

# S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

即時發佈

## 標普道瓊斯指數以核心地區及國家基準指數為基礎 推出全球 ESG 指數系列

紐約，2019年5月21日：領先全球的金融指數供應商標普道瓊斯指數（S&P DJI）今天宣佈，旗下的全球環境、社會及管治（ESG）指數家族將增加新成員。藉助標普 20 年來在 ESG 指數創新及編算方面的經驗，新增指數將以標普全球 1200 指數、標普歐洲 350 指數、S&P/ASX 200 指數及標普日本 500 指數等核心指數為基礎，反映市場表現。

新增指數亦包括標普道瓊斯指數廣為人知的國家及地區大中型股基準指數的 ESG 版本，涵蓋美洲、歐洲、歐非中東及亞太區。全球 ESG 指數系列使用增強的 ESG 評分體系及細化數據，以計算被納入或剔除公司的評分。

標普道瓊斯指數行政總裁 Alex Matturri 表示：「繼 4 月推出標普 500 ESG 指數及 ESG 評分體系後，我們很高興能夠再次推出新的 ESG 指數系列。我們致力於提供多元的產品組合，令客戶可以額外從 ESG 的角度審視投資。新指數為市場參與者提供了重要的投資工具，協助他們實現投資理念的同時取得與主流基準指數一致的投資回報水平。」

標普道瓊斯指數的 ESG 評分體系是決定指數成份股納入資格和選擇程序的基礎。該 ESG 評分體系受標普道瓊斯指數管理委員會監管，由 ESG 數據提供商 RobecoSAM 旗下的 SAM 部門計算。該 ESG 評分體系亦可授權予市場人士獨立使用，以作研究或投資用途。

全球 ESG 指數成份股資格主要受制於其 ESG 評分、公司業務範疇以及聯合國全球契約原則（UNGC）。指數成份股將不包括生產或銷售煙草，以及煙草相關產品及服務收益佔其總收益 10% 以上的公司。任何直接參與具爭議武器業務、或持有另一家參與相關業務公司 25% 或以上股權的公司亦不會被納入指數。此外，凡違反聯合國全球契約原則或相關評分欠佳的公司，以及在全球行業分類標準（GICS）框架下獲得的標普道瓊斯指數 ESG 評分屬最低 25% 的公司也不符合納入資格。儘管成份股資格審核嚴格，但最後得出的 ESG 版本指數將獲得與其地區或國家基準指數相近的風險與回報水平。

標普道瓊斯指數 ESG 指數全球主管 Reid Steadman 指出：「在設計核心地區及國家 ESG 指數家族時，我們進行了深入的研究，並遵從嚴謹的分析標準，我們為此感到自豪。投資者向來對 ESG 深感興趣，現時市場參與者亦逐漸將 ESG 因素與投資融合。透過與 SAM 的合作，我們推出了增強的 ESG 評分體系，專門用作指數編算。」

新聞發佈

此次推出的 **22 項地區及國家 ESG 指數** 包括：

- S&P/ASX 200 ESG 指數
- 標普歐洲 350 ESG 指數
- 標普日本 500 ESG 指數
- 標普全球 1200 ESG 指數
- 標普美國大中型股 ESG 指數
- 標普加拿大大中型股 ESG 指數
- 標普韓國大中型股 ESG 指數
- 標普北美洲大中型股 ESG 指數
- 標普歐洲發達市場大中型股 ESG 指數
- 標普中東及非洲發達市場大中型股 ESG 指數
- 標普亞太發達市場大中型股 ESG 指數
- 標普發達市場大中型股 ESG 指數
- 標普歐洲新興市場大中型股 ESG 指數
- 標普拉丁美洲新興市場大中型股 ESG 指數
- 標普中東及非洲新興市場大中型股 ESG 指數
- 標普亞太新興市場大中型股 ESG 指數
- 標普新興市場大中型股 ESG 指數
- 標普全球大中型股 ESG 指數
- 標普亞太發達市場（韓國除外）ESG 指數
- 標普亞太新興市場+大中型股 ESG 指數
- 標普發達市場 BMI（韓國除外）大中型股 ESG 指數
- 標普新興市場+大中型股 ESG 指數

標普道瓊斯指數於過去 20 年在 ESG 指數編算方面擔當領導角色。自 1999 年推出全球首項道瓊斯可持續發展指數（DJSI）起，標普道瓊斯指數至今已提供一系列 ESG 指數方案，包括 2018 年面世的碳效率指數。在 2019 年 4 月，標普道瓊斯指數推出以標普 500 指數為基礎的標普 500 ESG 指數。如要深入了解全球 ESG 指數家族的編算方法，請瀏覽網站 [www.spdji.com](http://www.spdji.com)。

### 關於標普道瓊斯指數

標普道瓊斯指數是全球最大的指數概念、數據及研究資源供應商，亦負責編算標普 500 指數及道瓊斯工業平均指數等金融市場權威指標。追蹤本公司指數的金融產品資產總值高於追蹤其他任何指數的金融產品資產總值。自 Charles Dow 於 1884 年創立首項指數以來，標普道瓊斯指數一直致力創新、開發各種資產類別的指數，協助投資者衡量市場表現及進行交易。

標普道瓊斯指數是標普全球（紐約證券交易所代碼：SPGI）旗下公司，為個人、公司及政府提供重要的市場資訊，協助他們作出明智的決定。請瀏覽 [www.spdji.com](http://www.spdji.com) 以了解詳情。

媒體查詢：[spdji.comms@spglobal.com](mailto:spdji.comms@spglobal.com)

新聞發佈