

# リフィニティブ・リッパー・ファンドESGスコア

## サステナビリティな投資への移行のための重要なデータ指標

リフィニティブは、投資業界にとって、透明かつ正確で比較可能な環境、社会、ガバナンス（ESG）データおよび分析の重要性が高まっていることに伴い、お客様の投資プロセスのバックボーンとして、最高のデータ、分析、ワークフローソリューションを市場に提供することをお約束いたします。

リフィニティブ・リッパー・ファンドESGスコアを使用することにより、ESG要因をポートフォリオ分析、株式調査、スクリーニング、または定量分析に簡単に統合することが可能になります。

33万以上のファンドをカバーするリフィニティブ・リッパーの主要なグローバルファンドデータベースと、グローバル時価総額の80%の主要なESG適格ファンドユニバースを組み合わせ、透明性かつ客観的に優れた、統合的なファンドESGスコアを算出します。

このデータセットは、グローバルデータフィードとAPIを通じて、デスクトップEikon、Refinitiv Workspaceを含む多くの製品で利用できます。

### ESG データセット及びスコアリング

リフィニティブは業界で最も包括的なESGのデータベースを提供しています。2002年までのヒストリカルデータを有する450を超えるESGメトリックを、グローバルに継続的に成長している9,000の企業で利用できます。

リフィニティブのESGスコアは、環境、社会、ガバナンスの3つの柱にまたがる10の主要なテーマについて、企業の相対的なESGパフォーマンス、コミットメント、効果を透過的かつ客観的に測定するように設計されています。

下記の2つの総合的なESGスコアを組み込んでいます。

- ESGスコア-パブリックドメインで検証可能なレポートデータに基づき、企業またはファンドのESGパフォーマンスを測定します。
- ESG複合（ESGC）スコア- ESGスコアとESG論争（ネガティブイベントの影響）を重ね合わせることで、企業のサステナビリティへの影響や行動をほぼリアルタイムで総合的に評価します。

E、S、およびGの個々の柱に従い、ファンドまたは会社がどのように企業活動を行ったかを確認するための3つの柱の合計スコアがあります。

### 公平性・客観性

リッパーでは、スコアリングシステムを業界で最も客観的なものとするに引き続き取り組んでおり、ESGスコアはデータ主導のアプローチで計算されています。ESGスコアリングの算出法は、ESGスコアのメソロジーに詳述されています。

広範な計算原理。3つのコアとなるもの：

相対ベンチマーク-正確なピア分析を提供する同業界および国のスコアリング

重要性マトリックス- ESG要因の重要性は業界によって異なるため。主要評価要因のスコア付けは、各ESGテーマの各業界グループに対する相対的な重要性を決定します。

透明性の重み付け-各会社の開示データは算出法のキー・ポイントです。データポイントが報告されない場合、企業スコアに悪影響を及ぼします。

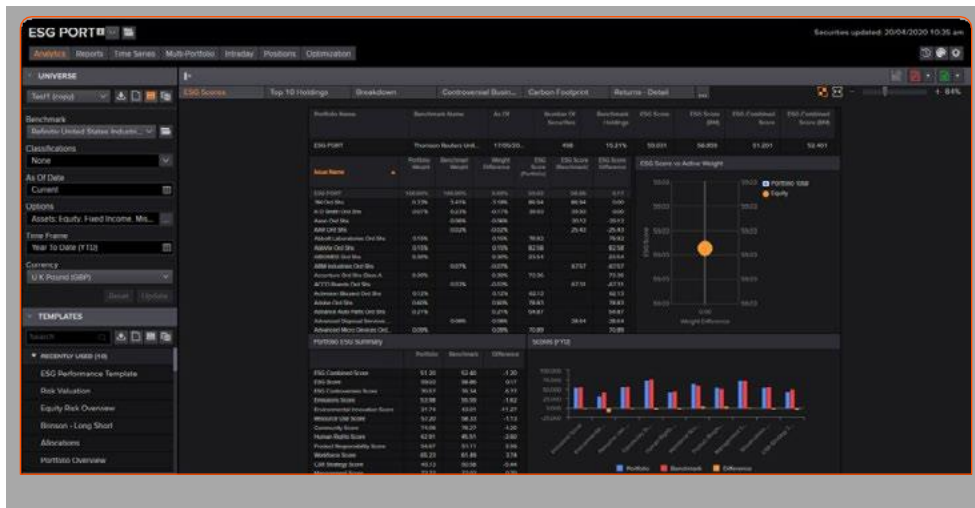


### ポートフォリオ アナリティクス

分析ツール一式は、ポートフォリオ内の構成要素が同業他社、ベンチマークに対してどのように実行されているかを示します。ESGスコアで特定された10の主要なテーマに対して各ファンドの保有状況がどのように実行されているかについてより詳細な見解を得ることが可能になります。

ESG分析ツールによるポートフォリオのエクスポージャーの要約分析をご覧ください。

スコアは、クライアントがESGの基礎となるメトリック、分析、またはスコアを評価し、投資プロセスおよびワークフローに統合できるように設計されています。



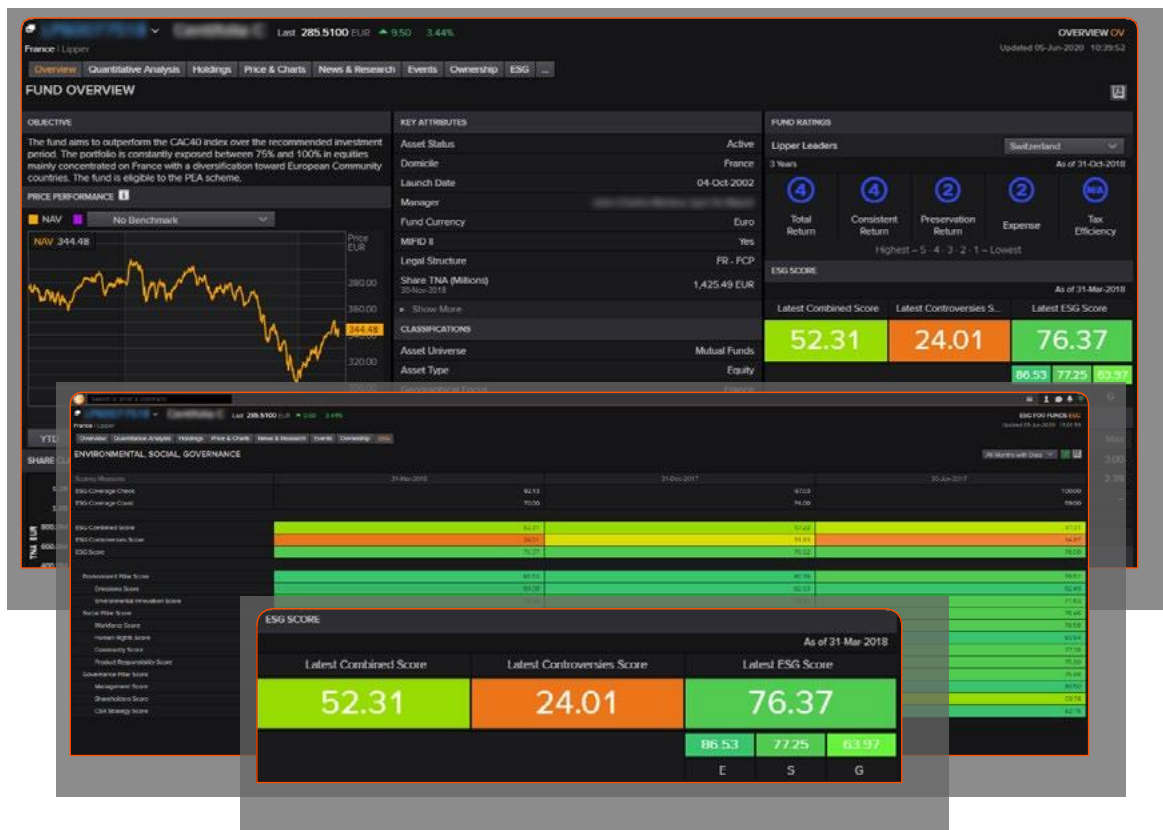
### リフィニティブ リッパー・ファンドESGスコア

リフィニティブ リッパー・ファンドESGスコアは、証券レベルのポートフォリオ分析に加えて、特定のファンドのサステナビリティを表す独立した統合的なファンドレベルのスコアを投資家やファンドセクターに提供いたします。すべてのスコアは、セキュリティレベル（保有銘柄）からロールアップされ、ファンドレベルのスコアを算出いたします。

リップパーのデータと分析ツールは、強力なESGパフォーマンスを持つファンドを特定し、データベース全体で、特定のESG基準に基づいて、ファンドをスクリーニングするのに役立ちます。

適格基準を満たすファンドのみを対象とし、ESGファンドスコアを算出いたします。ポートフォリオには最低10の証券が必要であり、ポートフォリオの70%で個別のESGセキュリティスコアが利用可能である必要があります。

ESGへの関心と投資が投資業界全体で高まる中、リフィニティブ・リップパーは、ESGのデータとソリューションの開発に歩調を合わせてきました。強力な責任投資原則を持つファンドの特定をさらに支援するために、独自のESGレーティングシステムでファンドのESGスコアをフォローいたします。



For illustration purpose only

Visit [refinitiv.com](https://refinitiv.com)

@Refinitiv Refinitiv

**REFINITIV**  
DATA IS JUST THE BEGINNING