

FTSE Blossom Japan Index

v2.7



目次

セクション 1 はじめに.....	3
セクション 2 運営・管理責任.....	4
セクション 3 FTSE Russell インデックス ポリシー.....	5
セクション 4 適格有価証券.....	7
セクション 5 サステナブル投資（SI）データ入力.....	9
セクション 6 構成銘柄の定期的見直し.....	11
セクション 7 構成銘柄の変更.....	11
セクション 8 コーポレートアクションおよびイベント.....	13
セクション 9 業種分類ベンチマーク（Industry Classification Benchmark: ICB）.....	15
セクション 10 インデックスウェイト.....	16
付録 A 外国為替レート.....	17
付録 B 気候サブセクターグループ.....	18
付録 C 追加情報.....	21

セクション 1

はじめに

はじめに

- 1.1 本書は、FTSE Blossom Japan Index の運営および算出に係わる基本ルールを説明したものです。本ルールのコピーは www.lseg.com/en/ftse-russell/ から入手できます。
- 1.2 FTSE Blossom Japan Index は、FTSE Japan Index と業種（ICB セクター）ニュートラルにしつつ、明確な環境・社会・ガバナンス（ESG）のグローバル基準を満たす日本企業のパフォーマンスが反映される様に設計されています。
- 1.3 FTSE Blossom Japan Index は、インデックス設計に ESG ファクターを考慮します。詳細はセクション 4 を参照してください。
- 1.4 当インデックスは、米国ドルおよび日本円で算出されます。
- 1.5 本インデックスのプライスリターン・インデックスとトータルリターン・インデックスは、終値ベースで算出されます。
トータル・リターンは、配当込みベースで算出されます。尚、配当金は企業公表値を適用します。
- 1.6 **FTSE Russell**
FTSE Russell は FTSE International Limited、Frank Russell Company、FTSE Global Debt Capital Markets Limited（およびその子会社 FTSE Global Debt Capital Markets Inc.ならびに FTSE Fixed Income Europe Limited）、FTSE Fixed Income LLC、The Yield Book Inc.、Beyond Ratings の商標名です。
- 1.7 **IOSCO**
- 1.7.1 FTSE は、FTSE Blossom Japan Index は 2013 年 7 月に公表された IOSCO の金融ベンチマーク原則を満たしていると考えます。
- 1.8 FTSE Russell は、FTSE Russell のコントロールが及ばない外部事象を含む様々な状況において、当インデックスの変更、中断、中止が余儀なくされる場合があること、また、当インデックスを参照するインデックス・ファンドなどの投資商品や諸契約は、当インデックスの変更、中断、中止に耐え得るか、その可能性に対応できるものであるべきことを、当インデックス利用者に対し表明するものです。
- 1.9 本インデックスに追随する運用を行うユーザー、または本インデックスに追随する商品を購入するユーザーは、自己資金、あるいはクライアントの資金で投資をする前に、当インデックスの長所を評価し、独立した立場にある者の助言を受けてください。FTSE Russell（または、これらの基本原則の作成および発行に関係するすべての人）は、以下による結果について、個人の被った損失、損害、請求、費用について一切の責任を負いません。
- 当基本ルールに対する依存、および/もしくは
 - 当基本ルールの不正確、および/もしくは
 - 当基本ルールに記載されている方針または手続きの不適用、誤用、および/もしくは
 - インデックスまたはデータの構成銘柄を組成する際の何らかの不正確性。

セクション 2

運営・管理責任

運営・管理責任

2.1 FTSE International Limited (FTSE)

2.1.1 FTSE は、インデックス・ベンチマークの管理者です。¹

2.1.2 FTSE Russell はインデックスの日次計算、構築、運用の責任を負っており、次のことを行います。

- インデックスを構成する全銘柄に関し、ウェートの記録を保管する
- 基本ルールに従って、銘柄入替えとそのウェート変更を行う
- 基本ルールに従って、インデックスの定期的な見直しを行い、その結果によって必要な変更を行う
- 継続的なメンテナンスと定期的な見直しによるウェート変更を公表する
- インデックスを配信する

2.2 基本ルールの改訂

基本ルールが指標シリーズの目的を最も適切に継続的に反映することができるよう、同ルールは FTSE Russell による定例見直し（少なくとも年 1 回）の対象になります。基本ルール大幅な改訂の提案に関しては、FTSE Russell Advisory Committee 及び必要に応じその他の利害関係者との協議に付されます。FTSE Russell Index Governance Board は、これらの協議結果を踏まえ、改訂の承認を判断します。

2.2.1 FTSE Russell Equity Indices の Statement of Principles に規定の通り、基本ルールに言及されていない、または具体的かつ明確に規定されていない事項に関して FTSE Russell が決定を下す場合、Statement of Principles に則って実際的な決定を行うものとします。上記の様な決定が行われた場合、FTSE Russell はその決定内容を速やかに公表します。また、上記の取扱いが、基本ルールの例外、変更、将来の前例など見做されない場合においても、FTSE Russell は、基本ルールをより明確な規定にするための改訂が必要かどうかを検討します。

¹ 本文書で管理者/アドミニストレーターという言葉は、[金融商品と金融契約のベンチマークとして用いられる指標、または投資資金のパフォーマンス測定を行うことに関する、2016 年 6 月 8 日付けの欧州議会ならびに欧州連合理事会による規制（欧州連合）2016/1011（欧州ベンチマーク規制）](#) および [2019 年付けベンチマーク（改正および経過規定）（EU 離脱）規則（英国ベンチマーク規則）](#) における定義と同義で使用されます。

セクション 3

FTSE Russell インデックス ポリシー

FTSE Russell インデックス ポリシー

基本ルールは、以下のリンクからご覧いただけるインデックス方針ドキュメントと併せてご参照下さい。

3.1 コーポレートアクションおよびイベント・ガイド

3.1.1 コーポレートアクションおよびイベントによる構成企業の変更の詳細は、以下のリンクからご覧いただけるコーポレートアクションおよびイベント・ガイドをご参照下さい。

[Corporate Actions and Events Guide.pdf](#)

3.2 FTSE Russell 時価総額加重株価指数の Statement of Principles (Statement of Principles)

3.2.1 インデックスは市場の変化に対応する必要がある一方、基本ルールはすべての事態を予測することはできません。基本ルールが特定の事象または変化を十分にカバーしていない場合は、FTSE Russell は、インデックス構築に対する FTSE Russell の基本的考え方をまとめた原則声明 (Statement of Principles) を参照して適切な取り組みを決定します。Statement of Principles は毎年見直され、FTSE Russell により提案される変更事項は FTSE Russell Policy Advisory Board に提出後、議論され、最終的には FTSE Russell の Index Governance Board により承認されます。

原則声明は、次のリンクからご覧いただけます：

[Statement of Principles.pdf](#)

3.3 お問い合わせ、苦情、異議申し立て

3.3.1 インデックスの構成銘柄である企業（またはその代理人）、構成銘柄となることを見込まれる企業（またはその代理人）、政府機関、または業として活動する組織においてインデックスを利用する者による 10 人以上のグループは、FTSE Russell の決定に対して異議申し立てを行うことができます。

FTSE Russell の苦情申し立て手続きは、次のリンクからご覧いただけます：

[Benchmark Determination Complaints Handling Policy.pdf](#)

FTSE Russell への異議申し立てのプロセスは、次のリンクをご参照下さい：

[Appeals Against Decisions.pdf](#)

3.4 取引停止または市場閉鎖の際のインデックス取り扱い方針

3.4.1 取引停止または市場閉鎖の際のインデックスの取り扱いに関するガイダンスは、次のリンクをご参照下さい。

[Index Policy for Trading Halts and Market Closures.pdf](#)

3.5 顧客が市場または有価証券の取引ができない場合のインデックス取り扱い方針

3.5.1 FTSE Russell のインデックス取り扱いの詳細は、次のリンクをご参照下さい。

[Index Policy in the Event Clients are Unable to Trade a Market or a Security.pdf](#)

3.6 再計算方針とガイドライン

3.6.1 何らかの不正確さが認識される際、FTSE Russell は、FTSE Russell インデックス再計算ガイドラインに定められたステップに沿って、ひとつのインデックスまたはインデックス・シリーズ全体を再計算すべきか、また関連データ・プロダクトを改定すべきかを決定します。FTSE Blossom Japan Index の利用者は適切な媒体を通じて、その通知を受けることになります。

FTSE Russell 再計算方針およびガイドラインの詳細は、次のリンクから FTSE Russell のウェブサイトでご覧いただくか、info@ftserussell.com までお問い合わせください。

[Recalculation Policy and Guidelines Equity Indices.pdf](#)

3.7 再計算方針とガイドライン – ESG データとスコア

ESG データ商品の不正確さが認識される際、FTSE Russell は ESG データ商品を再計算すべきと決定する文書に記述されるガイドラインに従います。

[Recalculation Policy and Guidelines ESG Products.pdf](#)

3.8 FTSE Russell のベンチマーク・メソドロジーの変更

3.8.1 FTSE Russell のベンチマーク・メソドロジーの変更は、次のリンクをご参照下さい：

[Policy for Benchmark Methodology Changes.pdf](#)

3.9 FTSE Russell のガバナンスの枠組みからご覧ください。

3.9.1 これらインデックスの監修にあたり、FTSE Russell では、プロダクト、サービス、テクノロジーの管理を行うガバナンス・フレームワークを採用しています。このフレームワークには、ロンドン証券取引所グループによる防衛リスク管理フレームワークの 3 つの防衛線が組み込まれており、金融ベンチマークの IOSCO 原則²、欧州ベンチマーク規則³、また英国ベンチマーク規則への準拠を確実にしています⁴。FTSE Russell ガバナンス・フレームワークの詳細は、次のリンクをご参照下さい：

[FTSE Russell Governance Framework.pdf](#)

3.10 リアルタイム・ステータスの定義

3.10.1 リアルタイムで計算されるインデックスについては、リアルタイム・ステータス定義の詳細を掲載する以下のガイドをご覧ください。

[Real Time Status Definitions.pdf](#)

² IOSCO Principles for Financial Benchmarks Final Report, FR07/13 July 2013

³ 有価証券および金融契約、また投資ファンドのパフォーマンス測定にベンチマークとして使われるインデックスにおける 2016 年 6 月 8 日付けの欧州議会ならびに欧州連合理事会による規制（欧州連合）2016/1011

⁴ ベンチマーク（改正および経過規定）（EU 離脱）規則 2019

セクション 4

適格有価証券

適格有価証券

4.1 適格ユニバース

- 4.1.1 FTSE Japan All Cap Index⁵の構成銘柄を FTSE Blossom Japan Index の組入れユニバースとします。
- 4.1.2 Japanese Real Estate Investment Trusts (J-REITs) (Real Estate Investment Trusts ICB 351020) は、FTSE Blossom Japan Index への組入れには不適格とします。

4.2 総合 ESG スコア

- 4.2.1 FTSE Japan All Cap Index 各銘柄の ESG 総合スコアを、「5」を最高スコアとする 0~5 の範囲で評価します。
- 4.2.2 総合 ESG スコアが 3.3 以上の銘柄を FTSE Blossom Japan Index に組み入れます。
- 4.2.3 総合 ESG スコアが 2.9 未満、あるいは、高エクスポージャーと判断される ESG テーマにおいて、スコアが「ゼロ」の評価を受けた FTSE Blossom Japan Index の銘柄は、FTSE Blossom Japan Index から除外される可能性があります。
- 4.2.4 構成銘柄がインデックス・レビュー時にセクション 4.0 のインデックス適格性基準を満たさず、1 年後のインデックス・レビュー時にもやはり適格性基準に達しない場合、その銘柄は除外されます。インデックス・ユーザーに対してはクライアント通知により、除外される可能性のある銘柄リストを提供します。FTSE Russell は、こうした構成銘柄企業に対しても、インデックスから除外される恐れがある旨を伝えるよう適切な取り組みを行います。

FTSE Russell ESG スコアの詳細については、次のリンクをご参照下さい。

[FTSE Russell の ESG スコア評価](#)

4.3 原子力発電事業および乳児用母乳代替ミルク製造業

- 4.3.1 上記の組入れ基準に加え、異論の多い製品やサービスを提供する事業内容の企業では、より高い組入れ基準を満たす必要があります。
 - 原子力発電に関係する企業は、FTSE Blossom Japan Index に組入れられるためには、健康及び安全に関するテーマに適用されるセクター特定指標を一つ以外全て満たす必要があります。
 - 乳児用粉ミルクおよび母乳代替ミルク製造に関係する企業は、FTSE Blossom Japan Index に組入れられるためには、顧客に対する責任に関するテーマに適用されるセクター特定指標を一つ以外全て満たす必要があります。

⁵ 2020 年 12 月付で、FTSE All World Japan Index から FTSE Japan All Cap Index に変更。

4.4 不祥事のモニタリング

FTSE Blossom Japan Index における不祥事に対する評価は、当該指数シリーズを構築する ESG スコアを補完するものです。不祥事の評価を受ける企業の取扱いは、当該企業が FTSE4Good 指数シリーズの現構成銘柄であるかどうかにより異なります。

4.4.1 現在 FTSE Blossom Japan Index の構成銘柄でない場合

深刻な不祥事を起こしていると特定される企業は、FTSE Blossom Japan Index の銘柄選定時に新規選定対象外となります。

そのような企業のリストは、ESG に関わる不祥事の深刻さや批判、当該企業自体及び当該企業が世界で展開するプロジェクトに対する申立てを体系的に分析され、当該企業不祥事の深刻度合いが決定されます。深刻度合いに基づき企業にランキングが付され、グローバル (FTSE All Cap Index の構成銘柄) のランキングと比較して最も深刻な申立てを受けているとされる上位 5% が、銘柄見直し時のリストに登録されません。当該リストには、世界最大手のアセットオーナー (管理下の総資産高で上位 40 位内) が現在、環境・社会・ガバナンスにおける懸念により、ポートフォリオから除外している企業も登録されます。

4.4.2 FTSE Blossom Japan Index の既存構成銘柄である場合

FTSE Russell では、FTSE Blossom Japan Index の既存構成銘柄企業が関与する不祥事をニュースでモニタリングします。

既存構成銘柄企業の不祥事評価は、不祥事の深刻度合いに基づいたリスク・エクスポージャーと、不祥事に対する企業の対応度合いに基づくスコアにより決定されます。

これらの評価の結果、不祥事の深刻度合いが高く、対応が遅いと評価された企業は、FTSE Blossom Japan Index への組入れが 2 年間停止されます。

当該企業が 2 年間の組入れ停止期間後、再度 FTSE Blossom Japan Index への組入れ対象となるためには、ESG における全ての組入れ基準を満たし、不祥事に適切に対応し、同様に不祥事再発防止に向けた適切な措置が講じられていることが証明される必要があります。

4.5 高エクスポージャー・テーマで低評価を受けた企業

4.5.1 高エクスポージャー・テーマで「ゼロ」あるいは「1」の評価を受けた企業は FTSE Blossom Japan Index に組み入れられません。

4.6 気候関連要件

4.6.1 FTSE Blossom Japan Index への継続的および新規の組入れを査定するときに、⁶気候変動スコアの最低基準値が付与されます。採用基準値は、企業が ICB 分類の一次影響または二次影響に指定されているかどうかにより決定されます。一次および二次の ICB サブセクターは、付録 B に掲載しました。

一次影響サブセクター	気候変動スコア 3 が必要
二次影響サブセクター	気候変動スコア 2 が必要

⁶ 2021 年 6 月より

セクション 5

サステナブル投資 (SI) データ入力

SI データ入力

5.1.1 以下のサステナブル投資データセットがインデックス・シリーズ構築に使用されます。

SI データ入力	説明	組み入れ、ウェイト、除外に使用 ⁷
FTSE ESG スコア	FTSE Russell の ESG スコアとデータモデルでは、ESG の課題に対する企業のエクスポージャーと管理について、投資家は多面的に理解することができます。詳細は以下でご覧いただけます。 https://www.ftserussell.com/data/sustainability-and-esg-data/esg-ratings and Guide to FTSE and Third Party Sustainable Investment Data used in FTSE Russell Indices.pdf	選定
FTSE の行動に関するデータ	問題となる行動やダイバーシティに直接的・間接的に関与する企業活動による FTSE の除外リスト。詳細は以下でご覧いただけます。以下文書のセクション 7Guide to the Construction and Maintenance of FTSE Exclusion Lists.pdf (ftserussell.com) 。	除外
行動に関するデータ - RepRisk	RepRisk Index (RRI) は、企業の評判に関わる ESG リスク・エクスポージャーを取得・定量化します。詳細は以下でご覧いただけます。 https://www.reprisk.com/news-research/resources/methodology	除外

5.1.2 本インデックス(インデックス・シリーズ)に使用される FTSE Russell およびサードパーティ提供の SI データについて、詳しくは以下のガイドでご覧いただけます。

[Guide to FTSE and Third Party Sustainable Investment Data used in FTSE Russell Indices](#)

5.1.3 これら SI データ入力に使われるデータおよび基準についての情報も掲載されています。これらデータには推定データも含まれます。

5.2 サステナブル投資指標

5.2.1 代表部規則 (EU) 2020/1816 付則に列記される環境・社会・ガバナンス (ESG) ファクターのスコア、価値に関しては、FTSE Russell の [サステナブル投資指標](#) ウェブサイトを参照してください。本インデックス・シリーズ内ベンチマークのベンチマーク・メソドロジーはこれらを考慮して設計されています。

⁷定義

組み入れ - 構成銘柄の選定またはランク付け、また最低スコアや閾値の計算に SI データを使用

ウェイト - インデックス中の銘柄のウェイト計算に SI データを使用

除外 - インデックスからの銘柄除外に SI データを使用

5.2.2 メトリックスの方法ロジックと計算について、詳細は以下のリンクからご覧いただけます。

[Sustainability and ESG Data | FTSE Russell](#)

[Sustainable Investment Disclosures Methodology Document](#)

セクション 6

構成銘柄の定期的見直し

構成銘柄の定期的見直し

- 6.1 FTSE Blossom Japan Index は、年 2 回、6 月と 12 月に見直しが行われます。
- 6.2 インデックス見直しには、3 月の最終営業日（6 月の見直し）および 9 月の最終営業日（12 月の見直し）までに公開された年次報告書と企業サステナビリティ・レポート（CSR）または総合レポートに基づく FTSE ESG データが使われます。インデックス見直しに先立つ ESG データに組入れるため、全レポートとも同じ財務年度に公開されたものとします。CDP に報告を行う企業であれば、3 月または 9 月の最終営業日までにアクセスできるよう、FTSE Russell にも同じレポートを入手可能とすることが求められます。
- 6.3 インデックス見直しは、見直し有効日の 4 週間前の月曜日の営業終了時の市場データを使って行われます。
- 6.4 FTSE Blossom Japan Index の定期見直しによる変更事項は、6 月および 12 月の第三金曜日の業務終了後に適用されます（すなわち、翌営業日より有効となります）。

セクション 7

構成銘柄の変更

構成銘柄の変更

7.1 除外および新規組入れ

- 7.1.1 ある組入れ銘柄が FTSE Japan All Cap Index から除外された場合は、FTSE Blossom Japan Index から除外されます。除外は FTSE Japan All Cap Index の除外と同時に行われ、そのウェイトは FTSE Blossom Japan Index の残存銘柄に比例配分されます。また、FTSE Blossom Japan Index からの除外銘柄は、定期見直し期間以外に別銘柄に入れ替えられることはありません。
- 7.1.2 FTSE Japan All Cap Index への新規組入れ銘柄（ファスト・エントリーでも通常の評価エントリーでも）は、FTSE Blossom Japan Index の定期見直し時点で、FTSE Japan All Cap Index に組み入れられて少なくとも 6 ヶ月以上が経過する場合、FTSE Blossom Japan Index への組入れ候補銘柄と見做されます。

セクション 8

コーポレートアクションおよびイベント

コーポレートアクションおよびイベント

8.1 コーポレートアクションおよびイベントによる組入れ銘柄への変更についての詳細は、次のリンクから「**Corporate Actions and Events Guide for Market Capitalisation Weighted Indices**」をご覧ください。

[Corporate Actions and Events Guide.pdf](#)

コーポレートアクションとは、株主に対するアクションを言い、株価は落ち日における調整に影響されません。株価は配当落ち日の調整に従います。これらには、次の事項が含まれます。

- 資本の払い戻し
- ライツ・イシュー/エンタイトルメント・オファー
- 株式化
- 分割 / 併合
- 無償新株発行（資本化または無償交付）

コーポレートイベントとは、インデックス・ルールに即してインデックスに影響を与える可能性のある企業ニュースを言います。例えば、政策投資家が組入れ企業の株式の売却を発表したとします。これは、浮動株比率の変動要因となり、インデックス調整が必要となる場合は、FTSE Russell が調整のタイミングを通知します。

8.2 発行済み株式

発行済み株式数の変更に伴う調整は、「コーポレートアクションおよびイベント・ガイド」の記載に基づきます。

8.3 合併、買収、スピノフ

8.3.1 FTSE Blossom Japan Index に組み入れられた 2 企業が合併した場合、または FTSE Blossom Japan Index の組入れ企業が、他の組入れ企業に買収された場合、存続企業がインデックスに残ります。

8.3.2 FTSE Blossom Japan Index の組入れ企業が、インデックス外の企業を買収した場合、買収後の存続企業がインデックスに組み入れられます。

8.3.3 組入れ企業がインデックス外の企業に買収された場合、存続企業は FTSE Blossom Japan Index から除外されます。存続企業の適格性は、買収から少なくとも 6 ヶ月が経過した後に行われる定期見直しにおいて、分析・評価が行われます。

8.3.4 組入れ企業が 2 社以上の企業に分割され、そのいずれかの企業が **FTSE Japan All Cap Index** に維持された場合、これらの企業は **FTSE Blossom Japan Index** への組入れも維持されます。当該企業の適格性は、分割から最低 6 ヶ月以上が経過した定期見直しにおいて、分析・評価が行われます。

8.3.5 重大なイベントが発生した場合、**FTSE Russell** は臨時会議を招集し、当該コーポレートイベントから生ずる事態を評価・分析し **FTSE Blossom Japan Index** の適格性に照らした助言を行います。**FTSE Russell** は、その結果として、1 社または複数の企業の **FTSE Blossom Japan Index** への組入れが不適格である状況であると判断する可能性があります。

8.4 取引の中止

取引中止についての規則は、「コーポレートアクションおよびイベントのガイド」をご覧ください。

セクション 9

業種分類ベンチマーク (Industry Classification Benchmark : ICB)

業種分類ベンチマーク (Industry Classification Benchmark : ICB) ⁸

9.1 分類構造

9.1.1 Industry Classification Benchmark (ICB) に規定されているとおり、産業、スーパーセクター、セクター、サブセクターに分類されます。

9.1.2 Industry Classification Benchmark の詳細については、FTSE Russell からご入手いただくか、FTSE Russell のウェブサイト (www.lseg.com/en/ftse-russell/) からご参照ください。

[Industry Classification Benchmark](#)

⁸ FTSE インデックスは、2022 年 3 月に新しい ICB 分類システムに移行しました。

セクション 10

インデックスウェイト

インデックスウェイト

10.1 FTSE Blossom Japan Index は、インデックスウェイト・メソドロジーに基づく見直しを、年 2 回（6 月・12 月）行います。

1. FTSE Blossom Japan Index における ICB 産業に基づく各産業ウェイトは、FTSE Japan All Cap Index における産業ウェイトと同等です。
2. FTSE Blossom Japan Index の個別銘柄 i の最大ウェイト W_i^{Max} は、FTSE Blossom Japan Index 全体の時価総額の 15% か、FTSE Japan All Cap Index 内のウェイトの 20 倍 W_i の、どちらか小さい方とします。

$$W_i^{Max} = \text{Min}(0.15, 20 \times W_i)$$

各産業ごとの上限値 IC_k は、個別銘柄ウェイトの最大値の総和になります。

$$IC_k = \sum_i W_{ik}^{Max}$$

産業 k における全銘柄について

3. 産業ごとのウェイト目標値 ITW_k は、上記 IC_k か、FTSE Japan All Cap Index における当該産業ウェイト IW_k 、のどちらか小さい方とします。

$$ITW_k = \text{Min}(IC_k, IW_k)$$

次に産業ごとのウェイト目標値 ITW_k は調整して $ITWN_k$ とされその総和が 1 となる様にします。調整後の超過分 ($ITWN_k - IC_k > 0$) はそれ以外の産業セクターに比例配分されます ($ITWN_k - IC_k < 0$)。このプロセスは、すべての産業セクターで条件が満たされるまで繰り返されます。

4. FTSE Blossom Japan Index の W_{ik}^{final} 各産業の構成銘柄 k のウェイト i には、産業ウェイトの目標値 $ITWN_k$ を反映させます。

$$W_{ik}^{final} = W_{ik} \times ITWN_k / IW4G_k$$

$IW4G_k = \sum_i W_{ik}$ とは、ユニバースにおける産業 k の業種ウェイトです。その上で、個別銘柄のウェイトが上限を超過した場合は、同産業内の別銘柄に比例配分されます。すべての銘柄で条件を満たすまで、これが繰り返されます。

10.2 インデックスウェイトの見直しには、6 月および 12 月の第一金曜日のコーポレートアクションに伴う調整済みの終値を適用します。インデックスウェイトの変更は、6 月および 12 月の第三金曜日の引け後に行われます。この際、Shares in Issue および浮動株は当該見直し月の第三金曜日の次の月曜日のそれを使用します。

付録 A

外国為替レート

FTSE Blossom Japan Index の算出に使用される外国為替レートは、WM/Refinitiv のリアルタイム・スポットレートです。

全てのインデックス計算の基本通貨は日本円です。日本円以外で表示された銘柄の価格は、インデックス算出のために日本円に換算されます。

Refinitiv から英国時間 06:20 に受領した外国為替 BID レートがインデックス算出に使用されます。これを「クロージング外国為替レート」と呼びます。

付録 B

気候サブセクターグループ

一次影響サブセクター・カテゴリー		二次影響サブセクター・カテゴリー	
533	探査と製造	583	再生可能エネルギー機器
537	総合石油・ガス	587	代替燃料
573	石油機器・サービス	2717	防衛
577	パイプライン	2723	容器・梱包
1353	原料化学品	2727	コングロマリット
1357	特殊化学	2733	電気部品・機器
1733	林業	2737	電子機器
1737	紙業	2757	機械：工業用
1753	アルミニウム	2771	デリバリーサービス
1755	非鉄	2775	鉄道
1757	鉄・鉄鋼	2777	輸送サービス
1771	石炭	2791	バックオフィスサポート
1773	ダイヤモンド・宝石	2793	企業研修会社・人材派遣会社
1775	一般鉱業	2795	財務管理
1777	金鉱	2797	産業向けサプライヤー
1779	プラチナ・貴金属	3355	自動車部品
2353	建材・備品	3357	タイヤ
2357	重量構造物建設	3533	醸造
2713	航空	3535	蒸留酒・ワイン醸造
2753	商用車・トラック	3537	ノンアルコール飲料
2773	海運	3573	農業・漁業
2779	トラック輸送	3577	加工食品
2799	廃棄処理サービス	3722	耐久家庭用品
3353	自動車	3724	非耐久家庭用品
7573	ガス供給	3726	内装
7575	多目的ユーティリティ	3728	住宅建設
5751	空運	3743	家庭用電子機器
7535	電力（従来発電）	3745	娯楽用品

一次影響サブセクター・カテゴリ	二次影響サブセクター・カテゴリ
	3747 玩具
	3763 衣料品・装飾品
	3765 靴
	3767 パーソナル用品
	3785 タバコ
	4533 ヘルスケアプロバイダー
	4535 医療機器
	4537 医療用品
	4573 バイオテクノロジー
	4577 医薬品
	5333 薬品小売
	5337 食品卸・小売
	5371 アパレル
	5373 大規模小売店
	5375 改築・リフォーム製品小売
	5377 特殊消費者サービス
	5379 専門店
	5553 放送事業・エンタテインメント
	5555 広告代理店
	5557 出版
	5752 賭博
	5753 ホテル
	5755 娯楽サービス
	5757 レストラン・バー
	5759 旅行・観光
	6535 固定回線通信サービス
	6575 携帯通信サービス
	7537 電力（代替発電）
	7577 水道
	8355 銀行
	8532 総合保険
	8534 保険ブローカー
	8536 損害保険
	8538 再保険
	8575 生命保険
	8633 不動産所有・開発
	8637 不動産サービス

一次影響サブセクター・カテゴリ	二次影響サブセクター・カテゴリ
	8671 産業・オフィスリート (REIT)
	8672 小売リート (REIT)
	8673 住宅リート (REIT)
	8674 分散型リート (REIT)
	8675 特殊リート (REIT)
	8676 Mortgage REITs
	8677 ホテル・宿泊施設リート (REIT)
	8771 アセットマネージャー
	8773 消費者金融
	8775 スペシャルティファイナンス
	8777 投資サービス
	8779 住宅金融
	8985 株式投資
	9533 コンピューターサービス
	9535 インターネット
	9537 ソフトウェア
	9572 コンピューターハードウェア
	9574 電子オフィス機器
	9576 半導体
	9578 通信機器

付録 C

追加情報

FTSE Russell の基本ルールで使用される用語については、次のリンクをご参照ください。

[Glossary.pdf](#)

The FTSE Russell サステナブル投資指標ウェブサイトは、次のリンクからアクセスしてください。 [サステナブル投資指標](#)

FTSE Blossom Japan Index の詳細については、FTSE Russell でご入手いただくか、ウェブサイト www.lseg.com/en/ftse-russell/ をご参照ください。

Disclaimer

© 2023 London Stock Exchange Group plc およびその該当するグループ企業（以下「LSE グループ」）。LSE グループには、(1) FTSE International Limited（以下「FTSE」）、(2) Frank Russell Company（以下「Russell」）、(3) FTSE Global Debt Capital Markets Inc. および FTSE Global Debt Capital Markets Limited（以下、併せて「FTSE Canada」）、(4) FTSE Fixed Income Europe Limited（以下「FTSE FI Europe」）、(5) FTSE Fixed Income LLC（以下「FTSE FI」）、(6) The Yield Book Inc.（以下「YB」）、(7) Beyond Ratings S.A.S.（以下「BR」）が含まれます。無断複写・転載を禁じます。

The FTSE Blossom Japan Index is calculated by or on behalf of FTSE International Limited or its affiliate, agent or partner. FTSE International Limited は、ベンチマーク管理者として Financial Conduct Authority から認可を受け、規制を受けています。

FTSE Russell® は、FTSE、Russell、FTSE Canada、FTSE FI、FTSE FI Europe、YB および BR の取引名です。「FTSE®」、「Russell®」、「FTSE Russell®」、「FTSE4Good®」、「ICB®」、「The Yield Book®」、「Beyond Ratings®」、その他本資料で使用される商標およびサービスマーク（登録されているか否かは問わない）は、LSE グループの該当メンバーまたはそのライセンサーが所有または許諾する商標およびサービスマークで、FTSE、Russell、FTSE Canada、FTSE FI、FTSE FI Europe、YB または BR によって保有または許諾に基づいて使用されているものです。

全ての情報は情報提供のみを目的として提供されています。本文書掲載の情報の正確性についてはあらゆる努力を払いましたが、何らかの誤り、本書または本書中の情報やデータの使用による何らかの損失について、LSE グループのメンバー、取締役、役員、従業員、パートナー、ライセンサーなどが責任を負うことはありません。

LSE グループのメンバーも、そのそれぞれの取締役、役員、従業員、パートナーまたはライセンサーも、情報もしくは FTSE Blossom Japan Index の使用により得た結果の正確性、適時性、完全性、商品性、またはインデックスを利用する特定の目的への適切性もしくは適合性について、明示、黙示を問わず、いかなる主張、予測、保証または表明も行いません。

LSE グループのメンバーまたはその役員、役員、従業員、パートナー、またはライセンサーのいずれも、投資アドバイスを提供しておらず、本資料のいかなる部分も、金融または投資アドバイスを構成するものとみなされるべきではありません。LSE グループのメンバー、その取締役、役員、従業員、パートナーまたはライセンサーは、いかなる資産への投資の是非に関して、いかなる表明も行いません。いずれかの資産への投資決定やそのような投資実行は、投資家自身に法規上およびコンプライアンス上のリスクを投じるものです。インデックスに直接投資することはできません。インデックスへの銘柄の組入れは、その銘柄の売買や保持を推奨するものではなく、いずれかの特定の投資家が行う資産または資産を含むインデックスの売買・保持が適法であると確認するものでもありません。本文書に掲載されている一般的な情報は、法律、税務、投資に関する専門的な助言を得ることなく使用されるべきではありません。

この情報のいかなる部分も、LSE グループの適切なメンバーの書面による事前の許可なしに、電子的、機械的、複写、録音、その他いかなる形式、手段によっても、複製、保存（検索可能なシステムによる保存）、または送信することを禁じます。LSE グループのインデックスデータの使用及び配布、金融商品を創り出すためのそうしたデータの利用には、FTSE、Russell、FTSE Canada、FTSE FI、FTSE FI Europe、YB、BR 及びまたはそれぞれのライセンサーからのライセンスが必要です。

