

For immediate release

バークレイズ 広報部
成松 恭多
03-4530-5623

バークレイズと MSCI、ESG 債券インデックス・ファミリーの一環としてグリーン・ボンド・インデックスを提供

環境保全に貢献するプロジェクト支援を目的に発行される債券の成長市場をトラックする革新的なインデックス

【2014年7月4日、東京】債券市場の広範なベンチマークを提供するバークレイズと、世界でも有数のグローバルな投資家の意思決定をサポートするツールの提供者である MSCI Inc (MSCI)は7月1日、新たにグリーン・ボンド・インデックスの提供開始に合意したと発表しました。本インデックスにより、2013年6月に公表した ESG (環境・社会・ガバナンス)債券ベンチマーク・インデックス・ファミリーが拡充されます。

グリーン・ボンド・インデックスは、環境保全に直接的に貢献するプロジェクトや取り組みを支援する債券の市場をトラックすることを目的とします。これらのインデックスはグリーン・ボンド・ファンドのベンチマークや、グリーン・ボンドのリスクやリターンの指標として活用されます。また機関投資家は、ライセンス契約に基づいて ETF、マネージド・アカウント、仕組み商品など、インデックスにリンクした投資商品にご利用いただくことも可能です。

バークレイズのベンチマーク・インデックス・リサーチ部門責任者であるブライアン・アップピンは、以下のようにコメントしています。「グリーン・ボンドの発行の増加に伴い、機関投資家から、この新しい成長市場に対するベンチマークが求められていました。ESG 基準を取り込むという意味で、グリーン・ボンド・インデックスは、MSCI の債券インデックス・ファミリーを拡充するインデックスだと思います」

2014年7月1日より7月31日まで、MSCI とバークレイズは 市場参加者からご意見を集めるための正式な協議期間を設けます。これは、市場参加者がどのようにグリーン・ボンドを特定、評価、分類しているかを確認し、適切なベンチマーク・インデックスの方法論を決定することを目的とします。

MSCI ESG リサーチ責任者でありマネージング・ディレクターのレミー・ブリアンドは「MSCI ESG リサーチは機関投資家に、グリーン・ボンド分類の明確な基準を満たしたグリーン・ボンド銘柄の独立かつ客観的な評価を提供します」とコメントしています。

バークレイズの債券資本市場部門のグローバル責任者であるジム・グラスコットは、以下のようにコメントしています。「Climate Bond Initiative によると、グリーン・ボンドは今年中に約 300-400 億ドル発行され、来年の発行規模は約 1,000 億ドルに達すると見込まれています。グリーン・ボンド・インデックスは、発行体および機関投資家にとってたいへん有益なツールとなり、グリーン・ボンド市場の発展、透明性の向上、および標準化への重要な一歩となるでしょう」

##

本稿は、バークレイズ PLC と MSCI が 2014 年 7 月 1 日に米国で発表した英文リリース “Barclays and MSCI to offer Green Bond Index as part of GSG Fined Income Index Family” を翻訳、編集したものです。

パークレイズについて

パークレイズは、個人・法人向け銀行業務、クレジットカード、投資銀行業務、資産管理業務などさまざまな金融サービスを欧州、米州、アフリカ、アジアといった地域で展開している国際的金融機関です。パークレイズは、人々が目標を実現できるよう、正しい方法で手助けをすることを目標としています。300年以上の歴史と銀行としての専門性を備えたパークレイズは、50カ国で約14万人もの従業員を擁しています。世界中のお客様に、為替、融資、投資、資産管理などのサービスを提供しています。より詳細な情報は、グループのウェブサイト www.barclays.com をご参照ください。

MSCIについて

MSCI Inc.は、世界の資産運用会社や銀行、年金基金、ヘッジファンドに対して、投資意思決定支援ツールを提供するリーダーである。MSCIは、指数やリスクパフォーマンス分析、ESG調査を提供している。

MSCI Inc.の旗艦商品は、世界で9兆米ドル以上*がベンチマークされているMSCI指数や、バラ・マルチアセットクラス・ファクター・モデルやポートフォリオ・リスクとパフォーマンス分析、マルチアセットクラスとクレジットリスク分析のRiskMetrics、IPD不動産情報や指数と分析、MSCI ESG調査や分析、エネルギーとコモディティに関するFEAバリュエーションモデルとリスク管理ソフトウェアなどがある。MSCIはニューヨークに本社があり、世界中に調査および営業拠点を有する。

MSCI ESG リサーチについて

MSCI ESG リサーチのプロダクトとサービスは、世界中の企業に対して環境、社会、ガバナンスに関連したビジネス活動の綿密なリサーチ、レーティングおよび分析を提供することを目的としている。MSCI ESG リサーチで提供されるESGのレーティング、データ、分析はMSCI ESG指数の構築にも使われている。MSCI ESG リサーチはInvestment Advisers Act of 1940の下、Investment Adviserとして登録されている。MSCIは国際連合が支援している「責任ある投資原則(PRI: Principles for Responsible Investment)」に署名している。

* 2014年3月末時点。データ出典：eVestment, Lipper and Bloomberg
MSCIに関するより詳細な情報は、ウェブサイトを参照。(www.msci.com)

This document and all of the information contained in it, including without limitation all text, data, graphs, charts (collectively, the “Information”) is the property of MSCI Inc. and/or its subsidiaries (collectively, “MSCI”), Barclays Bank PLC. and/or its affiliates (collectively, “Barclays”), or their licensors, direct or indirect suppliers or any third party involved in making or compiling any Information (collectively, with MSCI, the “Information Providers”) and is provided for informational purposes only. The Information may not be reproduced or disseminated in whole or in part without prior written permission from MSCI. All rights in the Barclays MSCI Environmental, Social & Governance (ESG) fixed income indices vest in MSCI and Barclays.

The Information may not be used to create derivative works or to verify or correct other data or information. For example (but without limitation), the Information may not be used to create indices, databases, risk models, analytics, software, or in connection with the issuing, offering, sponsoring, managing or marketing of any securities, portfolios, financial products or other investment vehicles utilizing or based on, linked to, tracking or otherwise derived from the Information or any other MSCI data, information, products or services.

The user of the Information assumes the entire risk of any use it may make or permit to be made of the Information. NONE OF THE INFORMATION PROVIDERS MAKES ANY EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES OR REPRESENTATIONS WITH RESPECT TO THE INFORMATION (OR THE RESULTS TO BE OBTAINED BY THE USE THEREOF), AND TO THE MAXIMUM EXTENT PERMITTED BY APPLICABLE LAW, EACH INFORMATION PROVIDER EXPRESSLY DISCLAIMS ALL IMPLIED WARRANTIES (INCLUDING, WITHOUT LIMITATION, ANY IMPLIED WARRANTIES OF ORIGINALITY, ACCURACY, TIMELINESS, NON-INFRINGEMENT, COMPLETENESS, MERCHANTABILITY AND FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE) WITH RESPECT TO ANY OF THE INFORMATION.

Without limiting any of the foregoing and to the maximum extent permitted by applicable law, in no event shall any Information Provider have any liability regarding any of the Information for any direct, indirect, special, punitive, consequential (including lost profits) or any other damages even if notified of the possibility of such damages. The foregoing shall not exclude or limit any liability that may not by applicable law be excluded or limited, including without limitation (as applicable), any liability for death or personal injury to the extent that such injury results from the negligence or wilful default of itself, its servants, agents or sub-contractors.

Information containing any historical information, data or analysis should not be taken as an indication or guarantee of any future performance, analysis, forecast or prediction. Past performance does not guarantee future results.

None of the Information constitutes an offer to sell (or a solicitation of an offer to buy), any security, financial product or other investment vehicle or any trading strategy.

MSCI’s subsidiary MSCI ESG Research Inc. is a Registered Investment Adviser under the Investment Advisers Act of 1940. Except with respect to any applicable products or services from MSCI ESG Research Information, none of MSCI’s products or services recommends, endorses, approves or 3 otherwise expresses any opinion regarding any issuer, securities, financial products or instruments or trading strategies and none of MSCI’s products or services is intended to constitute investment advice or a recommendation to make (or refrain from making) any kind of investment decision and may not be relied on as such.

The Barclays MSCI ESG fixed income indices use ratings and other data, analysis and information from MSCI ESG Research. MSCI ESG Research is produced by MSCI ESG Research Inc. Issuers mentioned or included in any MSCI ESG Research materials may be a client of MSCI or another MSCI subsidiary, or the

Press Release

parent of, or affiliated with, a client of MSCI, MSCI ESG Research Inc or another MSCI subsidiary. MSCI ESG Research materials, including materials utilized in any MSCI ESG Indices or other products, have not been submitted to, nor received approval from, the United States Securities and Exchange Commission or any other regulatory body. Barclays MSC ESG fixed income indices are unmanaged indices that cannot be invested in directly. None of the Barclays MSC ESG Indices recommends, endorses, approves or otherwise expresses any opinion regarding any issuer, securities, financial products or instruments or trading strategies and none of the Barclays MSCI ESG fixed income indices is intended to constitute investment advice or a recommendation to make (or refrain from making) any kind of investment decision and may not be relied on as such. Any funds, products or other securities or investment vehicles using or based on the Barclays MSCI ESG fixed income indices are not sponsored, endorsed, or promoted by Barclays or MSCI.

Any use of or access to the Barclays MSCI ESG fixed income indices requires a license from both MSCI and Barclays. Any use of or access to other index products, services or information of Barclays requires a license from Barclays. Any use of or access to products, services or information of MSCI requires a license from MSCI. MSCI, Barra, RiskMetrics, and other MSCI brands and product names are the trademarks, service marks, or registered trademarks of MSCI or its subsidiaries in the United States and other jurisdictions. The Global Industry Classification Standard (GICS) was developed by and is the exclusive property of MSCI and Standard & Poor's. "Global Industry Classification Standard (GICS)" is a service mark of MSCI and Standard & Poor's.