

For Immediate Release

成松恭多
+81 (0)3 4530 5623
kyota.narimatsu@barclays.com

バークレイズ、ルービニ・グローバル・エコノミクス と投資可能な株式インデックスを共同で提供開始

ルービニ・カントリー・インサイト™・モデルに基づく新しいインデックス、ルービニ・バークレイズ・カントリー・インサイト™・インデックス

【2015年7月14日、東京】 – バークレイズ・バンク・ピーエルシーとルービニ・グローバル・エコノミクスは7月13日、ルービニ・カントリー・インサイト™・モデルをベースとした投資可能な株式インデックス・シリーズであるルービニ・バークレイズ・カントリー・インサイト™・インデックス（以下「インデックス」）の提供を開始しました。

ルービニ・バークレイズ・カントリー・インサイト™・インデックスはルービニ・グローバル・エコノミクスとバークレイズのエクイティ・アンド・ファンズ・マーケッツ・インベストメント・ストラテジーズ（EFS）グループがベータ・エクスボージャーの向上を目的に共同開発したものです。流動性を考慮しながら、ルービニ・カントリー・インサイト™・モデルによりファンダメンタルズが最も健全と判断される国の株式ベンチマーク・インデックスへの名目上のエクスボージャーを体系的に配分します。インデックスには「全世界」、「先進国」、「先進国（除く北米）」、「エマージング市場」の4種類があります。

ルービニ・カントリー・インサイト™・モデルは国際決済銀行、国際通貨基金、世界銀行、世界経済フォーラム、ギャラップ・ポールズが提供する2,500以上のデータの分析を基に、国の投資魅力度（Investment Attractiveness Score）を判定するものです。このモデルは、技術革新を生み出す力、人口構成、教育制度の質、医療サービスの普及など、投資対象としての魅力度を測定するための様々な指標に基づき、国をきめ細かく評価することを目指しています。ルービニ・カントリー・インサイト™・モデルはマクロ経済パフォーマンスだけでなく、政策、政治リスク、社会の安定性など、その国の潜在成長力に直接影響及ぼす分野の要因についても勘案します。

バークレイズのEFSインベストメント・ストラテジーズのグローバル統括責任者であるファビエン・ラボレーは次のように述べています。「ルービニ・バークレイズ・カントリー・インサイト™・インデックスの提供を開始することを大変嬉しく思います。このインデックスは現在の厳しいマクロ環境下で投資対象国を選別する手段を提供し、世界でより高いベータにアクセスするための投資可能な仕組みとなるものです。」

また、ルービニ・グローバル・エコノミクスのマネージング・ディレクターであるポール・ドミヤンは次のように説明します。「企業に投資する際、大多数の投資家は、企業への投資に際して最初に資産、負債、株主構成を評価します。国の経済面の魅力を探る時に同様の分析をしたいと投資家は思うでしょう。ルービニ・バークレイズ・カントリー・インサイト™・インデックスはその役割を担うことを目指しています。国の短期的な経済パフォーマンスである『損益計算書』だけに着目するのではなく、特定の国あるいは地域の投資リスクと効果を理解するために足元のデータを使います。こうしたものには不平等や教育などの社会的な要素とともに、銀行システムの健全性、経済の債務総額、人口の年齢構成、イノベーションを生み出す力など、国の『バランスシート』に影響を与える要因に関するデータが含まれます」。

ルービニ・バークレイズ・カントリー・インサイト™・インデックスはパッシブ・インデックス運用で選好する地域のリスク調整後リターンを高めるための各種商品の参照インデックスとしてご利用いただけます。

バークレイズについて

バークレイズは、個人・法人向け銀行業務、クレジットカード、投資銀行業務、資産管理業務などさまざまな金融サービスを欧州、米州、アフリカ、アジアといった地域で展開している国際的な金融機関です。バークレイズは、人々が目標を実現できるよう、正しい方法で手助けをすることを目標としています。

325年の歴史と銀行としての専門性を備えたバークレイズは、50カ国以上で約130,000人の従業員を擁しています。世界中のお客様に、為替、融資、投資、資産管理などのサービスを提供しています。より詳細な情報は、グループのウェブサイト www.barclays.com をご参照ください。

ルービニ・グローバル・エコノミクスについて

ルービニ・グローバル・エコノミクスは著名エコノミストであるヌリエル・ルービニ氏が2004年に設立した独立系の大手グローバル・マクロ経済調査会社です。カントリー・インサイト™は銀行、事業会社、資産運用機関が長期計画の策定、リスク管理、信用分析、投資を行う際に利用されています。ルービニ・カントリー・インサイト™・モデルは対外調整能力、制度の頑強性、成長および適応性、社会受容性の4つの要素を基に国を10段階で評価するものです。

免責事項

インデックスのリターン

インデックスのリターンは当該インデックスの構成要素の実際のリターンを下回る場合があります。インデックスは報酬、費用、手数料を差し引いている場合があります。インデックスへの投資はインデックスの構成要素への直接的な投資とは異なる税制が適用される場合があります。

インデックスの調整、停止、終了

インデックス・スポンサーはインデックスの構成あるいは計算方法を調整する、また、インデックスのルールに従い、インデックスを中止、調整あるいは中断する場合があります。係る措置はインデックスに連動する商品の価値およびパフォーマンスに悪影響を与える場合があります。インデックスのパフォーマンスは法および税に関わる事象ならびにインデックスの構成要素の除外あるいは入替、それらに限定されない特定の異例および不可抗力の事象により悪影響を受ける場合があります。

インデックスのパフォーマンス

いずれのインデックスについても、将来のパフォーマンスを一切保証するものではありません。過去のパフォーマンスは将来のパフォーマンスを示唆するものではありません。過去のパフォーマンスは（バックテストを含め）過去のパフォーマンスのシミュレーションである場合があり、シミュレーションでは代用あるいは代替インデックス構成要素を使用、あるいは必要に応じてインデックス手法を調整する場合があります。

インデックス・ルールの曖昧性

インデックスのいかなるルールも包括的であるようにしていますが、曖昧性が生じる場合もあります。係る状況において、インデックス・スポンサーは係る曖昧性を誠実かつ合理的な方法により解消し、必要に応じて、係る解決策を反映し、インデックスのルールを修正します。

利益相反

バークレイズは総合的なサービスを提供する投資銀行です。顧客に投資銀行商品およびサービスを提供する通常の過程において、バークレイズは1つの商品に関し、同時に複数の異なる立場（発行体、マーケット・メーカー、引受会社、販売会社、インデックス・スポンサー、スワップ・カウンターパーティ、算出機関を含む）で業務を行う場合があり、商品のパフォーマンスに影響を与えるかもしれない利益相反が発生する可能性があります。

インデックス・スポンサーの活動およびバークレイズおよび/あるいはその関連会社のその他の部門ならびにチームの業務を遂行する通常の過程において、バークレイズの中で潜在的な利益相反が生じる可能性があります。インデックス・スポンサーはインデックスの水準を計算、公表し、インデックスに関する決定を下す一方で、バークレイズの他のチームがインデックスに完全あるいは部分的に連動する取引あるいは投資商品の発行、契約締結、販促、募集あるいは売却を行う場合があります。さらに、バークレイズの他のチームがインデックスを構成する原資産構成要素の、あるいはそれに関連する持ち分またはポ

リサーチではありません

バークレイズのポジション

非勧誘

免責

非助言

第三者の情報

ジション、購入または売却、あるいはその他の取引ポジションを保有している、あるいは保有していた場合があります。係る活動はインデックスの水準に影響を与える場合があります。これらの異なる役割に照らし、バークレイズでは潜在的に利益相反が発生する場合があります。

本文書はバークレイズ調査部門の商品ではありません。表明されている見解はバークレイズ調査部門の見解と異なる場合があります。

バークレイズ、関連会社および関係者はいかなる時でもロングあるいはショート・ポジション（ヘッジングおよびトレーディング・ポジションを含む）を取得、保有あるいは売却する場合があります。これは商品のパフォーマンスに影響を与える場合があります。

バークレイズはいかなる商品の販売あるいは購入、またはいかなる取引の開始の勧誘も行っていません。いかなる取引も内部承認および拘束力を有する取引文書を条件とするバークレイズの正式な事後の合意を必要とします。また、上記に限定されることなく、いかなる取引もバークレイズはその公表課税原則に照らして審査する場合があります。

法律あるいは規制により禁止されている場合を除き、バークレイズはその意図するところ以外を目的とする本文書の使用について責任を負いません。

投資あるいは取引を行う前に、独立した立場の専門家の助言を求めてください。バークレイズはアドバイザーではなく、商品に関するいかなる助言も提供しません。確かな情報に基づく投資判断を下すことができるよう、投資がもたらす法、財務、税、規制に関わる結果を把握できる情報を十分有していることを事前に確認されることをお勧めします。

バークレイズは第三者あるいは統計サービスから得た、あるいは抽出したと表明している情報について責任を負いません。バークレイズおよびルービニ・グローバル・エコノミクスは関連会社の関係にはありません。バークレイズはルービニ・カントリー・インサイツ™・モデルあるいはそれに含まれる、またはそれが依拠するいかなるデータあるいは手法の正確性あるいは完全性を保証するものではありません。さらに、それに含まれる、あるいはそれが依拠する情報の利用により当事者が経験したパフォーマンスあるいは結果について、バークレイズは明示的にも黙示的にも保証いたしません。

本リリースは、バークレイズが 2015 年 7 月 13 日にロンドン、ニューヨークで発表した英文リリース、"Barclays and Roubini Global Economics partner to launch family of tradable equity indices"を翻訳したものです。