

PRESS RELEASE

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス、S&P BDC 指数の算出を開始

日興アセットマネジメントが運用するインデックスファンド向けに同指数のライセンスを供与

東京、2014年2月3日: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 ビジネス・デベロップメント・カンパニー(BDC) 指数の算出を開始し、日興アセットマネジメント株式会社が運用するインデックスファンド向けに同指数のライセンスを付与したと発表しました。S&P BDC 指数は、中小企業向けに投融資を行っている米国の上場プライベート・エクイティ会社で構成されており、投資家は金融セクター内において成長している業界の動向を測定することが可能になります。

S&P BDC 指数は、米国株式市場を幅広く測定する S&P 米国 BMI 指数から銘柄を選択し、浮動株調整後の修正時価総額加重方式により算出されます。投資可能な浮動株を反映するため、必要に応じて時価総額ウェイトを修正する一方で、個別銘柄に関しては 10%の保有上限を設け、特定銘柄への過剰な集中を避けます。指数採用銘柄は、SEC ファイリングに明記されているビジネス・ディベロップメント・カンパニーの要件を備えた上場企業であり、また、ニューヨーク証券取引所(NYSE アーカ取引所を含む)NYSE MKT、ナスダック・グローバル・セレクト・マーケット、ナスダック・セレクト・マーケット、あるいはナスダック・キャピタル・マーケットに上場している必要があります。

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスの株式商品管理部門のヴァイス・プレジデントである Philip Murphy は次のように述べています。「日本の投資家は、特定の市場やセクターに対して正確に投資できるソリューションを模索しています。その様なニーズに応える形で、この度 S&P BDC 指数のライセンスを日興アセットマネジメントに付与できることを大変光栄に思います。我々は、日本の投資家に幅広い指数の選択肢を提供できるよう今後とも努力いたします。」

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスでは、指数の開発・提供においては、“完全性”を重んじます。指数の“完全性”とは、指数設計の透明性や、基礎データの信頼性、堅固なデータ処理、指数プロバイダーの独立性に基づいています。

詳しい情報をお求めの方は、<http://www.japanese.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

ザ・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® 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 830,000 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 まで。

「Standard & Poor's」および「S&P」は、ザ・マグロウヒル・フィ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

電話: 03-4550-8563

David R. Guarino

Communications

S&P Dow Jones Indices

dave.guarino@spdji.com

電話: (+1) 212 438 1471

Alex Yang

Communications, Asia Pacific

S&P Dow Jones Indices

alex.yang@spdji.com

電話: (+852) 2532 8001