

## PRESS RELEASE

### S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス、S&P クオリティ指数の算出を開始

この指数シリーズにより、  
幅広いファクター・ベース指数の提供が可能となる

2014年7月23日（ニューヨーク）－世界有数の金融市場指数プロバイダーの1つであるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは本日、S&Pクオリティ指数の算出を開始すると発表しました。この指数ファミリーは、クオリティ・スコアに基づき、グローバル株式市場の優良株を測定するように設計されています。クオリティ・スコアは、株主資本利益率(ROE)、会計発生高比率、財務レバレッジ比率の3つのファンダメンタル基準に基づいて計算されます。

S&Pクオリティ指数の他に、今年は低ベータ指数とイントリンシック・バリュー指数の算出をすでに開始しました。ファクター・ベース指数は戦略指数であり、伝統的な時価総額加重のベンチマークとは異なる方法でパフォーマンスの測定を目指します。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスでは、2003年に発表したS&P500®の均等加重バージョンをはじめ、長年にわたりファクター・ベース指数を提供しています。

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスの戦略指数部門のシニア・ディレクターである Vinit Srivastava は次のように述べています。「クオリティはリスク・ファクターの一つですが、規模やバリュー、モメンタム、低ボラティリティといったその他のファクターとは異なるものです。投資家は、優良企業から構成されるファクター・ベースのベンチマークとして、S&P クオリティ指数ファミリーを活用することが可能です。」

指数ファミリーは 12 のヘッドライン指数から構成されており、各指数は世界の主要地域・国をカバーしています。S&P クオリティ指数は、S&P グローバル総合指数(S&P グローバル BMI)またはその他のヘッドライン・ベンチマークの構成銘柄から構成されています。S&P クオリティ指数では、クオリティ・スコアに浮動株調整後時価総額を乗じるにより、各銘柄のウェイトを設定しています。

本日算出を開始した指数は以下の通りです：

- S&P クオリティ・グローバル中大型株指数
- S&P クオリティ先進國中大型株指数
- S&P クオリティ先進国(除く米国)中大型株指数
- S&P クオリティ先進国(除く日本)中大型株指数
- S&P クオリティ新興國中大型株指数
- S&P クオリティ欧州中大型株指数
- S&P クオリティ 350 クオリティ指数
- S&P クオリティ汎アジア中大型株指数
- S&P クオリティ汎アジア(除く日本)中大型株指数
- S&P クオリティ日本中大型株指数
- S&P500®クオリティ指数
- S&P クオリティ米国中大型株指数

完全なメソドロジーなどに関する詳しい情報をお求めの方は、[www.spdji.com](http://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

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・リソース企業である。金融市場の代表的指標である S&P 500<sup>®</sup> 株価指数およびダウ・ジョーンズ工業株平均<sup>™</sup>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る。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る。当社についての詳細は [www.spdji.com](http://www.spdji.com) まで。

「Standard & Poor's」および「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」)の登録商標である。「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」)の登録商標である。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る。指数に直接投資することはできない。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の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ない。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ない。S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、第三者への指数ライセンス供与に関連して報酬を得ている。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 及び各々の関連会社(これらを合わせて「S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス」という)は、第三者が提供し、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスの指数のリターンに基づく投資リターンを提供することを目指す投資ファンド、或いはその他のビークルを提供、推奨、販売、或い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・インデックスが必要なライセンスを持たない地域におけるサービスの提供を行う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。

## お問合せ先

牧野 義之  
S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス  
[yoshiyuki.makino@spdji.com](mailto:yoshiyuki.makino@spdji.com)  
電話: 03 4550 8563

David R. Guarino  
Communications  
S&P Dow Jones Indices  
[dave.guarino@spdji.com](mailto:dave.guarino@spdji.com)  
電話: (+1) 212 438 1471

Alex Yang  
Communications, Asia Pacific  
S&P Dow Jones Indices  
[alex.yang@spdji.com](mailto:alex.yang@spdji.com)  
電話: (+852) 2532 8001