

# 2018 債券インデックス カレンダー

FTSE  
Russell

## FTSE Russell とシティ債券インデックスは統合し、グローバル・マルチアセット・インデックスの提供会社となります

ロンドン証券取引所グループは、シティグループ・インクからイールドブックと債券インデックス事業の買収を完了いたしました。

世界的に定評のある債券分析ツール「イールドブック」と債券インデックス事業をロンドン証券取引所グループ傘下の専門性かつ独立性を持つグローバル・インデックス・プロバイダーであるFTSE Russellと統合しました。これにより、豊富な債券インデックスを取り揃え、マルチアセット・ベースのご提案、そしてより専門的な債券の情報と分析システムをお客様に提供できるようになります。

この事業買収により、新たな選択、イノベーションの機会と広範な地域のお客様のために価値観を生み出すことを、確信しております。統合サービス提供の実現により、債券インデックスと分析システムソリューションの新たな展開へと導いていきます。

### 2018 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、コールやテンダー、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

4月20日

7月25日

10月25日

2月22日

5月24日

8月27日

11月26日

3月23日

6月25日

9月24日

12月19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](http://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
2018年1月	9(火)	11(木)	12(金)	17(水)	18(木)	22(月)	22(月)	24(水)
2018年2月	9(金)	13(火)	13(火)	15(木)	16(金)	21(水)	20(火)	22(木)
2018年3月	9(金)	13(火)	13(火)	15(木)	16(金)	20(火)	19(月)	21(水)
2018年4月	10(火)	12(木)	13(金)	17(火)	17(火)	19(木)	20(金)	24(火)
2018年5月	10(木)	14(月)	15(火)	17(木)	17(木)	21(月)	21(月)	23(水)
2018年6月	11(月)	13(水)	14(木)	18(月)	18(月)	20(水)	21(木)	25(月)
2018年7月	10(火)	12(木)	13(金)	17(火)	17(火)	19(木)	19(木)	23(月)
2018年8月	9(木)	13(月)	14(火)	16(木)	17(金)	21(火)	20(月)	22(水)
2018年9月	11(火)	13(木)	14(金)	18(火)	18(火)	20(木)	20(木)	24(月)
2018年10月	9(火)	11(木)	12(金)	16(火)	16(火)	18(木)	19(金)	23(火)
2018年11月	8(木)	13(火)	13(火)	15(木)	15(木)	19(月)	16(金)	20(火)

# 2018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	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					



# 2018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

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      12: 建国記念日、振替休日(日本) ○ 海外の祝日      19: ワシントン誕生日(米国) □ 採用銘柄決定日		

# 2018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

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

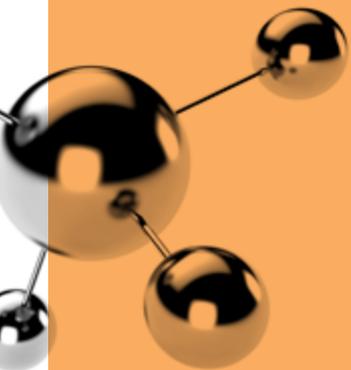
- 日本の祝日      21: 春分の日(日本)
- 海外の祝日      30: グッド・フライデー(米国、英国、豪州)
- 採用銘柄決定日

# 2018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

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 ●	<p>● 日本の祝日                      2: 復活祭(米国、英国、ドイツ、豪州) ○ 海外の祝日                    25: アイザックの日(豪州) □ 採用銘柄決定日            30: 昭和の日、振替休日(日本)</p>				

# 2018年5月

FTSE  
Russell

FTSE RAFI 債券  
インデックス・シリーズ  
ファンダメンタルズ  
によるウェイト配分

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: 憲法記念日(日本) 4: みどりの日(日本) 5: こどもの日(日本) 7: メイデー(英国) 28: 戦没将兵記念日(米国) 春の公休日(英国)	

- 日本の祝日
- 海外の祝日
- 採用銘柄決定日

# 2018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

日	月	火	水	木	金	土	
					1	2	
		11: 女王誕生休日(豪州)					
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

# 2018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

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	<p>● 日本の祝日                      4: 独立記念日 (米国) ○ 海外の祝日                    16: 海の日 (日本) □ 採用銘柄決定日</p>			

# 2018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

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
- 6: 銀行休業日(豪州)  
11: 山の日(日本)  
27: 夏の公休日(英国)

# 2018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

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	<p>● 日本の祝日      3: 労働者の日(米国) ○ 海外の祝日      17: 敬老の日(日本) □ 採用銘柄決定日    24: 秋分の日、振替休日(日本)</p>					

# 2018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

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 1: 労働者の日(豪州) 3: ドイツ統一の日(ドイツ) 8: 体育の日(日本)、 コロンブス・デー(米国)		

# 2018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

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
- 3: 文化の日(日本)  
12: 復員軍人の日、振替休日(米国)  
22: 感謝祭(米国)  
23: 勤労感謝の日(日本)

# 2018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

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 24: 天皇誕生日(日本)
- 海外の祝日 25: クリスマス(米国、英国、ドイツ、豪州)
- 採用銘柄決定日 26: ボクシング・デー(英国、ドイツ、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 Add-In LITE

Add-In機能でインデックス・  
データにアクセス

## 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ヵ月物国債レボ金利)
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
FNCI	FNMA 15年
FNCN	FNMA 10年
FNBS	FNMA 7年 バルーン
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年バルーン
FHBF	FHLMC 5年バルーン
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)

# 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	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 6860 4825

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ツは、リサーチアフィリエイツ(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います。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ツ社(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。

© 2017 The Yield Book Inc. 無断複写・転載を禁じます。

© 2017 FTSE Fixed Income Index LLC. 無断複写・転載を禁じます。