



FTSE
Russell

2020 FTSE Russell インデックスカレンダー

2020 FTSE Russell インデックスカレンダー

FTSE Russellのソリューションは、資産クラス、スタイル、戦略の枠を超えたグローバル市場の真の姿を提供します。当社のグローバルな視点は、ローカル・ソリューションの開発や世界中のお客様のニーズを理解することで手に入れた専門知識に支えられています。FTSE Russellはロンドン証券取引所グループ（LSEG）の完全子会社であり、情報サービス部門を担っています。

FTSE Russellの専門知識とプロダクトは、世界の機関投資家や個人投資家によって幅広く利用されています。30年以上にわたり、主要な資産保有者、資産運用会社、ETFプロバイダー、投資銀行がFTSE Russellのインデックスを、投資パフォーマンスのベンチマークとして、また、投資ファンド、ETF、ストラクチャード商品、インデックス・ベースのデリバティブ商品を組成するために選択しています。FTSE Russellのインデックスは、お客様の資産配分、投資戦略の分析、リスク管理のためのツールにもなっています。

債券インデックスの採用銘柄決定日について

採用銘柄決定日の日程は、採用銘柄決定日の翌営業日から月末までに米国、日本、英国、EMU(具体的にはドイツ)、オーストラリアの各市場において、4営業日を確保するというルールにより設定されます。壊滅的な自然災害や地域の政治的紛争などの予期不能な状況が前述の営業日に影響を与える場合は、採用銘柄決定日を変更する場合があります。

*詳細につきましては、インデックス・カタログをご参照ください。

株式インデックスのレビューについて（主要インデックスのみ）

Global Equity Index Series のレビューは12・6月の最終営業日(祝日の場合は前営業日)の引値データに基づき、3・9月の第3金曜日の引後に実行されます。また、その翌月曜日が効力発生日(Effective date)となります。

FTSE Blossom Japan Indexのレビューは6・12月の第3金曜日の翌月曜日(Effective date)から4週間前の月曜日の引値データに基づき、6・12月の第3金曜日の引後に実行されます。

FTSE EPRA Nareit Global Real Estate Index Seriesのレビューは3・6・9・12各月の第3金曜日の翌月曜日(Effective date)から4週間前の月曜日の引値データに基づき、FTSE EPRA Nareit Global Real Estate Index Series Regional Advisory Committees の承認を経て3・6・9・12各月の第3金曜日引後に実行されます。

*詳細については当社ホームページをご参照ください。

SIFMAの定める米国MBSの通知日と決済日

大半の米国政府系パススルー証券取引は、TBA(To be announced)ベースでSIFMA(米国証券業金融市場協会)が定めた標準決済スケジュールに従って行われています。TBA取引では、買い手と売り手が、発行体、クーポン、年限(15年、30年)、額面、価格などの全般的な取引条件を取り決め、通常、買い手は決済日の2営業日前のニューヨーク時間、午後3時まで実際にどのプールが引き渡されるのか知らされていません。売り手は決済日の2営業日前のニューヨーク時間、午後3時までに、プールに関する情報を伝えなければなりません。これが、いわゆる48時間ルール(通知日)です。

当カレンダーには、SIFMA(米国証券業金融市場協会)が公表している通知日および決済日を掲載しています。より、詳細については、下記URLを参照ください。

www.sifma.org

	30年コンベンショナル		15年パススルー		30年GNMA		ARMなど	
	通知日	受渡日	通知日	受渡日	通知日	受渡日	通知日	受渡日
2020年1月	10 (金)	14 (火)	14 (火)	16 (木)	16 (木)	21 (火)	21 (火)	23 (木)
2020年2月	10 (月)	12 (水)	13 (木)	18 (火)	18 (火)	20 (木)	21 (金)	25 (火)
2020年3月	10 (火)	12 (木)	16 (月)	18 (水)	19 (木)	23 (月)	23 (月)	25 (水)
2020年4月	13 (月)	15 (水)	16 (木)	20 (月)	17 (金)	21 (火)	23 (木)	27 (月)
2020年5月	11 (月)	13 (水)	14 (木)	18 (月)	18 (月)	20 (水)	21 (木)	26 (火)
2020年6月	9 (火)	11 (木)	15 (月)	17 (水)	18 (木)	22 (月)	23 (火)	25 (木)
2020年7月	10 (金)	14 (火)	14 (火)	16 (木)	17 (金)	21 (火)	23 (木)	27 (月)
2020年8月	11 (火)	13 (木)	13 (木)	17 (月)	18 (火)	20 (木)	24 (月)	26 (水)
2020年9月	10 (木)	14 (月)	15 (火)	17 (木)	17 (木)	21 (月)	22 (火)	24 (木)
2020年10月	9 (金)	14 (水)	15 (木)	19 (月)	19 (月)	21 (水)	23 (金)	27 (火)
2020年11月	9 (月)	12 (木)	13 (金)	17 (火)	17 (火)	19 (木)	19 (木)	23 (月)
2020年12月	10 (木)	14 (月)	14 (月)	16 (水)	17 (木)	21 (月)	21 (月)	23 (水)

2020年カレンダー

● 日本の祝日 ○ 海外の祝日

1月						
日	月	火	水	木	金	土
			1	2	3	4
5	6	7	8	9	10	11
12	13	14	15	16	17	18
19	20	21	22	23	24	25
26	27	28	29	30	31	

2月						
日	月	火	水	木	金	土
						1
2	3	4	5	6	7	8
9	10	11	12	13	14	15
16	17	18	19	20	21	22
23	24	25	26	27	28	29

3月						
日	月	火	水	木	金	土
1	2	3	4	5	6	7
8	9	10	11	12	13	14
15	16	17	18	19	20	21
22	23	24	25	26	27	28
29	30	31				

4月						
日	月	火	水	木	金	土
			1	2	3	4
5	6	7	8	9	10	11
12	13	14	15	16	17	18
19	20	21	22	23	24	25
26	27	28	29	30		

5月						
日	月	火	水	木	金	土
					1	2
3	4	5	6	7	8	9
10	11	12	13	14	15	16
17	18	19	20	21	22	23
24	25	26	27	28	29	30
31						

6月						
日	月	火	水	木	金	土
	1	2	3	4	5	6
7	8	9	10	11	12	13
14	15	16	17	18	19	20
21	22	23	24	25	26	27
28	29	30				

7月						
日	月	火	水	木	金	土
			1	2	3	4
5	6	7	8	9	10	11
12	13	14	15	16	17	18
19	20	21	22	23	24	25
26	27	28	29	30	31	

8月						
日	月	火	水	木	金	土
						1
2	3	4	5	6	7	8
9	10	11	12	13	14	15
16	17	18	19	20	21	22
23	24	25	26	27	28	29
30	31					

9月						
日	月	火	水	木	金	土
		1	2	3	4	5
6	7	8	9	10	11	12
13	14	15	16	17	18	19
20	21	22	23	24	25	26
27	28	29	30			

10月						
日	月	火	水	木	金	土
				1	2	3
4	5	6	7	8	9	10
11	12	13	14	15	16	17
18	19	20	21	22	23	24
25	26	27	28	29	30	31

11月						
日	月	火	水	木	金	土
1	2	3	4	5	6	7
8	9	10	11	12	13	14
15	16	17	18	19	20	21
22	23	24	25	26	27	28
29	30					

12月						
日	月	火	水	木	金	土
		1	2	3	4	5
6	7	8	9	10	11	12
13	14	15	16	17	18	19
20	21	22	23	24	25	26
27	28	29	30	31		

2020年1月

FTSE
Russell

Climate WGBI

気候リスクにより
国別ウェイトを
調整した新世代の
世界国債インデックス

ftserussell.com

ヘルプデスク
0120-695-322
fi.indexjp@ftserussell.com

日	月	火	水	木	金	土
1: 元日 (全ての市場) 2: 銀行休業日 (日本) 3: 銀行休業日 (日本)			1 ● ○	2 ●	3 ●	4
5	6	7	8	9	10	11
12	13 ●	14	15	16	17	18
19	20 ○	21	22	23	24	25
26	27 ○ □	28	29	30	31	● 日本の祝日 ○ 海外の祝日 □ 債券の採用 銘柄決定日

2020年2月

FTSE
Russell

ターゲット・ エクスポージャ・ インデックス

注目している
ファクターや
サステナブル指標
のエクスポージャ
レベルを達成する
ように設計された
新しい株式指数

ftserussell.com

お問い合わせ
+81 (0)3 4563 6346
info@ftserussell.com

日	月	火	水	木	金	土
● 日本の祝日 ○ 海外の祝日 □ 債券の採用銘柄決定日 11: 建国記念日 (日本) 17: ワシントン誕生日 (米国) 24: 天皇誕生日、振替休日 (日本)						1
2	3	4	5	6	7	8
9	10	11 ●	12	13	14	15
16	17 ○	18	19	20	21	22
23 ●	24 ● □	25	26	27	28	29

2020年3月

FTSE
Russell

世界BIG債券 インデックス

グローバル債券
市場の総合型
ベンチマーク

ftserussell.com

ヘルプデスク
0120-695-322
fi.indexjp@ftserussell.com

日	月	火	水	木	金	土
1	2	3	4	5	6	7
8	9	10	11	12	13	14
15	16	17	18	19	20 ● ☆	21
22	23	24	25 □	26	27	28
29	30	31	● 日本の祝日 ○ 海外の祝日 □ 債券の採用銘柄決定日 ☆ Global Equity Index SeriesとFTSE EPRA Nareit Global Real Estate Index Seriesの発行日 20: 春分の日（日本）			

2020年4月

FTSE
Russell

FTSE Blossom Japan Index

投資戦略に
スチュワードシップ
を統合した投資家
向けにデザイン
された指数

ftserussell.com

お問い合わせ
+81 (0)3 4563 6346
info@ftserussell.com

日	月	火	水	木	金	土
12: 復活祭 (米国、英国、ドイツ、豪州) 13: 復活の月曜日 (英国、ドイツ、豪州) 27: アンザックの日 (豪州) 29: 昭和の日 (日本)			1	2	3	4
5	6	7	8	9	10	11
12 ○	13 ○	14	15	16	17	18
19	20	21	22	23 □	24	25
26	27 ○	28	29 ●	30	● 日本の祝日 ○ 海外の祝日 □ 債券の採用銘柄決定日	

2020年5月

FTSE
Russell

WGBI-JIT &
EMGBI-JIT

国内投信評価に
基づくソブリン債
ベンチマーク

ftserussell.com

ヘルプデスク
0120-695-322
fi.indexjp@ftserussell.com

日	月	火	水	木	金	土
● 日本の祝日 ○ 海外の祝日 □ 債券の採用銘柄決定日 1: メーデー (英国、ドイツ) 4: みどりの日 (日本) 5: こどもの日 (日本) 6: 憲法記念日、振替休日 (日本) 21: 昇天の日 (ドイツ) 25: 春の公休日 (英国)、 戦没将兵記念日 (米国)					1 ○	2
3 ●	4 ●	5 ●	6 ●	7	8	9
10	11	12	13	14	15	16
17	18	19	20	21 ○	22	23
24 31	25 ○ □	26	27	28	29	30

2020年6月

FTSE
Russell

Russell US Indexes

米国株式の代表的
ベンチマーク
大型株の
Russell1000、
小型株の
Russell2000等を
サブセットに持つ

ftserussell.com

お問い合わせ
+81 (0)3 4563 6346
info@ftserussell.com

日	月	火	水	木	金	土
	1 ○	2	3	4	5	6
7	8 ○	9	10	11	12	13
14	15	16	17	18	19 ☆	20
21	22	23	24 □	25	26	27
28	29	30	● 日本の祝日 ○ 海外の祝日 □ 債券の採用銘柄決定日 ☆ FTSE Blossom Japan Index, FTSE EPRA Nareit Global Real Estate Index Seriesの実行日 1: Whit Monday (ドイツ) 8: 女王誕生休日 (豪州)			

2020年7月

FTSE
Russell

FTSE Multi-Asset Composite Index Series

共にグローバルで
代表的な指数
であるGEIS（株式）
とWGBI（債券）を
組み合わせた
マルチアセット・
ベンチマーク

ftserussell.com

お問い合わせ
+81 (0)3 4563 6346
info@ftserussell.com

日	月	火	水	木	金	土
3: 独立記念日、振替休日（米国） 23: 海の日（日本） 24: スポーツの日（日本）			1	2	3 ○	4 ○
5	6	7	8	9	10	11
12	13	14	15	16	17	18
19	20	21	22	23 ●	24 ●	25
26	27 □	28	29	30	31	● 日本の祝日 ○ 海外の祝日 □ 債券の採用 銘柄決定日

2020年8月

FTSE
Russell

FTSE 野村
CaRD WGBI

キャリーと
ロールダウンに
着目した新世代の
グローバル債券
スマートベータ・
インデックス

ftserussell.com

ヘルプデスク
0120-695-322
fi.indexjp@ftserussell.com

日	月	火	水	木	金	土
● 日本の祝日 ● 海外の祝日 □ 債券の採用銘柄決定日 10: 山の日 (日本) 31: 夏の公休日 (英国)						1
2	3	4	5	6	7	8
9	10 ●	11	12	13	14	15
16	17	18	19	20	21	22
23	24 □	25	26	27	28	29
30		31 ●				

2020年9月

FTSE
Russell

FTSE4Good Index Series

環境、社会、
企業統治に
関する世界基準を
満たす企業を
構成銘柄とした指数

ftserussell.com

お問い合わせ
+81 (0)3 4563 6346
info@ftserussell.com

日	月	火	水	木	金	土
7: 労働者の日 (米国) 21: 敬老の日 (日本) 22: 秋分の日 (日本)		1	2	3	4	5
6	7 ○	8	9	10	11	12
13	14	15	16	17	18 ☆	19
20	21 ●	22 ●	23	24 □	25	26
27	28	29	30	● 日本の祝日 ○ 海外の祝日 □ 債券の採用銘柄決定日 ☆ Global Equity Index SeriesとFTSE EPRA Nareit Global Real Estate Index Seriesの実行日		

2020年10月

FTSE
Russell

FTSE EPRA Nareit Global Real Estate Index Series

FTSEが欧州不動産
協会（EPRA）と
全米不動産投資
信託協会（Nareit）
と提携して作る
不動産投資指数

ftserussell.com

お問い合わせ
+81 (0)3 4563 6346
info@ftserussell.com

日	月	火	水	木	金	土
● 日本の祝日 ○ 海外の祝日 □ 債券の採用銘柄決定日				1	2	3 ○
3: ドイツ統一の日（ドイツ） 5: 労働者の日（豪州） 12: コロンブス・デー（米国）						
4	5 ○	6	7	8	9	10
11	12 ○	13	14	15	16	17
18	19	20	21	22	23	24
25	26 □	27	28	29	30	31

2020年11月

FTSE
Russell

世界国債インデックス (WGBI)

グローバル・
ソブリン債市場を
トラックする定評ある
標準ベンチマーク

ftserussell.com

ヘルプデスク
0120-695-322
fi.indexjp@ftserussell.com

日	月	火	水	木	金	土
1 ○	2	3 ●	4	5	6	7
8	9	10	11 ○	12	13	14
15	16	17	18	19	20	21
22	23 ● □	24	25	26 ○	27	28
29	30	● 日本の祝日 ○ 海外の祝日 □ 債券の採用銘柄決定日 1: すべての聖徒の日 (ドイツ) 3: 文化の日 (日本) 11: 復員軍人の日 (米国) 23: 勤労感謝の日 (日本) 26: 感謝祭 (米国)				

2020年12月

FTSE
Russell

FTSE Global Equity Index Series (GEIS)

世界49の先進・
新興国市場の
約16,000銘柄を
カバーする
世界株指数

ftserussell.com

お問い合わせ
+81 (0)3 4563 6346
info@ftserussell.com

日	月	火	水	木	金	土
25: クリスマス (すべての市場) 28: ボクシング・デー、振替休日 (英国、豪州) 31: 銀行休業日 (日本)		1	2	3	4	5
6	7	8	9	10	11	12
13	14	15	16	17	18 ☆	19
20	21 □	22	23	24	25 ○	26 ○
27	28 ○	29	30	31 ●	● 日本の祝日 ○ 海外の祝日 □ 債券の採用銘柄決定日 ☆ Global Equity Index Series、FTSE Blossom Japan IndexとFTSE EPRA Nareit Global Real Estate Index Seriesの発行日	

ESG Ratings

事業活動における潜在的な
ESGリスク管理の評価



Green Revenue

低炭素経済に向けた産業の再定義



Yield Book Q

従来のポートフォリオ分析の概念を
刷新する新世代プラットフォーム



Yield Book API

イールドブックの分析機能を
イン・ハウス・プラットフォームに
統合するAPIサービス



イールドブックのティッカー

米国債およびキャッシュ

ティッカー	分類名
30yr	30年指標銘柄
old5yr	前指標銘柄5年債
curve	米国債指標銘柄群
tint	ストリップ (INT)
tp	ストリップ (TP)
cashusd	米ドル・キャッシュ(1カ月物国債レボ金利)
cash%	キャッシュ
usx	米国債W銘柄

各国国債

国	ティッカー	国	ティッカー
オーストリア	ATGV	マレーシア	MYGV
オーストラリア	AUGV	オランダ	NLGV
ベルギー	BEGV	ニュージーランド	NZGV
カナダ	CAGV	ノルウェー	NOGV
デンマーク	DKGV	ポーランド	PLGV
フィンランド	FIGV	ポルトガル	PTGV
フランス	FRGV	シンガポール	SGGV
ドイツ	DEGV	スペイン	ESGV
ギリシャ	GRGV	スウェーデン	SEGV
アイルランド	IEGV	スイス	CHGV
イタリア	ITGV	台湾	TWGV
日本	JGB, JGTB	英国	GBGV
韓国	KRGV	米国	US

モーゲージ・ジェネリック

ティッカー/分類名	検索結果
Ticker=FHLG5 Description=GEN	Generic 30-year FHLMC Gold 5%
Ticker=FNMA4 Description=TBA	Generic and all TBA months for 30-yr FNMA 4%
ティッカー	製品
FNMA	FNMA 30年
FNCT	FNMA 20年
FNCL	FNMA 15年
FNCN	FNMA 10年
FNBS	FNMA 7年 バレーン
FNDUS	FNMA DUSプール
FHLM	FHLMC 30年
FHLG	FHLMC Gold 30年
FGTW	FHLMC Gold 20年
FHNM	FHLMC 15年
FHNG	FHLMC Gold 15年
FHBS	FHLMC 7年 バレーン
FHBF	FHLMC 5年 バレーン
GNMA	GNMA 30年
GNMG	GNMA 15年

モーゲージ・プール

例	分類名
n902558	ファニーメイプール (N+Pool ID)
fc02390	フレディマックプール(F + Pool ID)
g3921m	ジニーメイ プール (G + Pool ID + X or M)

株式インデックスの配信ファイル

ファイルの種類 例) Product Prefix	データ・コンテンツ
Constituents 例) engc	指数を構成する銘柄の価格、時価総額、ウェイト、証券認証コード、終値、配当利回り、発行株数、浮動株比率等
Valuation 例) engv	指数値、構成銘柄数、プライス・リターン、トータル・リターン、構成銘柄の総時価総額、配当落調整金相当値、配当利回り等
Day Tracker 例) engt	各種コーポレートアクション、除数の変更、構成銘柄の変更（組入・除外等）、配当落調整金等
Five Day Tracker 例) eng5	各種コーポレートアクションやレビュー等に基づく各種変更情報（銘柄入替、発行済株数の変更、浮動株比率の変更等）
Open Constituent 例) engo	上記のTracker fileの情報がすべて反映されている、ファイル作成日の翌営業日のConstituents file
Indicative Review Constituents 例) engr	インディケーションとしてレビューのアナウンスメント日からその実行日の前日まで配信される、実行日当日のConstituents file

*Product PrefixのサンプルにはFTSE EPRA Nareit Developed Index Seriesを使用しています。

2021年カレンダー

● 日本の祝日 ○ 海外の祝日

1月						
日	月	火	水	木	金	土
					①	②
③	4	5	6	7	8	9
10	⑪	12	13	14	15	16
17	⑱	19	20	21	22	23
24	25	⑳	27	28	29	30
31						

2月						
日	月	火	水	木	金	土
	1	2	3	4	5	6
7	8	9	10	⑪	12	13
14	⑮	16	17	18	19	20
21	22	⑳	24	25	26	27
28						

3月						
日	月	火	水	木	金	土
	1	2	3	4	5	6
7	8	9	10	11	12	13
14	15	16	17	18	19	⑳
21	22	23	24	25	26	27
28	29	30	31			

4月						
日	月	火	水	木	金	土
				1	2	3
④	⑤	6	7	8	9	10
⑪	12	13	14	15	16	17
18	19	20	21	22	23	24
25	⑳	27	28	㉑	30	

5月						
日	月	火	水	木	金	土
						①
2	③	④	⑤	6	7	8
9	10	11	12	⑬	14	15
16	17	18	19	20	21	22
23	⑳	25	26	27	28	29
30	⑳					

6月						
日	月	火	水	木	金	土
		1	2	3	4	5
6	7	8	9	10	11	12
13	⑭	15	16	17	18	19
20	21	22	23	24	25	26
27	28	29	30			

7月						
日	月	火	水	木	金	土
				1	2	3
④	⑤	6	7	8	9	10
⑪	12	13	14	15	16	17
18	⑱	20	21	22	23	24
25	26	27	28	29	30	31

8月						
日	月	火	水	木	金	土
1	2	3	4	5	6	7
8	9	10	⑪	12	13	14
15	16	17	18	19	20	21
22	23	24	25	26	27	28
29	30	⑳				

9月						
日	月	火	水	木	金	土
			1	2	3	4
5	⑥	7	8	9	10	11
12	13	14	15	16	17	18
19	⑳	21	22	㉑	24	25
26	27	28	29	30		

10月						
日	月	火	水	木	金	土
					1	2
③	④	5	6	7	8	9
10	⑪	12	13	14	15	16
17	18	19	20	21	22	23
24	25	26	27	28	29	30
31						

11月						
日	月	火	水	木	金	土
	①	2	③	4	5	6
7	8	9	10	⑪	12	13
14	15	16	17	18	19	20
21	22	㉑	24	⑳	26	27
28	29	30				

12月						
日	月	火	水	木	金	土
			1	2	3	4
5	6	7	8	9	10	11
12	13	14	15	16	17	18
19	20	21	22	23	⑳	㉑
⑳	㉑	㉒	29	30	㉑	

カレンダーに記載されている債券インデックス、イールドブック・プロダクトおよびサービスに関しては下記までお問い合わせください。

日本 +81 (0)3 4563 6345 // 0120 695 322

アジア・パシフィック +852 2164 3288 // +65 6818 6291

メールアドレス fi.indexjp@ftserussell.com

カレンダーに記載されている株式インデックスおよびサービスに関しては下記までお問い合わせください。

日本 +81 (0)3 4563 6346

アジア・パシフィック +852 2164 3333

メールアドレス info@ftserussell.com

© 2019 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") and (7) The Yield Book Inc ("YB"). All rights reserved.

FTSE Russell® is a trading name of FTSE, Russell, FTSE Canada, MTSNext, Mergent, FTSE FI, YB. "FTSE®", "Russell®", "FTSE Russell®", "MTS®", "FTSE4Good®", "ICB®", "Mergent®", "The Yield Book®" 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. FTSE International Limited is authorised and regulated by the Financial Conduct Authority as a benchmark administrator.