

バークレイズ・ハイ・イールド・ベリー・リキッド指数 (Barclays High Yield Very Liquid Index, VLI) の 指数算出方法の一部改良につきまして

先日バークレイズ社は、SPDRバークレイズ・ハイ・イールド債券ETFのベンチマークである「バークレイズ・ハイ・イールド・ベリー・リキッド指数(Barclays High Yield Very Liquid Index, Indexティッカー:LHVLTRUU)」の指数算出方法について改良を行うことを発表しました。これは近年流動性を増すハイ・イールド債券市場の状況をより精密に反映させることを目的に行われるものとなります。

今回の変更により当指数に含まれる債券の条件は以下の通りとなります。

- 1発行体あたりの組入れ銘柄数を発行金額が最大の1銘柄から3銘柄に増加
- 銘柄組入れに必要な経過期間を発行後3年から発行後5年へ延長
- 最低発行金額を600百万米ドルから500百万米ドルへ減額
- 1発行体あたりの組入れ上限を2%に設定

今回の算出方法改良により、当指数がより分散の効いた指数となることが予想される一方、指数特性(デュレーション、利回り等)の大幅な変更につながることは予想されておられません。

SPDRバークレイズ・ハイ・イールド債券ETFの運用方針には変更ございません。引き続き当指数に密接に連動する投資成果を挙げることを目的とします。

より詳細な情報をお求めの場合は、バークレイズ社のウェブサイト
<https://ecommerce.barcap.com/indices/index.dxml>にて関連情報をご確認下さい。

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:一般社団法人 日本投資顧問業協会、一般社団法人 投資信託協会、日本証券業協会

本資料は、情報提供を目的として作成したものであり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。

本資料は、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズが作成したものをステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社が和訳したものです。内容については原文が優先されることをご了承ください。本資料は各種の信頼できると考えられる情報・データに基づき作成しておりますが、弊社はその正確性・完全性を保証するものではありません。こうした情報は不完全であるか、要約されている場合があります。本資料内の意見は全て当社の判断で構成されており、事前に通知することなく変更される可能性があります。

<投資にかかるリスクについて>

ETFは、主に株式や債券などの有価証券、また金などのコモディティ等に投資を行います。投資対象としている株式等の値動きにより、当ファンドの基準価額が下落することがあります。有価証券への投資には、価格変動リスク、カントリーリスク、信用リスク、為替リスク等、様々なリスクがあり、ETFも同様のリスクが伴います。これらのリスク要因により、投資資産の市場価格が下落する場合があります。その為、投資元本を割り込む恐れがあります。ETFには上場廃止リスクがあり、純資産規模が縮小するなど、運用が困難になった場合や、上場取引所の上場基準に合致しなくなった場合、上場廃止となる場合があります。これらは主なリスクであり、ETFへの投資に係るリスクはこれらに限定されるものではありません。

<ETFの投資にかかる一般的な留意事項>

- ① 元本保証はされていません。
- ② ETFの一口あたりの純資産額と連動を目指す特定の株価指数等が乖離する可能性があります。
- ③ 市場価格とETFの一口あたりの純資産額が乖離する可能性があります。

<ETFにかかる手数料・費用について>

ETFを売買する際は、取扱いの金融商品取引業者の定める売買手数料がかかります。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。当掲載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。また、"Standard & Poor's"、"S&P"、"SPDR"および"S&P500"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。

その他のインデックス、登録商標に関しては、各会社及びその関係会社に帰属し、ステート・ストリートが特定の目的で使用許諾を得ています。本資料のETFの合法性や適合性について、インデックスあるいは登録商標の帰属する各会社及びその関係会社は、何ら判断を下していません。また、発行・後援・裏書・販売・宣伝されていません。インデックスあるいは登録商標の帰属する各会社及びその関係会社は、ETFに関していかなる保証も責任も負いません。また、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。

- ※取得のお申し込みには、必ず上場有価証券等書面又はその他の開示書類の内容をご確認の上、ご自身でご判断下さい。
- ※購入のお申込や売買手数料等につきましては、取扱いの金融商品取引業者(証券会社)までお問い合わせ下さい。

© 2012年ステート・ストリート・コーポレーション - 無断複写・転載を禁じます。