

SPDR®ブルームバーグ 新興国債券（現地通貨 建て）ETF

主な特徴

- ブルームバーグEMローカル・カレンシー・ガバメント・ダイバーシファイド指数の値動きに、経費控除前ベースで概ね連動する投資成果を追求します。
- 新興国の固定金利の現地通貨建てソブリン債へ投資を行います。
- 格付けが投資適格か否かに関わらず、新興国が米国外において現地通貨建てで発行した国債であり、かつ残存期間が1年以上の債券が指数に採用されます。
- 指数は毎月最終営業日にリバランスされます。

ベンチマークについて

ブルームバーグEMローカル・カレンシー・ガバメント・ダイバーシファイド指数は、新興国の現地通貨建て固定利付ソブリン債券のパフォーマンスを計測する指数です。同指数は、残存期間が1年以上かつ、ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インク、S&Pグローバル・レーティングス、フィッチ・レーティングス・インクによる格付けの中間値がB3/B-/B-以上の米国外で発行された現地通貨建て国債で構成されます。

ファンド情報

当初設定日	2011年02月23日
CUSIP	78464A391

EBND

ファクトシート
債券

基準日2024年06月30日

トータル・リターン（基準日 2024年06月30日）

	基準価額 (%)	市場価格 (%)	インデックス (%)
累積リターン			
当四半期末	-1.30	-1.60	-1.19
年初来	-4.15	-4.21	-3.79
年率化リターン			
1年間	0.10	-0.67	0.51
3年間	-4.38	-4.50	-4.41
5年間	-2.06	-2.15	-1.85
10年間	-1.35	-1.37	-0.86

総経費率 (%)	0.30
30日SEC利回り (%)	6.00

運用実績は過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。運用実績は米ドル建てで算出されています。投資収益と元本価額は変動しますので、売却時に損失を被る場合もあります。現在の運用実績は上記の実績を下回っている場合もあります。指数の実績は実際の投資成果を示すものではありません。すべての結果は過去のものであり、配当とキャピタルゲインの再投資を想定しています。指数に直接投資することは出来ません。

運用期間が1年未満の実績は、年率換算されていません。パフォーマンスはネットに表示しています。

インデックスのリターンは運用によるものではなく、いかなる手数料または経費の控除も反映されていません。インデックスのリターンには、収入、利益および損失のすべての項目と、該当する配当金およびその他収入の再投資が反映されています。当ファンドの実績を計算するための市場価格として、当ファンドが上場されている証券取引所の、NAV算出時におけるビッド価格とオファー価格の仲値を使用します。取引時期の違いにより、投資成果は異なります。

2021年10月31日以前はSPDR®ブルームバーグ新興国債券（現地通貨建て）ETFはSPDR®ブルームバーグ・パークレイズ新興国債券（現地通貨建て）ETFとして知られていました。

2021年8月24日以前はブルームバーグEMローカル・カレンシー・ガバメント・ダイバーシファイド指数はブルームバーグ・パークレイズEMローカル・カレンシー・ガバメント・ダイバーシファイド指数として知られていました。

ファンド特性

平均最低利回り（YTW）	6.65%
組入銘柄数	608
オプション調整後デュレーション（OAD）	6.26
オプション調整後スプレッド（OAS）	4.6

格付け別構成	組入比率 (%)
Aaa	1.17
Aa	17.06
A	30.95
Baa	37.87
Baa以下	12.95

組入れ上位国	組入比率 (%)
韓国	13.01
中国	12.02
インドネシア	7.25
マレーシア	6.68
メキシコ	6.12
南アフリカ	4.82
フィリピン	4.62
タイ	4.60
ポーランド	4.57
チェコ共和国	4.55
ブラジル	4.52
イスラエル	4.25
ルーマニア	4.12
コロンビア	4.11
ハンガリー	3.77

合計値は必ずしも100になりません。

残存期間構成	組入比率 (%)
0-1年	2.11
1-2年	10.20
2-3年	12.83
3-5年	17.99
5-7年	11.93
7-10年	16.95
10-15年	10.00
15-20年	7.19
20-30年	9.11
30年以上	1.67

State Street Global Advisors
One Iron Street, Boston MA
02210
T: +1 866 787 2257

用語解説

基準価格 (NAV) : 資産から負債を差し引いた純資産総額を受益権総口数で除したものの
市場価格 : ニューヨーク証券取引所の取引終了時刻 (通常米国東部標準時の16時) におけるビッド価格とオファー価格の中間
総経費率 (GER) : ファンドの運営にかかる年間の経費率。手数料減免や経費還付前の数値であり、最新の目録見書に記載されている
30日SEC利回り : 直近30日間に獲得した利金・配当収入から費用を差し引いたネットのインカム収入を期間最終日のオファー価格の高値で除すことによる計算された利回りを年換算したもの
指数の平均最低利回り : 発行体が債務不履行とならないとの前提で、当該債券から得られる最低限の利回り。最低利回りは、発行体が期限前償還などの条項を行使した場合に得られるリターンのように、当該銘柄について最悪シナリオを仮定して計算される。ポートフォリオレベルの最低利回りの計算においては、各銘柄の最低利回りを時価総額で加重平均する。
オプション調整後デュレーション : 債券に内包されたオプション性を加味した金利感応度のこと。国債のイールドカーブが +/-100bpsシフトした場合の価格変化率の平均をとることで算出。社債においては期限前償還のオプション効果、モーゲージ債については期限前返済の変化を考慮している。
オプション調整後スプレッド : 当該債券と無リスク金利の利回り格差から、オプション価値に相当する利回りを差し引いて計算されるスプレッドのこと。
格付け別分類 : ブルームバーグでは、格付けの分類の際には、ムーディーズ、S&Pおよびフィッチによる中間格付けを参照している。格付けを付与している機関が2社の場合は、保守的な格付けを採用し、1社のみ場合は当該格付けを使用する。個別債券に対して格付けが付与されていない場合は、発行体格付けを参照して分類する。ブルームバーグ指数の格付けは、AAA+お

よびAAAをAaa、AA1からAA3までをAaとする大まかな分類となっている。

ご留意事項

組入れ比率は記載された時点のものであり、変更される可能性があるため、その後は最新情報として依拠すべきではありません。
投資には元本割れリスクを含むリスクが伴います。
本情報は投資の勧誘等を目的とするものではありません。また、証券の売買の勧誘を目的としたものではなく、投資家の特定の投資目的、戦略、税務上の地位または投資期間を考慮したものではありません。お客様はご自身の税務・財務アドバイザーにご相談ください。
当社の書面による明示的な同意なしに、本著作物の全部または一部を複製、複写もしくは送信し、または第三者に開示することはできません。
本情報は投資の推奨または助言を意図したものではありません。
当ファンドの投資は、経済情勢の変化、相場の変動、および証券市場への投資に内在するリスクに左右されます。投資市場は、経済成長または景気後退、金利の変動、発行体の実際または認識された信用力の変化および一般的な市場の流動性のみならず、様々な要因によって変動し、投資先の価格は大幅に変動する可能性があります。
当ファンドは、地政学的イベントにより証券市場が混乱し、世界経済およびグローバル市場に悪影響を及ぼすリスクにさらされています。戦争、テロ行為、感染症やその他の公衆衛生上の問題の蔓延、その他の地方、地域あるいは、世界規模の事象は、当ファンドおよびその投資に重大な影響を与える可能性があります。
お客様の口座でロシアの証券および関連金融商品を保有している場合、本文書の公表日現在、それらの証券等は公正に評価されています。そのフェアバリューはゼロである可能性があります。お客様のポートフォリオがそうしたロシアの証券および関連金融商品を保有している場合、関連市場、適用される制裁要件、および/またはロシアの資本規制またはその他対抗措置によっては、当該証券および商品の処分ができない可能性があります。そのような状況下では、ポートフォリオはロシア関連の発行体および市場に対するエクスポージャーを保有し続けることとなります。ポートフォリオの保有明細書をご参照ください。
外国為替の差損益やファンドにおける租税負担等により、ファンドの配当利

回りとその他の利回り指標は同じとならない場合があります。
外国 (非米国) 証券への投資には、政治、経済、環境、信用および情報に関してより高いリスクが伴います。外国 (非米国) 資産は、規制の変更や限定的な流動性等により、米国資産よりもボラティリティが高い傾向があります。上記リスクはエマージング市場においてはより顕著になります。
債券型ファンドには、金利リスク (金利上昇により債券価格は下落)、発行体の債務不履行のリスク、流動性リスクおよび物価上昇リスクが伴います。モーゲージ証券やアセット・バック証券へ投資するファンドには発行体の債務不履行のリスクやクレジットリスク、インフレリスクなども追加で含まれます。
非分散型ファンドは、相対的に少数の銘柄へ集中して投資を行うため、市場全体あるいは広範に分散されたファンドと比べ、価格変動が大きくなる傾向があります。
パッシブ運用ファンドは、インデックス・サンプリング法を用い、インデックスの主要リスク要因やその他の特性を反映する代表的な銘柄を保有します。そのためトッキングエラーが発生 (インデックスのパフォーマンスから乖離) する場合があります。
ETFの受益証券は流通市場での売買が可能ですが、あらゆる市場環境においても容易に取引できるとは限らず、また市場が混乱している局面においては大幅に安い価格での取引を余儀なくされる場合があります。
ETFは株式と同様に取引することができますが、一般的な価格変動のリスクに加え、ETFの純資産総額から乖離した価格で取引される可能性もあります。また、証券会社への売買手数料やETFの経費率は収益率を低下させる要因となります。
知的財産情報
"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および第三者の使用許諾者は、ステート・ストリート・コーポレーション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かなる意見表明もしておらず、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。
"Bloomberg®" およびブルームバーグ EMOーカル・カレンシー・ガバメント・ダイバーシファイド指数は、Bloomberg Finance L.P. および指数の管理者である Bloomberg Index Services Limited (以下「BISL」) を含むその関連会社 (以下、総称して「ブルームバーグ」) のサービスマークであり、State Street Global Advisors は特定の目的のためにその使用許諾を得ています。ブルームバーグは State Street Global Advisors の関連会社ではなく、またブルームバーグは SPDR®ブルームバーグ新興国債券 (現地通貨建て) ETFの承認・支援・審査・推奨を行っておりません。ブルームバーグは SPDR®ブルームバーグ新興国債券 (現地通貨建て) ETFに関するいかなるデータまたは情報の適時性・正確性・完全性についても保証するものではありません。
販売会社 State Street Global Advisors Funds Distributors, LLCは、金融取引業規制機構 (FINRA)、証券投資者保護公社 (SIPC) の会員であり、State Street Corporationの完全子会社です。State Streetの記載は、State Street Corporationおよびその関連会社を含む場合があります。State Streetの関連会社の一部は、SPDR ETFへの役員提供の対価として、報酬を受け取っています。
SSGA Funds Management は、State Street Global Advisors Limited をサブアドバイザーとして起用しています。
投資に際しては、ファンドの投資目的、リスク、手数料や経費について十分考慮する必要があります。これらの情報については記載された目録見書または要約目録見書を入力するには、ssga.comへアクセスしてください。目録見書または要約目録見書をよくご覧ください。

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令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（「当社」）が日本国内で取り扱う外国籍ETFに関する投資情報の提供を目的として、当社の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。内容については原文（元資料）が優先されることをご了承ください。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

るいは事前に通知することなく変更されることがあります。過去の実績は将来の成果を保証または示唆するものではありません。また、当ETFに関わる様々なリスクの詳細については、当ETFのプロスペクトス等、開示書類をご確認ください。

<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運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。
- ④ ETFには上場廃止リスクがあり、運用の継続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等に上場廃止となることがあります。

<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あたっては、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

© 2024年ステート・ストリート・コーポレーション - 無断複写・転載を禁じます。

Tracking Number: 5829126.1.1.APAC.RTL
Expiration Date: 10/31/2024