

## S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス、米国指数の構成銘柄変更及びメソドロジーと時価総額ガイドラインの更新を発表

ニューヨーク、2017年3月10日: S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、米国指数の時価総額ガイドラインを更新し、これは本日から有効となります。新しいガイドラインは以下の通りです:

- S&P 500—61 億ドル、またはそれ以上(以前の範囲は、53 億ドル、またはそれ以上でした)
- S&P 中型株 400 指数—16 億ドルから 68 億ドル(以前の範囲は、14 億ドルから 59 億ドルでした)
- S&P 小型株 600 指数—4 億 5,000 万ドルから 21 億ドル(以前の範囲は、4 億ドルから 18 億ドルでした)

マネージング・ディレクター兼指数委員会の委員長である David M. Blitzer は、次のように述べています。「市場動向に関するレビューに基づき(S&P 500 は 2017 年に入ってから 5.5%上昇し、過去 12 ヶ月では 19%上昇している)、指数委員会は S&P 500、S&P 中型株 400 指数、及び S&P 小型株 600 指数の時価総額ガイドラインを修正しました。これらの数値は、浮動株調整後時価総額ではなく、時価総額合計を参考にしており、適宜見直されています。前回の変更は、2014 年の夏に実施されました。」

時価総額の範囲の履歴は 2007 年まで遡り、米国指数メソドロジーの付属資料 B でご覧いただけます。詳しい情報については、弊社のウェブサイト [www.spdji.com](http://www.spdji.com) をご覧ください。

各指数の構成銘柄の時価総額が所定の範囲内に収まるように、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスでは、3 月 20 日(月曜日)の取引開始前(3 月のリバランスと同時期)に次の指数の調整を有効にします。

**S&P 500** の 3 つの構成銘柄を S&P 中型株 400 指数の 3 つの構成銘柄と入れ替え、S&P 中型株 400 指数の 3 つの構成銘柄を S&P 小型株 600 指数の 3 つの構成銘柄と入れ替えます。S&P 中型株 400 指数から S&P 500 に移行する全ての企業は時価総額合計が 100 億ドル以上となっています。S&P 500 から S&P 中型株 400 指数に移行する全ての企業は時価総額合計が 34 億ドル以下となっています。その他全ての構成銘柄の移動は、各指数の構成銘柄の時価総額が所定の範囲内に収まるように行われます。

**S&P 中型株 400 指数**の構成銘柄である Advanced Micro Devices Inc. (NASDAQ:AMD)、Raymond James Financial Inc. (NYSE:RJF)、及び Alexandria Real Estate Equities Inc. (NYSE:ARE)は、それぞれ S&P 500 の構成銘柄である Urban Outfitters Inc.(NASDAQ:URBN)、Frontier Communications Corp. (NASDAQ:FTR)、及び First Solar Inc. (NASDAQ:FSLR)に取って代わり、S&P 500 の構成銘柄である Urban Outfitters、Frontier Communications、及び First Solar は、S&P 中型株 400 指数の構成銘柄である Advanced Micro Devices、Raymond James Financial、及び Alexandria Real Estate Equities に取って代わります。

**S&P 小型株 600 指数**の構成銘柄である Take-Two Interactive Software Inc. (NASDAQ:TTWO)、Masimo Corp. (NASDAQ:MASI)、及び Coherent Inc. (NASDAQ:COHR)は、それぞれ S&P 中型株 400 指数の構成銘柄である Fossil Group Inc. (NASDAQ:FOSL)、Denbury Resources Inc. (NYSE:DNR)、及び Vista Outdoor Inc. (NYSE:VSTO)に取って代わり、S&P 中型株 400 指数の構成銘柄である Fossil

Group、Denbury Resources、及び Vista Outdoor は、S&P 小型株 600 指数の構成銘柄である Take-Two Interactive Software、Masimo、及び Coherent に取って代わります。

Advanced Micro Devices は半導体企業です。同社はカリフォルニア州のサンニールに本店を構えており、S&P 500 GICS (世界産業分類基準)の半導体・産業サブグループ指数に加えられます。

Raymond James Financial は株式や債務証券の引き受け、販売、トレーディング、及び仲介や、ミューチュアルファンド及びその他の投資商品の販売に携わっています。同社はフロリダ州のセント・ピーターズバーグに本店を構えており、S&P 500 GICS の投資銀行・証券会社・産業サブグループ指数に加えられます。

Alexandria Real Estate Equities は不動産投資信託(REIT)であり、生命科学業界向けの不動産の所有、運営、管理、開発、取得、再開発に携わっています。同社はカリフォルニア州のパサディナに本店を構えており、S&P 500 GICS のオフィス不動産投資信託・産業サブグループ指数に加えられます。

Urban Outfitters は一般消費財の小売及び卸売に携わっています。同社はペンシルベニア州のフィラデルフィアに本店を構えており、S&P 中型株 400 GICS の衣料小売り・産業サブグループ指数に加えられます。

Frontier Communications は個人や法人などの顧客向けに通信サービスを提供しています。同社はコネチカット州のノーウォークに本店を構えており、S&P 中型株 400 GICS の総合電機通信サービス・産業サブグループ指数に加えられます。

First Solar は太陽光発電ソリューションを提供しています。同社はアリゾナ州のテンピに本店を構えており、S&P 中型株 400 GICS の半導体・産業サブグループ指数に加えられます。

Take-Two Interactive Software はインタラクティブ・エンターテインメント・ソリューションの開発・発行・販売を手掛けています。ニューヨーク州のニューヨークに本店を構え、同社は S&P 中型株 400 GICS のホームエンターテインメント・ソフトウェア・産業サブグループ指数に加えられます。

Masimo は非侵襲的モニタリング・テクノロジーの開発・製造・販売を手掛けています。同社はカリフォルニア州のアーバインに本店を構えており、S&P 中型株 400 GICS のヘルスケア機器・産業サブグループ指数に加えられます。

Coherent は、各種の科学、商業、工業向けの用途においてレーザーや、レーザーを基にしたテクノロジーを提供しています。同社はカリフォルニア州のサンタクララに本店を構えており、S&P 中型株 400 GICS の電子装置・機器・産業サブグループ指数に加えられます。

Fossil Group は消費者向けのファッション・アクセサリーのデザイン・開発・マーケティング・販売を手掛けています。同社はテキサス州のリチャードソンに本店を構えており、S&P 小型株 600 GICS アパレル・アクセサリー・贅沢品・産業サブグループ指数に加えられます。

Denbury Resources は独立系の石油・天然ガス会社です。同社はテキサス州のプレイノに本店を構えており、S&P 小型株 600 GICS の石油・ガス探査・開発・産業サブグループ指数に加えられます。

Vista Outdoor はアウトドア・スポーツとレジャー市場向けの消費者製品の設計・製造・販売を手掛けています。同社はユタ州のファーマントンに本店を構えており、S&P 小型株 600 GICS のレジャー用品・産業サブグループ指数に加えられます。

変更の概要は以下の通りです:

S&P 500 指数 - 2017年3月20日			
	会社名	GICS経済セクター	GICS産業サブグループ
追加	Advanced Micro Devices	情報技術	半導体
	Raymond James Financial	金融	投資銀行・証券会社
	Alexandria Real Estate Equities	不動産	オフィス不動産投資信託
除外	Urban Outfitters	一般消費財・サービス	衣料小売り
	Frontier Communications	電気通信サービス	総合電気通信サービス
	First Solar	情報技術	半導体

S&P 中型株 400指数 - 2017年3月20日			
	会社名	GICS経済セクター	GICS産業サブグループ
追加	Urban Outfitters	一般消費財・サービス	衣料小売り
	Frontier Communications	電気通信サービス	総合電気通信サービス
	First Solar	情報技術	半導体
	Take-Two Interactive Software	情報技術	ホームエンターテインメント・ソフトウェア
	Masimo	ヘルスケア	ヘルスケア機器
	Coherent	情報技術	電子装置・機器
除外	Advanced Micro Devices	情報技術	半導体
	Raymond James Financial	金融	投資銀行・証券会社
	Alexandria Real Estate Equities	不動産	オフィス不動産投資信託
	Fossil Group	一般消費財・サービス	アパレル・アクセサリ・贅沢品
	Denbury Resources	エネルギー	石油・ガス探査・開発
	Vista Outdoor	一般消費財・サービス	レジャー用品

**S&P 小型株 600指数 - 2017年3月20日**

	会社名	GICS経済セクター	GICS産業サブグループ
追加	Fossil Group	一般消費財・サービス	アパレル・アクセサリ・贅沢品
	Denbury Resources	エネルギー	石油・ガス探査・開発
	Vista Outdoor	一般消費財・サービス	レジャー用品
除外	Take-Two Interactive Software	情報技術	ホームエンターテインメント・ソフトウェア
	Masimo	ヘルスケア	ヘルスケア機器
	Coherent	情報技術	電子装置・機器

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスでは、新規公開株式 (IPO) が S&P コンポジット 1500 への採用に適格となる期間について方針を更新し、これは本日から有効になります。IPO は、指数への追加が検討される前までに、適格な証券取引所で少なくとも 12 ヶ月間取引されていることが必要となります。IPO は以前、S&P コンポジット 1500 への追加が検討される前までに、6 ヶ月から 12 ヶ月の期間が必要でした。S&P トータル・マーケット指数及び S&P コンプリーション指数の IPO 適格性基準については変更がありません。変更の概要は以下の通りです：

変更	現行のメソドロジー	新しいメソドロジー
IPO の取り扱いは、各リバランス月 (3 月、6 月、9 月、12 月) の第二金曜日の直前の火曜日の市場取引終了後に開始し、リバランス月の第三金曜日の市場取引終了後に終了する。	新規公開株式 (IPO) は、指数への追加が検討される前までに、6 ヶ月から 12 ヶ月の期間が必要である。	新規公開株式 (IPO) は、指数への追加が検討される前までに、適格な証券取引所で少なくとも 12 ヶ月間取引されていることが必要である。

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスに関する詳しい情報については、[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

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。1,000,000 超の指数や、革新的で透明性のあるソリューションを 120 年以上にわたり構築してきたことにより、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。

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](http://www.spdji.com)をご覧ください。

### 詳しい情報について:

#### **Soogyung Jordan**

コミュニケーション部門のグローバル・ヘッド

ニューヨーク、米国

(+1) 212 438 2297

[soogyung.jordan@spdji.com](mailto:soogyung.jordan@spdji.com) should we change it to @spglobal.com???

#### **David Blitzer**

マネージング・ディレクター兼指数委員会の委員長

ニューヨーク、米国

(+1) 212 438 3907

[david.blitzer@spglobal.com](mailto:david.blitzer@spglobal.com)