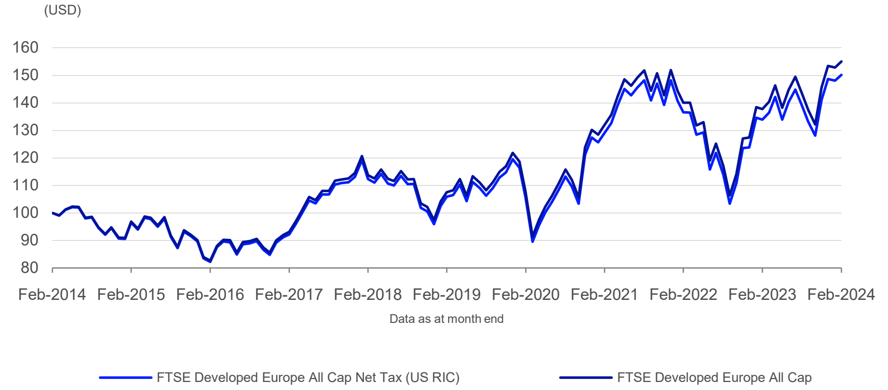
FTSE Developed Europe All Cap Net Tax (US RIC) Index (Japanese)

Data as at: 29 February 2024

FTSE Developed Europe All Cap インデックスは、英国を含む欧州先進国市場の大型株、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、16カ国から選ばれた約 1,250 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 Developed Europe All Cap Net Tax (US RIC) 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)

10 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 Developed Europe All Cap Net Tax (US RIC)	6.4	8.1	1.0	12.2	16.4	41.8	5.2	7.2	14.9	17.6	20.0
FTSE Developed Europe All Cap	6.4	8.1	1.0	12.6	17.6	44.1	5.6	7.6	14.9	17.6	20.0

* 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 Developed Europe All Cap Net Tax (US RIC)	-5.9	-1.2	-0.5	26.8	-15.1	24.6	6.5	16.4	-16.5	20.1
FTSE Developed Europe All Cap	-5.6	-1.0	-0.1	27.2	-14.9	25.0	6.8	16.7	-16.2	20.5

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

当該インデックスは、インデックス連動型ファンドの組成、デリバティブ取引、またパフォーマンスのベンチマークとしての利用を目的として設計されています。

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、ティック毎のリアルタイムおよび終日ベースで計算されています。

Industry Classification Benchmark (ICB)

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 Developed Europe All Cap Net Tax (US RIC)	0.8	0.3	0.4	0.2	-12.4	-32.4	-36.3	-36.4
FTSE Developed Europe All Cap	0.8	0.3	0.4	0.3	-12.4	-32.1	-36.3	-36.3

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 %
Novo-Nordisk B	Denmark	Pharmaceuticals and Biotechnology	372,182	3.13
ASML Holding	Netherlands	Technology Hardware and Equipment	371,259	3.12
Nestle	Switzerland	Food Producers	278,234	2.34
LVMH	France	Personal Goods	225,487	1.90
Novartis (REGD)	Switzerland	Pharmaceuticals and Biotechnology	210,192	1.77
Shell	UK	Oil Gas and Coal	205,359	1.73
SAP	Germany	Software and Computer Services	205,100	1.73
AstraZeneca	UK	Pharmaceuticals and Biotechnology	186,486	1.57
Roche Hldgs (GENUS)	Switzerland	Pharmaceuticals and Biotechnology	182,412	1.53
HSBC Hldgs	UK	Banks	151,337	1.27
Totals			**2,388,048**	**20.09**

ICB スーパーセクター構成

ICB Code	ICB Supersector	No. of Cons	Net MCap (USDm)	Wgt %
1010	Technology	83	1,015,024	8.54
1510	Telecommunications	38	284,522	2.39
2010	Health Care	104	1,736,364	14.61
3010	Banks	73	1,015,037	8.54
3020	Financial Services	82	467,709	3.94
3030	Insurance	42	624,534	5.26
3510	Real Estate	96	198,289	1.67
4010	Automobiles and Parts	29	318,057	2.68
4020	Consumer Products and Services	63	783,935	6.60
4030	Media	33	232,606	1.96
4040	Retailers	35	118,307	1.00
4050	Travel and Leisure	35	148,305	1.25
4510	Food Beverage and Tobacco	53	770,433	6.48
4520	Personal Care Drug and Grocery Stores	30	314,781	2.65
5010	Construction and Materials	63	453,240	3.81
5020	Industrial Goods and Services	235	1,735,337	14.60
5510	Basic Resources	45	286,677	2.41
5520	Chemicals	35	304,569	2.56
6010	Energy	50	659,731	5.55
6510	Utilities	48	416,556	3.51
Totals		**1272**	**11,884,015**	**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

リアルタイムおよび終日ベース

終日データの配信方法

FTP および電子メール

通貨

米ドル (USD)、カナダドル (CAD)、ユーロ (EUR)、英ポンド (GBP)、日本円 (JPY)、豪ドル (AUD)、その他現地通貨

見直しの実施時期

年 2 回 (3 月と 9 月)

国別内訳

Country	No. of Cons	Net MCap (USDm)	Wgt %
Austria	27	54,222	0.46
Belgium	39	182,526	1.54
Denmark	40	619,234	5.21
Finland	34	200,161	1.68
France	136	2,032,716	17.10
Germany	156	1,528,112	12.86
Ireland	6	47,147	0.40
Italy	89	537,726	4.52
Netherlands	55	863,107	7.26
Norway	57	152,587	1.28
Poland	28	78,705	0.66
Portugal	14	38,183	0.32
Spain	56	466,570	3.93
Sweden	141	670,804	5.64
Switzerland	116	1,650,570	13.89
UK	278	2,761,644	23.24
Totals	**1272**	**11,884,015**	**100.00**

インデックス特性

Attributes	FTSE Developed Europe All Cap Net Tax (US RIC)
Number of constituents	1272
Net MCap (USDm)	11,884,015
Dividend Yield %	2.75
Constituent Sizes (Net MCap USDm)	
Average	9,343
Largest	372,182
Smallest	19
Median	2,031
Weight of Largest Constituent (%)	3.13
Top 10 Holdings (% Index MCap)	20.09

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