

FTSE
Products



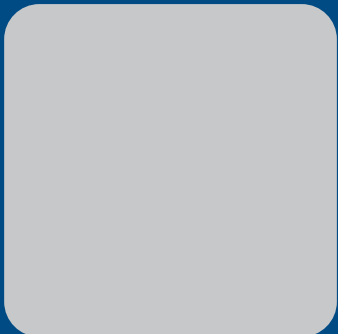
Transparency



Customisation



Innovation



Solutions



FTSEグループ

FTSEグループは、インデックス（指数）の構築と管理において世界をリードする企業です。北京、ロンドン、フランクフルト、香港、ボストン、上海、マドリード、パリ、ニューヨーク、サンフランシスコ、シドニー、東京にオフィスを持ち、世界77カ国のお客様にサービスを提供しています。FTSEグローバル株式インデックス・シリーズ（GEIS）を構成する代表的なものにはFTSE All Worldインデックス、FTSE4Goodシリーズ、FTSEurofirstインデックス・シリーズがあり、定評のあるFTSE100をはじめとする多くのインデックスを計算、管理しています。

FTSEは、数多くのパートナーと提携することにより、全世界の市場をカバーする様々なソリューションを提供しています。提携先には、アテネ、キプロス、NYSE、Euronext、ヨハネスブルグ、ロンドン、マドリード、マレーシア、NASDAQ、シンガポール、台湾およびタイ証券取引所や、欧州不動産協会（EPRA）、全米不動産投資信託協会（NAREIT）、リサーチ・アフィリエイツ（RAFI）社、グローバル・ウェルス・アロケーション（GWA）社、シンガポール・プレス・ホールディングス社、ヤサール社、APCIMSおよび中国の新華ファイナンスなどの企業があります。FTSEはまた、ダウ・ジョーンズ社と協力して、グローバル投資家を対象とした業種分類システム、ICB（Industry Classification Benchmark）を開発しました。

世界中の投資家が投資分析、運用評価、資産配分決定、ポートフォリオヘッジングなど、様々な指数連動型ファンドの設定にFTSEインデックスを利用しています。また、インデックスの変更はすべて、客観的で公平なものであるかどうかをシニアファンドマネジャー、デリバティブの専門家、アクチュアリーその他の経験豊富な実務家からなる第三者委員会が審査、承認しています。

より詳しくお知りになりたい方は、ホームページwww.ftse.comをご覧ください。

目次

- 2 FTSEの特長
- 3 イノベーションで市場をリードする
- 3 ビルディング・ブロック方式のインデックス構成
- 4 業種分類ベンチマーク (ICB)
- 5 カスタムソリューション
- 6-23 FTSEの商品
- 24 FTSEの商品パッケージ

グローバル株式インデックス

- 6 FTSEグローバル株式インデックス・シリーズ
- 7 FTSEマルチナショナル・インデックス・シリーズ
- 7 FTSEグローバル・スタイル・インデックス・シリーズ
- 7 FTSEシャリア・グローバル株式インデックス・シリーズ

地域・パートナー・インデックス

- 8 FTSE EMEAインデックス
- 10 FTSE英国インデックス
- 12 FTSEアジア太平洋インデックス
- 15 FTSE米国インデックス

戦略投資インデックス

- 16 FTSE RAFIインデックス・シリーズ
- 17 FTSE GWAインデックス・シリーズ
- 17 FTSE UK高配当インデックス

不動産およびオルタナティブ投資インデックス

- 18 FTSE EPRA/NAREITグローバル不動産インデックス・シリーズ
- 18 FTSE EPRA/NAREIT高配当インデックス・シリーズ
- 18 FTSE EPRA/NAREITグローバルREITおよび非REITインデックス・シリーズ
- 18 FTSE NAREIT US不動産インデックス・シリーズ
- 19 FTSE UK商業不動産インデックス・シリーズ
- 19 FTSE IDFCインド・インフラ・インデックス・シリーズ
- 20 FTSEヘッジ

社会的責任投資インデックス

- 21 FTSE4Goodインデックス・シリーズ
- 21 FTSE4Good環境リーダー欧州40インデックス
- 21 FTSE4Good IBEXインデックス
- 21 FTSE4Good ET50インデックス
- 21 FTSE4Good環境オポチュニティAll-Shareインデックス

債券インデックス

- 22 FTSEアクチュアリーUK国債インデックス・シリーズ
- 22 FTSEグローバル債券インデックス・シリーズ
- 23 FTSE MTIRSインデックス・シリーズ
- 23 FTSETルコリラ国債インデックス
- 23 FTSE新華中国政府債インデックス



FTSEの特長

FTSEの理念はすべてのインデックスに反映され、今日の投資家ニーズに応えられるように日々努力しています。

インデックスの専門家

FTSEはインデックス構築の専門企業です。市場の中心に位置することにより顧客ニーズを理解し、適切な商品を提供いたします。

世界の市場をカバー

FTSEは12万を超える株式、債券、不動産およびヘッジファンド指数を算出しています。FTSEグローバル株式インデックス・シリーズ（GEIS）だけでも世界の投資可能時価総額の98%以上をカバーしています。どんな通貨、市場、地域、業種、アセットクラスであっても、ベンチマークや取引可能なインデックスが必要なときには、FTSEインデックスがご利用になれます。目的に合うインデックスがない場合は、お客様の個別のニーズに合わせてインデックスをカスタマイズすることができます。

市場分類

FTSEは、各国の市場を分類する際に重要なことは、透明かつ客観的で一貫性のある手法を用いることであると考えています。

FTSEは大規模な市場調査を実施し、

- ・ 経済規模
- ・ ウェルス
- ・ 投資環境の整備
- ・ 市場の深さおよび広さ

に基づく市場分類の枠組みおよび基準を策定しました。

FTSEはこの枠組みを使用して、すべての国の市場を毎年、「先進国」「準先進国」「エマージング」「フロンティア」に分類しています。市場分類に変更がある場合は、変更の6ヶ月以上前にその旨を発表します。市場分類の変更が投資家にとって透明なものであるようにするため、分類の変更が検討されている国とその変更条件を記載したウォッチリストを作成しています。すべての国の現行の市場分類の一覧は、www.ftse.com/countryで見ることができます。

イノベーション

今や株式市場の常識となっている浮動株調整や各国の市場分類などをFTSEは先駆けて導入し、お客様に画期的なソリューションを提供し続けます。

自律性

FTSEはいかなる受益団体や特定のユーザーグループも代表していません。FTSEの目的は、世界中の投資家にニュートラルな立場から評価ツールを提供することです。

カスタマイズ

「FTSEカスタムソリューション」は、お客様にカスタマイズされたベンチマークソリューションを提供します。インデックスをお客様のニーズに合わせてデザインします。

透明性

FTSEのインデックスは最高の透明性を誇っています。FTSEのインデックスルールは公開され、各インデックス・シリーズに使用されている手法を詳しく知ることができます。

第三者委員会

FTSEのインデックスは、独立したインデックス委員会が常に市場ニーズへの適合性をチェックしています。委員会はまた、インデックスルールの変更や複雑な企業活動への対応の決定を行っています。

数々の賞を受賞

- ・ 2005、2006および2008年、「インデックス・プロバイダー・オブ・ザ・イヤー」 — Global Pensions Magazine誌
- ・ 2008年、Finans Portföy Yönetimiの「最も革新的なETF」にFTSEトルコリラ国債インデックス
- ・ 2007年、第3回グローバルETFアワードの「最も革新的なETF」にPowerShares FTSE RAFI 1000
- ・ 2007年、Asia Asset Management誌の「最も革新的な商品」にFTSE/ASEAN 40 ETF
- ・ 2005年、William F Sharpe Award「インデックス・イノベーション賞」にFTSE RAFIインデックス・シリーズ
- ・ 2005年、「ベストインデックスプロバイダー賞」 — Structured Products Magazine誌

イノベーションで市場をリードする

FTSEは市場の中心に位置することで顧客ニーズを理解し、適切な商品を提供できるようにしています。FTSEはインデックスを革新する新しい基準の設定に常に尽力しています。

ユニバース		2000年 FTSE All-Worldインデックスを導入し新興市場を加えることにより、グローバルユニバースを90%に拡大	2003年 FTSE小型株インデックスを含むFTSEグローバル株式インデックス・シリーズ(GEIS)の創設に伴い、グローバルユニバースを98%に拡大		2008年 グローバルユニバースをさらに拡大するため、「フロンティア」市場を追加		
業種・市場分類		1999年 GCS (グローバル業種分類システム)を導入		2003年 市場分類基準を導入	2004年 ダウ・ジョーンズと提携して独自の分類システム、「業種分類ベンチマーク (ICB)」を開発		
浮動株調整・流動性							
1999年 浮動株調整インデックスの導入について市場の意見を求める	2000年 新規インデックスに浮動株調整を適用	2001年 全インデックスに浮動株調整を適用				2007年 流動性基準を強化	
多様な手法							
1999年 FTSEマルチナショナル・インデックス・シリーズを導入	2001年 FTSE社会的責任投資指数 (FTSE4Good)を導入	2002年 マルチファクター方式を用いたグローバル・スタイル・インデックス・シリーズを導入	2003年 グローバル小型株インデックスをグローバル株式インデックス・シリーズに追加	2004年 ヘッジファンด์・インデックスを導入	2005年 FTSEプライベートバンキング・インデックス・シリーズと非時価総額加重インデックス (GWAおよびRAFI)を導入	2006年 ヤサール社のイスラム法学者の審査を受け、シャリア準拠のイスラム株式インデックスを導入	2008年 FTSE初の「環境技術 (ET) インデックス」を導入

ビルディング・ブロック方式のインデックス構成

FTSEのインデックスはビルディング・ブロック方式で構成されているため、ユーザーは様々な基準によって世界の株式市場を評価することができます。



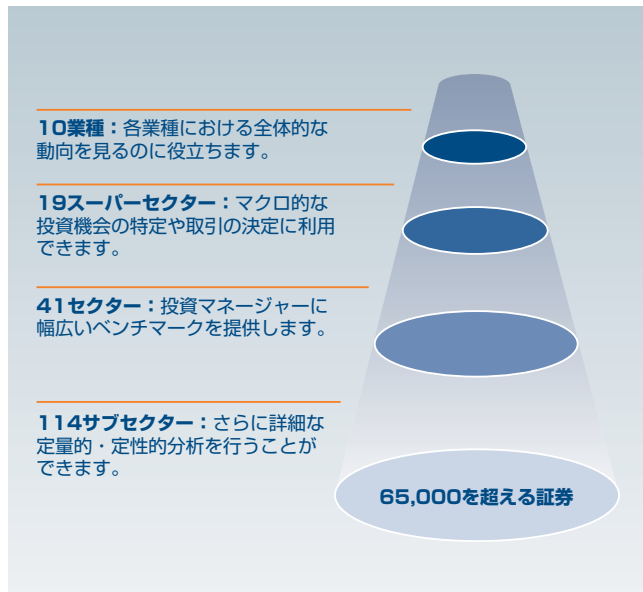
業種分類ベンチマーク (Industry Classification Benchmark: ICB)

FTSEグループとダウ・ジョーンズ・インデックスは、共同で「業種分類ベンチマーク (ICB)」と呼ばれる明確な分類システムを提供しています。ICBは現在では業界基準として認められています。

本システムは、FTSEとダウ・ジョーンズの両ユニバース、世界の60,000以上の企業と65,000以上の証券をカバーする「ICBユニバース・データベース」に基づいています。ICBは、セクターおよび産業別分析のための詳細かつ包括的なシステムで、4層分類と国を超えてすべての企業を比較することができます。各企業はその事業の性質を最も的確に表わした「サブセクター」に下位分類されます。事業の性質は、企業の主な収益源がどこにあるかによって決まります。

ICBユニバースは、トップダウンアプローチにより市場を大きく捉えた場合にも、ボトムアップアプローチにより市場を細かく捉えた場合にも、どちらのニーズにも応えることができます。

www.icbenchmark.com



ICBの特長

投資家本位

ICBは、投資家の高度なニーズに応え、より一層の明確性、より良い構成および普遍性を実現するために開発されました。

フレキシブルな構成

4層分類により、各業種における全体的な動向から詳細な分析まで、地域と国の境を超えて業種分析をすることが可能です。

グローバルな普及

ICBは、世界の上場銘柄時価総額の65%超を扱う主要証券取引所によって採用されています。

投資家のニーズに応える

「業種」および「スーパーセクター」は、最新のセクター投資戦略を考慮したもので、セクター別投資を容易にします。

世界の市場をカバー

ダウ・ジョーンズ・インデックスとFTSEのシステム統合によって生み出され、今までにない高い企業・業種カバー率で投資家のニーズに応えます。

確実かつ正確

独立した運営と世界中の調査チームによるデータの裏付けにより、市場を監視し、市場の正確な反映と持続的な成長を常に確認しています。

単一データベース

包括的な証券ユニバースから生まれた「ICBユニバース・データベース」は、セクター分析をさらに容易にします。

明確で公開されたルール／管理規則

ICBは、一貫性ある保守を確保するため、公開されている「ICB管理規則」に従って独立管理されています。

カスタムソリューション

FTSEカスタムソリューションは、世界72カ国の65,000を超える企業の株式データベースをもとにカスタマイズされたベンチマークインデックスを提供します。カスタマイズの代表的な例としては「特定国除外」、「特定業種除外」、通貨ヘッジ、特定税制、特定株式の組込／除外などがあります。

カスタマイズする理由

- ・ **最適なソリューション** — お客様のニーズにぴったり合ったインデックスソリューションを設計。
- ・ **技術的に優れたインデックス** — 専門知識を持ったFTSEのインデックスデザイナーによるカスタムソリューション。
- ・ **柔軟性** — 72カ国、65,000以上の企業の株式データベースをもとにお客様のユニバース（投資銘柄）を決定。
- ・ **省時間・省コスト** — 第三者グローバルインデックスデザイナーや計算スペシャリストへの業務委託。

FTSEカスタムインデックスの利用者

FTSEは、世界有数のアセットオーナーやファンドマネージメント会社の、それぞれのニーズに合ったソリューションの開発に協力してきました。

- ・ カリフォルニア州職員退職年金基金（カルパース）の依頼によりFTSE All-Worldインデックスに基づくカスタムベンチマークを開発。
- ・ フランス政府の年金積立基金（FRR）のために、欧州、米国およびアジア太平洋市場をカバーする、アクティブ運用とパッシブ運用のための14のカスタムベンチマークインデックスを作成。

www.ftse.com/custom

FTSEカスタムソリューションチームは以下のサービスを提供します。

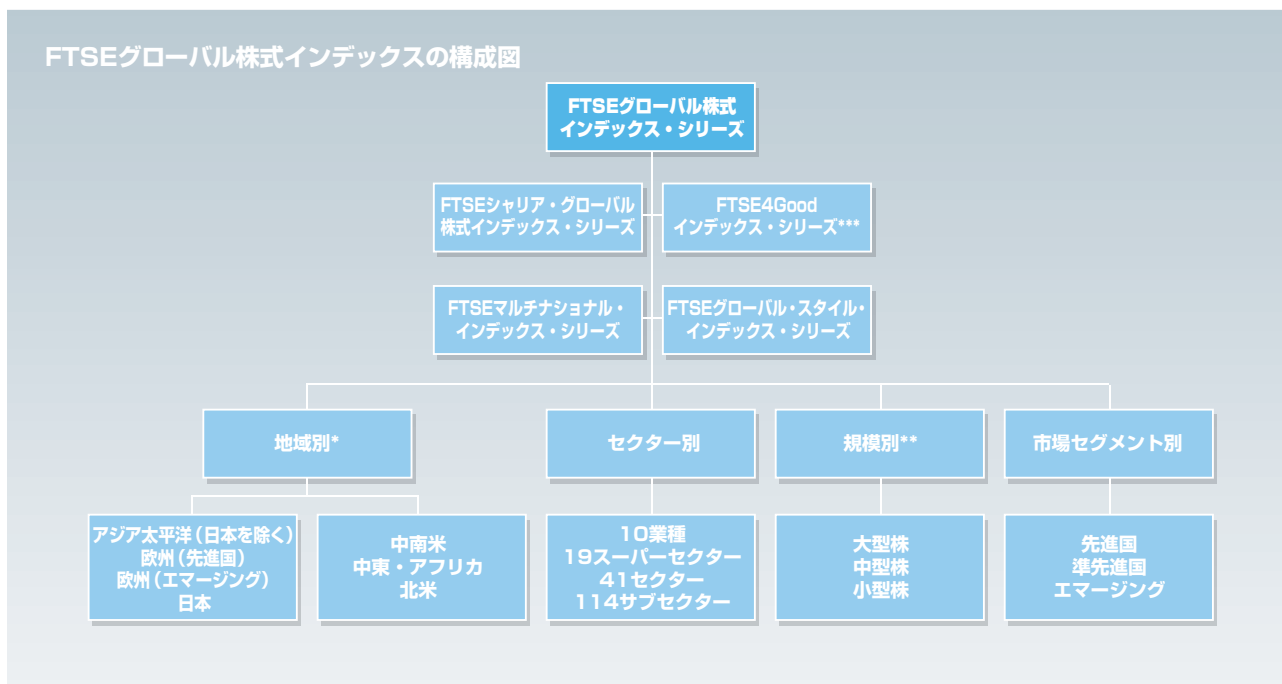
1 お客様とともにニーズを見極める

2 お客様のカスタムベンチマークを設計・構築する

3 配信管理と継続的なメンテナンス、サポートを行う



グローバル株式インデックス



FTSEは、地域、セクター、規模、市場セグメント別の、様々なインデックス・シリーズを提供するために、毎日12万以上の指数を計算しています。

* これらの地域はさらに個々の国に分類可能。

** FTSE All-Worldインデックス（大型株・中型株の総合指数）を含む。

*** 詳細は責任投資のセクションを参照。

FTSEグローバル株式インデックス・シリーズ (GEIS)

FTSEグローバル株式インデックス・シリーズ (GEIS) は、世界48カ国の8,000以上の株式をカバーし、世界の投資可能時価総額98%を占めています。世界中の投資家ニーズに応えるため、あらゆる株式・業種を網羅しています。

モジュラー方式により、ベンチマーク選択やポートフォリオ構成を極めて自由に行うことができます。本インデックス・シリーズは、「先進国」「準先進国」「エマージング」「フロンティア」に分類され、インデックスは地域・国・セクターレベルで計算されます。また、インデックスは、すべての株式を対象としたFTSE Global All Capインデックス（大型株・中型株・小型株）、FTSE All-Worldインデックス（大型株・中型株）、または個別に（大型株、中型株または小型株）と、規模別でも計算されます。

FTSEグローバル株式インデックス・シリーズは、世界中の投資家のニーズに応え、妥当性と投資適格性を保証する、優れた投資ユニバースです。

- ・ **代表性** — 投資機会集合を的確に反映
- ・ **包括性** — 投資可能なユニバースを網羅
- ・ **投資適格性** — 浮動株調整と流動性スクリーニング
- ・ **透明性** — 規則に基づく明確な手法を用い、定期的な独立審査を実施

www.ftse.com/geis

FTSE All-Worldインデックス

FTSE All-Worldインデックスは、FTSEグローバル株式インデックス・シリーズの2,700に及ぶ大型株・中型株を対象とし、投資可能時価総額の90~95%をカバーしています。

www.ftse.com/allworld

FTSEグローバル小型株インデックス

FTSEグローバル小型株インデックスでは、他に類を見ない48カ国、4,600以上もの小型株を網羅しています。

FTSEグローバル小型株インデックスは、FTSEグローバル株式インデックス・シリーズの世界7地域それぞれの投資可能時価総額下位10%をカバーしています。個々のグローバルユニバースで同一の選択手法を用いることにより、規模レベル間での株式重複がなく、小型株のみの管理や総合ベンチマークの一部としての小型株管理が柔軟に行えます。

www.ftse.com/smallcap

FTSEマルチナショナル・インデックス・シリーズ

FTSEマルチナショナル・インデックス・シリーズは、多国籍企業と地元企業のパフォーマンスを別々に評価するためのインデックス・シリーズです。

FTSEマルチナショナル・インデックス・シリーズは、収益の30%以上を国外で得ている企業を対象としています。FTSEグローバル100インデックスは、FTSEマルチナショナル・インデックスの上位100企業で構成されています。上記以外の株式（収益の70%以上を国内で得ている企業）は「地元企業」に分類され、真に地域的なインデックスを形成します。本シリーズは、地域的な経済要因に左右される企業と国際的な経済要因に左右される企業を明確に区別できる、市場で唯一のインデックス・シリーズです。

www.ftse.com/multinationals

FTSEグローバル・スタイル・インデックス・シリーズ

FTSEグローバル・スタイル・インデックス・シリーズは、次世代の国際的なバリュー株/グロース株インデックスです。本シリーズは、9つの項目によるマルチファクター方式を用い、企業のバリューおよびグロースの特徴を明確に評価します。パッシブおよびアクティブ運用者やアセットオーナーの資産配分、運用評価およびベンチマーキングに役立つ優れたベンチマークです。

常に進化し続ける市場において、スタイルマネージャーにとっての最大の困難の1つは、グロース株とバリュー株を見分けることです。グローバル・スタイル・インデックス・シリーズは、総合スタイルランキング (OSR) *コンセプトにより、バリュー株とグロース株の分類を比類ない正確さで行うことができます。

www.ftse.com/style

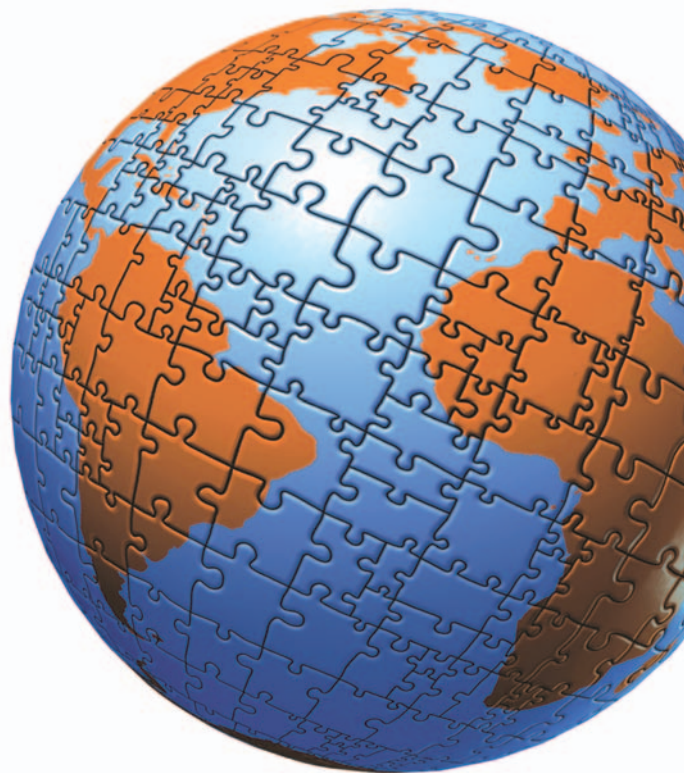
* FTSEおよびスタイル・リサーチ社が開発

FTSEシャリア・インデックス・シリーズ

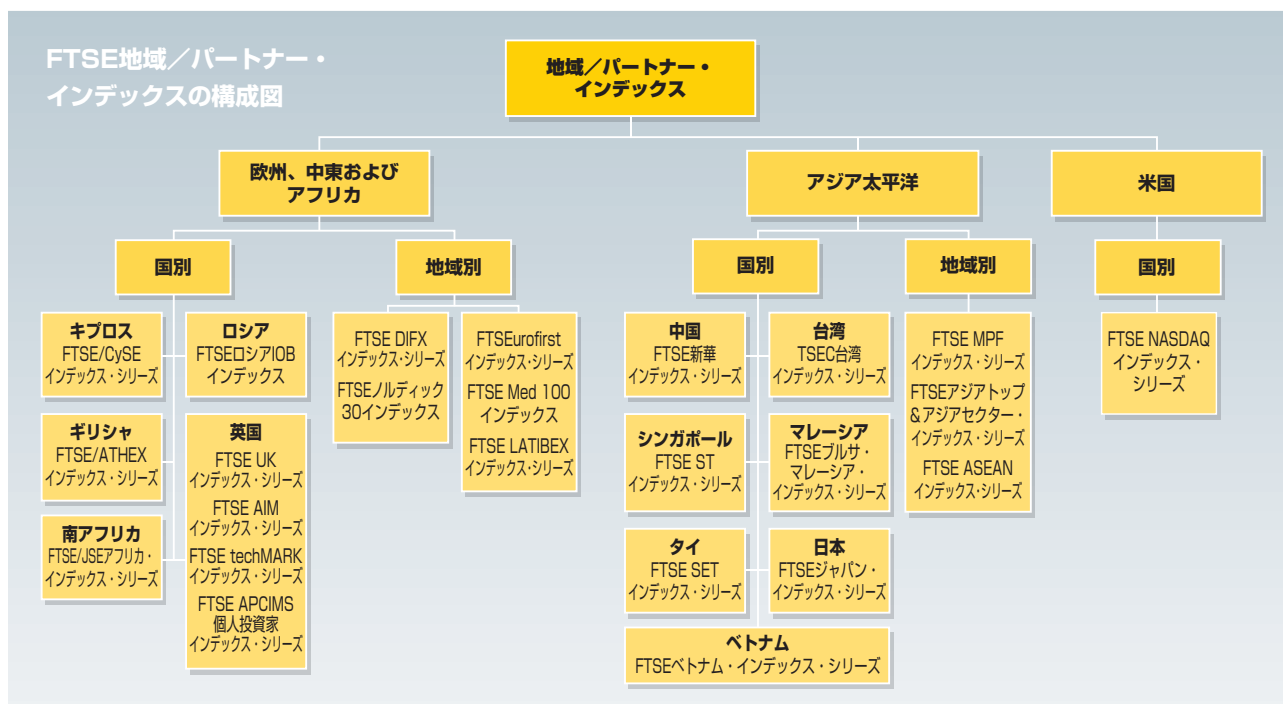
増大するシャリア適格の投資機会に対する需要に応えるため、FTSEでは様々なシャリア・インデックスを開発し、イスラム投資家に幅広いシャリア・インデックス・ソリューションを提供しています。

FTSEグローバル株式インデックス・シリーズを構成する大型・中型株を基本ユニバースとし、シャリアのコンサルティング企業、ヤサール社により、シャリアの明確な原則に基づいてスクリーニングされています。

www.ftse.com/shariah



地域／パートナー・インデックス



欧州、中東およびアフリカ

FTSE/ATHEXインデックス・シリーズ

FTSE/ATHEXインデックス・シリーズは、FTSEとアテネ証券取引所のジョイントベンチャーです。本シリーズはギリシャ市場のパフォーマンスベンチマークとなる、時価総額加重のインデックスです。アテネ株式市場をリアルタイムで評価する、FTSE/ATHEX 20、FTSE/ATHEX 中型40、FTSE/ATHEX 小型株、FTSE/ATHEX 140、FTSE/ATHEX 国際インデックスがあり、指数連動型デリバティブ取引の構築も可能です。

www.ftse.com/athex

FTSE/CySEインデックス・シリーズ

FTSE/CySEインデックス・シリーズは、FTSEとキプロス証券取引所 (CSE) のジョイントベンチャーで、キプロス市場で取引される最大・最流動証券に対するパフォーマンスベンチマークです。

www.ftse.com/cyse

FTSE DIFXインデックス・シリーズ

FTSEとドバイ国際金融取引所 (DIFX) のジョイントベンチャーによって開発されたFTSE DIFXインデックス・シリーズは、湾岸協力会議 (GCC) 加盟国市場を対象とした取引可能なインデックスとしては初めてのもので、シャリア準拠のインデックスとシャリア非準拠のインデックスにより構成されています。本シリーズに最初に組み入れられたGCC国は、UAE、クウェート、カタールです。本シリーズは、指数連動型ファンド、インデックス証券、ワラント、ETFなどの投資商品の創出を容易にし、先物やオプションを含むインデックス・デリバティブの導入を実現するために作成されたものです。

www.ftse.com/difx

FTSEurofirstインデックス・シリーズ

FTSEurofirstインデックス・シリーズは、FTSEとNYSE Euronext（株式、債券、デリバティブ、コモディティの欧州国際総合取引所）のジョイントベンチャーです。

FTSEurofirstインデックス・シリーズは欧州の最大・最流動株をカバーし、投資家が様々なベンチマークをより正確にトラックできるようにしています。取引可能なFTSEurofirst 80および100インデックスからベンチマークのFTSEurofirst 300インデックスまで、FTSEurofirstインデックス・シリーズは、欧州におけるすべての投資ニーズに応える様々な商品を提供しています。

- ・ **FTSEurofirstスーパーセクター・インデックス**

FTSEurofirstスーパーセクター・インデックスは、FTSEurofirst 300ユニバースに基づくICB（業種分類システム）18セクターをベースにしたインデックスです。

www.ftse.com/ftseurofirst

FTSE/JSEアフリカ・インデックス・シリーズ

FTSEとJSE社は協力して、南アフリカ市場のインデックスを作成しました。FTSE/JSEアフリカ・インデックス・シリーズは、南アフリカ企業のパフォーマンスを示し、南アフリカ市場の主要企業、業種セグメントのパフォーマンスを評価する総合的なインデックスを提供します。本シリーズにより、投資家は規模別、あるいは業種別でのトラックが可能になります。

www.ftse.com/jse

FTSE LATIBEXインデックス・シリーズ

FTSEとボルサデマドリードは協力して、FTSE LATIBEX All-ShareインデックスおよびFTSE LATIBEXトップ・インデックスを開発しました。これにより欧州の投資家は、リアルタイムでLATIBEX市場で取引されている中南米株のパフォーマンスに対するワンポイントアクセスが可能となりました（ユーロ建て）。FTSE LATIBEXブラジルインデックスはブラジル優良株に対する関心の増大に応じて導入されました。本インデックスは、ブラジル株をカバーするユーロ建ての取引可能なインデックスとしては唯一のもので、LATIBEX上場企業の浮動株調整後時価総額上位13社によって構成される、流動性の高いインデックスです。

www.ftse.com/latibex

FTSE Med 100インデックス

FTSE Med 100インデックスは、東地中海地域の証券取引所パフォーマンスをトラックします。本指数はキプロス、ギリシャ、イスラエルの証券取引所に上場されている東地中海地域の最大・最流動企業100社をカバーする取引可能なインデックスで、リアルタイムに計算され、デリバティブ取引、あるいは上場投資信託、その他の投資商品に適しています。

www.ftse.com/med100

FTSEノルディック30インデックス

FTSEノルディック30インデックスは、スウェーデン、デンマーク、ノルウェーおよびフィンランドの最大・最流動企業30社のパフォーマンスを、デリバティブ取引を目的としてリアルタイムでトラックします。本インデックスは、FTSE All-Worldインデックスの北欧地域のユニバースを使用しています。

www.ftse.com/nordic

FTSEロシアIOBインデックス

FTSEグループはロンドン証券取引所と共同して、FTSEロシアIOBインデックスを開発・導入しました。FTSEロシアIOBインデックスは、ロンドン証券取引所の預託証券取引システム「インターナショナル・オーダー・ブック」（IOB）でロシア預託証券（DR）の形で取引されている最大・最流動のロシア企業15社のパフォーマンス評価を目的として設計された時価総額加重インデックスです。本インデックスは、世界有数の規模と影響力を持つロシア商品市場への投資機会と、IOBによる便利で費用効果の高い投資手段を提供します。

www.ftse.com/iob



UKインデックス

FTSE UKインデックス・シリーズ

UKインデックス・シリーズは英国企業のパフォーマンスを対象とし、英国株式市場の主要セグメントおよび個々の業種のパフォーマンスを評価するための総合的なインデックス・シリーズです。

FTSE 100インデックス

FTSE 100インデックスは、ロンドン証券取引所で取引されている、規模および流動性によるスクリーニングを通過した上位100大企業のパフォーマンスを表わす時価総額加重インデックスです。デリバティブやETFなどの投資商品の構築に広く利用されています。

FTSE 250インデックス

FTSE 250インデックスは、ロンドン証券取引所で取引されている中型株の時価総額加重インデックスです。本インデックスは、規模および流動性によるスクリーニングを通過した、大型株を対象としたFTSE 100インデックスでカバーされない英国中型株と産業セグメントのパフォーマンスを評価できるよう設計されています。

FTSE 350インデックス

FTSE 100およびFTSE 250インデックスの全構成銘柄が対象です。

FTSE小型株インデックス

FTSE小型株インデックスは、FTSE350以外の銘柄を対象としています。

FTSE All-Shareインデックス

FTSE All-Shareインデックスは、ロンドン証券取引所の主要市場に上場している規模および流動性のスクリーニングを通過したすべての適格企業のパフォーマンスを表わす時価総額加重インデックスです。英国市場の投資資金の大部分が本インデックスがトラックするファンドに投資されているため、ロンドン株式市場全体のパフォーマンス評価に最適です。本インデックスは、FTSE 100、FTSE 250およびFTSE小型株インデックスを合わせたものです。

FTSE 350業種セクター

FTSE 350の全構成銘柄を業種別、セクター別、サブセクター別にしたものです。各業種・セクターは別個のインデックスとして計算されます。

FTSE 350利回りインデックス

FTSE 350インデックスの平均年間配当利回りを超える企業は、FTSE高利回りインデックスの対象となり、FTSE 350インデックスの平均年間配当利回りを下回る企業は、FTSEアクチュアリー低利回りインデックスの対象となります。

FTSEフレッジリング・インデックス

FTSEフレッジリング・インデックスは、ロンドン証券取引所の主要市場に上場している英国企業のうち、小さすぎてFTSE All-Shareインデックスに含まれないものを対象としています。

www.ftse.com/uk

FTSE AIMインデックス・シリーズ

FTSE AIMインデックス・シリーズは、ロンドン証券取引所のオルタナティブ投資市場の適格企業すべてを対象としています。普通株の全分類が組み入れ対象です。本インデックス・シリーズは、FTSE AIM UK 50インデックス、FTSE AIM 100インデックス、FTSE AIM All-Shareインデックス、およびFTSE AIM All-Shareスーパーセクター・インデックスで構成されています。

www.ftse.com/aim

FTSE techMARKインデックス・シリーズ

FTSE techMARKインデックス・シリーズは、ロンドン証券取引所のtechMARKに上場されているイノベーションテクノロジー株のパフォーマンスを反映します。業種分類ベンチマーク（ICB）により分類され、未来の市場を形成するテクノロジーに積極的に携わっている企業への投資機会を提供します。

www.ftse.com/techmark

FTSE APCIMS個人投資家インデックス・シリーズ

FTSE APCIMS個人投資家インデックス・シリーズは、ポンド建てアカウントを持つ英国国内の投資家に対し、自身のポートフォリオを評価するための客観的なベンチマークを提供します。

FTSE APCIMS株式市場成長ポートフォリオ・インデックス

株式投資を中心に成長／資本の評価増を目的としています。

FTSE APCIMS株式市場収益株ポートフォリオ・インデックス

株式および債券投資からの収益を目的としています。

FTSE APCIMS株式市場バランス型ポートフォリオ・インデックス

成長と収益をバランスさせたインデックスです。

本インデックス・シリーズは、成長追求、収益追及およびバランス型投資のパフォーマンスを反映するように設計されています。各インデックスは、英国株、外国株、債券、商業不動産、ヘッジファンドなどのインデックスデータと委員会が決定する資産配分比率に基づいて計算されます。

www.ftse.com/apcims



アジア太平洋インデックス

FTSE/ASEANインデックス・シリーズ

FTSEおよびASEANの5つの証券取引所（ブルサマレーシア、ジャカルタ、フィリピン、シンガポール、タイ）が協力し、画期的なFTSE/ASEANインデックス・シリーズを開発しました。

本シリーズは、国内および世界の投資家に、ベンチマークや取引可能なインデックスの形でASEAN市場に投資する機会を促し、指数連動型ファンドやETF、デリバティブ商品などの投資商品の創出も可能です。

www.ftse.com/ASEAN

FTSEアジアトップ&アジアセクター・インデックス・シリーズ

FTSEは、アジア株式市場向けの取引可能なインデックスを幅広く作成しています。これらのインデックスは取引所取引およびOTCのデリバティブ商品、投資信託、ETFの理想的なインデックスとなります。ユニバースはFTSE All-Worldインデックス・シリーズで、中国（H株・B株）、香港（香港株、レッドチップ、HSBC）、インドネシア、インド、韓国、マレーシア、フィリピン、シンガポール、台湾、タイの市場の様々なセクターの株式によって構成されています。

www.ftse.com/asiansector

FTSEブルサマレーシア・インデックス・シリーズ

FTSEおよびブルサマレーシアは、シャリア（イスラム法）準拠のインデックスを含む、マレーシア市場向けの総合的なリアルタイムインデックス・シリーズを開発しました。本シリーズは主要なセグメントのパフォーマンスを評価するよう設計され、マレーシア市場を大型株・中型株・小型株およびフレッジリング（超小型株）に分類し、個々のセグメントにおける柔軟な評価・投資が可能です。FTSEブルサマレーシアEMASインデックスが市場ベンチマークとして導入されています。

www.ftse.com/bursamalaysia

FTSEジャパン・インデックス

FTSEジャパン・インデックスはFTSEグローバル株式インデックス・シリーズの一部で、460以上の大型株・中型株を網羅、日本市場の90%をカバーしています。FTSEジャパン・インデックスは浮動株調整され、流動性の検証も行われています。独立委員会の管理により、市場を最も透明で予測可能なものにします。

www.ftse.com/japan

FTSE海外インデックス

FTSE海外インデックスは、日本の投資家の国際株式投資のためのベンチマークとして設計されています。本インデックスはFTSE All-World（除く日本）の先進国市場における大型株・中型株をカバーしています。取引可能な市場を確実に反映するよう、流動性スクリーニングおよび浮動株調整を全構成銘柄に対して行っています。

www.ftse.com/kaigai

FTSE MPFインデックス・シリーズ

FTSEグループは、香港投資コミュニティの複雑なニーズに応えるカスタムソリューションとして、香港政府運営の退職年金基金（マンドトリー・プロビデント・ファンド）のベンチマークを開発しました。ワトソン・ワイアット社および香港投資ファンド協会（HKIFA）は、国別および地域別の香港ドル通貨ヘッジ株式指数の基本ユニバースとして、FTSE All-Worldインデックス・シリーズを採用しました。2007年に業界に助言を求め、インデックスが最新の投資機会および制限を反映しているかどうかを確認しました。

www.ftse.com/mpf



FTSE SGXシャリア・インデックス・シリーズ

FTSEおよびシンガポール証券取引所（SGX）は、イスラム投資家向けのシャリア準拠インデックス・シリーズとしてSGXシャリア・インデックス・シリーズを共同で開発しました。シャリアの世界的コンサルティング企業であるヤサール社が、全株式に対するシャリア適格性の第三者審査を実施しています。

www.ftse.com/sgx

FTSE SETインデックス・シリーズ

FTSEグループは、タイ証券取引所（SET）と共同で、タイ市場の主要なセグメントをより容易に評価できる総合的な新インデックス群を投資家に提供するため、FTSE SETインデックス・シリーズを開発しました。本シリーズは、FTSEが定める投資適格性スクリーニング基準を満たしたタイの時価総額上位30銘柄のパフォーマンスを示す新しいヘッドライン・インデックスであるFTSE SET大型株インデックスを含んでいます。既存のSET 50インデックスに代わる頼れる選択肢となる、より小さな株式バスケットによる、より焦点を絞った流動性の高いヘッドライン・インデックスです。

www.ftse.com/thailand

FTSE STインデックス・シリーズ

長い歴史を持つストレイトタイムズ指数を含むFTSE STインデックス・シリーズは、FTSE、シンガポール証券取引所（SGX）およびシンガポール・プレス・ホールディングス社（SPH）による新たな提携事業の一環として開発されました。新たにヘッドラインSTIおよびセクター・インデックスを加えた本シリーズは、シンガポール市場の総合的なインデックス・ソリューションを提供します。本シリーズにもFTSEの浮動株調整と流動性スクリーニングがなされ、透明性と流動性を高めています。

www.ftse.com/st

TSEC台湾インデックス・シリーズ

TSEC台湾インデックス・シリーズは、台湾証券取引所（TSEC）とFTSEグループとのジョイントベンチャーです。この提携により、台湾市場のローカルな知識と国際インデックスの機能が融合し、台湾市場へのエクスポージャーを投資家に提供します。

本シリーズはデリバティブ取引、指数連動型ファンド、ETF、パフォーマンスベンチマークを目的として開発されました。

www.ftse.com/taiwan

FTSEベトナム・インデックス・シリーズ

魅力的な新興ベトナム市場への投資に対する総合的なソリューションを提供するFTSEベトナム・インデックス・シリーズは、ホーチミン証券取引所に上場しているベトナム企業のパフォーマンスを表わすもので、取引可能ユニバースの上位90%（浮動株調整前）をカバーする広範な市場のベンチマークと、FTSEベトナムAll-Shareインデックスのサブセットをカバーする、海外投資家の保有可能性が十分にある銘柄で構成される投資可能インデックスの2つで構成されています。

www.ftse.com/vietnam

FTSE新華インデックス・シリーズ

FTSE新華インデックス・リミテッド（FXI）は、FTSEグループの国際インデックス構築技術と新華ファイナンスの地元中国市場の知識とデータ力を組み合わせたユニークなジョイントベンチャー企業です。FTSE新華インデックスは、中国市場をトラックする世界初の包括的な透明性のあるシリーズであり、幅広いベンチマーク、大型株の取引可能インデックスおよびセクター・インデックスにより、様々な投資家に向けあらゆる種類の中国株をカバーするユニークなシリーズです。

中国は独特な規制環境を持ち、異なる投資ニーズと認可を持つ様々な区分の投資家があります。投資家区分は、中華人民共和国内に居住しているかどうか、国内投資か海外投資か、あるいは中国に投資したい海外投資家であるかによって決定されます。各投資家区分に適したFTSE新華インデックスを次ページで紹介します。

www.ftsexinhua.com



アジア太平洋インデックス (続き)

FTSE新華インデックス・シリーズ (続き)

中国投資

対象となる投資家区分：

適格外国機関投資家 (QFII) — 中国政府の認可を受け、全種類の中国株式を既定／承認割当量まで取引できる海外機関投資家。適切なインデックスには以下のものがあります。

FTSE新華A株インデックス・シリーズ

上海証券取引所および深セン証券取引所に上場されている'A'株をカバーするインデックス・シリーズで、パフォーマンスベンチマークとして、あるいは指数連動型ファンドや投資信託、ストラクチャード商品およびデリバティブ商品の構築に使用することができます。本シリーズには次のインデックスがあります。

- **FTSE新華All-Shareインデックス** — FTSE新華A株インデックス・シリーズのベンチマーク・インデックスで、中国国内の全適格'A'株を含み、A株市場の全時価総額の95%をカバーすることを目標としています。本インデックスは国内の中国人投資家により広く使用されていますが、中国国内市場の動きをトラックしたい海外投資家にも利用されています。
- **FTSE新華中国A株50インデックス** — 全時価総額トップ50の'A'株企業で構成されたリアルタイムの取引可能なインデックスです。当インデックスは適格海外機関投資家 (QFII) のニーズに合わせて特別にデザインされており、取引所およびOTCデリバティブ商品、投資信託、ETFの構築に使用することができます。FXI中国A株50インデックスは、中国のA株市場の代表性と取引可能性を最適なバランスでミックスしたインデックスです。

FTSE新華Bインデックス・シリーズ

上海証券取引所および深セン証券取引所に上場されている'B'株をカバーするインデックス・シリーズで、パフォーマンスベンチマークとして、あるいは指数連動型ファンドや投資信託、ストラクチャード商品およびデリバティブ商品の構築に使用することができます。本シリーズにはFTSE新華中国B株インデックス、およびFTSE新華中国B株35インデックスがあります。

その他のインデックス：

FTSE新華総合200インデックス — 中国本土の国内株式および中国債券市場の総合パフォーマンスを表わします。

FTSE新華中国政府債インデックス — 中国の政府債市場のパフォーマンスを表わし、上海および深セン証券取引所で取引される政府債を対象としています。

その他の海外投資家 — 香港証券取引所に上場されているH株およびレッド・チップ株で中国市場にアクセスできる、中国企業への投資機会を求めるQFII以外の機関投資家。適切なインデックスには以下のものがあります。

FTSE新華中国25インデックス — 中国の優良株を最適に反映するリアルタイムの取引可能なインデックスで、香港証券取引所で上場・取引されているH株やレッド・チップ株を含む、中国の時価総額上位25銘柄で構成されています。

FTSE新華中国A株50インデックス — 時価総額トップ50の'A'株企業で構成されたリアルタイムの取引可能なインデックスです。QFIIのニーズに合わせて特別にデザインされており、非QFII投資家のための取引所およびOTCデリバティブ商品、投資信託、ETFの構築に使用されています。FXI中国A株50インデックスは、中国のA株市場の代表性と取引可能性を最適なバランスでミックスしたインデックスです。

国外投資

対象となる投資家区分：

適格国内機関投資家 (QDII) — 中国当局の認可を受け、海外に上場している株式の取引を行うことのできる機関投資家。適切なインデックスには以下のものがあります。

FTSEグローバル株式インデックス・シリーズ — 世界48カ国、8,000以上の株式をカバーし、世界の投資可能時価総額98%を占めるグローバルなインデックス・シリーズで、世界中の投資家ニーズに見合う、あらゆる株式およびセクターを網羅しています。(詳しい情報は6～7ページをご覧ください。)

その他のインデックス：

FTSE新華香港インデックス — レッド・チップ、FTSE香港インデックス (大型／中型株) の香港上場銘柄、FTSE中国インデックス (大型／中型株) のH株、およびHSBCを含む、FTSEグローバル株式インデックス・シリーズ (GEIS) 銘柄で構成されるベンチマーク・インデックスです。

FTSE新華中国25インデックス — 中国の優良株を最適に反映するリアルタイムの取引可能なインデックスで、香港証券取引所で上場・取引されているH株やレッド・チップ株を含む、中国の時価総額上位25銘柄で構成されています。



FTSE新華インデックス・シリーズの全インデックスの一覧は、www.ftsexinhua.comからご覧になれます。

USインデックス

FTSE NASDAQインデックス・シリーズ

2大グローバルファイナンシャルサービスブランドであるFTSEとNASDAQは、それぞれの経験を持ち寄り、世界で最もダイナミックな市場の1つである米国市場に投資しようとする人の新たな視点として、FTSE NASDAQインデックス・シリーズを創出しました。本シリーズは、米国最初で最大のエレクトロニック株式市場を分類した4つのインデックスで構成されています。NASDAQがカバーする企業（約3,200社）や1日の平均取引ボリュームは他のいかなる米国市場よりも多く、そのNASDAQ市場の評価、投資および取引に、さらに新しい方法が提供されたこととなります。

本シリーズはFTSEの標準グローバル手法により計算され、指数連動商品の創出を可能としています。

以下の4つのインデックスで構成されています。

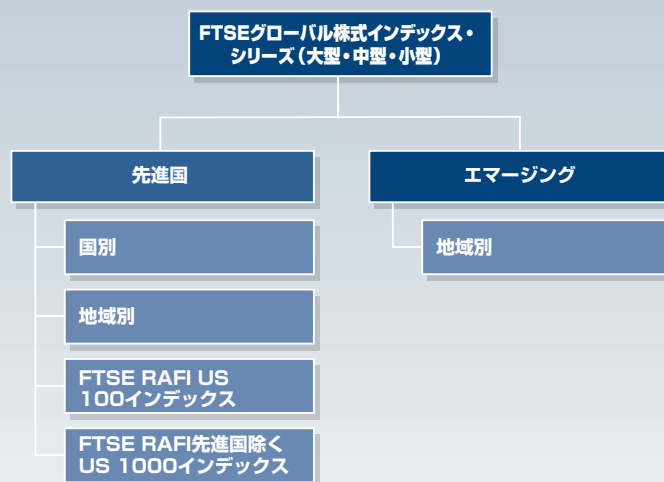
- ・ **FTSE NASDAQ 500**
- ・ **FTSE NASDAQ大型株**
- ・ **FTSE NASDAQ中型株**
- ・ **FTSE NASDAQ小型株**

www.ftse.com/nasdaq

戦略投資インデックス

FTSE RAFIインデックス・シリーズ

FTSE RAFIインデックス・シリーズの構成図



FTSE RAFIインデックス・シリーズ

FTSEとリサーチ・アフィリエイツ社は協力して、画期的なFTSE RAFIインデックス・シリーズを開発しました。本シリーズは、FTSEの非時価総額加重の戦略投資インデックス・シリーズの一環として、インデックスの構成銘柄を時価総額ではなく総現金配当、フリーキャッシュフロー、総売上、企業簿価の4つのファンダメンタル要因によって加重しています。投機的な思惑の影響を受けやすい株価を加重要素に加えていないため、市場のバブルの影響を受けにくく、特定の企業、セクターまたは国への過度のエクスポージャーを避けることができます。FTSE RAFIインデックス・シリーズは、従来の時価総額加重インデックスを補う、非投機的な長期投資のためのインデックスを提供します。

本シリーズには以下のインデックスがあります。

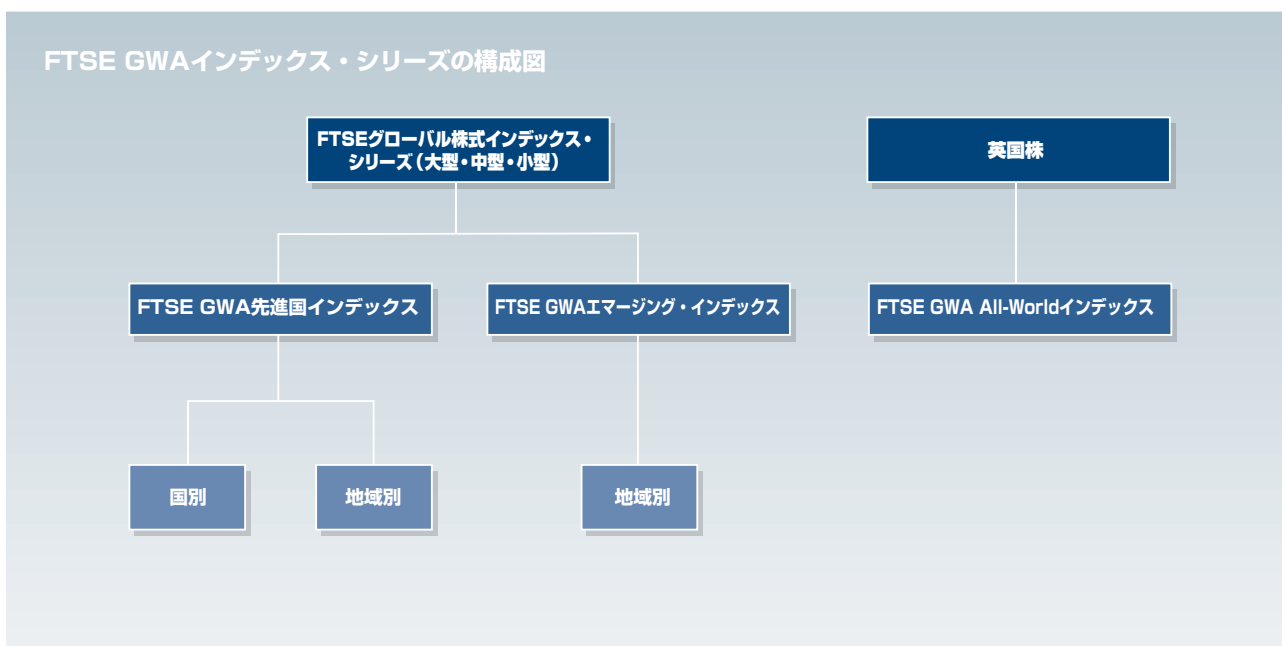
- ・ FTSE RAFI US 100インデックス
- ・ FTSE RAFI先進国除くUS1000インデックス
- ・ FTSE RAFI欧州インデックス
- ・ FTSE RAFIユーロ圏インデックス
- ・ FTSE RAFI香港／中国インデックス
- ・ FTSE RAFI US 1000業種別インデックス
- ・ FTSE RAFIジャパン・インデックス
- ・ FTSE RAFIエマージング・インデックス
- ・ FTSE RAFI先進国1000インデックス
- ・ FTSE RAFI不動産インデックス

主な特徴

- ・ FTSE RAFIインデックス連動商品は、低い回転コストや透明なルールに基づく運用、高いキャパシティというパッシブ運用の利点を持ちながら、アクティブ運用戦略のメリットを提供します。
- ・ FTSE RAFIインデックスは、時価総額ではなくファンダメンタル要因を用いて株式の加重を行っているため、インデックスレビューを行う際、ファンダメンタルバリューに対して割高な銘柄の保有比率を下げ、割安な銘柄の保有比率を上げることで、株価変動のメリットをより多く享受できます。
- ・ ファンダメンタル加重では、非持続的なP/E拡大時に高いP/E株をかかえるリスクが増大しません。つまり、割高株への過度なエクスポージャーを避けることができます。
- ・ 本シリーズは、指数連動型ファンド、ETF、OTC商品の構築が可能です。

www.ftse.com/rafi

FTSE GWAインデックス・シリーズ



FTSE GWAインデックス・シリーズ

FTSE GWAインデックス・シリーズは、FTSEの多様な戦略投資インデックスの1つで、従来の時価総額加重デザインではなく、グローバル・ウェルス・アロケーション (GWA) 社が開発したウェルス・アロケーション手法を使用したウェルス加重インデックスとなっています。この手法では、監査済み財務報告書から得る、簿価、キャッシュフロー、純利益という3つのウェルス要因を使用します。投機的な思惑の影響を受けやすい株価を加重要素に加えないため、特定企業、部門、国への過度なエクスポージャーの原因となる市場バブルによる影響を受けにくい加重方式となっています。

FTSE GWAインデックス・シリーズにより、従来の時価総額加重インデックスを補う、非投機的な長期投資のためのインデックスを提供します。

本シリーズには以下のインデックスがあります。

- ・ FTSE GWA All-Worldインデックス
- ・ FTSE GWA UKインデックス
- ・ FTSE GWA USインデックス
- ・ FTSE GWAアジア太平洋インデックス
- ・ FTSE GWAイマージング・インデックス
- ・ FTSE GWA先進国インデックス

主な特長

- ・ 従来の時価総額加重インデックスを補足する非投機的かつ長期的なインデックス
- ・ パッシブ運用の長所を兼ね備えたアクティブ運用戦略：ハイキャパシティ、透明性、簡便性。
- ・ 短期的な価格変動と投機的な思惑の落とし穴を避けるウェルス加重戦略。

www.ftse.com/gwa

FTSE UK高配当インデックス

FTSE UK高配当インデックスは、FTSE350インデックス（投資信託を除く）のユニバースにおいて、より高利回りの株式を選択・評価するための利回り加重インデックスです。FTSE UK高配当インデックスでは、配当利回りの年間予測によるトップ50銘柄を選択し、時価総額ではなく配当利回りによる加重を行います。FTSE UK高配当インデックスは、従来の時価総額加重インデックスとの相関性が低く、投資家はより高い複合収益を長期的に上げられるようにデザインされています。FTSE UK高配当インデックスの配当情報は、値洗い、資産評価、配当予測、インデックスサービスの大手民間プロバイダー、マーキット・グループが提供します。

www.ftse.com/ukdividendplus

不動産&オルタナティブ投資インデックス

FTSE EPRA/NAREITグローバル不動産インデックス・シリーズ

FTSE EPRA/NAREITグローバル不動産インデックス・シリーズは、世界の適格不動産株式の全体的なトレンドを反映するようデザインされています。対象となる不動産事業は、収益に結びつく不動産の所有、売却および開発と定義されています。このインデックス・シリーズには、様々な地域および国のインデックス、高配当インデックス、グローバル・セクター、REITおよび非REITシリーズが含まれています。

FTSE EPRA/NAREIT高配当インデックス・シリーズ

FTSE EPRA/NAREIT高配当インデックス・シリーズは、FTSE EPRA/NAREITグローバル不動産インデックス・シリーズのユニバース内の、高利回り株式のパフォーマンスを選択・評価します。本インデックス・シリーズは、配当利回りが年率2%以上と予想される株式を対象として時価総額加重を行うことにより、不動産投資信託（REIT）の拡大傾向を活用するとともに、より高い複合収益を長期的に上げられるようにするものです。

FTSE EPRA/NAREITグローバルREITおよび非REITインデックス・シリーズ

FTSE EPRA/NAREITグローバルREITおよび非REITインデックス・シリーズにより、投資家は、各国独自のREIT関連法に従ったEPRA/NAREITユニバース内の非REIT銘柄とREIT銘柄を区別することが可能になります。不動産商品に対する関心の高まりと個別の投資ニーズに対応した本インデックス（サブセット）により、投資家は市場をより細分化することが可能となります。

FTSE EPRA/NAREITアジア33インデックス

FTSE EPRA/NAREITアジア33インデックスにより、オーストラリア、香港SAR、シンガポール、ニュージーランドおよび日本の最大・最流動の不動産証券のパフォーマンスをより詳細に評価することができます。構成銘柄は特定の1銘柄への集中を避けるため、インデックス全体の10%でキャップしています。

FTSE EPRA/NAREIT投資フォーカス・インデックス

FTSE EPRA/NAREIT投資フォーカス・インデックスはFTSE EPRA/NAREITグローバル不動産インデックス・シリーズのサブセットで、賃料インデックスと非賃料インデックスに分けたものです。不動産投資による賃料収入が総収入の70%以上の企業が賃料インデックスに含まれます。70%未満の企業は非賃料インデックスの対象となります。

www.ftse.com/epranareit

FTSE EPRA/NAREIT US不動産インデックス・シリーズ

FTSE EPRA/NAREIT US不動産インデックス・シリーズは、全米の商業不動産スペースへの投資を橋渡しする包括的なREITパフォーマンス指数群として設計され、全ての投資および不動産セクターへの投資機会を提供します。また、さらに分化した不動産セクターおよびサブセクター指数により市場をより詳細に選択し、その市場に見合った商業用不動産を選択することができます。

www.ftse.com/nareit



FTSE UK商業不動産インデックス・シリーズ

FTSE UK商業不動産インデックス・シリーズは、英国内の店舗、オフィスおよび産業用不動産の投資パフォーマンスを反映するようデザインされています。本インデックスは、直接不動産投資に代わる、より分散効果が高く流動性に優れた選択肢を投資家に提供します。主軸となるFTSE全不動産インデックスは、英国商業用不動産市場の店舗、オフィスおよび産業用不動産セクターの毎日のパフォーマンスを提供する3つのセクター指数を追加した今までにないインデックスです。本シリーズは、専用資産ユニット投資信託であるFTSEpxファンドのパフォーマンスに連動しています。純資産価値および未収収益データは多様な資産ポートフォリオに投資するFTSEpxファンドから提供され、個々の指数計算はこれらのデータに基づいて行われます。

www.ftse.com/ukcommercialproperty

FTSE IDFCインド・インフラ・インデックス・シリーズ

FTSEグループは、インドのインフラストラクチャー整備金融社（IDFC）と提携し、インド市場を対象とした新しいインデックスを作成しました。FTSE IDFCインド・インフラ・インデックス・シリーズは、収益の大半をインフラ事業から得ているインド企業のパフォーマンスを反映するように設計され、近年著しい成長を遂げているインド市場のインフラ関係のサブセクターへの投資機会を提供します。

www.ftse.com/india

FTSEプライベートバンキング・インデックス・シリーズ

FTSEはプライベートバンキング・インデックス社と提携し、プライベートバンキング業界向けのユニークなインデックス・シリーズを開発しました。本シリーズは、マルチ資産クラスから成るプライベートポートフォリオの投資パフォーマンスを評価する、総合的で透明かつ業界代表性の高いベンチマークツールです。

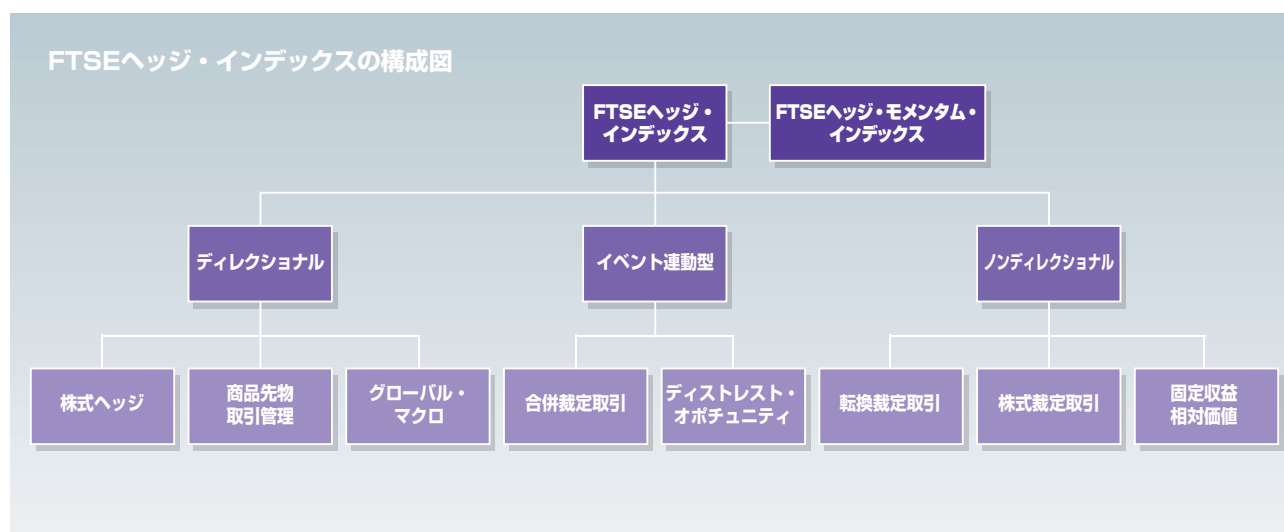
FTSEプライベートバンキング・インデックス・シリーズの特長

- ・プライベートバンクとその顧客に対し、絶対的・相対的な投資パフォーマンスの評価を可能とする、明確な業界ベンチマークを提供します。
- ・多様なリスク指向と基準通貨をカバーする12のインデックスから選択できます。
- ・プライベートバンクから送られる資産配分データ、および資産分類による実市場リターンに基づき市場を正確に反映。
- ・金融商品の構築が可能です。

www.ftse.com/privatebanking



不動産&オルタナティブ投資インデックス (続き)



FTSEヘッジ

FTSEヘッジは、これまで複雑だったヘッジファンド投資を参加しやすいものにします。FTSEヘッジは、完全な透明性とアクセス性を実現した投資可能インデックスで、他のFTSEインデックス商品・サービス同様の高い品質を提供します。

- ・ **信頼性** — オープンで投資可能なヘッジファンド・ユニバースの総合的なリスクおよびリターン状況を反映するインデックス・シリーズ。
- ・ **透明性** — 流動性のあるオルタナティブ投資商品の構築を可能とするツール。投資可能なヘッジファンドへの低コストで透明なアクセスを実現します。
- ・ **投資可能性** — 投資家にヘッジファンドへの投資機会を開きます。FTSEヘッジの投資家は、FTSEの豊富な経験に基づく手法と徹底したアプローチがFTSEヘッジにも確実に受け継がれていることを実感するでしょう。

FTSEヘッジ・インデックスは、ヘッジファンドセクターに内在する様々なバイアスを排除し、パフォーマンスとリターンを正確に把握できるようにします。

FTSEヘッジ・インデックスの特長

- ・ 投資可能なヘッジファンド・ユニバース全体の総合的なリスクおよびリターン状況の毎日の評価を可能にする。
- ・ 投資可能な、代表的な分散型グローバル・ヘッジ・ファンドの情報を低コストで提供。
- ・ 流動性のあるオルタナティブ投資商品の構築を可能とする。
- ・ FTSEの「投資可能性*」手法を用いた加重を実施。
- ・ 多様な取引戦略、透明なルールに基づくファンド選択、および市場戦略分類を可能とする。
- ・ 統一管理プラットフォームに基づいて行われる日々のリスク監視および原資産評価のデータを反映。
- ・ 年度ごとにリバランスを実施。

www.ftse.com/hedge

FTSEヘッジ・モメンタム・インデックス

FTSEヘッジ・モメンタム・インデックスは、基礎となるFTSEヘッジ・インデックスをアウトパフォームすることを目的とした戦略投資インデックスで、継続的なポジティブリターン（モメンタム）を示しているか否かによって、構成ファンドをオーバーウェイトもしくはアンダーウェイトします。

* 「投資可能性」は、FTSE株式インデックスに用いる浮動株調整と類似するものです。FTSEヘッジ・インデックスの構成プロセスは、「Rules for the Management of FTSE Hedge」(「FTSE Ground Rules」, www.ftse.com/hedgeからダウンロード可能) に詳しく記載されています。

責任投資インデックス

FTSEは、FTSE4Goodインデックス・シリーズの導入以来、責任投資（RI）市場の形成と発展に大きな役割を果たし、大きな賞賛と関心を寄せられてきました。FTSEはその後、多様な環境・社会基準を満たす銘柄への簡便な投資を実現するため、様々な責任投資インデックスを開発してきました。

FTSE4Goodインデックス・シリーズ

FTSE4Goodインデックス・シリーズは、世界的に認められている企業責任基準に適合する企業のパフォーマンスを評価し、これらの企業への投資を促進する目的で作成されました。本インデックス・シリーズは、世界的に認められているFTSEグローバル株式インデックス・シリーズから派生したもので、FTSEの世界に知られた最先端のインデックス・デザイン、透明性、計算技術を受け継いでいます。その透明な運営および基準により、FTSE4Goodは、幅広い責任投資（RI）商品の創出に最適なインデックスとなっています。

FTSE4Goodの組み入れ基準は、世界的に認められている企業責任（CR）基準を反映しており、その発展に合わせて随時変更されます。組み入れ基準は広範な市場調査に基づいており、NGO、政府機関、コンサルタント、学術機関、投資機関、企業部門などの幅広いステークホルダーの協力により策定されました。

FTSE4Goodインデックス・シリーズには、グローバル、グローバル100、UK、UK50、欧州、欧州50、US、US100およびジャパン・インデックスがあります。

FTSE4Goodインデックス・シリーズを投資ユニバースとして使用することにより、投資家は、ポートフォリオの構成銘柄が新しい環境・社会基準に随時適合していることを確信することができます。ライセンス契約による収益はすべて、FTSEによりユニセフ（国連児童基金）に寄付されます。

www.ftse.com/ftse4good

FTSE4Good環境リーダー欧州40インデックス

FTSE4Good環境リーダー欧州40インデックスは、主導的な環境活動を行なっている欧州企業を選定しています。これらの企業は、環境リスクおよび環境影響の管理、および環境フットプリントの削減に意欲的に取り組んでいます。本インデックスは、FTSE4Goodインデックス・シリーズ内の、5段階の環境評価で最高の「ベストプラクティス」に認定された欧州企業、時価総額上位40社により構成されています。

本インデックスは、個人および機関投資家向け商品の構築に使用できるようデザインされています。

www.ftse.com/environmental_leaders



FTSE4Good

FTSE4Good IBEXインデックス

FTSEグループはボルサス・イ・メルカードス・エスパニョール（BME）社と提携し、FTSE4Good IBEXインデックスを開発しました。本インデックスは、BME社のIBEX 35インデックスとFTSEスペインAll-Shareインデックス中の、環境持続性を含む企業責任基準を満たすステークホルダーとの建設的な関係形成や普遍的な人権の擁護・支持に貢献している企業で構成されています。

FTSE4Good IBEXインデックスの企業責任に関する組み入れ基準は一般に公開された、透明性のあるものとなっています。

www.ftse.com/IBEX

FTSE ET50インデックス

FTSE ET（環境技術）50インデックスは、環境技術専門企業、Impax Asset Management社との提携により導入されました。Impax社により最初に設計され1999年に導入された本インデックスは、コアビジネス（全体の50%以上）が環境技術の開発あるいは活用によって成り立っている企業のパフォーマンスを評価するものです。これには代替エネルギー、エネルギー効率、水処理、公害防止、廃棄物処理企業などが含まれます。

Impax社が開発したインデックスは、FTSEのインデックス構築手法、最先端の浮動株調整および流動性スクリーニングを適用することによりさらに強化され、FTSE ET50インデックスとして再導入されました。本インデックスは、FTSE環境技術委員会の第三者審査を受けています。

www.ftse.com/ET50

FTSE環境オポチュニティAll-Shareインデックス

FTSE環境技術委員会の指揮のもと、Impax Asset Management社との共同で開発されたもう1つのインデックスです。本インデックスは、環境技術分野に注力する企業で構成されたベンチマークインデックスとしても使用でき、環境関連企業への投資機会を提供します。FTSEグローバル株式インデックス・シリーズの全構成銘柄のうち、環境市場・技術による収益が事業全体の20%を超える企業により構成されている、グローバルなインデックスです。

www.ftse.com/EO

債券インデックス



FTSEアクチュアリーUK国債インデックス・シリーズ

FTSEアクチュアリーUK国債インデックス・シリーズは、普通国債市場および指数連動国債市場をカバーする、指数および関連債券データ（例：利回り、デュレーション、コンベクシティー）の総合的なインデックス・シリーズです。本シリーズは、適格英国国債の主要ベンチマークであり、ヘッドライン・インデックスの他、様々な満期時期に対応するサブインデックスがあります。

また、1年から50年までの期間構造の利回りインデックスもあります。

www.ftse.com/uk_gilts

FTSEグローバル債券インデックス・シリーズ

FTSEグローバル債券インデックス・シリーズは、主要な国債市場、および選り抜かれた社債市場をカバーするインデックスの総合的なシリーズです。本インデックスは、他のすべてのFTSEインデックスと同様に、規則に基づいた、一貫性および透明性の高いインデックスであり、債券市場の適切、正確かつ便利なベンチマークとなっています。

FTSEはその中立性により、利害対立のない客観的な市場情報を提供します。また、FTSE債券インデックスは、債券投資専門家の第三者委員会により審査され、FTSEの債券グループとともに継続的にインデックスのあらゆる側面における監視および再検討を行っています。

本シリーズは、各市場の主要ディーラー銀行の気配値を使用して計算されているのが特長です。債券価格は品質管理プロセスで処理され、各構成銘柄に最適な単一価格を提示します。

FTSEは市場と投資家のニーズに合わせたインデックスの継続的な拡大・開発を行っています。本シリーズには、価格と総収益の2種類のインデックスがあります。

FTSEグローバル国債インデックス

FTSEグローバル国債インデックスは、22カ国の中央政府が発行する当該国通貨またはユーロ建ての債券をカバーしています。ユーロ圏総合インデックスとアジア太平洋、北米、ユーロ圏、欧州除くユーロ圏の4つの地域別インデックスがあります。また、国別・満期別のインデックスも提供しています。さらに、これらとは独立した、中国とトルコの政府債インデックスもあります。

FTSEカバードボンド・インデックス

FTSEカバードボンド・インデックスは、ドイツのジャンボ・ファンドブリーフを含む14カ国の証券化銘柄で構成されています。各銘柄は、ドイツのジャンボ・ファンドブリーフ市場と同等の構造と品質を持っています。総合、国別および満期別インデックスがあります。

FTSE社債インデックス

・ FTSEユーロ社債インデックス

FTSEユーロ社債インデックスは、世界の企業の社債のうち、ユーロ建ての債券をカバーしています。各社債は業種分類ベンチマーク（ICB）により分類されています。本インデックスは、投資グレードBBB-以上の社債で構成されています。信用格付け別、満期別のサブインデックスがあります。

・ FTSEスターリング社債インデックス

FTSEスターリング社債インデックスは、投資グレード品質のポンド建て社債をカバーし、各社債は業種分類ベンチマーク（ICB）により分類されています。通信、ユーティリティ（電気・ガス・水道）、銀行を含む11の産業セクターがあります。セクター格付け別、満期別のサブインデックスがあります。

FTSEユーロ建てエマージング市場債券インデックス

FTSEユーロ建てエマージング市場債券インデックスは、FTSEの国分類システムでエマージング市場に分類される国の政府・都市が発行するユーロ建て債券をカバーしています。満期別のサブインデックスがあります。

www.ftse.com/fixedincome

FTSE MTIRSインデックス・シリーズ

FTSEは、金利スワップ・インデックス・シリーズとしてFTSE MTIRSインデックス・シリーズを作成しました。本インデックス・シリーズは、米ドルのスワップ・カーブをカバーする45の指数で構成され、期間は2～30年でスプレッド取引とバタフライ取引を含んでいます。本インデックス・シリーズは、キャッシュフローの正味現在価値（NPV）をリアルタイムで計算することにより市場パフォーマンスをトラックし、基礎となる固定金利を変動金利に変えるスワップ市場の動きを反映します。FTSE MTIRSインデックス・シリーズは、ベンチマークとして使用できると同時に、市場参加者によるインデックス取引ができるよう設計されています。メリットとして、取引詳細の標準化、取引コストの削減、価格の透明化、バックオフィスによるポジションの監視およびポジション価値計算の負担軽減が挙げられます。

www.ftse.com/mtirs



FTSE MTIRSインデックス・シリーズには、次の各インデックスがあります。

- ・金利スワップ — 2～30年スワップの29インデックス
- ・スワップ・スプレッド — 2×3、2×5、2×10、2×30、3×5、3×10、3×30、5×10、5×30、10×30の各期間のベンチマークの組み合わせによる10インデックス
- ・バタフライ・スワップ — 2×3×5、2×5×10、2×10×30、3×5×10、3×10×30、5×10×30の各期間のベンチマークの組み合わせによる6インデックス

FTSEトルコリラ国債インデックス

FTSEトルコリラ国債インデックスは、国内のトルコ国債市場のパフォーマンスを評価する適切、正確で便利なインデックスです。トルコ国債市場に対する投資家の関心は、トルコの経済パフォーマンスおよび安定性の向上に伴い上昇しています。本インデックスは、発行済み額面総額が10億トルコリラを超えるトルコ国債で構成され、一般債（満期一括償還債）とゼロクーポン債の両方を含んでいます。2007年10月、FTSEトルコリラ国債インデックスに基づくETFが欧州のエマージング市場初の債券ETFとして上場されました。2008年グローバルETF賞の授賞式で「最も革新的なETF賞」を受賞した本ETFは、イスタンブール証券取引所に上場され、本市場における利益機会を提供しています。

FTSE新華中国政府債インデックス

FTSE新華中国政府債インデックスは、中華人民共和国政府債のパフォーマンスを反映するよう設計され、上海および深セン証券取引所で取引されている政府債をカバーしています。価格インデックスと総収益インデックスの両方があり、リアルタイムおよび終値指数が中国人民元で計算され、公表されています。

FTSEの商品パッケージ

FTSEデータ商品は、12万以上の指数について、詳細な構成銘柄データとインデックスレベルのデータを提供いたします。お客様のニーズに見合ったサービスを自由に選択することができます。

オプション1：標準パッケージ

- ・ インデックス評価サービス
- ・ 構成銘柄サービス
- ・ トラッカーサービス

オプション1は全FTSEインデックス・シリーズでご利用になれます。

オプション2：上級サービス

オプション2では、オプション1の3つのサービスファイルすべてに加え、様々な追加データを提供します。より詳細なデータにより、株式の属性やパフォーマンス評価についてさらに詳細な分析が可能です。追加データには次のようなものがあります。

- ・ 調整価格
- ・ 株価リターン（1日、1ヵ月、1年）（分割調整済み）
- ・ 実配当
- ・ 配当再投資を含む株価トータルリターン（1日、1ヵ月、1年）

オプション1、2ともにFTP経由でFTSEから直接配信、またはFTSE委託配信サービスからの配信が可能です。

オプション2は、FTSEグローバル株式インデックス・シリーズ（All-Worldおよびマルチナショナル）、FTSEurofirst 300、FTSE UK All-ShareおよびアクチュアリーUK国債インデックスで利用可能で、配当やリスク情報、収益データを含むより広範囲なデータを提供します。

ファイルの内容

インデックス数値サービス

指数数値サービスでは、米ドル、ポンド、ユーロ、円および現地通貨によるインデックスレベルのデータを提供します。

構成銘柄サービス

構成銘柄サービスは、時価総額、浮動株調整割合、インデックス加重などのインデックス構成銘柄データを毎日または月ごとに提供します。

トラッカーサービス

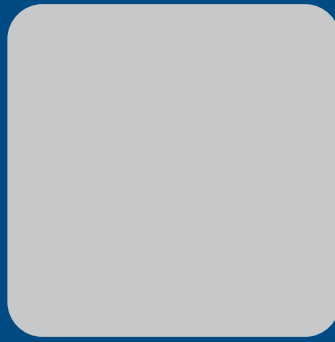
FTSEのトラッカーサービスは、日々の企業活動、配当施策およびその他のインデックスや構成企業の変化を捉えます。オプション1、2の両方で利用できます。

5-DAYトラッカーサービスは、インデックス変更の情報を変更予定日の5日前にお知らせします。オープン構成銘柄サービスは、取引開始時のインデックス・ポジションをお知らせします。





再生紙を使用しています。大豆油インキを使用しています。



FOR FURTHER INFORMATION VISIT WWW.FTSE.COM, EMAIL INFO@FTSE.COM OR CALL YOUR LOCAL FTSE OFFICE:
 LONDON +44 (0) 20 7866 1810 BOSTON +1 888 747 FTSE (3873) FRANKFURT +49 (0) 69 156 85 144 HONG KONG +852 2230 5800 BEIJING + 86 10 5864 5277 MADRID +34 91 411 3787
 NEW YORK +1 888 747 FTSE (3873) PARIS +33 (0) 1 53 76 82 88 SAN FRANCISCO +1 888 747 FTSE (3873) SYDNEY +61 2 9293 2866 TOKYO +81 3 3581 2811

© FTSE International Limited ("FTSE") 2008. All rights reserved.

"FTSE®", "FT-SE®", "Footsie®" and "FTSE4Good®" are trade marks of the London Stock Exchange Plc and The Financial Times Limited and are used by FTSE under licence. "All-Share®" and "All-World®" are trade marks of FTSE. All other trade marks referred to within this brochure are the trade marks of FTSE and/or its partners. All of the indices referred within this brochure ("Indices") are calculated by FTSE and/or its relevant licensed partners. All rights in and to the Indices vest in FTSE and/or its relevant partners. No part of this publication may be reproduced, stored in a retrieval system or transmitted by any other form or means whether electronic, mechanical, photocopying, recording or otherwise without the prior permission of FTSE. All information is provided for information purposes only. Whilst every effort is made to ensure that all information given by FTSE and its relevant partners within this publication is accurate, no responsibility or liability can be accepted by FTSE and its relevant partners for any errors, omissions and/or inaccuracies or for any loss arising from use of this publication. Distribution of FTSE index values and the use of the Indices to create financial products requires a licence from FTSE and/or its licensors.