



2016年4月27日

株式会社 日本取引所グループ  
株式会社 東京証券取引所  
S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス

### 「JPX/S&P 設備・人材投資指数」の算出開始について

株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所（「JPX グループ」）と S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスは、2016年4月27日より「JPX/S&P 設備・人材投資指数」の算出・公表を開始いたします。本指数は、2016年3月23日に公表いたしましたとおり、「設備投資・人材投資」に積極的に取り組む企業を対象とする新たな株価指数として共同開発を進めたものです。

本指数は、東証株価指数（TOPIX）をユニバースとし、運用利便性を考慮した流動性等のスクリーニングの後、「設備投資の成長性」「設備投資の効率性」「人材投資の充実度」の観点でスコアリングを行います。「設備投資の成長性」および「設備投資の効率性」に関しては、公表されている財務諸表を、「人材投資の充実度」に関しては、RobecoSAM 社の調査結果を参照しています。

なお、日本取引所グループの大阪取引所では、関係者のご意見を踏まえながら本指数を対象とする先物の上場についても前向きに検討してまいります。

本指数のライセンス手続き等に関しましては、東京証券取引所及び S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスにお問い合わせください。

東京証券取引所の代表取締役社長、宮原幸一郎は、「本日算出を開始した JPX/S&P 設備・人材投資指数が、「設備投資・人材投資」に積極的に取り組む企業の動向を示す新指数として幅広く認知され、またこの指数をベースとした投資商品が多く開発されることを期待します」と述べています。

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスの CEO、Alex Matturri は、「この様な形で JPX グループと共同で新指数を開発できたことを心より喜んでおります。本日の発表は、両社が日本独自の市場のニーズをしっかりと把握し、即座にソリューションを提供できることの証明だと思っております」と述べています。

### 東京証券取引所について

東京証券取引所は、金融商品取引法に基づく金融商品取引所の免許を受け、金融商品市場を運営しています。具体的な業務として、有価証券の売買を行うための市場施設の提供、相場の公表及び有価証券の売買等の公正の確保その他の取引所金融商品市場の開設に係る業務などがあります。

### 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・リソース企業です。金融市場の代表的指標である S&P 500®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 120 年以上にわたり構築してきました。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ます。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ます。当社についての詳細は <http://www.spdji.com> まで。

### RobecoSAM 社について

RobecoSAM 社は、サステナビリティ投資に特化している投資スペシャリストであり、1995 年に創業されました。同社は、資産運用や、指数、エンゲージメント、議決権行使、インパクト分析、持続可能性評価、ベンチマーキングなどのサービスを提供しています。資産運用業務では、機関投資家や金融仲介業者を対象に、幅広い ESG (環境・社会・企業統治) 統合投資 (上場及び非上場株式への投資) をカバーしており、資源効率テーマ戦略において優れた実績を上げています。RobecoSAM 社は S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスと連携し、世界的に認められているダウ・ジョーンズ・サステナビリティ・インデックス (DJSI) を公表しています。2,900 社の上場企業の年間 ESG 分析である「企業の持続可能性評価 (CSA)」に基づき、RobecoSAM 社は財務面で重要な持続可能性情報に関する世界で最も包括的なデータベースの一つを編集しています。また、CSA のデータは、898 億ドルに上る Robeco 社の運用資産残高にも要素として採り入れられています。RobecoSAM 社は、資産運用を専門とするグローバルな企業である Robeco 社の子会社です。

### 【お問い合わせ】

株式会社 日本取引所グループ  
広報・IR 部  
電話: 03-3666-1361  
Email: [index@jpx.co.jp](mailto:index@jpx.co.jp)

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス  
牧野義之  
日本オフィス統括責任者  
電話: 03-4550-8424  
Email: [index.tokyo@spdji.com](mailto:index.tokyo@spdji.com)