

Product highlights

FTSE
Russell

FTSE Global Equity Index Series (FTSE GEIS)

十分な情報に基づいた投資判断とプロダクト・イノベーションをサポート

FTSE GEISは、投資対象として厳選された、先進国および新興国49市場の投資可能な時価総額の99%以上をカバーすることを目標としています。モジュール方式の設計により、包括的なインデックス・ファミリーは、企業規模、国、地域、セクター、スタイルごとの厳格なターゲティングが容易に実現できます。FTSE GEISは、複数の資産クラスを対象とするFTSE Russellの拡大するインデックス・プラットフォームに投資家が期待する汎用性を提供するものです。

FTSE GEISのカバレッジとモジュラー性

FTSE GLOBAL SMALL CAP

ネット時価総額5.9兆ドル
5,076銘柄

FTSE ALL-WORLD*

時価総額51.8兆ドル
3,975銘柄(大型株・中型株)

FTSE GLOBAL MICRO CAP

時価総額1.3兆ドル
8,551銘柄

FTSE GLOBAL ALL CAP

時価総額57.8兆ドル
9,051銘柄(大型株・中型株・小型株)

FTSE DEVELOPED TOTAL CAP

時価総額52.3兆ドル
11,703銘柄(大型株・中型株・小型株・マイクロキャップ)

FTSE EMERGING TOTAL CAP

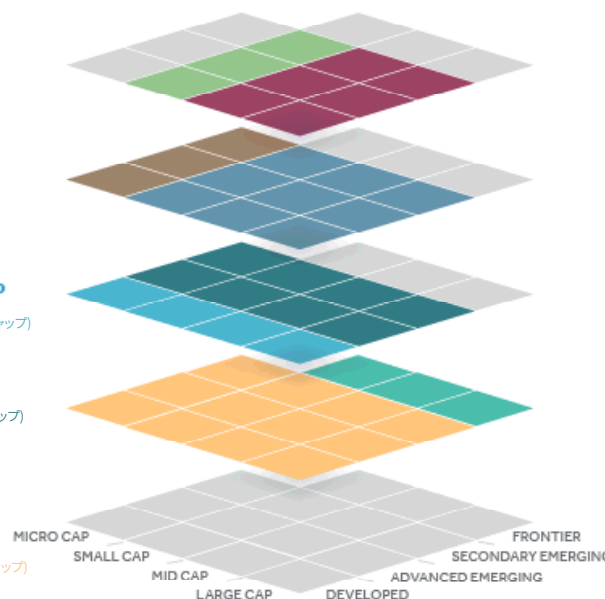
第一・第二新興国
時価総額6.7兆ドル
5,899銘柄(大型株・中型株・小型株・マイクロキャップ)

FTSE FRONTIER

時価総額900億ドル
331銘柄(大型株・中型株・小型株)

FTSE GLOBAL TOTAL CAP

時価総額59兆ドル
17602銘柄(大型株・中型株・小型株・マイクロキャップ)



出所: FTSE Russell、データは2020年9月21日の取引時間内

ルール・ベースの柔軟性

FTSE GEISは、偏りのない透明性の高い手法に準拠していますが、その手法はすべてにフィットする固定的なものではありません。広範なインデックスのモジュールは、投資家が求める多様な目的と極めて高い柔軟性を示す汎用性を備えながら、グローバルなガバナンス基準もすべて盛り込んでいます。

包括的な視点

インデックスのガバナンスと商品開発プロセスには、お客様とのコラボレーションや外部の専門家からなる委員会の助言が反映されており、貴重な知的価値を創出し、当社の知見を強化しています。

信頼できるパートナー

1.5兆ドル以上の運用資産がFTSE GEISをトラックしており、アクティブ運用戦略のベンチマークとして、またETF等のパッシブ運用の投資ビークルのベースとして、利用されています。¹

1 出所: 2020年4月1日に公表された、2019年12月31日時点のeVestment (機関投資家の運用資産)、Morningstar (個人投資家向け投信、保険商品、ETF)。加えて、パッシブ運用資産については、FTSE Russellが直接集計したデータも反映。運用資産残高のデータにはブレンド・ベンチマーク運用が含まれ、先物やオプションは除外されています。重複を避けるため、FTSE Russellが直接収集したパッシブ資産は、サードパーティーのデータから除外されています。FTSE Russellはデータの正確性について保証するものではありません。

世界共通の分類法

FTSE GEISは、定量的かつ測定可能な属性に基づいて市場や証券を定義することにより、グローバル株式市場を偏りなく反映しており、投資家が市場機会を追跡し、評価するための信頼性の高い手段を提供しています。

FTSE GEIS

データに基づいた詳細な分類

市場の状況		サイズ		運用スタイル		産業 (ICB®)	
先進国	第一新興国	大型株	中型株	グロース	バリュー	業種	セクター
第二新興国	フロンティア	小型株	マイクロキャップ	ディフェンシブ	ダイナミック	スーパーセクター	サブセクター

FTSE GEIS headline indexes

インデックス	FTSE Global Total Cap	FTSE Global All Cap	FTSE All-World®	FTSE Global Small Cap	FTSE Global Small/Micro Cap	FTSE Global Micro Cap
構成銘柄の時価総額セグメント	大型株、中型株、小型株、マイクロキャップ	大型株、中型株、小型株	大型株、中型株	小型株	小型株、マイクロキャップ	マイクロキャップ
FTSE Global Total Cap Indexに占める比率	100%	98%	88%	10%	12%	2%
ネット時価総額(米ドル)	59	57.8	51.8	5.9	7.2	1.3
国数	49	49	49	49	49	49
先進国	25	25	25	25	25	25
新興国	24	24	24	24	24	24
第一新興国	10	10	10	10	10	10
第二新興国	14	14	14	14	14	14
構成銘柄数	17,602	9,051	3,975	5,076	13,627	8,551
先進国	11,703	5,648	2,138	3,510	9,565	6,055
新興国	5,899	3,403	1,837	1,566	4,062	2,496
第一新興国	2,522	1,072	429	643	2,093	1,450
第二新興国	3,377	2,331	1,408	923	1,969	1,046

出所：FTSE Russell、データは2020年9月21日の取引開始時間

FTSE Russellのインデックスに関する詳細はftserussell.comをご覧ください。

© 2020 London Stock Exchange Group plc and its applicable group undertakings (the “LSE Group”). The LSE Group includes (1) FTSE International Limited (“FTSE”), (2) Frank Russell Company (“Russell”), (3) FTSE Global Debt Capital Markets Inc. and FTSE Global Debt Capital Markets Limited (together, “FTSE Canada”), (4) MTSNext Limited (“MTSNext”), (5) Mergent, Inc. (“Mergent”), (6) FTSE Fixed Income LLC (“FTSE FI”), (7) The Yield Book Inc (“YB”) and (8) Beyond Ratings S.A.S. (“BR”). All rights reserved.

FTSE Russell® is a trading name of FTSE, Russell, FTSE Canada, MTSNext, Mergent, FTSE FI, YB and BR. “FTSE®”, “Russell®”, “FTSE Russell®”, “MTS®”, “FTSE4Good®”, “ICB®”, “Mergent®”, “The Yield Book®”, “Beyond Ratings®” and all other trademarks and service marks used herein (whether registered or unregistered) are trademarks and/or service marks owned or licensed by the applicable member of the LSE Group or their respective licensors and are owned, or used under licence, by FTSE, Russell, MTSNext, FTSE Canada, Mergent, FTSE FI, YB or BR. FTSE International Limited is authorised and regulated by the Financial Conduct Authority as a benchmark administrator.

All information is provided for information purposes only. All information and data contained in this publication is obtained by the LSE Group, from sources believed by it to be accurate and reliable. Because of the possibility of human and mechanical error as well as other factors, however, such information and data is provided “as is” without warranty of any kind. No member of the LSE Group nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors make any claim, prediction, warranty or representation whatsoever, expressly or impliedly, either as to the accuracy, timeliness, completeness, merchantability of any information or of results to be obtained from the use of FTSE Russell products, including but not limited to indexes, data and analytics, or the fitness or suitability of the FTSE Russell products for any particular purpose to which they might be put. Any representation of historical data accessible through FTSE Russell products is provided for information purposes only and is not a reliable indicator of future performance.

No responsibility or liability can be accepted by any member of the LSE Group nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors for (a) any loss or damage in whole or in part caused by, resulting from, or relating to any error (negligent or otherwise) or other circumstance involved in procuring, collecting, compiling, interpreting, analysing, editing, transcribing, transmitting, communicating or delivering any such information or data or from use of this document or links to this document or (b) any direct, indirect, special, consequential or incidental damages whatsoever, even if any member of the LSE Group is advised in advance of the possibility of such damages, resulting from the use of, or inability to use, such information.

No member of the LSE Group nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors provide investment advice and nothing contained herein or accessible through FTSE Russell products, including statistical data and industry reports, should be taken as constituting financial or investment advice or a financial promotion.

Past performance is no guarantee of future results. Charts and graphs are provided for illustrative purposes only. Index returns shown may not represent the results of the actual trading of investable assets. Certain returns shown may reflect back-tested performance. All performance presented prior to the index inception date is back-tested performance. Back-tested performance is not actual performance, but is hypothetical. The back-test calculations are based on the same methodology that was in effect when the index was officially launched. However, back-tested data may reflect the application of the index methodology with the benefit of hindsight, and the historic calculations of an index may change from month to month based on revisions to the underlying economic data used in the calculation of the index.

This document may contain forward-looking assessments. These are based upon a number of assumptions concerning future conditions that ultimately may prove to be inaccurate. Such forward-looking assessments are subject to risks and uncertainties and may be affected by various factors that may cause actual results to differ materially. No member of the LSE Group nor their licensors assume any duty to and do not undertake to update forward-looking assessments.

No part of this information may be reproduced, stored in a retrieval system or transmitted in any form or by any means, electronic, mechanical, photocopying, recording or otherwise, without prior written permission of the applicable member of the LSE Group. Use and distribution of the LSE Group data requires a licence from FTSE, Russell, FTSE Canada, MTSNext, Mergent, FTSE FI, YB, BR and/or their respective licensors.

FTSE Russell について

FTSE Russell は、世界をリードするグローバル・インデックスブランドであり、様々な資産クラス、スタイル、戦略にわたりお客様のニーズを満たすために、幅広いインデックス、データ、および測定・ベンチマークするのに必要なツールを提供しています。投資可能市場の98%をカバーするFTSE Russellインデックスは、経験豊富なプロフェッショナルが世界中のローカルベンチマークから得た深い業界知識と理論的な探究に基づいて構築し、維持管理しています。

FTSE Russellのインデックスの専門知識とプロダクトは、世界中の機関投資家や個人投資家によって幅広く使用されています。30年以上にわたり、一流のアセット・オーナー、アセット・マネージャー、ETFプロバイダー、および投資銀行はその投資パフォーマンスをベンチマークし、ETF、仕組商品、インデックス・ベースのデリバティブを作成するのにFTSE Russellインデックスを参考にしてきました。FTSE Russellのインデックスは、お客様のアセット・アロケーション、投資戦略の分析、リスク管理のためのツールにもなっています。

中核をなす一連の普遍的な原則が、FTSE Russellインデックスの設計と管理の指針となっています。透明性が高くルールに基づいた手法は、有力な市場関係者で構成される独立委員会から得られた知見に裏付けられています。FTSE Russell は業界最高の水準を掲げてIOSCO原理を遵守し、インデックスのイノベーションとお客様とのパートナーシップに全力を注ぎます。FTSE Russellは、ロンドン証券取引所グループの完全子会社です。

詳細はftserussell.comをご覧ください。

詳細については ftserussell.com をご覧頂くか、info@ftserussell.com までeメールでご連絡ください。下記の当社各拠点のFTSE債券インデックス担当チームにお電話いただくこともできます。

欧州・中東・アフリカ
+44 (0) 20 7866 1810

北米
+1 877 503 6437

アジア・パシフィック
香港 +852 2164 3333
東京 +81 (3) 4563 6346
シドニー +61 (0) 2 8823 3521