

野村日本株高配当70・米ドルヘッジ指数 (ネットトータルリターン)

NOMURA

本インデックスは、米ドル建てで投資を行う投資家が為替リスクを回避しつつ「野村日本株高配当70の円建てネットトータルリターン指数」に投資する際のパフォーマンスを表す。
月末時点の投資残高を1カ月のドル円為替フォワード取引を用いて毎月末ヘッジしたものととして算出される。

時点 2023年11月末

米ドル建てインデックス

銘柄数 70
定期入替 毎年12月
基準日 2000年12月29日
(基準時点の指数値) (=10000)
加重方法 等金額型

代表的な上場商品

Bloomberg 2048 JP <Equity>
上場市場 東京証券取引所
通貨 円建て
上場日 2015年3月16日
運用会社 ノムラ・ヨーロッパ・
(ETNは発行会社) ファイナンス・エヌ・ブイ

インデックスに関するお問い合わせ先

野村フィデューシャリー・リサーチ &
コンサルティング株式会社
インデックス事業部

e-mail : idx_mgr@nfrco.jp

野村日本株高配当70・米ドルヘッジ指数
提供メディア

野村日本株高配当70・米ドルヘッジ指数は
以下の媒体で公表されている。

ウェブサイト <http://qr.nomuraholdings.com/jp/nhdiv/index.html>

日次の指数値は以下の媒体で公開されている。

Bloomberg NMRIUHD <Index>

QUICK SNJPHD#NRDH/NRIJ

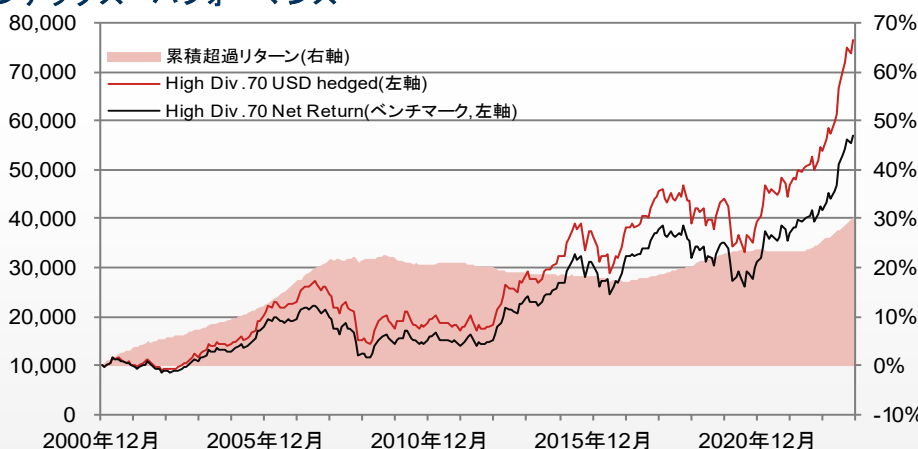
LSEG .NHDIV70UNH

ウェブサイト <http://qr.nomuraholdings.com/jp/nhdiv/index.html>

概要

- 野村日本株高配当70は今期予想配当利回りが高い日本株70銘柄に集中投資する等金額型の指数である。そのネットトータルリターン指数とは、税引後の配当金を指数構成銘柄に再投資した場合のパフォーマンスを表す。
- 本インデックスでは、配当に対する源泉徴収税率として国内非居住者に対する税率を用いており、米ドル建てで投資を行う海外投資家が、為替リスクをヘッジしながら日本株高配当銘柄に集中投資することを容易かつ低コストで実現可能とできるように配慮している。本インデックスは米ドル建てで算出される。
- 米ドルヘッジ指数で用いるドル円為替レートは、WMR Closing Spot Rates及びWMR Closing Forward Rates(ロンドン時間16時の仲値、1米ドル当たりの円レート)を使用する。

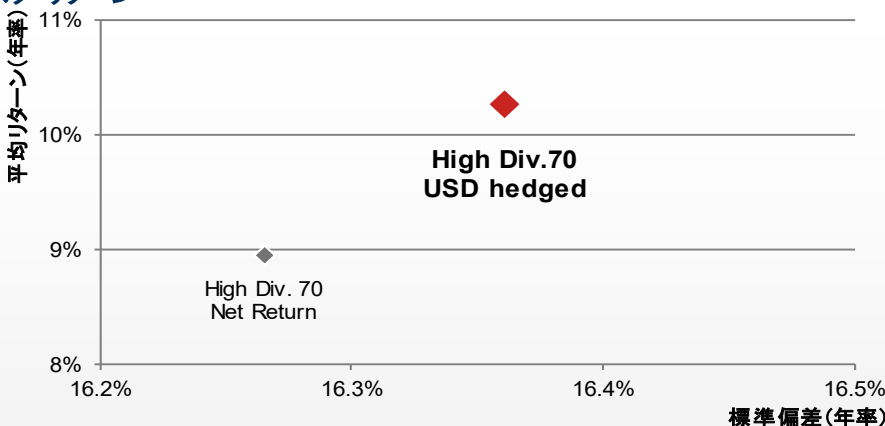
インデックス・パフォーマンス



(上)指数値は2000年12月末を10,000とする。米ドルヘッジ指数は米ドルベース、高配当70(ネットリターン)は円ベース、のそれぞれネットトータルリターン指数を使用。(下)注1参照。)

	1カ月	3カ月	年度ベース	1年	2年	5年	01年01月~
High Div.70 USD hedged	3.7%	6.9%	34.0%	35.1%	28.0%	12.8%	10.3%
High Div.70 Net Return	3.1%	5.3%	29.4%	30.1%	24.6%	10.8%	8.9%
High Div.70 USD hedged - High Div.70 Net Return	0.6%	1.6%	4.6%	5.0%	3.4%	2.0%	1.3%
IR	-	-	-	10.86	4.60	2.92	1.77

リスク・リターン



(期間は2001年1月~現在、米ドルヘッジ指数は米ドルベース、高配当70(ネットリターン)は円ベース、ネットトータルリターン指数を使用、月次リターンを元に年率換算 注2参照)

	High Div.70 USD hedged	High Div.70 Net Return
平均リターン	10.27%	8.95%
標準偏差	16.36%	16.27%
リターン/標準偏差	0.63	0.55

野村日本株高配当70・米ドルヘッジ指数 (ネットトータルリターン)

NOMURA

時点 2023年11月末

バリュエーション

(今期予想ベース、連結優先 注3参照)

	PER(倍)	PBR(倍)	配当利回り(%)	ROE(%)
High Div. 70	11.68	0.96	3.51	8.45
R/N Total	15.69	1.37	2.30	8.98
R/N Large Value	12.07	0.94	2.97	8.00

(注1)

- ・1年未満は期間内のリターン、1年以上の期間は月次リターンを元に年率換算(ドルヘッジ指数は米ドルベース、高配当70(ネットリターン)は円ベース、のそれぞれネットトータルリターン指数)
- ・年率換算リターン(当該指数、ベンチマーク指数)は、期間中の月次リターンの平均値を12倍して算出。
- ・超過リターン(3行目)は、各期について計算した当該指数リターン(1行目)から同様に計算したベンチマーク指数リターン(2行目)をマイナスして算出。
- ・IR(Information Ratio 情報比)は、期間中の当該指数の対ベンチマーク指数月次超過リターンの平均値の12倍を、月次超過リターンの標準偏差に12の正の平方根を乗じた数値で除して算出。

(注2)

- ・平均リターン(1行目)は、期間中の月次リターンの平均値を12倍して算出。
- ・標準偏差(2行目)は、期間中の月次リターンの標準偏差に12の正の平方根を乗じて算出。
- ・リターン/標準偏差(3行目)は、1行目の値を2行目の値で除して算出。

(注3)

- ・今年度(4月～翌3月)に到来する年次決算を同一の期として集計している。
- ・財務指標の集計上は、各指数構成銘柄の指数組入比率を考慮している。
ただし、親会社と子会社が同一指数に含まれる場合は、子会社を計算対象から除く。
- ・各指標の算出は、以下の計算式による。

PER(Price Earnings Ratio 株価収益率) = 時価総額合計 ÷ 税引利益合計

PBR(Price Book-value Ratio 株価純資産倍率) = 時価総額合計 ÷ 自己資本合計

配当利回り = 配当総額合計 ÷ 時価総額合計

ROE(Return On Equity 自己資本利益率) = 税引利益合計 ÷ ((自己資本 + 前期自己資本) ÷ 2)

その他レポート

インデックス構成の詳細

野村日本株高配当70 ルールブック

野村日本株高配当70の知的財産権およびその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下、NFRC)に帰属します。なお、NFRCは、当インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、インデックスの利用者およびその関連会社が当インデックスを用いて行う事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

Russell/Nomura 日本株インデックスの知的財産権およびその他一切の権利はNFRCおよびFrank Russell Company(以下、Russell)に帰属します。なお、NFRCおよびRussellは、当インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、インデックスの利用者およびその関連会社が当インデックスを用いて行う事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

インデックスの算出において、電子計算機の障害もしくは天災地変その他やむを得ない事由が発生した場合は、インデックスの公表を延期または中止することがあります。

インデックス・データを取得した経路(当社ウェブサイト、情報ベンダー各社のサービスを通じた取得、等)に関わらず、これらのインデックスをご利用の際は、「インデックス・ライセンスについて」をご確認ください。

「インデックス・ライセンスについて」<http://qr.nomuraholdings.com/jp/indexlicense.html>

The WMR FX Benchmarks (WMR Spot Rates) are provided by London Stock Exchange Group (LSEG). LSEG shall not be liable for any errors in or delays in providing or making available the data contained within this service or for any actions taken in reliance on the same.

■ 本資料は、お客様への情報提供を目的として、NFRCが作成したものです。

■ 本資料に掲載された全ての意見や予想はNFRCの本資料作成時点での判断に基づいており、通知なく変更されることがあります。また、本資料における将来の予測に関する意見が実際に生ずるといことを担保あるいは保証するものではありません。本資料の内容の一部は、NFRCが信頼性があると判断した様々な入手可能な情報に基づいています。しかし、NFRCはその正確さを保証するものではなく、これらの情報は要約された不完全なものである可能性があります。過去の投資実績は将来の結果を示唆するものではありません。

■ 本資料は特定の証券取引に関する投資勧誘や投資アドバイスを目的としたものではありません。

■ NFRCが開発・提供する市場インデックス(自社関連インデックス)が使用されている運用商品等をお客様が投資対象とする場合、当該インデックス利用料の一部が直接的・間接的問わずNFRCに帰属する可能性があります。自社関連インデックスの詳細は以下のウェブサイトをご参照ください。

証券市場インデックス <http://qr.nomuraholdings.com/jp/>

■ 本資料は、配布されたお客様限りでご使用ください。本資料はNFRCの著作物であり、NFRCの書面による事前の承諾なく、本資料の全部もしくは一部を複製、転送または再配布することはご遠慮ください。

野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第451号

加入協会 一般社団法人日本投資顧問業協会 会員番号(第011-00961号)