

2021年8月11日

関係各位

野村證券株式会社

## 自然言語処理技術を応用したSDGs債の判定に関する研究開始について

野村證券株式会社(代表取締役社長:奥田健太郎、以下「当社」)は、株式会社ソニーコンピュータサイエンス研究所(代表取締役社長、所長:北野宏明、以下「ソニーCSL」)の技術協力を得て、自然言語処理技術を応用した事業債のSDGs債判定に関する研究(以下「本研究」)を開始しました。

2019年11月、当社と株式会社野村総合研究所(代表取締役会長兼社長:此本臣吾、以下「NRI」)はNOMURA-BPIのサブインデックスとして、グリーンボンド、ソーシャルボンド、サステナビリティボンド(以下総称して「SDGs債」)で構成されたNOMURA-BPI SDGs<sup>※</sup>を公表しました。当該インデックスの構成銘柄としてのSDGs債の判定は、第三者機関の評価を参考にして、NRIの定めるルールに基づきNRIが行っています。

本研究では、SDGs債に分類されていない事業債に対して、発行要項や発行体のサステナビリティレポート等の言語解析を行い、資金用途とSDGs達成への取組みとの関連度を定量的に評価します。当該債券がグリーン、ソーシャル、サステナビリティの性質をどの程度持ち合わせているかを評価することで、SDGs債の判定を定量化、精緻化しながら、投資対象のユニバース拡大を両立させることを目指します。

本研究においては、当社およびNRIがNOMURA-BPI SDGsの知見を提供し、ソニーCSLが技術開発を担当しています。技術の内容や研究の結果については、セミナー等で公表する予定です。

野村グループは、「Drive Sustainability.」というコンセプトのもと、サステナブルな社会の実現と社会的課題の解決のため、ESG/SDGsに関連する活動に積極的に取り組んでいます。当社は今後、本研究の成果を用いたデータ提供やインデックス開発等を通じて、日本のSDGs債市場の発展をサポートしながら、経済成長と社会の持続的な発展に貢献していきます。



※ NOMURA-BPI SDGs はNOMURA-BPIの構成銘柄を母集団として、その中からSDGs債を構成銘柄とする銘柄群の指数値やリスク指標を算出します。

以上