



2020年6月17日

各 位

会 社 名 日 本 証 券 金 融 株 式 会 社  
代 表 者 名 代 表 執 行 役 社 長 櫛 田 誠 希  
( コード番号 8511 東証第1部 )  
問 合 せ 先 経 営 企 画 部 長 由 元 裕 二  
( TEL . 03 - 3666 - 3184 )

### 兼業業務の承認取得のお知らせおよび「日証金 信用取引プライム指数」の公表について

当社は、先般、金融庁より指数情報等の提供に関する兼業業務の承認を取得し、本日「日証金 信用取引プライム指数」(略称：日証金プライム指数)を公表いたしました。

日証金プライム指数は、個別銘柄の信用取引残高や貸借取引残高を分析し、信用取引の投資家が買い方向で注目している銘柄で構成されたポートフォリオの動向を示す指数で、信用取引に関連するデータが指数化されることは世界初 となります。

2020年6月16日現在 当社調べ

信用取引の投資家は、典型的な逆張り型と言われることが多く、株価の変動に応じて積極的に売買を入れ、思惑通りに株価が動く機敏に反対売買を行い、柔軟に相場を切り抜けていくイメージが一般的にあります。しかし、必ずしも単純に値下がりした銘柄を購入しているわけではなく、各投資家の得意分野における目利き力を活かし、相場観や個別銘柄の特性に応じて投資銘柄を選別しているようです。このような信用取引の投資家の動向を、信用取引に長年携わってきた日本で唯一の証券金融会社である当社が、京都大学大学院加藤康之客員教授および Qontigo 社と共同で計量化し、日証金プライム指数をリリースいたしました。

当社としては、日証金プライム指数の公表により、信用取引・貸借取引の認知度向上を図るとともに、証券市場の発展に寄与して参ります。

なお、本件の当社業績への影響は軽微です。

以 上

< 本件についてのお問い合わせ先 >

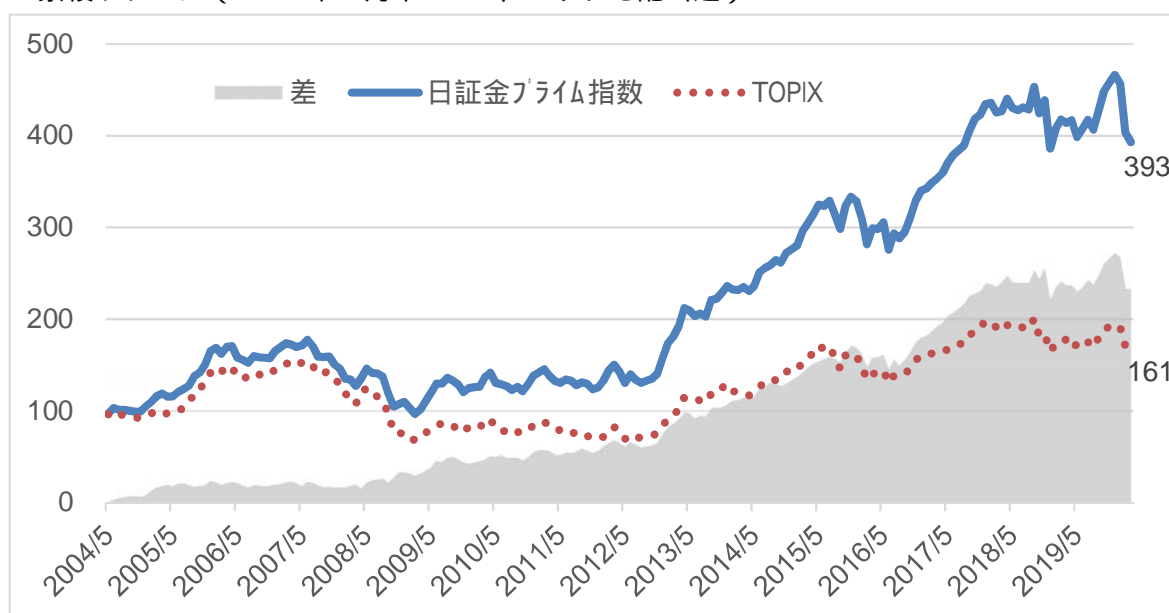
日本証券金融株式会社

業務開発部

E-mail : bddept@jsf.co.jp

## ご参考

累積リターン（2004年4月末 = 100、いずれも配当込）



バックテスト期間（2004年4月末～2020年3月末）のみ、参考として掲載しております。将来の成果を予想するものではありません。

### Qontigo（コンティゴ）社について

ドイツ取引所傘下の金融・投資情報サービス会社。2019年9月、ポートフォリオ構築・リスク分析ツールの Axioma（アクシオマ）社と指数開発の STOXX（ストッククス）社が合併して誕生しました。スペイン語で「あなたと共に」を意味する「Contigo（コンティゴ）」が新社名の由来です。リスク分析事業のサービスはマルチアセットに対応しており、アクシオマのリスク管理・最適化技術を世界各国の金融機関に提供しています。指数事業では、STOXX・DAX ブランドで欧州を中心に 10,000 超の指数を展開。世界最大規模の資産運用会社など 500 以上の顧客と取引があります。

日証金プライム指数ウェブサイト：<https://www.taisyaku.jp/jsf-index/>

指数値については、上記ウェブサイトのほか、Refinitiv 社 EIKON（RIC コード：JSFMTPI（配当なし））にて、毎営業日終値を公表しています。

- 本資料は情報提供のみを目的としたものであり、投資勧誘や特定の証券会社との取引を推奨することを目的として作成されたものではありません。
- 万一、本資料に基づき被った損害があった場合でも、当社は責任を負いかねます。
- 本資料で提供している情報は万全を期していますが、その情報の完全性を保証しているものではありません。
- 本資料は日証金プライム指数について平易に解説・記述しておりますが、すべての内容を網羅したものではありません。
- 本資料に記載されている内容は、将来予告なしに内容が変更される可能性があります。また、過去の情報は実績であり、将来の成果を予想するものではありません。