

【ご案内】FTSE世界国債インデックス構成国の見直しについて

■ FTSE世界国債インデックスの構成国の見直しについて

FTSE Russell社では、「市場アクセシビリティ・レベル」、「市場規模」、「信用格付け」の3つのインデックス基準に基づき、定期的にインデックス構成国の見直しを行っています。

同社は2025年9月の見直しにおいて、インデックス採用基準の全てを満たしたと判断*し、スロバキア国債を2026年6月よりFTSE世界国債インデックスへ追加することを発表しました。

*「市場規模」、「信用格付け」がインデックス採用基準を満たし、「市場アクセシビリティ・レベル」が 1 から、インデックス採用基準である 2 へ引き上げられました。

【組入れ時期】

2026年6月インデックス(2026年5月末)

【組入れ比率】

組み入れ比率は、FTSE世界国債インデックスは0.17%程度、FTSE世界国債(除く日本)インデックスは0.19%程度となります。
(2025年9月末時点に基づく概算)

<ご参考>

●インデックス採用基準

以下の3つの採用条件を満たすこと

①市場アクセシビリティ・レベルが最上位の2であること

②市場の額面総額合計が500億米ドル、400億ユーロ、5兆円を上回ること

③発行体の自国通貨建て長期債務の格付けが、S&P社とムーディーズ社の双方でA-/A3以上であること
(但し③については、3月・9月のレビュー時と変更適用時の両時点条件を満たす必要あり)

●市場アクセシビリティ・レベル

市場アクセシビリティ・レベルは、「市場、マクロ経済、規制環境」「外国為替市場の構造」「債券市場の構造」「グローバル決済およびカストディ」の4つの側面で判定し、「2、1、0」の3段階で評価。