

Morningstar 先進国（除く日本）ジェンダー・ダイバーシティ指数

よくあるご質問（FAQ）

Morningstar の指数は、指数化のための理論と技術を融合して構築され、世界の金融市場の動向をより明確に把握するための手段として投資家の皆様に活用されています。指数は、徹底したバックテストや独自の調査によって裏付けられた透明性の高いルール・ベース型のメソドロジーを基盤としています。これらの指数は、「Morningstar インベストメント・リサーチ・エコシステム」（投資環境を分析し投資手法の向上に取り組む熟練したアナリストやリサーチャーたちが築き上げたネットワーク）によって組成され、全ての主要な資産クラスを網羅しています。上場投資信託（ETF）のプロバイダーやその他の資産運用会社など、顧客の皆様は、我々の専門家チームと協働することで、我々の指数を基に投資家本位の独自商品の開発が可能になります。Morningstar の指数はまた、精度の高いベンチマークのリソースとしても活用されています。

概要に関するご質問

指数の目的は何ですか？

Morningstar 先進国（除く日本）ジェンダー・ダイバーシティ指数は、ジェンダー間の平等に取り組む、北米、欧州、アジア太平洋地域（除く日本）の上場企業の株式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。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 先進国（除く日本）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、コミットメント・透明性・説明責任の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、[指数メソドロジー](#)をご覧ください。

指数のリバランスはいつ行われますか？

指数の構成銘柄の入れ替えは、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？

指数の算出開始日は2020年8月10日、遡及算出開始日であるパフォーマンス基準日は2014年12月19日に設定しています。

どのような銘柄が指数に採用されていますか？

全ての構成銘柄のリストは、[Morningstar 先進国（除く日本）ジェンダー・ダイバーシティ指数のウェブページ](#)にある「データ」の項にある「構成銘柄」でご覧いただけます。

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、コミットメント・透明性・説明責任の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。あるいは、indexes@morningstar.com にお問い合わせください。Morningstar の指数チームがご質問にお答え致します。

指数に採用されている当社のジェンダー・イクオリティ・スコアを改善するために、どのような基準に注目すべきですか？

Morningstar は、ジェンダー・イクオリティ・スコアカードが定める 4 つのカテゴリーを企業のスクリーニング基準とし、各企業の職場でのジェンダー平等への取り組みを評価しスコアを付与します。スコアに応じて企業に優劣をつけ 1~5 のグループに分類した後、各グループの構成銘柄比率に重みをつけます。企業のスコアを決める基準の詳細については、[Equileap のジェンダー・イクオリティ・スコアカード](#) をご参照ください。あるいは、indexes@morningstar.com からお問い合わせください。Morningstar の指数チームがご質問にお答え致します。

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？

指数を構成する銘柄はスコアを基準に 5 つのグループに分類されます。最上位グループの中でトップに位置する銘柄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 から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でしょうか？

Morningstar 先進国（除く日本）大中型株指数のユニバースでなければ、Morningstar 先進国（除く日本）ジェンダー・ダイバーシティ指数の適格銘柄となることはできません。また、この適格ユニバースのうち、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銘柄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](#) にある Morningstar 先進国（除く日本）ジェンダー・ダイバーシティ指数の [メソッドロジー・ブック](#) 内「付録」の項をご参照ください。

お問い合わせ先

指数の更なる情報は、<https://indexes.morningstar.com/our-products/gender-diversity> をご覧いただくか、indexes@morningstar.com からお問い合わせください。

米国 Morningstar, Inc. のミッションは、投資家の皆様の成功を支援することです。我々は、投資家の皆様と課題を共有することが、ビジネスを成功に導く上で重要な意味を持つと考えるだけでなく、それが我々の使命であると確信しています。我々には、ミッション主導型のさまざまな組織と協働し、投資家の皆様によりよい成果を提供するとともに社会にプラスのインパクトをもたらしてきた実績があります。

米国 Morningstar, Inc. は、北米、欧州、オーストラリア、およびアジアで事業を展開する独立系大手投資調査会社です。米国 Morningstar, Inc. は、個人投資家、ファイナンシャル・アドバイザー、資産運用会社、退職プランのプロバイダーやスポンサー、および債券市場やプライベート資本市場の機関投資家の皆様に、多岐にわたる商品やサービスを提供しています。商品やサービスには、資産運用、上場企業、プライベート資本市場、債券など幅広い投資対象を網羅するデータや調査・分析、リアルタイムで配信する世界のマーケットデータなどがあります。また、投資アドバイザーを専門とする子会社を通じて資産運用サービスも手掛け、2020 年 6 月 30 日現在の助言・運用資産残高はおよそ 2,050 億ドルに上ります。米国 Morningstar, Inc. は、2020 年 6 月 30 日現在、世界 27 カ国で事業を展開しています。米国 Morningstar, Inc. の更なる情報は、www.morningstar.com/company をご覧ください。また、ツイッターのアカウントは @MorningstarInc です。