

《 発表資料 》

2012年11月22日
日本経済新聞社
東京工業品取引所

日経・東工取商品指数のレバレッジ・インバース指数の公表開始について

日本経済新聞社と東京工業品取引所は、2009年から共同で算出している「日経・東工取商品指数」と「日経・東工取サブ商品指数」の値動きを対象にした新指数の算出・公表を開始します。市場参加者に対し、多様な投資戦略や価格変動リスク回避策の評価指標を提供するのが狙いです。

新指数は、前日比の変化率が対象指数の2倍になる仕組みの「レバレッジ指数」と逆の動きになる仕組みの「インバース指数」です。日経・東工取商品指数と、その構成銘柄で作る11本のサブ商品指数を対象にそれぞれ「レバレッジ指数」「インバース指数」を算出し、12月3日(月)から日々、東京工業品取引所のホームページを通じて公表します。

例えば「日経・東工取商品指数」が前日比10%上昇(下落)した日には、日経・東工取商品レバレッジ指数は20%上昇(下落)、日経・東工取商品インバース指数は10%下落(上昇)するようになっています。より大きな値動きを求めて、ハイリスク・ハイリターン型の投資戦略を指数化したものがレバレッジ指数です。インバース指数は相場と逆向きの収益(リターン)を追求する投資戦略で、相場の先行きが弱いと見た際に、インバース指数に連動した運用をすることで収益を狙ったり相場下落のリスクを回避したりするケースなどが考えられます。

実物資産として商品投資への関心は高まっています。日本経済新聞社と東京工業品取引所は市場参加者の投資戦略の多様化を踏まえ、運用指標となる指数の裾野を広げて、市場の活性化や透明性の向上に資することを期待しています。

新指数は2009年末の数値を10000として指数化し、日々1回、帳入値ベースで算出します。

以上

[1]

新指数の一覧

日経・東工取レバレッジ指数シリーズ

日経・東工取インバース指数シリーズ

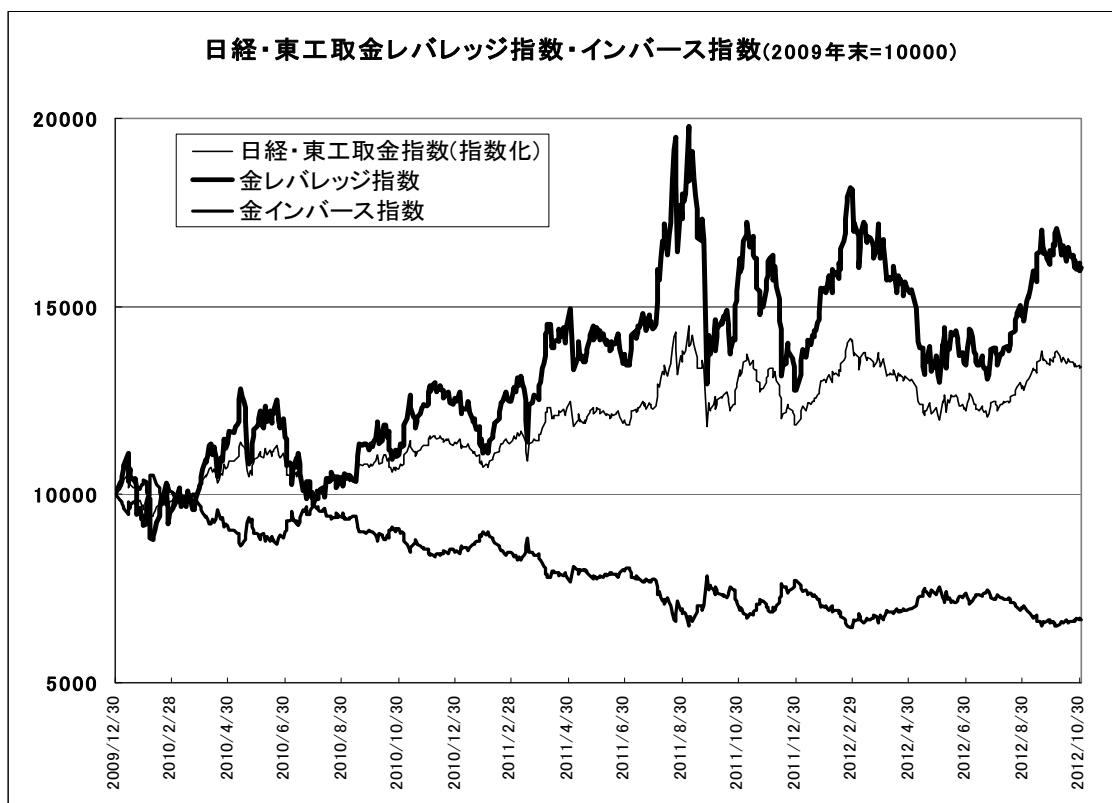
日経・東工取商品レバレッジ指数	日経・東工取商品インバース指数
日経・東工取期近限月商品レバレッジ指数	日経・東工取期近限月商品インバース指数
日経・東工取貴金属レバレッジ指数	日経・東工取貴金属インバース指数
日経・東工取石油レバレッジ指数	日経・東工取石油インバース指数
日経・東工取金レバレッジ指数	日経・東工取金インバース指数
日経・東工取銀レバレッジ指数	日経・東工取銀インバース指数
日経・東工取白金レバレッジ指数	日経・東工取白金インバース指数
日経・東工取パラジウムレバレッジ指数	日経・東工取パラジウムインバース指数
日経・東工取ガソリンレバレッジ指数	日経・東工取ガソリンインバース指数
日経・東工取灯油レバレッジ指数	日経・東工取灯油インバース指数
日経・東工取原油レバレッジ指数	日経・東工取原油インバース指数
日経・東工取ゴムレバレッジ指数	日経・東工取ゴムインバース指数

英文名称：〔 〕内はそれぞれ対象商品名

Nikkei-TOCOM Leveraged [Commodity] Index (日経・東工取[商品]レバレッジ指数)

Nikkei-TOCOM Inverse [Commodity] Index (日経・東工取[商品]インバース指数)

レバレッジ、インバース指数の動きの例



※日経・東工取金指数は起点(2009年末)の値(241.75)を10000として指数化

《ご参考》詳細は「[レバレッジ指数](#)」「[インバース指数](#)」ページをご覧ください。(東工取サイトに移動します)

[2]