MORNINGSTAR®

News Release

傳媒查詢：

何羽 Stephanie Ho, +852 2973 4655 or Stephanie.Ho@morningstar.com

黃夕 Imogene Wong, +852 2973 4646 or Imogene.Wong@morningstar.com

即時發布

晨星(Morningstar) 產品及服務提供對企業、基金及基金公司的永續性評估工具

晨星基金及基金公司ESG 實踐程度(Morningstar ESG Commitment Level for strategies and asset managers)及晨星企業ESG 風險評級評估(ESG Risk Rating Assessment for companies)可協助投資者進行比較，有助於針對ESG 相關的投資選擇。

台北，2021 年 5 月 13 日 -- 全球領先的獨立第三方投資研究機構 Morningstar, Inc. (Nasdaq: MORN)本週於其旗艦投資研究平台(包括 Morningstar Direct™ 及個人投資者網站 Morningstar.com®)導入兩項全新針對環境、社會及公司治理(ESG)的評估工具——晨星基金及基金公司 ESG 實踐程度和晨星企業 ESG 風險評級評估。

這兩項新的評估工具已納入晨星的獨立評級工具系列，為投資者簡化投資流程及支持長期投資決策。同時，它們亦成為晨星現有永續投資分析工具系列的一部分，晨星永續投資分析工具包括晨星基金永續性評級、晨星投資組合碳風險評分(Morningstar® Portfolio Carbon Risk Score™)及晨星低碳基金標籤(Morningstar® Low Carbon Designation™)、晨星永續屬性(Morningstar Sustainable Attributes℠)、晨星投資組合產品參與度指標(Morningstar® Portfolio Carbon Risk Score™)和代理投票數據。

Sustainalytics 行政總裁 Michael Jantzi 指出：「不同類型的投資者都希望在進行永續投資選擇及了解重大 ESG 風險時得到協助。藉由持續將基金和證券層面的 ESG 數據與觀察納入晨星各產品及服務平台，我們可針對各種 ESG 問題及應對方法，向投資者表達及說明其風險和投資機會，以協助投資者作出明智的投資決策。」

晨星於 2020 年 7 月收購了全球享負盛名的 ESG 研究、評級及數據機構 Sustainalytics，這次推出永續性評估證明了兩家公司強大的聯動能力，為各類型的投資者提供跨資產類別的永續投資研究分析。晨星日前的研究數據及報告顯示，全球永續發展基金在過去三年持續保持穩定增長，且 2021 年第一季的資產規模來到接近 2 兆美元。

晨星基金及基金公司 ESG 實踐程度

即日起，評估接近 900 檔基金及 70 家基金公司的晨星 ESG 實踐程度之資訊將在 Morningstar Direct、Morningstar Office℠*及 Morningstar.com®的付費會員(Premium member)*平台中提供，Morningstar® Advisor Workstation™*及 Morningstar® Analyst Research Center™*則可望於本月下旬提供前述資訊（以*標記的晨星服務現時未有在亞洲（印度除外）地區提供）。

ESG 實踐程度評估反映晨星基金研究分析師對基金和基金公司在投資流程中融入 ESG 因子的程度所作出之質化分析。該評估會根據領先(Leader)、進階 (Advanced)、基本(Basic)及初階(Low)四個標籤，以簡單方式呈現基金公司或基金的 ESG 資源、政策及專門知識。

繼 2020 年 11 月首次發表的研究報告後，晨星基金研究團隊於今日發表了第二份 ESG 實踐程度評估報告，進一步涵蓋 251 檔基金和 31 家基金公司。報告摘要包括：

- 在評估的 140 檔基金策略中，只有一檔獲得「領先」(Leader) 標籤，19 檔為「進階」(Advanced)，59 檔「基本」(Basic)，及 61 檔「初階」(Low)。此分佈反映了我們這次涵蓋更多非專注 ESG 策略的基金。
- 在 31 家獲得評估的基金公司中，只有澳洲的 Affirmative Investment Management 獲「領先」(Leader) 標籤。東方匯理(Amundi)、法國巴黎資產管理(BNP Paribas Asset Management)、匯豐環球投資管理(HSBC Global Asset Management)、木星資產管理(Jupiter)和 LGIM 5 家公司獲得「進階」(Advanced) 標籤。
- 最多基金公司(13 家)獲得「基本」(Basic) 標籤，包括安聯投資(Allianz Global Investors)、景順(Invesco)、摩根資產管理(JPMorgan)、道富環球投資管理(State Street)和普徠仕(T. Rowe Price)。其餘 12 家則屬於「初階」(Low)，包括富蘭克林坦伯頓(Franklin Templeton)、駿利亨德森(Janus Henderson)、Mellon Investments 和 VanEck。

晨星分析師亦在報告中概述了他們認為是基金公司的最佳做法。隨著行業不斷發展，分析師對三大支柱，即理念與流程、資源和積極擁有權(active ownership)，列出最優秀的做法。

分析師將不斷擴展晨星 ESG 實踐程度的涵蓋範圍，並延伸至更多已獲得晨星基金研究評級(Morningstar Analyst Rating™)的基金和基金公司。

按此進一步了解 ESG 實踐程度，並可按此瀏覽研究方法論。

晨星企業 ESG 風險評級評估

晨星亦於今日推出晨星 ESG 風險評級評估，讓投資者容易進行比較及掌握不同行業間公司的整體 ESG 風險情況。目前，在 Morningstar Direct、Morningstar Office℠*、Morningstar® Advisor Workstation™*及

Morningstar.com®的付費會員(Premium member)*平台，已提供 13,000 家企業的相關資訊（以*標記的晨星服務現時未有在亞洲（印度除外）地區提供），預計於本月稍晚時間前述數據亦可在晨星股票數據服務中取得。

晨星企業 ESG 風險評級評估以視覺方式呈現 Sustainalytics 的 ESG 風險評級，衡量企業面臨個別行業的重大 ESG 風險程度，以及評估企業管理相關風險的表現。這種結合管理層面和風險程度層面的獨特評估方式，最後得出絕對的 ESG 風險評估結果。

晨星企業 ESG 風險評級評估採用了晨星基金永續性評級中易於識別及比較的地球標示（晨星基金永續性評級在 2016 年由晨星與 Sustainalytics 共同推出，為業界首個針對基金層面的永續性評級）。此標示分為 1 至 5 個地球評級：可忽略風險(5 個地球，0–9.99)、低風險(4 個地球，10–19.99)、中等風險(3 個地球，20–29.99)、高風險(2 個地球，30–39.99)及嚴重風險(1 個地球，40 或以上)。

晨星企業 ESG 風險評級評估為最近 Sustainalytics 的 ESG 風險研究正式融入至晨星股票研究方法論後的另一項新評估。歡迎按此進一步了解晨星企業 ESG 風險評級評估，並可按此瀏覽常見問題。

關於 Morningstar 以及 Morningstar Investment Management Asia Limited

Morningstar, Inc.是全球領先的獨立投資研究機構之一，業務遍及北美、歐洲、澳洲及亞洲。Morningstar 為個人投資者、財務顧問、資產管理公司及擁有人、退休計劃提供者和贊助商，以及機構投資者在債券及私人資本市場提供廣泛的產品和服務。Morningstar 提供有關各種投資產品的數據和研究報告，包括管理投資產品、上市公司、私人資本市場、債務證券和即時全球市場數據。Morningstar 亦有提供投資管理及顧問服務，截至 2021 年 3 月 31 日，Morningstar 所管理及給予投資建議的資產約 2,440 億美元。Morningstar 在全球 29 個市場提供業務及服務。請瀏覽以下網站以獲取更多資訊： www.morningstar.com/company。歡迎關於晨星的 Twitter 帳號@MorningstarInc。

Morningstar Investment Management Asia Limited (晨星投資管理亞洲有限公司) 獲香港證券及期貨事務監管委員會授牌向專業投資者提供投資研究及投資諮詢服務，其服務受證券及期貨事務監管委員會監管。此新聞稿中闡述的研究服透過晨星投資管理亞洲有限公司負責提供。

###

©2021 Morningstar, Inc. All Rights Reserved.

MORN-R