

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、債券指数において制裁の影響を受ける証券に関する方針をアップデート

ニューヨーク、2021年2月17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、最近におけるグローバル市場の動向を踏まえ、制裁の影響を受ける証券に関する方針をアップデートします。変更の概要は以下の表の通りです。

方針	変更前	変更後
制裁の影響を受ける証券	<p>一部の制裁プログラムは包括的なものであり、政府を阻止するか、または幅広い取引制限を含んでいる一方、その他の制裁プログラムは特定の個人や事業体を選択的にターゲットとしています。制裁は包括的または選択的のいずれかになり得るため、S&P DJI はケースバイケースで制裁をレビューします。状況次第では、国または特定の証券は制裁の影響を受ける可能性があります。S&P DJI は通常、米国および（または）欧州連合（EU）をベースとする投資家の視点を使用して制裁を取り扱います。制裁の影響を受ける証券が現在の指数構成銘柄である場合、そうした証券は指数から除外される可能性があるため、非構成証券の指数への追加を阻止するか、制裁期間にわたり証券の現在の額面残高/指数ウェイト/GICS を凍結させます。いかなるケースでも、制裁の発動または解除によって指数に影響が及ぶ場合、S&P DJI の取り扱いはお客様に公表されます。</p>	<p>一部の制裁プログラムは包括的なものであり、幅広い取引制限を含んでいる一方、その他の制裁プログラムは特定の個人や事業体を選択的にターゲットとしています。制裁は包括的または選択的のいずれかになり得るため、S&P DJI はケースバイケースで制裁をレビューします。状況次第では、国全体または特定の証券が制裁の影響を受ける可能性があります。</p> <p>S&P DJI は通常、標準的なグローバル指数に関しては、米国および（または）欧州連合（EU）をベースとする投資家の視点を使用して制裁を考慮します。指数委員会の決定により、制裁の影響を受ける特定の証券は：</p> <ul style="list-style-type: none"> ● 制裁期間にわたり現在の額面残高/指数ウェイト/GICS が凍結される ● 指数から除外される、および（または） ● 指数への追加が不適格となる <p>いかなるケースでも、制裁の発動または解除によって指数に影響が及ぶ場合、S&P DJI の特定の取り扱いはお客様に公表されます。</p> <p>S&P DJI は適用法令を遵守することを条件に、上記の制裁による影響を受けない可能性のある米国/英国/欧州連合（EU）以外の特定の投資家グループの観点から証券のパフォーマンスを測定することを目的とした指数を公表することを選択する場合もあり</p>

		<p>ます。当該指数には、米国/英国/欧州連合（EU）の観点から制裁の対象となる証券が含まれる場合があるため、当該指数は S&P DJI のグローバル指数には不適格となります。そのような場合、関連する指数メソドロジーによって S&P DJI の取り扱いが明確に定義されます。S&P DJI は適用法令を遵守するために、当該指数の使用およびライセンス供与を制限する場合があります。</p> <p>S&P DJI の指数のユーザーは、指数の使用（取引、投資、またはその他の使用を含むが、これに限定されない）に関連するすべての適用法令を遵守する全責任を負っています（制裁に関する法令およびその他の規則、規制、または禁止事項を含むが、これに限定されない）。</p>
--	--	--

S&P DJI の指数のユーザーは、指数の使用（取引、投資、またはその他の使用を含むが、これに限定されない）に関連するすべての適用法令を遵守する全責任を負っています（制裁に関する法令およびその他の規則、規制、または禁止事項を含むが、これに限定されない）。米国の法律では現在、中国の特定の発行体が発行した上場証券、および当該証券のデリバティブ証券、または当該証券への投資エクスポージャーを提供するように設計された証券を米国人が売買することを禁止しています。したがって、米国の法律の適用対象になる米国の投資家およびその他の人々は、これらの証券を含む可能性のある S&P DJI の指数を使用する場合には、制裁に関するすべての適用法令および規制を遵守する責任を負っています。

上記の変更は 2021 年 2 月 22 日（月曜日）に有効となります。

今回の変更を反映するため、S&P DJI のウェブサイトに掲載されている S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスの債券指数方針および実務メソドロジー（S&P Dow Jones Indices' Equity Indices Policies & Practices Methodology）はアップデートされます。

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.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。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.spdji.com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