

PRESS RELEASE

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス 新たなファクター・ベース指数ファミリーとして S&P モメンタム指数の算出を開始

*この新たな指数ファミリーの提供により、
投資家はモメンタム・ファクターを正確に捉えることが可能となる*

ニューヨーク、2014年12月3日 – 世界有数の金融市場指数プロバイダーの1つであるS&P ダウ・ジョーンズ・インデックス(以下「S&P DJI」という)は本日、S&P モメンタム指数の算出を開始すると発表しました。この指数は最新のファクター・ベース指数ファミリーであり、世界の株式市場において高い相対パフォーマンスを維持する証券のパフォーマンスを測定するように設計されています。この指数の算出開始により、重要かつ十分に裏付けされたモメンタム・ファクターを捉えることができ、S&P DJIが提供する世界トップクラスのファクター・ベース指数ファミリーがさらに強化されることとなります。

モメンタム・ファクターは、過去のリターンに基づいて株式のランク付けを行うことにより、向こう3~12ヶ月にわたる株式の相対パフォーマンスを予測することが可能との理論を前提としています。S&P モメンタム指数は、リスク調整後価格リターンのモメンタム・スコアが高い銘柄のみから構成されています。透明性が高くルールに基づいたメソドロジーを通じ、様々な市場のモメンタムを測定すると同時に、ある程度の流動性や組入銘柄数、売買回転率を維持することを目的としています。

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスの戦略指数部門のシニア・ディレクターである Vinit Srivastava は次のように述べています。「ファクター・ベース指数ファミリーに S&P モメンタム指数を追加できることを光栄に思います。この最新の指数シリーズは、既存の単一ファクター指数を補完するものであり、オルタナティブ・ベータ戦略から成る戦略的配分ポートフォリオ内でモメンタムの活用を望む投資家や、市場環境が良好な時に戦術的戦略としてモメンタムの活用を望む投資家に対し、多くの選択肢を提供するものとなります。」

S&P モメンタム指数は S&P グローバル総合指数 (S&P Global BMI) の組入銘柄から構成されています。S&P グローバル総合指数はルールに基づいた包括的な指数であり、世界の株式市場のパフォーマンスを測定するように設計されています。S&P モメンタム指数ファミリーは現在、以下の 14 の代表的な指数から構成されています。

1. S&P モメンタム・グローバル中型大型株
2. S&P モメンタム先進国中型大型株
3. S&P モメンタム先進国中型大型株 (除く米国)
4. S&P モメンタム先進国中型大型株 (除く日本)
5. S&P モメンタム新興国中型大型株
6. S&P モメンタム欧州中型大型株
7. S&P モメンタム汎アジア中型大型株
8. S&P モメンタム汎アジア (除く日本) 中型大型株
9. S&P モメンタム日本中型大型株

10. S&P モメンタム米国中型大型株
11. S&P モメンタム中国 A 株
12. S&P モメンタム南アフリカ
13. S&P 500 モメンタム
14. S&P 欧州 350 モメンタム

より詳しい情報をお求めの方は、www.spdji.comをご覧ください。

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスについて

ザ・マグロウヒル・フィナンシャルのグループ会社である S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、指数ベースのコンセプト、データおよびリサーチを提供する世界最大のグローバル・リソース企業である。金融市場の代表的指標である S&P 500® 株価指数およびダウ・ジョーンズ工業株平均® をはじめとして、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、機関投資家や個人投資家のニーズを満たす革新的で透明性のあるソリューションを 115 年以上にわたり構築してきた。当社の指数に基づく金融商品に投資される資産額は、世界の指数プロバイダーの中で最大規模となっている。広範なアセット・クラスをカバーする 830,000 超の指数により、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、投資家が市場を測定し売買する方法を定義している。当社についての詳細は www.spdji.com まで。

S&P® は、マグロウヒル・フィナンシャルの一部門であるスタンダード&プアーズ・フィナンシャル・サービシズ LLC (以下「S&P」という) の登録商標です。Dow Jones® は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズ LLC (以下「ダウ・ジョーンズ」という) の登録商標です。これらの登録商標は S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスにライセンス供与されています。指数に直接投資することはできません。S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス LLC、ダウ・ジョーンズ、S&P 及びそれぞれの関連会社 (以下、これらを合わせて「S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス」という) は、指数のリターンに基づく投資リターンを提供することを目指す第三者の投資ファンド、あるいはその他のビークルを提供、推奨、販売、宣伝、または運用することはありません。本資料は、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスが必要なライセンスを持たない地域におけるサービスの提供を意図するものではありません。S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、指数を第三者にライセンス供与することに関連した報酬を受けています。

お問い合わせ先

牧野 義之

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス

yoshiyuki.makino@spdji.com

電話: 03-4550-8563

David R. Guarino

Communications

S&P Dow Jones Indices

dave.guarino@spdji.com

電話: (+1) 212 438 1471

Alex Yang

Communications, Asia Pacific

S&P Dow Jones Indices

alex.yang@spdji.com

電話: (+852) 2532 8001