

NASDAQ100指数特別リバランス実施

2023年7月25日

ナスダック社は2023年7月7日（現地時間、以下同様）、NASDAQ100指数の指数構成銘柄のウエートを再配分する特別リバランスを行う旨を発表し、2023年7月24日の取引開始前に実施されました。

NASDAQ100指数では、指数の健全性を維持するために必要であるとナスダック社が判断した場合に、リバランスルールに則ったウエート制限に基づき特別リバランスが実施されます。

今回は、足元でアップルやマイクロソフトなどの大型ハイテク銘柄の成長が目覚ましく、NASDAQ100指数におけるGAFAM※+NVIDIA+Teslaの7銘柄合計ウエートが55%に達しており、特定の銘柄による指数への影響力が過大となっていることから、特別リバランスが必要であると判断されたと考えられます。また特別リバランスは、ウエートを再配分することで指数内の過度な集中に対処することを目的としており、銘柄の入替は行われません。

※GAFAM : Google（現Alphabet）、Amazon、Facebook（現Meta）、Apple、Microsoftの5社

NASDAQ100指数に占めるGAFAM+NVIDIA+Teslaの割合推移

（2018年12月末～2023年7月7日）



（出所）NASDAQ

特別リバランスが実施された結果、GAFAM※+NVIDIA+Teslaの7銘柄のウエートのみが減少し、7銘柄の合計ウエートは43%程度まで低下しました。

リバランス後NASDAQ100指数ウエート上位銘柄

	時価総額 (10億ドル) 7/24	ウエート (%)			騰落率 (%)	
		7/24	7/7	変化	年初来~7/24	7/7~7/24
アップル	3,032	11.6	12.5	▲ 0.8	48.3	1.1
マイクロソフト	2,566	9.9	12.9	▲ 3.1	43.9	2.3
アルファベット	1,545	5.5	7.4	▲ 1.9	37.7	1.7
アマゾン・ドット・コム	1,322	5.1	6.9	▲ 1.8	53.3	▲ 0.8
エヌビディア	1,102	4.2	7.0	▲ 2.8	205.3	5.0
メタ・プラットフォームズ	747	3.5	4.3	▲ 0.8	142.3	0.4
テスラ	854	3.3	4.5	▲ 1.2	118.4	▲ 2.0
ブロードコム	372	3.1	2.4	0.7	61.2	6.5
ペプシコ	263	2.2	1.7	0.5	5.7	4.3
コストコホールセール	250	2.1	1.6	0.5	23.5	7.4
アドビ	239	2.0	1.5	0.5	55.7	8.0
シスコシステムズ	216	1.8	1.4	0.4	11.5	4.2
ネットフリックス	190	1.6	1.3	0.3	45.3	▲ 2.2
コムキャスト	180	1.5	1.2	0.3	23.8	4.5
AMD	178	1.5	1.2	0.2	70.8	▲ 2.3

(出所) NASDAQ、Bloomberg

当資料のお取扱いにおけるご注意

- 当資料は投資判断の参考となる情報提供を目的として大和アセットマネジメント株式会社が作成したものであり、勧誘を目的としたものではありません。投資信託のお申込みにあたっては、販売会社よりお渡しする「投資信託説明書(交付目論見書)」の内容を必ずご確認ください。
- 当資料は信頼できると考えられる情報源から作成しておりますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。運用実績などの記載内容は過去の実績であり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。記載内容は資料作成時点のものであり、予告なく変更されることがあります。また、記載する指数・統計資料等の知的所有権、その他一切の権利はその発行者および許諾者に帰属します。
- 当資料の中で個別企業名が記載されている場合、それらはあくまでも参考のために掲載したものであり、各企業の推奨を目的とするものではありません。また、ファンドに今後組み入れることを、示唆・保証するものではありません。