

ファンド情報

設定日	2011年5月10日
ベンチマーク指数	MSCI Europe(税引き後配当込)指数
通貨	ユーロ
形態	フランス籍オープンエンド(SICAV)
ティッカー	Bloomberg: ERO FP Reuters: ERO.PA
ISINコード	FR0000001885
Euronextコード	ERO
純資産額	242.15(百万ユーロ)
一口当たり純資産額	97.83(ユーロ)

運用方針

完全法を採用し、MSCI Europe(税引き後配当込)指数の値動きとの連動を目指します。当指数は、ヨーロッパ諸国で上場されているすべての銘柄を表象するべく構成されています。

運用実績(%) (2011年9月30日現在)

ネット収益率	ファンド	ベンチマーク	差異
1ヶ月	-4.47	-4.47	0.00
1年間	-10.34	-10.26	-0.08
3年間(年率)	-1.31	-1.27	-0.04
5年間(年率)	-5.32	-5.23	-0.09
設定来	-2.08	-1.87	-0.21

累積収益率	ファンド	ベンチマーク	差異
1年間	-10.34	-10.26	-0.08
2年間	-1.58	-1.39	-0.19
3年間	-3.87	-3.75	-0.12
5年間	-23.91	-23.54	-0.37
設定来	-19.54	-17.73	-1.81

年間収益率	ファンド	ベンチマーク	差異
2001	-11.44	-11.15	-0.29
2002	-31.91	-31.56	-0.35
2003	13.63	13.84	-0.21
2004	10.49	10.67	-0.18
2005	25.24	25.74	-0.50
2006	19.26	19.61	-0.35
2007	2.47	2.71	-0.23
2008	-43.48	-43.64	0.16
2009	31.24	31.59	-0.35
2010	10.96	11.10	-0.14
2011	-15.62	-15.61	-0.01

標準偏差	ファンド	ベンチマーク	差異
過去3年間	19.41	19.48	-0.07

トラッキングエラー(過去3年間、年率化) 0.21%

※ 運用実績は報酬控除前です。

※ 運用成果は過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。投資収益と元本価額は変動しますので、売却時に損失を被る場合もあります。現在の運用成果は上記の実績を下回っている場合があります。

## SPDR® MSCI ヨーロッパ ETF

2011年9月30日現在

ファンド特性	ファンド	ベンチマーク
平均株価収益率	9.16	9.16
平均株価純資産倍率	1.19	1.18
平均株価キャッシュフロー倍率	4.55	4.55
配当利回り	4.62	4.66
組入銘柄数	463	463

国別構成比率(%)	ファンド	ベンチマーク
オーストリア	0.44	0.41
ベルギー	1.54	1.52
デンマーク	1.59	1.58
フィンランド	1.41	1.41
フランス	14.27	14.34
ドイツ	12.23	12.23
ギリシャ	0.26	0.23
アイルランド	0.39	0.40
イタリア	3.69	3.68
オランダ	3.77	3.83
ノルウェー	1.39	1.40
ポルトガル	0.42	0.40
スペイン	5.58	5.51
スウェーデン	4.51	4.51
スイス	13.47	13.52
イギリス	34.99	35.02
アメリカ	0.06	-
	100.00	100.00

業種別構成比率(%)	ファンド	インデックス
一般消費財・サービス	8.06	8.04
生活必需品	14.09	14.11
エネルギー	11.37	11.42
金融	18.99	18.91
ヘルスケア	11.90	11.90
資本財・サービス	10.33	10.32
情報技術	3.15	3.15
素材	9.24	9.28
電気通信サービス	7.44	7.44
公益事業	5.42	5.42
合計	100.00	100.00

組入上位銘柄(%)	国名	インデックス
Nestle	スイス	3.24
HSBC Holdings	イギリス	2.34
Vodafone Group	イギリス	2.25
Novartis	スイス	2.20
BP	イギリス	1.94
Roche Holdings	スイス	1.92
Royal Dutch Shell	イギリス	1.90
GlaxoSmithKline	イギリス	1.81
Total	フランス	1.60
Brit Amer Tobacco	イギリス	1.43

### ご留意事項

当資料は、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社によって作成された SPDR MSCI ヨーロッパ ETF (以下当 ETF) のご参考資料です。国内の金融商品取引所に上場していない当 ETF は、金融商品取引法に基づいた発行者開示は行なわれておりません。当資料記載の内容は、将来の運用成果等を保証又は示唆するものではありません。当 ETF は主に株式等の有価証券に投資を行います。当 ETF への投資には、市場リスク、為替リスク、金利リスク、信用リスク、カントリーリスク、流動性リスク等が伴います。これらのリスク要因により当 ETF の価格が変動し、その結果、投資元本を損なう可能性があります。なお、ETF の投資にかかるリスクは上記に限定されるものではありません。ETF を売買する際は、取扱いの金融商品取引業者(証券会社等)の定める売買手数料がかかります。当 ETF の信託にかかる費用は年率 0.30%程度であり、その他 ETF を保有する際には、それぞれ個別に定められた費用がかかります。これらの費用には、運用会社・管理会社に支払う報酬、組入れ有価証券の売買の際に発生する手数料、監査費用等があります。これらは、運用の状況等によって変動するため、上限を示すことができません。当資料記載の情報は作成時点のものであり、市場の環境その他の状況等により予告なく変更されることがあります。

“SPDR®”は、Standard & Poor’s Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標であり、ステート・ストリート・コーポレーションがその使用許諾を得ています。“Standard & Poor’s®”、“S&P®”、“SPDR®”および“S&P 500®”は、S&P の登録商標であり、ステート・ストリート・コーポレーションがその使用許諾を得ています。S&P またはその関係会社は、ステート・ストリート・コーポレーションまたはその関係会社が提供するいかなる金融商品のスポンサーではなく、これらの商品の内容に関する保証・販売・宣伝もしていません。また S&P は、これらの商品への投資の適否に関して、いかなる意見表明もしていません。

MSCI Europe<sup>SM</sup> インデックスは、Morgan Stanley Capital International Inc.（以下「MSCI」）とその関係会社のサービス・マークであり、ステート・ストリート・バンク SA が特定の目的での使用許諾を得ています。SPDR®MSCI Europe<sup>SM</sup> ETF は MSCI Europe インデックスに基づいており、当 ETF の合法性や適合性について MSCI は何ら判断を下していません。また、MSCI によって発行・後援・裏書・販売・宣伝されていません。MSCI は ETF に関していかなる保証も責任も負いません。また当 ETF の資産運用や販売にしていかなる責任も負いませんし、管理運営に携わることもありません。

本資料は英文ファクトシートの参考和訳です。本文と原文の内容に相違がある場合は、原文が優先します。

**※取得のお申し込みに当たっては、当ファンドを取扱いの金融商品取引業者（証券会社）にお問い合わせ下さい。**

## **ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社**

東京都港区赤坂 9-7-1 ミッドタウン・タワー39階 Tel: 03-4530-7152

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第 345 号 加入協会: 日本証券投資顧問業協会、投資信託協会、日本証券業協会