

2015年7月22日

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
株式会社 大阪取引所

日本初となる本格的な債券ボラティリティ指数の算出を開始

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス (S&P DJI) と、株式会社日本取引所グループ (JPX) 及び同グループ傘下の株式会社大阪取引所 (OSE) は、**S&P/JPX 日本国債 VIX 指数**の共同開発に向け戦略的契約を締結しました。このS&P/JPX 日本国債 VIX 指数は、OSEで取引される日本国債 (長期国債) 先物オプション取引の価格を利用し、日本国債のインプライド・ボラティリティを算出するもので、世界の主要な株式ボラティリティ関連の指標であるシカゴ・オプション取引所ボラティリティ指数® (VIX® 指数) と同様のメソドロジーを利用した日本初となる本格的な債券ボラティリティ指数であり、今年後半に算出を開始する予定です。

S&P/JPX 日本国債 VIX 指数は、シカゴ・オプション取引所® (CBOE®) から同社が有するVIXの算出メソドロジーに係る利用ライセンスの供与を受けたうえで、S&P DJI、JPX及びOSEが共同開発するもので、2013年に米国で算出を開始した世界初の債券ボラティリティ指数であるCBOE/CBOT米10年国債ボラティリティ指数SM (TYVIXSM 指数)に次いで、VIXのメソドロジーを利用した世界で2番目の債券ボラティリティ指数となります。

S&P DJIを代表し、同社CEOであるAlex Matturriは次のように述べています。「JPX及びOSEの協力により、S&P/JPX 日本国債 VIX指数の算出を開始することができ、光栄に思います。この指数は、投資家に幅広く利用されるCBOEのVIXメソドロジーに基づいており、S&P/JPX 日本国債 VIX指数が日本国債のボラティリティを測定するベンチマークとして機能するのみならず、世界の様々な市場のボラティリティ比較を行う際にも重要な役割が担われることを期待しています。」

JPX及びOSEを代表し、JPX取締役 兼 OSE代表取締役社長である山道 裕己は次のように述べています。「我々はS&P/JPX 日本国債 VIX指数の算出において世界有数の金融市場指数プロバイダーであるS&P DJIと新たな協力関係を築くことができ、とても嬉しく思います。日本国債の市場リスクを計測する新たな指標が開発されることで、投資判断に際して利用が普及されることを期待します。」

私どもS&P DJI、JPX及びOSEは、今後も投資家の利便性向上に寄与する指標の構築等をめざし、協力関係を継続する予定です。なお、S&P/JPX 日本国債 VIX 指数の具体的な算出開始日等につきましては、追って御連絡いたします。

詳しい情報をお求めの方は、www.spdji.com 及び 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

David R. Guarino
Head of Communications
New York, USA
(+1) 212 438 1471
dave.guarino@spdji.com

株式会社 日本取引所グループ

広報・IR部（大阪）
06-4706-0800
webmaster@jpx.co.jp

Alex Yang

Communications Manager for Asia-Pacific
Hong Kong, HK
(+852) 2532 8001
alex.yang@spdji.com

牧野義之

日本オフィス統括責任者
03-4550-8424
index.tokyo@spdji.com

日本取引所グループ及び大阪取引所について

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。株式会社大阪取引所は、日本を代表するデリバティブ取引である、国債証券先物、日経225先物、TOPIX 先物、JPX日経400先物、日経225オプション等の取扱いを行っています。

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。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。

※CBOEボラティリティ指数(VIX指数)は、S&P 500を対象とするオプションのボラティリティを元に算出される指数であり、株式市場の期待ボラティリティを示す最も一般的な指標です。S&P DJIは、VIX指数に関連する先物のパフォーマンスに連動する様々なベンチマークや、VIX指数のメソドロジーを利用するその他の指数を算出しています。

CBOEは、S&P DJIが第三者に対してライセンス供与を行う独占的権利をS&P DJIに許諾しました。これにより、S&P DJIは、特定のCBOE指数や、独自の指数メソドロジー、VIX指数に基づくストラクチャード商品に関連する商標及びデータの利用に関して第三者にライセンス供与することが可能となりました。

※「CBOE」、「Chicago Board Options Exchange」、「CBOE Volatility Index」及び「VIX」はChicago Board Options Exchange (CBOE)の登録商標です。CBOE/CBOT米10年国債ボラティリティ指数SM およびTYVIXSM 指数はCBOEのサービスマークです。その他すべての登録商標及びサービスマークは、各所有者の所有物です。