

**報道機関のお問い合わせ先:**

山下 絢子 +81 3-5511-7572 または [ayako.yamashita@morningstar.com](mailto:ayako.yamashita@morningstar.com)

ステファニー・ホー +852 2973 4655 または [stephanie.ho@morningstar.com](mailto:stephanie.ho@morningstar.com)

モーニングスターが新しいグローバル債券インデックスファミリーを発表  
すべての主要な債券市場やセクターを包括的に代表するインデックスファミリー

2019年5月22日 東京発—独立系大手投資調査会社の米国**モーニングスター** (Morningstar, Inc., NASDAQ: MORN) は、すべての主要な債券市場やセクターを代表する新たなグローバル債券インデックスファミリーを発表しました。これらのインデックスは、運用ポートフォリオのベンチマーク、あるいは指数連動商品等を通じたポートフォリオの構成要素の一部として利用されることを想定しています。

モーニングスター債券インデックスは、流動性のある取引可能な証券を重視し、市場カバレッジの幅広さと投資可能性のバランスを取り、ポートフォリオで活用しやすい形の一連の投資機会を、債券投資家に対し明確にします。

米国モーニングスターのインデックス部門責任者であるサンジャイ・アルヤは、次のように述べています。「債券は投資家がファイナンシャル・ゴールを達成する上で重要な役割を果たします。債券市場について理解することは投資成果の向上に重要であり、当社は、情報を投資家にとって分かりやすい形で入手しやすくすることが、投資環境全般で公平な競争の場を確保すると考えます。当社は、各債券市場、セクターに対し、欠落や重複が無い形でエクスポージャーを提供する包括的なグローバル債券インデックスファミリーを構築しました。」

新しいホワイトペーパー「A Whole New World for Bond Investing: Aligning Bond Indexes With an Evolving Market (債券投資のまさに新世界：進化を続ける市場と債券インデックス)」で、米国モーニングスターは債券市場の基本的な変化、債券インデックスプロバイダーの業種の変化、パッシブ債券投資の拡大について検討しています。ホワイトペーパー全文は[こちら](#)からお読みください。

米国モーニングスターインデックス部門のストラテジストでホワイトペーパーの執筆者であるダン・レフコウィッツは、次のように述べています。「債券インデックスの構築は簡単ではありません。しかし、インデックスはポートフォリオ構築ツール、そして運用商品の基本情報として重要性が高まっています。投資可能な市場をより適切に反映させると同時に、金利感応度、クレジットクオリティ、セクターアロケーションなどの重要なエクスポージャーについて透明性を高めたいと考えています。」

この新たなインデックスファミリーの発表は、債券分野における米国モーニングスターの幅広い取り組みの一部です。モーニングスターは、投資家がファンドをより適切に比較できるように、米国にて債券のカテゴリーを見直し、中期コア債券、中期コア

プラス債券をカテゴリーに追加しました。さらに、より正確で一貫性があり比較可能な分析ができるように、米国モーニングスターは2019年7月31日（2019年6月30日時点のデータ）より、ファンドレベルの最終利回りやクレジットレーティングデータを、運用会社による報告データから、米国モーニングスターが計算するデータに変更します。

各種モーニングスターインデックスの詳細は、[こちら](#)をご覧ください。

### メソドロジー

モーニングスター債券インデックス構築のメソドロジーに関する全情報は[こちらから](#)  
[お読みください](#)。

### 米国モーニングスターについて

モーニングスターは独立系大手投資調査会社で、北米、欧州、オーストラリア、アジアの27カ国で拠点を展開しています。同社は、個人投資家、ファイナンシャル・アドバイザー、機関投資家の皆様に対してさまざまなプロダクトやサービスを提供しています。同社が提供している金融商品のデータは株式、投資信託およびその他の投資関連商品や指数を網羅しており、加えてリアルタイム配信する世界各国の市場データとして、外国為替や米国債市場のほか、株式、指数、先物、オプション、コモディティ、貴金属などの系列を有しています。また、投資顧問登録を持つ傘下の子会社を通じて、資産運用ソリューションも提供しており、2019年3月31日現在の助言・運用残高は2,100億ドル以上です。

###

©2019 Morningstar, Inc. All Rights Reserved.

MORN-P