FTSE 野村気候リスク調整 Carry and Roll Down (CaRD) 世界国債インデックス

ソブリン | 多通貨

FTSE野村気候リスク調整CaRD世界国債インデックス(FTSE Nomura Climate Risk-Adjusted Carry and Roll Down World Government Bond Index、以下本インデックス)は、代表的なグローバル国債のベンチマークであるFTSE世界国債インデックスを基本ユニバースとして、定量的に観測された気候関連の3つの指標（移行リスク、物理的リスクおよび耐性）により気候リスクの低減を目的として時価総額ウェイトをティルトさせたFTSE気候リスク調整世界国債インデックスがベースラインとなります。

さらに、本インデックスでは、各市場（国）毎の満期別セクターのウェイトにおいてキャリー・ロールダウンが最適、すなわち気候リスク調整後の時価総額ウェイトの制約と金利リスクの制約を同時に満たしつつ、キャリー（利回り）とロールダウン（債券の残存期間の短縮とイールドカーブの傾きから予想される利回り低下によって得られるキャピタルリターン）の合計が最大となるよう満期セクターが選択されています。

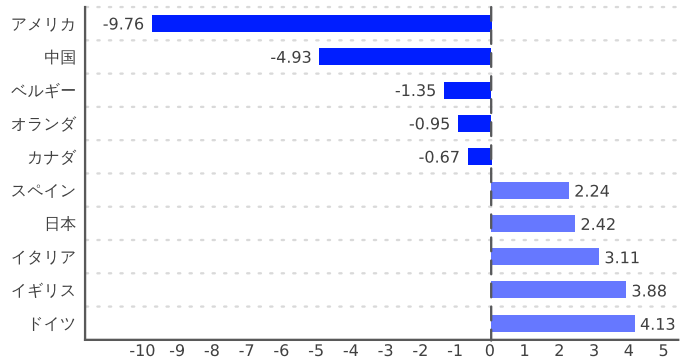
インデックス・プロファイル

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 CaRD WGBI	455	27303.90	26452.81	100.00	2.54	9.05	3.38	7.61
1-3 年	206	8093.90	7853.26	29.69	2.12	1.95	4.08	1.85
5-7 年	14	746.04	775.58	2.93	2.83	6.02	2.32	5.46
7-10 年	34	3170.67	3007.61	11.37	2.70	8.34	3.57	7.28
10+ 年	201	15293.30	14816.35	56.01	2.72	13.11	3.03	10.85

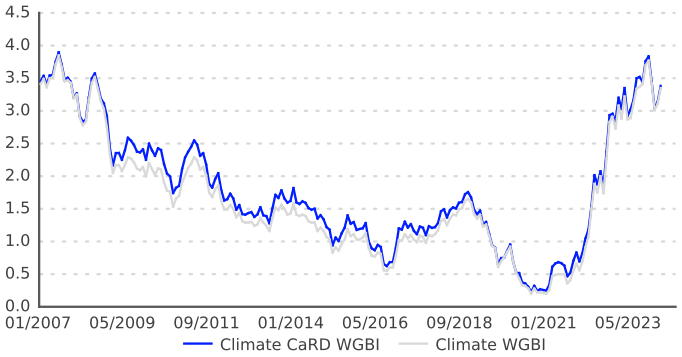
* In USD billions

時価総額比較 (単位 %)

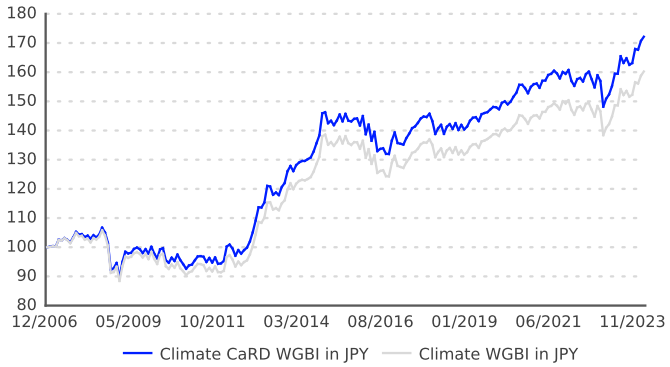
アンダーウェイトおよびオーバーウェイト、各上位5カ国 (Climate CaRD WGBI) - (WGBI)



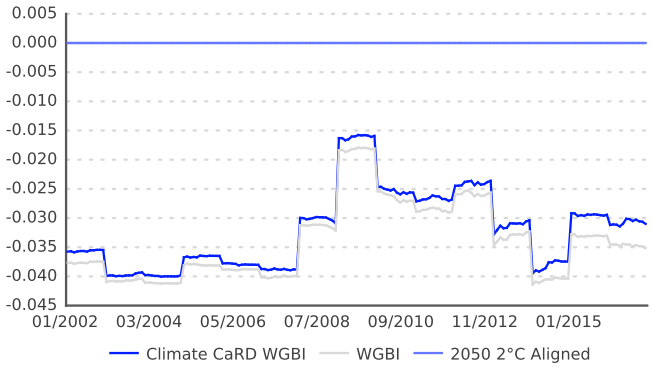
利回りの推移



過去のインデックス値 (ヘッジなし、日本円ベース)



2度シナリオGHG排出量目標（2050年時点）との整合性



出所：FTSE Russell。2024年2月29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。
インデックス開始日より前に表示されるリターンは仮定の過去データです。
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 CaRD WGBI		Climate WGBI	
	JPY		JPY	
	ヘッジなし	ヘッジあり	ヘッジなし	ヘッジあり
YTD	2.67	-2.22	2.65	-2.23
1 Year	12.98	-1.00	12.67	-1.25
3 Years	3.64	-5.98	3.59	-6.00
5 Years	3.73	-2.35	3.58	-2.47
Climate CaRD WGBI 開始来	3.22	1.52	2.78	1.11

組み入れ基準と計算の前提

利率：	固定利付き
最低残存期間：	1年
最低信用格付：	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
ウェイト：	代替加重 ベース・ユニバースの国別ウェイトは、気候スコアとピラーにより決定されます。シリーズ中各インデックスの最終的なウェイトは、最適化プロセスにより決定されます。詳細は基本ルールの最適化メソドロジーの項を参照のこと。
各国気候リスク：	毎年更新され、５月末のリバランス時から適用される。入力データのカットオフ日は毎年の5月1日です。
国別気候リスク評価：	WGBI適格の現地通貨建てソブリン市場
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
キャッシュフローの再投資：	月次のインデックス・トータルリターン計算において、月中に発生した利子と元本償還によるキャッシュフローの再投資は行いません。
リバランス：	月次更新（月末時点）
算出の頻度：	日次
受渡日：	月次：暦上の月末 日次：当日受渡し。ただし、月の最終営業日だけは暦上の月末とする
採用銘柄決定日：	毎月、ベース・ユニバースにおける翌月のインデックス構成銘柄を採用銘柄決定日に「決定」する。インデックスは採用銘柄決定日翌日に決定。
基準日：	2006年12月31日

ベンダーコード

CFIICXJJ	FTSE野村気候リスク調整CaRD世界国債インデックス（円ベース）
CFIICXJC	FTSE野村気候リスク調整CaRD世界国債インデックス（円ヘッジ・円ベース）

© 2024 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.