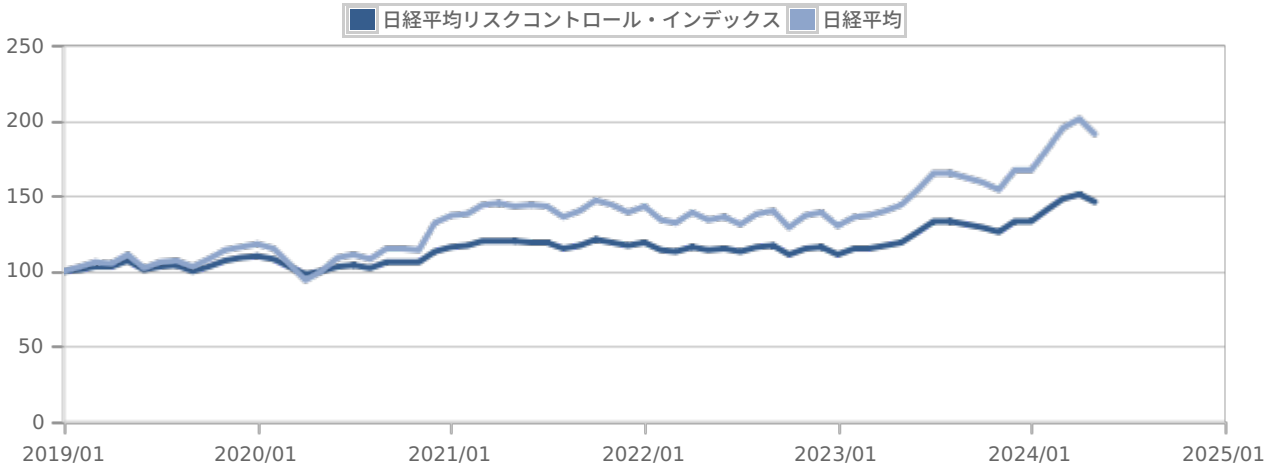
日経平均リスクコントロール・インデックス
月次ファクトシート

日経平均リスクコントロール・インデックスは、日経平均株価を対象に、日経平均よりも変動率（ボラティリティー）を低く抑え、一定の水準内におさまるようにコントロールした指数です。「日経平均ストラテジー・インデックス・シリーズ」の一つで、日経平均よりも変動率が安定した運用を求める投資家のニーズに対応した指数です。

■基本情報

対象指数	日経平均株価
算出開始日	2011年6月6日(2001年12月28日まで遡及算出)
基準日	2001年12月28日＝10,000ポイント
計算頻度	1日1回終値ベース

■パフォーマンス



■年間リターン

	年間リターン%					
	2019	2020	2021	2022	2023	YTD
日経平均リスクコントロール・インデックス	10.91	4.82	2.67	-6.56	19.39	10.04
日経平均	18.20	16.01	4.91	-9.37	28.24	14.77

■リスク・リターン

	累積リターン（年率）%			標準偏差（年率）%		
	1年	3年	5年	1年	3年	5年
日経平均リスクコントロール・インデックス	22.41	6.88	6.49	12.63	10.55	10.42
日経平均	33.09	10.05	11.53	17.67	15.77	17.24

■ベンダーコード

QUICK	S101#RC/NKNJ
Bloomberg	NKYRC
Refinitiv	.N225RC

■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。
→(URL) https://indexes.nikkei.co.jp/nkave/index/profile?idx=nk225rc

（※）月次ファクトシートは前月末時点のデータで作成しています。

<<免責事項>>
日経平均リスクコントロール・インデックスは、日本経済新聞社（以下「日経」という）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、 日経は、日経平均リスクコントロール・インデックス自体及び日経平均リスクコントロール・インデックス等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。 「日本経済新聞社」、「日経」および「日経平均リスクコントロール・インデックス」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべて日経に帰属しています。 日経は、日経平均リスクコントロール・インデックス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。 日経は、日経平均リスクコントロール・インデックスの計算方法など、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。 日経は日経平均リスクコントロール・インデックスを対象としたすべての金融商品等に対して、それらを保証するものではなく、一切の責任を負いません。

<<本資料について>>
本資料は日経の著作物であり、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。 本資料は日経平均リスクコントロール・インデックス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、日経平均リスクコントロール・インデックス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からの最新の開示に基づく情報が優先されます。

<<連絡先>>
日本経済新聞社
インデックス事業室
index@nex.nikkei.co.jp