

2022 年 10 月 31 日
ブルームバーグ・エル・ピー

*本プレスリリースは Bloomberg が 2022 年 10 月 31 日(現地時間)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。

ブルームバーグが、グリーン、ソーシャル、サステナビリティボンドの グローバル債券インデックスを提供開始

環境・社会的利益をもたらすプロジェクトにファイナンスする債券の新しいベンチマーク

【ニューヨーク - 2022 年 10 月 31 日】ブルームバーグは本日、「ブルームバーグ・グローバル総合グリーン/ソーシャル/サステナビリティボンド・インデックス (Bloomberg Global Aggregate Green, Social, Sustainability Bond Indices)」の提供を開始し、当社の主要 [ESG 債券インデックス](#) をさらに拡大することを発表しました。本インデックスは、ブルームバーグ・グローバル総合インデックスをベースとし、グリーンボンド、ソーシャルボンド、サステナビリティボンドに関する、ブルームバーグ・サステナブル・ファイナンス・グループのインジケーター、さらに国際資本市場協会 (ICMA) が発行する原則およびガイドラインに沿った定義を活用するものです。

数多くの受賞歴を誇る、ブルームバーグの ESG データチームのデータセットとともに本インデックスを提供開始することにより、ブルームバーグターミナルをご利用されるお客様は、適格プロジェクトのカテゴリおよびサブカテゴリへの資金配分の用途や、国際連合の持続可能な開発目標 (SDGs) との整合性など、債券に関する文書の透明性からも、メリットを得ることができます。これにより、パフォーマンスや要因分析を含む、ポートフォリオ管理ワークフロー全体において、よりシームレスに統合することが可能です。新たに提供開始した「サステナブル・インデックス適格性インジケーター (Sustainable Index Eligibility Indicator)」の定義により、ブルームバーグターミナルをご利用のお客様は、現状本インデックスに含まれている債券だけでなく、除外の可能性のある債券も分析することができます。

対象資産クラスは、社債やソブリン債、国際機関債、エージェンシー債といった SSA 債、地方債、仕組債など多岐にわたります。ブルームバーグの債券や ESG データを担当するチームが、各債券について個別に調査・管理し、幅広いデータ収集・処理の技術を活用して、迅速かつ適切に債券の審査とタグ付けがされることを保証します。さらに、全ての債券は発行体によるインパクトレポートとアロケーションレポートの提出を通じて、継続的な報告が確認されるように審査されます。このようなプロセスにより、本インデックスに組み入れられるサステナブル債券の適格性が担保されます。

ブルームバーグのインデックス部門でサステナブル・インデックス・プロダクト・マネージャーを務めるジョナサン・ガーディナーは、次のように述べています。「私たちはサステナブル・インデックスを提供し、短期と長期の両方の市場トレンドを捉えることに努めています。BloombergNEF がまとめたデータによると、2022 年の世界のサステナブル債の発行額はすでに 1 兆ドルを超え、急速に拡大しています。ブルームバーグの主要なグローバル総合インデックスをベースに、当社の新しいグローバル総合グリーン/ソーシャル/サステナビリティボンド・インデックスは、この成長市場を探る投資コミュニティのさまざま

なニーズを満たす多様なインデックスを提供するべく、当社の債券・ESG データチームの研究者も取り入れています」

本インデックスは現在、ベンチマーク作成、資産配分、金融商品組成の目的でご利用いただくことができます。また、個々の投資家のニーズに合わせてカスタマイズすることが可能で、特定の除外項目、サステナブルファイナンス開示規則(SFDR)や EU タクソミー規則などの規制を考慮した項目、さらにはセクターごとの加重といった追加項目を用いることができます。

ブルームバーグ・グローバル総合グリーン/ソーシャル/サステナビリティ債券・インデックスは、下記のインデックスを含む、24 の新たなインデックスで構成されています。

- ブルームバーグ・グローバル総合グリーン/ソーシャル/サステナビリティ債券・インデックス (Bloomberg Global Aggregate Green Social Sustainability Bond Index、ティッカー: I37363US)
- ブルームバーグ・グローバル総合グリーン債券・インデックス (Bloomberg Global Aggregate Green Bond Index、ティッカー: I37364US)
- ブルームバーグ・グローバル総合ソーシャル債券・インデックス (Bloomberg Global Aggregate Social Bond Index、ティッカー: I37365US)
- ブルームバーグ・グローバル総合サステナビリティ債券・インデックス (Bloomberg Global Aggregate Sustainability Bond Index、ティッカー: I37356US)
- ブルームバーグ・ユーロ総合グリーン/ソーシャル/サステナビリティ債券・インデックス (Bloomberg Aggregate EUR Green Social Sustainability Bond Index、ティッカー: I37358EU)
- ブルームバーグ・米ドル総合グリーン/ソーシャル/サステナビリティ債券・インデックス (Bloomberg Aggregate USD Green Social Sustainability Bond Index、ティッカー: I37375US)

ブルームバーグの ESG および気候インデックスは、投資家が資産クラスを横断的にサステナブルファイナンスに取り組めるよう支援します。先日、ブルームバーグは、グリーン、ソーシャル、サステナビリティの地方債を追跡する「[ブルームバーグ米国地方債インパクト・インデックス](#)」および、パリ協定整合ベンチマークを含む「[ブルームバーグ気候インデックス](#)」の提供を開始しました。

ブルームバーグ端末をご利用いただいているお客様は、ブルームバーグターミナル上で利用可能なインデックスにアクセスすることができ、インデックスのすべてのリサーチと算出法は[こちら](#)からご覧いただくことができます。ブルームバーグは、独立した透明性の高いアプローチで、世界中のお客様にインデックスを提供しています。当社のサステナブル・ファイナンス・ソリューションズの詳細については、[こちら](#)をご覧ください。

ブルームバーグ・インデックス・サービス・リミテッドについて

ブルームバーグのインデックスチームは、ベストインクラスの債券インデックスやコモディティインデックスなど、資産クラスを問わず、業界をリードするオーダーメイドのインデックスを開発してきた実績を誇ります。ブルームバーグ・インデックス・サービス・リミテッド (BISL) は、革新的なアプローチで、市場参加者の進化するニーズを満たす戦略的ベンチマークを提供しています。ブルームバーグの重要な一部として、計算・分析・ワークフローの自動化で活用する、包括的な信頼性の高いデータと技術を有しており、さらに、顧客の皆様の商品の認知度の向上をご支援する、データ・技術を提供しています。

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・金融情報のリーディング・カンパニーとして、市場に透明性、効率性、公正性をもたらす、信頼性の高いデータ、ニュース、インサイトを提供しています。当社は、お客様がより多くの情報に基づいた意思決定を行い、より良いコラボレーションを促進することを可能にする信頼性の高いテクノロジー・ソリューションを通じて、世界の金融エコシステムにおいて影響力のあるコミュニティをつなぐ支援をしています。

詳細については、[こちら](#)をご覧くださいか、[デモをリクエスト](#)してください。

報道関係者お問い合わせ先

ブルームバーグ広報代行: アシュトン・コンサルティング ac-bloomberg@ashton.jp