

全球範圍內，資產所有者結合可持續發展投資和 Smart Beta 指數策略持續上升

- FTSE Russell（富時羅素）2020年調研結果顯示，全球 58% 的資產所有者預期將採用可持續發展投資和 Smart Beta 相結合的策略，相較 2019 年調研結果中 44% 的比例有所上升。
- 目前歐非中東（EMEA）地區仍是 Sustainable Smart Beta（智慧可持續發展投資）策略的主導市場，北美緊隨其後。
- 在可持續發展指標調整投資權重和負面篩選方法之間，資產所有者機構更偏好前者。
- 正在評估或實施可持續發展投資的資產所有者中，對不同資產類別的興趣比例分別為：股票（85%）、固定收益（58%）和多元資產（31%）。

全球指數、數據和分析結果提供商富時羅素發佈“智慧可持續發展：2020年全球資產所有者調研結果”報告（[英文版本](#)），該調研項目主要針對 Smart Beta 策略和可持續發展投資的融合。

富時羅素可持續發展投資數據和方法論部門主管 Jaakko Kooroshy 說：

“四年前我們首次開始有關可持續發展投資問題的調研，很快可持續發展投資這個話題就引起了很多市場興趣，令我們意識到有必要對其進行更深入的分析。在 2020 年，我們注意到全球資產所有者對將可持續發展要素結合進他們的 Smart Beta 策略（我們稱之為智慧可持續發展投資）的興趣顯著上升。這一點在我們與客戶的合作中也已體現出來，我們的客戶正在更多地尋求將這些參數納入 Smart Beta 指數，以作為其投資組合策略的基礎。”

倫敦證券交易所集團可持續發展投資業務部負責人 David Harris 說：

“2020 年上半年，受新冠全球疫情及對社會公平正義持續增加地關注等一系列因素的影響，領先的資產所有者需要重新對投資戰略和優先事項進行評估。這些事件導致投資者對環境和社會因素、國際合作及其對金融市場的影響的關注大大提高。考慮到這些大規模的轉變，將 Smart Beta 與氣候和可持續發展的優先事項結合起來，將成為資產所有者更大的投資趨勢，正如這份調查報告所顯示。”

全球上升趨勢

目前全球超過七成的資產所有者正在他們 2020 年的投資戰略中評估和實施可持續發展投資策略。此外，在全球使用和（或）評估 Smart Beta 策略的投資者中，58% 的投資者預期將可持續發展投資要素結合進其 Smart Beta 策略中，而這一比例在 2019 年為 44%。在預期將這些要素結合進其 Smart Beta 策略的受訪投資者中，近一半的比例希望在未來一到兩年增加他們在智慧可持續發展投資的配置。



從整個資產管理規模的角度來看，資產所有者對可持續發展要素的評估和採用有所增加，其中大型資產所有者對其興趣明顯更高。在資產管理規模大於/等於 100 億美元的投資者中，有 80% 的投資者已經評估或採用了可持續發展投資策略，而 2019 年這一比例為 54%。

歐非中東為主導地區，北美緊隨其後

在 2020 年，歐非中東（EMEA）地區資產所有者的可持續發展投資評估和採用率（85%）仍高於北美地區（63%）。此外，在將可持續發展投資要素結合進 Smart Beta 策略方面，歐非中東地區仍處於領先地位，正在評估或已採用 Smart Beta 的資產所有者中，超過八成預計將採用可持續發展投資和 Smart Beta 相結合的策略，而去年這一比例為 73%。

但是，2019 年調研結果中明顯的地區差異已在縮小。在北美，資產所有者的投資組合中對可持續發展投資的評估和應用比前一年增長超過 20 個百分點，達到了 63%。在評估或已採用 Smart Beta 策略的北美資產所有者中，預期將可持續發展要素與 Smart Beta 策略相結合的比例顯著上升，從 2019 年的 17% 升至 2020 年的 42%。

環境問題佔據關注問題榜單前列，調整投資權重取代負面篩選

氣候風險是 2020 年資產所有者的一個熱門話題，其中對於預期將可持續發展要素與 Smart Beta 策略相結合的投資者尤其是如此。氣候風險/碳排放是可持續發展主題中被討論最多的主題，達到了 64% 的關注度，排在第二的是環境因素，關注度達到 59%，此外公司治理和社會責任主題也廣為關注，達到 55% 的關注度。

此外，可持續發展投資資料最常見的應用方式已經轉向調整投資權重，投資者對負面篩選的興趣明顯下降，2019 年該比例為 64%，而 2020 年則降到了 48%，與此同時，更複雜的、基於可持續發展投資標準調整投資權重的方法熱度上升，從 2019 年的 36% 升至 2020 年的 55%。

投資者在多元資產類別的興趣增加

全球範圍內，在評估或採用可持續發展投資的資產所有者中，對不同資產類別的興趣比例分別為：股票（85%）、固定收益（58%）和多元資產（31%）。此前可持續發展投資理念於固定收益資產的應用一直落後於股票市場，但現在在歐非中東地區正在評估或已採用可持續發展要素於固定收益投資在調研物件中的比例高達 75%，在北美這一比例為 45%。

本次調研在 2020 年一月和二月進行，共有 139 名全球資產所有者參與，其中絕大多數參與調研機構位於北美（37%）、歐非中東地區（37%）以及亞太地區（21%），且參與調研機構類型多樣，包括政府組織（28%）、公司或私營企業（18%）、工會或行業養老金計劃（12%）以及非謀利性組織或大學（12%），其它調研對象包括保險公司、主權財富基金、醫療健康機構以及家族財富管理辦公室。



-結束-

媒體連絡人

Lucie Holloway (EMEA) +44 (0)20 7797 1126

Oliver Mann (EMEA) +44 (0)20 7797 1222

Tim Benedict (Americas) +1 917 582 0641

Jelena Nedelka (Americas) +1 929 228 6987

Sophie Mou (Asia Pacific) +852 2164 3267

電子郵件：newsroom@lseg.com

編者注：

關於 FTSE Russell(富時羅素):

富時羅素是全球指數行業的領導者，為全球投資者提供創新的基準、分析和數據解決方案。富時羅素計算成千上萬的指數，用以衡量和基準化70多個國家/地區的市場和資產類別，業務範圍覆蓋全球98%的可投資市場。

富時羅素指數的專業知識和產品已被全球機構和散戶投資者廣泛使用。目前，約有16萬億美元的投資額以富時羅素指數為基準。30多年來，領先的資產所有者、資產管理者、ETF提供者以及投資銀行選擇富時羅素指數作為其投資表現的基準，並創建ETF、結構性產品以及基於指數的衍生品。

富時羅素採用一套核心的通用原則指導其指數的設計和管理。這是由領先的市場參與者組成的獨立委員會基於規則提供的透明方法。富時羅素專注於在索引設計和管理中應用最高的行業標準，並遵循IOSCO原則。富時羅素還致力於提高指數產品服務的廣度、深度和範圍，專注於指數創新和增進客戶合作夥伴關係。

富時羅素由倫敦證券交易所集團全資擁有。

如需更多資訊，請流覽 www.ftserussell.com

*截至 2019 年 12 月 31 日富時羅素資產管理規模數值

©2020 年，倫敦證券交易所集團及其適用的集團企業(以下簡稱“倫敦交易所集團”)。LSE 集團包括 (1) FTSE International Limited (“FTSE”)、(2) Frank Russell Company (“Russell”)、(3) FTSE Global Debt Capital Markets Inc. 及 FTSE Global Debt Capital Markets Limited(統稱為“FTSE Canada”)、(4) MTSNext Limited (“MTSNext”)、(5) Mergent, Inc. (“Mergent”)、(6) FTSE Fixed Income LLC (“FTSE FI”)、(7) The Yield Book Inc (“YB”) 版權所有。

FTSE Russell®是 FTSE、Russell、FTSE Canada、MTSNext、Mergent、FTSE FI、YB 的商標。“FTSE®”、“Russell®”、“FTSERussell®”、“MTS®”、“FTSE4Good®”、“ICB®”、“Mergent®”、“The YieldBook®”以及本文使用的所有其他商標與服務標章(無論是已註冊的還是未註冊的)均為 LSE 集團適用成員或其各自的許可人擁有或許可的商標和/或服務標章，並且由 FTSE、Russell、MTSNext、FTSE Canada、Mergent、FTSE FI、YB 或 BR 根據許可擁有或使用。FTSE International Limited 由金融行為監管局(FCA，作為基準管理人)授權和監管。

