

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

Data as at: 28 June 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)	1.3	2.8	2.8	9.8	-6.1	27.6	-2.1	5.0	11.5	16.2	20.6

* 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)	1.0	-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/Market	ICB Sector	Net MCap (USDm)	Wgt %
WSP Global	Canada	Construction and Materials	19,404	0.65
RB Global Inc	Canada	Consumer Services	13,937	0.47
TFI International	Canada	Industrial Transportation	11,564	0.39
Arc Resources	Canada	Oil Gas and Coal	10,642	0.36
Kinross Gold	Canada	Precious Metals and Mining	10,181	0.34
Stantec Inc	Canada	Construction and Materials	9,544	0.32
Emera Inc	Canada	Electricity	9,532	0.32
First Quantum Minerals	Canada	Industrial Metals and Mining	8,913	0.30
GFL Environmental Holdings	Canada	Waste and Disposal Services	8,678	0.29
Descartes Sys	Canada	Software and Computer Services	8,241	0.28
Totals			110,636	3.71

ICB スーパーセクター構成

ICB Code	ICB Supersector	No. of Cons	Net MCap (USDm)	Wgt %
1010	Technology	624	369,223	12.38
1510	Telecommunications	107	46,177	1.55
2010	Health Care	392	187,216	6.28
3010	Banks	129	133,605	4.48
3020	Financial Services	175	152,507	5.11
3030	Insurance	40	50,812	1.70
3510	Real Estate	340	257,748	8.64
4010	Automobiles and Parts	135	66,919	2.24
4020	Consumer Products and Services	230	155,078	5.20
4030	Media	94	36,695	1.23
4040	Retailers	133	73,195	2.45
4050	Travel and Leisure	128	68,548	2.30
4510	Food Beverage and Tobacco	182	96,574	3.24
4520	Personal Care Drug and Grocery Stores	90	49,950	1.67
5010	Construction and Materials	237	179,917	6.03
5020	Industrial Goods and Services	771	478,611	16.04
5510	Basic Resources	297	235,957	7.91
5520	Chemicals	221	97,631	3.27
6010	Energy	154	136,295	4.57
6510	Utilities	136	110,697	3.71
Totals		4615	2,983,355	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 / 市場別内訳

Country/Market	No. of Cons	Net MCap (USDm)	Wgt %
Australia	185	141,880	4.76
Austria	19	20,590	0.69
Belgium	23	30,680	1.03
Brazil	84	37,707	1.26
Canada	119	442,599	14.84
Chile	10	4,302	0.14
China	1130	138,085	4.63
Denmark	23	57,658	1.93
Egypt	6	3,368	0.11
Finland	19	28,654	0.96
France	63	69,859	2.34
Germany	84	81,068	2.72
Greece	4	791	0.03
Hong Kong	51	16,246	0.54
Iceland	4	739	0.02
India	281	249,390	8.36
Indonesia	34	13,331	0.45
Ireland	1	947	0.03
Israel	40	20,586	0.69
Italy	53	60,879	2.04
Japan	924	394,827	13.23
Korea	319	124,911	4.19
Kuwait	13	7,575	0.25
Malaysia	42	24,916	0.84
Mexico	10	8,371	0.28
Netherlands	23	26,680	0.89
New Zealand	12	7,772	0.26
Norway	41	55,659	1.87
Pakistan	13	3,982	0.13
Philippines	7	2,483	0.08
Poland	20	25,077	0.84
Portugal	11	8,498	0.28
Qatar	4	2,677	0.09
Romania	1	140	0.00
Saudi Arabia	28	18,034	0.60
Singapore	31	17,935	0.60
South Africa	37	26,308	0.88
Spain	29	32,557	1.09
Sweden	89	121,581	4.08
Switzerland	63	82,201	2.76
Taiwan	377	263,765	8.84
Thailand	75	28,269	0.95
Turkiye	39	6,203	0.21
UAE	5	2,962	0.10
UK	169	270,614	9.07
Totals	4615	2,983,355	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	4615
Net MCap (USDm)	2,983,355
Dividend Yield %	2.38
Constituent Sizes (Net MCap USDm)	
Average	646
Largest	19,404
Smallest	5
Median	341
Weight of Largest Constituent (%)	0.65
Top 10 Holdings (% Index MCap)	3.71

© 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者の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 の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