

\* 本プレスリリースは2018年4月17日に英語で発表されたプレスリリースを日本語に翻訳・再編集したものです。オリジナルのプレスリリースの正式言語は英語であり、この内容および解釈については英語が優先となります。英文オリジナルにつきましては次のサイトをご参照ください。

<https://www.bloomberg.com/company/announcements/rules-changes-bloomberg-barclays-canada-aggregate-index-announced/>

## ブルームバーグ・バークレイズ・カナダ総合インデックスの算出方法を変更

【ニューヨークー2018年4月17日】ブルームバーグは本日、ブルームバーグ・バークレイズ・カナダ総合インデックスファミリーの算出方法を一部変更すると発表しました。この変更は、現在行われているグローバルインデックスの見直しおよびガバナンスプロセスによるものです。また、2017年12月に国内市場参加者を対象として開催されたカナダ・インデックス協議会(Canada Index Advisory Council)からのフィードバックも反映されています。この結果、ブルームバーグ・バークレイズ・カナダ総合インデックスファミリーには2018年8月1日付で以下の変更および改善が加えられます。その中には、次に示す通りグローバル総合インデックスに影響を及ぼすものも含まれています。

### 最低残高

カナダ総合インデックス適格証券の最低残高を3億カナダドルから1億5,000万カナダドルに引き下げます。この変更により、新たに約347銘柄がカナダ総合インデックスに組み入れられ、その残高総額は710億カナダドル(カナダ総合インデックスの約5%)に上ります。これによりカナダ社債市場がより正確にインデックスに反映されるようになります。また、カナダ総合インデックスはそのままグローバル総合インデックスに組み入れられます。

### DBRSの格付を採用

カナダドル建て債券をカナダ総合インデックスおよびグローバル総合インデックスに組み入れる際のインデックス格付けの判定にDBRSの債券格付を採用します。この変更により、新たに約49銘柄がカナダ総合インデックスに組み入れられ、その残高総額は100億カナダドルです。現在の算出方法では、3大格付会社の格付の中央値を判定基準としていますが、新たな算出方法では4社の格付を考慮に入れます。まず最も高い格付と最も低い格付を除外した後、残りの格付の低い方を判定基準とします。3社またはそれ以下の格付しか取得していない証券については、現在使用している3社以下の格付による算出基準が適用されます。

### ユーロおよびアジアを発行市場とする債券の除外

一部の市場を発行市場とする債券、特に「ユーロMTN」または「ユーロ非ドル建て」債券をカナダ総合インデックスから除外します。カナダ国内の投資家による購入が難しいためです。ただしグローバル総合インデックスにはこれらの債券を引き続き組み入れます。

## ベイルイン債および実質破綻時損失吸収条項付債券の適格性

2018年第3四半期に発行が始まる予定のベイルイン債は、カナダ総合インデックスに組み入れられます。また、実質破綻時損失吸収条項付債券(NVCC)も引き続きカナダ総合インデックスに組み入れられます。

## サブインデックスを新たに公表

ブルームバーグは、カナダ債券市場の市場構造に合わせて、以下の新たなカナダ総合サブインデックスを2018年8月1日にローンチします。

- メープル債および国内債
- 州政府債
- 地方債
- 政府機関債
- 国債

ブルームバーグは、世界各地の顧客の皆様のために、独立した透明性のあるアプローチでインデックスを作成します。詳細につきましては、[bloombergindices.com](http://bloombergindices.com) をご覧ください。

## ブルームバーグについて

グローバルビジネス、金融情報、ニュースにおけるリーダーであるブルームバーグは、情報、人、アイデアのダイナミックなネットワークを通じて、影響力のある意思決定者の皆様に決定的な優位性を提供します。ブルームバーグの根幹ビジネスであるブルームバーグターミナルは、革新的テクノロジーを基盤に、データ、ニュース、分析機能を迅速かつ正確に配信します。ブルームバーグのエンタープライズソリューションズは、テクノロジーを活用し、お客さまが効率的、効果的に、データ、情報にアクセスし取り入れ、配信、管理するというブルームバーグの強みに基づいています。詳細に関しては次のリンク先 <http://about.bloomberg.co.jp/> をご覧いただくか [こちらよりデモをご要望ください](#)。

## 報道関係者 お問い合わせ

ブルームバーグ広報代行: アシュトン・コンサルティング 03-5425-7220

ブルームバーグ広報: 03-3201-8900