

# Truvalue LabsのESGデータと分析

## AIの力を最大限活用し、ESGのインサイトを解き明かす

投資家は、企業開示情報にとどまらず、企業のインパクトを把握するためのより信頼性の高い高品質なデータを求めるようになってきています。情報が溢れる今日にあっては、人口知能 (AI) の応用を中心に構築された最新の環境・社会・ガバナンス (ESG) 分析により、持続可能な投資についてより深いインサイトを得ることができます。

### Truvalue Labsが選ばれる理由

Truvalue Labsは、AIを応用し、リアルタイムにリスクと機会の両方を特定するタイムリーで客観的なESGデータを発掘する初めての企業です。当社は外部のソースから企業のESG行動に焦点を当て、従来のESGリスクデータのソースでは分からない、**ポジティブなイベントとネガティブなイベント**の両方を考慮します。Truvalue Labsでは機械学習を使用し、イベントの発生に伴って毎月数百万という文書を収集、抽出、分析してスコアを生成します。

### グローバルカバレッジ

**100K+**  
データソースの数

地方・国内・国際ニュース、非政府組織 (NGO)、監視団体、売買ブログ、業界刊行物、ソーシャルメディア

**120K+**  
企業数

上場および未上場企業をカバーし、13年間にわたり継続的に更新

**10+**  
言語

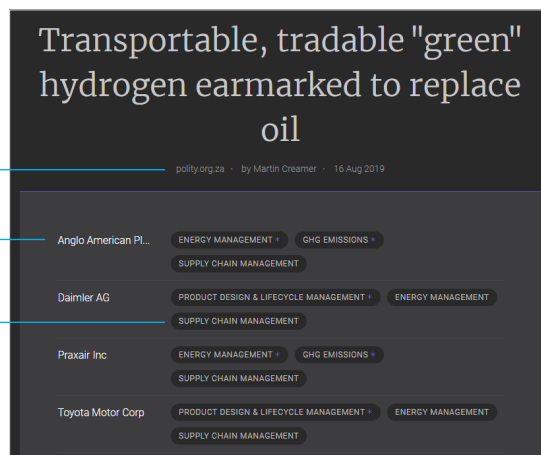
英語、フランス語、スペイン語、ドイツ語、中国語、日本語、ポルトガル語、イタリア語、オランダ語、デンマーク語、フィンランド語、ノルウェー語、スウェーデン語

### 10万を超える情報源から得られる情報を処理

ソース

複数のエンティティへ紐づけ

マテリアル/非マテリアルのカテゴリー



「企業の公開情報に依存しない、Truvalue Labsのデータの客観性を私たちは評価しています。タイムリーで重要なESGデータは、顧客のパートナーファンドのマネージャーの継続的なモニタリングや新しいマネージャーの評価・選任に役立ちます。」

Brunel Pension Partnership Ltd.  
最高責任投資責任者  
**Faith Ward氏**

### ワークフローの支援

世界最大手の資産運用会社やアセットオーナー、ウェルスマネージャー、コンサルタントが、受賞歴のあるTruvalue Labsのデータや分析を利用して、リスクと機会を明らかにし、より多くの情報に基づく投資判断を下しています。

#### • 資産運用会社

- アイデア創出とポートフォリオ構築
- コンポジットスコア
- ポートフォリオ分析、アラート、レポート
- 企業および産業リサーチ

#### • アセットオーナー

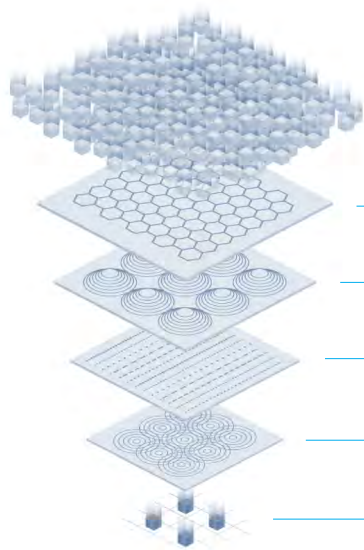
- マネージャーの選任とモニタリング
- 投資家の照会管理
- ポートフォリオ分析、アラート、レポート

#### • クォンツマネージャー

- ESGリスクプレミアムの反映
- 独自のESGスコア作成
- リスク管理

#### • リスク・法令遵守

- デューデリジェンス
- リサーチとモニタリング
- ポートフォリオリスク管理



### Truvalue AIエンジン

非構造化テキストからESG情報を定量化し、企業のESGパフォーマンスを第三者的な視点から提供します。

収集：100,000+の情報源 メディア、ステークホルダー、その他サードパーティ

抽出：4,500,000+のデータポイント 月間処理数

分析：300,000のシグナル 月間生成

生成：4つのキースコア 26のESGカテゴリと16のSDGs

提供：13年を超えるヒストリカルデータ 120,000+社のカバレッジ

## ESGソリューション

### 独自のスコア

Truvalue Labsのデータはノイズからシグナルを分離し、市場を上回る機会を発見するのに役立ちます。一般的な定量戦略とは相関がない、付加的な新種のESGデータを組み入れます。Truvalueは、サステナビリティ会計基準審議会 (SASB)<sup>™</sup>と持続可能な開発目標 (SDG) のカテゴリにおいて、短期、長期、およびパフォーマンスの傾向を計測する4つの重要なスコアを提供します。

### 複数の提供手段

FactSetワークステーションや、Truvalue Platform、データフィード、API、主要なクラウドプラットフォームを通じて、Truvalue Labsデータハブにアクセスが可能です。当社のプラットフォーム・ツールは、優れた検索機能、直感的なダッシュボード、インサイト豊富な分析を備えており、Truvalue Labsのデータを素早く統合することができます。

### 主な特徴

#### 差別化されたESGソリューションの顧客への提供

AIの力を活用して戦略を強化し、リスクを管理します。

#### SASBのマテリアリティフレームワークの活用

SASBが提供する業界標準のフレームワークを用いて、企業分析を行うことができます。

### カギとなるSpotlights

TruvalueのAIエンジンはSpotlight Eventsと呼ばれる最も重要なポジティブおよびネガティブなESGイベントを検出します。ESGイベントとその情報源、トピックス、影響の程度に対するこれまでにない透明性を活かしています。

### コネクテッド・コンテンツとワークフローソリューション

リサーチ、ポートフォリオ構築、インパクト評価、リスク管理、コンプライアンスの各プロセスに対応したESGソリューションにより、持続可能な投資のワークフローを強化します。信頼性の高いオープンなESGデータエコシステムを通じ、Truvalue Labsスコアと従来ながらの主要なESGベンダーのデータを組み合わせることで、独自のコンポジットスコアを作成することができます。

#### 市場を動かしているESG問題を常に掌握

タイムリーなESGアラートと直感的なダッシュボードでリスクを管理し、準備を怠りません。

#### より多くの情報に基づいた意思決定

企業のESG行動を、同業他社、セクター、ベンチマーク、または業界の観点からリアルタイムで比較します。トレンドを事前に察知します。

#### 国連SDGsに対する企業のインパクトを測定

SDGsの16項目にポジティブ、ネガティブの両面から企業活動を分析します。

#### 13年を超えるマテリアルファクターに関するデータに依拠

Truvalue Labsは、SASBの26のマテリアル・カテゴリと国連SDGsの16項目に関する、13年を超える歴史を持つクリーンで一貫性のあるデータセットを提供します。



### スコアの概要

Truvalue Labsはあらゆる投資戦略を支援する複数のスコアを提供します。インサイト、パルス、モメンタム、およびボリュームのスコアが、すべてのTruvalueプロダクトの基礎を形成しています。

すべてのスコアが毎日更新されます。これは、SASBのマテリアリティフレームワークの中の26のカテゴリーや国連の16の持続可能な開発目標など、Truvalueが生成したレンズの中の各カテゴリーで提供されます。

#### インサイト

企業の長期的なESGのパフォーマンスを計測するもので、ESGレーティングに相当します。スコアは日々のイベントには比較的感度が低く、企業の長期にわたる持続的なパフォーマンスが反映されます。

#### モメンタム

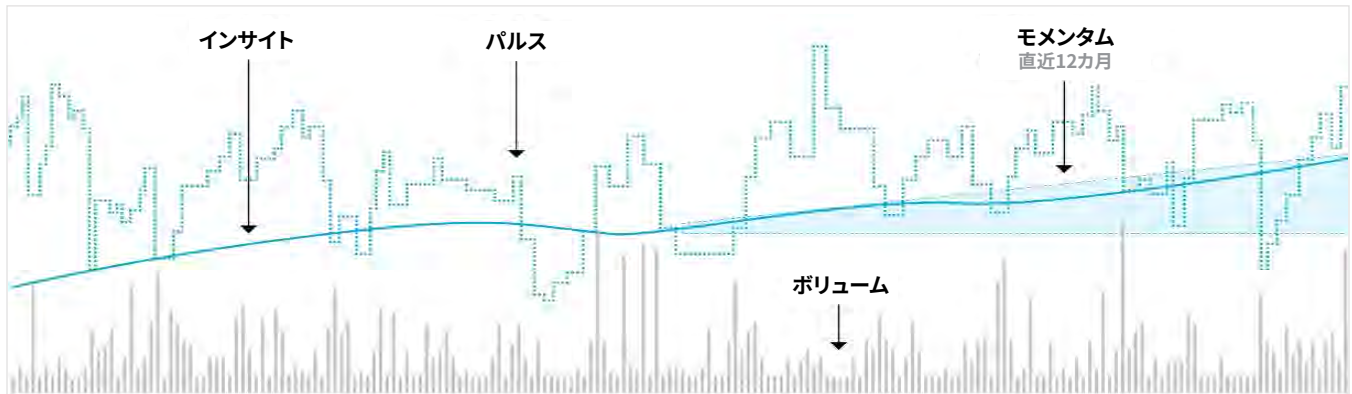
企業のインサイトスコアのトレンドを計測し、ESGパフォーマンスが改善または悪化している企業を明らかにするために使用します。

#### パルス

ニュースに即応する短期的なパフォーマンス変化を測定します。これはリスクと機会の両方を強調し、企業をリアルタイムでモニタリングすることができます。

#### ボリューム

過去12カ月間の企業に関する情報の流れや記事の数を計測します。



Truvalueでは、インサイトスコアをベースに、さらに3つのスコアを提供しています。これらのスコアは、より広範なユニバースをカバーしており、ユーザーはESGに対するleaderとlaggardを容易に識別することができます。

#### 調整インサイト

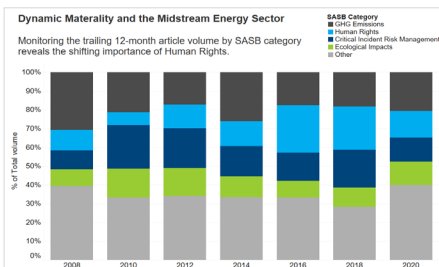
企業の長期的なESG実績を計測します。ボリュームが小さい、またはゼロの企業では、企業のインサイトスコアと業界の中央値の両方を使って調整済みインサイトスコアを決定します。ボリュームが中程度あるいは大きい企業では、調整済みインサイトスコアと企業のインサイトスコアは等しくなります。

#### 産業別パーセンタイル

同じSIC産業の同業他社と比較した企業ごとに調整を行ったインサイトスコアの状況を提供します。

#### ESGランク

leaderとlaggardを体系的に特定するために使用される産業別パーセンタイルに基づき、総合的な企業のカテゴリー別ランキングを提供します。カテゴリーは次のとおりです。



#### ダイナミック・マテリアリティ

ダイナミック・マテリアリティは、各企業でどのESGカテゴリーが最も注目を集めているかを明らかにします。これは、記事の数により計測されます。

Truvalue Labsの研究によると、企業にとって財務的に重要なESGファクターは、所属する業界によって固定されるのではなく、時間とともに変化することが分かっています。このデータをポートフォリオやセクターまたは国レベルでまとめ、重要なESG問題が異なるグループの中で時間とともにどのように変化しているかを理解することができます。