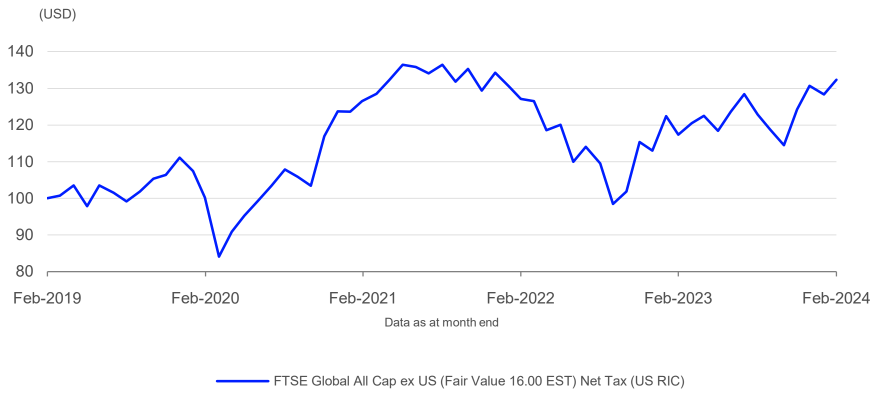
FTSE Global All Cap ex US Fair Market Value Index (Japanese)

Data as at: 29 February 2024

FTSE Global All Cap ex US インデックスは、アメリカ合衆国を除く先進国市場と新興国市場の大型株、中型株、小型株のパフォーマンスを示す時価総額加重インデックスです。このインデックスは 47 カ国から選ばれた約 6,600 銘柄の株式で構成されており、FTSE Global Equity インデックス・シリーズ(GEIS)のうちの 1 つです。なお、GEIS には世界 47 カ国の 7,600 銘柄以上の株式が採用されており、世界の投資可能時価総額の 98%をカバーしています。

FTSE Global All Cap ex US Fair Market Value インデックスは、米国株式市場の大引けよりも先に引けてしまう市場における構成銘柄の価格変動を反映するように設計されています。その計算にはアメリカ東部標準時(EST)の午後 4 時における適正株価と外国為替レートが使用されています。FTSE の Fair Value インデックスで使用する税率は、米国を拠点とする米国規制投資会社(US RIC)が受け取る配当金に適用される源泉税率に基づいています。(1940 年 ミューチュアルファンド法)

5 年間のパフォーマンス推移 - トータルリターン



パフォーマンスおよびボラティリティ - トータルリターン

Index (USD)	Return %						Return pa %*		Volatility %**		
	3M	6M	YTD	12M	3YR	5YR	3YR	5YR	1YR	3YR	5YR
FTSE Global All Cap ex US (Fair Value 16.00 EST) Net Tax (US RIC)	6.5	7.8	1.3	12.7	4.6	32.4	1.5	5.8	11.5	15.2	18.1

* Compound annual returns measured over 3 and 5 years respectively
** Volatility – 1YR based on 12 months daily data. 3YR based on weekly data (Wednesday to Wednesday). 5YR based on monthly data

年間のパフォーマンス - トータルリターン

Index % (USD)	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023
FTSE Global All Cap ex US (Fair Value 16.00 EST) Net Tax (US RIC)	-4.0	-4.2	4.8	27.8	-14.5	21.6	11.4	8.5	-15.8	15.6

FEATURES

カバレッジ

世界の投資可能時価総額の 98% を占める FTSE Global Equity インデックス・シリーズ(GEIS)のうちの 1 つです。

目的

FTSE の Fair Value インデックスは、米国株式市場の大引けよりも先に引けてしまう市場における構成銘柄の価格変動を反映するように設計されています。その計算には、アメリカ東部標準時(EST)の午後 4 時における適正株価と外国為替レートが使用されています。

投資可能性

インデックスの投資可能性を確保するために、構成銘柄の選定とウェイトの調整が行われています。

流動性

インデックスの取引可能性を確保するために、構成銘柄には流動性スクリーニングがかけられています。

透明性

インデックス･ルールについては FTSE ウェブサイト上にてご自由にご覧いただけます。

計算方法と算出頻度

当該インデックスは、プライスリターン(配当なし)とトータルリターン(配当込み)それぞれの計算方法に基づき、終日ベースで計算されています。

Industry Classification Benchmark

インデックスの構成銘柄は、産業･業種分類において国際標準である Industry Classification Benchmark(ICB)に基づいて分類されています。

シャープレシオおよびドローダウン (最高値からの下落率) - トータルリターン

Index (USD)	Return/Risk Ratio				Drawdown (%)			
	1YR	3YR	5YR	10YR	1YR	3YR	5YR	10YR
FTSE Global All Cap ex US (Fair Value 16.00 EST) Net Tax (US RIC)	1.1	0.1	0.3	0.3	-11.7	-29.5	-35.0	-36.0

Return/Risk Ratio – based on compound annual returns and volatility in Performance and Volatility table
Drawdown - based on daily data

上位 10 銘柄

Constituent	Country	ICB Sector	Net MCap (USDm)	Wgt %
Taiwan Semiconductor Manufacturing	Taiwan	Technology Hardware and Equipment	523,904	1.77
Novo-Nordisk B	Denmark	Pharmaceuticals and Biotechnology	371,739	1.25
ASML Holding	Netherlands	Technology Hardware and Equipment	370,796	1.25
Toyota Motor	Japan	Automobiles and Parts	288,299	0.97
Nestle	Switzerland	Food Producers	277,039	0.93
Samsung Electronics	Korea	Telecommunications Equipment	262,293	0.88
LVMH	France	Personal Goods	225,206	0.76
Tencent Holdings (P Chip)	China	Software and Computer Services	221,077	0.75
Novartis (REGD)	Switzerland	Pharmaceuticals and Biotechnology	209,288	0.71
Shell	UK	Oil Gas and Coal	204,930	0.69
Totals			**2,954,571**	**9.97**

ICB スーパーセクター構成

ICB Code	ICB Supersector	No. of Cons	Net MCap (USDm)	Wgt %
1010	Technology	947	3,766,993	12.71
1510	Telecommunications	232	1,134,571	3.83
2010	Health Care	676	2,636,742	8.89
3010	Banks	387	3,542,789	11.95
3020	Financial Services	342	1,058,623	3.57
3030	Insurance	141	1,289,574	4.35
3510	Real Estate	558	868,666	2.93
4010	Automobiles and Parts	251	1,169,734	3.95
4020	Consumer Products and Services	410	1,464,938	4.94
4030	Media	148	290,910	0.98
4040	Retailers	226	689,041	2.32
4050	Travel and Leisure	225	483,152	1.63
4510	Food Beverage and Tobacco	378	1,294,128	4.37
4520	Personal Care Drug and Grocery Stores	191	678,485	2.29
5010	Construction and Materials	384	862,166	2.91
5020	Industrial Goods and Services	1293	3,825,800	12.90
5510	Basic Resources	490	1,194,984	4.03
5520	Chemicals	391	750,184	2.53
6010	Energy	310	1,671,801	5.64
6510	Utilities	329	973,756	3.28
Totals		**8309**	**29,647,035**	**100.00**

INFORMATION

ユニバース

FTSE Global Equity インデックス・シリーズ

基準日

2012 年 12 月 31 日

基準値

1000

投資可能性スクリーニング

実効性の高い浮動株の適用および流動性スクリーニング

算出頻度

終値ベース

終日データの配信方法

FTP および電子メール

通貨

米国ドル(USD)

評価時点

ニューヨーク証券取引所(NYSE)の大引けとなるアメリカ東部標準時の 16:00 における WM/ロイターの為替レートを用いて算出

見直しの実施時期

年 2 回(3 月と 9 月)

過去データ

2008 年 12 月 31 日から入手可能

国別内訳

Country	No. of Cons	Net MCap (USDm)	Wgt %
Australia	298	1,461,314	4.93
Austria	27	54,155	0.18
Belgium	39	182,299	0.61
Brazil	165	474,063	1.60
Canada	171	2,096,482	7.07
Chile	31	43,968	0.15
China	2361	2,002,882	6.76
Colombia	5	11,137	0.04
Czech Rep.	5	9,989	0.03
Denmark	40	618,498	2.09
Egypt	9	11,845	0.04
Finland	34	199,911	0.67
France	136	2,030,181	6.85
Germany	156	1,526,207	5.15
Greece	29	44,034	0.15
Hong Kong	125	393,400	1.33
Hungary	4	19,216	0.06
Iceland	14	8,935	0.03
India	462	1,651,593	5.57
Indonesia	79	162,797	0.55
Ireland	6	47,088	0.16
Israel	72	139,773	0.47
Italy	89	537,055	1.81
Japan	1426	4,926,643	16.62
Korea	492	1,028,396	3.47
Kuwait	21	69,654	0.23
Malaysia	79	139,905	0.47
Mexico	49	224,338	0.76
Netherlands	55	862,031	2.91
New Zealand	30	63,677	0.21
Norway	57	152,270	0.51
Pakistan	14	3,986	0.01
Philippines	35	57,393	0.19
Poland	28	78,603	0.27
Portugal	14	38,136	0.13
Qatar	21	70,669	0.24
Romania	7	9,734	0.03
Saudi Arabia	90	348,028	1.17
Singapore	67	229,029	0.77
South Africa	77	227,793	0.77
Spain	56	465,988	1.57
Sweden	141	669,578	2.26
Switzerland	116	1,643,478	5.54
Taiwan	496	1,470,108	4.96
Thailand	130	169,341	0.57
Turkiye	137	91,551	0.31
UAE	36	124,013	0.42
UK	278	2,755,874	9.30
Totals	**8309**	**29,647,035**	**100.00**

インデックス特性

Attributes	FTSE Global All Cap ex US (Fair Value 16.00 EST) Net Tax (US RIC)
Number of constituents	8309
Net MCap (USDm)	29,647,035
Dividend Yield %	2.62
Constituent Sizes (Net MCap USDm)	
Average	3,568
Largest	523,904
Smallest	13
Median	571
Weight of Largest Constituent (%)	1.77
Top 10 Holdings (% Index MCap)	9.97

Data definitions available from info@ftserussell.com

To learn more, visit lseg.com/ftse-russell; email info@ftserussell.com; or call your regional Client Services 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