

S&P GIVI 指数及び S&P/JPX GIVI 指数のリバランス日程に関する相談 - アップデート

ニューヨーク、2020年8月17日：S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス（以下、「S&P DJI」という）は、S&P GIVI 指数及び S&P/JPX GIVI 指数のメソドロジーの変更に関して市場参加者と相談を行います。

指数の複製可能性を向上させるために、S&P DJI はこれらの指数のリバランス日程を修正することを提案します。変更案の概要は以下の通りです。

| 変更案 | メソドロジー | |
|---------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | 現在 | 提案 |
| リバランス日程 | 指数は年に2回の頻度でリバランスされ、3月の第4金曜日と9月の第3金曜日の取引終了後に有効となります。ファンダメンタル・データ参照日（ベータに使用され、また本源的価値モデルへの財務諸表インプット情報を得るためにも使用される）は、リバランス日の6週間前です。リバランス参照日（浮動株調整後時価総額などの追加情報を使用して本源的価値を計算し、構成銘柄のウェイトを決定するために使用される）は、リバランス月の前月の最終取引日です。 | 指数は年に2回の頻度でリバランスされ、3月と9月の第4金曜日の取引終了後に有効となります。9月の第1営業週が5日間全て平日（月曜日～金曜日）である年については、指数は9月の第3金曜日にリバランスされます。ファンダメンタル・データ参照日（ベータに使用され、また本源的価値モデルへの財務諸表インプット情報を得るためにも使用される）は、リバランス日の6週間前です。リバランス参照日（浮動株調整後時価総額などの追加情報を使用して本源的価値を計算し、構成銘柄のウェイトを決定するために使用される）は、リバランス月の前月の最終取引日です。 |

以下の表は、将来における9月のリバランス日の例を示しています。

| リバランス | 参照日 | プロフォーマ日 | リバランス有効日 |
|---------|-----------|------------|------------|
| 2020年9月 | 2020年9月1日 | 2020年9月11日 | 2020年9月28日 |
| 2021年9月 | 2021年9月1日 | 2021年9月10日 | 2021年9月27日 |
| 2022年9月 | 2022年9月1日 | 2022年9月9日 | 2022年9月26日 |
| 2023年9月 | 2023年9月1日 | 2023年9月8日 | 2023年9月25日 |
| 2024年9月 | 2024年9月2日 | 2024年9月6日 | 2024年9月23日 |

指数に関する詳細については、[S&P GIVI 指数メソドロジー](#)及び[S&P/JPX GIVI 指数メソドロジー](#)を参照ください。

実施のタイミング

S&P DJI は、メソドロジーの変更を実施することを提案しており、この提案が採用された場合、2020年9月のリバランスに合わせて実施します。

質問

次の質問に回答し、回答の根拠を S&P DJI に提示ください。

1. リバランス日程を修正する提案に賛成ですか？
2. 変更案が採用された場合、実施予定日に賛成ですか？
3. 上述した変更案に関して他にコメントまたはフィードバックはありますか？

S&P DJIでは、貴社の見解や意向を適切に評価する上で様々な市場参加者から情報を収集しているため、貴社がこの相談に参加していただくことは非常に重要です。**2020年8月28日**までにこの調査に回答いただければ幸いです。この日付を過ぎた場合、回答を受け取ることができませんので、ご容赦ください。S&P DJIでは指数委員会の最終レビュー前に、レビューの一環として回答者からの説明をお願いする場合があります。

今回の相談に参加するには、[ここ](#)をクリックしてオンライン調査に回答してください。

今回の相談に関する詳細については、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス (SPDJ_Index_Governance@spglobal.com) にお問い合わせください。

今回の相談で寄せられた全てのコメントをレビュー・検討した上で、最終決定が下されます。ただし、S&P DJIは、回答に従うことを保証するものではなく、またはその義務もありません。この調査を行った結果、変更が一切行われな場合もあります。S&P DJIが指数メソドロジーの変更を決定した場合、弊社のウェブサイト上でその旨を報告いたします。

調査にご協力いただき有難うございました。

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスに関する詳細については、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

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やデータ、リサーチを提供する世界最大のグローバル・リソース企業であり、S&P 500®及びダウ・ジョーンズ工業株平均®といった金融市場の代表的指標を算出しています。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。チャールズ・ダウが1884年に初めて指数を発明して以降、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、広範なアセット・クラスをカバーする指数を開発しており、これにより投資家が市場を測定し、売買する方法を定義することが可能となっています。

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P グローバル (NYSE: SPGI) のグループ会社であり、個人や企業、政府が確信を持って意思決定を行う上で不可欠な情報を提供しています。詳しい情報については、www.spdji.com をご覧ください。

詳しい情報については、以下にお問い合わせください：

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス
index_services@spglobal.com