

ESGレポーティングのためのソリューション

業界最高峰のポートフォリオ分析、信頼できる規制分野の専門家、魅力的なレポート作成ツールにより、環境、社会、ガバナンス（ESG）報告を高度化し、拡張することができます。

課題

- 複数のESGデータセットへのアクセスや連携
- 製品・エンティティ（企業・発行体）までのESG指標の集計
- 複数のソースからデータを引き出すための階層的なロジックの組み込み
- 開示必須の定量的・定性的な項目両方をサポートするカスタマイズ可能なレポート作成
- 作成後の内容や計算の確認といった監査性を犠牲にせず、大量のレポート作成

解決策

コンテンツに依存しないレポート作成

選択したESGデータセットを保有するポートフォリオ情報にシームレスに接続します。FactSetに統合されているデータセットや独自コンテンツをロードでき、柔軟にレポートを作成することができます。

マルチアセットクラスのポートフォリオ分析

ESGや規制当局への報告を簡素化するために、会社全体の残高情報よりESG指標を集計できます。

- FactSetのESGテンプレートを活用し、レポート作成を迅速に行うことが可能
- カスタムロジックを使用して、複数ソースからデータ取り込み
- 国、セクター/産業、アセットクラスなど様々なレベルにてポートフォリオをグルーピングしてデータ集計

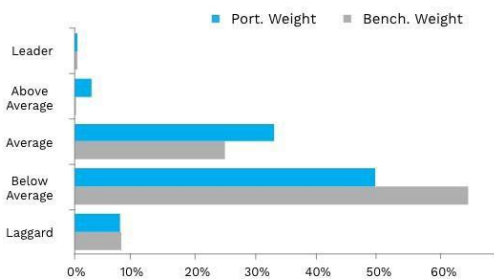
マルチベンダーのデータ統合の実績

- FactSet Truvalue Scores and Spotlights
- FactSet Sustainable Finance Disclosure Regulation (SFDR) Principal Adverse Impacts (PAI)
- MSCI Climate Value-at-Risk
- MSCI ESG Ratings
- MSCI SFDR PAI & EU Taxonomy
- Sustainalytics ESG
- ISS ESG Carbon & Climate Impact Solution
- ISS ESG SFDR Principal Adverse Impacts and EU Taxonomy

Truvalue Labs ESG Snapshot

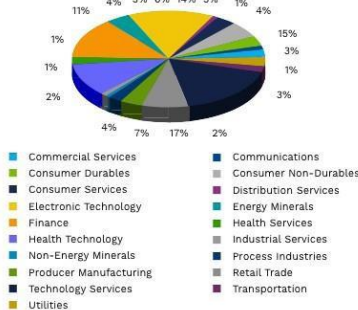
Benchmark: S&P 100 Currency: \$USD Data as of 5/31/2022

ESG Category Weights



Sector Distribution

Sector	% of Port.
Technology Services	16.98%
Electronic Technology	14.87%
Finance	13.60%
Health Technology	10.91%
Retail Trade	7.42%
Consumer Non-Durables	5.53%
Energy Minerals	4.09%
Producer Manufacturing	3.72%
Consumer Services	3.63%
Commercial Services	3.04%
Utilities	2.98%
Consumer Durables	2.87%
Health Services	2.71%



ESG Characteristics

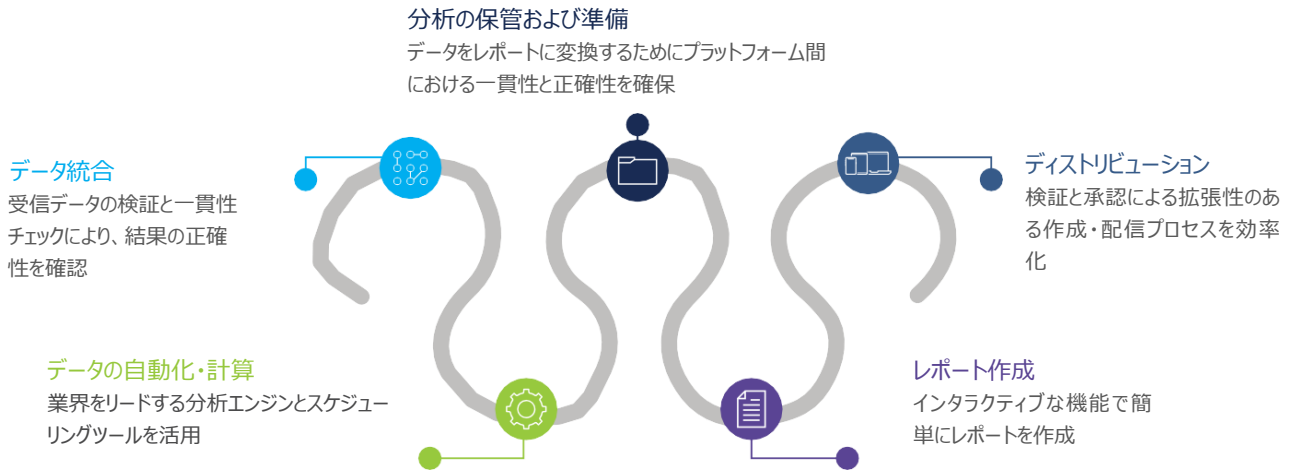
Characteristic	Portfolio	Benchmark
# of Securities	504	101
All Categories - Adj Insight	52.69	50.91
All Categories - Momentum	51.61	51.03
Environmental - DM %	17.10	15.14
Social Capital - DM %	29.79	30.90
Human Capital - DM %	14.99	13.79
Business Model - DM %	20.62	21.22
Leadership & Governance - DM %	17.50	18.94

Top Insight Scores

Company	Avg Weight	Adjusted Insight
ABIOMED, Inc.	0.03	79.67
Principal Financial Group, Inc.	0.05	77.99
Zebra Technologies Corporation Class A	0.05	77.82
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	0.07	74.19
Welltower Inc	0.11	73.82

カスタムドキュメントのアウトソーシング

ファクトセットのクライアント・サービス・エキスパートと連携し、ブランディングされた独自のコンテンツ設計が可能です。ポートフォリオ分析、モニタリング、リスク管理、レポート作成、その他ポートフォリオライフサイクルのあらゆるフェーズにシームレスに統合しており、比類ない透明性、監査性、管理機能を提供しています。アドホックなレポート作成や定期的なバッチ出力だけでなく、プログラムによるオンデマンドアクセスもご利用いただけます。



レポート作成プロセスの簡素化

ポートフォリオ情報や任意のESGデータベンダーに関して、予め用意されたテンプレートを使用することでレポート作成を効率化させることができます。値の確認は直接ポートフォリオ分析機能で行え、高い透明性を提供しています。バージョン管理、タスク承認により情報開示を管理します。対象規制やルールに準拠した出力、集計方法を採用して、データ統合とレポート作成における一貫性を確保しています。

Indicators applicable to investments in investee companies					
Adverse sustainability indicator	Metric	Impact ¹ (year 2022)	Impact ² (year 2021)	Explanation ³	Actions taken, and actions planned and targets set for the next reference period
CLIMATE AND OTHER ENVIRONMENT-RELATED INDICATORS					
Greenhouse gas emissions	1. Greenhouse gas emissions	Scope 1 GHG emissions	3,632.73	NA NA	FactSet Asset Management (FAM) is committed to achieving net zero carbon emissions by 2040. The milestones include 50% reduction by 2030 and 100% by 2040, well before the 2050 target date. This will include 100% of client mandates by 2040.
		Scope 2 GHG emissions	817.27	NA NA	FactSet Asset Management (FAM) is committed to achieving net zero carbon emissions by 2040. The milestones include 50% reduction by 2030 and 100% by 2040, well before the 2050 target date. This will include 100% of client mandates by 2040.
		Scope 3 GHG emissions	76,510.63	NA NA	FactSet Asset Management (FAM) is committed to achieving net zero carbon emissions by 2040. The milestones include 50% reduction by 2030 and 100% by 2040, well before the 2050 target date. This will include 100% of client mandates by 2040.
		Total GHG emissions	80,960.63	NA NA	FactSet Asset Management (FAM) is committed to achieving net zero carbon emissions by 2040. The milestones include 50% reduction by 2030 and 100% by 2040, well before the 2050 target date. This will include 100% of client mandates by 2040.

¹ FactSet Asset Management has started measuring performance on Principal Adverse Impact as of 31 March 2022. The first results will be published in 2023.
² FactSet Asset Management has started measuring performance on Principal Adverse Impact as of 31 March 2022. The first results will be published in 2023, 2024 will be the first year reflecting a comparison to a previous year.
³ This column will provide an explanation on the development of the specific principal adverse impact indicator against the different reference periods, in relation to the actions taken.

SFDR 付属書1 サンプルレポート