

【ご案内】 GICS業種分類の変更について/Barraリスク分析モデルの変更について

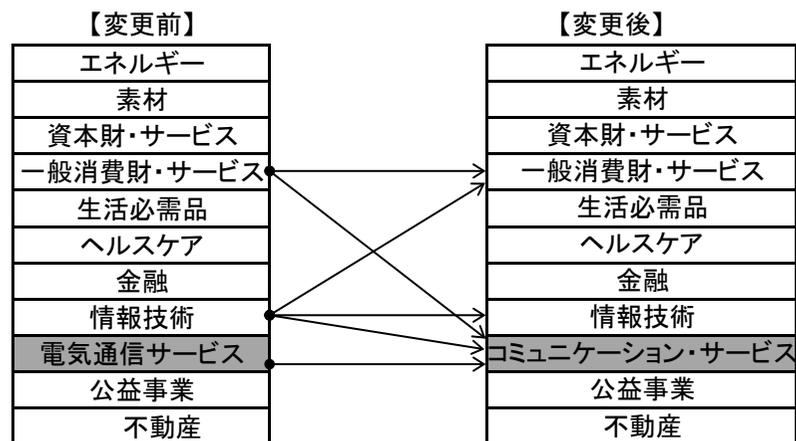
■ GICS業種分類の変更について

2018年9月28日の金融市場の取引終了後より、GICS(世界業種分類基準)のセクター分類が変更となりました。MSCI社が変更内容を指数へ反映させる時期は、2018年11月のMSCI指数定例見直しのタイミングに合わせる旨、MSCI社から公表されています。

弊社では、2018年12月より本変更を反映したパフォーマンス計測を開始予定です。

【変更概要】

- ・「電気通信サービス」セクターが「コミュニケーション・サービス」セクターに名称変更
- ・「コミュニケーション・サービス」セクターには、情報技術、一般消費財・サービスの各セクターから一部の銘柄が追加
- ・情報技術セクターの一部の銘柄が、一般消費財・サービスセクターに分類変更



■ 外国株式のBarraリスク分析モデルの変更について

外国株式のポートフォリオのリスク分析を行うBarraモデルについて、2019年4月初よりモデルが変更されることとなりましたので、ご案内いたします。

今回の変更では、リスクを計測する項目が増加し、現行のモデルと比較しより精緻なリスク分析を行うことを目的としております。

弊社では、2019年3月末までに本変更を反映したパフォーマンス計測を開始予定です。

【現行】	【変更後】※
ボラティリティ	ベータ レジデュアル・ボラティリティ
サイズ	サイズ
サイズ非線形	中型株
流動性	流動性
財務レバレッジ	レバレッジ
グロース	グロース
バリュー	簿価株価比 配当利回り 益回り
モーメンタム	モーメンタム
	利益変動性
	利益クオリティ
	投資クオリティ
	長期リバーサル
	収益性

※レーダーチャートの項目も上記に変更となります