

Contact: 広報担当(マーケティング部)
Tel: 03-5411-3790
E-mail: Tokyo-RIJ@russell.com

ラッセル・インベストメント株式会社
東京都港区赤坂 7-3-37 プラス・カナダ
www.russell.com

発信日: 2008年2月28日

ラッセル・インベストメントがグローバル株 スタイルインデックスの提供開始を発表

米国株スタイルインデックスのパイオニアが、グローバルの 視点で計算した新しいスタイルインデックスを開発

ラッセル・インベストメント(本社:米国ワシントン州タコマ市)は、グローバル株スタイルインデックスの提供を2008年4月1日より開始すると発表しました。今般発表した新しいインデックスには、ラッセル・グローバル株大型グロースインデックスやラッセル・グローバル株大型バリューインデックスなどがあり、ラッセル・グローバル株インデックスのグロース、バリューの各セグメントを反映しています。

ラッセル・インデックスの商品開発担当ディレクターのロルフ・アガサーは、2008年2月27日(現地時間)シンガポールにおいて開催された「Indexing & ETF Investments Asia 2008」のカンファレンスにおいて、「グローバルな視点での株式運用に投資家の注目が集まる中、米国株式市場同様、各市場のセグメントを的確に測定するための強固で透明性の高いツールに対する投資家のニーズが高まっています。現在ラッセルの米国株スタイルインデックスは100%に近いシェアで機関投資家の皆様に受け入れられています。私たちの調査の結果、米国以外の株式市場でもスタイルに関して米国同様の現象が確認されたため、米国株スタイルインデックスで培ったノウハウをグローバル株インデックスについても活かしたいと考えたのです」と述べました。

またアガサーは、2007年初めにラッセル・グローバル株インデックスの提供を開始して以来、ラッセルがグローバル株スタイルインデックスの調査・開発に組織的に取り組んできたことを補足しています。

さらにアガサーは、「ラッセルのアナリストは年間8,000以上もの運用商品について調査を行っています。長期的な観点で見ると、自国中心からグローバルなポートフォリオの移行に取り組む運用機関が増えてきています。その結果、グローバル株式のポートフォリオの分析や調査を深めるよりよいツールへのニーズが高まりつつあるのです」と述べています。

ラッセルでは、スタイルは、運用機関が保有する銘柄を選択する手法の相違を最も明確に反映するものと考えています。その手法のひとつとして、売上や利益等の成長性が市場平均より高い企業を主な投資対象とする手法があります。また、企業の資産価値などから判断して株価が過小評価されている企業を主な投資対象とする手法もあります。

「1980年代前半にラッセルが米国株式市場のためのグロースおよびバリューのスタイルインデックスを開発した背景は、上述の投資手法の相違の重要性の認識が高まったことに起因します。ラッセルは、米国株式市場における運用機関の行動やパフォーマンスの源泉について詳細に調査し、米国株スタイルインデックスの開発を行いました。そして現在は、それと同様のことをグローバル株式市場で行っています」と、前述のアガサーは述べています。

ラッセルのグローバル株スタイルインデックスの詳細については、同インデックスの提供を開始する2008年4月1日にラッセル・インベストメントのウェブサイト(www.russell.com)にてご覧いただける予定です。この構築方法は、グローバル株式市場を個々の市場の集合体という視点ではなく、異なっているもののひとつの大きな投資機会という視点で捉えています。

このグローバル株スタイルインデックスは、幅広いニーズに対応するために開発されました。例えば、運用機関やパフォーマンスの要因分析の基準、運用機関のベンチマーク、グローバルレベルでグロース株、バリュー株に投資する市場参加者へのエクスポージャーの洞察の材料、金融派生商品や上場投資信託などの参照指数としての役割が挙げられます。

現在、米国株における大型グロース株のセグメントを反映している Russell 1000[®]グロースインデックスは、機関投資家の運用資産のベンチマークとして、世界のスタイルインデックスを代表する存在となっています。Russell 1000[®]グロースインデックスと Russell 1000[®]バリューインデックスを合わせると、1兆米ドル以上の運用資産でベンチマークとして利用されています。

これまでラッセルは、浮動株修正、銘柄入れ替え、マルチファクター(多変量)でのスタイル分析、客観的で透明性の高いルールといった新しい手法をインデックスに導入してきました。その結果、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は、米国の機関投資家の資産全体の 58.5%を占めています。

このリリースの本文は、2008年2月27日にラッセル・インベストメントがシンガポールで発表した英文ニュースリリースを翻訳したものです。

ラッセル・インベストメントについて

ラッセル・インベストメントは、今日世界 44 カ国において、年金、金融機関および個人投資家など様々な投資家の皆様を対象に総合的な資産運用ソリューションを提供しています。グローバルに行う運用会社調査をもとに、世界最高水準の運用会社へのアクセスを提供することに強みがあり、資産運用、オルタナティブ投資、確定拠出年金サービス、資産運用コンサルティング、売買執行管理、株式インデックスの開発など幅広く業務を行っています。現在当グループが提供するファンドの運用資産総額は約 25 兆円^{*}、また資産運用コンサルティング・サービスの対象資産総額は約 224 兆円^{**}となっています。グループの創立は 1936 年。米国ワシントン州タコマを本拠地とし、アムステルダム、オークランド、サンフランシスコ、シドニー、シンガポール、東京、トロント、ニューヨーク、パリ、香港、メルボルン、ヨハネスブルグ、ロンドンに主要拠点を擁しています。米国最大手の個人生命保険会社であるノースウェスタン・ミューチュアル・ライフ・インシュアランスの子会社です。

日本においては 1986 年に東京オフィスを開業。現在、ラッセル・インベストメント株式会社を通じて各種サービスを提供しています。詳しくは、www.russell.com をご覧ください。

(* 2007 年 12 月末現在 ** 2006 年 9 月末現在、グループ合算)

Copyright © Russell Investments 2008. All rights reserved. ラッセル・インベストメント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」、「ラッセル・インベストメント」および「ラッセル」は、フランク・ラッセル・カンパニーおよびその子会社等の総称です。当資料は、当社が信頼できると判断した情報に基づき作成しておりますが、その情報の正確性や完全性についてこれを保証するものではありません。当資料は、一般的な情報の提供を目的としており、特定の運用商品の推奨等の投資勧誘を目的としたものではありません。当社による事前の書面による許可がない限り、資料の全部または一部の複製、転用、配布はいかなる形式においてもご遠慮下さい。