

For immediate release

Contact:

広報部 成松 恭多
+81 3 4530 5623

バークレイズ、 債券ベンチマーク・インデックスの組入れルールを変更

**ロシア・ルーブルとトルコ・リラ建て債券をグローバル総合インデックスに追加
米国エージェンシーCMBSを米国総合インデックスに追加**

【2013年11月5日、ニューヨーク（和文配信11月6日）】バークレイズは、広く使われる債券ベンチマーク・インデックスについて10月に実施した年次の定期的なインデックス見直し作業と運営管理プロセスを受け、本日、インデックス組入れルール見直しを発表しました。今回の見直しに伴い2014年からいくつかの組入れルールが変更される一方、その他既存ルールは従来通りとすることが再確認されました。

こうした変更は、変貌しつつある債券市場の現状を注意深く考察するとともに、バークレイズ・インデックスをポートフォリオのベンチマークや、広範な債券市場のリターン計測の手段としてご利用いただく世界中の投資家の皆様のご意見を考慮した上で決定されたものです。

実施されるインデックス組入れルール変更と適用日は以下の通りです。

グローバル総合インデックス

- ロシア・ルーブル(RUM)とトルコ・リラ(TRY)建ての自国通貨建て国債は、2014年3月31日より、グローバル総合インデックス適格となります。これら通貨はグローバル総合インデックスでは23番目および24番目の適格通貨となります。また自国通貨建て新興市場政府債インデックスとグローバル総合インデックスの両方に含まれる通貨としては、10番目と11番目となります。なおロシア・ルーブル建ての国債については、2008年以降に発行された、期限一括償還のOFZ債のみがグローバル総合インデックス適格となります。
- ハンガリー・フォリント(HUF)については、投資適格のインデックス適格銘柄が存在しないため、グローバル総合インデックスの適格通貨から除外されます。この変更は即座に実施されます。現在、HUF建てのグローバル総合インデックス適格債券が存在しないため、インデックスへの影響はありません。今後ハンガリーのソブリン格付けが投資適格に変更された場合、年次の運営管理プロセスによりグローバル総合インデックスへの再組み入れが議論されます。ハンガリーは引き続きバークレイズの自国通貨建て新興市場政府債インデックスに含まれます。

米国総合インデックス

- 米国政府機関によって発行される商業用不動産担保証券(CMBS)については、2014年6月30日から、米国総合インデックスとグローバル総合インデックス適格となります。またバークレイズでは、両インデックスに組入れられる前の2014年の早い段階で、単独の米国エージェンシーCMBSインデックスを算出開始する予定です。
- 米国のRule 144Aに基づいて発行され、かつ登録権を持たない債券は、引き続き米国総合インデックスには含まれませんが、このような債券を含むベンチマークを必要とする投資家向けに、新たに米国総合+144Aインデックスが、2014年中に算出開始されます。144A債券は、従来グローバル総合インデックス、米国ユニバーサル・インデックス、米ドル建て新興市場総合インデックス、米国ハイ・イールド・インデックスには含まれています。

米国MBSインデックス

- 米国MBSインデックス構成銘柄の最低残高基準は、2014年3月31日より、現行の2.5億ドルから10億ドルに引き上げられます。
- 今回の年次運営管理プロセス、および2013年に実施された米国MBSインデックスのレビュー・プロセスの結果をふまえ、米国MBS固定利付インデックスの構成方法は変更しないこととします。これらプロセスでは、インデックスの構成要素をさらに細かく分解する代替案が議論されましたが、今回は変更が見送られます。現在の構成方法は、各MBSプールを、エージェンシー、プログラム、クーポン、ヴィンテージによってグループ化したものをインデックス構成銘柄としています。
- 一方、運営管理プロセスの際に得られたご意見をふまえ、バークレイズ・インデックス・グループでは、固定利付MBSについての価格決定手法を見直し、現在の構成方法を変えずに、MBSプールの個別性をより良く反映する方法を検討いたします。

新興市場インデックス

- 年次レビューの結果、バークレイズの新興国リストに変更は加えられないことになりました。
- エジプトとクロアチアについては、流動性および投資可能性に懸念があるため2014年3月31日より主要な自国通貨建て新興市場政府債インデックスから除外されます。一方両国は、上記インデックスよりも広い市場を含む、自国通貨建て新興市場政府債ユニバーサル・インデックスには引き続き含まれます。
- 2009年より前に発行された、元本分割償還のあるロシア国債(OFZ債)については、流動性および投資可能性に懸念があるため、2014年3月31日より各種自国通貨建て新興市場政府債インデックスから除外されます。
- 外貨建て新興市場総合インデックスに含まれる、英ポンド建て債券の最低残高基準は、2014年3月31日より、現在の3.5億ポンドから5億ポンドに引き上げられます。

マルチバース・インデックス

- バークレイズのマルチバース・インデックスは、広範な固定利付かつ多通貨の債券市場をカバーするもので、現在はグローバル総合インデックスとグローバル・ハイ・イールド・インデックスを含みます。これらに加え、2014年3月31日より、ユーロ・ハイイールド国債インデックスと、自国通貨建て新興市場政府債インデックスの構成銘柄も、マルチバース・インデックスに含まれます。

ハイ・イールド・インデックス

- 汎欧州ハイ・イールド・インデックスの対象通貨について、2014年3月31日より、通貨別の最低残高基準が導入されます。ユーロ建てハイ・イールド債券の最低残高基準は現行の1億ユーロから変わりませんが、他の通貨の基準は、各市場でのハイ・イールド債の通常の発行サイズに基づいて変更されます。

バークレイズのセクター分類方法変更

バークレイズのセクター分類に関して、2014年6月30日よりいくつかの変更がなされます。具体的には、産業セクターに含まれるエネルギー・セクターの下にミッドストリーム・セクターを新設すること、REITセクターのサブセクターを細分化すること、およびいくつかのセクターについて、より実態に即するように名称変更することなどが含まれます。

本稿は、バークレイズ・グループの英文リリースの日本語訳です。その正確な内容につきましては、原文である英文リリースをご参照ください。本稿と原文において齟齬がある場合には原文が優先します。リリース原文は <http://www.barclays.co.jp/> の「News」欄にてご覧いただけます。

バークレイズについて

バークレイズは世界で事業を展開し、お客様に貸付、投資、資産保護のサービスを提供しています。バンキング事業では300年以上の歴史と卓越した専門性を有しており、世界50カ国以上で展開し、約140,000人の従業員を擁しています。

バークレイズは世界の大手事業法人、政府、金融機関のお客様にニーズに応じた戦略的アドバイス、資金調達およびリスク管理に関するフルレンジのサービスを提供しています。お客様にはバークレイズ・グループ全体に幅広くわたる、金融に関する専門性をお届けしています。また、世界最大規模の金融サービス機関として、リテール・バンキング、クレジットカード、コーポレート・バンキング、ウェルスおよびインベストメント・マネジメントの事業も展開しています。バークレイズ・グループは、バークレイズ・バンク・ピーエルシーを通じ、世界トップクラスの投資銀行サービスと金融商品をお客様に提供しています。