

FTSE気候リスク調整世界国債インデックス (除く日本)

ソブリン | 多通貨

FTSE Climate Risk-Adjusted World Government Bond Index ex Japan (気候 WGBI (除く日本)) は、気候変動リスクに対する耐性と準備状況に関してテイリング手法を採用することにより、各国の気候リスクへの相対的エクスポージャーに応じてインデックスのウェイトを調整し、FTSE World Government Bond Index ex Japan (FTSE世界国債インデックス (除く日本)、WGBI ex Japan) に含まれる現地通貨建て固定利付き投資適格ソブリン債のパフォーマンスを測定します。国別気候スコアは、気候変動の3つの柱 (それぞれ複数のサブインディケーターがあります) について、各国の相対的な気候リスクを評価することにより算出します。

- 移行リスク - パリ協定で定める摂氏2度目標と整合的なGHG排出可能量のモデル化による国家およびその経済への気候関連リスク
- 物理的リスク - 気候変動に起因する物理的影響が国家およびその経済に及ぼす気候関連リスク
- 耐性 - 気候関連リスクに対処するための国家の準備状況および行動

各国にそれぞれの指標のスコアが付与され、さらに合算された単一の国別スコアが算出されます。次に気候リスク特性が良好な国についてはインデックスにおけるウェイトが大きくなり、気候リスクのエクスポージャーが高い国についてはウェイトが小さくなるよう、各国のスコアを用いてインデックスにおけるその国のウェイトを調整します。

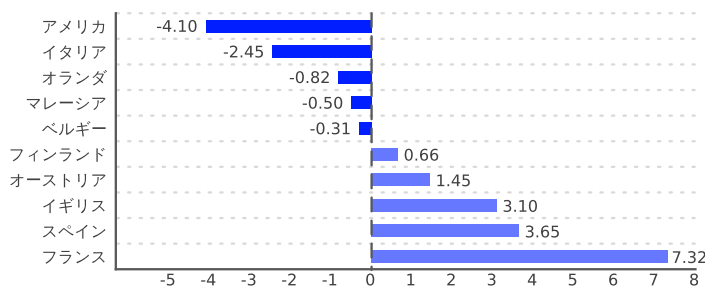
インデックス・プロフィール

| セクター | 銘柄数 | 額面総額* | 時価総額* | ウェイト (%) | 平均クーポン (%) | 平均残存年限 (年) | 最終利回り (%) | 実効デュレーション |
|------------------------------|--------------|------------------|------------------|---------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| Climate WGBI ex Japan | 1,050 | 31,589.66 | 29,455.91 | 100.00 | 2.67 | 9.53 | 3.46 | 6.73 |
| 1-3 年 | 253 | 7,951.57 | 7,910.58 | 26.86 | 2.46 | 1.97 | 3.12 | 1.89 |
| 3-5 年 | 187 | 6,116.60 | 6,080.43 | 20.64 | 2.74 | 3.99 | 3.10 | 3.73 |
| 5-7 年 | 129 | 4,186.32 | 3,913.67 | 13.29 | 2.02 | 6.00 | 3.31 | 5.57 |
| 7-10 年 | 135 | 4,335.27 | 4,356.63 | 14.79 | 3.36 | 8.56 | 3.45 | 7.40 |
| 10年超 | 346 | 8,999.90 | 7,194.60 | 24.42 | 2.78 | 22.06 | 4.23 | 14.83 |
| 北米 | 327 | 13,771.53 | 12,925.45 | 43.88 | 3.11 | 8.40 | 3.97 | 5.89 |
| 中南米 | 17 | 162.09 | 153.65 | 0.52 | 7.86 | 9.39 | 8.89 | 5.07 |
| アジア・パシフィック | 176 | 1,120.50 | 1,127.98 | 3.83 | 2.61 | 7.57 | 2.49 | 6.30 |
| 欧州、中近東およびアフリカ | 530 | 16,535.53 | 15,248.83 | 51.77 | 2.26 | 10.59 | 3.04 | 7.50 |
| WGBI ex Japan | 1,050 | 31,020.13 | 29,441.14 | 100.00 | 2.78 | 8.98 | 3.37 | 6.47 |

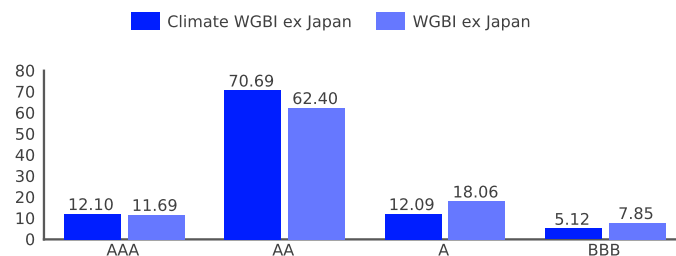
* In USD billions

時価総額比較 (単位 %)

アンダーウェイトおよびオーバーウェイト、各上位5カ国
(Climate WGBI ex Japan) - (WGBI ex Japan)



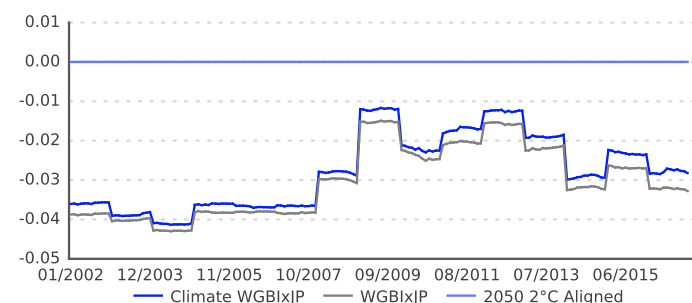
信用格付 (単位 %)



過去のインデックス値 (為替ヘッジなし、米ドルベース)



2度シナリオGHG排出量目標 (2050年時点) との整合性



lseg.com/ftse-russell

出所: FTSE Russell. 2025年6月30日のデータ。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。

Returns shown prior to 2020年1月16日 reflect hypothetical historical performance.

重要な法的開示事項については巻末をご参照ください。

年率リターン (%)

| | Climate WGBI ex Japan | | | | | | | | WGBI ex Japan | | | | | | | |
|---------------------------|-----------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|---------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | USD | | EUR | | JPY | | GBP | | USD | | EUR | | JPY | | GBP | |
| | Unhgd | Hgd | Unhgd | Hgd | Unhgd | Hgd | Unhgd | Hgd | Unhgd | Hgd | Unhgd | Hgd | Unhgd | Hgd | Unhgd | Hgd |
| YTD | 8.91 | 2.64 | -3.93 | 1.65 | 0.10 | 0.47 | -0.47 | 2.64 | 7.57 | 2.82 | -5.10 | 1.82 | -1.13 | 0.65 | -1.68 | 2.83 |
| 1 年 | 9.51 | 5.56 | -0.02 | 3.61 | -1.67 | 0.31 | 1.02 | 5.34 | 8.63 | 5.87 | -0.82 | 3.90 | -2.46 | 0.63 | 0.21 | 5.65 |
| 3 年 | 2.77 | 1.91 | -1.12 | -0.23 | 4.89 | -3.43 | -1.28 | 1.19 | 2.66 | 2.26 | -1.23 | 0.12 | 4.78 | -3.08 | -1.39 | 1.57 |
| 5 年 | -1.66 | -1.41 | -2.53 | -3.07 | 4.25 | -4.85 | -3.68 | -1.93 | -1.55 | -1.13 | -2.42 | -2.81 | 4.37 | -4.58 | -3.57 | -1.65 |
| Climate WGBI ex Japan 開始来 | 3.98 | 3.54 | 2.76 | 2.71 | 4.41 | 1.30 | 4.25 | 3.80 | 3.94 | 3.52 | 2.72 | 2.69 | 4.37 | 1.29 | 4.20 | 3.77 |

組入基準と計算の前提

| | |
|-----------------|---|
| 通貨： | オーストラリア・ドル、カナダ・ドル、人民元*、デンマーク・クローネ、ユーロ、英ポンド、イスラエルシェケル、日本円、メキシコ・ペソ、マレーシア・リンギット、ノルウェー・クローネ、ニュージーランド・ドル、ポーランド・ズロチ、スウェーデン・クローナ、シンガポール・ドル、米ドル |
| 最低残存期間： | 1年 |
| 市場規模基準： | 採用規準：500億米ドル、400億ユーロ、5兆円 除外規準：250億米ドル未満、200億ユーロ未満、2兆5,000億円未満 |
| 最低発行額： | 国により異なる |
| 格付け： | 採用規準：S&Pの「A-」、ムーディーズの「A3」 除外規準：S&Pの「BBB-」未満、ムーディーズの「Baa3」未満 |
| 市場アクセシビリティ・レベル： | レベル2 |
| ウェイト： | 代替加重 |
| 各国気候リスク： | 年次で更新され、9月末時点のリバランスに適用されます。なお、入力データの締め切りは毎年9月1日となっています。 |
| 国別気候リスク評価： | FTSE Russellがアクティブに追跡する主要な現地通貨建てソブリン市場です。これにはFTSE世界国債インデックス (WGBI)、FTSE新興国市場国債インデックス (EMGBI)、FTSE債券国分類フレームワークを通じて発表されるウォッチリストに掲載されたソブリン債の国が含まれます。 |
| 気候関連指標とティルト調整： | 移行リスク指標：0.25、物理的リスク指標：1、耐性指標：1 |
| リバランス： | 毎月末更新 |
| 価格付け： | 以下を除きLSEG Pricing Service: - イギリス国債 – Tradeweb FTSE UK Gilt Benchmark Closing Prices - EMU国債 – Tradeweb FTSE Euro Government Benchmark Closing Prices - アメリカ国債 – Tradeweb FTSE US Treasury Benchmark Closing Prices - イスラエル – テルアビブ証券取引所16 - メキシコ – Proveedor Integral de Precios S.A. de C.V. - ポーランド – BondSpot - シンガポール – シンガポール金融管理局 |
| 算出の頻度： | 日次 |
| 採用銘柄決定日： | 毎月、翌月のインデックス構成銘柄を採用銘柄決定日に固定する。各年の採用銘柄決定日のスケジュールはウェブサイトで発表する。 |
| 基準日： | 2001年12月31日 |

* FTSE世界国債インデックス (WGBI) では、2021年11月プロファイルより中国国債の採用が開始され、36ヶ月の期間をかけて段階的に組み入れられます。

ベンダーコード

SBCWXJY FTSE Climate Risk-Adjusted WGBI ex Japan, in JPY SBCWXJYC FTSE Climate Risk-Adjusted WGBI ex Japan, in JPY Hedged

© 2025 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.

The FTSE Fixed Income Indices are calculated by or on behalf of FTSE Fixed Income LLC or its affiliate, agent or partner. FTSE International Limited is authorized and regulated by the Financial Conduct Authority as a benchmark administrator. 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®", "WorldBIG®", "USBIG®", "EuroBIG®", "AusBIG®", "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 license, by FTSE, Russell, MTSNext, FTSE Canada, Mergent, FTSE FI, YB, or BR.

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 the FTSE Russell Indices or the fitness or suitability of the FTSE Russell Indices for any particular purpose to which they might be put. Any representation of historical data accessible through FTSE Russell Indices 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, analyzing, 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 in this document or accessible through FTSE Russell Indices, 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 license from FTSE, Russell, FTSE Canada, MTSNext, Mergent, FTSE FI, YB, BR, and/or their respective licensors.