

The FTSE Russell logo is a semi-transparent light blue circle containing the text "FTSE" and "Russell" stacked vertically in white, sans-serif font. The background of the slide is a scenic landscape of rolling hills and mountains under a soft, hazy sky with a color gradient from light blue to pale pink.

FTSE
Russell

2019 債券インデックス カレンダー

2019 債券インデックスカレンダー

インデックスの採用銘柄決定日は、インデックスのユーザーに対して事前に翌月のインデックス構成銘柄の変化を周知させるための明確な基準点となります。各月のインデックス採用銘柄決定日においては、公的に取得可能な銘柄情報がインデックス構成銘柄への採用か否かに用いられ、翌月のインデックス・プロファイルで用いられる属性情報となります。各インデックスの予想銘柄から構成されるプレリミナリー・プロファイルは、採用銘柄決定日の米国の翌営業日に弊社ウェブサイト上で公表されます。プレリミナリー・プロファイルを公表してから月末までの間に、コールやテnder、デフォルトになる銘柄があれば、その銘柄をインデックス・プロファイルから除外します。

このプロセスにより、債券インデックスをベンチマークとする投資家に、十分な透明性とポートフォリオのリバランスに必要な時間を確保することができます。

この日程は、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。

1月24日

2月22日

3月25日

4月19日

5月27日

6月24日

7月25日

8月26日

9月24日

10月25日

11月22日

12月20日

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、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
2019年1月	10(木)	14(月)	15(火)	17(木)	18(金)	23(水)	22(火)	24(木)
2019年2月	11(月)	13(水)	14(木)	19(火)	19(火)	21(木)	21(木)	25(月)
2019年3月	11(月)	13(水)	14(木)	18(月)	19(火)	21(木)	21(木)	25(月)
2019年4月	8(月)	10(水)	11(木)	15(月)	15(月)	17(水)	17(水)	22(月)
2019年5月	9(木)	13(月)	14(火)	16(木)	17(金)	21(火)	20(月)	22(水)
2019年6月	11(火)	13(木)	14(金)	18(火)	18(火)	20(木)	20(木)	24(月)
2019年7月	11(木)	15(月)	16(火)	18(木)	18(木)	22(月)	22(月)	24(水)
2019年8月	9(金)	13(火)	15(木)	19(月)	19(月)	21(水)	20(火)	22(木)
2019年9月	10(火)	12(木)	13(金)	17(火)	17(火)	19(木)	20(金)	24(火)
2019年10月	8(火)	10(木)	15(火)	17(木)	17(木)	21(月)	21(月)	23(水)
2019年11月	8(金)	13(水)	14(木)	18(月)	18(月)	20(水)	21(火)	25(木)
2019年12月	10(火)	12(木)	13(金)	17(火)	17(火)	19(木)	19(木)	23(月)

2019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		

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			

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				

2019年1月

FTSE
Russell

WGBI-JIT &
EMGBI-JIT

国内投信評価に
基づくベンチマーク

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	1: 元日 (全ての市場) 2: 銀行休業日 (日本) 3: 銀行休業日 (日本) 14: 成人の日 (日本) 21: マーティン・ルーサー・キング日 (米国) 28: 振替休日 (豪州)	

- 日本の祝日
- 海外の祝日
- 採用銘柄決定日

2019年2月

FTSE
Russell

世界BIG債券 インデックス

グローバル
債券市場の
広範囲におよぶ
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		

● 日本の祝日
○ 海外の祝日
□ 採用銘柄決定日

11: 建国記念日 (日本)
18: ワシントン誕生日 (米国)

2019年3月

FTSE
Russell

デット・キャパシティ
世界国債インデックス

代替ウェイトの
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
		21: 春分の日 (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 □ 31	26	27	28	29	30

2019年4月

FTSE
Russell

日本国債 インデックス

日銀保有分を反映
させて流動性を重視
したインデックス

ftserussell.com

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

日	月	火	水	木	金	土
	1	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 □ 採用銘柄決定日 19: 復活祭 (米国、英国、ドイツ、豪州) 22: 復活の月曜日 (英国、ドイツ、豪州) 25: アンザックの日 (豪州) 29: 昭和の日 (日本) 30: 国民の休日 (日本)			

2019年5月

FTSE
Russell

世界国債拡張インデックス (WGBI Extended)

WGBIにイスラエル、中国、
韓国が加わった拡張版の
ソブリン・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: 即位の日 (日本), メーデー (ドイツ) 2: 国民の休日 (日本) 3: 憲法記念日 (日本) 4: みどりの日 (日本)		6: こどもの日、振替休日(日本), メイデー (英国) 27: 春の公休日 (英国)、 戦没将兵記念日 (米国) 30: 昇天の日 (ドイツ)		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 □ 採用銘柄決定日	

2019年6月

FTSE
Russell

EMU国債 インデックス

ユーロ圏の国債市場
のベンチマーク

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 10: 女王誕生休日 (豪州), Whit Monday (ドイツ)
○ 海外の祝日
□ 採用銘柄決定日

2019年7月

FTSE
Russell

Index Website
FTSE 債券
インデックス・データ
の自動配信機能

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 □ 採用銘柄決定日 4: 独立記念日 (米国) 15: 海の日 (日本)		

2019年8月

FTSE
Russell

米国フォーリン・ エンジェル債券 インデックス

クレジットの
オーバーシュート
を捉える新型指数

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

2019年9月

FTSE
Russell

アジア・パシフィック 国債インデックス

アジアおよび
アジア・パシフィックの
国債市場の
パフォーマンスを測定

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 □ 採用銘柄決定日 2: 労働者の日 (米国) 16: 敬老の日 (日本) 23: 秋分の日 (日本)				

2019年10月

FTSE
Russell

モーゲージ証券
インデックス
米国MBS市場
のベンチマーク

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	3: ドイツ統一の日 (ドイツ) 7: 労働者の日 (豪州) 14: 体育の日 (日本) コロムプス・デー (米国) 22: 即位礼正殿の儀 (日本)	

2019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

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
□ 採用銘柄決定日

4: 文化の日、振替休日 (日本)
11: 復員軍人の日 (米国)
23: 勤労感謝の日 (日本)
28: 感謝祭 (米国)

2019年12月

FTSE
Russell

世界インフレ連動債券 インデックス

10通貨、
13カ国から構成され、
実質ベースのリターンを測定

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 □ 採用銘柄決定日 25: クリスマス (米国、英国、ドイツ、豪州) 26: ボクシング・デー (英国、豪州) 31: 銀行休業日 (日本)			

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 Add-In

The Yield Book の分析機能
をスプレッドシート環境に



Yield Book Calculator

個別銘柄の分析に特化した分析ツール



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WI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
FNCI	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)

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		

**カレンダーに記載されているイールドブック・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 3 4563 6346

米国 +1 212 816 0700

欧州・中東・アフリカ +44 20 7334 8963

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

当カレンダーに記載されている詳細は、情報提供のみを目的としております。

掲載された日付等は信用に足る情報に基づいております。ただし、いくつかの祝日、特に国民的な性質や週末にかかる政策的な祝日については変更される場合も想定されます。弊社は、そうした祝日の変更等については責任を負いかねます。

The Yield BookはThe Yield Book Inc. の登録商標であり、米国その他の国で登録されています。

RAFI® およびリサーチアフィリエイトは、リサーチアフィリエイト(Research Affiliates, LLC)の排他的知的所有権であり、米国および他国で登録されております。許可なしに商号を使用することは禁じられており、また、リサーチアフィリエイト社(Research Affiliates, LLC)は商号やあらゆる権利、タイトル、所有権を保護するための権利を有します。

© 2019 The Yield Book Inc. 無断複写・転載を禁じます。

© 2019 FTSE Fixed Income Index LLC. 無断複写・転載を禁じます。