

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7月4日

『ラッセル・グローバル株インデックス』年次銘柄入れ替え 新たに 1,242 銘柄を組み入れ

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、この度ラッセル・グローバル株インデックスの年次銘柄入れ替えを行いました。今回の入れ替えで世界 62 カ国の 1,242 銘柄が新たに組み入れられました。新規採用銘柄数の上位 10 位は、米国が最多の 279 銘柄で、その後にインド(93)、カナダ(89)、台湾(89)、オーストラリア(51)、中国(43)、イギリス(41)、韓国(36)、ロシア(34)、ブラジル(32)が続きました。

また、今回の銘柄入れ替えでは、カザフスタン、カタール、チュニジア、ウクライナ、ベトナムの 5 カ国の銘柄が初めてエマージング市場の銘柄として組み入れられました。なお、これらの新規銘柄は当該インデックスのサブ・インデックスにも同時に組み入れられます。例えば、新規に組み入れられたベトナムの小型株は、ラッセル・エマージング株インデックス、ラッセル・アジア株インデックス、ラッセル・アジア太平洋株インデックス、ラッセル・グローバル株小型インデックス等に同時に組み入れられます。また、前述のインデックスのグロース株/バリュー株のスタイル・インデックスにも同時に組み入れられます。

新規採用銘柄の顔ぶれがこのようになったのは、年次銘柄入れ替えを包括的かつ客観的に行った結果であり、この入れ替えによってラッセル・グローバル株インデックスは、グローバル市場の実勢を一層反映するよう再編成されました。

「インデックスの構成銘柄入れ替えは、真に市場を代表する株式ベンチマークを投資家に提供するうえで、必要不可欠なプロセスです。年次銘柄入れ替えにより世界の株式市場の変化を捉え、実勢を正確に反映したインデックスへと調整します。これは、株式ポートフォリオのパフォーマンスあるいは定年後の計画をより適切に評価することを望む投資家にとって重要なプロセスなのです」とシニア・ポートフォリオ・ストラテジストのステイブン・ウッドは述べています。

新規に採用された 1,242 銘柄を業種別に見ると、「原材料・加工」が 295 銘柄と最も多く、次に「金融サービス」の 220 銘柄、「一般消費財・サービス」の 162 銘柄が続きます。新規採用銘柄の中には第 2 四半期に上場した 48 の新規公開株も含まれ、その内 8 銘柄が中国株、5 銘柄がインド株でした。

ラッセル・グローバル株インデックスは、世界の投資可能な株式市場全体の 98%をカバーしており、世界 70 カ国、10,000 以上の銘柄で構成されています。時価総額の規模は、4,680 億米ドル(エクソン・モービル、本社:米国テキサス州)から 1 億 6,700 万米ドル(NVE 社、本社:米国ミネソタ州)にわたり、中央値は 320 億米ドルです。

パッシブおよびアクティブ運用のベンチマークとして多くの投資家の皆様にご利用いただいているラッセル・インデックスの構成銘柄は、時価総額の順位などを用いた客観的なルールによって決定されています。ラッセルが継続的に調査している運用商品は 8,000 を数え、これらの商品を評価するうえで精度の高いベンチマークが不可欠なツールとなっています。

ラッセル・グローバル株インデックスの詳細は、www.russell.com/jp/globalindex.aspをご覧ください。

このリリースは、2008年7月3日にラッセル・インベストメント(米国)が発表した英文ニュースリリースをもとに日本のお客様向けに作成したものです。

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、現在世界 47 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、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おり、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 21 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、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設。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/jpii をご覧ください。

(※ 2008 年 3 月末現在)

Copyright ©2008. Russell Investments. 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。