

「SOMPOサステナビリティ・インデックス」(2026年度)構成銘柄を選定

SOMPOリスクマネジメント株式会社(代表取締役社長:中村 隆久、以下「SOMPOリスク」)は、ESG評価に優れた銘柄で構成されるESG指数「SOMPOサステナビリティ・インデックス」(2026年度)の構成銘柄を選定し、2026年6月上旬、構成銘柄へ選定した企業への通知を実施しました。

1. 概要

「SOMPOサステナビリティ・インデックス」は、ESG評価に優れた約300銘柄*1から構成される国内株式型のESG指数です。SOMPOリスクが「環境経営調査」と「ESG経営調査」*2の評価結果等に基づきESG総合スコアリング(サステナビリティ評価)によって銘柄を選定し、SOMPOアセットマネジメント(代表取締役社長:山口力、以下「SOMPOアセット」)が株式価値評価を組み合わせ独自に作成します。構成銘柄はSOMPOリスクのESG評価に基づき、毎年見直しています。

SOMPOアセットでは、当インデックスに追随するポートフォリオを構築し、バイ・アンド・ホールドによる長期投資を志向するESGプロダクトである「サステナブル運用*3」を2012年8月から行っています。当プロダクトは、現在、年金基金等の複数の機関投資家に採用されています。

当インデックスの構成銘柄に選定した企業にはロゴマークを提供しています。

SOMPOサステナビリティ・インデックスのパフォーマンス*4

SOMPOサステナビリティ・インデックス

2024年度における「SOMPOサステナビリティ・インデックス」のパフォーマンスは+0.4%となり、TOPIX(配当込み)の-1.5%を1.9%上回りました。2008年4月の当インデックスの計算開始から17年が経過し、2024年度は年度ベースで13度目のTOPIXを上回るパフォーマンスとなりました。また、SOMPOサステナビリティ・インデックスの設定来のパフォーマンスは年率+8.9%と、TOPIX(配当込み)の+7.1%を1.8%上回っています。



「SOMPOサステナビリティ・インデックス」は、ESG分野において高い知見と経験を持つ「SOMPOリスクマネジメント」が選定する経営クオリティの高い企業を幅広く採用し、当社の投資価値評価に応じてインデックス採用銘柄のウェイト配分を決定しています。これまでの安定的なパフォーマンス成績は、ESG要素とファンダメンタル・バリューを組み合わせる当インデックスのコンセプトの有効性を示していると考えています。

SOMPOサステナビリティ・インデックスのロゴマーク



ロゴマークは、企業・SOMPOアセットマネジメント・SOMPOリスクマネジメントの対話を通じてESG向上に向けた相互理解を深め*1、より企業の企業価値が拡大し*2、今後ますますの発展を祈念するイメージを示しています。

*1 2つの白丸が「対話」「相互理解」を表しています。

*2 丸が大きくなっていくことで「企業価値拡大」を表しています。

*1 全構成銘柄は非公表です。

*2 SOMPOリスク「ESG調査・評価の手法」<https://www.sompo-rc.co.jp/services/view/259>

調査・評価対象銘柄は全上場銘柄ではありません。対象銘柄は非公表です。調査に回答いただいた企業には、評価結果をフィードバックしています。

*3 SOMPOアセット「サステナブル運用」<https://www.sompo-am.co.jp/institutional/product/06/>

*4 SOMPOアセット「2024年度ステュードシップ活動報告」<https://www.sompo-am.co.jp/img/institutional/stewardship2024.pdf>

