

富时社会责任指数面世 15 周年 再推出全新的可持续投资指数

- 自 2001 年推出富时社会责任指数以来，可持续投资模式渐成主流
- 新推出 FTSE4Good 新兴市场指数及 FTSE4Good 新兴拉丁美洲指数
- 即将推出全新的 ESG 评级数据模型
- FTSE Russell 预期投资者对相关的 ESG 数据和 “Smart Sustainability” 指数的需求将会增加

FTSE Russell 今天庆祝旗舰 ESG 指数系列富时社会责任指数 (FTSE4Good) 面世 15 周年；该指数系列于 2001 年推出，为投资者提供一个具透明度的客观基准。只有那些符合特定环境、社会及管治 (ESG) 准则的公司方获纳入该指数系列，而 FTSE Russell 将定期审视以确保有关公司的表现持续与准则一致。

回顾 15 年前，评估公司的过程相对简单，现在采用的方法更见深入和精密。自 2001 年起，该准则所涵盖的范畴由起初的三个主题*显著增加至现时的 14 个；模型所评估的指标数目亦由约 40 个增至 300 多个，并根据公司所经营的行业和国家分类应用。

此外，该模型特别强调量化和行业特有指标。例如在分析健康和主题时，FTSE Russell 将评估工程及建筑公司的工业事故死亡率，在处理气候变化主题时则计算能源公用事业公司每兆瓦时所排放的温室气体吨数。

随著大部份大型机构投资者把 ESG 因素列作考虑标准，可持续投资领域出现明显的变化**。适逢富时社会责任指数面世 15 周年，FTSE Russell 今天推出 FTSE4Good 新兴市场指数及 FTSE4Good 新兴拉丁美洲指数，使该系列的指数增至超过 15 个，以便运用富时社会责任指数的投资者进行新兴市场配置。

与此同时，FTSE Russell 亦推出全新的 ESG 评级数据模型，透过 300 多项指标提供逾 4,100 家公司的环境、社会及管治数据；绿色收入（低碳经济）数据模型的用户将可取得这些数据。

近年，FTSE Russell 的可持续投资服务渐趋广泛，富时社会责任指数便是其中之一，其他服务包括早前推出的绿色收入（低碳经济）数据模型和 FTSE Russell 首个 Smart Sustainability 指数。绿色收入（低碳经济）是一项创新的数据模型，用以追踪赚取绿色收入的公司，而现有的可持续投资模型都缺乏这个重要数据。Smart Sustainability 指数***率先结合聪明贝他因素策略和气候变化因素，并获欧洲资产管理公司 Legal & General Investment Management (LGIM) 新成立的基金 Future World Fund 选作基准。滙丰银行英国退休金计划 (HSBC Bank UK Pension Scheme) 的界定供款计划已把该基金列作股票预设选项，总值 18.5 亿英镑。

FTSE Russell 首席执行官 Mark Makepeace 表示：

「我们在 15 年前推出富时社会责任指数系列时，外界抱持怀疑态度，认为这是只限专业投资者涉足的领域。自此以后，全球市场和投资环境经历巨变。可持续投资、气候风险、低碳经济转型及整合 ESG 因素等议题已经成为资产持有人、资产经理、投资顾问及银行等客户的关注重点。」



ESG 投资渐成全球主流：

现已签署联合国责任投资原则（PRI）的机构超过 1,500 个，其管理资产总值逾 60 万亿美元，较 2011 年增长一倍**。签署机构承诺履行一系列的原则，包括在投资分析和决策过程中纳入 ESG 原则，并须编制详细的年度报告，汇报落实原则的进展。

伦敦证券交易所集团是支持全球绿色及可持续融资行动的先驱，提供全面的绿色和可持续投资产品。如欲了解详情，请浏览我们的[环球可持续投资中心](#)。

— 完 —

编辑垂注：

* 该 14 个主题包括：反贪腐、生物多样性、气候变化、企业管治、消费者责任、健康及安全、人权及社群、劳工标准、污染及资源、风险管理、供应链（环境和社会）、赋税透明度及水资源使用

** 资料来源：<https://www.unpri.org/about>

*** [FTSE All-World Ex CW Climate Balanced Factor Index](#)

如欲查询详情：

媒体办公室

Ed Clark	+44 (0) 20 7797 1222
Tim Benedict	+1 212 314 1199
	newsroom@lseg.com

地区联系人

香港: Fennie Wong	+852 2164 3267
悉尼: Laura McCrackle	+61 2 9293 2867

编者注：

关于 FTSE Russell:

FTSE Russell 是全球提供创新指数编制、分析与数据方案的领跑者，计算数以千计的独特指数，用以量度全球超过 80 个国家的市场和资产类别基准，涵盖全球 98% 的可投资市场。

FTSE Russell 指数的专业知识与产品获全球机构投资者和零售投资者广泛使用，现时以 FTSE Russell 指数作基准的投资产品总值超过 10.8 万亿美元。在过去 30 多年来，众多领先的资产所有人、资产管理人、ETF 提供商和投资银行均以 FTSE Russell 指数作为投资业绩比较基准，并且用以创立 ETF、结构性产品和指数衍生品。

FTSE Russell 指数的设计与管理基于最高的行业标准：指数的编制方法透明、有规则可循，并由领先的市场参与者组成的独立委员会负责监督。FTSE Russell 完全遵守国际证监会组织（IOSCO）的原则，其合规声明也获得独立认可。另外，为配合客户需要及建立良好的客户关系，FTSE Russell 专注于指数创新，致力强化其产品服务的广度、深度和影响力。

FTSE Russell 由伦敦证券交易所集团全资持有。

欲知更多资讯，请登录 www.ftserussell.com



Press Release



FTSE
Russell

© 2016 年伦敦证券交易所集团公司及其附属企业(“LSE Group”)。 LSE Group 包含(1)FTSE International Limited (“FTSE”)、 (2) Frank Russell Company (“Russell”)、 (3) FTSE TMX Global Debt Capital Markets Inc. 及 FTSE TMX Global Debt Capital Markets Limited (合称 “FTSE TMX”) 和 (4) MTSNext Limited (“MTSNext”)。 版权所有。

FTSE Russell®为 FTSE、 Russell、 FTSE TMX 和 MTS Next Limited 的商号名称。“FTSE®”、“Russell®”、“FTSE Russell®”、“MTS®”、“FTSE TMX®”、“FTSE4Good®”及 “ICB®” 和本文使用的全部其他商标与服务标记（不论是否已经注册）均为 LSE Group 附属企业或其相关特许人持有或许可的商标和 / 或服务标记，并由 FTSE、 Russell、 MTSNext 或 FTSE TMX 持有或由其授权使用。

所有信息只作说明用途。虽已尽力确保本文所提供的全部信息准确，但 LSE Group 任何成员公司或其各自的董事、主管人员、雇员、合伙人或特许人概不就本文任何错误或由于使用本文或其所载的任何信息或数据而引起的任何损失承担责任。

LSE Group 任何成员公司或其各自的董事、主管人员、雇员、合伙人或特许人概不就使用[指数产生的后果或出于任何特定目的而使用 [指数] 的适用性或适合性，做出任何明示或暗示的声明、预测、保证或陈述。

LSE Group 任何成员公司或其各自的董事、主管人员、雇员、合伙人或特许人并不提供任何投资建议，且本通信中的内容亦不得作为任何理财或投资的建议。LSE Group 任何成员公司或其各自的董事、主管人员、雇员、合伙人或特许人并不就投资任何资产提供意见。不应依赖本文任何信息做出投资某类资产的决定。不能直接投资于指数。把资产纳入指数并不代表建议购买、出售或持有该资产。不应在未取得经过认证的专业人士提供具体法律、税务和投资建议的情况下，根据本文所载的一般信息行事。

未预先取得 LSE Group 附属企业的书面同意，任何人士不得以任何形式或以任何手段、电子、机械、影印、录制或其他方法，复制、储存于检索系统或传送本文件的任何部份。如要使用及发布 LSE Group 的指数数据和使用其指数开发金融产品，必须取得 FTSE、Russell、FTSE TMX、MTSNext 和 / 或其特许人的授权。



London
Stock Exchange Group