



Morningstar ジェンダー・ダイバーシティ 指数：GenDi/GenDi J よくあるご質問（FAQ）

2023年4月

概要に関するご質問

指数の目的は何ですか？

Morningstar ジェンダー・ダイバーシティ指数は、それぞれの投資対象ユニバースにおいて、男女平等に取り組んでいる上場企業の株式を反映するように設計されています。

同指数は、広範な市場に投資するのと同様のリスク・リターン特性を生み出すことを目的とし、ジェンダー間の平等を専門とする調査で業界をリードする Equileap による個別企業の分析データを活用しています。

Morningstar ジェンダー・ダイバーシティ指数は、リーダーシップおよび従業員の男女均衡度、賃金の平等とワークライフバランス、ジェンダー・イクオリティを推進するためのポリシー、透明性・説明責任に対するコミットメントの4つの大きなカテゴリーに分類された19項目の基準で企業を評価する Equileap ジェンダー・イクオリティ・スコアカード™を活用し算出されます。

Equileap について

[Equileap](#) は、企業セクターのジェンダー間の平等に関するデータや調査・分析で業界をリードする社会的企業です。従業員の男女均衡度、男女の給与格差、育児休業制度、反セクシュアル・ハラス

メント・ポリシーなど19項目の基準をもとに、総合的な評価を可能にする独自のジェンダー・イクオリティ・スコアカード™を用いて、世界の数千社にも及ぶ上場企業を調査しています。Equileap が提供するデータや指標は、世界中の多くの金融機関によって活用されています。

指数のメソドロジーとメンテナンスに関するご質問

指数はどのようにして構築されますか？

指数の構築に関する情報については、以下の指数メソドロジーをご覧ください。

Morningstar 先進国（除く日本）ジェンダー・

ダイバーシティ指数 (GenDi) [指数メソドロジー](#)

Morningstar 日本株式ジェンダー・ダイバーシティ指数（除く REIT）(GenDi J) [指数メソドロジー](#)

指数のリバランスはいつ行われますか？

指数の構成銘柄入替は、毎年12月に、その年のEquileap ジェンダー・イクオリティ・スコアを用いて行います。リバランス（構成比率の調整）は、毎四半期の3月、6月、9月、12月に行います。

指数の算出開始日はいつですか？

指数の設定日は以下の表をご覧ください。

指数	設定日	パフォーマンス算出開始日
GenDi	2020年8月10日	2014年12月19日
GenDi J	2023年3月27日	2015年12月18日

指数の構成銘柄のリストはありますか？

指数ごとに全構成銘柄のリストがございますのでご覧ください。

GenDi: [構成銘柄一覧](#)

GenDi J: [構成銘柄一覧](#)

当社は指数に採用されています。どのような基準を用いて当社の Equileap ジェンダー・イクオリティ・スコアが決定されたのでしょうか？

[Equileap ジェンダー・イクオリティ・スコアカード](#)は、リーダーシップおよび従業員の男女均衡度、賃金の平等とワークライフ・バランス、ジェンダー間の平等を推進するためのポリシー、透明性・説明責任に対するコミットメントの4つの大きなカテゴリーに分類された19項目の基準をもとに企業を評価します。各カテゴリーのスコアを決定する19項目の基準には、シニア・マネジメントの男女均衡度、男女間の給与格差、育児休業制度、職場でのセクシュアル・ハラスメントなどがあります。各基準の更なる詳細については[Equileap ジェンダー・イクオリティ・スコアカード](#)をご参照ください。貴社のジェンダー・イクオリティ・スコアをお知りになりたい場合は、indexes@morningstar.comにお問い合わせください。Morningstar の指数チームが対応させていただきます。

当社はジェンダー・イクオリティという観点で見た場合に他社と比較してどのような位置にあるのでしょうか。

当指数では、各企業のジェンダー・イクオリティ・スコアカードに基づき指数の構成銘柄を5つのグループに分類します。5つのグループの内Group 1に分類された企業は評価が最も高い企業群、Group 5に分類された企業は評価が最も低い企業群となります。貴社がどのグループに入っているかについては、指数の構成銘柄レポートをご覧ください。また、追加のご質問がございましたら、indexes@morningstar.comにお問い合わせください。Morningstar の指数チームが対応させていただきます。

当社は指数の構成銘柄です。構成銘柄であることを会社のマーケティングに使うことはできますか？

Group 1に属する企業はロゴを使用することができます。貴社が、マーケティング目的でこのロゴを使用することをご希望される場合は、indexes@morningstar.comにお問い合わせください。

当社は指数の構成銘柄に含まれていません。指数の適格銘柄となるにはどのようにすればよいのでしょうか？

親指数に含まれている企業でなければ、指数の適格銘柄となることはできません。また、親指数に含まれている企業のうち、ジェンダーに起因する暴力や差別が絡む訴訟事件に巻き込まれた企業が登録されるEquileapのアラーム・ベル論争（コントロールバーシー）リストに登録されている企業は指数から除外されます。アラーム・ベル論争（コントロールバーシー）リストの詳細については、Morningstar 指数のウェブサイトにてメソドロジャー・ブック内の「付録」の項をご参照ください。

指数名	指数
GenDi	Morningstar 先進国（除く日本 大中型株指数
GenDi J	Morningstar 日本株式指数 （除く REIT）

Morningstar Indexes について

Morningstar Indexes は、進化し続ける投資家の皆様のニーズに対応し、最先端の商品やサービスで投資家の皆様の支援するために設立されました。透明性が確保され、投資家に焦点を当てたデータとリサーチのリーダー的存在として我々が築いてきた豊富な経験を活かし、主要な資産クラス、スタイル、投資戦略の選択の幅を広げ、個人投資家、機関投資家、ウェルスマネジャー、アドバイザーの皆様が、それぞれの目的に合う投資機会を見いだせるよう独自の手段を備えています。伝統的指数や独自の IP を活用した指数から、インデックスの設計、算出、配信サービスまで、当社のソリューションは、投資家自身と同じくらい多様な投資環境に及びます。

www.indexes.morningstar.com

お問い合わせ

indexes@morningstar.com