

JPX 日経 400 為替ヘッジ指数は、海外の投資家が為替リスクを回避しつつ JPX 日経インデックス 400 (JPX 日経 400) に投資する際のベンチマークとして開発した指数です。ユーロヘッジ指数、ドルヘッジ指数、ポンドヘッジ指数、スイスフランヘッジ指数、デイリーユーロヘッジ指数、デイリードルヘッジ指数、デイリーポンドヘッジ指数、デイリースイスフランヘッジ指数の 8 種類を算出しています。

■ (対象とする指数)

税引後配当込 JPX 日経 400 の値動きを対象にした指数です。JPX 日経 400 は東京証券取引所 (第一部、第二部、マザーズ、JASDAQ) を主たる市場とする銘柄 (普通株式を原則とする) から選定された 400 銘柄で構成されています。

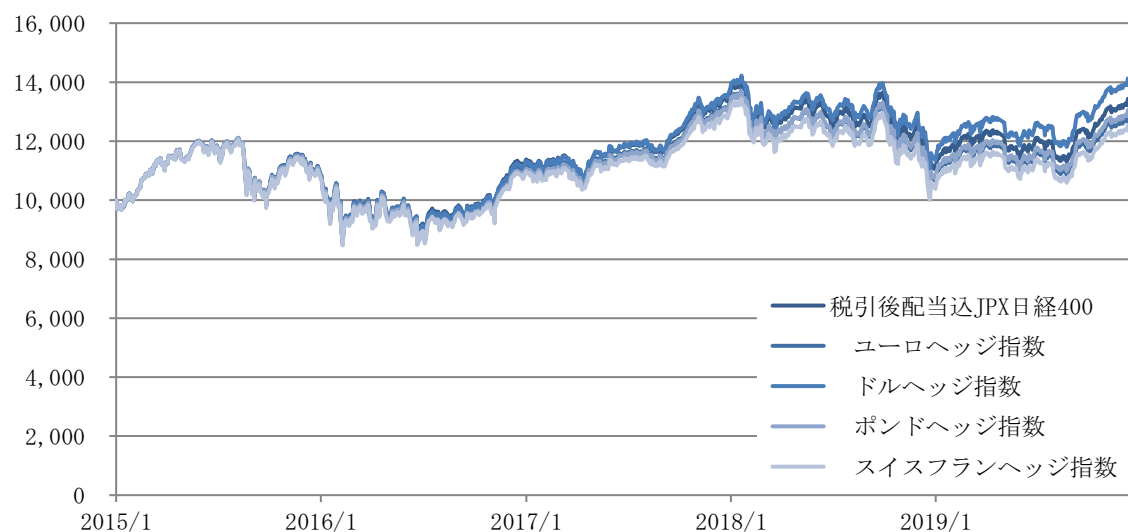
■ (算出方法)

①税引後配当込 JPX 日経インデックス 400 の外貨建てのリターン (日本円を本国通貨としない投資家が為替ヘッジなしで対象指数に投資した場合のリターン) と②為替ヘッジによるリターンの合成により算出します。ヘッジの比率は 100%で、月次ヘッジと日次 (デイリー) ヘッジの両方を算出します。

■ (起点など)

算出開始は 2014 年 1 月 26 日 (スイスフランヘッジ指数とデイリースイスフランヘッジ指数については 2015 年 5 月 19 日) で、2008 年 12 月 30 日まで遡及算出しています。2013 年 8 月 30 日の値を 10,000 ポイントとして、1 日 1 回終値ベースで算出します。

■ 時系列グラフ (2019/12/30)



(*) 2015/1/5 の値を起点に 10000.00 に基準化

■ パフォーマンス (2019/12/30)

	年間リターン%					累積リターン% (年率)		標準偏差% (年率)	
	2015	2016	2017	2018	2019	3年	5年	3年	5年
税引後配当込 JPX 日経 400	11.06	-0.58	20.22	-15.96	18.51	6.19	5.74	12.80	15.49
ユーロヘッジ指数	10.93	-2.31	19.66	-16.98	17.81	5.38	4.87	12.95	15.69
ドルヘッジ指数	10.80	-0.90	22.02	-14.38	21.40	8.25	6.85	12.84	15.61
ポンドヘッジ指数	10.47	-2.83	20.48	-16.14	18.57	6.20	5.16	12.92	15.80
スイスフランヘッジ指数	9.64	-2.84	19.15	-17.24	17.63	5.07	4.32	12.95	15.69
デイリーユーロヘッジ指数	11.29	-2.02	19.54	-16.88	17.89	5.41	5.02	12.84	15.55
デイリードルヘッジ指数	10.74	-1.69	21.71	-14.27	21.56	8.24	6.67	12.81	15.63
デイリーポンドヘッジ指数	10.95	-2.24	20.21	-15.99	18.87	6.28	5.42	12.82	15.62
デイリースイスフランヘッジ指数	9.43	-2.28	19.08	-17.03	17.61	5.13	4.44	12.87	15.55

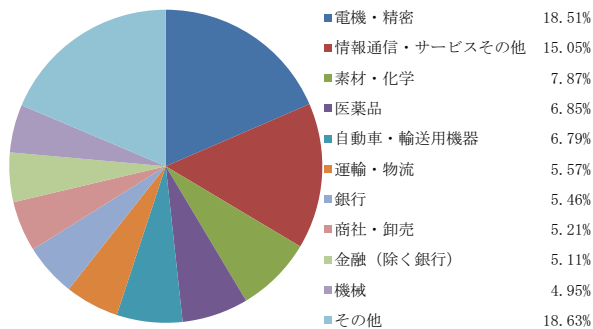
■ウェイト上位 10 銘柄 (2019/12/30)

銘柄名	コード	TOPIX-17 シリーズの業種	ウェイト%	キャップ調整あり(*)
ソニー	6758	電機・精密	1.69	*
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8306	銀行	1.58	*
トヨタ自動車	7203	自動車・輸送用機器	1.58	*
リクルートホールディングス	6098	情報通信・サービスその他	1.50	
武田薬品工業	4502	医薬品	1.48	*
キーエンス	6861	電機・精密	1.47	*
日本電信電話	9432	情報通信・サービスその他	1.47	*
任天堂	7974	情報通信・サービスその他	1.44	
三井住友フィナンシャルグループ	8316	銀行	1.42	*
本田技研工業	7267	自動車・輸送用機器	1.30	

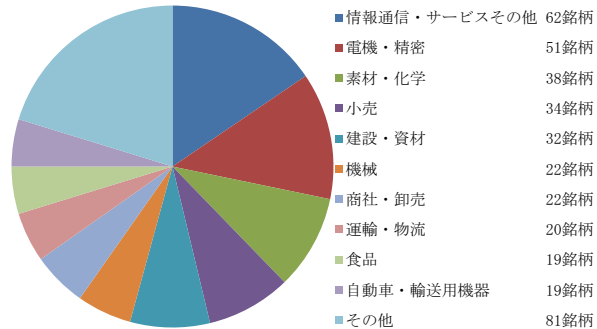
(*)キャップ調整の適用銘柄

■業種別ウェイト (2019/12/30) ※TOPIX-17 シリーズの業種による区分に基づく

ウェイト上位 10 業種



銘柄数上位 10 業種



■ベンダーコード

	QUICK	Bloomberg	THOMSON REUTERS
税引後配当込 JPX 日経 400 ユーロヘッジ指数	S105#NREH/NKNJ	JN4NEH	.JPXNK400NTR2E
税引後配当込 JPX 日経 400 ドルヘッジ指数	S105#NRDH/NKNJ	JN4NUH	.JPXNK400NTR2D
税引後配当込 JPX 日経 400 ボンドヘッジ指数	S105#NRPH/NKNJ	JN4NGH	.JPXNK400NTR2P
税引後配当込 JPX 日経 400 スイスフランヘッジ指数	S105#NRCH/NKNJ	JN4NCH	.JPXNK400NTR2C
税引後配当込 JPX 日経 400 デイリーユーロヘッジ指数	S105#NRDEH/NKNJ	JN4NDEH	.JPXNK400NTRD2E
税引後配当込 JPX 日経 400 デイリードルヘッジ指数	S105#NRDDH/NKNJ	JN4NDUH	.JPXNK400NTRD2D
税引後配当込 JPX 日経 400 デイリーボンドヘッジ指数	S105#NRDPH/NKNJ	JN4NDGH	.JPXNK400NTRD2P
税引後配当込 JPX 日経 400 デイリースイスフランヘッジ指数	S105#NRDCH/NKNJ	JN4NDCH	.JPXNK400NTRD2C

■リファレンス

詳しい計算方法や構成銘柄選定ルールは「算出要領」を参照ください。

→(日経サイト) <https://indexes.nikkei.co.jp/nkave/index/profile?idx=jpxnk400eur>
<https://indexes.nikkei.co.jp/nkave/index/profile?idx=jpxnk400usd>
<https://indexes.nikkei.co.jp/nkave/index/profile?idx=jpxnk400gbp>
<https://indexes.nikkei.co.jp/nkave/index/profile?idx=jpxnk400chf>
 (東証サイト) <https://www.jpx.co.jp/markets/indices/jpx-nikkei400/index.html>

<p>《免責事項》 JPX 日経 400 為替ヘッジ指数は、株式会社日本経済新聞社 (以下、「日経」という) と株式会社東京証券取引所 (以下、「東証」という) とによって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、日経と東証は、JPX 日経 400 為替ヘッジ指数自体及び JPX 日経 400 為替ヘッジ指数を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。JPX 日経 400 為替ヘッジ指数を示す標準に関する商標権その他の知的財産権は、すべて日経、東証及び株式会社日本取引所グループに帰属しています。日経と東証は、JPX 日経 400 為替ヘッジ指数を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。日経と東証は、JPX 日経 400 為替ヘッジ指数の計算方法など、その内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。《本資料について》 本資料は日経と東証の著作物であり、本資料の全部又は一部を、いかなる形式によっても日経と東証に無断で複写、複製、転載または流布することができません。本資料は JPX 日経 400 為替ヘッジ指数について深く理解いただくことを目的として作成したものであり、JPX 日経 400 為替ヘッジ指数を対象とした金融商品等の売買に関する勧誘を行うためのものではありません。本資料は作成時点までの信頼できると思われる各種情報、データに基づいて作成されていますが、その正確性、相当性、完全性などに対して日経と東証は責任を負いません。また本資料に記載された情報を利用したことにより発生するいかなる費用又は損害について、日経と東証は一切その責任を負いません。本資料は、常に最新の情報に更新されていることを保証せず、また予告なく変更することがあります。本資料が対象とする指数の運営において本資料と異なる方法等が適用されることがあります。いずれの場合も日経と東証からの最新の開示に基づく情報が優先されます。</p>	<p>《連絡先》 日本経済新聞社 インデックス事業室 TEL 03-6256-7341 index@nex.nikkei.co.jp 東京証券取引所 情報サービス部 TEL 050-3377-7754 index@jpx.co.jp</p>
---	---