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

Data as at: 29 February 2024

FTSE Global Small 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 3,200 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 Small 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 Small Cap ex US (Fair Value 16.00 EST) Net Tax (US RIC)	4.8	4.4	-1.3	8.2	-1.6	24.5	-0.5	4.5	11.8	16.4	20.8

* 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 Small Cap ex US (Fair Value 16.00 EST) Net Tax (US RIC)	-4.8	-0.3	4.1	30.2	-18.7	21.5	11.8	12.7	-21.1	15.3

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ため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 時の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 Small Cap ex US (Fair Value 16.00 EST) Net Tax (US RIC)	0.7	-0.1	0.2	0.2	-13.3	-33.8	-40.2	-44.1

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 %
WSP Global	Canada	Construction and Materials	18,603	0.66
Cameco Corp	Canada	Alternative Energy	17,496	0.62
RB Global Inc	Canada	Consumer Services	13,628	0.48
TFI International	Canada	Industrial Transportation	12,010	0.42
Arc Resources	Canada	Oil Gas and Coal	10,292	0.36
Open Text Corp	Canada	Software and Computer Services	10,282	0.36
Emera Inc	Canada	Electricity	9,617	0.34
Stantec Inc	Canada	Construction and Materials	9,278	0.33
Toromont Industries	Canada	Industrial Support Services	7,413	0.26
Descartes Sys	Canada	Software and Computer Services	7,322	0.26
Totals			**115,941**	**4.09**

ICB スーパーセクター構成

ICB Code	ICB Supersector	No. of Cons	Net MCap (USDm)	Wgt %
1010	Technology	620	375,841	13.25
1510	Telecommunications	112	45,892	1.62
2010	Health Care	391	181,317	6.39
3010	Banks	128	126,594	4.46
3020	Financial Services	167	138,794	4.89
3030	Insurance	40	46,399	1.64
3510	Real Estate	352	254,056	8.95
4010	Automobiles and Parts	126	62,396	2.20
4020	Consumer Products and Services	237	150,482	5.30
4030	Media	93	32,299	1.14
4040	Retailers	133	64,681	2.28
4050	Travel and Leisure	128	70,979	2.50
4510	Food Beverage and Tobacco	184	83,058	2.93
4520	Personal Care Drug and Grocery Stores	90	53,989	1.90
5010	Construction and Materials	236	167,179	5.89
5020	Industrial Goods and Services	754	433,040	15.26
5510	Basic Resources	299	199,595	7.04
5520	Chemicals	222	92,058	3.24
6010	Energy	156	152,775	5.38
6510	Utilities	134	105,708	3.73
Totals		**4602**	**2,837,132**	**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

終日ベース

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

見直しの実施頻度

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	189	131,614	4.64
Austria	19	19,621	0.69
Belgium	24	27,175	0.96
Brazil	82	43,144	1.52
Canada	122	418,102	14.74
Chile	10	4,290	0.15
China	1124	118,400	4.17
Denmark	22	50,147	1.77
Egypt	6	5,707	0.20
Finland	19	26,153	0.92
France	65	71,932	2.54
Germany	83	82,262	2.90
Greece	3	767	0.03
Hong Kong	49	13,951	0.49
Iceland	4	847	0.03
India	249	212,550	7.49
Indonesia	37	15,165	0.53
Ireland	1	1,077	0.04
Israel	42	27,256	0.96
Italy	55	58,786	2.07
Japan	915	396,102	13.96
Korea	335	121,473	4.28
Kuwait	12	6,943	0.24
Malaysia	40	21,726	0.77
Mexico	10	9,579	0.34
Netherlands	24	28,036	0.99
New Zealand	15	11,113	0.39
Norway	39	43,336	1.53
Pakistan	13	3,698	0.13
Philippines	9	3,753	0.13
Poland	18	20,584	0.73
Portugal	10	7,731	0.27
Qatar	4	2,641	0.09
Romania	1	147	0.01
Saudi Arabia	34	23,645	0.83
Singapore	32	17,279	0.61
South Africa	36	22,955	0.81
Spain	32	33,606	1.18
Sweden	86	106,888	3.77
Switzerland	64	80,626	2.84
Taiwan	377	255,449	9.00
Thailand	80	31,529	1.11
Turkiye	33	5,245	0.18
UAE	5	2,962	0.10
UK	173	251,140	8.85
Totals	**4602**	**2,837,132**	**100.00**

インデックス特性

Attributes	FTSE Global Small Cap ex US (Fair Value 16.00 EST) Net Tax (US RIC)
Number of constituents	4602
Net MCap (USDm)	2,837,132
Dividend Yield %	2.42
Constituent Sizes (Net MCap USDm)	
Average	616
Largest	18,603
Smallest	13
Median	330
Weight of Largest Constituent (%)	0.66
Top 10 Holdings (% Index MCap)	4.09

© 2024 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」）。無断複写・転載を禁じます。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。

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。 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。

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。本資料に記載されている全ての情報及びデータは、LSE グループが正確かつ信頼できると考える情報源から入手したものです。ただし、人的ミスや機械的エラー、その他の要因の可能性があるため、当該情報及びデータについては、如何なる種類の保証も行われず、すべて「現状有姿のまま」提供されています。LSE グループのメンバーまたはその取締役、役員、従業員、パートナー、ライセンサーのいずれも、情報や FTSE Russell の商品（インデックス、データとアナリティクスを含むがこれらに限定されない）の使用から得られる結果について、明示または黙示を問わず、正確性、適時性、完全性、商品性に関していかなる主張、予想、保証、表明も行わず、FTSE Russell 商品の特定の目的への適切性または適合性に関しても、明示または黙示を問わず、主張、予想、保証、表明を行いません。FTSE Russell の商品を通じてアクセス可能な過去のデータの表示 は、情報提供のみを目的として提供されており、将来のパフォーマンスを示唆するものではありません。

LSE グループのメンバーまたはその取締役、役員、従業員、パートナー、ライセンサーは、以下の事項に関して一切の責任または義務を負いません： (a) 当該情報またはデータの調達、収集、コンパイル、解釈、分析、編集、転記、送信、通信もしくは提供に関わるエラー（過失の有無を問わない）、その他の状況、または本資料または本資料へのリンクの使用に関連あるいは起因する損失又は損害（全部又は一部を問わない）および、(b)（たとえ LSE グループのメンバーがかかる損害の可能性について事前に知らされていた場合であっても）当該情報の使用または使用不能から生じるいかなる直接的、間接的、特別、派生的または付随的損害

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、あるいはかかる投資が投資家にとっていかなる法的リスクまたはコンプライアンス上のリスクを生じさせるか否かに関しても、いかなる表明も行いません。このような資産への投資を決定する際には、本資料に記載された情報に依拠すべきではありません。インデックスは、直接投資することはできません。インデックスへの資産の組み入れは、当該資産の売買や保有を推奨するものではなく、また、特定の投資家が当該資産や当該資産を含むインデックスを合法的に売買や保有することができると確認するものでもありません。本資料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。

過去のパフォーマンスは将来の結果を保証するものではありません。チャートやグラフは説明目的のためだけに提示されています。提示されているインデックスのリターンは投資可能な資産における実際の取引の結果を表しているとは限りません。提示されている特定のリターンはバックテストされたパフォーマンスを反映している場合があります。インデックス算出開始日以前の全てのパフォーマンスはバックテストされたパフォーマンスです。バックテストされたパフォーマンスは実際のパフォーマンスではなく、仮説に基づいたものです。バックテストの計算は、インデックスの算出が正式に開始されたときに有効であったものと同じメソドロジーに基づいています。ただし、バックテストされたデータは、インデックスのメソドロジーの適用による後講釈のメリットを反映している場合があり、インデックスの過去の計算は、インデックスの計算に使用される元の経済データの改訂に基づいて月によって変化する可能性があります。

本資料には将来予測に関する評価が含まれている場合があります。これらは将来の状況に関する多くの仮定に基づいており、最終的には不正確であることが判明する可能性があります。このような将来予測に関する評価は、リスクと不確実性の影響を受け、また、様々な要因の影響により、実際の結果と大きく異なる可能性があります。LSE グループのメンバーおよびそのライセンサーは、将来予想に関する評価を更新する義務を負わず、また更新することを約束するものではありません。

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、記録、その他いかなる形式、手段によっても、複製、保存（検索システムによる保存）、または送信することを禁じます。LSE グループのデータの使用及び配布には、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。

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