

Morningstar Sustainalytics 加強對上市公司的實體氣候風險評估

實體氣候風險指標助投資者評估投資組合內企業面對直接及間接氣候風險所產生的財務影響

2023年6月26日，香港 – 全球領先的ESG數據、研究及評級機構之一 Morningstar Sustainalytics 宣布加強其**實體氣候風險指標 (Physical Climate Risk Metrics)** 產品，包括加入兩個全新報告，就企業面對實體氣候風險相關的敞口、損失及財務抗禦力提供更深入的觀點。這些報告已加入新的間接風險指標，務求更有效地達到氣候相關財務披露工作小組 (TCFD) 建議的直接及間接實體風險披露水平，並提供覆蓋全個業務價值鏈的見解。

在全球熱室環境下，如果氣候政策不足以制止全球暖化，產生不能逆轉的氣候變化問題，而相關實體風險亦帶來嚴重後果，估計從現在到 2050 年，對**實體氣候風險指標**涵蓋範圍內面對一般程度實體氣候風險敞口的企業造成的財務影響或會相當於**每 1 美元累計營運現金損失 0.45 美元**。Morningstar Sustainalytics 的一系列針對氣候的解決方案正不斷完善，而實體氣候風險指標作為氣候解決方案的一部分，其全面詳盡的數據集從企業收入、實體資產價值及營運現金流等角度，為投資者提供了實體氣候風險對企業財務影響的能見度。

Morningstar Sustainalytics 氣候解決方案高級副總裁 Azadeh Sabour 表示：「隨著全球政府陸續實施氣候相關政策以加速去碳化的進度，加上降低全球暖化效應的工作逼在眉睫，投資者需要更多數據及見解，以了解這些日益頻繁且嚴重的氣候事件對他們帶來的財務風險。結合我們最近推出的**低碳轉型評級 (Low Carbon Transition Ratings)** 提供的淨零排放見解，及實體氣候風險指標在資產層面的數據性見解，我們為投資者提供一套符合 TCFD 指引的氣候解決方案。」

實體氣候風險指標是一個由下而上的評估方法，分析與氣候變化相關的實體災害造成的不利影響，包括重大風暴、山火、水災及其他災害。此數據集有助投資者以 TCFD 建議一致的角度審視其投資組合，為投資者提供透明度，令投資者了解由現在至 2050 年企業的預計財務損失。這些指標是與屢獲殊榮的實體氣候風險分析領導機構 **XDI** (Cross Dependency Initiative) 協作編製而成，覆蓋逾 12,000 間公司，涵蓋 1,200 萬種資產、135 個行業及 235 個國家/地區。

收集和剖析大量資產層面及氣候的數據需要龐大的技術資源，而大部分投資者都無法觸及這種資源。此外，用以釐定風險敞口的資產層面的數據，在以往的可用性及獲取途徑都有限。實體氣候風險指標可助投資者量化其投資組合內企業面對的實體氣候風險，並且獲取多角度評估，包括特定災害、國家、資產損失估算、收入損失估算、時間序列分析，以及氣候情景分析。

Morningstar Sustainalytics 目前透過其數據服務 (Data Services) 以標準組合（五個報告）提供**實體氣候風險指標**，並將於今年較後時間透過其網上客戶平台 Global Access 提供企業層面的報告。如欲了解更多關於 Morningstar Sustainalytics 的實體氣候風險指標的詳情及其氣候解決方案完整組合，請前往[此處](#)查閱。

有關前瞻性陳述的提醒

本新聞稿包含美國 1995 年《私人證券訴訟改革法案》所定義的前瞻性陳述。此等陳述乃根據我們目前對未來事件或未來財務表現的預測。前瞻性陳述就其性質而言涉及不同程度的不確定事項，並通常包含例如「可能」、「或會」、「預期」、「打算」、「計劃」、「尋求」、「預計」、「相信」、「估計」、「預測」、「潛在」或「繼續」等字眼。此等陳述涉及已知及未知的風險及不確定因素，可能導致我們提及的事件不會發生或與我們的預測出現重大偏差。就我們而言，這些風險及不確定因素包括（但不限於）未能革新我們提供的產品及服務，或未能預視我們客戶不斷改變的需求。此等風險及不確定因素的完整描述詳載於我們向美國證券交易委員會報備的檔案，包括最近期的 10-K 表格年度報告。倘若有任何此等風險及不確定性事件實際發生，實際的未來結果與其他日後發生的事件可能會與我們預期的情形截然不同。我們概不負責因新資料或未來事件引起的任何情況而更新我們的前瞻性陳述。

###

關於 Morningstar Sustainalytics

Morningstar Sustainalytics 作為領先的 ESG 數據、研究及評級機構之一，致力支援全球投資者制定和實施負責任的投資策略。30 多年以來，本公司一直積極開拓高品質的創新解決方案，以滿足全球投資者不斷變化的需求。如今，Morningstar Sustainalytics 已與數百間世界一流的資產管理公司和退休基金攜手合作，在其投資流程中納入 ESG 的相關資料和評估。本公司亦聯同與數百間公司及其金融服務機構，在其政策、實踐和投資項目中融入重要的可持續發展因素。Morningstar Sustainalytics 的分析師遍佈全球，他們擁有橫跨 40 多個行業界別的多元化跨學科背景。如欲了解更多資訊，請瀏覽網站：www.sustainalytics.com。

Morningstar Sustainalytics 提供各種指標、評級及評估，當中包括對未來事件的假設，而未來事件可能會或可能不會發生，且或與假設出現重大偏差。這些指標、評級及評估均屬意見陳述，且可能會有所變化，不應視為保證，亦不應作為投資決定的唯一依據。Morningstar Sustainalytics 不會提供投資建議或任何其他形式的（財務）建議，且本新聞稿內容並不構成此等建議。

傳媒查詢：

葛丹 (Lavender Ge)

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