

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスの指数算出メソ ドロジーの明確化

ニューヨーク、2021年12月3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 ダウ・ジョーンズ・インデックスの指数算出メソドロジー」に詳述されている一部の計算手順を明確化することを発表します。

メソドロジーの明確性と透明性を高めるために、S&P DJI は計算の説明及び定義をより厳密に規定します。ただし、実際の計算式が変更されるわけではありません。今回の対応は、現行の計算手順についてより詳細に記載することだけを目的とするものです。

計算	明確化の概要
価格リターン、トータル・リターン、及び正味トータル・リターンの計算	価格リターン指数の水準及び指数配当に基づくトータル・リターンの計算方法に関する追加の明確化
権利落ち日後の配当調整	新たなセクション：指数の配当ポイント調整を計算するために使用されるステップと、この価値を指数配当計算に組み込む方法
フランキング・クレジット調整後トータル・リターン指数	フランキング・クレジット調整後トータル・リターン指数の指数水準の計算
為替及び為替ヘッジ指数	S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスの為替ヘッジ指数の計算で用いられる変数の明確化
加重リターン指数	日次リバランス及び定期的リバランスを行う指数のコンポーネント指数のウェイト及びリターンの計算

S&P DJI は、当社ウェブサイトに掲載されている「S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスの指数算出メソドロジー」をアップデートし、これらの明確化を反映します。

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