

# FTSE China 50 Index (Japanese)

Data as at: 28 June 2024

世界中の投資家が中国の資本市場にアクセスするために FTSE 中国 50 インデックスを利用しています。当インデックスは取引可能なリアルタイムのインデックスであり、最も大きくまた流動性の高い香港証券取引所に上場している中国株（H株、レッドチップ、P株）50 銘柄で構成されています。当インデックスはグローバルな投資家を対象として設計され、香港証券取引所での取引の容易性と同時に世界中の運用規制に適合するように配慮されております。

2013 年 3 月 18 日からは香港上場の P 株も FTSE China Index および FTSE China 50 Index に組み入れ可能となりました。

## H 株

H 株とは中華人民共和国にて設立され、香港証券取引所に上場している銘柄を指します。中国の投資家は適格国内機関投資家スキーム（Q D II）の下でのみ取引可能ですが、国際投資家には制約はありません。

## レッドチップ

レッドチップとは中華人民共和国外に籍をおき、香港証券取引所で取引される株のうち、30% 以上を直接か間接的に中華人民国国有企業・団体が保有し、かつ売上或いは資産の 50% 以上が中国本土に由来する銘柄を指します。

## P 株

P チップとは中華人民共和国外に籍をおき、香港証券取引所で取引される株のうち中国本土の個人によって支配され、その起源が中国本土にあり、かつ売上或いは資産の 50% 以上が中国本土に由来する銘柄を指します。

## 5 年間の推移（配当込み指数）



## リターン及びボラティリティー – 配当込み

| Index (HKD)            | Return % |      |      |      |       |       | Return pa %* |      | Volatility %** |      |      |
|------------------------|----------|------|------|------|-------|-------|--------------|------|----------------|------|------|
|                        | 3M       | 6M   | YTD  | 12M  | 3YR   | 5YR   | 3YR          | 5YR  | 1YR            | 3YR  | 5YR  |
| FTSE China 50          | 9.2      | 10.2 | 10.2 | -0.2 | -37.1 | -27.5 | -14.3        | -6.2 | 25.5           | 28.6 | 26.0 |
| FTSE China (HK Listed) | 8.6      | 7.0  | 7.0  | -3.8 | -44.7 | -23.4 | -17.9        | -5.2 | 25.0           | 28.9 | 26.7 |

\* 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

## FEATURES

### カバレッジ

時価総額および流動性の最も高い中国株 50 銘柄で構成(香港証券取引所上場の H 株、レッドチップおよび P 株)。一つの銘柄への過度な傾斜を避けるために一銘柄の組み入れ上限は 10% としています。

(会社分割があった場合には一時的に組入銘柄が 50 を超える場合があります。)

### 目的

当インデックスはインデックスに追随するファンドや派生商品の作成、またパフォーマンスのベンチマークとしての利用を念頭に設計されています。

### 投資可能性

インデックスが投資可能な機会セットを反映するために各銘柄は浮動株調整を行っています。

### キャッピング

一つの銘柄への過度な偏重を避けるために個別銘柄の上限は四半期毎の見直しにおいて 10% に設定されています。

### 流動性

インデックスの取引可能性を確保するために、全銘柄に流動性のスクリーニングをかけています。

### 透明性

インデックスはルールに基づき構築され、ルールはホームページ誰でも閲覧可能となっております。

### 計算頻度

当インデックスは、終値ベースおよびリアルタイムベースで、指数値および配当込みの値を計算しています。

### 業種区分

指数構成銘柄は業種分析の世界標準である Industry Classification Benchmark (ICB) に従って業種分類を行っています。

年間リターン - 配当込み

| Index % (HKD)          | 2014 | 2015  | 2016 | 2017 | 2018  | 2019 | 2020 | 2021  | 2022  | 2023  |
|------------------------|------|-------|------|------|-------|------|------|-------|-------|-------|
| FTSE China 50          | 13.4 | -11.2 | 2.9  | 37.1 | -11.4 | 14.3 | 11.0 | -19.4 | -19.2 | -12.6 |
| FTSE China (HK Listed) | 8.2  | -6.5  | 2.9  | 48.8 | -14.7 | 18.3 | 25.4 | -20.4 | -20.7 | -15.0 |

Return/Risk Ratio（シャープレシオ）及びドローダウン（高値からの最大下落率） - 配当込み

| Index (HKD)            | Return/Risk Ratio |      |      |      | Drawdown (%) |       |       |       |
|------------------------|-------------------|------|------|------|--------------|-------|-------|-------|
|                        | 1YR               | 3YR  | 5YR  | 10YR | 1YR          | 3YR   | 5YR   | 10YR  |
| FTSE China 50          | -0.1              | -0.5 | -0.2 | 0.0  | -28.5        | -53.7 | -59.9 | -59.9 |
| FTSE China (HK Listed) | -0.2              | -0.6 | -0.2 | 0.1  | -29.5        | -57.5 | -62.8 | -62.8 |

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                                 | Country/Market | ICB Sector                     | Net MCap (HKDm) | Wgt % |
|---|----------------|--------------------------------|-----------------|-------|
| Tencent Holdings (P Chip)                   | China          | Software and Computer Services | 806,537         | 8.95  |
| Alibaba Group Holding (P Chip)              | China          | Retailers                      | 796,576         | 8.84  |
| Meituan Dianping (P Chip)                   | China          | Software and Computer Services | 738,908         | 8.20  |
| China Construction Bank (H)                 | China          | Banks                          | 670,788         | 7.45  |
| Industrial and Commercial Bank of China (H) | China          | Banks                          | 455,093         | 5.05  |
| Totals                                      |                |                                | 3,467,901       | 38.50 |

ICB スーパーセクター構成比

| ICB Code | ICB Supersector                | No. of Cons | Net MCap (HKDm) | Wgt %  |
|----------|--------------------------------|-------------|-----------------|--------|
| 1010     | Technology                     | 4           | 1,997,998       | 22.18  |
| 1510     | Telecommunications             | 1           | 331,434         | 3.68   |
| 2010     | Health Care                    | 2           | 89,880          | 1.00   |
| 3010     | Banks                          | 10          | 2,119,397       | 23.53  |
| 3020     | Financial Services             | 3           | 52,298          | 0.58   |
| 3030     | Insurance                      | 5           | 621,706         | 6.90   |
| 3510     | Real Estate                    | 2           | 177,007         | 1.97   |
| 4010     | Automobiles and Parts          | 3           | 467,501         | 5.19   |
| 4020     | Consumer Products and Services | 3           | 585,175         | 6.50   |
| 4040     | Retailers                      | 3           | 1,136,712       | 12.62  |
| 4050     | Travel and Leisure             | 1           | 280,146         | 3.11   |
| 4510     | Food Beverage and Tobacco      | 1           | 91,578          | 1.02   |
| 5010     | Construction and Materials     | 1           | 24,686          | 0.27   |
| 5020     | Industrial Goods and Services  | 3           | 147,294         | 1.64   |
| 5510     | Basic Resources                | 2           | 173,723         | 1.93   |
| 6010     | Energy                         | 5           | 655,686         | 7.28   |
| 6510     | Utilities                      | 1           | 54,403          | 0.60   |
| Totals   |                                | 50          | 9,006,625       | 100.00 |

INFORMATION

ユニバース

FTSE All-World Index (Red Chips, P Chips and H Shares)

設定日

19 April 2001

基準日

16 March 2001

基準値

5000

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

リアルタイムおよび終値ベース

終値配信時刻

グリニッジ標準時 12:00

FTP および email にて配信

通貨

HKD および USD

見直し頻度

四半期ベース（3，6，9，12 月）

インデックス特性

| Attributes                        | FTSE China 50 | FTSE China (HK Listed) |
|-----------------------------------|---------------|------------------------|
| Number of constituents            | 50            | 258                    |
| Net MCap (HKDm)                   | 9,006,625     | 11,793,041             |
| Dividend Yield %                  | 3.48          | 2.90                   |
| Constituent Sizes (Net MCap HKDm) |               |                        |
| Average                           | 180,133       | 45,709                 |
| Largest                           | 806,537       | 2,336,163              |
| Smallest                          | 7,384         | 515                    |
| Median                            | 92,019        | 11,218                 |
| Weight of Largest Constituent (%) | 8.95          | 19.81                  |
| Top 10 Holdings (% Index MCap)    | 58.21         | 53.72                  |

© 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され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いは起因する損失又は損害（全部又は一部を問わない）および、(b)（たとえ 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