

2026 年 8 月 24 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 牧野 弥子
(TEL. 03-6703-4100)

iシェアーズ S&P 500 プレミアムインカム ETF (452A)
iシェアーズ 米国債20年超 プレミアムインカム ETF (453A)
の連動対象指数のメソドロジー変更のお知らせ

ブラックロック・ジャパン株式会社を管理会社として上場する下記ETF銘柄について、連動対象指数のメソドロジー変更が公表されたため、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 S&P 500 プレミアムインカム ETF (452A)

iシェアーズ 米国債20年超 プレミアムインカム ETF (453A)

2. 変更予定日

2026 年 9 月 18 日

3. 変更の内容

今回の指数メソドロジー変更により、コールオプションの売建ての頻度および権利行使の設定方法が、以下のとおり変更されます。

連動対象指数のメソドロジー：

ファンド名称	iシェアーズ S&P 500 プレミアムインカム ETF	iシェアーズ 米国債 20 年超 プレミアムインカム ETF
連動対象指数	Cboe S&P 500 エンハnst 1% OTM バイライト NTR 指数（円建て）	Cboe TLT・2% OTM・バイライト・インデックス（国内投信用、円建て）

指数メソッドロジーの概要 (変更後)	IVV（S&P 500 指数に連動する米国 ETF）のロングポジションと、4 週間後に満期を迎える 1%アウト・オブ・ザ・マネーの SPX コールオプションを、4 本に分けて毎週順次売り建てるカバードコール戦略のパフォーマンスを反映します。ただし、1%アウト・オブ・ザ・マネーのコールオプションのプレミアムが所定の水準を下回る場合は、アット・ザ・マネーの SPX コールオプションを売り建てます。	TLT（残存期間 20 年超の米国債で構成される指数に連動する米国 ETF）のロングポジションと、4 週間後に満期を迎える 2%アウト・オブ・ザ・マネーの TLT コールオプションを、4 本に分けて毎週順次売り建てるカバードコール戦略のパフォーマンスを反映します。ただし、2%アウト・オブ・ザ・マネーのコールオプションのプレミアムが所定の水準を下回る場合は、アット・ザ・マネーのコールオプションを売り建てます。
指数メソッドロジーの概要 (変更前)	IVV（S&P 500 指数に連動する米国 ETF）のロングポジションと、毎月満期を迎える 1%アウト・オブ・ザ・マネー SPX コールオプションのショートを使用したカバードコール戦略のパフォーマンスを反映します。	TLT（残存期間 20 年超の米国債で構成される指数に連動する米国 ETF）のロングポジションと、毎月満期を迎える 2%アウト・オブ・ザ・マネー TLT コールオプションのショートを使用したカバードコール戦略のパフォーマンスを反映します。

変更内容に関する更なる詳細は、指数算出先である Cboe Global Indices, LLC 社の開示資料（英語）をご参照ください。

- https://cdn.cboe.com/resources/release_notes/2026/Consultation-Results-Regarding-Methodology-Changes-for-Select-Cboe-Fixed-Income-and-ETF-BuyWrite-Indices.pdf

以上