

「海外年金資金等の ESG 投資に関する調査研究報告書」公表

公益財団法人 年金シニアプラン総合研究機構
(<http://www.nensoken.or.jp/>)

年金に関する専門研究機関である公益財団法人 年金シニアプラン総合研究機構（東京都港区、理事長 西村周三）は、「海外年金資金等の ESG 投資に関する調査研究報告書」を公表しました。

<要旨>

ESG 投資はメインストリームの投資においても無視することのできないものとなってきている。

本報告書では、海外年金資金等における ESG 投資への取り組み状況の調査を行うとともに、発行が拡大しているグリーンボンド市場、新しいインデックスのローンチが増加している ESG インデックス、多様な銘柄が上場されてきている ESG 関連 ETF の状況についても調査を行っている。

ESG 投資は、上場株式を主たる対象としていたが、すべての資産クラスを対象とするものとなっており、ESG の投資手法は多様なものともなっている。また、ESG 投資を行う投資家の考え方は一様ではなく、個々の投資家が利用する手法も多様なものとなっている。

※報告書は当機構 HP(<http://www.nensoken.or.jp/pastresearch/>)より無料で閲覧頂けます。

【お問い合わせ】 〒108-0074 東京都港区高輪 1 丁目 3 番 13 号 NBF 高輪ビル 4 階
公益財団法人 年金シニアプラン総合研究機構
(担当) 研究部 主任研究員 樺山和也
(電話) 03-5793-9412 (E-Mail) k-kabayama@nensoken.or.jp

《目次》

はじめに	1
第1章 ESG投資の概要	
1 概要	2
2 ESG投資の手法.....	7
3 ESG投資の資産クラス.....	21
4 ESG評価.....	23
第2章 海外年金基金等の ESG投資	
1 調査対象海外年金基金等	27
2 欧州	28
3 英国	42
4 カナダ.....	46
5 オーストラリア／ニュージーランド	51
6 アメリカ	54
第3章 グリーンボンド	
1 グリーンボンド市場.....	62
2 グリーンボンド・インデックス.....	68
3 第三書評価・認証	72
4 グリーンボンド評価.....	74
5 グリーンボンド投資家	80
第4章 ESGインデックス	
1 概要	82
2 MSCI.....	84
3 FTSE ラッセル	95
4 S&P Dow Jones Indices.....	99
第5章 ESG関連ETF	
1 概要	105
2 KLDとDSIの比較.....	107
3 低炭素系ETF.....	109
4 その他のESG関連ETF	112
参考文献	116

以上