

## FTSE 債券インデックス

### インデックス・パッケージと過去データ



#### 概要

FTSE Russell は、透明性が高いルール・ベースのフレームワークで構築された、グローバル債券投資における包括的なベンチマーク・ソリューションを提供しています。FTSE Russell はマルチアセットの分野においても業界を牽引する存在であり、投資家にとって利用が容易で多様性を備えた FTSE 債券インデックスを提供しています。

#### モジュラー形式による包括的な地域別インデックス・パッケージ

FTSE 債券インデックスは、複数の債券タイプをカバーする包括的なヘッドライン・インデックスに加え、国別、期間別、セクター別、クオリティ別など、多くのパラメータによって分類された多様で詳細なサブインデックスが利用しやすいよう、綿密に設計された 5 つの地域別パッケージで提供されています。さらに、多面的な投資テーマや代替加重アプローチをカバーするテーマ別インデックスもご利用いただけます。

#### クラス最高のモデルに支えられた豊富で汎用性の高いデータセット

各インデックス・パッケージには、リスクとリターンを広範なデータ・ポイントが含まれた銘柄レベルおよびインデックス・レベルのファイルが収録されています。多用途性を念頭に設計されているファイルは、使いやすさとインデックスの実装が念頭に置かれ、シームレスなフローを実現します。なお、各パッケージには設定日以降のインデックス統計値と直近 3 年分の構成銘柄レベルの過去データが含まれます。

#### FTSE 債券インデックスの特徴

##### 包括的な地域別パッケージ

複数の債券プロダクトを幅広く、詳細にカバー

##### モジュラー形式のサブインデックス

詳細な市場調査、分析、モデリング、投資機会の発掘に役立ちます

##### 豊富で多様なデータ群

幅広いデータを使いやすいファイル形式で提供

##### 日次提供のプレビュー・ファイル

月末のリバランスをシームレスに実行するために必要な個別銘柄を可視化するフォワード・ルッキングなレポートを提供。

##### 日次ベースのキャッシュフロー

利払い、元本償還および再投資収入から、個別銘柄ベースでインデックスに保有されているキャッシュを日次および月次ベースで報告

5+

包括的パッケージ

50+

ヘッドラインインデックス

5,000+

詳細なサブインデックス

5,000,000+

日次で計算される  
リスクリターンの統計値



**FTSE  
RUSSELL**

An LSEG Business

## FTSE 債券インデックスの地域およびテーマ別パッケージ

グローバル・パッケージ	
	基準日
FTSE 世界国債インデックス <sup>1</sup>	1984年12月31日
FTSE 世界先進国債インデックス	1984年12月31日
FTSE 世界国債拡張インデックス	1984年12月31日
FTSE 世界国債インデックス (国内投信用) <sup>2</sup>	1996年12月31日
FTSE 世界国債0年+インデックス	2005年12月31日
FTSE 世界短期国債0-1年インデックス・シリーズ	市場毎に設定
FTSE 世界BIG債券インデックス <sup>2</sup>	1998年12月31日
FTSE 世界ハイイールド市場インデックス	2012年12月31日
FTSE 世界インフレ連動債券インデックス	2007年4月30日
FTSE 世界マネーマーケット・インデックス	1997年12月31日
FTSE ユーロドル債インデックス	1993年6月30日
FTSE ユーロスターリング債インデックス	1994年12月31日
FTSE ユーロ円債インデックス	1994年12月31日

アメリカ・パッケージ	
	基準日
FTSE 米国短期国債インデックス	2014年12月31日
FTSE 米国債0-1年インデックス	2000年12月31日
FTSE 米国変動利付国債インデックス	2014年1月31日
FTSE LATAM 国債インデックス	2011年3月31日
FTSE 米国BIG債券インデックス (USBIG®)	1979年12月31日
FTSE 米国大規模年金基金債券インデックス	1979年12月31日
FTSE 米国ハイイールド市場インデックス	1988年12月31日
FTSE 米国ハイイールド市場キャップ・インデックス	2001年12月31日
FTSE 米国優先株・ハイブリッド証券インデックス	2005年12月31日
FTSE 米国債STRIPSインデックス	1991年12月31日
FTSE 米国モーゲージ証券インデックス	1979年12月31日
FTSE 米国投資適格非課税地方債インデックス	2012年12月31日
FTSE 米国マネーマーケット・インデックス	1997年12月31日

アジア・パシフィック・日本	
	基準日
FTSE アジア国債インデックス (AGBI) <sup>3</sup>	2007年12月31日
FTSE 中国国債・政策金融銀行債インデックス	2010年12月31日
FTSE ベトナム国債インデックス	2014年12月31日
FTSE アジア・パシフィック国債インデックス	2007年12月31日
FTSE アジア・ブロード債券インデックス (ABBI)	2008年9月30日
FTSE 日本ブロード債券インデックス	2007年12月31日
FTSE 中国 (オンショア人民元) ブロード債券インデックス	2013年12月31日
FTSE 点心債 (オフショア人民元) インデックス	2010年12月31日
FTSE オーストラリアBIG債券インデックス	2000年6月30日
FTSE 中国 (オンショア人民元) グリーンボンド・インデックス	2016年6月30日
FTSE 日本BIG債券インデックス	2007年12月31日

欧州・中東・アフリカ	
	基準日
FTSE CEEMEA 国債インデックス	2011年3月31日
FTSE EMU 国債インデックス (EGBI)	1998年12月31日
FTSE スイス国債インデックス	1984年12月31日
FTSE ポルトガル国債インデックス	1994年12月31日
FTSE サウジアラビア国債インデックス	2020年2月28日
FTSE ナイジェリア国債インデックス	2014年12月31日
FTSE ギリシャ国債インデックス	2000年3月31日
FTSE ユーロBIG債券インデックス	1998年12月31日
FTSE MENA ブロード債券インデックス	2010年12月31日
FTSE 汎欧州BIG債券インデックス	2005年12月31日
FTSE 英国BIG債券インデックス	2005年12月31日
FTSE 英国国内投資適格インデックス	2005年12月31日
FTSE 汎欧州ハイイールド市場インデックス	2012年12月31日

新興国市場	
	基準日
FTSE 新興国市場国債インデックス (EMGBI) <sup>3</sup>	2007年12月31日
FTSE 新興国市場国債インデックス (国内投信用)	2007年12月31日
FTSE フロンティア新興国市場国債インデックス・シリーズ	2007年12月31日
FTSE 新興国市場ドル建てソブリン債インデックス <sup>3</sup>	1995年12月31日
FTSE インド国債インデックス	2010年7月31日
FTSE 新興国市場ドル建てブロード債券インデックス <sup>3</sup>	2012年12月31日
FTSE 新興国市場インフレ連動債券インデックス	2008年3月31日

国債
  ブロード
  社債
  その他

- 1 日本や米国、オーストラリア、中国を除いた指数もご利用いただけます。
- 2 日本を除いた指数もご利用いただけます。
- 3 キャップ付きの指数もご利用いただけます。

FTSE 債券インデックス

テーマ別	スマート ベータ	サステナブル投資	マルチ アセット	その他
FTSE 気候リスク調整世界国債インデックス・シリーズ (CLMTWGBI)		X		
FTSE 気候リスク調整EMU国債インデックス・シリーズ (CLMTEGBI)		X		
FTSE 気候リスク調整世界国債インデックス・シリーズ (ACLMTWGBI)		X		
FTSE 気候リスク調整EMU国債インデックス・シリーズ (ACLMTEGBI)		X		
FTSE 野村キャリア&ロールダウン (CaRD) 世界国債インデックス・シリーズ	X			
FTSE 野村 Climate CaRD WGBI シリーズ	X	X		
FTSE 気候リスク調整 CaRD 世界国債インデックス・シリーズ	X	X		
FTSE アドバンスト気候リスク調整 CaRD 世界国債インデックス・シリーズ	X	X		
FTSE 気候リスク調整 CaRD EMU 国債インデックス・シリーズ	X	X		
FTSE アドバンスト気候リスク調整 CaRD EMU 国債インデックス・シリーズ	X	X		
FTSE ESG 世界国債インデックス・シリーズ		X		
FTSE ESGEMU 国債インデックス・シリーズ		X		
デット・キャパシティ世界国債インデックス	X			
FTSE IdealRatings ドル建てブロード債券インデックス・シリーズ				X
MPF 世界国債インデックス (MPF WGBI)				X
米国年金負債カーブ	X			X
FTSE ユーロ BIG インパクト・ボンド・インデックス		X		
FTSE 米国 BIG グリーン・インパクト・ボンド・インデックス		X		
FTSE RAFI 世界社債インデックス	X			
FTSE 米国フォーリン・エンジェル債券インデックス	X			
FTSE 気候リスク調整世界インフレ連動債券インデックス・シリーズ (CLMTWILSI)		X		
FTSE アドバンスト気候リスク調整世界インフレ連動債券インデックス・シリーズ (ACLMTWILSI)		X		
FTSE RAFI 先進国ソブリン債券インデックス・シリーズ	X			
FTSE グローバル・グリーン・インパクト債券インデックス		X		
FTSE 世界 BIG グリーン・インパクト債券インデックス・シリーズ		X		
FTSE コア・インフラストラクチャー投資適格債券インデックス			X	X
FTSE コア・インフラストラクチャー・ハイイールド債券インデックス			X	X

国債
  ブロード
  社債
  その他

インデックス構成銘柄の過去データ

データ主導のシステムティックな投資を支援する用途で、広範な投資ユニバースの過去データの重要性が高くなっています。FTSE Russell では、債券価格、パフォーマンス、リスク値を含むインデックス構成銘柄の包括的な過去データを提供しています。これらのデータを組み合わせることで、多様な債券を含むグローバルな金融商品について、複数の市場サイクルを横断した投資戦略を検証することができます。

## インデックスの構成銘柄および収益率

証券銘柄コード:	ISIN   CUSIP   SEDOL
証券属性データ:	ティッカー   償還年限   クオリティ   格付け別セクター   国名   通貨   利払頻度   コール日付   起債日
派生データ:	額面   時価総額   経過利子   時価
業種分類:	GLIC   COBS
業種分類:	月初来総合収益率   日次総合収益率   インデックス値   月初来価格収益率   月初来利金収益率   月初来再投資収益率   月初来元本収益率   年初来総合収益率

## 構成銘柄のリスク指標

満期利回り | 最悪ケース利回り | 実効デュレーション | OAS | コンバクシティ | マコーレー・デュレーション | 修正デュレーション | 実質利回りデュレーション | 最悪ケース・デュレーション | 修正コンバクシティ | グロス・スプレッド | 最悪ケース・スプレッド | 平均残存年

---

## Disclaimer

© 2023 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) FTSE Fixed Income Europe Limited ("FTSE FI Europe"), (5) FTSE Fixed Income LLC ("FTSE FI"), (6) The Yield Book Inc ("YB") and (7) Beyond Ratings S.A.S. ("BR"). All rights reserved.

FTSE Russell® is a trading name of FTSE, Russell, FTSE Canada, FTSE FI, FTSE FI Europe, YB and BR. "FTSE®", "Russell®", "FTSE Russell®", "FTSE4Good®", "ICB®", "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, FTSE Canada, FTSE FI, FTSE FI Europe, 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 in this document should be taken as constituting financial or investment advice. No member of the LSE Group nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors make any representation regarding the advisability of investing in any asset or whether such investment creates any legal or compliance risks for the investor. A decision to invest in any such asset should not be made in reliance on any information herein. Indexes cannot be invested in directly. Inclusion of an asset in an index is not a recommendation to buy, sell or hold that asset nor confirmation that any particular investor may lawfully buy, sell or hold the asset or an index containing the asset. The general information contained in this publication should not be acted upon without obtaining specific legal, tax, and investment advice from a licensed professional.

The information contained in this report should not be considered "research" as defined in recital 28 of the Commission Delegated Directive (EU) 2017/593 of 7 April 2016 supplementing Directive 2014/65/EU of the European Parliament and of the Council ("MiFID II") and is provided for no fee.

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, FTSE FI, FTSE FI Europe, YB, BR and/or their respective licensors.

## About FTSE Russell

FTSE Russell is a leading global provider of index and benchmark solutions, spanning diverse asset classes and investment objectives. As a trusted investment partner we help investors make better-informed investment decisions, manage risk, and seize opportunities.

Market participants look to us for our expertise in developing and managing global index solutions across asset classes. Asset owners, asset managers, ETF providers and investment banks choose FTSE Russell solutions to benchmark their investment performance and create investment funds, ETFs, structured products, and index-based derivatives. Our clients use our solutions for asset allocation, investment strategy analysis and risk management, and value us for our robust governance process and operational integrity.

For over 35 years we have been at the forefront of driving change for the investor, always innovating to shape the next generation of benchmarks and investment solutions that open up new opportunities for the global investment community.

To learn more, visit [lsegroup.com/ftse-russell](https://lsegroup.com/ftse-russell); email [info@ftserussell.com](mailto:info@ftserussell.com); or call your regional Client Service team office:

**EMEA** +44 (0) 20 7866 1810

**North America** +1 877 503 6437

**Asia-Pacific**

**Hong Kong** +852 2164 3333

**Tokyo** +81 (3) 6441 1430

**Sydney** +61 (0)2 7228 5659



**FTSE  
RUSSELL**  
An LSEG Business