

2020年12月17日

投資家の皆様へ

Global X Japan 株式会社

(YLCO) グローバルX イールドコー&再生可能エネルギー ETF  
の内容変更に関する重要なお知らせ

投資家の皆様には、Global X の ETF にご投資いただきまして、誠にありがとうございます。

さて、Global X Management Company, Inc.(以下「Global X 社」)が設定・運用を行っております上場投資信託『(YLCO) グローバルX イールドコー&再生可能エネルギー ETF』(以下「当ETF」)にご投資いただいております投資家の皆様に、当ETFの内容変更に関する重要なお知らせをご報告申し上げます。

当ETFの対象指数を算出しております指数会社(以下「Indxx社」)は、2021年2月1日付(米国時間)で指数の構築方法および指数名の変更を行うことを決定いたしました。これを受け、当ETFを設定・運用しておりますGlobal X社では、2021年2月1日より当ETFの名称とティッカーシンボルの変更を行います。

(次ページ「記」をご参照ください。)

当ETFにご投資いただいております投資家の皆様には、今回の当ETFの内容変更に関しまして十分にご理解いただきたくお願い申し上げます。なお、今回の内容変更をご理解いただきました上で、ご投資を継続される場合には、特段の手続きは必要ございません。

また今後、当ETFにご投資される際には、2021年2月1日より、当ETFの内容が変更されますことを、十分にご理解いただいた上でのご投資をお願い申し上げます。

投資家の皆様には、当ETFの変更内容のご確認など、ご負担をお掛けいたします。

何卒ご理解賜りますようお願い申し上げます。

(次ページへ)

# GLOBAL X

## 記

変更期日：2021年2月1日（米国時間）

変更内容：（1）Indxx社による当ETFの対象指数の指数構築方法の変更および名称変更

（2）Global X社による当ETFの名称変更およびティッカーシンボルの変更

※なお、当ETFの日本語名称も2月1日に変更する予定です。

### ➤ 詳細（1）Indxx社による当ETFの対象指数の指数構築方法の変更および名称変更

	変更前	変更後
インデックスの名称	Indxx YieldCo & Renewable Energy Income Index	Indxx Renewable Energy Producers Index
インデックスの定義（対象企業）	再生可能エネルギー関連企業のなかで一定の配当金利回りの条件を満たした企業	風力、水力、太陽熱、地熱、バイオなどから再生可能エネルギーを生産する関連企業
セクター分類	同社サブ・テーマ基準	FactSet 産業基準
銘柄選定基準	<ul style="list-style-type: none"><li>・ユニバースの中で過去12ヵ月の配当利回りが2%以上の銘柄</li><li>・ポートフォリオが30銘柄以下の場合、最低時価総額基準を3億米ドルに変更</li><li>・それでも30銘柄に達しない場合、利回り基準を緩和する</li></ul>	<ul style="list-style-type: none"><li>・再生可能エネルギーを生産する関連企業（同部門の売上率が全体の50%以上）のうち、時価総額の上位50銘柄（最低基準5億米ドル）</li><li>・ポートフォリオが50銘柄以下の場合、50銘柄に達するまで時価総額基準を緩和</li></ul>

※出所：Indxx社のホームページより抜粋。

変更内容のご理解のため、上記比較表の表現が原文と異なる場合がございます。

※FactSet：金融情報及び分析ソフトウェア等を提供する米国の金融情報提供会社

### ➤ 詳細（2）Global X社による当ETFの名称変更およびティッカーシンボルの変更

	変更前	変更後
名称変更	Global X YieldCo & Renewable Energy Income ETF	Global X Renewable Energy Producers ETF
ティッカーの変更	YLCO	RNRG

（次ページへ）

# GLOBAL X

以下は当 ETF の内容変更に関する背景等につきまして、Q&A 形式でご説明をさせていただきます。

Q1：今回の指数構築方法の変更の背景を教えてください。

当 ETF が対象としている指数は利回りを追求することも、その目的の一つです。しかし米国金融市場では、利回りの追求を「主たる目的」の他の ETF や投資信託は多く存在しています。一方、再生エネルギーの分野は高い成長が見込まれるものと Indxx 社での判断もあります。

そこで二つの目的を合わせた現行の指数構築方法から、より成長性の高い投資を「主たる目的」とした指数構築方法に変更することで、指数の目的を明確にすることができること、またそのことが当指数を利用する方々の投資判断の利便性を向上させることができるものと Indxx 社は判断し、指数構築方法の変更を決定いたしました。

Q2：今回は指数構築方法の大幅な変更がなされましたが、これを受けて Global X 社はなぜこの ETF を存続させることを決定したのですか？

今回の Indxx 社の方針を受け、Global X 社では十分な検討を行ないました。このまま当 ETF を存続させることは、当初の目的の一部を変更することになりますので、あらゆる面から慎重に検討を行ないました。Indxx 社による指数構築方法の変更の主旨(上記 Q1 をご参照下さい)を踏まえ、かつそのことが当 ETF の投資家の皆様の投資判断の利便性に適うものと Global X 社は判断し、当 ETF の存続を決定いたしました。

従いまして、Global X 社としましては、当 ETF にご投資いただいております投資家の皆様には、今回の指数構築方法の変更、すなわち当 ETF の目的の変更の主旨を十分ご理解された上で、今後の投資のご判断をしていただけますよう切にお願い申し上げます。

Q3：指数構築方法の変更前と後では、構成銘柄はどのように変わりますか？

当指数の指数構築方法の中には、リバランスのタイミングについても規定されています。今回の指数構築方法の変更に伴って、年 4 回のリバランスから年 2 回のリバランスに変更されます。現行の指数構築方法による 2020 年 12 月のリバランスは実行されず、2021 年 1 月末（改定後の指数は 2 月 1 日より算出開始）（それぞれ米国時間）にリバランスを行ないません。改訂後の指数構築方法では、毎年 1 月末と 7 月末にリバランスが行われることとなりますが、改定後の指数の構成銘柄は 2020 年 12 月 24 日（米国時間）に、各銘柄の構成比率については 2021 年 1 月 21 日（米国時間）にそれぞれ Indxx 社より公表されます。

従いまして、現時点では指数構築方法の改訂の前後の構成銘柄の違いについては判明しておりません。判明したところで Global X Japan 株式会社のホームページの「お知らせ」に掲

# GLOBAL X

載させていただく予定です。投資家の皆様には掲載内容をご確認いただけますようお願い申し上げます。

Q4：今回の変更によって、基準価額や口数に変化は生じますか？

今回の変更は当 ETF の対象指数の構築方法変更になります。当 ETF の純資産や口数が変更されるものではありません。従いまして基準価額につきましては連続いたします。また 2021 年 1 月末と 2 月 1 日の間に、投資家の皆様が保有しておられます口数にも変更は生じません。

Q5：改訂後の想定利回りはどのくらいになりますか？

現時点では、改定後の指数構成銘柄やその各銘柄の構成比率は公表されておられません。（上記 Q3 をご参照ください。）

しかし指数構築方法の変更により、現行の方法における銘柄選定ルールの一つとなっております「過去 12 ヶ月の配当利回りが 2 %以上の銘柄」というスクリーニング条件が無くなりますので、ポートフォリオ全体の利回りは現状より低くなるものと Global X 社では見えています。

しかしながら改定後の指数構成銘柄、その構成比率が判明しておられませんので、現時点では想定利回り等のポートフォリオの状況につきましてはご案内が困難となっています。投資家の皆様には何卒ご理解賜りますようお願い申し上げます。

Q6：当 ETF を保有しています。何か手続きは必要ですか？

今回の改訂に際しまして、投資家の皆様に、何らかのお手続きをお願いすることはございません。

## 【お問い合わせ先】

Global X Japan 営業部 米山 (070-7595-2183)・崔(チェ) (070-7595-2186)

## 【付記】

Global X Japan 株式会社は、Global X 社が設定・運用する米国市場上場の ETF に関する情報提供サービスを行っております。当 ETF の関係法人ではありませんが、Global X 社の代理業務として、投資家の皆様にご報告させていただいております。

以上