

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスの浮動株調整メソッドロジーの明確化

ニューヨーク、2021年8月27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 及びダウ・ジョーンズが算出するグローバル株価指数の四半期リバランス・プロセスを変更する提案に関して市場参加者と相談を行い、その[結果](#)を最近公表しました。S&P DJI は変更内容を発表するとともに、どのタイプの株主の保有株式が浮動株の一部と見なされるかについても明確にしています。

現行	変更後
<p>以下の投資主体が保有する株式は通常、浮動株の一部と見なされます：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 預託銀行 2. 年金基金（政府の年金基金及び退職年金制度を含む） 3. ミューチュアル・ファンド及びETFのプロバイダーや、投資ファンド、資産運用会社（取締役会に代表者を送り込んでいないヘッジファンドなどを含む） 4. 保険会社の投資ファンド¹ 5. 企業に関連していない独立系の基金 	<p>以下の投資主体が保有する株式は通常、浮動株の一部と見なされます：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 預託銀行 2. 年金基金（政府の年金基金及び退職年金制度を含む） 3. ミューチュアル・ファンド、ETFのプロバイダー、投資ファンド、及び取締役会に代表者を直接送り込んでいない資産運用会社（以下を含む）： <ul style="list-style-type: none"> ● 取締役会（BOD）メンバーを指名する権利を有しているが、指名することを選択しない可能性のある利害関係者 ● 取締役会“オブザーバー”を指名する権利を行使した利害関係者（利害関係者がそのオブザーバーを雇っている場合も含む）

¹ 特定の国では、保険会社は、規制上の問題や国固有の慣習に基づいて戦略的保有者と見なされる場合があります。

現行	変更後
	<ul style="list-style-type: none"> ● 利害関係者が雇っていない独立取締役を指名する権利を行使した利害関係者 <ol style="list-style-type: none"> 4. 保険会社の投資ファンド² 5. 企業に関連していない独立系の基金

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスのウェブサイトに掲載されている浮動株調整メソッドロジックは、この明確化を反映して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

² 特定の国では、保険会社は、規制上の問題や国固有の慣習に基づいて戦略的保有者と見なされる場合があります。