

報道各位

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

**日本初のアクティブ運用型 ETF が登場
SPDR ブランドへ新たに 3 銘柄を追加**

【東京発、8月2日】米ステート・ストリート・コーポレーション(NYSE:「STT」)の資産運用部門であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社(本社 東京都港区、代表取締役社長 山本幸次)は、ステート・ストリートグループの展開するETF(上場投資信託)ブランド「SPDR® ETF」の3銘柄につきまして、新たに金融庁への届け出を行いましたのでお知らせいたします。今回届け出を行った3銘柄は、日本初のアクティブ運用型ETFとなります。

今回届け出を行った3本のSPDR ETFは以下の通りです。

SPDR® SSgA マルチ・アセット・リアルリターン ETF (銘柄コード:RLY)

主な投資対象はインフレ連動証券、不動産、コモディティ、資源関連株式などに関する実物資産を中心としたETFです。年間経費率は0.70%です。

SPDR® SSgA インカム・アロケーション ETF (銘柄コード:INKM)

主な投資対象は米国および海外株式、投資適格およびハイイールド債券、ハイブリッド株式/債券(優先株式、転換社債)、不動産などに関する高利回り金融商品を中心としたETFです。年間経費率は0.70%です。

SPDR® SSgA グローバル・アロケーション ETF (銘柄コード:GAL)

主な投資対象は米国および海外株式、不動産、債券、キャッシュなどに関するグローバル主要資産を中心としたETFです。年間経費率は0.35%です。

3本のETFともに米国上場で、投資対象にETFを活用したファンド・オブ・ファンズ形式での運用となります。

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の代表取締役社長である山本幸次は、「今回のアクティブ運用型ETFは、世界の機関投資家の皆様への資産運用サービスを通じて、SSgAが長年にわたり培ってきたグローバル・タクティカル・アセット・アロケーション(戦術的資産配分)に関する豊富なノウハウと、SSgAのETFブランドであるSPDR ETFの融合により、新しく誕生したETFです。今回の届け出により、日本の投資家の皆様へより広範なSPDR ETFのラインアップを提供できることを、大変嬉しく思います」と述べています。

今回届け出を行った3銘柄のアクティブ運用型ETFは、市場の一時的なミスプライシングから生じる非効率性を捕捉することを目的として組成されました。アクティブ運用型SPDR®ETFは、市場のファンダメンタルズ分析に加え、厳しくリスク管理された定量的プロセスによるタクティカル・アセット・アロケーション(戦術的資産配分)戦略に沿って構築されているのが特徴です。

今回届け出を行ったETF3銘柄の運用を担当するステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ(SSgA)のインベストメント・ソリューション・グループ(ISG)は、1,600億米ドルを超える戦略的かつ戦術的な資産配分ポートフォリオの投資運用に特化した専門チームです。ポートフォリオの運用にあたっては、市場の洞察とモデル運用の経験に基づく定量分析を重ね、リスク環境とマルチファクター定量モデルを把握するダイナミックなアプローチを採用します。

SSgA ISGのマネージングディレクターでCIO(運用責任者)であるダン・ファーレーは「アクティブ運用型SPDR®ETFは、『市場の新たな機会を捉えることで投資価値を高める』という長い経験に基づく戦術的な資産配分プロセスを通じ、幅広く分散したグローバルポートフォリオを広範なアセットクラスで運用するのが特徴です。今日のように利回りが低水準にあり、変動が激しい市場環境下において、アクティブ運用型SPDR®ETFを通じて、投資家に新たな投資機会を提供できるものと期待しています」と述べています。

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の証券営業本部長であるリチャード・クレアモンは、「今回の届け出により、日本国内で投資可能な弊社グループETFは20銘柄となりました。国内においてもETFに対する市場からの注目度が高まる中で、今後とも日本の投資家の皆様にとって、分散されたポートフォリオの構築や運用がより身近になる革新的なツールを提供して参りたいと考えております。」と述べています。

ステート・ストリートは世界中で3,000億米ドル以上のSPDRETFを運用しており(2012年6月30日現在)、世界の大手ETFプロバイダーの一つです。各ETFの詳細につきましてはSPDR®ETFのホームページwww.spdrs.jpをご覧ください。

SPDR®ETFについて

SPDRETFは、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ(SSgA)が提供するETF(上場投資信託)シリーズで、投資家の皆様の投資戦略に適切で柔軟な選択肢を提供します。ETFのパイオニアであるSSgAは、アメリカン証券取引所と提携し、1993年に世界初のETFとなるSPDR S&P 500®を設定した実績を持ちます。現在、SSgAは全世界で約3,000億ドル*1のETF資産を運用しています。

*1 2012年6月30日現在。運用資産には、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズの関連会社であるステート・ストリート・グローバル・マーケッツ・エル・エル・シーが販売代理店を務めるSPDRゴールド・トラスト(2012年6月30日現在で約657億米ドル)の資産が含まれています。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ(SSgA)について

SSgAは、世界をリードする大手資産運用会社として、規律のとれた投資プロセス、強力なグローバル投資プラットフォーム、あらゆる主要資産クラス、投下資本レンジ、投資スタイルへのアクセスを求める世界中の

洗練された投資家によって信頼されています。ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズは、機関投資家を対象とする世界有数の金融サービス機関であるステート・ストリートの資産運用部門です。詳細についてはwww.ssga.comをご参照ください。

“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®”、“S&P 500®”、“Select Sector SPDR”、“S&P MIDCAP 400”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。

FINRA(金融取引業規制機構)、SIPC(証券投資者保護公社)の会員であるステート・ストリート・グローバル・マーケッツ LLC は SPDR 全商品の販売会社で、ステート・ストリート・コーポレーションの完全出資子会社です。ステート・ストリートに関する記述には、ステート・ストリート・コーポレーションおよびその関係会社が含まれる場合があります。ステート・ストリートの関係会社は、SPDR ETF に関するサービス提供をすると同時に、信託報酬等を受け取ります。

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。ETF は主に株式や債券、REIT 等の有価証券、金などのコモディティ等、上場投資信託(ETF)、コモディティ上場投資信託、上場投資証券等に投資を行います。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、トラッキングエラー等が伴います。これらのリスク要因により 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。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、組入れ有価証券等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 SSgA アクティブ・アセット・アロケーション ETF は、ファンド・オブ・ファンド方式によって運用されています。SPDR SSgA アクティブ・アセット・アロケーション ETF はアクティブ運用されているため、SSgA が選択した投資によっては、そのベンチマークまたは同様の投資目的を有するその他のファンドと比較して ETF のパフォーマンスが下回る可能性があるというリスクがあります。アクティブ運用されている ETF は、特定の指数のパフォーマンスの再現は追求しません。

この件に関するお問い合わせ先：
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ 広報担当(IFC)
神谷・中嶋 03-5532-8921