

For immediate release

**Contact:**

成松 恭多

+81 (0)3 4530 5623

kyota.narimatsu@barclays.com

河村 亜希子

+81 (0)3 4530 5631

akiko.kawamura@barclays.com

## バークレイズ、ミラー先物インデックスおよびデュレーション・ヘッジ・インデックスを公表

### 債券投資にともなう金利リスクをヘッジした新しいインデックス

【2013年9月20日、東京】バークレイズは、ミラー先物インデックスおよびデュレーション・ヘッジ・インデックスの提供を開始しました。これらのインデックスは、流動性の高い国債先物を用いて、バークレイズ債券インデックスの金利デュレーション・エクスポージャーを再現するものです。アクティブ運用、パッシブ運用を問わず、投資家は、インデックスの複製、金利ヘッジ、既存のベンチマークとは異なるデュレーション・エクスポージャーを取るなど、多様なポートフォリオの用途に利用することができます。

バークレイズのベンチマーク・インデックス・リサーチ部門統括責任者であるブライアン・アップピンは、以下のようにコメントしています。「新しいインデックス技術に投資し、革新的なインデックスを構築し続けることによって、バークレイズは債券投資家の戦略的なマーケットの見方に適したインデックスおよびポートフォリオ・リスク・ソリューションを提供しています。」

また、バークレイズの債券リサーチ部門共同統括責任者であるアジェイ・ラジャドヒヤクシャは次のコメントを寄せています。「金利変動は債券投資のリターン最大の要因です。金利上昇に備えて債券ポートフォリオのデュレーションの短期化を図りたい投資家は、独立かつルールに基づいたこれらのベンチマークを活用することで、既存の債券投資における広範なカバレッジおよび多様性を維持しつつ、希望するデュレーション・エクスポージャー水準への調整が可能となります。」

バークレイズは、単一通貨および多通貨の債券に投資する投資家にデュレーション・マネジメントのため以下の2種類のインデックスを提供します。

- **バークレイズ・ミラー先物インデックス (MFI)** : 米国総合インデックスやグローバル総合インデックスなどバークレイズの標準的な債券インデックスの月初におけるオプション調整済みデュレーション (OAD) 構造を、ウェイト付けた国債先物と現金ポジションによって再現したバスケットのリターンをあらわすインデックス
- **バークレイズ・デュレーション・ヘッジ・インデックス (DHI)** : バークレイズ債券インデックスの金利デュレーションの全部または一部を、対応するミラー先物インデックスを用いてヘッジした場合のリターンをあらわすインデックス

バークレイズ・ミラー先物インデックスおよびデュレーション・ヘッジ・インデックスは、多くのバークレイズの代表的なインデックスについて公表されるとともに、お客様のニーズに合わせたカスタマイズも可能です。

米国先物ディストリビューション・エグゼキューションの統括責任者兼先物電子取引ディストリビューション統括責任者であるテレンス・バークは、「ミラー先物インデックスは、投資家が自身の金利見通しに沿ったポートフォリオを構築するために、非常に有用なインデックスだと思います」と述べています。

本インデックスの公表は、バークレイズ・インデックス・プラットフォームの 40 周年と時を同じくします。1973 年に米国政府債インデックスおよび米国社債インデックス、1986 年に米国総合インデックスを公表開始して以来、バークレイズのインデックス・ポートフォリオ・リスク・ソリューション (IPRS) 事業は、インデックスおよびポートフォリオ分析の提供において業界をリードしてきました。今日では、先進国および新興国債券市場、投資適格およびハイ・イールド債券、固定利付および変動利付債券、名目および物価連動債券、課税および非課税市場にわたる、数千の標準およびカスタム・インデックスを提供しています。近年は、財政健全度加重インデックス、GDP 加重インデックス、LDI ベンチマーク、環境、社会、ガバナンス (ESG) をテーマとした債券インデックスなどを含む、各種の代替加重債券インデックスを公表いたしました。バークレイズはインスティテューショナル・インベスター誌の債券インデックス部門ランキングにおいて、米国、欧州それぞれで第 1 位に選出されており、また米国においては同部門のランキングが開始された 1997 年以降その地位を維持し続けています。

本稿は、バークレイズ PLC が 2013 年 9 月 19 日に発表した英文リリース” Barclays Launches Mirror Futures and Duration Hedged Indices”を翻訳したものです。

##

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世界有数の金融機関です。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。300 年以上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 カ国で約 14 万人も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](http://www.barclays.com) をご参照ください。

