

【ご案内】シティ債券インデックスの名称変更について

／外国株式E45の集中投資規制10%ルール抵触の件について

■シティ債券インデックスの名称変更について

シティグループの債券分析、並びにインデックス事業が、ロンドン証券取引所グループへ売却されたことに伴い、シティグループが提供しておりましたインデックス名称における「シティ」が「FTSE」へ変更されることとなりました。
なお、各インデックスの連続性は維持されます。
(同インデックスは、ロンドン証券取引所グループ傘下のFTSE Fixed Income LLCが運営します。)

【主なインデックスの変更内容】

変更前	変更後
シティ世界国債インデックス(WGBI)	FTSE世界国債インデックス(WGBI)

※略称(WGBI)の変更はありません。

【当社対応方針】

順次、シティ債券インデックス名称の表記を、「FTSE」へ変更する予定です。

■外国株式E45の集中投資規制10%ルール抵触の件について

【事態】

外国株式E45(アジア・アクティブ型)は、約款にてファンドに対する同一銘柄の保有割合を原則10%以内に収める旨定めておりますが、11月7日及び11月20日にテンセント・ホールディングス(中国・情報技術)について、株価の上昇によりファンドに占める割合が10%を超える事態が発生しました。

【テンセント・ホールディングスのウェイト推移】

日付	ファンドウェイト	ベンチマークウェイト
11/7	10.01%	6.20%
11/20	10.10%	6.64%

※ファンドウェイトの上限は原則10%

【経緯】

テンセント・ホールディングスにつきましては、MSCI AC Asia ex Japan Index対比でアクティブ・ウェイト3%程度を目安に運用を行ってまいりました。今般、情報技術セクターが高成長期待や好決算を背景に大きく上昇する中、テンセント・ホールディングスもモバイルゲームやオンライン広告分野への成長期待を背景に株価が急伸し、ベンチマークに対するウェイトが上昇。ファンドに占める割合が10%を超える事態となったものです。

【対応】

11月7日に発生したルール抵触につきましては、11月8日に株価が下落したため、解消しました。

11月20日に発生したルール抵触につきましては、11月21日にウェイト引下げのため売却オペレーションを行い、解消しました。

今後においても、10%を超えないように運用を実施致しますが、株価の急激な上昇などによりファンドにおける構成比が高まった場合には、速やかに10%以内に収めるような運営を継続してまいります。