

2021年2月4日

関係各位

野村證券株式会社

FTSE Nomura Climate CaRD WGBI Index Seriesの公表について

野村證券株式会社(代表取締役社長: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(フツィー・ラッセル)と共同で「FTSE Nomura Climate CaRD (Carry and Roll Down) World Government Bond Index」(以下「本指数」)を開発し、本指数の公表を開始しました。

本指数は、世界の国債(現在22カ国)の時価総額加重インデックスであるWGBI(世界国債インデックス)の気候リスクを低減したFTSE Climate Risk-Adjusted WGBIをベンチマークとし、各国のデュレーションと時価総額加重がベンチマークに等しく、キャリー・ロールダウンは最も高い国債ポートフォリオに投資します。

国債インデックスにおける気候リスクを低減しつつ、国債のキャリー(利回り)だけでなくロールダウン(順イールドにおいて残存期間が短くなることで利回りが低下することによる債券価格の上昇)を加えた期待リターンの合計が最大のポートフォリオを毎月構築するのが本指数の特徴です。各国のデュレーションと金額ウェイトは気候リスクを低減したベンチマークに合わせており、ベンチマークの趣旨に沿いながら期待リターンの高い資金運用が可能になります。債券のESG投資の中心になっている社債市場はグローバル債券市場の約15%にとどまり、50%以上を占める国債市場においてESG投資を可能にするとともに期待リターンを高められる本指数は新たなESG投資の指数として期待されます。

本指数は当社とFTSE Russellが開発し、算出はFTSE Russellが担当しています。本指数の指数値はFTSE Russellのウェブサイト(<https://www.ftserussell.com/ja/products/indices/thematic-and-alternatively-weighted-fixed-income-indexes>)にて、2021年1月26日より公開しています。

野村グループは、「Drive Sustainability.」というコンセプトのもと、サステナブルな社会の実現と社会的課題の解決のため、ESG/SDGsに関連する活動に積極的に取り組んでおり、本指数の開発・公表はその一環です。

当社は今後も、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