

平成 27 年 6 月 11 日

各 位

管理会社名 国際投信投資顧問株式会社
代表者名 取締役社長 田中 裕之
(銘柄コード 1552)
問合せ先 ディスクロージャー部 永田 英二
(TEL. 03-5221-6168)

国際のETF VIX短期先物指数の信託財産に組み入れの
有価証券の発行体に係る信用格付の変更に関するお知らせ

当社は、国際のETF VIX短期先物指数に関して、特定の指標に連動する投資成果を目的として発行された有価証券として信託財産に組み入れている下記有価証券の発行体であるパークレイズ・バンク・ピーエルシーの信用格付が変更されたことを確認しましたので、お知らせいたします。

ケース	格付対象	
ETFの投資信託財産等がカウンター・パーティの発行する有価証券の場合	当該有価証券	<input type="checkbox"/>
	カウンター・パーティ(発行体格付)	<input checked="" type="checkbox"/>
ETFの投資信託財産等がカウンター・パーティとの契約に係る権利である場合	カウンター・パーティが発行する債券(個別債券格付)	<input type="checkbox"/>
	カウンター・パーティ(発行体格付)	<input type="checkbox"/>

記

1. 格付機関による格付の変更の公表日
平成 27 年 6 月 9 日
2. 当該有価証券の名称
S&P 500 VIX Short-Term Futures 連動債
3. 格付機関による変更の内容及びその理由

(変更前)

格付機関	格付け	方向性
スタンダード&プアーズ・レーティングズ・サービス	A	アウトルック:ネガティブ

(変更後)

格付機関	格付け	方向性
スタンダード&プアーズ・レーティングズ・サービス	A-	アウトルック:ステイブル

※ 格付け「A」水準は格付機関の定義で「債務を履行する能力は高いが、事業環境や経済状況の悪化からやや影響を受けやすい。」としております。なお、マイナス記号はA格内における相対的な強さを表します。また、方向性は今後6ヵ月から2年の間に格付けが変更されると予想する場合に公表されます。格付けが上方に向かう可能性があれば「ポジティブ」、下方に向かう可能性があれば「ネガティブ」、安定的に推移しそうであれば「ステイブル」としております。

米国の格付機関であるスタンダード&プアーズ・レーティングズ・サービスは、平成 27 年 6 月 9 日付で、上記有価証券の発行体であるパークレイズ・バンク・ピーエルシーの信用格付の見直しを行い、上記の通り変更しました。

4. 当該変更が銘柄に与える影響

当該変更が国際のETF VIX短期先物指数の取引価格等に与える影響は無いものと考えております。

今回の変更は金融危機発生時における英国政府による銀行支援の枠組みを見直した結果によるものであり、発行体の独自要因による信用力の変化に起因したものではありません。

なお、一般的には投資している有価証券等の発行体の財務状況または信用状況の悪化等の影響により、ETFの基準価額は下落し、損失を被ることがあります。

以上