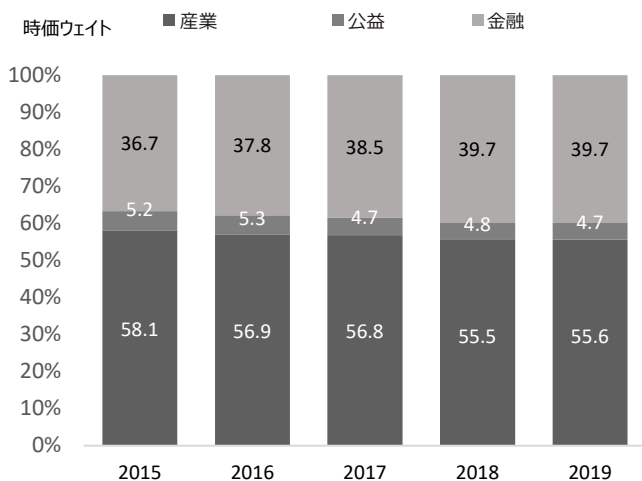


米国投資適格社債（1-10年）インデックス

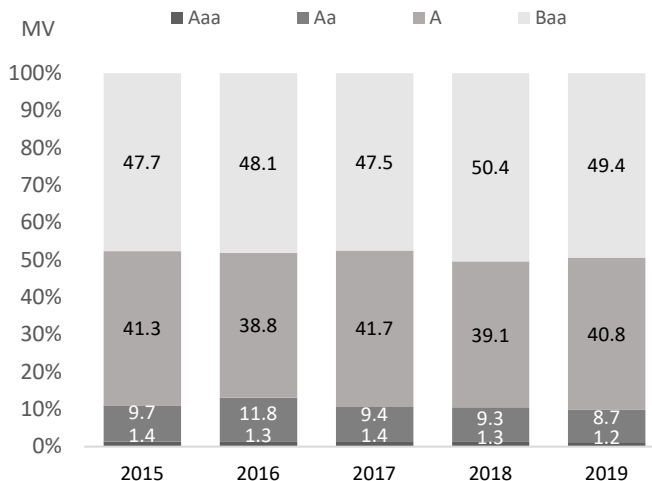
ブルームバーグ・バークレイズ米国投資適格社債（1-10年）インデックスは、投資適格、固定利付きの課税対象社債市場のパフォーマンスを測定します。インデックスには、米国内外の産業、公益、および金融セクターの発行体が公募発行した、満期日まで1年以上かつ10年未満の米ドル建ての債券が組み入れられています。米国投資適格社債（1-10年）インデックスは米国クレジット・インデックスおよび米国総合インデックスの構成要素にもなっています。また、必要なインデックス組入れ基準を満たす場合、インデックスの構成銘柄は多通貨型のグローバル総合インデックスにも含まれます。米国投資適格社債（1-10年）インデックスは2000年4月に算出が開始されましたが、過去データは1973年1月1日まで遡ることができます。

セクター時価ウェイト（MV%）



*2019年データは2019年3月29日現在

格付け別時価ウェイト



インデックス組入れ基準

セクター	社債（産業、公益、金融）の発行体のみ。
適格通貨	元本と利息は米ドル建て。
格付け	<p>ムーディーズ、S&P、フィッチの中間の格付けが投資適格（Baa3/BBB-/BBB-以上）であること。格付機関2社のみから格付けを取得している場合、低い方の格付けをインデックス格付けとします。1社のみから格付けを取得している場合は、当該格付けをインデックス格付けとします。銘柄レベルで明示的な格付けを取得していない場合、他のソースを格付けに用いることがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> 新規発行後すみやかにインデックスに組み入れるため、またはスプリット格付けの発行体を適切に分類するため、予想格付けが用いられることがあります。 債券格付けが付与されていない債券で、発行体格付けが存在する場合、インデックスの分類上発行体格付けを使用することがあります。債券格付けが付与されていない劣後債券で、劣後発行体格付けが存在する場合、劣後発行体格付けを用いてインデックスに組み入れられます。
残存額面金額	残存額面金額3億米ドル以上。
クーポン	<ul style="list-style-type: none"> 固定金利。 固定金利から変動金利に変わるコーラブル債は、固定金利期間のみインデックス適格とします。 あらかじめ決められたスケジュールでクーポンが変更されるステップアップ・クーポン債も、インデックス適格とします。
残存年数	<ul style="list-style-type: none"> オプションの有無に関わらず、満期日まで1年以上かつ10年未満であること。 固定金利から変動金利に転換するコーラブル債（固定金利から変動金利に転換する永久債を含む）は、変動金利への転換の1年前にインデックスから除外されます。固定金利の永久債はインデックス非適格。

インデックス組入れ基準

課税	<ul style="list-style-type: none">課税証券のみがインデックス適格。受取配当金控除 (DRD) や適格配当金 (QDI) 対象証券は不適格。				
優先/劣後	優先債券、劣後債券、ともに含まれます。				
発行市場	<ul style="list-style-type: none">SEC 登録債、発行時の登録が免除されている債券、登録権のある SEC ルール 144A 債券がインデックス適格となります。SEC 規則 S (Reg-S) と SEC ルール 144A 両方のトランシェをもつ債券は、本インデックスでは同一銘柄として扱われます。二重計上を避けるため 144A トランシェをインデックスに含め、144A と Reg-S のトランシェを合わせた残高を用いるものとします。グローバル債も含まれます。後に発行体が登録を中止した債券であっても、以前は SEC 登録債もしくは登録権のある 144A 債券であれば、インデックス適格。				
証券種別	<table><thead><tr><th>インデックス適格</th><th>インデックス非適格</th></tr></thead><tbody><tr><td><ul style="list-style-type: none">期限一括償還債、プットブル債、シンカブル・ボンド/分割償還債、コールブル債ゼロクーポン債として発行された債券引受けされた MTNエンハンスド設備信託証券 (EETC)預金証券 (CD)固定利付きおよび固定から変動に金利が転換する資本証券</td><td><ul style="list-style-type: none">自己資本比率またはソルベンシー/バランスシートに基づく明示的なトリガー条項が規定されている条件付き資本証券 (伝統的な CoCo 債および条件付き・元本削減型の債券を含みます)株式の属性を有する債券 (ワラント債、転換社債、優先債券、DRD/QDI 適格証券など)物価連動債、変動利付債課税および非課税の地方債、カバードボンド私募債、個人向け債券額面が 25 米ドル/50 米ドルの債券仕組み債、バスルー証券社内外の価格ソースから価格が取得できない流動性のない債券</td></tr></tbody></table>	インデックス適格	インデックス非適格	<ul style="list-style-type: none">期限一括償還債、プットブル債、シンカブル・ボンド/分割償還債、コールブル債ゼロクーポン債として発行された債券引受けされた MTNエンハンスド設備信託証券 (EETC)預金証券 (CD)固定利付きおよび固定から変動に金利が転換する資本証券	<ul style="list-style-type: none">自己資本比率またはソルベンシー/バランスシートに基づく明示的なトリガー条項が規定されている条件付き資本証券 (伝統的な CoCo 債および条件付き・元本削減型の債券を含みます)株式の属性を有する債券 (ワラント債、転換社債、優先債券、DRD/QDI 適格証券など)物価連動債、変動利付債課税および非課税の地方債、カバードボンド私募債、個人向け債券額面が 25 米ドル/50 米ドルの債券仕組み債、バスルー証券社内外の価格ソースから価格が取得できない流動性のない債券
インデックス適格	インデックス非適格				
<ul style="list-style-type: none">期限一括償還債、プットブル債、シンカブル・ボンド/分割償還債、コールブル債ゼロクーポン債として発行された債券引受けされた MTNエンハンスド設備信託証券 (EETC)預金証券 (CD)固定利付きおよび固定から変動に金利が転換する資本証券	<ul style="list-style-type: none">自己資本比率またはソルベンシー/バランスシートに基づく明示的なトリガー条項が規定されている条件付き資本証券 (伝統的な CoCo 債および条件付き・元本削減型の債券を含みます)株式の属性を有する債券 (ワラント債、転換社債、優先債券、DRD/QDI 適格証券など)物価連動債、変動利付債課税および非課税の地方債、カバードボンド私募債、個人向け債券額面が 25 米ドル/50 米ドルの債券仕組み債、バスルー証券社内外の価格ソースから価格が取得できない流動性のない債券				

リバランス・ルール

頻度	ブルームバーグは、各インデックスについて、リターン (バックワード) ・ユニバースと予想 (フォワード) ユニバースという 2 つの証券ユニバースを公表しています。リターン・ユニバースの構成銘柄は月末ごとにリバランスされ、翌月分のインデックス・リターンを計算する元になる固定の債券銘柄群とされます。予想ユニバースは、インデックスから除外される銘柄や追加される銘柄を反映して日々変動する将来に関する予想ですが、リターンの計算には使用されません。月末最終営業日 (すなわちリバランス日) における最新の予想ユニバースの構成が、翌月のリターン・ユニバースになります。
インデックス銘柄属性変更	当該月中において、インデックス構成銘柄の属性変更 (信用格付の変更、業種分類の変更、残存額面の変動、コーポレートアクション、ティッカー変更など) は、インデックスの予想ユニバースとリターン・ユニバースに日々反映されます。インデックスの予想ユニバースでは、これらの変更により銘柄の追加除外が毎日発生する可能性がありますが、リターン・ユニバースの構成が影響を受けるのは、次のインデックスのリバランスが実施される月末だけです。
現金再投資	利払いや元本償還により月中発生した現金はインデックスの月次リターンに反映されますが、リバランス日までの間短期金利で再投資されることはありません。実質的に、リバランスごとに、キャッシュは翌月のリターン・ユニバースに再投資されるため、2 カ月を超える期間では、月次の複利計算が行われます。
新発債	発行済みの適格債券は、月末のリバランス日以前に受渡しされていなくても、必要な属性情報および評価価格を容易に入手できる場合、翌月からインデックスに組み入れることができます。

インデックス価格と関連事項

価格ソースと頻度	インデックス構成銘柄の価格は日次でブルームバーグの評価価格サービス (BVAL) によって評価されます。
価格クオート方法	インデックス組入銘柄の多くは、米国国債に対するスプレッドを用いて価格が評価されますが、ドル建て価格で値付けされる銘柄もあります。
タイミング	<ul style="list-style-type: none"> 午後 3 時 (ニューヨーク時間)。 債券市場が前場で引ける日は、特に断りのない限り、午後 1 時 (ニューヨーク時間) の価格を採用。 米国市場において月末最終営業日が祝日の場合、前営業日の価格が利用されます。
ビッド・オファー価格	インデックス組入銘柄の価格はビッド価格を使用します。新発社債がインデックスに初めて組み入れられるときはオファー価格を使い、翌月以降はビッド価格を使用します。
決済の前提条件	すべての債券に関して、翌暦日を受渡し日とします。月末には、最終営業日が月末日でなくとも、丸々 1 カ月分の経過利子が計算されるように、翌月の 1 日を受渡し日とします。
価格チェック	大きな乖離を識別するために、各銘柄の日々の価格変動がインデックス・プライシング・チームによって分析されます。インデックス・ユーザーが価格水準に異議を唱えることもできます。その場合、さまざまなソースからの情報を活用して価格水準が再検討され、必要に応じて更新されます。
通貨ヘッジ	米国投資適格社債 (1-10 年) インデックスに関しては、米ドル以外の各種通貨に対するヘッジを考慮したリターンも公表されます。インデックスの通貨ヘッジ方法は、インデックスに含まれる個別銘柄のローカル・リターンを毎月末に 1 カ月為替フォワード・レートを用いてヘッジすると想定し、報告通貨建てのヘッジ付きリターンを算出します。インデックスのリターン・ユニバース構成銘柄の価格変動を考慮して、月中にヘッジ額に調整を加えることはありません。
カレンダー	米国投資適格社債 (1-10 年) インデックスの算出日は、米国債券市場の休日カレンダーに準じています。

米ドル建て月次リターン (2008 年～2019 年) (単位 : %)

	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	年初来
2008	1.63	0.46	-1.30	0.50	-0.65	-0.67	-0.46	0.57	-7.14	-4.89	3.07	4.49	-4.82
2009	1.69	-1.61	-0.13	3.38	3.51	1.97	3.42	1.70	1.45	0.94	1.56	-0.61	18.56
2010	1.66	0.41	0.39	1.34	-0.34	1.50	1.85	1.33	0.97	0.71	-0.77	-1.04	8.27
2011	0.66	0.47	-0.05	1.48	1.12	-0.45	1.82	-0.19	-0.82	1.41	-1.39	1.39	5.52
2012	2.20	0.78	-0.24	1.02	0.13	0.42	1.84	0.50	0.82	0.84	0.15	0.08	8.84
2013	-0.34	0.70	0.22	1.01	-1.38	-2.00	0.73	-0.57	0.95	1.12	0.09	-0.38	0.08
2014	1.21	0.67	-0.15	0.79	1.02	0.02	-0.15	0.86	-0.84	0.69	0.53	-0.38	4.35
2015	1.92	-0.42	0.40	0.01	-0.08	-1.02	0.29	-0.32	0.74	0.26	-0.10	-0.58	1.08
2016	0.54	0.44	1.76	0.84	-0.07	1.46	0.75	0.06	0.08	-0.28	-1.80	0.24	4.04
2017	0.39	0.77	0.00	0.83	0.70	-0.04	0.73	0.55	-0.23	0.22	-0.35	0.30	3.92
2018	-0.79	-0.77	0.06	-0.45	0.55	-0.20	0.44	0.61	-0.25	-0.45	-0.01	1.05	-0.23
2019	1.79	0.37	1.62	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3.82

インデックス・データへのアクセス

ブルームバーグ プロフェッショナル® サービス

ブルームバーグのベンチマークインデックスは、資本市場投資家にとって世界標準になっています。

- INDE<Go> - ブルームバーグ・インデックスの基本ページは、ターミナル上に表示されるインデックス関連情報のダッシュボードです。各種方法、ファクトシート、月次レポート、最新情報、アラートなどのインデックス公表物に加えて、各インデックス・ファミリーの主要インデックスに関する日次および月次のインデックス・リターンを検索できます。
- IN<Go> - ブルームバーグ・インデックス・ブラウザは、インデックスの最新のパフォーマンス結果や統計値、および過去の実績を表示します。IN は、ブルームバーグのマルチ・アセットクラス型グローバル・インデックス・ファミリーを構成する各種インデックスを階層に分けて一括表示し、検索や比較を容易に行えるようにしています。「マイ・インデックス」タブでは、一連のお気に入りインデックスに絞って表示できます。
- PORT<Go> - ブルームバーグのポートフォリオ&リスク分析ソリューションには、インデックスのリスク、リターン、現在の構成を分析するツールが盛り込まれています。ポートフォリオとベンチマークインデックスのパフォーマンスを比較分析したり、パフォーマンス寄与度、トラッキング・エラー、バリュー・アット・リスク、シナリオの分析、および最適化のためのモデルを使用したりすることができます。
- DES<Go> - インデックスの概要が説明されているこの画面は、構成要素に関する情報、全体的な特性とリターン、過去のパフォーマンスなど、個々のインデックスを掘り下げ、透明性を提供します。

ブルームバーグ・インデックスのサイト (www.bloomberginindices.com)

このインデックスのサイトでは、次のような限定的なインデックス情報を閲覧できます。

- インデックスの算出方法とファクトシート
- 主要なインデックスのパフォーマンス直近値

データ配信

インデックスの契約者は、ファイル形式でインデックス・データを受信することも選択できます。ファイルには次のようなデータが含まれます。

- 当該インデックスに関するインデックス・レベルおよび/または構成銘柄レベルのリターンと特性
- 市場引け後にインデックス作成プロセスが完了した後に、電子メールまたは SFTP でファイルを自動配信します。
- 標準的なファイルを受信することも、ファイルの内容をカスタマイズすることもできます。
- 公認再配信業者経由でインデックス・データを配信することもできます。

ブルームバーグのトータル・リターン・インデックス値のティッカー：米国投資適格社債（1-10 年）インデックスおよび関連インデックス

ティッカー（米ドル建て、ヘッジなし）

LD06TRUU
LD06TRJU
LD06TRJH
LUACTRUU

インデックスおよび通貨区分

米国投資適格社債（1-10 年）インデックス（ドルベース）
米国投資適格社債（1-10 年）インデックス（円ベース、ヘッジなし）
米国投資適格社債（1-10 年）インデックス（円ベース、ヘッジつき）
米国社債インデックス（ドルベース）

トータル・リターン・インデックス値は、他の通貨建てやヘッジ付きでも計算しています。利回りやデュレーションなど、他の特特別のインデックスも計算しています。利用可能なティッカーおよび特特別インデックスの一覧については、Accessing Bloomberg Barclays Index Data Using Bloomberg Tickers（ブルームバーグのティッカーを使用したブルームバーグ・ Barclays - インデックス・データへのアクセス）を参照願います。

インデックス・ライセンス

インデックスに連動したサービスや商品には、インデックス・データ・ライセンスが必要です。

- インデックス・レベルや構成銘柄レベルの再配信
- 債券価格評価サービス
- ETF
- 上場投資証券（ETN）
- インデックス連動保険商品
- ミューチュアルファンド
- OTC デリバティブ商品
- カスタム・インデックス

免責事項

ニューヨーク

+1-212-318-2000

ロンドン

+44-20-7330-7500

シンガポール

+65-6212-1000

香港

+852-2977-6000

東京

+81-3-3201-8900

シドニー

+61-2-9777-8600

indexhelp@bloomberg.net

ブルームバーグはブルームバーグ・ファイナンス L.P.の商標およびサービスマークです。パークレイズはパークレイズ・バンク Plc の商標およびサービスマークで、使用許諾に基づいて使用されます。ブルームバーグ・ファイナンス L.P.およびその関連会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスにおけるすべての所有権を所有しています。ブルームバーグ、もしくはパークレイズ・バンク Plc、パークレイズ・キャピタル・インク、またはそれらの関連会社（以下「パークレイズ」と総称します。）のいずれも、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスに関連するデータや情報の適時性、正確性、完全性を保証するものではなく、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックス、それに関連するデータや値、またはそれらから得られる結果に関して、明示的または黙示的に保証することでもなく、それらに関する特定の目的上の市場性や適合性についてのあらゆる保証を明示的に否認します。インデックスに直接投資することはできません。バックテストされたパフォーマンスは実際のパフォーマンスではありません。過去のパフォーマンスは将来の結果を示すものではありません。ブルームバーグおよびそのライセンサー、ならびにそれぞれの従業員、契約者、代理人、供給者、および販売者は、過失またはその他によるものに関わらず、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスまたはそれに関連するデータや値に関して発生したいかなる損害または被害（直接的、間接的、結果的、偶発的、懲罰的、その他かを問いません。）に対しても、法律で認められた最大限の範囲で、一切の責任または責務を負わないものとします。本文書は、金融商品に関する助言ではなく、事実に基づく情報の提供にあたります。ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスのいかなる構成要素も、ブルームバーグまたはその関連会社もしくはライセンサーによる金融商品の提供、投資助言、もしくは投資推奨（すなわち、「買い」、「売り」、「継続保有」、または特定の利害関係を伴う他の取引を行うか否かに関する推奨意見）、あるいは投資戦略もしくは他の戦略に関する推奨意見にあらず、またはそれらとして解釈されないものとします。ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスを通じて入手できるデータおよびその他の情報は、投資判断の根拠とするのに十分な情報と考えるべきではありません。ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスによって提供されるすべての情報は一般的なもので、特定の個人、事業体、または個人の集団のニーズに合わせているわけではありません。ブルームバーグおよびその関連会社は、有価証券またはその他の持分の将来の値や予想値について意見を明示するものではなく、いかなる類の投資戦略も明示的または黙示的に推奨または提案するものではありません。またパークレイズは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスの発行体または作成者ではなく、これらのインデックスの投資家に対する責任、義務、責務を一切負いません。ブルームバーグは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスにおいてまたは同インデックスに関連して、パークレイズとの取引を自ら執行することがありますが、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスの投資家は、パークレイズとの間でいかなる関係も結ぶものではありません。パークレイズは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスまたはそれに組み入れられているデータの後援、支持、販売、または販売促進を行わず、妥当性や使用に関して表明を行うこともありません。お客さまは、金銭的な意思決定を下す前に独立した立場からの助言を受けることを検討する必要があります。©2019 ブルームバーグ・ファイナンス L.P. 本データシートの一部または全部を当社に無断で複製、転載すること禁じます。