

S&P GIVI 指数及び S&P/JPX GIVI 指数のリバランス日程に関する相談の結果 – アップデート

ニューヨーク、2020年8月31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、S&P GIVI 指数及び S&P/JPX GIVI 指数のメソドロジーの変更に関して市場参加者と相談を行いました。

指数の複製可能性を向上させるために、S&P DJI はこれらの指数のリバランス日程を修正します。変更の概要は以下の通りです。

変更	変更前	変更後
リバランス日程	指数は年に2回の頻度でリバランスされ、3月の第4金曜日と9月の第3金曜日の取引終了後に有効となります。ファンダメンタル・データ参照日（ベータに使用され、また本源的価値モデルへの財務諸表インプット情報を得るためにも使用される）は、リバランス日の6週間前です。リバランス参照日（浮動株調整後時価総額などの追加情報を使用して本源的価値を計算し、構成銘柄のウェイトを決定するために使用される）は、リバランス月の前月の最終取引日です。	指数は年に2回の頻度でリバランスされ、3月と9月の第4金曜日の取引終了後に有効となります。9月の第1営業週が5日間全て平日（月曜日～金曜日）である年については、指数は9月の第3金曜日にリバランスされます。ファンダメンタル・データ参照日（ベータに使用され、また本源的価値モデルへの財務諸表インプット情報を得るためにも使用される）は、リバランス日の6週間前です。リバランス参照日（浮動株調整後時価総額などの追加情報を使用して本源的価値を計算し、構成銘柄のウェイトを決定するために使用される）は、リバランス月の前月の最終取引日です。

この変更は、S&P GIVI 南アフリカ指数に影響を及ぼさないため、同指数は引き続き年に2回の頻度でリバランスされ、3月と9月の第3金曜日の取引終了後に有効となります。

この変更は、次回の指数リバランスに合わせて実施される予定であり、**2020年9月28日（月）**の市場開始前に有効となります。

S&P DJI のウェブサイト上の S&P GIVI 指数メソドロジー及び S&P/JPX GIVI 指数メソドロジーについてはアップデートを行い、今回の変更を反映します。

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