



Morningstar® 日本株式ジェンダー・ダイバーシティ・ティルト指数 (除くREIT)SM

Morningstar指数の詳細についてはこちらをご参照ください
indexes.morningstar.com

お問い合わせ先
indexes@morningstar.com

国連の持続可能な開発目標は、「男女平等は基本的な人権であるだけでなく、平和で、繁栄し、持続可能な世界に必要な基盤でもある」と述べています。人々の可能性を最大限に活用する社会はより競争力があり、企業分野でも同じ原則が成り立ちます。

調査によると、強固なジェンダーダイバーシティポリシーと実践に取り組んでいる企業は、優れた財務結果を達成できることが示されています。

当指数は、Equileap¹が提供するデータと評価手法を活用し、確立されたジェンダー・ダイバーシティ・ポリシーが企業文化として浸透している企業、および、ジェンダーに関係なく従業員に対し平等な機会を約束している企業に重点をおいた投資が可能になるよう設計されています。

ジェンダー・ダイバーシティを計測する

Equileapは、4つのカテゴリーに分類された19項目の基準にそれぞれ異なる重みを付けて評価し、ジェンダー・イクオリティ・スコアを企業に付与します。

- カテゴリーA: リーダーシップおよび従業員の男女均衡度
- カテゴリーB: 賃金の平等とワークライフ・バランス
- カテゴリーC: ジェンダー間の平等を推進するためのポリシー
- カテゴリーD: コミットメント、透明性および説明責任

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、育児休暇制度、職場でのセクシュアル・ハラスメントなどがあります。また、Equileapは、企業の法的記録を調査し、ジェンダーに絡む暴力や差別などの法的論争(コントロールバリー)に関与した企業を「アラーム・ベル」論争(コントロールバリー)リストに登録します。

指数の適格基準

Morningstar 日本株式ジェンダー・ダイバーシティ・ティルト指数(除くREIT)の構成銘柄は、Morningstar 日本株式指数(除くREIT)(以下、親指数)の構成銘柄の中から選択されます。Equileapから提供される直近のアラーム・ベル論争(コントロールバリー)リストに登録されている銘柄を除く、すべての親指数構成銘柄が適格基準を満たします。アラーム・ベルリストに登録された企業は、その後12カ月間、非適格銘柄となります。

ポートフォリオ構築

構成銘柄はEquileap GEスコアに基づき降順にランク付けされ、同じ銘柄数になるように5つのグループに分けられます。最上位のスコアを持つ企業はグループ1、最下位のスコアを持つ企業はグループ5に分類されます。以下に示すティルト係数は親指数の各構成銘柄ウェイトに加重され、Morningstar 日本株式ジェンダー・ダイバーシティ・ティルト指数(除くREIT)の構成銘柄のウェイトが決まります。

各構成銘柄入替時に、指数のセクター配分比率が親指数と同じセクター配分比率となるよう調整します。

グループ	ティルト・ファクター
1	1.50
2	1.25
3	1.00
4	0.75
5	0.50

GEスコアが等しい銘柄がある場合は、昇進やキャリア・デベロップメント等の追加項目にてどの企業がより高いティルト係数を使うべきか決定します。構成銘柄比率の上限を5%とします。

¹ Visit <https://equileap.com> to learn more about Equileap

指数のメンテナンス

当指数は毎年12月に構成銘柄入れ替え、四半期ごとの3月、6月、9月、12月にリバランスを行います。

指数構成プロセス



Morningstarの指数について

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の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。Morningstar 指数チームが提供する指数ソリューションが対象とする投資環境は、従来のベンチマークによるリスク・リターンの評価から、投資家の皆様がESG目標を投資プロセスに効果的に組み込むための支援に至るまで、投資家の皆様の多様化するニーズに十分に答えることができるよう広範に及びます。Morningstar Indexesは、投資家の皆様がますます複雑化する今日の課題への答えを見つけ、明日の目標をより容易に達成できるように支援します。指数の詳細については、indexes.morningstar.comをご覧ください。

Equileapについて

Equileapは、投資家向けの男女平等に関するデータと洞察の大手プロバイダーです。2016年に設立された同社の使命は、労働力の平等のギャップを埋めることです。Equileapは、幅広い男女平等基準に基づいて数千の企業を評価しています。これには、リーダーシップと労働力における男女バランス、男女賃金格差とワークライフバランス、有給育児休暇などに関する19の基準が含まれます。詳細については、equileap.comをご覧ください。

この資料は英語で作成された資料の翻訳版です。日本語版と英語版との間で相違がある場合は英語版をご参照ください。英語版はこちらに掲載されています。

© 2023 Morningstar, Inc. and Ibbotson Associates Japan, Inc. All Rights Reserved. 本レポートの全ての著作権はMorningstar, Inc. (以下「Morningstar」) およびイボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社 (以下「イボットソン」) に帰属します。本レポートのMorningstarまたはイボットソンの事前の書面による承諾なしの利用、複製等は、全体一部分を問わず、損害賠償、著作権法の罰則の対象となります。

本レポートに記載されている情報、データ、分析、意見は、(1) Morningstarの機密情報ならびに専有情報が含まれます、(2) コピーならびに再配布はできません、(3) 作成日時点の情報です、(4) 予告なしに変更することがあります、(5) Morningstarまたはイボットソンによる投資助言ではありません、(6) 情報提供のみを目的としたものです、(7) 銘柄の売買を推奨するものではありません、(8) 情報の正確性、完全性や適時性を保証するものではありません。Morningstarおよびイボットソンは、法律により定められている場合を除き、本レポートの情報、データ、分析、意見を利用して行ったいかなる投資の判断、損失、損害に責任は負いません。当資料にある指数はそれ自体運用商品ではなく、直接投資することはできません。過去のパフォーマンスは将来のリターンを保証するものではありません。Morningstarの商号、ロゴはMorningstar, Inc.の登録商標です。