

晨星 Sustainalytics 增强上市公司物理气候风险评估

物理气候风险指标助力投资者评估投资组合中的公司直接和间接气候风险所产生的财务影响

2023年6月26日，上海 – 全球领先的 ESG 数据、研究和评级公司之一晨星 Sustainalytics 宣布增强其物理气候风险指标(Physical Climate Risk Metrics)产品，包括新增两份报告，旨在深入了解公司的物理气候风险敞口、损失及财务弹性。报告中增加了新的间接风险指标，以更好地满足气候相关财务披露工作组 (TCFD) 关于披露直接和间接物理风险的建议，并提供对整个业务价值链的深入洞察。

从现在起到 2050 年，在全球变暖的场景下，如果气候政策并不足以阻止全球变暖，相关物理风险将导致不可逆转的气候变化和严重后果，而在物理气候风险指标范围内，具有平均物理气候风险敞口的公司每 1 美元的累积运营现金可能蒙受相当于 0.45 美元的损失。晨星 Sustainalytics 为投资者提供了一整套针对气候并且持续完善的解决方案，其中包括全面的物理气候风险指标数据集，这能够结合公司的收入、物理资产价值和经营性现金流，呈现物理气候风险对财务的影响。

晨星 Sustainalytics 气候解决方案高级副总裁 Azadeh Sabour 表示：“为了加速脱碳并在有限时间内减轻全球变暖的影响，气候相关法规正在全球范围内日益普及。在此形势下，投资者需要相关数据和分析来了解由渐趋频繁的破坏性气候事件所造成的财务风险。我们最近推出的低碳转型评级 (Low Carbon Transition Ratings) 可以提供净零洞察，再结合我们的物理气候风险指标中的资产维度数据洞察，便可为投资者提供一套符合 TCFD 指导方针的气候解决方案。”

物理气候风险指标是一种自下而上的评估方法，分析与气候变化相关的不利影响，包括风暴、野火、洪水等物理灾害。该数据集可以协助投资者与 TCFD 的建议保持一致，还可呈现公司从现在到 2050 年的预期财务损失。这些指标是与屡获殊荣的物理气候风险分析领导者 XDI (Cross Dependency Initiative) 合作开发的，涵盖了 12,000 多家公司、1,200 万项资产、135 个行业部门和 235 个国家/地区。

收集和分析大量资产维度和气候的数据需要投入庞大的技术资源，而这些资源是许多投资者所不具备的。此外，用于定义风险敞口的资产维度数据也一向不易获得。借助物理气候风险指标，投资者可以量化投资组合中的公司所面临的物理气候风险，并从多个角度进行评估，包括具体危害、国家、估计资产损失、估计收入损失、时间序列和气候情景。

晨星 Sustainalytics 的物理气候风险指标目前提供标准解决方案，包含五种数据服务报告，今年晚些时候将通过线上客户端 Global Access 提供公司维度的报告。如需了解晨星 Sustainalytics 的物理气候风险指标及其全套气候解决方案，请浏览[此处](#)。

有关前瞻性陈述的注意事项

本新闻稿包含 1995 年《私人证券诉讼改革法》中界定的前瞻性陈述。这些陈述是根据我们目前对未来事件或未来财务业绩的预期而作出。前瞻性陈述涉及的事项具有不确定性，通常包含诸如“可能”、“或许”、“预期”、“打算”、“计划”、“寻求”、“预计”、“相信”、“估计”、“预测”、“潜在”或“继续”等词语。这些陈述涉及已知和未知的风险和不确定性，可能导致我们讨论的事件不会发生或与我们的预期有很大不同。对我们而言，这些风险和不确定因素包括（但不限于）我们的产品和服务未能创新，或者未能预测客户不断变化的需求。有关这些风险和不确定因素的完整描述，请参见我们提交至美国证券交易委员会的文件，包括最近一期 10-K 表格年报。如果这些风险和不确定因素中的任何一个成为现实，我们的实际未来业绩和其他未来事件可能与我们的预期有很大不同。我们并未承诺根据新的信息或未来事件而更新我们的前瞻性陈述。

###

关于晨星 Sustainalytics

晨星 Sustainalytics 是全球领先的 ESG 数据、研究、和评级公司之一，帮助全球投资者制定和实施负责任的投资战略。30 多年来，公司始终处于打造高质量创新解决方案的前沿，以满足全球投资者不断变化的需求。如今，晨星 Sustainalytics 与数百家世界领先的资产管理公司和养老基金合作，将 ESG 信息与评估纳入其投资流程。晨星 Sustainalytics 还与数百家公司及其金融服务机构合作，帮助他们在政策、实践和投资项目中考虑重要的可持续发展因素。晨星 Sustainalytics 的分析师遍布全球，他们在 40 多个行业中拥有多元化跨学科的专业背景。有关详细信息，请访问 www.sustainalytics.com。

晨星 Sustainalytics 提供各种指标、评级和评估，其中包括对未来事件的假设，这些事件可能会发生，也可能不会发生，或者可能与假设的情况有很大不同。这些指标、评级和评估均是观点陈述，可能会发生变化，不可视作保证，也不可作为投资决策的唯一依据。晨星 Sustainalytics 不提供投资建议或任何其他形式的（财务）建议，本新闻稿中的任何内容均不构成此类建议。

媒体查询：

葛丹

lavender.ge@morningstar.com 或 +852 2973 4670
