

2015年12月1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

## S&P/JPX スマート・ベータ指数シリーズ第一弾

### S&P/JPX GIVI の算出開始

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス（以下「S&P DJI」という）、日本取引所グループ（以下「JPX」という）及び東京証券取引所（以下「TSE」という）は本日、**S&P/JPX GIVI® (Global Intrinsic Value Index)** の算出を開始すると発表しました。この指数は、日本の株式市場のリスク調整後パフォーマンスを評価する革新的なベンチマークです。S&P DJI、JPX及びTSEは今年10月、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として3つの指数を開発する旨の戦略的契約を発表しており、S&P/JPX GIVI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を開始する最初の指数となります。**

S&P/JPX GIVIは、低リスクの株式ポートフォリオの選択に加え、指数ウェイトを時価総額ではなく独自のメソドロジーにより算出された本源的価値により加重することを通じて、日本の株式市場のパフォーマンスを評価する代替手段を提供するように設計されています。このベンチマークは、東証株価指数（TOPIX）をユニバースとして算出されます。

スマート・ベータ指数シリーズのその他の2指数は**S&P/JPX 配当貴族指数**と**S&P/JPX リスク・コントロール指数（5%、10%、15%）**です。前者は、TOPIX構成銘柄の中で、少なくとも過去10年間継続して増配している銘柄のパフォーマンスを測定します。後者は、S&P DJIのリスク・コントロールの枠組みを

TOPIXに適用し、各目標ボラティリティ（5%、10%、15%）に応じて、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・レートに基づき、TOPIX トータル・リターン指数のポジションとキャッシュ・ポジションを組み合わせます。両指数は12月に公表される予定です。

**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。「共同ブランドであるスマート・ベータ指数シリーズの第一弾として**S&P/JPX GIVI**の算出を開始することについて大変光栄に思います。日本の金融市場は高度に発展しており、洗練された投資コミュニティが存在しています。日本において**GIVI**の新たなファミリーの算出を開始することにより、日本の投資家が利用可能な指数の選択肢がさらに拡大することを期待しています。」

**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。「弊社と**S&P DJI**とのコラボレーションにおいて、**S&P/JPX GIVI**の算出開始は重要な意味を持ちます。両社の協力関係により、多くの透明性の高い革新的な指数ソリューションを提供することが可能となり、このことを通じて投資家や金融市場の発展に貢献できると確信しています。」

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。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。