

2019年2月22日

関係各位

野村證券株式会社

FTSE野村CaRD世界国債インデックスの公表について

野村證券株式会社(代表執行役社長:森田敏夫、以下「当社」)は、ロンドン証券取引所グループのFTSE Russell(フツイー・ラッセル、以下「FTSEラッセル」)と共同で、新しい債券指数「FTSE 野村 キャリー・ロールダウン(CaRD)世界国債インデックス」(以下「本指数」)を開発しました。

本指数は、世界の国債(現在22か国)の時価総額加重インデックスであるFTSE世界国債インデックス(WGBI)をベンチマークとし、投資方針の違いに応じて2種類の指数値を算出します。国債のキャリー(利子収入)だけでなく、ロールダウン(満期までの残存期間が短くなるにつれ債券価格が上昇することによるリターン)を加えた期待リターンの合計が最大となるポートフォリオを毎月構築するのが本指数の特徴です。国ごとの金利リスクはベンチマークに合わせる一方、国別の投資金額のウェイトはベンチマークからは乖離できるため、より効率的な運用が可能になります。

本指数は当社とFTSEラッセルが開発し、算出はFTSEラッセルが担当します。本指数の指数値および指数構築ルールなどの詳細はFTSEラッセルのウェブサイト(<https://www.ftserussell.com/>)にて順次公開予定です。

当社は今後も、本指数に連動する金融商品の開発を通じて、投資家のニーズに沿ったサービスの提供に努めていきます。

以上