

---

# FTSE Blossom Japan Index

v2.0

---

## もくじ

---

1.0	はじめに .....	3
2.0	運営・管理責任.....	5
3.0	FTSE Russell インデックス ポリシー.....	7
4.0	適格有価証券 .....	9
5.0	SI データ入力 .....	11
6.0	構成銘柄の定期的見直し .....	12
7.0	構成銘柄の変更.....	13
8.0	コーポレートアクションおよびイベント .....	14
9.0	業種分類ベンチマーク（Industry Classification Benchmark: ICB） .....	16
10.0	インデックスウェイト .....	17
付録 A:	外国為替レート .....	19
付録 B:	気候サブセクターグループ .....	20
付録 C:	追加情報 .....	23

## セクション 1

# はじめに

---

### 1.0 はじめに

- 1.1** 本書は、FTSE Blossom Japan Index の運営および算出に係わる基本ルールを説明したものです。本ルールのコピーは [www.ftserussell.com](http://www.ftserussell.com) から入手できます。
- 1.2** FTSE Blossom Japan Index は、FTSE Japan Index と業種（ICB セクター）ニュートラルにしつつ、環境・社会・ガバナンス(ESG)のグローバル基準を満たす日本企業のパフォーマンスが反映される様に設計されています。
- 1.3** FTSE Blossom Japan Index は、インデックス設計に ESG ファクターを考慮します。詳細はセクション 4 を参照してください。
- 1.4** 本インデックスは、米国ドルおよび日本円で算出されます。
- 1.5** 本インデックスのプライスリターン・インデックスとトータルリターン・インデックスは、終値ベースで算出されます。
- トータル・リターンは、配当込みベースで算出されます。尚、配当金は企業公表値を適用します。

### 1.6 FTSE Russell

FTSE Russell is a trading name of FTSE International Limited, Frank Russell Company, FTSE Global Debt Capital Markets Limited (and its subsidiaries FTSE Global Debt Capital Markets Inc. and MTSNext Limited), Mergent, Inc., FTSE Fixed Income LLC, The Yield Book Inc and Beyond Ratings.

### 1.7 IOSCO

- 1.7.1** FTSE は、FTSE Blossom Japan Index は 2013 年 7 月に公表された IOSCO の金融ベンチマーク原則を満たしていると考えます。
- 1.8** FTSE Russell は、FTSE Russell のコントロールが及ばない外部事象を含む様々な状況において、当インデックスの変更、中断、中止が余儀なくされる場合があること、また、当インデックスを参照するインデックス・ファンドなどの投資商品や諸契約は、当インデックスの変更、中断、中止に耐えられるか、その可能性に対応できるものであるべきことを、当インデックス利用者に対し表明するものです。
- 1.9** 本インデックスに追従する運用を行うユーザー、または本インデックスに追従する商品を購入するユーザーは、自己資金、あるいはクライアントの資金で投資をする前に、当インデックスの長所を評価し、独立した立場にある者の助言を受けてください。FTSE Russell は、以下の事項に係わるいかなる過失・その他の結果として生ずるいかなる者が被る一切の損失、損害、請求、費用に関し一切の責任を負いません。

- 当基本ルールに対する依存、および/もしくは
- 当基本ルールの誤りまたは不正確、および/もしくは
- 当基本ルールに記載されている方針または手続きの不適用、誤用、および/もしくは
- インデックスまたはデータの構成銘柄を組成する際の誤りまたは不正確。

## セクション 2

# 運営・管理責任

## 2.0 運営・管理責任

### 2.1 FTSE International Limited (FTSE)

2.1.1 FTSE は、インデックス・ベンチマークの管理者です。<sup>1</sup>

2.1.2 FTSE Russell はインデックスの日次計算、構築、運用の責任を負っており、次のことを行います。

- インデックスを構成する全銘柄に関し、ウェイトの記録を保管する
- 基本ルールに従って、銘柄入替えとそのウェイト変更を行う
- 基本ルールに従って、インデックスの定期的な見直しを行い、その結果によって必要な変更を行う
- 継続的なメンテナンスと定期的な見直しによるウェイト変更を公表する
- インデックスを配信する

### 2.2 FTSE Russell ESG Advisory Committee

2.2.1 FTSE Blossom Japan Index の適切な運営を助言するために、FTSE Russell は FTSE Russell ESG Advisory Committee（以下、“Committee”）を設立しました。この Committee のメンバーには、環境・社会・ガバナンス分野における経験豊富かつ独立した投資専門家が含まれます。

2.2.2 本 Committee は、クライテリアの開発、FTSE Russell ESG レーティング並びに FTSE4Good Index シリーズを含む ESG インデックスの構築について助言を行う役割を担います。FTSE4Good Index の組入れ基準は、FTSE Blossom Japan Index の組入れ要件の一部として利用されます。

2.2.3 FTSE Russell ESG Advisory Committee の規約は次のリンクからアクセスできます。

[FTSE\\_Russell\\_ESG\\_Advisory\\_Committee.pdf](#)

<sup>1</sup> 本文書で管理者/アドミニストレーターという言葉は、[金融商品と金融契約のベンチマークとして用いられる指標、または投資資金のパフォーマンス測定を行うことに関する、2016年6月8日付けの欧州議会ならびに欧州連合理事会による規制（欧州連合）2016/1011（欧州ベンチマーク規制）および2019年付けベンチマーク（改正および経過規定）（EU 離脱）規則（英国ベンチマーク規則）における定義と同義で使用されます。](#)

## 2.3 基本ルールの改訂

基本ルールが指標シリーズの目的を最も適切に継続的に反映することができるよう、同ルールは FTSE Russell による定例見直し（少なくとも年 1 回）の対象になります。基本ルール大幅な改訂の提案に関しては、FTSE Russell Advisory Committee 及び必要に応じその他の利害関係者との協議に付されます。FTSE Russell Product Governance Board は、これらの協議結果を踏まえ、改訂の承認を判断します。

- 2.3.1 FTSE Russell Equity Indexes の Statement of Principles に規定の通り、基本ルールに言及されていない、または具体的かつ明確に規定されていない事項に関して FTSE Russell が決定を下す場合、Statement of Principles に則って実際的な決定を行うものとします。上記の様な決定が行われた場合、FTSE Russell はその決定内容を速やかに公表します。また、上記の取扱いが、基本ルールの例外、変更、将来の前例など見做されない場合においても、FTSE Russell は、基本ルールをより明確な規定にするための改訂が必要かどうかを検討します。

## セクション 3

# FTSE Russell インデックス ポリシー

---

### 3.0 FTSE Russell インデックス ポリシー

基本ルールは、以下のリンクからご覧いただけるインデックス方針ドキュメントと併せてご参照下さい。

#### 3.1 コーポレートアクションおよびイベント・ガイド

3.1.1 コーポレート・アクションおよびイベントによる構成企業の変更の詳細は、以下のリンクからご覧いただけるコーポレート・アクションおよびイベント・ガイドをご参照下さい。

[Corporate Actions and Events Guide.pdf](#)

#### 3.2 FTSE Russell 時価総額加重株価指数の Statement of Principles (Statement of Principles)

3.2.1 インデックスは市場の変化に対応する必要がある一方、基本ルールはすべての事態を予測することはできません。基本ルールが特定の事象または変化を十分にカバーしていない場合は、FTSE Russell は、インデックス構築に対する FTSE Russell の基本的考え方をまとめた原則声明(Statement of Principles)を参照して適切な取り組みを決定します。Statement of Principles は毎年見直され、FTSE Russell により提案される変更事項は FTSE Russell Policy Advisory Board に提出後、議論され、最終的には FTSE Russell の Product Governance Board により承認されます。

原則声明(Statement of Principles)は、次のリンクからご覧いただけます:

[Statement of Principles.pdf](#)

#### 3.3 お問い合わせ、苦情、異議申し立て

3.3.1 インデックスの構成銘柄である企業（またはその代理人）、構成銘柄となることが見込まれる企業（またはその代理人）、政府機関、または業として活動する組織においてインデックスを利用する者による 10 人以上のグループは、FTSE Russell の決定に対して異議申し立てを行うことができます。

FTSE Russell の苦情申し立て手続きは、次のリンクからご覧いただけます:

[Benchmark Determination Complaints Handling Policy.pdf](#)

FTSE Russell への異議申し立てのプロセスは、次のリンクをご参照下さい:

[Appeals Against Decisions.pdf](#)

### 3.4 取引停止または市場閉鎖の際のインデックス取り扱い方針

- 3.4.1 取引停止または市場閉鎖の際のインデックスの取り扱いに関するガイダンスは、次のリンクをご参照下さい。

[Index Policy for Trading Halts and Market Closures.pdf](#)

### 3.5 顧客が市場で取引できない場合のインデックス取り扱い方針

- 3.5.1 FTSE Russell のインデックス取り扱いの詳細は、次のリンクをご参照下さい:

[Index Policy in the Event Clients are Unable to Trade a Market.pdf](#)

### 3.6 再計算方針とガイドライン

- 3.6.1 FTSE Blossom Japan Index は、何らかの相違、または、重大と見なされる歪みが生じた場合、再計算を行います。FTSE Blossom Japan Index の利用者は適切な媒体を通じて、その通知を受けます。

FTSE Russell 再計算方針およびガイドラインの詳細は、次のリンクから FTSE Russell のウェブサイトでご覧いただくか、[info@ftserussell.com](mailto:info@ftserussell.com) までお問い合わせください。

[Index Recalculation Policy and Guidelines.pdf](#)

### 3.7 再計算方針とガイドライン – ESG データとレーティング

ESG データ商品の不正確さが認識される際、FTSE Russell は ESG データ商品を再計算すべきと決定する文書に記述されるガイドラインに従います。

[Recalculation Policy and Guidelines ESG Products.pdf](#)

### 3.8 FTSE Russell のベンチマーク・メソドロジーの変更

- 3.8.1 FTSE Russell のベンチマーク・メソドロジーの変更は、次のリンクをご参照下さい:

[Policy for Benchmark Methodology Changes.pdf](#)

### 3.9 FTSE Russell のガバナンスの枠組みからご覧ください。

- 3.9.1 FTSE Russell はそのインデックスを監督するために、プロダクト、サービス、テクノロジーのガバナンスをカバーするガバナンス・フレームワークを採用しています。このフレームワークには、ロンドン証券取引所グループによる防衛リスク管理フレームワークの 3 つの防衛線が組み込まれており、金融ベンチマークの IOSCO 原則<sup>2</sup>、欧州ベンチマーク規則<sup>3</sup>、また英国ベンチマーク規則への準拠を確実にしています<sup>4</sup>。FTSE Russell ガバナンス・フレームワークの詳細は、次のリンクをご参照下さい:

[FTSE Russell Governance Framework.pdf](#)

---

<sup>2</sup> IOSCO Principles for Financial Benchmarks Final Report, FR07/13 July 2013

<sup>3</sup> 有価証券および金融契約、また投資ファンドのパフォーマンス測定にベンチマークとして使われるインデックスにおける 2016 年 6 月 8 日付けの欧州議会ならびに欧州連合理事会による規制 (欧州連合) 2016/1011

<sup>4</sup> ベンチマーク (改正および経過規定) (EU 離脱) 規則 2019



## セクション 4

# 適格有価証券

### 4.0 適格有価証券

#### 4.1 適格ユニバース

4.1.1 FTSE All Cap Japan Index<sup>5</sup>の構成銘柄を FTSE Blossom Japan Index の組入れユニバースとします。

#### 4.2 総合 ESG 評価

4.2.1 FTSE All Cap Japan Index 各銘柄の ESG 総合スコアを、「5」を最高点とする 0~5 の範囲で評価します。

4.2.2 総合 ESG 評価が 3.3 以上の銘柄を FTSE Blossom Japan Index に組み入れます。

4.2.3 総合 ESG 評価が 2.9 未満、あるいは、高エクスポージャーと判断される ESG テーマにおいて、スコアが「ゼロ」の評価を受けた FTSE Blossom Japan Index の銘柄は、FTSE Blossom Japan Index から除外される可能性があります。

4.2.4 FTSE Russell は FTSE Blossom Japan Index に組み入れられた企業で、かつインデックスから除外される可能性がある企業への情報提供に適切に取り組みます。FTSE Blossom Japan Index に組み入れられた企業が 12 ヶ月の通知期間後にも適格基準を満たさない場合、FTSE Russell が FTSE Russell ESG Advisory Committee に諮ったうえ、通知期間を延長すると決定しない限り、当該企業は FTSE Blossom Japan Index から除外されます。

FTSE ESG 評価の詳細については、次のリンクをご参照下さい。

[FTSE Russell の ESG 評価](#)

### 4.3 原子力発電事業および乳児用粉ミルク製造業

#### 4.3.1 原子力発電事業および乳児用粉ミルク製造業

上記の組入れ基準に加え、企業の事業内容によっては、より高い組み入れ基準を満たす必要があります。

- 原子力発電に関係する企業は、FTSE Blossom Japan Index に組み入れられるためには、健康及び安全に関するテーマに適用される（セクター特定の）指標を一つ以外全て満たす必要があります。

<sup>5</sup>2020 年 12 月付で、FTSE All World Japan index から FTSE All Cap Japan Index に変更。

- 乳児用粉ミルク製造に関係する企業は、FTSE Blossom Japan Index に組入れられるためには、顧客に対する責任に関するテーマに適用される（セクター特定の）指標を一つ以外全て満たす必要があります。

#### 4.4 不祥事のモニタリング

FTSE Blossom Japan Index における不祥事に対する評価は、当該指数シリーズを構築する ESG レーティングを補完するものです。不祥事の評価を受ける企業の取扱いは、当該企業が FTSE4Good 指数シリーズの現構成銘柄であるかどうかにより異なります。

##### 4.4.1 現在 FTSE Blossom Japan Index の構成銘柄でない場合

深刻な不祥事を起こしていると特定される企業は、ウォッチリストに登録され、FTSE Blossom Japan Index の銘柄選定時に新規選定対象外となります。

ウォッチリストへの登録は、ESG に関わる不祥事の深刻さや批判、当該企業自体及び当該企業が世界で展開するプロジェクトに対する申立てを体系的に分析し、不祥事の深刻度合いが決定されます。深刻度合いに基づき企業にランキング付し、グローバル（FTSE All Cap Index の構成銘柄）のランキングと比較して最も深刻な申立てを受けているとされる上位 5%が、銘柄選定時にウォッチリストに登録されます。当該ウォッチリストには、世界最大手のアセットオーナー(管理下の総資産高で上位 20 位内)が現在、環境・社会・ガバナンスにおける懸念により、ポートフォリオから除外している企業も登録されます。

##### 4.4.2 FTSE Blossom Japan Index の既存構成銘柄である場合

FTSE Russell では、FTSE Blossom Japan Index の既存構成銘柄企業が関与する不祥事をニュースでモニタリングします。

既存構成銘柄企業の不祥事評価は、不祥事の深刻度合いに基づいたリスク・エクスポージャーと、不祥事に対する企業の対応度合いに基づくスコアにより決定されます。

これらの評価の結果、不祥事の深刻度合いが高く、対応が遅いと評価された企業は、FTSE Blossom Japan Index への組入れが 2 年間停止されます。

当該企業が 2 年間の組入れ停止期間後、再度 FTSE Blossom Japan Index への組入れ対象となるためには、ESG における全ての組入れ基準を満たし、不祥事に適切に対応し、同様に不祥事再発防止に向けた適切な措置が講じられていることが証明される必要があります。

#### 4.5 高エクスポージャー・テーマで低評価を受けた企業

##### 4.5.1 高エクスポージャー・テーマで「ゼロ」あるいは「1」の評価を受けた企業は FTSE Blossom Japan Index に組入れられません。

#### 4.1 気候関連要件

##### 4.1.1 FTSE Blossom Japan Index への継続的および新規の組入れを査定するときに、<sup>6</sup>気候変動スコアの最低基準値が付与されます。採用基準値は、企業が ICB 分類の一次影響または二次影響に指定されているかどうかにより決定されます。一次および二次の ICB サブセクターは、付録 B に掲載しました。

一次影響サブセクター —	気候変動スコア 3 が必要
二次影響サブセクター —	気候変動スコア 2 が必要

<sup>6</sup>2021 年 6 月より

## セクション 5

# サステナブル投資（SI）データ入力

### 5.0 SI データ入力

以下のサステナブル投資データセットが FTSE4Good インデックス・シリーズ構築に使用されます。

#### 5.1 ESG Ratings

5.1.1 公表された会社報告書から FTSE Russell のアナリストが収集したデータが、FTSE ESG Ratings 算定の入力情報として用いられます。トレンド分析、自動チェック、シニアアナリストによるレビューを含むデータ品質を確実にするため、数段階の品質管理が行われます。FTSE ESG モデルに含まれる構成銘柄データポイントは、国際労働機関（ILO）の国際労働基準、国連グローバル・コンパクト、国連の世界人権宣言、気候関連財務情報開示タスクフォースの提言をはじめとして、広範囲にわたる国際基準に照合されます。

5.1.2 FTSE Russell ESG ratings モデルのデータは、原子力発電および母乳代用品のスクリーニングにも用いられます。

5.1.3 FTSE Russell ESG Ratings の詳細は以下をご参照ください。 [FTSE Russell の ESG 評価](#)

#### 5.2 不祥事のモニタリング・データ

5.2.1 不祥事モニターのデータは、Reprisk AG より提供されます。矛盾を特定し正確性を保つために、データには定期的な品質チェックが行われます。これには、データ品質評価のためのトレンド分析と、Reprisk の有意なスコア変更の依拠データに対する詳細なレビューが含まれます。

サードパーティからのデータ使用について、詳細は以下をご覧ください。

[Guide to Third Party Sustainable Investment Data used in FTSE Russell Indexes.pdf](#)

#### 5.3 サステナブル投資指標

5.3.1 代表部規則（EU）2020/1816 付則に列記される環境・社会・ガバナンス（ESG）ファクターのレーティング、スコア、価値に関しては、FTSE Russell の [サステナブル投資指標](#) ウェブサイトを参照してください。本インデックス・シリーズ内ベンチマークのベンチマーク・メソドロジーはこれらを考慮して設計されています。

## セクション 6

# 構成銘柄の定期的見直し

---

### 6.0 構成銘柄の定期的見直し

- 6.1 FTSE Blossom Japan Index は 6 月と 12 月の年 2 回定期見直しが行われ、見直しが適用される日の 4 週間前の月曜日の終値ベースの市場データを用います。
- 6.2 FTSE Blossom Japan Index の定期見直しによる変更事項は、6 月および 12 月の第三金曜日の業務終了後に適用されます（すなわち、翌営業日より有効となります）。

## セクション 7

# 構成銘柄の変更

---

### 7.0 構成銘柄の変更

#### 7.1 除外および新規組入れ

- 7.1.1 ある組入れ銘柄が FTSE All Cap Japan Index から除外された場合は、FTSE Blossom Japan Index から除外されます。除外は FTSE All Cap Japan Index の除外と同時に行われ、そのウェイトは FTSE Blossom Japan Index の残存銘柄に比例配分されます。また、FTSE Blossom Japan Index からの除外銘柄は、定期見直し期間以外に別銘柄に入替えられることはありません。
- 7.1.2 FTSE All Cap Japan Index への新規組入れ銘柄は、FTSE Blossom Japan Index の定期見直し時点で、FTSE All Cap Japan Index に組入れられて少なくとも 6 ヶ月以上が経過する場合、FTSE Blossom Japan Index への組入れ候補銘柄と見做されます。

## セクション 8

# コーポレートアクションおよびイベント

---

### 8.0 コーポレートアクションおよびイベント

8.1 コーポレートアクションおよびイベントによる組入れ銘柄への変更についての詳細は、次のリンクから「コーポレートアクションおよびイベントのガイド」をご覧ください。

[Corporate Actions and Events Guide.pdf](#)

コーポレートアクションとは、株主に対するアクションを言い、株価は落ち日における調整に影響されます。株価は配当落ち日の調整に従います。これらには、次の事項が含まれます。

- 資本の払い戻し
- ライツ・イシュー/エンタイトルメント・オファー
- 株式化
- 分割/併合
- 無償新株発行（資本化または無償交付）

コーポレートイベントとは、インデックス・ルールに即してインデックスに影響を与える可能性のある企業ニュースを言います。例えば、政策投資家が組入れ企業の株式の売却を発表したとします。これは、浮動株比率の変動要因となり、インデックス調整が必要となる場合は、FTSE Russell が調整のタイミングを通知します。

### 8.2 発行済み株式

発行済み株式数の変更に伴う調整は、「コーポレートアクションおよびイベント・ガイド」の記載に基づきます。

### 8.3 合併、買収、スピノフ

8.3.1 FTSE Blossom Japan Index に組入れられた 2 企業が合併した場合、または FTSE Blossom Japan Index の組入れ企業が、他の組み入れ企業に買収された場合、存続企業がインデックスに残ります。

8.3.2 FTSE Blossom Japan Index の組入れ企業が、インデックス外の企業を買収した場合、買収後の存続企業がインデックスに組入れられます。

8.3.3 組入れ企業がインデックス外の企業に買収された場合、存続企業は FTSE Blossom Japan Index から除外されます。存続企業の適格性は、買収から少なくとも 6 ヶ月が経過した後に行われる定期見直しにおいて、分析・評価が行われます。

8.3.4 組入れ企業が 2 社以上の企業に分割され、そのいずれかの企業が FTSE All Cap Japan Index に維持された場合、これらの企業は FTSE Blossom Japan Index への組入れも維持されます。当該企業の適格性は、分割から最低 6 ヶ月以上が経過した定期見直しにおいて、分析・評価が行われます。

**8.3.5** 重大なイベントが発生した場合、FTSE Russell は臨時会議を招集し、当該コーポレートイベントから生ずる事態を評価・分析し FTSE Blossom Japan Index の適格性に照らした助言を行います。FTSE Russell は、その結果として、1 社または複数の企業の FTSE Blossom Japan Index への組み入れが不適格である状況であると判断する可能性があります。

#### **8.4 取引の中止**

取引中止についての規則は、「コーポレートアクションおよびイベントのガイド」をご覧ください。

## セクション 9

# 業種分類ベンチマーク（Industry Classification Benchmark: ICB）

---

### 9.0 業種分類ベンチマーク（Industry Classification Benchmark : ICB）<sup>7</sup>

#### 9.1 分類構造

9.1.1 Industry Classification Benchmark (ICB) に規定されているとおり、産業、スーパーセクター、セクター、サブセクターに分類されます。

9.1.2 Industry Classification Benchmark の詳細については、FTSE Russell からご入手いただくか、FTSE Russell のウェブサイト ([www.ftserussell.com](http://www.ftserussell.com)) からご参照ください。

[Industry Classification Benchmark](#)

---

<sup>7</sup> FTSE インデックスは、2021年3月に新しいICB分類システムに移行されます。



## セクション 10

# インデックスウェイト

### 10.0 インデックスウェイト

**10.1** FTSE Blossom Japan Index は、インデックス・ウェイト・メソドロジーに基づく見直しを、年 2 回 (6 月・12 月) 行います。

- 1) FTSE Blossom Japan Index における ICB 産業に基づく各産業ウェイトは、FTSE All Cap Japan Index における産業ウェイトと同等です。
- 2) FTSE Blossom Japan Index の個別銘柄  $i$  の最大ウェイト  $W_i^{Max}$  は、FTSE Blossom Japan Index 全体の時価総額の 15% か、FTSE Japan All Cap Index 内のウェイトの 20 倍  $W_i$  の、どちらか小さい方とします。

$$W_i^{Max} = \text{Min}(0.15, 20 \times W_i)$$

各産業ごとの上限値  $IC_k$  は、個別銘柄ウェイトの最大値の総和になります。

$$IC_k = \sum_i W_{ik}^{Max}$$

産業  $k$  における全銘柄について

- 3) 産業ごとのウェイト目標値  $ITW_k$  は、上記  $IC_k$  か、FTSE All Cap Japan Index における当該産業ウェイト  $IW_k$ 、のどちらか小さい方とします。

$$ITW_k = \text{Min}(IC_k, IW_k)$$

産業ごとのウェイト目標値である  $ITW_k$  は、その総和が 1 となる様に調整され、それを  $ITWN_k$  とします。調整後の超過分 ( $ITWN_k - IC_k > 0$ ) はそれ以外の産業セクターに比例配分されます ( $ITWN_k - IC_k < 0$ )。このプロセスは、すべての産業セクターで条件が満たされるまで繰り返されます。

- 4) FTSE Blossom Japan Index の  $W_{ik}^{final}$  各産業の構成銘柄  $k$  のウェイト  $i$  には産業ウェイトの目標値  $ITWN_k$  を反映させます。

$$W_{ik}^{final} = W_{ik} \times ITWN_k / IW4G_k$$

$IW4G_k = \sum_i W_{ik}$  とは、ユニバースにおける産業  $k$  の業種ウェイトです。その上で、個別銘柄のウェイトが上限を超過した場合は、同産業内の別銘柄に比例配分されます。すべての銘柄で条件を満たすまで、これが繰り返されます。

- 10.2** インデックスウェイトの見直しには、6月および12月の第一金曜日のコーポレート・アクションに伴う調整済みの終値を適用します。インデックスウェイトの変更は、6月および12月の第三金曜日の引け後に行われます。この際、**Shares in Issue** および浮動株は当該見直し月の第三金曜日の次の月曜日のそれを使用します。

## 付録 A: 外国為替レート

---

FTSE Blossom Japan Index の算出に使用される外国為替レートは、WM/ロイターのリアルタイム・スポットレートです。

全てのインデックス計算の基本通貨は日本円です。日本円以外で表示された銘柄の価格は、インデックス算出のために日本円に換算されます。

ロイターから英国時間 16:00 に受領した外国為替 BID レートがインデックス算出に使用されます。これを「クロージング外国為替レート」と呼びます。

## 付録 B: 気候サブセクターグループ

一次影響サブセクター・カテゴリー		二次影響サブセクター・カテゴリー	
533	探査と製造	583	再生可能エネルギー機器
537	総合石油・ガス	587	代替燃料
573	石油機器・サービス	2717	防衛
577	パイプライン	2723	容器・梱包
1353	原料化学品	2727	コングロマリット
1357	特殊化学	2733	電気部品・機器
1733	林業	2737	電子機器
1737	紙業	2757	機械：工業用
1753	アルミニウム	2771	デリバリーサービス
1755	非鉄	2775	鉄道
1757	鉄・鉄鋼	2777	輸送サービス
1771	石炭	2791	バックオフィスサポート
1773	ダイヤモンド・宝石	2793	企業研修会社・人材派遣会社
1775	一般鉱業	2795	財務管理
1777	金鉱	2797	産業向けサプライヤー
1779	プラチナ・貴金属	3355	自動車部品
2353	建材・備品	3357	タイヤ
2357	重量構造物建設	3533	醸造
2713	航空	3535	蒸留酒・ワイン醸造
2753	商用車・トラック	3537	ノンアルコール飲料
2773	海運	3573	農業・漁業
2779	トラック輸送	3577	加工食品
2799	廃棄処理サービス	3722	耐久家庭用品
3353	自動車	3724	非耐久家庭用品
7573	ガス供給	3726	内装
7575	多目的ユーティリティ	3728	住宅建設
5751	空運	3743	家庭用電子機器
7535	電力（従来発電）	3745	娯楽用品
		3747	玩具

3763	衣料品・装飾品
3765	靴
3767	パーソナル用品
3785	タバコ
4533	ヘルスケアプロバイダー
4535	医療機器
4537	医療用品
4573	バイオテクノロジー
4577	医薬品
5333	薬品小売
5337	食品卸・小売
5371	アパレル
5373	大規模小売店
5375	改築・リフォーム製品小売
5377	特殊消費者サービス
5379	専門店
5553	放送事業・エンタテインメント
5555	広告代理店
5557	出版
5752	賭博
5753	ホテル
5755	娯楽サービス
5757	レストラン・バー
5759	旅行・観光
6535	固定回線通信サービス
6575	携帯通信サービス
7537	電力（代替発電）
7577	水道
8355	銀行
8532	総合保険
8534	保険ブローカー
8536	損害保険
8538	再保険
8575	生命保険
8633	不動産所有・開発
8637	不動産サービス
8671	産業・オフィスリート（REIT）
8672	小売リート（REIT）
8673	住宅リート（REIT）
8674	分散型リート（REIT）
8675	特殊リート（REIT）
8676	Mortgage REITs
8677	ホテル・宿泊施設リート（REIT）
8771	アセットマネージャー
8773	消費者金融
8775	スペシャルティファイナンス

8777	投資サービス
8779	住宅金融
8985	株式投資
9533	コンピューターサービス
9535	インターネット
9537	ソフトウェア
9572	コンピューターハードウェア
9574	電子オフィス機器
9576	半導体
9578	通信機器

## 付録 C:追加情報

---

FTSE Russell の基本ルールで使用される用語については、次のリンクをご参照ください。

[Glossary.pdf](#)

The FTSE Russell サステナブル投資指標ウェブサイトは、次のリンクからアクセスしてください。 [サステナブル投資指標](#)

FTSE Blossom Japan Index の詳細については、FTSE Russell でご入手いただくか、ウェブサイト [www.ftserussell.com](http://www.ftserussell.com) をご参照ください。

---

© 2021 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") and (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 Blossom Japan Index is calculated by or on behalf of FTSE International Limited or its affiliate, agent or partner. FTSE International Limited is authorised 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®", "The Yield Book®", "Beyond Ratings®" and all other trademarks and service marks used herein (whether registered or unregistered) are trade marks 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.

All information is provided for information purposes only. Every effort is made to ensure that all information given in this publication is accurate, but no responsibility or liability can be accepted by any member of the LSE Group nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors for any errors or for any loss from use of this publication or any of the information or data contained herein.

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 results to be obtained from the use of the FTSE Blossom Japan Index or the fitness or suitability of the Index for any particular purpose to which it might be put.

No member of the LSE Group nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors provide investment advice and nothing in this document should be taken as constituting financial or investment advice. No member of the LSE Group nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors make any representation regarding the advisability of investing in any asset. A decision to invest in any such asset should not be made in reliance on any information herein. Indexes cannot be invested in directly. Inclusion of an asset in an index is not a recommendation to buy, sell or hold that asset. The general information contained in this publication should not be acted upon without obtaining specific legal, tax, and investment advice from a licensed professional.

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 index data and the use of their data to create financial products require a licence with FTSE, Russell, FTSE Canada, MTSNext, Mergent, FTSE FI, YB, BR, and/or their respective licensors.