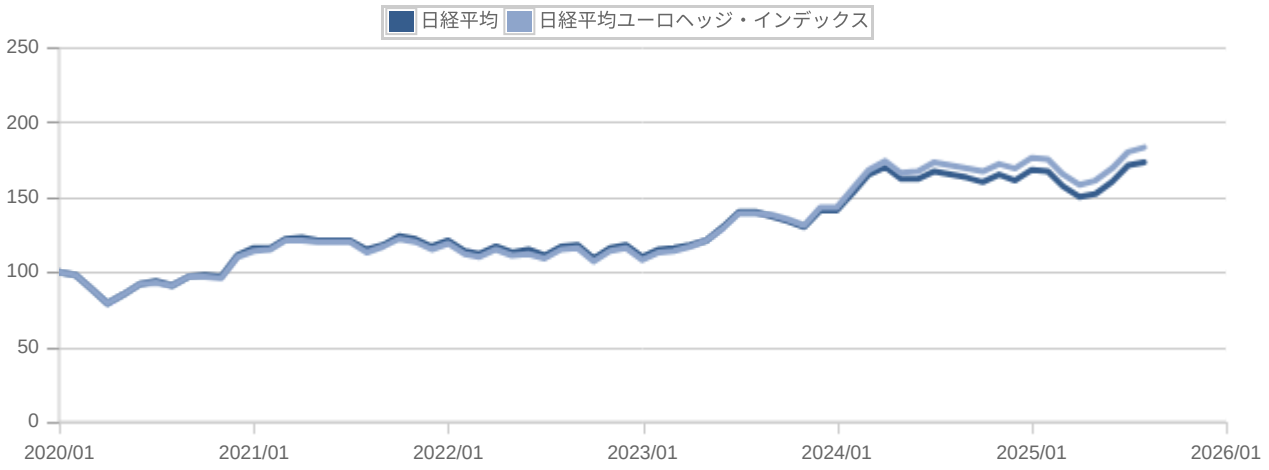
日経平均ユーロヘッジ・インデックス
月次ファクトシート

日経平均ユーロヘッジ・インデックスは、日経平均株価を対象にした「日経平均為替ヘッジ・インデックス」の１つで、主に海外投資家が為替リスクを回避しつつ、ユーロ建てで日経平均に投資する際のベンチマークとなる指数です。ユーロ建てでの日経平均に対する投資に、為替ヘッジのポジションを組み合わせた投資戦略に対応しています。日経平均トータルリターン・インデックスを原指数とした日経平均トータルリターン・ユーロヘッジ・インデックスも算出しています。両指数とも、月次ヘッジで算出しています。

■基本情報

対象指数	日経平均株価、日経平均トータルリターン・インデックス
算出開始日	2014年12月8日（2004年9月30日まで遡及算出）
基準日	2004年9月30日＝10823.57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%					
	2020	2021	2022	2023	2024	YTD
日経平均	16.01	4.91	-9.37	28.24	19.22	2.95
ドルヘッジ・インデックス	17.12	4.99	-7.30	35.52	24.67	5.16
ユーロヘッジ・インデックス	14.93	4.15	-9.31	32.36	23.11	3.89
日経平均 (TR)	18.26	6.66	-7.34	30.96	21.33	4.06
ドルヘッジ・インデックス	19.38	6.71	-5.31	38.38	26.87	6.31
ユーロヘッジ・インデックス	17.17	5.89	-7.32	35.15	25.28	4.99

■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	5.03	13.89	13.60	13.50	15.21	15.38
ドルヘッジ・インデックス	9.13	19.13	16.99	13.52	15.13	15.33
ユーロヘッジ・インデックス	7.23	16.77	14.97	13.35	15.08	15.24
日経平均 (TR)	7.09	16.20	15.80	13.19	14.96	15.31
ドルヘッジ・インデックス	11.28	21.53	19.23	13.21	14.89	15.25
ユーロヘッジ・インデックス	9.31	19.11	17.18	13.05	14.83	15.17

■ベンダーコード

	QUICK	Bloomberg	Refinitiv
日経平均ドルヘッジ・インデックス	S101#DH/NKNJ	NKYCH2U	.N225CH2U
日経平均ユーロヘッジ・インデックス	S101#EH/NKNJ	NKYCH2E	.N225CH2E
日経平均トータルリターン・ドルヘッジ・インデックス	S101#TRDH/NKNJ	NKYCHTU	.N225CHTU
日経平均トータルリターン・ユーロヘッジ・インデックス	S101#TREH/NKNJ	NKYCHTE	.N225CHTE

■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=nk225eur

（※）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>>
日経平均ユーロヘッジ・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、日経平均ユーロヘッジ・インデックス自体及び日経平均ユーロヘッジ・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「日経平均ユーロヘッジ・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、日経平均ユーロヘッジ・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、日経平均ユーロヘッジ・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。 日経は日経平均ユーロヘッジ・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。 本資料は日経平均ユーロヘッジ・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、日経平均ユーロヘッジ・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