

2015年12月18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 LLC

## S&P/JPX スマート・ベータ指数シリーズ第二弾 S&P/JPX リスク・コントロール指数（5%、10%、15%）の算出開始

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス（S&PDJI）、日本取引所グループ（JPX）及び東京証券取引所（TSE）は本日、**S&P/JPX リスク・コントロール指数（5%、10%、15%）**の算出を開始すると発表しました。この指数は、**S&P/JPX スマート・ベータ指数シリーズ**の一環として算出される指数です。**S&P/JPX スマート・ベータ指数シリーズ**とは、S&PDJI、JPX 及び TSE が今年 10 月に締結した戦略的指数契約に基づいて開発された指数シリーズです。

S&P/JPX リスク・コントロール指数（5%、10%、15%）では、S&PDJI のリスク・コントロールの枠組みを東証株価指数（TOPIX）に適用しています。また、この指数は各目標ボラティリティ（5%、10%、15%）に応じて、配当込み TOPIX のポジションと国内インターバンク市場の無担保オーバーナイト・コール・レートに基づくキャッシュ・ポジションを組み合わせます。

S&P/JPX スマート・ベータ指数シリーズは共同ブランドによる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いるとともに、適切なリスク調整後エクスポージャーを提供しています。その他2つの指数は、S&P/JPX GIM 指数と S&P/JPX 配当貴族指数です。

また、本指数の算出開始に伴い、TSEはTOPIXリスクコントロール指数の算出及び配信を終了いたします。

より詳しい情報をお求めの方は、S&PDJI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・サービスズ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。東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(以下、「東証」)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)の商標または標章に関するすべての権利は東証が有しています。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」)、株式会社日本取引所グループ(以下、「JPX」)または東証は、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を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、JPXまたは東証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、JPXまたは東証は、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。