

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P コンポジット 1500 指数の時価総額ガイドラインのアップデートを発表

ニューヨーク、2024 年 4 月 1 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 コンポジット 1500 指数への新規採用に関する時価総額適格性基準をアップデートします。新たな時価総額適格性基準の範囲は以下の通りであり、このアップデートは **2024 年 4 月 1 日** から有効となります。

以前の時価総額適格性基準	アップデート後の時価総額適格性基準
浮動株調整前時価総額： <ul style="list-style-type: none"> S&P 500 については 158 億ドル以上 S&P 中型株 400 指数については 58 億ドル以上～158 億ドル未満 S&P 小型株 600 指数については 9 億ドル以上～58 億ドル未満 	浮動株調整前時価総額： <ul style="list-style-type: none"> S&P 500 については 180 億ドル以上 S&P 中型株 400 指数については 67 億ドル以上～180 億ドル未満 S&P 小型株 600 指数については 10 億ドル以上～67 億ドル未満

S&P DJI は現在の市場状況を反映するために、各四半期の開始時点で時価総額の範囲を見直し、必要に応じてアップデートしています。最低時価総額ガイドラインは、おおよそ以下の累積パーセンタイルで S&P トータル・マーケット指数（以下、「TMI」という）ユニバースにおける企業レベルの 3 ヶ月間の平均累積合計時価総額を捉えるように設計されています。

- S&P 500 – 85 パーセンタイル
- S&P 中型株 400 指数 – 85～93 パーセンタイル
- S&P 小型株 600 指数 – 93～99 パーセンタイル

企業レベルの合計時価総額基準を満たしている企業は、証券レベルの浮動株調整後時価総額（以下、「FMC」という）基準も満たしている必要があります。証券レベルの浮動株調整後時価総額基準は、それぞれの指数における企業レベルの最低合計時価総額基準の少なくとも 50%です。

念のための確認として、時価総額の適格性基準は指数への新規採用銘柄に対するものであり、既存の構成銘柄に対するものではありません。したがって、指数への新規採用基準に抵触するように思われる指数構成銘柄が直ちに指数から除外されることはありません。ただし、基準への抵触が一時的なものではなく、継続的なものであると判断される場合にはその限りではありません。

S&P 米国株価指数メソドロジーの付属資料 A では、2007 年まで遡った過去の時価総額範囲を掲載しています。S&P 米国株価指数メソドロジー資料はまもなくアップデートされ、今回の変更が反映される予定です。詳細については、当社のウェブサイト (www.spglobal.com/spdji) をご覧ください。

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.spglobal.com/spdji 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.spglobal.com/spdji 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

報道関係のお問い合わせ：

spdji.comms@spglobal.com