

各 位

三菱 UFJ 信託銀行株式会社

「iSTOXX MUTB 気候変動インデックス」の開発について
 ～「パリ協定に準拠した気候変動対応インデックス～」



三菱 UFJ 信託銀行株式会社(取締役社長 ながしま いわお 長島 巖)は、2015 年より、ドイツ取引所傘下の指数提供会社 STOXX 社*と共同し、インデックス提供ビジネスに参入しておりますが、今般、「iSTOXX MUTB 気候変動インデックス」を共同開発いたしましたので、お知らせします。

三菱 UFJ 信託銀行およびその子会社である三菱 UFJ 国際投信、エム・ユー投資顧問、Mitsubishi UFJ Asset Management (UK)、三菱 UFJ オルタナティブインベストメンツは、三菱 UFJ フィナンシャルグループにおけるアセットマネジメント会社として、MUFG Asset Management(以下、「MUFG AM」という。)ブランドを形成しております。

MUFG AM では、2021 年 10 月に資産運用会社によるグローバルなイニシアティブ「Net Zero Asset Managers initiative」に参画し、2050 年までに投資先企業の GHG 排出量ネット・ゼロの実現に取り組んでいくことを表明しております。地球温暖化を 1.5℃に抑えるための世界的な取組みに沿って、2050 年までに GHG 排出量をネット・ゼロにするという目標に貢献すること、また、2050 年までに投資活動をネット・ゼロに整合させることに貢献することを掲げております。

また、スチュワードシップ活動やアセットオーナー等との協働、インデックスおよびアクティブ運用における新たなソリューションの開発等を通じて、投資先企業の GHG 排出量ネット・ゼロをめざすとともに、当該施策をより効果的に推進するために MUFG AM としてグループ一体となって取り組んでいくことをめざしています。

本指数は、上記の取り組みを実現する指数として開発したもので、気候変動に対するリスク(物理的リスク、移行リスク)と機会(将来の炭素削減計画、脱炭素に関するソリューション提供力)を評価し、パリ協定に準拠する制約条件のもと、ポートフォリオを構築しております。加えて、三菱 UFJ 信託銀行では、自己資金を用いて同指数に連動したファンドの設定も今後行う予定です。

【概要】

名称	iSTOXX MUTB 気候変動インデックス (英文名:iSTOXX MUTB Paris Aligned Index)
構成銘柄数	(日本株)160 銘柄/(外国株除く日本株)303 銘柄(22 年 12 月末基準)
投資対象	STOXX JAPAN 600/Global 1800exJapan
銘柄選定基準	ユニバース採用銘柄のうち、パリ協定の制約条件内で期待リターンの高い銘柄を選定
銘柄入替	6 月、12 月(年 2 回)
構築方法	Axioma 社のリスクモデルを用いてリスクコントロールのもと期待リターン最大化の最適化を実施

* 指数の算出・公表は STOXX 社が担当し、指数の全権利は同社に帰属します。

三菱 UFJ 信託銀行は、国内の年金運用で培った商品開発力と、STOXX 社のインデックス算出・管理ノウハウの融合により、国内外のお客さまの幅広い資産運用ニーズに応えると共に、「安心・豊かな社会」を創り出すためのサステナビリティ活動にも取り組んでまいります。

【* STOXX 社の概要】

- ・1997 年設立のドイツ取引所(Deutsche Börse Group)傘下の指数開発・提供会社。
- ・2019 年 9 月、ドイツ取引所が米国リスク分析モデル提供会社 Axioma 社を買収し設立された Qontigo 社の一部である。

以 上

(照会先) 三菱 UFJ 信託銀行 アセットマネジメント事業部 プロダクト戦略グループ sramd_post@tr.mufg.jp