

## 大和投資信託が ESG 投資の ETF を初上場、 同インデックスに FTSE Blossom Japan Index を採用

- ESG 投資の ETF が東京証券取引所に初上場
- 同 ETF は FTSE Russell's ESG Ratings data model を活用した FTSE Blossom Japan Index に連動した運用成果を目指す
- パッシブ運用の世界で ESG を取り入れる傾向が拡大
- FTSE Russell index に連動した運用成果を目指す ETF の運用残高は全世界で約 5,620 億米ドルに

世界的なインデックスプロバイダーである FTSE Russell は、同社の ESG インデックスである FTSE Blossom Japan Index に連動した運用成果の達成を目指す ETF(上場投資信託)、「ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index (コード:1654)」が本日、9月26日に大和証券投資信託委託株式会社(大和投資信託)により東京証券取引所に上場したことを発表しました。同 ETF は FTSE Blossom Japan Index をインデックスとする最初の ETF となります。大和投資信託は、これまで 35 本の ETF を東京証券取引所に上場させており同純資産総額は約 5.4 兆円(2017年9月21日時点)を誇り、国内最大手の ETF プロバイダーの一社となっています。

FTSE Blossom Japan Index は、国連の持続可能な開発目標(SDGs)を含む既存の国際的な ESG 基準に基づいた FTSE Russell の ESG 評価モデルを使用して構築されています。銘柄組み入れの基準は世界的に確立された FTSE4Good Index Series のそれを活用しています。本インデックスを採用することにより、従来の時価総額加重ベンチマークの設計から大幅に逸脱することなく、ESG を広く投資に取り入れることが可能となります。なお、業種の偏りを最小限に抑えるために、本インデックスは FTSE Japan に対して業種ニュートラルとなるよう設計されています。

**FTSE Russell の Evan Ong (Managing Director, Asia ETP and listed derivatives strategy and business development)**は以下のとおり述べています。:

“今回、大和投資信託が東京証券取引所に初上場となる ESG 投資の ETF のインデックスとして FTSE Russell Blossom Japan Index を選択したことを大変光栄に思います。当社は、ETF をはじめとするパッシブ運用の世界で ESG を考慮する傾向は今後も世界中で高まっていくものとみており、こうして傾向は企業の透明性と業績の向上につながっていくものとみています。”



FTSE Blossom Japan Index は、FTSE Russell が提供する多様なサステナブル投資商品の一つです。サステナブル投資商品には、ESG Ratings データモデル、Green Revenues データモデル、および 11 月にローンチされた FTSE All World Ex CW Climate Balanced Factor Index のような新しい smart sustainability Index が含まれます。FTSE Russell の ESG Ratings データモデルは、世界中の 4,100 以上の企業に関する環境、社会およびガバナンスのデータを提供しています。ロンドン証券取引所グループは、グローバルなグリーンファイナス、およびサステナブルな資金調達を支援するパイオニアであり、多様なサステナブル商品を提供しています。これには、2017 年 2 月にローンチした上場企業向けの ESG 情報開示ガイドが含まれます。

FTSE Blossom Japan Index に関する詳しい情報は以下をご参照ください。

<http://www.ftse.com/products/indices/blossom-japan-jp>  
<https://www.lseg.com/sustainable>

– 以上 –

## お問い合わせ先:

### グローバルメディア

Ed Clark Lucie Holloway	+44 (0)20 7797 1222 newsroom@lseg.com
----------------------------	--

### 地域別のお問い合わせ先

香港: Fennie Wong	+852 2164 3267
シドニー: Laura McCrackle	+61 2 8823 3526
東京: Toshi Okada	+81 3 3581 3443

## FTSE Russell グループについて

インデックス、データ、分析ソリューションを幅広く作成・管理する大手グローバルインデックスプロバイダー、FTSE Russell は、資産クラス、スタイル、戦略全体における顧客ニーズに対応しています。投資可能な市場の 98% をカバーする FTSE Russell インデックスは、世界にローカルベンチマークを開発することで得られた専門知識とともに、グローバル市場の実態を伝えます。

FTSE Russell インデックスの専門知識とプロダクトは、世界中の機関投資家や個人投資家により幅広く使用されています。30 年以上にわたり、主要な資産保有者、資産運用会社、ETF プロバイダー、投資銀行などが、投資パフォーマンスをベンチマークし、投資ファンド、ETF、ストラクチャード商品、インデックスベースのデリバティブ商品を組成するために、FTSE Russell インデックスを選択しています。FTSE Russell インデックスは、資産配分、投資戦略分析、リスク管理のためのツールもクライアントにご提供しています。

中核となる一連の普遍原理が、FTSE Russell インデックスの設計と管理を駆動しています。透明性がありルールに基づいた方法論は、主要市場参加者の独立した委員会から情報提供を受けています。FTSE Russell は、業界最高レベルの基準を適用し、IOSCO



# プレスリリース



FTSE  
Russell

の原則を採用したインデックス・イノベーションおよび顧客パートナーシップに注力しています。FTSE Russell は、ロンドン証券取引所グループの完全子会社です。

詳しくは [www.ftserussell.com](http://www.ftserussell.com) をご参照ください。

© 2017 London Stock Exchange Group plc および関連グループ事業体（「LSE グループ」）。LSE グループには、(1) FTSE International Limited（「FTSE」）、(2) Frank Russell Company（「Russell」）、(3) FTSE TMX Global Debt Capital Markets Inc. および FTSE TMX Global Debt Capital Markets Limited（合わせて「FTSE TMX」）ならびに (4) MTSNext Limited（「MTSNext」）が含まれます。無断複写・転載を禁じます。

FTSE Russell® は、FTSE、Russell、FTSE TMX および MTS Next Limited の商号です。ここで使用される「FTSE®」、「Russell®」、「FTSE Russell®」、「MTS®」、「FTSE TMX®」、「FTSE4Good®」、「ICB®」およびその他の商標ならびにサービスマーク（登録されているか否かを問いません）はすべて、LSE グループの該当メンバー会社またはその各ライセンサーによって所有またはライセンスを供与されているか、FTSE、Russell、MTSNext、FTSE TMX が所有またはライセンスに基づいて使用しています。すべての情報は、情報提供のみを目的として提供されています。本刊行物に掲載されているすべての情報の正確性には万全を期しておりますが、LSE グループのいかなるメンバー会社、そのそれぞれの取締役、役員、従業員、パートナーまたはライセンサーも、本刊行物または本刊行物に含まれる情報またはデータの使用による誤りまたは損害に対して一切の責任を負いません。

LSE グループのいかなるメンバー会社、そのそれぞれの取締役、役員、従業員、パートナーまたはライセンサーも、明示的・黙示的を問わず、FTSE Russell Index の使用から生じる結果や、インデックスが使用されるなんらかの特定目的へのそれらの適合性について、いかなる要求、予測、補償、表明も行いません。

LSE グループのいかなるメンバー会社およびその取締役、役員、従業員、パートナーまたはライセンサーも、投資アドバイスを提供しません。本文書のいかなる内容も、金融や投資の

助言を構成するものではありません。LSE グループのいかなるメンバー会社、取締役、役員、従業員、パートナーまたはライセンサーも、いかなる資産への投資の推奨度に関しても一切の表明を行いません。このような資産への投資における決定は、ここに記載されるいかなる情報にも依拠すべきではありません。インデックスに直接投資することはできません。インデックスへのある資産の購入は、その資産の購入、売却または保持を推奨するものではありません。認定を受けた専門家から法律、税務、投資についての助言を得ることなく、本刊行物に記載される一般情報を実行しないでください。

LSE グループの該当メンバー会社の書面による事前の許可なく、この情報の一部または全部を複製、情報検索システムへの蓄積、電子・機械・写真複写・録音などの方法により転送しないでください。LSE グループのインデックスデータの使用および販売ならびに金融商品を作成するためのデータの使用には、FTSE、Russell、FTSE TMX、MTSNext および/またはそのライセンサーの許諾が必要です。



**London**  
Stock Exchange Group