

各位

三菱UFJ信託銀行株式会社

「iSTOXX MUTB Japan 積極投資企業 200 インデックス」のスイス STOXX 社との共同開発について
 ～設備投資・人材投資を積極的に行なっている国内企業で構成～

三菱UFJ信託銀行株式会社(取締役社長 池谷幹男)は、昨年5月より、ドイツ証券取引所の子会社の STOXX(ストック)社*と共同し、インデックス提供ビジネスに参入しておりますが、今般、同社と「iSTOXX MUTB Japan 積極投資企業 200 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。

当指数は、国内の投資家のみならず、海外の投資家に対しても、投資や成長に対して積極的かつ前向きに取り組んでいる日本企業をアピールしたいという狙いで、開発いたしました。

本インデックスは、安定的に高収益を上げている企業のうち、将来の成長に繋げるために積極的な投資(設備・人材)を行なっている企業 200 銘柄から構成されています。銘柄選定の基準となるスコアリングにおいて、収益・安定性を評価する独自の収益性スコアに、設備投資の積極性や、人材投資の積極性を評価するスコアを加えています。

- ・収益性スコア : ROE、財務健全性、キャッシュフロー収益性、利益安定性を考慮
 - ・設備投資スコア : 設備投資の変化、減価償却費を上回る設備投資額、研究開発の変化を考慮
 - ・人材投資スコア : 給与や従業員数の変化、スキル・モチベーション、社員が働きやすい環境づくり、女性の活躍推進を考慮
- また、売買コストやリバランスタイミング等にも配慮しており、大規模資金の運用でも高い運用効率が維持できます。

【概要】

名称	iSTOXX MUTB Japan 積極投資企業 200 インデックス (英文名:iSTOXX MUTB Japan Proactive Leaders 200 Index)
構成銘柄数	200 銘柄
投資対象ユニバース	STOXX Japan 600 ex REIT(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、①収益・安定性、②設備投資の積極性、 ③人材投資の積極性の3点に着目しスコアリングを実施、銘柄を選定
銘柄入替	6月と12月の年2回
算出方法	時価総額加重方式(個別銘柄保有上限:2.0%)

なお、本指数の開発は弊社及び STOXX 社の共同で行ない、算出・公表は STOXX 社が担当しています。

【* 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。
- ・欧州における指数ビジネスやETFシェアはトップクラス。

三菱UFJ信託銀行は、国内の年金運用で培った商品開発力と、STOXX 社のインデックス算出・管理ノウハウの融合により、国内外のお客さまの多様な資産運用ニーズにお応えしてまいります。

以上