

平成27年8月4日

各位

三菱UFJ信託銀行株式会社

スイス STOXX 社とのスマートベータインデックスの共同開発について

～共同開発の第1弾は「高 ROE」の日本株に投資～

三菱 UFJ 信託銀行は、本年5月、ドイツ証券取引所の子会社の STOXX(ストックス)社^{*1}と協働し、インデックス提供ビジネスに参入することといたしました。今般、同社と高 ROE の日本株に投資するスマートベータインデックス「iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ 150 インデックス」を共同開発いたしましたので、お知らせします。

1. スマートベータインデックスについて

スマートベータインデックスは、上場全銘柄の時価総額への単純連動等の従来型パッシブとは異なり、銘柄選択や加重方法に投資理論に基づく付加価値を加えるなどアクティブに近い運用手法により、投資コストを抑えながら、高い運用効率の実現を目指すインデックスで、欧米を始めとする世界の資産運用市場で急速に成長・拡大しています。

2. STOXX 社との協働の狙いについて

インデックス提供ビジネスで欧州最大の STOXX 社と組むことにより、同社の顧客である海外投資家に販路を拡大すると共に、同社が日々算出・公表するインデックスを国内外の資産運用会社に提供し、運用商品の組成が可能となります。

3. 「iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ 150 インデックス」について

金融工学専門の研究機関である当社子会社の三菱 UFJ 投資工学研究所(MTEC)^{*2}と共に定量分析を行った結果、高 ROE(株主資本収益率)企業のうち、一定の条件下における高 ROE 継続銘柄にかかる株価収益率が高いことが判明しました。

今回開発した「iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ 150 インデックス」は、単年度だけでなく、継続的に高い ROE を実現するポテンシャルを持つ 150 社の企業群から構成されています。

【概要】

名称	iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ 150 インデックス
構成銘柄数	150 銘柄
投資対象ユニバース	STOXX JAPAN 600(東証上場銘柄から流動性の高い銘柄で構成)
銘柄選定基準	ユニバース採用銘柄のうち、高 ROE かつ、①財務健全性、②キャッシュフロー収益性、③利益安定性の3点に着目し高 ROE の継続性を評価し、銘柄を選定
銘柄入替	6月と12月の年2回
算出方法	浮動株調整時価総額加重型(2.0%キャップ付き)

三菱UFJ信託銀行は、国内の年金運用で培った開発力と、STOXX 社のインデックス算出・管理ノウハウの融合によりインデックス提供ビジネスに参入し、国内外のお客さまのグローバルな資産運用ニーズにお応えしてまいります。

以上

<ご参考>

【*1 STOXX 社の概要】

- ・1997年(平成9年)設立の指数開発・提供の専業会社。本社チューリッヒ。
- ・ドイツ証券取引所の100%子会社。
- ・本年1月現在で、7,100以上の指数を算出し公表。
- ・欧州における指数ビジネスやETFシェアはトップクラス。

【*2 MTEC の概要】

- ・昭和63年に国内初の金融工学に特化した研究機関として設立。従業員数38名。
- ・三菱UFJ信託銀行グループの100%子会社。