日経平均気候変動1.5℃目標指数
月次ファクトシート

「日経平均気候変動1.5℃目標指数（日経気候変動指数）」は日経平均株価の構成銘柄、ウエート（構成比率）をベースに、指数全体の企業価値当たりのGHG排出量を日経平均と比べて50%以上削減し、かつ前年比で毎年7%以上削減するように各構成銘柄のウエートを調整して算出する指数です。ＥＵが定めたパリ協定適合ベンチマーク（PAB）で、米ウィルシャーと共同で開発を行いました。本指数はウィルシャーが開発、修正または提供する気候変動モデルおよびその他のコンテンツである「Wilshire Climate Content」を適用して算出しています。

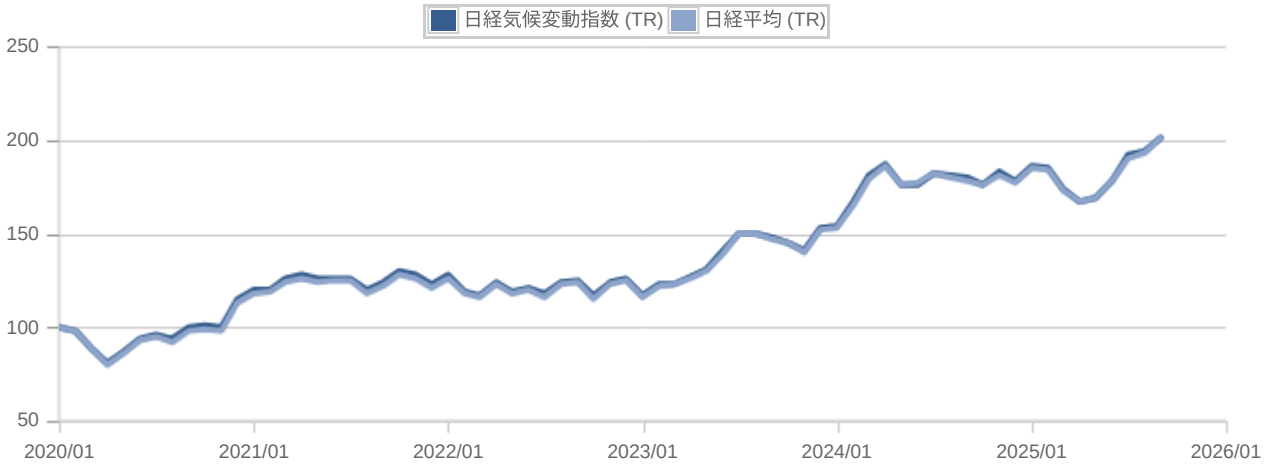
■銘柄選定

日経平均株価の構成銘柄から一定の条件で銘柄を除外した銘柄を対象に算出します。

■基本情報

銘柄入れ替え	年2回(4月、10月)
銘柄数	定めなし
ウェート	日経平均株価におけるウエートにGHG強度（企業価値当たりのGHG排出量）等を加味
算出開始日	2022年5月30日(2015年10月30日まで遡及算出)
基準日	2020年10月30日=22,977円13銭
計算頻度	リアルタイム(5秒間隔)

■パフォーマンス



■年間リターン

	年間リターン%					
	2020	2021	2022	2023	2024	YTD
日経気候変動指数 (TR)	20.18	6.82	-8.26	30.89	21.25	7.59
日経平均 (TR)	18.26	6.66	-7.34	30.96	21.33	8.30

■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
日経気候変動指数 (TR)	11.46	16.97	14.90	14.31	15.52	15.52
日経平均 (TR)	12.69	17.33	15.24	13.46	15.04	15.17

■ファンダメンタルズ

	配当利回り％	PER	PBR	ROE%
日経気候変動指数	1.78	22.59	2.21	9.81
日経平均	1.84	21.83	2.09	9.57

（※）各指標の定義は日経平均プロフィル「ユーザーズ・ガイド」をご参照ください。

■指数の特性

	銘柄数
構成銘柄数	203
大型株（時価総額1～100位）	80
中型株（時価総額101～500位）	113
小型株（時価総額501位～）	10

（※）東証上場銘柄における順位

	時価総額（百万円）
合計	683,529,327
最大	45,378,999
最小	175,127
平均	3,367,140
中央値	1,438,594

■ウェート上位10銘柄

銘柄名	コード	業種	ウェート%
アドバンテスト	6857	電気機器	9.13
ファーストリテイリング	9983	小売業	8.60
ソフトバンクグループ	9984	通信	7.79
東京エレクトロン	8035	電気機器	6.02
ＫＤＤＩ	9433	通信	2.42
ＴＤＫ	6762	電気機器	2.24
信越化学工業	4063	化学	2.17
テルモ	4543	精密機器	2.10
リクルートホールディングス	6098	サービス	2.06
ソニーグループ	6758	電気機器	1.96

■業種別ウェート・銘柄数

	ウェート%
技術	54.00
消費	23.46
素材	10.02
資本財・その他	7.52
金融	3.13
運輸・公共	1.88

	銘柄数
技術	61
素材	38
消費	36
資本財・その他	32
金融	20
運輸・公共	16

■ベンダーコード

		（トータルリターン）	（ネット・トータルリターン）
QUICK	108	S101#C15TR/NKNJ	S101#C15NR/NKNJ
Bloomberg	NKYC15	NKYC15TR	NKYC15NR
Refinitiv	.NKCCAP	.NKCCAT	.NKCCAN

■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=nk225c15

（※）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>>
日経平均気候変動1.5°C目標指数は、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、日経平均気候変動1.5°C目標指数自体及び日経平均気候変動1.5°C目標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「日経平均気候変動1.5°C目標指数」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、日経平均気候変動1.5°C目標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、日経平均気候変動1.5°C目標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。 日経は日経平均気候変動1.5°C目標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。
日経平均気候変動1.5°C目標指数の算出のために提供される「Wilshire Climate Content」およびデータ提供会社（ISS ESG）との契約に基づきウィルシャーが取得したデータ、 ならびにこれらから派生するデータの一切の知的財産権は、ウィルシャーまたはそのライセンサーであるデータ提供者が独占的に所有しています。これらのデータの無断使用を禁じます。 「Wilshire Climate Content」は、一般に公開され、かつ信頼できる第三者から入手した情報に基づいています。ウィルシャーは入手した情報を独自に検証していません。 ウィルシャーは 「 Wilshire Climate Content」を含むウィルシャーによって提供される情報の正確性について何ら表明や保証を与えず、その情報の誤謬や遺漏、不正確性、 ならびにその利用から得られる結果に対し、直接、間接問わず一切の責任を負いません。 情報はいずれも表示時点のものであり、予告なく変更されることがあります。Wilshire®は登録サービスマークです。 その他の商号、商標および/またはサービスマークは各所有者に属します。

<<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。 本資料は日経平均気候変動1.5°C目標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、日経平均気候変動1.5°C目標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