

2015年10月14日

株式会社日本取引所グループ  
株式会社東京証券取引所  
S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス

## 日本取引所グループ・東京証券取引所と S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス 共同ブランドによるスマート・ベータ指数シリーズを日本で開発

株式会社日本取引所グループ（JPX）、東京証券取引所（TSE）とS&P ダウ・ジョーンズ・インデックス（S&P DJI）は本日、共同ブランドによるS&P/JPX スマート・ベータ指数シリーズを開発する旨の戦略的契約を発表しました。本シリーズの第一弾であるS&P/JPX GIVI指数の算出は本年11月に開始される予定となっています。このシリーズは3つの革新的なベンチマークで構成されており、各ベンチマークは優れたスマート・ベータ指数としてデザインされており、かつ日本の株式市場へのエクスポージャーを提供します。

- **S&P/JPX GIVI 指数**：TOPIX 構成銘柄をベースとしており、本源的株式価値に基づいて指数の構成比率を決定し、低いボラティリティとパフォーマンスを実現するように設計された指数です。
- **S&P/JPX 配当貴族指数**：TOPIX 構成銘柄の中で、過去 10 年間継続して増配している銘柄で構成された指数です。
- **S&P/JPX リスク・コントロール指数（5%、10%、15%）**：この指数は、設定した目標ボラティリティレベル（5%、10%、15%）に合わせて、株式（TOPIX）と現金（国内インターバンク市場）の比率をルールに沿って調整します。

**S&P DJIの最高経営責任者（CEO）であるAlex Matturri**は次のように述べています。「多くの海外投資家にとって、日本株はポートフォリオと投資戦略における重要な要素となっています。その結果、ルールに基づいた透明な指数メソドロジーに基づいて、市場へのオルタナティブなエクスポージャーを持つことに対する需要が高まっています。**S&P/JPX スマート・ベータ指数シリーズ**は、日本株のパフォーマンスを測定するための主要なベンチマークになると同時に、パッシブ投資商品の基礎になるものと期待しています。」

**TSEの代表取締役社長である宮原幸一郎**は次のように述べています。「弊社は**S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス**と協力することで長年にわたり多くの成果を達成しており、今回の指数ラインナップが国内外の投資家に対して様々な可能性を提供するものと期待しています。**S&P/JPX スマート・ベータ指数シリーズ**を活用することで、投資家は日本におけるスマート・ベータ投資戦略のパフォーマンスをより正確に把握できるようになると確信しています。」

日本ではスマート・ベータ指数戦略に対する需要が続いており、実際に年金積立金管理運用独立行政法人（GPIF）は2014年より、**S&P GIVI ジャパン指数**をベンチマークとして採用しています。こうした状況を踏まえ、**JPX・TSE**と**S&P DJI**は本シリーズの共同開発で合意しました。**JPX・TSE**と**S&P DJI**は、投資家の異なるニーズに応えるため、**S&P/JPX スマート・ベータ指数シリーズ**の他にも、**S&P/TOPIX 150 指数**や**S&P/TOPIX 150 カーボン・エフィシエント指数**など様々な株価指数を共同で算出しています。

より詳しい情報をお求めの方は、**S&P DJI**の公式ウェブサイト [www.spdji.com](http://www.spdji.com) 及び **JPX**の公式ウェブサイト [www.jpx.co.jp](http://www.jpx.co.jp) をご覧ください。

**お問合せ:**

**S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス**

牧野義之

日本オフィス統括責任者

(+81) 3 4550 8424

[index.tokyo@spdji.com](mailto:index.tokyo@spdji.com)

**株式会社 日本取引所グループ**

広報・IR部

(+81) 3 3666 1361

[index@jpx.co.jp](mailto:index@jpx.co.jp)

**Alex Yang**

Communications Manager for Asia-Pacific

Hong Kong

(+852) 2532 8001

[alex.yang@spdji.com](mailto:alex.yang@spdji.com)

**David R. Guarino**

Head of Communications

New York, USA

(+1) 212 438 1471

[dave.guarino@spdji.com](mailto:dave.guarino@spdji.com)

**日本取引所グループ及び東京証券取引所について**

株式会社日本取引所グループは、世界を代表する取引所グループであり、アジア太平洋地域で最大規模の証券取引所である株式会社東京証券取引所と、主要デリバティブ取引所である株式会社大阪取引所の経営統合により、2013年1月1日に設立された持株会社です。同年1月4日には、自社株式を、東京証券取引所にも上場しています。東京証券取引所は、金融商品取引法に基づく金融商品取引所の免許を受け、金融商品市場を運営しています。具体的な業務として、有価証券の売買を行うための市場施設の提供、相場の公表及び有価証券の売買等の公正の確保その他の取引所金融商品市場の開設に係る業務などがあります。

**S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスについて**

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・リソース企業です。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ました。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ます。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ます。当社についての詳細は<http://www.spdji.com>まで。

「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・サービシズLLC(以下、「S&P」)の登録商標です。「Dow Jones」は、ダウ・ジョーンズ・トレ

ードマーク・ホールディングスLLC(以下、「ダウ・ジョーンズ」)の登録商標です。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・インデックスがライセンスを有していない法域におけるサービス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、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。