

# 公募投資信託の保有資産にかかる流動性リスクの 階層分類について

2022年1月1日

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

投資信託協会の定める「投資信託等の運用に関する規則」に基づき、公募投資信託の流動性リスク管理に用いる流動性リスクの階層分類について開示いたします。

当社が設定する公募投資信託（当社が設定する公募投資信託が投資するマザーファンドを含む）の個々の保有資産について、流動性の程度に応じて以下の階層に分類しております。

**高流動性資産：** 現金、または市場における対象資産の価格に顕著な影響を与えることなく現在の市場環境で3営業日以内に現金化できることが期待される投資資産

**中流動性資産：** 市場における対象資産の価格に顕著な影響を与えることなく現在の市場環境で4暦日以上7暦日以内に現金化できることが期待される投資資産

**低流動性資産：** 市場における対象資産の価格に顕著な影響を与えることなく現在の市場環境で7暦日以内に売却・処分できることが期待されるが、決済には8暦日以上かかると考えられる投資資産

**非流動性資産：** 市場における対象資産の価格に顕著な影響を与えることなく現在の市場環境で7暦日以内に売却・処分することができないと考えられる投資資産

以上

**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**

金融商品取引業者登録番号関東財務局長（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

[ssga.com/jp](http://ssga.com/jp)

著作権 © 2023 State Street Corporation. All Rights Reserved. 不許複製

Tracking Number: 4298848. 2.1.APAC.RTL

Exp. Date: 2025/4/30