

FTSE Nareit Equity REITs Index (Japanese)

Data as at: 31 January 2020

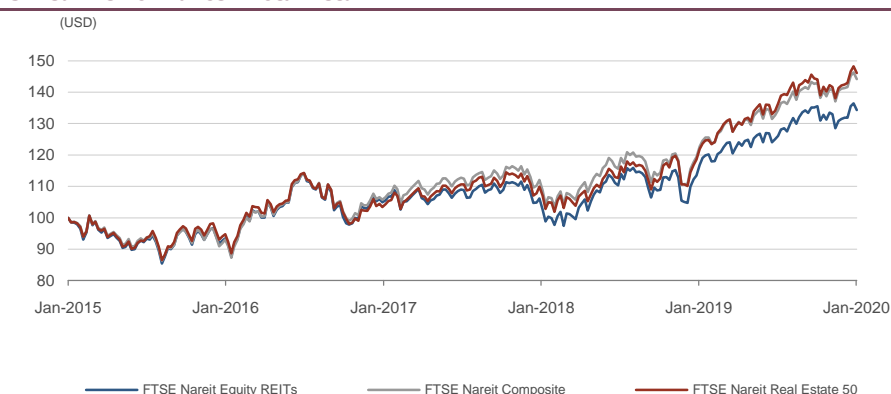
FTSE Nareit 米国不動産インデックスシリーズは、米国経済全体の商業不動産スペースを網羅する REIT パフォーマンスインデックスの包括的なファミリーを投資家に提供するように設計されています。このインデックスシリーズは、すべての投資および不動産セクターへのエクスポージャーを投資家に提供します。さらに、より焦点を絞った不動産セクターならびにサブセクターのインデックスでは、商業不動産へのエクスポージャーを、より限定的な市場に集中させることが可能です。

FTSE Nareit エクイティ型 REIT インデックスには、森林 REIT またはインフラストラクチャ REIT に分類されないすべてのエクイティ型 REIT が含まれます。

REIT について

REIT はアパート、ショッピングセンター、オフィス、ホテルや倉庫などの不動産を所有し、ほとんどの場合にそれらを収益を生み出す事業として運営している企業です。一部の REIT は不動産への融資も行っています。多くの REIT の証券は、通常は主要な証券取引所で自由に取引されています。REIT とみなされるには、企業は課税収益の最低 90% を毎年証券保有者に配当していなければなりません。REIT とみなされる企業は、証券保有者に支払われる配当金を法人税の課税対象収益から差し引くことが認められています。その結果、ほとんどの REIT は課税対象収益の最低 100% を証券保有者に配当しているため、法人税を支払う必要がありません。税金は、受け取った配当金および資本利得に対して証券保有者によって支払われます。大多数の州はこの連邦の制度に従っているため、REIT は州所得税を支払う必要もありません。他のビジネスと同様ですがパートナーシップとは異なり、REIT は資本損失を証券保有者に転嫁することはできません。

5-Year Performance - Total Return



FEATURES

カバレッジ

上場された米国 REIT

目的

当インデックスは、仕組み商品やインデックストラッキングファンドの作成、またはパフォーマンスのベンチマークとしての位置づけを念頭に設計されています。

投資可能性

投資可能な機会セットのみをインデックスに反映するため、各銘柄に浮動株調整を行っています。

流動性

インデックスを売買可能にするために、銘柄にスクリーニングをかけています。

透明性

インデックスの構成銘柄選択手法は FTSE Russell のウェブサイトですべて閲覧可能です。

計算頻度

当インデックスは、リアルタイムベースおよび終値ベースで、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) の値をもとに計算しています。

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 Nareit Equity REITs	-0.9	6.9	1.2	14.1	27.8	34.3	8.5	6.1	11.9	12.4	13.3
FTSE Nareit Composite	0.8	7.8	1.4	16.7	36.2	44.1	10.8	7.6	11.4	11.7	12.4
FTSE Nareit Real Estate 50	1.2	8.0	2.0	19.0	40.9	46.1	12.1	7.9	11.9	11.9	12.4

* 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

前年同期比のパフォーマンス - トータルリターン

Index % (USD)	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019
FTSE Nareit Equity REITs	28.0	8.3	18.1	2.5	30.1	3.2	8.5	5.2	-4.6	26.0
FTSE Nareit Composite	27.6	7.3	19.7	2.3	27.2	2.1	9.4	9.3	-3.9	28.2
FTSE Nareit Real Estate 50	26.7	9.4	18.0	-0.5	28.7	4.4	5.5	9.2	-2.1	29.2

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 Nareit Equity REITs	1.1	0.8	0.5	0.9	-6.0	-14.2	-16.0	-23.0
FTSE Nareit Composite	1.4	1.0	0.6	0.9	-5.3	-12.7	-15.0	-22.1
FTSE Nareit Real Estate 50	1.5	1.1	0.6	0.9	-6.2	-12.5	-14.8	-21.6

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

Drawdown - based on daily data

上位 5 銘柄

Constituent	Property Subsector	Net MCap (USDm)	Wgt %
Prologis	Industrial	58,214	5.82
Equinix Inc	Data Centers	50,055	5.01
Simon Property Group	Regional Malls	40,848	4.09
Welltower Inc.	Health Care	34,332	3.43
Public Storage	Self Storage	33,057	3.31
Totals		216,507	21.65

サブセクター内訳

Property Subsector	No. of Cons	Net MCap (USDm)	Wgt %
Apartments	15	138,750	13.88
Data Centers	5	89,963	9.00
Diversified	16	59,807	5.98
Free Standing	8	57,071	5.71
Health Care	17	125,796	12.58
Industrial	14	120,628	12.06
Lodging/Resorts	15	39,475	3.95
Manufactured Homes	3	27,773	2.78
Office	18	100,918	10.09
Regional Malls	7	47,704	4.77
Self Storage	5	60,227	6.02
Shopping Centers	18	54,362	5.44
Single Family Homes	3	24,304	2.43
Specialty	11	53,134	5.31
Totals	155	999,913	100.00

INFORMATION

ユニバース

Nareit 国内不動産インデックスシリーズ

設定日

2006 年 3 月 6 日

基準日

1999 年 12 月 31 日

基準値

100

投資可能性スクリーニング

浮動株の調整および流動性のスクリーニング

算出頻度

リアルタイムベースおよび終値ベース

終値配信方法

FTP および電子メール

通貨

米ドル (USD)、ユーロ (EUR)、英ポンド (GBP)、日本円 (JPY)、およびその他現地通貨

見直し頻度

四半期ベース (3 月、6 月、9 月、12 月)

インデックス特性

Attributes	FTSE Nareit Equity REITs
Number of constituents	155
Net MCap (USDm)	999,913
Dividend Yield %	3.91
Constituent Sizes (Net MCap USDm)	
Average	6,451
Largest	58,214
Smallest	141
Median	3,059
Weight of Largest Constituent (%)	5.82
Top 10 Holdings (% Index MCap)	35.01

全米不動産投資信託協会について

全米不動産投資信託協会 (National Association of Real Estate Investment Trusts®) Nareit は、米国の不動産および投資市場で運用している REIT や上場不動産企業の同業組合です。詳細は www.reit.com を参照してください。

Nareit®

© 2020 London Stock Exchange Group plc and its applicable group undertakings (the "LSE Group"). The LSE Group includes (1) FTSE International Limited ("FTSE"), (2) Frank Russell Company ("Russell"), (3) FTSE Global Debt Capital Markets Inc. and FTSE Global Debt Capital Markets Limited (together, "FTSE Canada"), (4) MTSNext Limited ("MTSNext"), (5) Mergent, Inc. ("Mergent"), (6) FTSE Fixed Income LLC ("FTSE FI"), (7) The Yield Book Inc. ("YB") and (8) Beyond Ratings S.A.S. ("BR"). All rights reserved.

FTSE Russell® is a trading name of FTSE, Russell, FTSE Canada, MTSNext, Mergent, FTSE FI, YB and BR. "FTSE®", "Russell®", "FTSE Russell®", "MTS®", "FTSE4Good®", "ICB®", "Mergent®", "The Yield Book®", "Beyond Ratings®" and all other trademarks and service marks used herein (whether registered or unregistered) are trademarks and/or service marks owned or licensed by the applicable member of the LSE Group or their respective licensors and are owned, or used under licence, by FTSE, Russell, MTSNext, FTSE Canada, Mergent, FTSE FI, YB or BR. FTSE International Limited is authorised and regulated by the Financial Conduct Authority as a benchmark administrator.

Nareit® is a trade mark of National Association of Real Estate Investment Trusts® ("Partner"). All rights in and to the FTSE Nareit Equity REITs ("Index") vest in FTSE Russell® and/or its relevant Partner(s).

All information is provided for information purposes only. All information and data contained in this publication is obtained by the LSE Group, from sources believed by it to be accurate and reliable. Because of the possibility of human and mechanical error as well as other factors, however, such information and data is provided "as is" without warranty of any kind. No member of the LSE Group nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors make any claim, prediction, warranty or representation whatsoever, expressly or impliedly, either as to the accuracy, timeliness, completeness, merchantability of any information or of results to be obtained from the use of FTSE Russell products, including but not limited to indexes, data and analytics, or the fitness or suitability of the FTSE Russell products for any particular purpose to which they might be put. Any representation of historical data accessible through FTSE Russell products is provided for information purposes only and is not a reliable indicator of future performance.

No responsibility or liability can be accepted by any member of the LSE Group nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors for (a) any loss or damage in whole or in part caused by, resulting from, or relating to any error (negligent or otherwise) or other circumstance involved in procuring, collecting, compiling, interpreting, analysing, editing, transcribing, transmitting, communicating or delivering any such information or data or from use of this document or links to this document or (b) any direct, indirect, special, consequential or incidental damages whatsoever, even if any member of the LSE Group is advised in advance of the possibility of such damages, resulting from the use of, or inability to use, such information.

No member of the LSE Group nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors provide investment advice and nothing contained herein or accessible through FTSE Russell products, including statistical data and industry reports, should be taken as constituting financial or investment advice or a financial promotion.

Past performance is no guarantee of future results. Charts and graphs are provided for illustrative purposes only. Index returns shown may not represent the results of the actual trading of investable assets. Certain returns shown may reflect back-tested performance. All performance presented prior to the index inception date is back-tested performance. Back-tested performance is not actual performance, but is hypothetical. The back-test calculations are based on the same methodology that was in effect when the index was officially launched. However, back-tested data may reflect the application of the index methodology with the benefit of hindsight, and the historic calculations of an index may change from month to month based on revisions to the underlying economic data used in the calculation of the index.

No part of this information may be reproduced, stored in a retrieval system or transmitted in any form or by any means, electronic, mechanical, photocopying, recording or otherwise, without prior written permission of the applicable member of the LSE Group. Use and distribution of the LSE Group data requires a licence from FTSE, Russell, FTSE Canada, MTSNext, Mergent, FTSE FI, YB, BR and/or their respective licensors.

Data definitions available from
info@ftserussell.com

To learn more, visit www.ftserussell.com;
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 4563 6346

Sydney +61 (0) 2 8823 3521