体におけるデータや情報へのアクセスから統合、配信、管理まで、より効率的かつ効果的な業務遂行を支援します。詳細については、www.bloomberg.com をご覧いただくか、[デモをリクエスト](#)してください。

ロックフェラー・アセット・マネジメントについて

ロックフェラー・キャピタル・マネジメントに属するロックフェラー・アセット・マネジメントは、グローバル、米国、米国以外の環境・社会・ガバナンス(ESG)株式戦略に加え各種の非課税・課税対象債券戦略を、機関投資家、富裕層、ファミリーオフィス向けに提供しています。グローバル投資に30年以上の経験を持つ同社は、従来型・非従来型分析を組み合わせた詳細なファンダメンタル・リサーチに独自の世界観と長期的投資観を取り入れています。連携性の高いチーム文化のもと、統制された投資プロセスに基づき、市場周期の各局面にわたりベンチマークのアウトパフォーマンスを目指す戦略を提供しています。2020年9月30日時点でロックフェラー・アセット・マネジメントの運用資産額は100億ドルです。詳細は、<https://rcm.rockco.com/ram> をご参照ください。