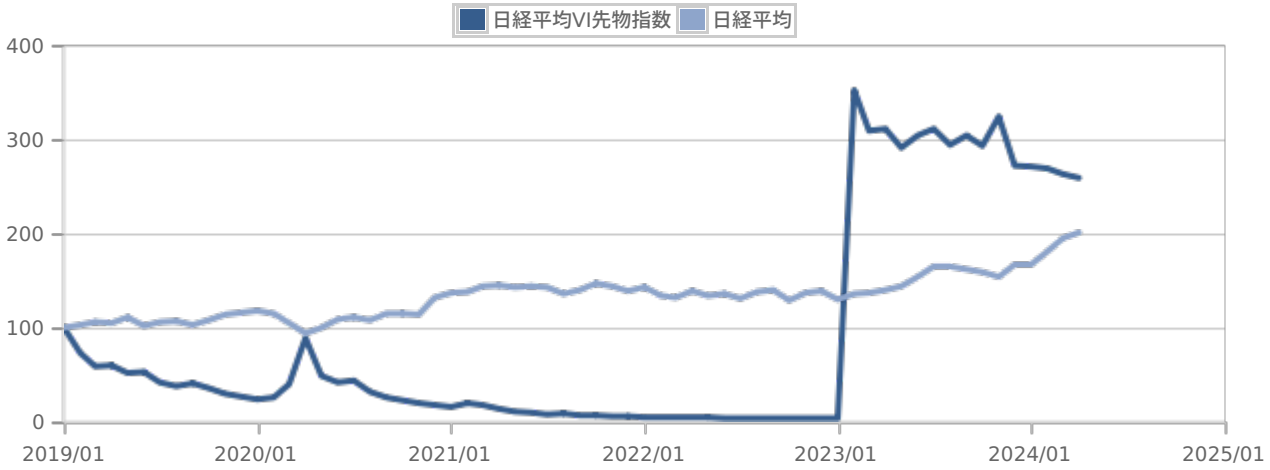
日経平均ボラティリティー・インデックス先物指数
月次ファクトシート

日経平均VI先物指数は、大阪取引所の日経平均VI先物を対象にして、期近限月と期先限月のウエートを日々調整することで、仮想的に満期1カ月の日経平均VI先物を合成し、その合成した先物価格の日々の変動率に連動するよう設計された指数です。

■基本情報

算出開始日	2012年12月3日（2012年2月27日まで遡及算出）
基準日	2012年2月27日＝100,000ポイント（※ただし、2023年1月23日以降、指数値の水準を2桁引き上げ）
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VI先物指数	-75.38	-32.46	-69.25	-21.74	-32.09	-4.37
日経平均	18.20	16.01	4.91	-9.37	28.24	20.63

■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VI先物指数	-16.66	-43.42	-46.64	22.80	29.64	73.43
日経平均	43.96	11.43	13.74	15.73	15.45	17.11

■ベンダーコード

QUICK	S101#VIF/NKNJ
Bloomberg	NKYVF
Refinitiv	.N225VF

■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=nk225vifi

（※）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>>
日経平均ボラティリティー・インデックス先物指数は、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、日経平均ボラティリティー・インデックス先物指数自体及び日経平均ボラティリティー・インデックス先物指数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「日経平均ボラティリティー・インデックス先物指数」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、日経平均ボラティリティー・インデックス先物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。 日経は、日経平均ボラティリティー・インデックス先物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。
日経は日経平均ボラティリティー・インデックス先物指数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。 本資料は日経平均ボラティリティー・インデックス先物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、日経平均ボラティリティー・インデックス先物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