

Morningstar 日本株式ジェンダー・ダイバーシティ・ティルト指数(除くREIT、税引前配当込み、ドルベース)

指数詳細

概要

Morningstar 日本株式ジェンダー・ダイバーシティ・ティルト指数(除くREIT)は、ジェンダー・ダイバーシティに関連する環境・社会・ガバナンス(ESG)基準に合った投資目的の達成を目指します。同指数は、Equileapが提供するデータと評価手法を活用し、確立されたジェンダー・ダイバーシティ・ポリシーが企業文化として浸透している日本企業、および、性別に関係なく従業員に対し平等な機会を約束している日本企業にエクスポージャーを持つことができるよう設計されています。

属性情報

| | |
|------------|-------------|
| 算出開始日 | 2023/03/27 |
| 遡及算出開始日 | 2015/12/18 |
| リバランス頻度 | 四半期ごと |
| 構成銘柄入れ替え頻度 | 年1回 |
| 加重方法 | 浮動株調整時価総額加重 |

Morningstar ID F00001F5A1

指数資産クラス 株式

ベース通貨 米ドル

リターン・タイプ トータリターン

ベンチマーク Morningstar 日本株式指数
(除くREIT、税引前配当込み、ドルベース)

指数特性

構成銘柄数 911

お問い合わせ先

指数提供者 Morningstar インデックス
Web サイト ContactDetailsWebsite
Email indexes@morningstar.com

パフォーマンス推移



四半期パフォーマンス

| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 | 年間 |
|------|--------|--------|-------|--------|--------|
| 2018 | 1.01 | -2.51 | 3.59 | -14.87 | -13.16 |
| 2019 | 6.82 | 0.47 | 3.03 | 8.11 | 19.53 |
| 2020 | -17.34 | 11.51 | 7.23 | 14.38 | 13.05 |
| 2021 | 2.16 | -0.55 | 4.90 | -4.51 | 1.78 |
| 2022 | -6.32 | -13.85 | -7.14 | 13.21 | -15.15 |
| 2023 | 6.76 | 5.86 | -0.56 | — | — |

直近パフォーマンス

| | 指数リターン% | ベンチマークリターン% |
|-------|---------|-------------|
| 3ヶ月 | -7.84 | -7.87 |
| 6ヶ月 | -0.05 | -0.20 |
| 1年 | 19.45 | 19.05 |
| 3年年率 | 2.80 | 2.22 |
| 5年年率 | 3.34 | 3.19 |
| 10年年率 | — | — |

リスク分析

| | 標準偏差 | | | シャープレシオ | | | 最大ドローダウン | | |
|--------|-------|-------|-------|---------|------|------|----------|-----------------------|--|
| | 3年 | 5年 | 10年 | 3年 | 5年 | 10年 | 10年(%) | 日付 | |
| インデックス | 15.71 | 15.39 | — | 0.11 | 0.17 | — | — | — | |
| ベンチマーク | 15.65 | 15.36 | 13.52 | 0.08 | 0.16 | 0.30 | -28.82 | 2021/10/01-2022/09/30 | |

バリュエーション指標

| | PER | PBR | PSR | PCFR | 配当利回り% |
|--------|-------|------|------|-------|--------|
| インデックス | 13.78 | 1.26 | 0.90 | 10.21 | 2.40 |
| ベンチマーク | 13.86 | 1.25 | 0.88 | 10.27 | 2.37 |

成長性・収益性指標

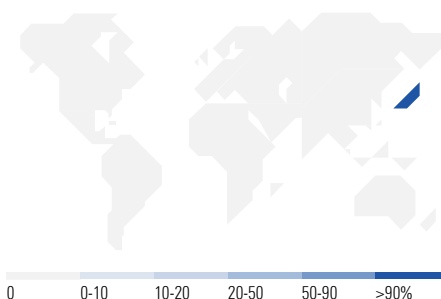
| | 純資産成長率 | 売上高成長率% | ROIC | ROE | ROA |
|--------|--------|---------|------|-------|------|
| インデックス | 10.21 | 8.71 | 8.96 | 11.56 | 5.65 |
| ベンチマーク | 9.89 | 8.49 | 9.00 | 11.52 | 5.79 |

Morningstar 日本株式ジェンダー・ダイバーシティ・ティルト指数(除く REIT、税引前配当込み、ドルベース)

ポートフォリオ分析

| 株式セクター分析 | インデックス% | ベンチマーク% |
|------------|---------|---------|
| 🔄 景気循環 | 37.7 | 37.7 |
| 🏠 素材 | 5.3 | 5.9 |
| 🛒 景気循環消費財 | 17.0 | 17.2 |
| 🏦 金融サービス | 13.0 | 12.3 |
| 🏠 不動産 | 2.3 | 2.3 |
| 🌊 景気敏感 | 44.8 | 46.2 |
| 📠 通信 | 6.7 | 6.1 |
| ⚡ エネルギー | 0.8 | 0.8 |
| 💰 資本財 | 23.8 | 25.0 |
| 💻 テクノロジー | 13.5 | 14.3 |
| ➡ 景気非連動 | 17.5 | 16.1 |
| 🛒 景気非連動消費財 | 7.1 | 6.6 |
| 🏥 ヘルスケア | 9.1 | 8.1 |
| 💡 公益 | 1.3 | 1.4 |

Morningstar 地域別構成比率



事業国別構成比率 %

| | |
|----|--------|
| 日本 | 100.00 |
|----|--------|

各種指標

| 指標 | インデックス | ベンチマーク |
|-------------------|--------|--------|
| 🏠 モート「広い」比率 % | 4.4 | 4.2 |
| 🏠 モート「狭い」比率 % | 14.5 | 13.8 |
| 🏠 モート「なし」比率 % | 24.5 | 22.5 |
| アナリストカバレッジ なし比率 % | 56.6 | 59.5 |

構成銘柄上位

| 銘柄名称 | 比率 % | 国 |
|-------------------------------------|------|----|
| Toyota Motor Corp | 4.88 | 日本 |
| Sony Group Corp | 2.85 | 日本 |
| Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | 2.72 | 日本 |
| Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | 1.80 | 日本 |
| Mitsui & Co Ltd | 1.53 | 日本 |
| Mitsubishi Corp | 1.52 | 日本 |
| Daiichi Sankyo Co Ltd | 1.45 | 日本 |
| Tokyo Electron Ltd | 1.44 | 日本 |
| ITOCHU Corp | 1.43 | 日本 |
| Shin-Etsu Chemical Co Ltd | 1.40 | 日本 |

| セクター | モート |
|-----------|-----------|
| 🛒 景気循環消費財 | 🏠 モート「なし」 |
| 💻 テクノロジー | 🏠 モート「なし」 |
| 🏦 金融サービス | 🏠 モート「なし」 |
| 🏦 金融サービス | 🏠 モート「なし」 |
| 💰 資本財 | 🏠 モート「なし」 |
| 💰 資本財 | 🏠 モート「なし」 |
| 🏥 ヘルスケア | 🏠 モート「狭い」 |
| 💻 テクノロジー | 🏠 モート「広い」 |
| 💰 資本財 | 🏠 モート「なし」 |
| 🏠 素材 | 🏠 モート「広い」 |

ESG リスク

ポートフォリオ・コーポレート・サステナビリティ・スコア



📊 インデックス | 📊 ベンチマーク

コーポレート・サステナビリティ・レーティング

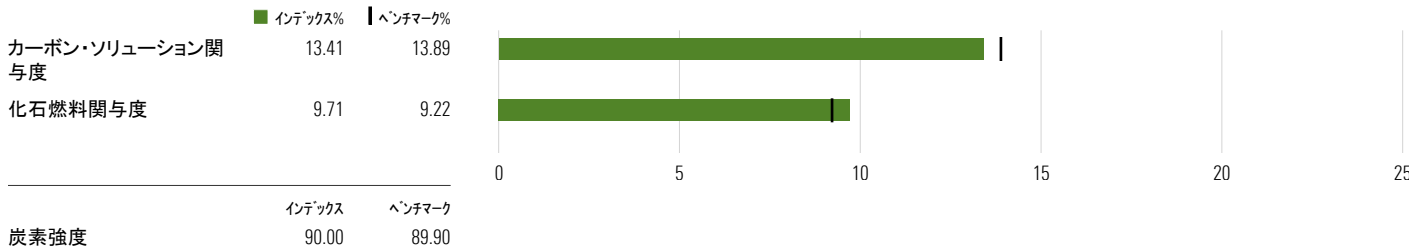
| | インデックス% | ベンチマーク% |
|---------------------|---------|---------|
| ポートフォリオ・ESG リスク・スコア | 99.74 | 99.58 |
| カバー率 | | |

Product Involvement

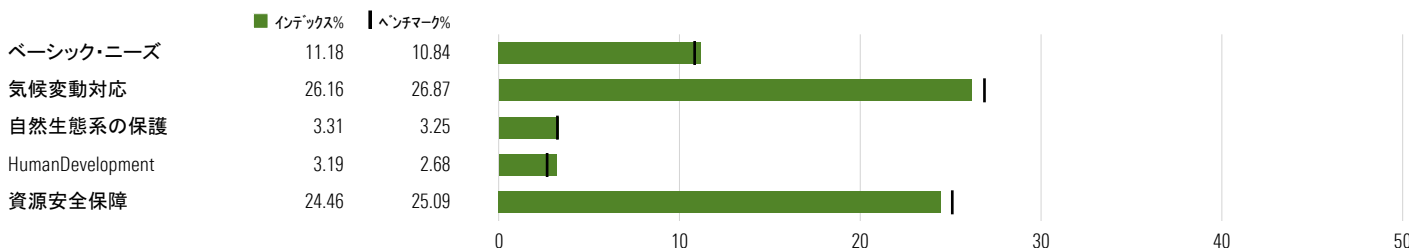
| | インデックス% | ベンチマーク% |
|----------------|---------|---------|
| アルコール | 1.07 | 1.00 |
| 非人道的兵器 | 1.02 | 1.03 |
| ギャンブル | 0.22 | 0.33 |
| GMO (遺伝子組換え食品) | 0.00 | 0.00 |
| 軍需産業 | 0.54 | 0.59 |
| 原子力 | 0.74 | 0.81 |
| パームオイル | 0.02 | 0.02 |
| 農薬 | 0.17 | 0.23 |
| 小型武器 | 0.25 | 0.25 |
| 石炭 | 0.48 | 0.59 |
| タバコ | 0.74 | 0.62 |

Morningstar 日本株式ジェンダー・ダイバーシティ・ティルト指数(除く REIT、税引前配当込み、ドルベース)

気候変動



インパクト



ディスクレーム

本レポートに記載されている内容は、情報提供のみを目的としたもので、作成日時点の情報であり、予告なしに変更することがあります。本レポートには Morningstar の専有情報が含まれており、Morningstar の事前の書面による承諾なしの利用、複製等は、全体一部分を問わず、損害賠償、著作権法の罰則の対象となります。本レポートおよび記載されている内容を違法または不正な目的のために使用することはできません。

本レポートに記載されている内容は、いかなる証券、運用商品、運用戦略に関する売買の申し出、販売促進や推奨を行うものではありません。さらに、投資助言ではなく、投資に関するいかなる意思決定を行うまたは行わないことを推奨するものではありません。指数の構成銘柄としてある銘柄が含まれていることについては、その銘柄の売買または保有を推奨するものではありません。指数はそれ自体運用商品ではなく、直接投

資することはできず、記載されている指数のリターンは実際の運用口座のリターンを表すものではありません。指数算出開始日前のリターンは、指数メソドロジーに基づき選及計算されたものです。選及計算によるパフォーマンスと実際の結果は大きく異なることがしばしばあります。過去のパフォーマンス(選及計算、実際のものともに)は将来のリターンを保証するものではありません。

この資料は英語で作成された資料の翻訳版です。日本語版と英語版との間で相違がある場合は英語版をご参照ください。英語版は <https://indexes.morningstar.com/our-products/gender-diversity> に掲載されています。

詳細は重要事項・各種定義をご覧ください。

関連資料

[指数メソドロジー](#)
[重要事項・各種定義](#)