

PRESS RELEASE

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス、 ファクター・ベース指数に S&P 日本 500 GIVI を追加

日本市場で高いリスク調整後リターンを獲得するように設計された指数

東京、2015年1月22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・インデックスは本日、S&P 日本 500 GIVI の算出を開始すると発表しました。同指数は、本源的価値と低ボラティリティを組み合わせた革新的かつマルチ・マクターな指数で、日本内外の投資家に提供しません。

日本では GIVI 戦略が幅広く支持されており、例えば年金積立金管理運用独立行政法人 (GPIF) は 2014 年、ベンチマークの1つとして S&P GIVI ジャパンの採用を決定しました。

S&P 日本 500 GIVI は S&P GIVI (グローバル・イントリンシック・バリュー指数) ファミリーに属しています。同指数はボラティリティを低く抑えるとともに、株式時価総額ではなく本質的価値に基づいて株式の構成比率を決定する加重スキームを採用しており、日本市場への適切なリスク調整後エクスポージャーを提供することを目指しています。同指数はより広範囲をカバーする既存の S&P GIVI ジャパンを補完するように設計されており、よりの絞った市場の動きに連動することを目指しています。

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。「高度に洗練された投資家層の増加や人口の高齢化といった大きな市場トレンドを背景に、日本では投資目標が徐々に変化しています。S&P 日本 500 GIVI はリスクを低く抑えるとともに、中長期的に高いリスク調整後リターンを達成するように設計されています。この指数は投資可能なベンチマークであり、この指数に基づいて商品を開発することが可能となっています。」

低ボラティリティとバリューは、株式市場で十分に立証されている2つの持続するアノマリーであると言えます。リスクを抑えた株式運用に対する投資家の需要が高まる中で、この2つの要因の認知度はここ数年で世界的に高まっています。

GPIF は 2014 年にポートフォリオの見直しを行った際に、ファクター・ベース戦略をマニフェストに組み入れ、パフォーマンスを測るベンチマークの1つとして S&P GIVI ジャパンを選択すると発表しました。このように、アジアでは一般に GIVI 戦略やファクター・ベース指数の認知度が高まっており、ベンチマークとしてこの指数を採用する動きが広がっています。

詳しい情報をお求めの方は、<http://www.japanese.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

マクローヒル・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 1,000,000 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。

「Standard & Poor's」および「S&P」は、マグロウヒル・ファイナンシャルの子会社であるスタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービスズ LLC (以下、「S&P」) の登録商標である。「Dow Jones」は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングス LLC (以下、「ダウ・ジョーンズ」) の登録商標である。これらの商標は、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス LLC がライセンス許諾を受けている。指数に直接投資することはできない。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 およびそれぞれの関連会社 (総称して、「S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス」) は、第三者が提供する、いかなる指数のパフォーマンスにもとづく投資リターンの提供を目的とした投資ファンドまたは投資ビークルも、提供、保証、販売、または宣伝することはない。本資料は、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスがライセンスを有していない地域におけるサービス提供を意図するものではない。S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、第三者への指数ライセンス供与に関連して報酬を得ている。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 及び各々の関連会社 (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、第三者が提供し、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスの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投資ファンド、或いはその他のビークルを提供、推奨、販売、或いは宣伝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行う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、その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。

お問合せ先

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