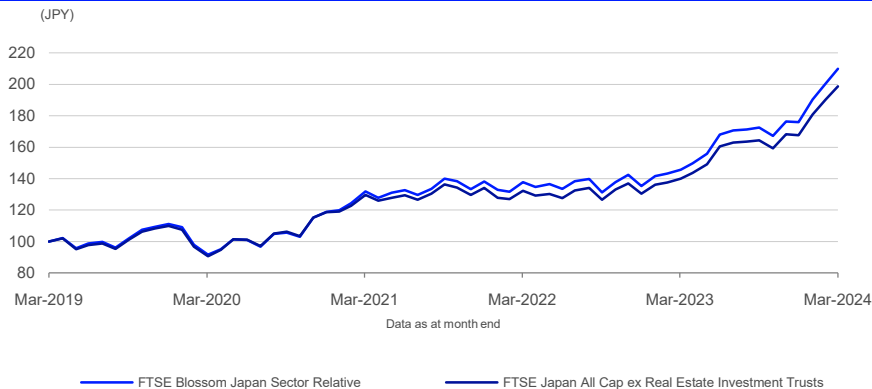


FTSE Blossom Japan Sector Relative Index (Japanese)

Data as at: 29 March 2024

FTSE Blossom Japan Sector Relative Index は、環境、社会、ガバナンス（ESG）評価の高い日本の大型株、中小型株のパフォーマンスを反映するように設計されたセクター・ニュートラルなベンチマーク指数です。さらに、銘柄選定の基準として、気候関連財務情報開示タスクフォース（TCFD）の提言に沿って企業の気候ガバナンスや炭素排出強度を評価することで、低炭素経済への移行をサポートします。本インデックスでは、FTSE Russell と Transition Pathway Initiative (TPI) のデータや分析を組み合わせて利用しています。TPI の詳細については、以下をご参照ください。 <https://transitionpathwayinitiative.org/>.

過去 5 年間のパフォーマンス推移・トータルリターン



パフォーマンス及びボラティリティ・トータルリターン

| Index (JPY) | Return % | | | | | | Return pa %* | | Volatility %** | | |
|---|----------|------|------|------|------|-------|--------------|------|----------------|------|------|
| | 3M | 6M | YTD | 12M | 3YR | 5YR | 3YR | 5YR | 1YR | 3YR | 5YR |
| FTSE Blossom Japan Sector Relative | 19.2 | 21.7 | 19.2 | 44.0 | 59.1 | 109.8 | 16.7 | 16.0 | 14.3 | 16.5 | 14.5 |
| FTSE Japan All Cap ex Real Estate Investment Trusts | 18.5 | 21.0 | 18.5 | 42.0 | 53.3 | 98.7 | 15.3 | 14.7 | 13.7 | 16.1 | 14.3 |

* 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

年度別パフォーマンス・トータルリターン

| Index % (JPY) | 2019 | 2020 | 2021 | 2022 | 2023 |
|---|------|------|------|------|------|
| FTSE Blossom Japan Sector Relative | 19.4 | 7.0 | 16.3 | -2.0 | 30.1 |
| FTSE Japan All Cap ex Real Estate Investment Trusts | 18.4 | 8.0 | 13.0 | -2.7 | 28.6 |

Return/Risk Ratio（シャープレシオ）及びドローダウン

| Index (JPY) | Return/Risk Ratio | | | | Drawdown (%) | | | |
|---|-------------------|-----|-----|------|--------------|-------|-------|-------|
| | 1YR | 3YR | 5YR | 10YR | 1YR | 3YR | 5YR | 10YR |
| FTSE Blossom Japan Sector Relative | 3.4 | 1.0 | 1.1 | - | -8.1 | -15.3 | -29.2 | - |
| FTSE Japan All Cap ex Real Estate Investment Trusts | 3.1 | 1.0 | 1.0 | 0.8 | -8.0 | -16.3 | -29.1 | -32.0 |

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

Drawdown - based on daily data

FEATURES

透明性

ESG（環境・社会・ガバナンス）分野に経験豊富な専門家によって構成される独立性の高い委員会、FTSE Russell ESG Advisory Committee によってガバナンスされます。

適合基準

グローバルな ESG 基準を満たした企業が、当インデックスに組入れられます。適合基準の詳細については、www.ftserussell.com をご覧ください。

目的

インデックス・ファンド、ETP（上場金融商品）等の投資商品の組成、投資パフォーマンス計測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

投資可能性を確保するために構成銘柄選定、ウェイト付けがされています。

流動性

取引可能性を確保するために、構成銘柄の全てに流動性スクリーニングがかけられています。

セクター・ニュートラル/キャップ

投資可能性を確保し、特定セクターへの過度な偏重を避けるため、キャップが適用されています。

計算頻度

終値ベースで、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）が計算されます

業種分類 Benchmark (ICB)

構成銘柄は、セクター分類の国際基準である Industry Classification Benchmark (ICB) に基づいて分類されています。

上位 10 銘柄 - FTSE Blossom Japan Sector Relative Index

| Constituent | ICB Sector | FTSE Blossom Japan Sector Relative (Wgt %) | FTSE Japan All Cap ex Real Estate Investment Trusts (Wgt %) | Diff % |
|---------------------------------|-------------------------------------|--|---|--------|
| Toyota Motor | Automobiles and Parts | 6.26 | 6.02 | 0.24 |
| Sony Corp | Leisure Goods | 2.49 | 2.13 | 0.36 |
| Mitsubishi UFJ Financial | Banks | 2.40 | 2.30 | 0.10 |
| Tokyo Electron | Technology Hardware and Equipment | 2.40 | 2.31 | 0.09 |
| Keyence Corp | Electronic and Electrical Equipment | 1.90 | 1.80 | 0.10 |
| Shin-Etsu Chemical | Chemicals | 1.87 | 1.67 | 0.20 |
| Mitsubishi Corp | General Industrials | 1.77 | 1.75 | 0.02 |
| Hitachi | General Industrials | 1.65 | 1.64 | 0.01 |
| Sumitomo Mitsui Financial Group | Banks | 1.55 | 1.48 | 0.07 |
| Mitsui & Co | Industrial Support Services | 1.43 | 1.38 | 0.05 |
| Totals | | 23.72 | 22.48 | |

業種(ICB インダストリー)別構成比

| | | FTSE Blossom Japan Sector Relative | | FTSE Japan All Cap ex Real Estate Investment Trusts | | |
|----------|------------------------|------------------------------------|--------|---|--------|--------|
| ICB Code | ICB Industry | No. of Cons | Wgt % | No. of Cons | Wgt % | Diff % |
| 10 | Technology | 84 | 11.88 | 173 | 12.14 | -0.26 |
| 15 | Telecommunications | 7 | 3.56 | 15 | 3.67 | -0.11 |
| 20 | Health Care | 32 | 6.77 | 65 | 6.88 | -0.12 |
| 30 | Financials | 55 | 12.05 | 107 | 12.35 | -0.31 |
| 35 | Real Estate | 14 | 4.30 | 34 | 1.98 | 2.32 |
| 40 | Consumer Discretionary | 120 | 22.84 | 297 | 23.34 | -0.49 |
| 45 | Consumer Staples | 51 | 5.76 | 126 | 5.93 | -0.17 |
| 50 | Industrials | 188 | 24.98 | 396 | 25.66 | -0.69 |
| 55 | Basic Materials | 60 | 5.56 | 122 | 5.65 | -0.09 |
| 60 | Energy | 5 | 0.83 | 15 | 0.87 | -0.04 |
| 65 | Utilities | 16 | 1.48 | 31 | 1.53 | -0.04 |
| Totals | | 632 | 100.00 | 1381 | 100.00 | |

インデックス特性

| Attributes | FTSE Blossom Japan Sector Relative | FTSE Japan All Cap ex Real Estate Investment Trusts |
|-------------------------|------------------------------------|---|
| Number of constituents | 632 | 1381 |
| Dividend Yield % | 1.99 | 1.97 |
| Constituent (Wgt %) | | |
| Average | 0.16 | 0.07 |
| Largest | 6.26 | 6.02 |
| Median | 0.04 | 0.01 |
| Top 10 Holdings (Wgt %) | 23.72 | 22.48 |

INFORMATION

ユニバース

FTSE Japan All Cap Index

算出開始日

2022 年 3 月 30 日

基準日

2014 年 9 月 19 日

基準値

1000

投資可能性スクリーニング

浮動株の適用および流動性のスクリーニング

算出頻度

終値ベースで算出

配信方法

FTP および電子メール

通貨

日本円

見直し頻度

年 2 回 (6 月および 12 月)

© 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「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す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、商品性に関し何かなる主張、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)（たとえば 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、直接投資することではありません。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ッ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ッドロジーの適用による後講釈のメトリック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