

【ご案内】 ファンド併合について/ FTSE世界国債インデックスの構成国変更について

■ ファンド併合について

年投(外)E07(MSCI EM連動型/レンディング無)については、ファンド運用残高の減少により、「年投(外)E06(MSCI EM連動型/レンディング有)」を存続ファンドとしてファンド併合することと致しました。

併合対象ファンド		
ファンド名称		運用残高
閉鎖ファンド (被併合)	年投(外)E07(MSCI EM連動型/レンディング無)	約2億円
存続ファンド (併合)	年投(外)E06(MSCI EM連動型/レンディング有)	約620億円

※運用残高:2019年9月末時点

※被併合ファンドE07で保有する資産は、適正時価でE06に移管します。

【実施時期】

ファンド併合の実施につきましては、2019年11月22日を予定しています。

■ FTSE世界国債インデックスの構成国変更について

FTSE Russell社は、2020年3月末よりFTSE世界国債インデックスにイスラエルを追加することを発表しました。

FTSE Russell社では、「市場アクセシビリティ」、「市場規模」、「信用格付け」の3つの基準に基づき、毎年9月にインデックス構成国の見直しを決定しています。イスラエルは、「市場規模」「信用格付け」基準に加えて、2019年3月より「市場アクセシビリティ」基準を満たしており、全ての基準を継続的に満たしていることから新たに追加されることとなりました。

【組入れ比率】

FTSE世界国債(除く日本)インデックスへの組入れ比率は、約0.36%となる予定です。(2019年8月末時点に基づく弊社概算)

【組入れ時期】

2020年3月末(予定)

<ご参考>

●採用基準

以下の3つの採用条件を満たす場合

- ①市場アクセシビリティレベルが最上位の2であること
- ②市場の額面総額合計が500億米ドル、400億ユーロ、5兆円を上回ること
- ③発行体の自国通貨建て長期債務の格付けが、S&P社とムーディーズ社の双方でA-/A3以上であること(但し③については、9月の年次レビュー時と変更適用時の両時点で条件を満たす必要あり)

●市場アクセシビリティレベル

市場アクセシビリティレベルは、「市場、マクロ経済、規制環境」「外国為替市場の構造」「債券市場の構造」「グローバル決済およびカस्टディ」の4つの側面で判定し、「2、1、0」の3段階で評価。