

クレディ・スイス・グループ AG および UBS グループ AG に対する米国籍上場投資信託 (ETF) のエクスポージャーについて (2023 年 3 月 17 日現在、日本の金融庁に届出されている銘柄のみを対象として抽出)

2023 年 3 月 19 日 (日)、UBS グループ AG (以下「UBS」) がクレディ・スイス・グループ AG (以下「クレディ・スイス」) を買収することで合意したと、報じられました。

以下の表は、**2023 年 3 月 17 日**現在でステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズが確認した、本表記載のプールド・ファンド (合同運用投資ファンド) が直接保有する UBS および/またはクレディ・スイスが発行する株式および/または債務証券について、各ファンドにおける保有比率を示したものです。(注: 本表に記載されている ETF は、日本の金融庁に届出されている銘柄のみを対象として抽出したものです。これら以外にも、UBS および/またはクレディ・スイスに対するエクスポージャーを保有する SPDR ETF が存在することにご留意ください。) カウンターパーティーとしてのエクスポージャーおよびデリバティブによるエクスポージャーは、これらの保有比率には含まれません。ファンドが他のファンドに投資する場合、「他のファンド」がクレディ・スイスまたは UBS が発行する証券を保有する可能性があります。そのようなエクスポージャーはステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズが運用・管理するファンドが直接保有するものではありません。現在の保有状況につきましては、該当するウェブサイトで、個々のファンドに係る保有状況の開示をご参照ください。本表におけるポートフォリオ・エクスポージャーは、表示されている日付時点で、第三者である価格提供ベンダーから提供された市場価格データを用いて算出されています。本表のデータは監査を受けておらず、ベスト・エフォート・ベースで作成されたもので、ファンドの公式な帳簿や記録を表すものではなく、変更される可能性があります。ファンドの評価方針に関する追加情報につきましては、各ファンドの目論見書等をご参照ください。ファンドの保有資産のさらなる詳細については、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズのウェブサイト (ssga.com) をご参照ください。

2023 年 3 月 17 日の営業終了時点で、以下の SPDR ETF のいずれも、クレディ・スイスまたは UBS が発行する Additional Tier 1 債券 (AT1 債; その他ティア 1 債) を直接保有していません。SPDR ファンドが第三者 (ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ以外) が運用するプールド・ファンドに投資する場合、第三者が運用するファンドがクレディ・スイスまたは UBS が発行する AT1 債を保有する可能性があります。そのようなエクスポージャーは SPDR ETF が直接保有するものではありません。

表：該当する有価証券がポートフォリオに占めるウェイト（％）

| ETF 銘柄名 | ISIN | ティッカー | 合計 | UBS グループ AG | クレディ・スイス・グループ AG |
|-----------------------------------|--------------|-------|-------|----------------|---------------------|
| 債券 | | | | | |
| SPDR® ダブルライン・トータル・リターン・タクティカル ETF | US78467V8485 | TOTL | 1.15% | 0.06% | 1.09% |
| SPDR® ポートフォリオ米国短期社債 ETF | US78464A4748 | SPSB | 0.89% | 0.00% | 0.89% |
| SPDR® ポートフォリオ米国中期社債 ETF | US78464A3757 | SPIB | 0.49% | 0.00% | 0.49% |
| SPDR® ポートフォリオ米国総合債券 ETF | US78464A6495 | SPAB | 0.10% | 0.03% | 0.07% |
| SPDR® ポートフォリオ米国長期社債 ETF | US78464A3674 | SPLB | 0.07% | 0.00% | 0.07% |
| 株式 | | | | | |
| SPDR® MSCI 全世界株式（除く米国）ETF | US78463X8487 | CWI | 0.40% | 0.37% | 0.03% |
| SPDR® ポートフォリオ先進国株式（除く米国）ETF | US78463X8891 | SPDW | 0.33% | 0.31% | 0.02% |

出所：ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ（2023年3月17日時点）

注：上表に記載されているETFは、日本の金融庁に届出されている銘柄のみを対象として抽出したものです。

ご留意事項

本資料は、情報提供を目的として作成したものであり、金融商品取引法およびその他の日本の法律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・アドバイザーズ株式会社を含むそのグループ会社が提供する外国籍ETF等に関する情報を含む投資情報の提供を目的として、グループ会社により作成された資料を元に作成しており、投資の勧誘等を目的とするものではありません。本資料には、日本国内での募集の取扱い等に係る金融庁への届出等がされていない外国籍ETFに関する情報も含まれています。国内の金融商品取引所に上場していないETFについて、金融商品取引法に基づいた発行者開示は行われていません。

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、当社はその正確性・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。また、本資料に記載している各種情報・データは、特に記載のない限り作成時点のものであり、これらは市場動向やその他の状況等によって随時変動し、あるいは変更されることがあります。

本資料に記載している各種シミュレーション・データは、過去のデータに基づき当社モデルを利用したバックテスト結果であり、将来の運用収益を保証するものではありません。実際の運用収益はバックテスト結果から大きく異なる可能性があります。過去の実績は将来の成果を保証するものではありません。本資料内の意見は全て当社あるいはグループ会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。なお、本資料中のステート・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、本資料のETFに関するサービスを提供すると同時に、信託報酬ないしその他の報酬等を受け取ります。

<登録商標等について>

“Standard & Poor’s®”、“S&P®”、“SPDR®”は、Standard & Poor’s Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標です。“Dow Jones”は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（以下「ダウ・ジョーンズ」）の登録商標です。これらの登録商標は、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が使用許諾を得ており、ステート・ストリート・コーポレーションは特定の目的の使用について再許諾を受けています。SPDJI、ダウ・ジョーンズ、S&P、それぞれの関連会社及び第三者の使用許諾者は、ステート・ストリートが提供する金融商品のスポンサーではなく、これらの商品の推奨・販売・宣伝もしていません。また、SPDJI、ダウ・ジョーンズ、S&P、それぞれの関連会社及び第三者の使用許諾者は、これらの商品への投資の適否に関してもいかなる意見表明もせず、関連する指数に係るいかなる過誤、遺漏ないし中断等に対しても責任を一切負いません。

その他のインデックス、登録商標ないしサービスマークに関しては、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等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・宣伝もしていません。インデックスあるいは登録商標等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関していかなる責任も負わず、管理運営に携わることもありません。

<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、あるいはその他の資産に投資を行います。投資対象としているこれらの資産の値動きにより、ETFの基準価額が下落することがあります。これらの資産への投資には、市場リスク、金利リスク、カントリーリスク、信用リスク、為替リスク、流動性リ

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、ETF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は流通市場において株式と同様に取引されますが、取引価格は変動し、基準価額を下回ることがあります。また、常に取引可能であるとは限らず、市場環境が悪化している場合は、取引価格が大幅なディスカウントとなる可能性があります。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、上場廃止となることがあります。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。

なお、コモディティETFやコモディティ指数連動証券は、市場全体動向の変化、金利の変化、および対象資産となるコモディティへの投機や裁定に係る取引活動に加え、天候や病気、通商条件あるいは政治や規制の展開の様な他の要因によって影響を受ける可能性があります。

<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の動きと連動を目指す特定の指数等の動き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。

<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、組入れ資産の売買の際に発生する手数料、ライセンス・フィー、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、事前に上限額を示すことができません。本資料の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将来予告なく変更されることがあります。

※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。

※購入のお申し込みや売買手数料等につきましては、当ETFを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。

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

東京都港区虎ノ門1-23-1 虎ノ門ヒルズ森タワー25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

©2023 State Street Corporation. All Rights Reserved.

Expiration Date: 3/31/2024

5531766.1.1.APAC.RTL