

《 発表資料 》

2010年3月18日
日本経済新聞社

「日経平均・配当指数」の算出・公表開始について

日本経済新聞社は、4月から日経平均株価の構成銘柄の累積配当額を指数化した「日経平均・配当指数」※の算出・公表を開始します。

※略称：日経配当指数、英文名称：Nikkei Stock Average Dividend Point Index

「日経配当指数」は日経平均の構成銘柄（225種）の株式を、日経平均の計算式に合わせて1年間（暦年ベース）保有した場合に受け取ることのできる配当金を積み上げて指数にしたものです。各銘柄の1株当たり実績配当金を確定のつど株価の代わりに日経平均の計算式に当てはめた値を求め、それを年間累積することで算出します。（詳しい計算方法等は別紙をご参照ください。）

ここ数年の経済環境を背景に、日経平均を原資産とした各種金融商品を取引する市場参加者から、配当部分の変動リスクをヘッジ（回避）したいというニーズが拡大しています。リスクヘッジ用途などのために、配当スワップ取引のベースとなる配当指数を算出してほしいという声を多数お寄せいただいております。今回の日経配当指数の算出・公表開始は、こうした市場参加者のニーズに応えたものです。

欧米では主要な株価指数の配当指数が算出・公表され、店頭での配当スワップ取引に加え、配当指数を使った先物など上場取引も拡大しつつあります。日経配当指数も欧米同様に、さまざまな金融取引の場面での活用を期待しています。

以上