

2025年7月31日

各 位

管理会社名 ブラックロック・ジャパン株式会社
代表者名 代表取締役社長 橋本 幸子
問合せ先 プロダクト・ソリューション部 田崎 遼也
(TEL. 03-6703-4656)

iシェアーズ MSCI 日本株最小分散 ETF (1477)
ベンチマークに関するお知らせ

本日、ブラックロック・ジャパン株式会社を管理会社とする上場 ETF について、下記の通りベンチマークについて計算方法の変更が行なわれる事になりましたので、お知らせいたします。

記

1. 変更の対象となるファンド名称 (銘柄コード)
iシェアーズ MSCI 日本株最小分散 ETF (1477)
2. ベンチマークの名称 (銘柄コード)
MSCI日本株最小分散指数 (配当込み)
3. 変更の内容
2025年8月の指数の見直しより、対象ファンドのベンチマークの計算方法が次の通り変更されます。
 - リバランス頻度の変更
年2回から年4回へ変更。年間売買回転率の上限は維持され、見直し時期ごとの制限を調整します。
 - リスクモデルデータ
使用するリスクモデルデータを「月末時点」から「利用可能な最新データ」に変更し、よりタイムリーな市場反映を可能にします。
 - 制約条件の緩和手順
制約条件の最適化時に「売買回転率の制約」と「最小ウェイト制約」を順番に緩和していましたが、緩和幅を縮小しながら両制約を交互に緩和する方式に変更します。

MSCI Inc社からのアナウンスメントはこちら

<https://www.msci.com/documents/1296102/43946801/Consultation+on+Potential+Enhancements+to+the+MSCI+Momentum+Indexes+and+MSCI+Minimum+Volatility+Indexes+Methodologies.pdf/11784cfe-a98e-832d-38d7-4bdeb3337c01?t=1731965656742>

MSCI Inc社からベンチマークの新規の計算方法が公開されましたら、弊社ホームページでの指数ハンドブックへのリンクを更新いたします。

以上