REFINITIV® MARKETPSYCH ESG ANALYTICS

ESG データを活用して
優れた投資判断をサポート

Refinitiv® MarketPsych ESG Analytics（マーケットサイク ESG アナリティクス）は、企業のサステナビリティ関連のニュースやソーシャルメディアをほぼリアルタイムで分析します。

MarketPsych Data の AI 搭載の自然言語処理エンジンを駆使して、世界中の何千もの報道機関やソーシャルメディアが毎日配信する膨大な記事を分析。そこから企業や国に関する ESG の定量的なインサイトを引き出すことで、より優れた投資判断を下すことができます。

Refinitiv MarketPsych ESG Analytics を投資プロセスに組み込む

リフィニティブと MarketPsych は共同で、サステナビリティや ESG に関わるリスクに対する人々の認識をモニタリングするための多次元的な ESG 分析手法を開発しました。この分析では、3 万社以上の企業と 252 の国や地域を対象に、12 の言語で重要な ESG テーマを検出して取り込みます。

Refinitiv MarketPsych ESG Analytics のフィードは、企業発表からサステナビリティのスコアを評価するのではなく、企業の ESG の取り組みや実績に関する外部のニュースやソーシャルメディア上の視点を提供します。

MarketPsych ESG Analytics は次のような目的で活用できます。

- クオンツ運用を行う投資家が相関性のないアルファ・シグナルを検出する
- 裁量運用を行う投資家が資産配分とリスク管理を行う
- 法人顧客が市場の視点をモニタリングする
- 規制当局が調査を的確に指示する
- アナリストやリサーチャーが隠れた関係性を見いだす
- 政府機関が ESG 関連のメディア報道をフォローする

AI 搭載

Refinitiv MarketPsych ESG Analytics の分析ソフトウェアである、AI 搭載の精巧な自然言語処理（NLP）エンジンは、カーボンニュートラルなクラウドサーバー上で稼動しています。この NLP エンジンは、特定の企業、都市、地域、国に関する ESG（環境・社会・ガバナンス）をテーマとしたコンテンツを検出してフィルタリングし、スコア評価を行います。信頼できる報道機関、インターネット上のニュース・ソース、ESG 関連のブログ、ソーシャルメディアから、何千万人もの筆者が執筆した毎日 200 万本を超える記事や投稿を取り込んでいます。

そして、特定のポリシー、アクション、テーマなど、4,000 以上の属性についてセンチメントをスコア評価します。したがって、Refinitiv MarketPsych ESG Analytics は、知的財産権の侵害、経営陣の不祥事、ESG 施策の不備など、市場に影響を及ぼすイベントなどに関するテキストの複雑な意味を定量化することができます。

カバレッジ

過去データ

1998 年 1 月 1 日以降の各種ニュース・ソースやソーシャルメディアのコンテンツが利用できます。

言語

英語については、1998 年以降のニュース・ソースがスコア評価されます。アラビア語、中国語、日本語、ポルトガル語は、2020 年 2 月以降のニュース・ソースがスコア評価されます。2021 年 1 月には、さらにオランダ語、フランス語、ドイツ語、インドネシア語、イタリア語、韓国語、スペイン語、ロシア語が追加されました。

企業のカバレッジ

フィードとアーカイブ全体で 120 か国以上の 2 万社を超える上場企業を網羅しています。

- 米州の株式 : 6,000 銘柄以上
- 欧州・中東・アフリカの株式 : 4,000 銘柄以上
- アジア太平洋の株式 : 8,000 銘柄以上

過去データでは、さらに 1 万社の上場廃止企業もカバーされています。

アクセス

Refinitiv MarketPsych ESG Analytics では、下の 2 つのデータ・パッケージを利用できます。

コア・パッケージ :

- すべての企業と国について、ニュースおよびソーシャルメディア全体で以下 17 種類の日次スコアを提供します。
  - バズ・スコア（1）
  - ESG 総合スコア（1）
  - ESG スコア（1）
  - ESG 不祥事スコア（1）
  - ピラー・スコア（3 = E、S、G）
  - カテゴリー・スコア（10）

アドバンスド・パッケージ :

- 日次コア・スコアに加えて、以下を提供します。
  - 300 種類の企業分析（CMPNY-ESG）
  - 456 種類の国別分析（COU-ESG）
  - これらの詳細分析は、分単位、時間単位、日単位で更新

コア・パッケージの総合スコア

コア･パッケージでは、17 種類の日次スコアが提供されます。これらは、基礎となるアドバンスド（詳細）･スコアを加重平均して算出されるスコアです。

Refinitiv MarketPsych ESG コア・データは、リフィニティブの ESG データにおけるコア・スコアと比較するために設けられました。このコア･スコアは、リフィニティブの ESG データと同じ業種別の比重とパーセンタイル・ランクを用いてスコアリングされます。両者の主な違いと付加価値は、ESG 報告の主体、すなわちそれが外部のメディアであるか（MarketPsych ESG Analytics）、それとも企業で作成された文書であるか（リフィニティブの ESG データ）、という点にあります。

アドバンスド・パッケージの詳細スコア

アドバンスド・パッケージでは、数百種類の ESG 指標のスコアがほぼリアルタイムで提供されます。これらのスコア項目は、リフィニティブの ESG データに含まれるスコアとも対応しています。

ESG Advanced Analytics には、以下のような 3 つの主要 ESG 指標が含まれています。

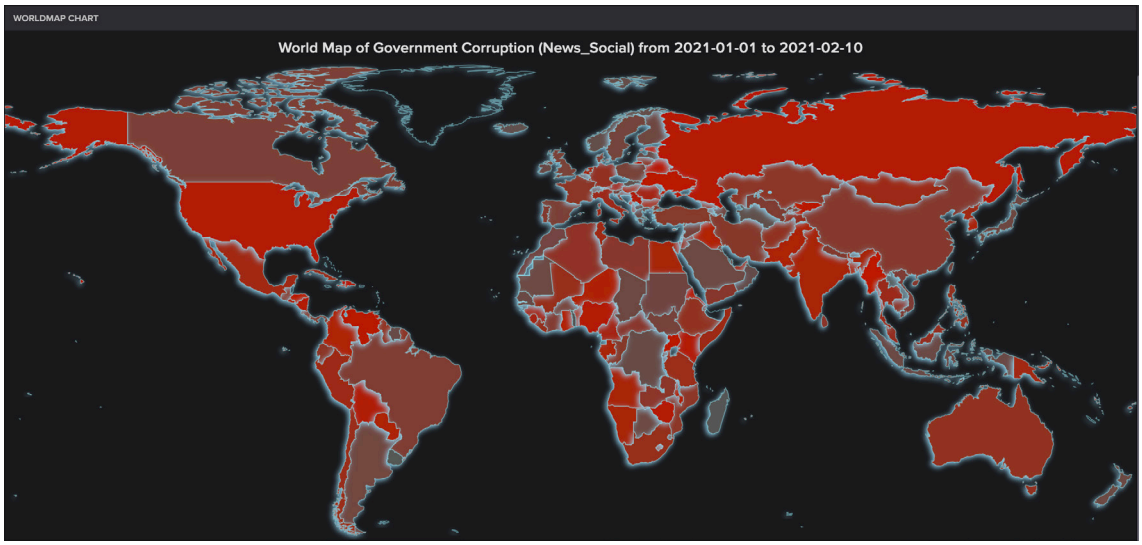
- 環境（E）指標 : Recycling（リサイクル）、CarbonEmissionsImprovement（炭素排出量削減）、ForestHealth（森林の健全性）など
- 社会（S）指標 : WorkplaceConditions（職場環境）、PublicHealthEfforts（公衆衛生の取り組み）、Misinformation（誤情報）など
- ガバナンス（G）指標 : ManagementTrust（経営陣の信用）、CivicEngagement（市民とのエンゲージメント）、SocialUnrest（社会不安）また、従来の ESG 分析に加えて、以下のような不祥事とバズ（注目度）の分析も提供します。
- 不祥事（C）指標 : AirborneEmissionsControversy（大気汚染関連の不祥事）、IndustrialAccident（労働災害）、TaxFraud（税務不正）など
- バズ指標 : メディアの注目度の代理指標であり、メディアにおける、あるアセット（企業や所在国）に関する ESG 関連の言及数を提供

Analytics のユースケース

Refinitiv MarketPsych ESG Analytics を使用することにより、投資戦略に役立つ情報が得られます。

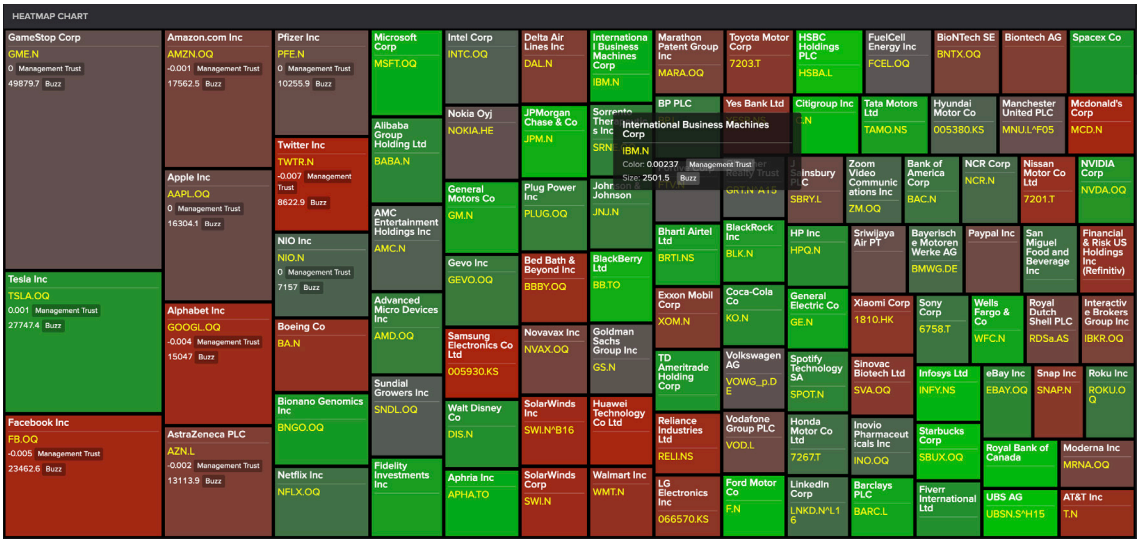
カントリー・リスク管理スクリーニング

政府の腐敗スコアを表示して、世界のどこで汚職が報じられているかを確認することができます。アナリストはこの情報を投資戦略や事業計画で考慮することができます。



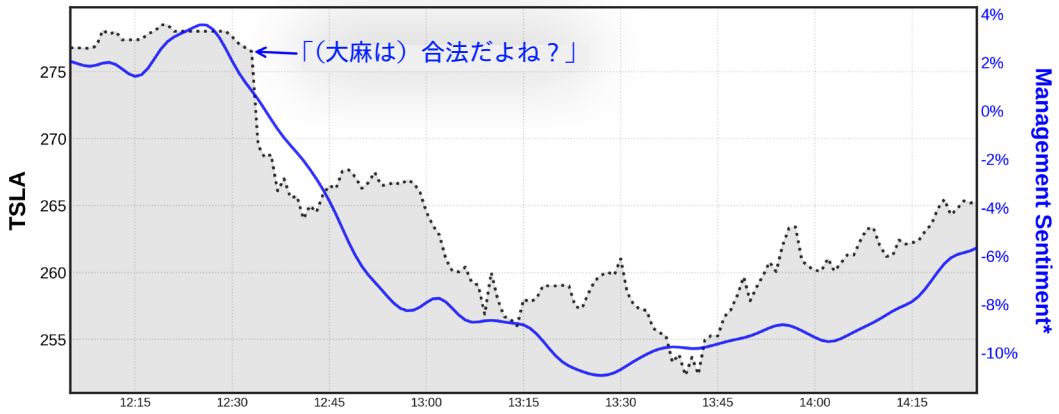
リサーチ・ツールと視覚化

企業の経営陣の信用度を視覚化して、経営陣の信頼性に関する一般的な見方について、容易に理解を深めることができます。



ほぼリアルタイムの企業リスク管理

経営陣のセンチメントを分析に取り入れることにより、主要メディアで大きく報道される前に不祥事を把握することができます。下の例は、2018 年 9 月 8 日、ポッドキャスト「The Joe Rogan Experience」で Elon Musk 氏が大麻を吸引する姿が配信された後の Tesla 社の株価と ESG スコア ManagementSentiment（経営陣のセンチメント）の反応を示しています。



クオンツ・ポートフォリオ管理

ESG 詳細スコアの 1 つに WorkplaceSentiment（職場環境のセンチメント）があります。基本的なクオンツ・リサーチでは、S&P 500 企業を前月の WorkplaceSentiment スコアでランク付けすると、センチメントが最も高い企業（上位 5%）の株価は、センチメントが低い企業（下位 5%）を毎月大幅に上回っています。最新のクオンツ・リサーチについては、リフィニティブのホワイトペーパーをご覧ください。

Web サイト：refinitiv.com/ja

お問い合わせ先
URL：refinitiv.com/ja/ask
電話：03-6743-6515

Refinitiv（リフィニティブ）はロンドン証券取引所グループ（LSEG）のグループ企業として、金融市場のデータとインフラストラクチャを提供する世界有数のプロバイダーです。Refinitiv の売上高は 62.5 億ドルに上り、190 カ国で 4 万余りの企業・機関、40 万を超える利用者を擁し、世界全体で金融にかかわる市場参加者を支えています。お客様が自信を持って重要な投資や取引、リスク判断を実行できるように、Refinitiv は情報とインサイト、テクノロジーを提供しています。独自のオープン・プラットフォームとクラス最高のデータおよび専門知識を組み合わせることで、選択と機会に結び付け、お客様とパートナーの皆様のパフォーマンス、革新、成長を促進してまいります。詳しくはウェブサイトをご参照ください。https://www.refinitiv.com/ja

@RefinitivJP @RefinitivJP

An LSEG Business

REFINITIV®