

外株用TruValueファクター開発

 [Open in Visual Studio Code](#)

* README.mdを快適に読むために, Visual Studio Codeに以下の拡張機能を追加することを推奨.



**または[Typola](#)上でも快適に閲覧可能.

About

TruValueデータを用いてKOKUSAIに有効な新ファクターを開発する.

What is TruValue?

TruValueスコアは企業のESG行動を評価したスコアであり, 4つのタイプに分類される.

- Pulse: 企業の短期的なESGパフォーマンスを測定

$$Pulse_t =$$

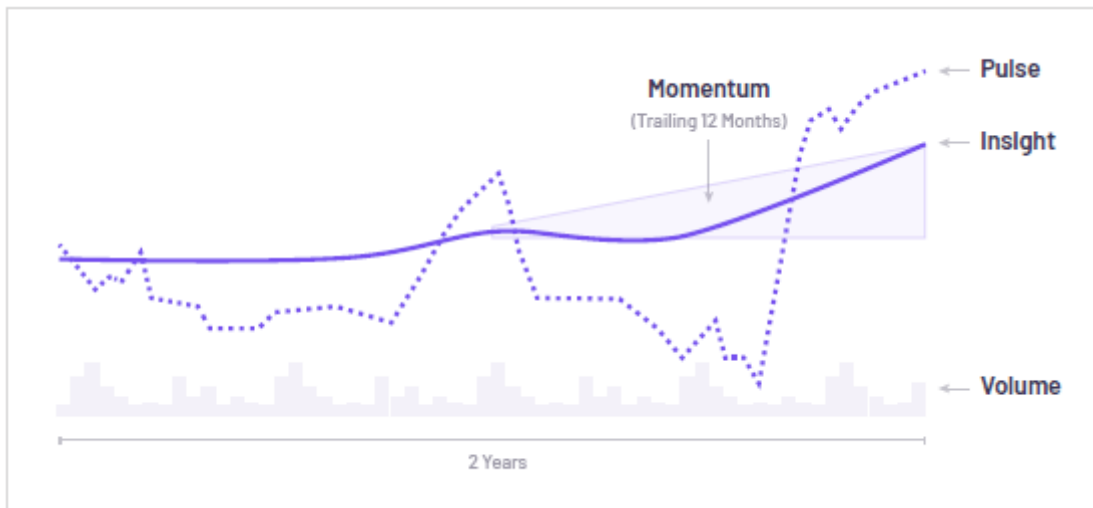
- Insight: 企業の長期的なESGパフォーマンスを測定

$$Insight_t =$$

- Momentum: 12か月に渡る企業のESGパフォーマンスのトレンド

$$Momentum_t$$

- Volume: 過去12か月間の企業のESGの記事数



Materiality

TruValueのmaterialityは[SASB's Materiality Map](#)®に準拠している。

- Environment
 - GHG Emissions (GHG排出量)
 - Air Quality (大気質)
 - Energy Management (エネルギー管理)
 - Water & Wastewater Management (水及び排水管理)
 - Waste & Hazardous Materials Management (廃棄物及び有害物質管理)
 - Ecological Impacts (生体多様性影響)
- Social Capital
 - Human Rights & Community Relations (人権及び地域社会との関係)
 - Customer Privacy (お客様のプライバシー)
 - Data Security (データセキュリティ)
 - Access & Affordability (アクセスおよび手頃な価格)
 - Product Quality & Safety (製品品質・製品安全)
 - Customer Welfare (消費者の福利)
 - Selling Practices & Product Labeling (販売慣行・製品表示)
- Human Capital
 - Labor Practices (労働慣行)
 - Employee Health & Safety (従業員の安全性)
 - Employee Engagement, Diversity & Inclusion (従業員参画・ダイバーシティと包摂性)
- Business Model & Innovation
 - Product Design & Lifecycle Management (製品及びサービスのライフサイクルへの影響)
 - Business Model Resilience (ビジネスモデルの強靱性)
 - Supply Chain Management (サプライチェーンマネジメント)
 - Materials Sourcing & Efficiency (材料調達及び資源効率性)

- Physical Impacts of Climate Change (気候変動の物理的影響)
- Leadership & Governance
 - Business Ethics (事業倫理)
 - Competitive Behavior (競争的行為)
 - Management of the Legal & Regulatory Environment (規制の把握と政治的影響)
 - Critical Incident Risk Management (重大インシデントリスク管理)
 - Systemic Risk Management (システミックリスク管理)

Where is the dataset is stored?

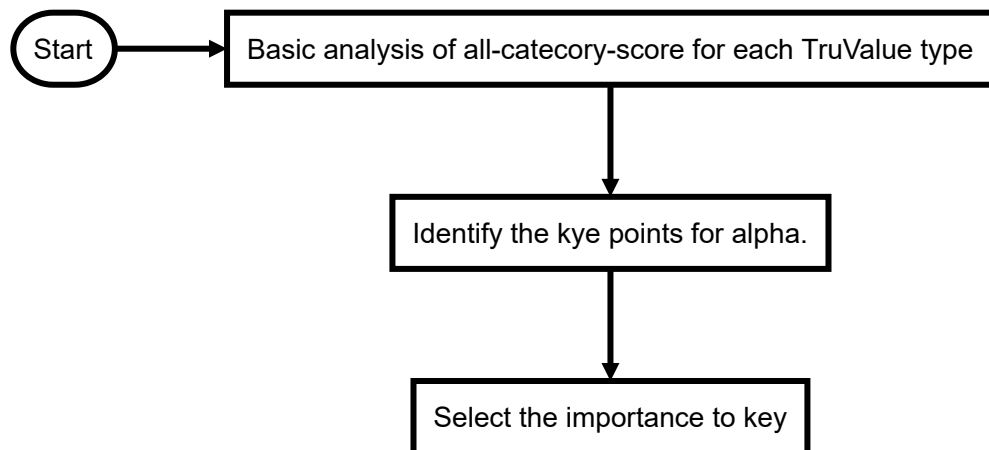
- 格納ディレクトリ: ./input/tv_score_for_kokusai
- データ更新方法: 以下のコマンドを叩く

```
python ./src/load.py
```

Plan

Flow

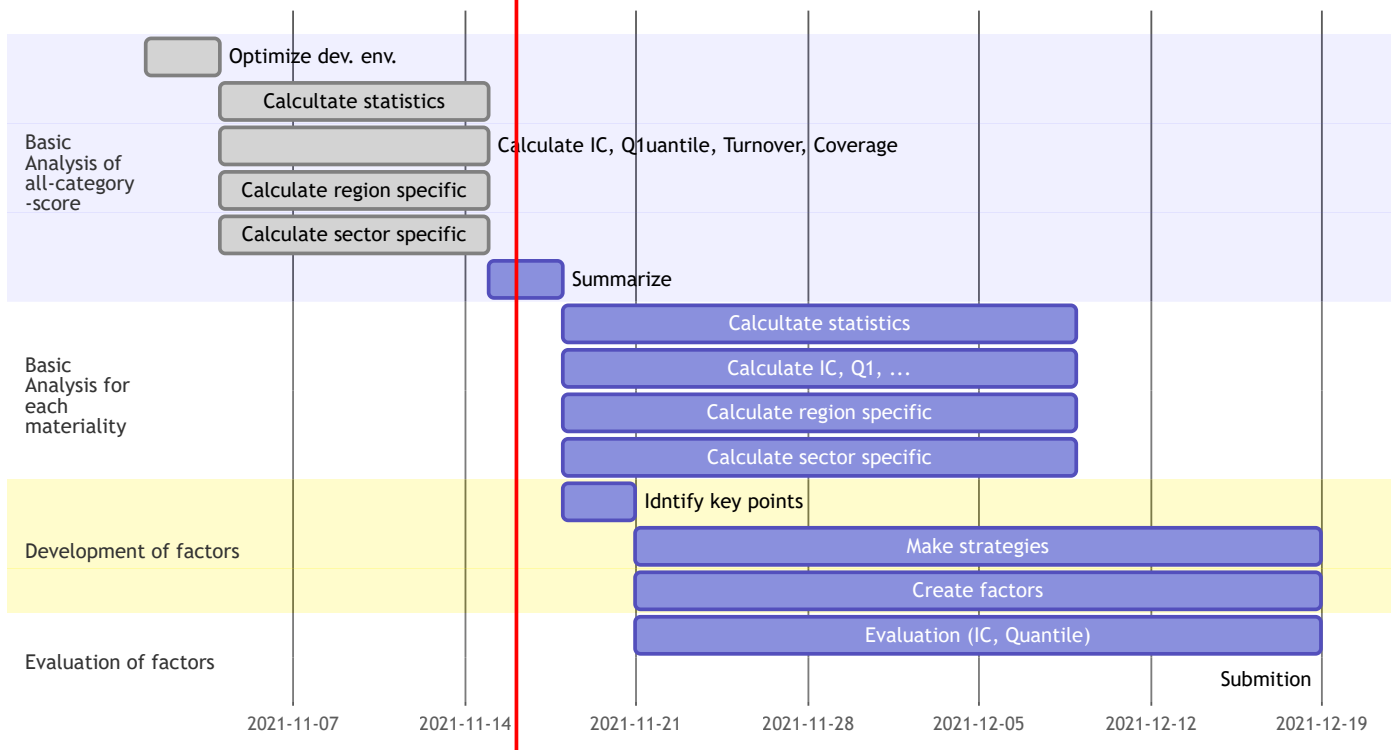
開発フローは以下のように考えている.



Schedule

開発日程は以下のように考えている.

Create a new factor for KOKUSAI



What is important to create factors?