

## FTSE Russell（富时罗素）扩大对中国和日本的可持续发展投资分析覆盖范围

- 约 800 只中国 A 股已被纳入涵盖气候、筛选和 ESG 评级在内的富时罗素可持续发展投资分析
- 对小盘股的覆盖面扩大后，对日本市场的研究范围已扩展至 1300 只股票
- 富时罗素可持续发展投资分析目前覆盖亚太地区超过 4300 只股票

全球指数和数据提供商 FTSE Russell（富时罗素）今日宣布，进一步扩大其在亚太地区的可持续发展投资分析。在富时罗素的 ESG 评级和数据模型中，增加对中国 A 股的覆盖范围，扩展至目前约 800 只 A 股。此举使富时罗素 ESG 对中国上市公司证券<sup>1</sup>的覆盖范围提升到 1800 只。此外，小盘股评级覆盖面扩大后，对日本证券的 ESG 研究已扩展至约 1300 只股票。富时罗素涵盖气候、筛选和 ESG 评级在内的详细的可持续发展投资分析已覆盖整个亚太地区超过 4300 多只股票<sup>2</sup>，目前对全球股票的总覆盖量达到 7200 只，以支持投资人履行尽责管理责任及在全球范围内将 ESG 融合进其主动和指数化投资策略。

富时罗素的可持续发展投资数据模型提供了广泛的衡量指标，适合多种方式应用，包括如气候风险考量、提供 ESG 评级和支持与联合国可持续发展目标（UN SDGs）相一致的投资。

中国 A 股是全球第二大经济体的增长驱动力，涵盖了从金融服务到科技创新等各类企业股票。中国近年来的政策和发展受到了市场参与者的欢迎。作为 2018 年富时股票国家分类审核结果的一部分，中国 A 股作为次级新兴市场从 2019 年 6 月开始已在逐步被纳入富时全球股票指数系列（FTSE GEIS），纳入的第一阶段<sup>3</sup>预计于 2020 年 3 月完成。

日本仍是集团的重要市场之一。富时罗素已成功推出多项创新，以满足日本投资者日益增长的将可持续发展投资纳入其投资组合的需求。这其中就包括创建 FTSE Blossom Japan 指数，该指数采用富时罗素创新的 ESG 评级数据模型，并被日本政府养老金投资基金（GPIF）采用作为其旗舰基金的核心 ESG 基准。

**伦敦证券交易所集团（LSEG）亚太区信息服务部负责人，董事总经理白美兰表示：**

“我们很高兴能够扩大对中国和日本的 ESG 评级覆盖，这标志着富时罗素正持续增加对亚太市场的投入。全球市场参与者越来越希望能将可持续发展投资纳入其投资理念和主动与指数化投资战略。我们的 ESG 评级和数据模型详细、结构化且高度透明，向市场参与者和上市公司展示了清晰的标准，以应用于其 ESG 尽责管理及互动沟通中。”

今年早些时候，富时罗素宣布将澳大利亚小盘股票纳入富时罗素的 ESG 研究范畴，使对澳大利亚股票的覆盖面扩展到约 280 只。

富时罗素的 ESG 评级包括一个整体评级，及其下细分的基础支柱、主题暴露和评分。这些支柱和主题的评估则基于适用于评定每家公司特定情况的 300 多个独立评估指标。每家符合条件的公司会获得一个分值在 0 至 5 分之



间的 ESG 评级，其中 5 分为最高评分。富时罗素 ESG 评级与联合国可持续发展目标（UN SDGs）相一致，所有 17 项可持续发展目标均反映在富时罗素 ESG 评级框架下的 14 个主题中。

更多信息可在富时罗素的 [ESG 评级数据页面](#) 上找到。

<sup>1</sup> 中国的 A 股、B 股和 H 股均以人民币计价，但根据上市地点的不同，其交易货币也存在差异。在中国境外注册和上市的中国企业通常被称为“红筹股”、“P 股”、“S 股”或“N 股”。

<sup>2</sup> 所有提及的证券均指权益证券。

<sup>3</sup> 中国 A 股纳入的第一阶段基于每个合格股票的可投资比例的 25%，并分为 3 个批次执行。

- 完 -

如欲了解更多信息：

## 媒体联络

Lucie Holloway / Nandeepr Roopray	+44 (0)20 7797 1222 <a href="mailto:newsroom@lsegroup.com">newsroom@lsegroup.com</a>
Sophie Mou Tina Wang	+852 2164 3267 +886 2 8979 4868

## 编辑说明：

### 关于富时罗素：

富时罗素是全球指数领军企业，为全球投资者提供创新的基准测试、分析和数据解决方案。富时罗素计算的指数达数千个，为 70 多个国家/地区的市场和资产类别提供衡量及基准测试服务，覆盖了全球 98% 的可投资市场。

富时罗素指数的专业知识和产品被全球的机构及散户投资者广泛使用。约有 15 万亿美元以富时罗素指数为基准。30 多年来，领先的资产所有者、资产管理公司、ETF 提供商和投资银行一直选择富时罗素指数作为其投资业绩的基准，并据此创建 ETF、结构性产品和以指数为基础的衍生品。

富时罗素指数的设计和管理贯穿着一套核心的通用原则：由主要市场参与者组成的独立委员会为基于规则的透明方法提供信息。富时罗素致力在指数设计和治理方面采用最高行业标准，并采纳 IOSCO 原则。同时，富时罗素还重点聚焦指数创新和客户合作领域，力求提高其产品的广度、深度和影响范围。

富时罗素由伦敦证券交易所集团全资拥有。

如欲了解更多信息，请访问 [www.ftserussell.com](http://www.ftserussell.com)

© 2019 伦敦证券交易所集团及其适用的集团企业（“LSE Group”）。LSE Group 包括 (1) FTSE International Limited（“FTSE”），(2) Frank Russell Company（“Russell”），(3) FTSE Global Debt Capital Markets Inc. 和 FTSE Global Debt Capital Markets Limited（统称为“FTSE Canada”），(4) MTSNext Limited（“MTSNext”）(5) Mergent, Inc.（“Mergent”），(6) FTSE Fixed Income LLC（“FTSE FI”）以及 (7) The Yield Book Inc.（“YB”）。保留所有权利。

FTSE Russell® 是 FTSE、Russell、FTSE Canada、MTS Next Limited、Mergent、FTSE FI 和 YB 的交易名称。“FTSE®”、“Russell®”、“FTSE Russell®”、“MTS®”、“FTSE4Good®”、“ICB®”、“Mergent®”、“The Yield Book®”以及本文使用的其他所有商标和服务商标（无论是否注册）均为 LSE Group 或其各自授权人的适用成员所拥有或许可的商标和/或服务商标，并由 FTSE、Russell、MTSNext、FTSE Canada、Mergent、FTSE FI 或 YB 拥有或许可使用。FTSE International Limited 是英国金融行为监管局授权和监管的基准管理机构。

