

# アジア国債・公債 ETF ※東証銘柄コード 1349

(正式名称: ABF 汎アジア債券インデックス・ファンド)

アジア国債・公債 ETF は、アジア 8 つの国と地域(中国・香港・インドネシア・韓国・マレーシア・フィリピン・シンガポール・タイ)の国債と公債に投資する ETF(上場投資信託)です。手数料および費用控除前でベンチマーク指数(iBoxx ABF 汎アジア指数)に連動する投資成果を上げることがを目標とします。投資家の皆様は 1 回の取引で、上記アジア 8 つの国・地域の国債・公債市場への費用効率の高い投資が、可能となります。※アジア国債・公債 ETF はインデックス運用のファンドです。

## 投資方針

当ファンドは、手数料および費用控除前でベンチマーク指数(iBoxx ABF 汎アジア指数)に連動する投資成果を上げることがを目標とします。中国、香港、インドネシア、韓国、マレーシア、フィリピン、シンガポール、タイの政府および準政府機関が発行する現地通貨建て国債および公債を主な投資対象とします。

## 運用方針

インデックス運用にて運用します。アジア国債・公債 ETF とベンチマーク(iBoxx ABF 汎アジア指数)とのトラッキングエラー(乖離の度合い)を最小限に抑えるため、随時、当ファンドの投資ポートフォリオを見直し、ベンチマーク構成銘柄の変更を反映させます。また、トラッキングエラーを最小限に抑えるため、ベンチマーク指数以外の証券にも投資する場合があります。

## ファンド属性 (2010 年 7 月末現在)

一口当り純資産額	117.71 米ドル
純資産総額	2,130,850,119 米ドル
組入銘柄数	357
基準通貨	日本円(東証)、米ドル(香港証取)
運用手法	インデックス運用
ベンチマーク	iBoxx ABF 汎アジア指数
上場日	2009 年 6 月 19 日 東京証券取引所上場 (2005 年 7 月 7 日香港証券取引所上場)
総経費率	純資産総額の 0.20%(年率)
収益分配方針	各分配期間の利息等収入及び売買益(評価益を含みます)から、諸経費などを控除後、年 2 回分配します(1 月および 7 月)。ただし、分配対象金額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。
運用会社	ステート・ストリート・グローバル アドバイザーズ・シンガポール・リミテッド
受託者	HSBC インスティテューショナル・トラスト・ サービスズ(シンガポール)・リミテッド
カストディー	HSBC インスティテューショナル・トラスト・ サービスズ(アジア)・リミテッド
ウェブサイト URL	<a href="http://www.abf-paif.com">www.abf-paif.com</a>

## 主な特長

- ・ アジア初のアジア債券連動型 ETF(上場投資信託)
- ・ 原則として半期毎の収益分配
- ・ 株式と同様に証券会社を通じてリアルタイムに売買可能(銘柄コード:1349)
- ・ 最低投資金額は約 1 万 1 千円(2010 年 7 月末現在)

## 上場取引所

上場証券取引所	東京証券取引所・香港証券取引所
銘柄コード	1349 (香港証取では 2821)
取引単位	1 口 (香港証取では 10 口)

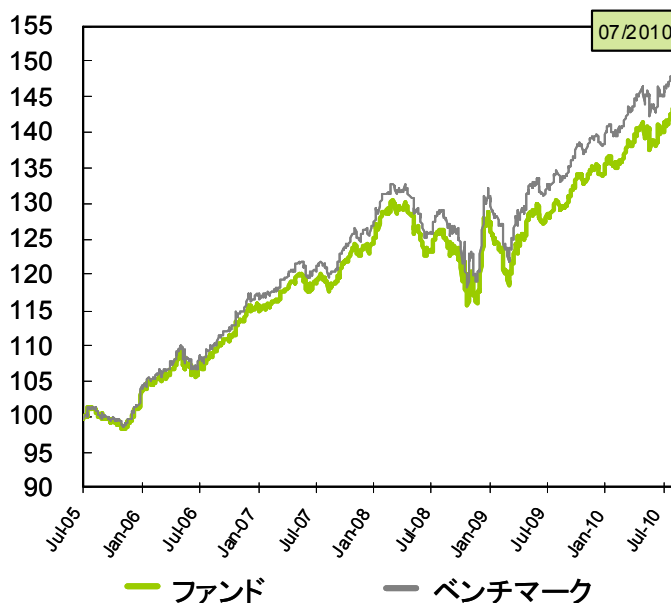
## 米ドルベース運用実績 \* (2010 年 7 月末現在)

	1ヶ月	3ヶ月	年初来	2009	2008	2007	2006	設定来*
本ファンド	2.28	1.29	6.61	4.34	3.53	7.80	13.71	7.32%*
ベンチマーク	2.35	1.52	7.00	5.13	4.22	8.39	14.59	8.09%*

※上記は米ドル建ての運用実績です。

※ファンドのリターンは、報酬および費用控除後で、分配金再投資した場合の数字です。ファンドのベンチマークへの連動性を分析するには、源泉税や取引コスト、ファンドとベンチマークにおける為替レートの採用基準の違いなど、いくつかの考慮すべき不可避要因があります。

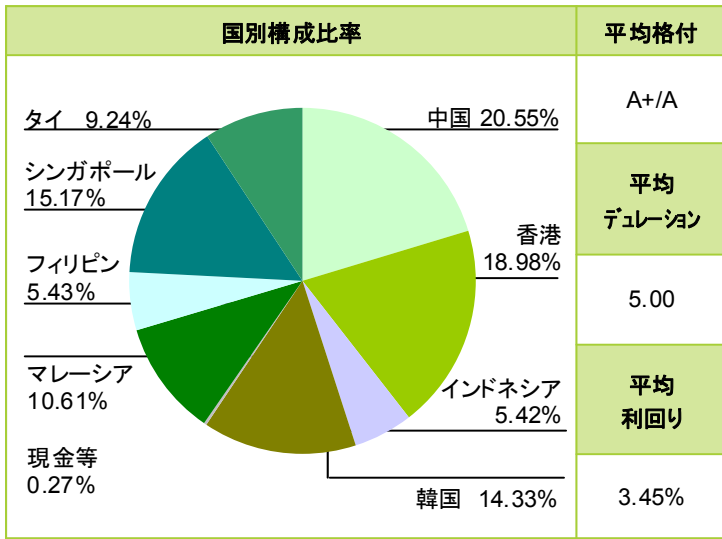
\* 香港証取上場日(2005 年 7 月 7 日)以降の実績を年率化しています。



※上場日を 100 として指数化しています。

データソース: International Index Company Limited, HSBC Institutional Trust Services (Asia) Ltd, State Street Global Advisors Singapore Limited

**ポートフォリオ構成** (2010年7月末現在)



※平均格付は、時価総額と修正デュレーションで加重しています。  
 ※平均デュレーションは時価総額で加重しています。これはあくまでも参考値であり、市況により随時変動します。  
 ※平均利回りは、時価総額およびデュレーションで債券を加重して算出しています。これはあくまでも参考値であり、市況により随時変動します。  
 ※平均利回りは、ファンドの運用成果を表すものではありません。

**【ご参考データ①】**

**本国(香港)での配当実績** (2010年7月末現在)

発表日	配当基準日	分配金額	通貨
2010年7月14日	2010年7月21日	1.95	USドル
2010年1月14日	2010年1月22日	1.95	USドル
2009年7月14日	2009年7月22日	1.67	USドル
2009年1月14日	2009年1月22日	2.14	USドル
2008年7月14日	2008年7月22日	2.09	USドル
2008年1月17日	2008年1月22日	2.16	USドル
2007年7月18日	2007年7月23日	2.05	USドル
2007年1月19日	2007年1月22日	2.16	USドル

※本データは、当ファンドにおける過去の配当実績を示したものであり、将来の運用成果等を保証又は示唆するものではありません。

**組入上位銘柄** (2010年7月末現在)

発行者	クーポン (%)	満期	組入比率
中国政府	2.700	2013年5月21日	1.67%
香港政府	2.930	2020年1月13日	1.40%
シンガポール政府	3.625	2014年7月1日	1.30%
シンガポール政府	3.750	2016年9月1日	1.24%
韓国財務省	5.750	2018年9月10日	1.20%
シンガポール政府	3.625	2011年7月1日	1.02%
シンガポール政府	3.250	2020年9月1日	1.01%
シンガポール政府	2.625	2012年4月1日	1.01%
シンガポール政府	2.500	2012年10月1日	0.95%
マレーシア政府	5.094	2014年4月30日	0.93%

**【ご参考データ②】**

**先進国債券市場との相関性** (2010年7月末現在)

	アメリカ	アジア
アメリカ	1.00	0.35
ドイツ	0.80	0.23
イギリス	0.78	0.36
日本	0.38	0.19
オーストラリア	0.72	0.22

データソース: Citigroup Government Bond Index と iBoxx Pan-Asia Index の月次リターンからステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズが作成(2001年~2010年7月)

**ご留意事項**

＜投資にかかるリスクについて＞

ETFは株式のように売買され、投資リスクがあり、市場価値は変動します。通常ETFは連邦預金保険機構(FDIC)、或いは他の政府機関や管理信託銀行によって保証されていません。同ETFは投資した元本を失う可能性等の投資リスクがあります。またETFは運用会社や証券保管管理機関、名義書換代理人、株主サービス代理人等に対してサービスの対価を支払います。本資料中の商標およびサービス・マークは各所有者の資産です。独立系データ提供会社は提供したデータの正確性、完全性、または適時性に関し何ら事実の保証ないし表明を行うものではなく、こうしたデータに関連して発生するいかなる損害に対し責任はありません。一般的に、ETFの価値は適用される指数の価値と連動して変動すると予想されます。ETFは証券口座を利用して取引所で売買できますが、ETFから株式を個別に償還することはできません。

当ETFは主に債券等の有価証券に投資を行います。当ETFへの投資には、市場リスク、為替リスク、金利リスク、信用リスク、カントリーリスク、流動性リスク等が伴います。これらのリスク要因により当ETFの価格が変動し、その結果、投資元本を損なう可能性があります。なお、ETFの投資にかかるリスクは上記に限定されるものではありません。

<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。②ETFの一口あたりの純資産価額と連動を目指す特定の指標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価額が乖離する可能性があります。

<アジア国債・公債ETFにかかる一般的な留意事項>

①当ETFの運営費用が将来に渡り変更される可能性があります。②連動対象であるiBoxx ABF 汎アジア指数の変動、指数構成銘柄の価格の下落及び指数構成銘柄の発行者の財務状況の悪化等により当ETFの純資産価額又は市場取引価格が下落し、それにより損失が生じることがあります。

**※ その他当ETFのリスク全般に関する詳しい内容は有価証券報告書等をご確認下さい。**

<ETFにかかる手数料・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。当ETFの信託にかかる費用は、運用報酬、信託報酬、ライセンス・フィー及びその他の費用等があり、年率は合計で当ETFの純資産価額の0.20～0.25%程度です。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。これらの費用は、運用状況等により変動するものであり、事前に上限額を示すことができません。

- 当資料は、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によって作成された販売用資料であり、法令に基づく開示資料ではありません。
- 当資料記載の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予告なく変更されることがあります。
- 当資料記載の内容は、将来の運用成果等を保証又は示唆するものではありません。
- 当ETFは主に債券等の有価証券に投資を行い、当ETFの基準価格は変動し、元本は保証されません。
- 当ETFの運用による損益は、当ETFをご購入のお客様に帰属します。
- 当ETFは、金融機関の預貯金とは異なり、元本及び利息の保証はありません。
- 当ETFは、預金又は保険契約ではないため、預金保険及び保険契約者保護機構の保護の対象にはなりません。
- 当ETFのご購入時には、売買手数料がかかります。
- 取得のお申し込みに当たっては、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、ご自身で判断して下さい。

**※ 購入のお申込や売買手数料等につきましては、各取扱会社(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

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第345号

加入協会: 日本証券投資顧問業協会、投資信託協会、日本証券業協会

本件に関するお問合せ先: 証券営業部 03-4530-7152