

News Release

ラッセル・インベストメント・グループ

発信日: 2006年6月7日(米国時間2006年6月6日)

ラッセルがグローバル株インデックスの提供を予定

米国株式インデックスの業界リーダーが全世界を対象にした新インデックスを開発

ラッセル・インベストメント・グループ(本部:米国ワシントン州タコマ)は、2006年第4四半期を目処に、新たなグローバル株インデックス・シリーズの開発を予定しています。ラッセルは、これまで米国小型株を代表する Russell 2000 インデックスなど、米国株インデックス・シリーズを開発してきましたが、今回の新しいグローバル株インデックスを通じて、世界の投資家の皆様に、先進国市場およびエマージング市場の両方を含むそれぞれの国・地域・業種、また、大型株・小型株を包括的に網羅したベンチマークを提供することが可能となります。

ラッセル・インデックスのマネージング・ディレクターを務めるデイビッド・グリーガーは、以下のように述べています。「ラッセルは、これまで先進的なインデックスの構築方法を用いて、米国株式市場の異なるセグメントを的確に測定するための客観的でかつ透明性の高いツールを提供してまいりました。そして、今後その技術をグローバル株にも応用してまいります。私共は、世界44カ国においてビジネスを展開しており、これらの国々のクライアントの皆様は、自らの運用パフォーマンスを測定するための、客観的で、横断的、かつ統一性のあるグローバルな枠組みの提供を求めています。」

今回の開発は、外国株式を運用の対象にしている米国の大手年金、資産運用コンサルタント、運用機関、富裕層向け資産運用アドバイザーからの一歩進んだグローバル株インデックスに対する需要の高まりに答えるものです。この新しいベンチマークは、それぞれの国を包括的に網羅しつつ、投資可能性に配慮したグローバル株市場全体の98%を代表するものになります。

また、ラッセル・インデックスのディレクターを務めるロン・バンディーは、「弊社の米国株インデックスは、当初、運用機関のパフォーマンスを正確に測定するツールをクライアントの皆様を提供するため開発されました。弊社は、グローバルな運用機関として、そしてインデックスの提供者としてこれまで培ってきた知識と経験を生かし、この度、グローバル株インデックスを開発する運びとなりました。今回の開発にあたっては、業界関係者の皆様のご意見を伺い、グローバル株インデックスに対する皆様のニーズの理解に努めてまいりました。そして、それらのニーズにお応えする統合型のベンチマークの開発が可能であると確信しております。」と述べています。

ラッセルは、浮動株修正、銘柄入れ替え、REITの組入れ、多様なスタイル・インデックス、客観性や透明性に関するルールといったインデックスの構築方法を先駆的に開発してきており、その結果、ラッセル米国株インデックス・シリーズをベンチマークとする資産がその他のインデックスのそれに比べ大きく拡大してきました。ネルソン・インフォメーション社のデータベース『Marketplace Web』に登録された2,954の米国株の運用プロダクトを元にラッセルが実施した調査によると、現在、ラッセル米国株インデックスをベンチマークとしている運用資産の規模は3兆8,000億米ドルにのぼり、米国の機関投資家の資産全体の52%を占めています。

ラッセル米国株インデックス・シリーズは、ラッセルのビジネスの中核をなす運用機関の調査・評価を支援するため、20年以上前に開発されました。ラッセルは、世界のマルチ・マネージャー運用業界においてリーダー的な存在であり、年間6,800以上にものぼる運用機関との個別面談を実施しています。また、4,500もの運用プロダクトを対象に継続的なモニター、また、定量的な評価基準と対面による評価面談を通じた包括的な調査プログラムを実施しており、それらの中から現在180の運用プロダクトをラッセル・ファンドの運用に採用しています。

「インデックスは、私達にとって定量的な尺度となるものです。その構造が現実に近ければ近いほど、運用機関やファンドのパフォーマンス分析がよりの確なものとなります。多くの投資家の皆様にとって弊社が実施しているような定性評価を再現することは容易なことではありませんが、インデックスは、どなたにも共通の定量的なベンチマークとして利用が可能です。」と前述のバンデューは述べています。

日々のリターンデータを含むラッセル・インデックスに関するより詳細な情報は、以下のサイトでご覧いただけます。

www.russell.com/indexes

ラッセル・インベストメント・グループについて

ラッセル・インベストメント・グループは、「マルチ・マネージャー運用のグローバル・リーダー」として今日世界 44 カ国で総合的な資産運用管理サービスを提供しています。ラッセルが提供するサービスは、グローバルな運用会社調査をベースに、資産運用コンサルティング、資産運用サービス、売買執行管理サービス、オルタナティブ投資サービス、Russell 1000[®]、Russell 2000[®]、Russell 3000[®]、Russell/Nomura 日本株インデックス等のインデックスの開発など多岐にわたります。ラッセル・インベストメント・グループの創立は 1936 年。現在当グループが提供する資産運用コンサルティング・サービスの対象資産総額は 270 兆円^{*}、またマルチ・マネージャー運用の資産総額は約 19 兆円^{**}となっています。なお、1999 年よりノースウェスタン・ミューチュアルが当グループの親会社となっています。

詳しくは、www.russell.com をご覧ください。

(※ 2005 年 9 月末現在 ※※ 2006 年 3 月末現在、グループ合算)

ラッセル米国株インデックスについて

「ラッセル米国株インデックス」は、1984 年にラッセル・インベストメント・グループによって開発された株式市場インデックスです。米国における全上場銘柄を広く網羅しており、浮動株修正時価総額で約 98% を代表する「Russell 3000 Index」を中心に、大型/小型といった規模別や、グロース/バリューの投資スタイル別のサブインデックスを含む、計 26 種類のインデックスが含まれます。インデックスの構成銘柄は、各銘柄の浮動株修正時価総額による公平かつ完全なランキングに基づいて決定されており、年一回 7 月第一営業日に構成銘柄の定期入れ替えが実施されます。

Russell/Nomura 日本株インデックスについて

「Russell/Nomura 日本株インデックス」は、1995 年にラッセル・インベストメント・グループと野村証券によって開発された株式市場インデックスです。東証 2 部、大証、名証、東証マザーズ、大証ヘラクレス、JASDAQ などの全上場銘柄を広く網羅しており、浮動株修正時価総額で約 98% を代表する「Russell/Nomura Total Market インデックス」を中心に、大型/小型といった規模別や、グロース/バリューの投資スタイル別のサブインデックスを含む、計 27 種類のインデックスが含まれます。インデックスの構成銘柄は、各銘柄の浮動株修正時価総額による公平かつ完全なランキングに基づいて決定されており、年一回 12 月第一営業日に構成銘柄の定期入れ替えが実施されます。

【本件に関するお問い合わせ先】

【米国窓口】

ラッセル・インベストメント・グループ
PR 担当 Steve Claiborne
Tel: US, 253-439-1858
E-mail: newsroom@russell.com

【日本窓口】

ラッセル・インベストメント・グループ
企画・広報部門
Tel: 03-5411-3538
E-mail: Tokyo-RIJ@russell.com

ラッセル・インベストメント・グループは世界中の拠点を通じて事業を展開しています。

「ラッセル・インベストメント・グループ」および「ラッセル」は、フランク・ラッセル・カンパニー及びその子会社等の総称です。