

日経平均高配当株50指数 月次ファクトシート

「日経平均高配当株50指数（日経高配当株50）」は日経平均構成銘柄のうち配当利回りの高い50銘柄から構成される配当利回りウェイト方式の株価指数です。配当利回りに流動性（売買代金）を加味して構成銘柄の指数算出上のウェイトを決定するという、従来までの価格平均や時価総額加重平均とは異なる算出方法を採用しており、いわゆるスマートベータ型のインデックスとみることができます。2017年1月10日から算出を開始しました。

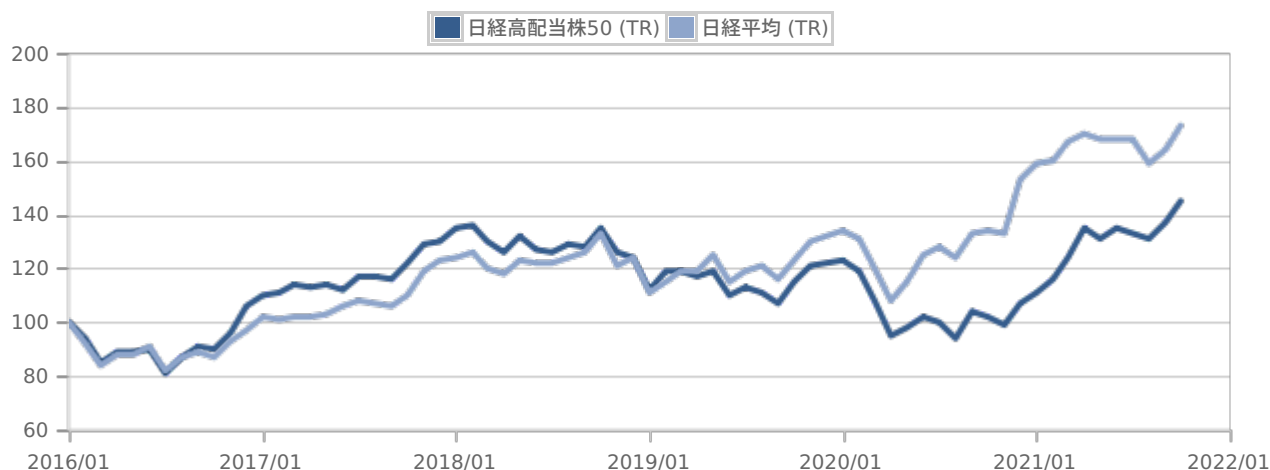
■銘柄選定

日経平均の構成銘柄の中から50銘柄を選定します。

■基本情報

銘柄入れ替え	年1回(6月)
銘柄数	50
ウェイト	配当利回り
算出開始日	2017年1月10日(2001年12月28日まで遡及算出)
基準日	2001年12月28日=10,000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%					
	2016	2017	2018	2019	2020	YTD
日経高配当株50 (TR)	10.75	22.09	-17.07	10.52	-9.70	30.22
日経平均 (TR)	2.38	21.33	-10.29	20.72	18.26	8.92

■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
日経高配当株50 (TR)	42.58	2.37	9.95	14.43	19.39	16.97
日経平均 (TR)	29.12	8.97	14.52	17.32	18.94	16.04

■ファンダメンタルズ

	配当利回り%	PER	PBR	ROE%
日経高配当株50	4.45	9.35	0.73	7.80
日経平均	1.64	15.67	1.95	12.44

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

■指数の特性

銘柄数		時価総額 (百万円)	
構成銘柄数	50	合計	116,391,644
大型株 (時価総額1~100位)	19	最大	12,033,934
中型株 (時価総額101~500位)	27	最小	85,386
小型株 (時価総額501位~)	4	平均	2,327,833
(※) 東証上場銘柄における順位		中央値	1,297,803

■ウェート上位10銘柄

銘柄名	コード	業種	ウェート%
日本郵船	9101	海運	4.61
ソフトバンク	9434	通信	3.75
三菱商事	8058	商社	3.71
日本たばこ産業	2914	食品	3.53
三井住友フィナンシャルグループ	8316	銀行	3.48
東京海上ホールディングス	8766	保険	3.36
武田薬品工業	4502	医薬品	3.35
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8306	銀行	3.21
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	8725	保険	2.99
野村ホールディングス	8604	証券	2.98

■業種別ウェート・銘柄数

ウェート%		銘柄数	
銀行	18.11	銀行	8
商社	12.28	化学	6
保険	10.19	商社	5
通信	9.39	電気機器	4
化学	5.53	保険	4
証券	5.08	通信	4
電気機器	5.04	証券	3
石油	4.94	石油	2
海運	4.61	窯業	2
食品	3.53	建設	2

■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	S101#HD/NKNJ	S101#HDTR/NKNJ	S101#HDNR/NKNJ
Bloomberg	NKHD50	NKHD50T	NKHD50NT
Refinitiv	.NKHD	.NKHT	.NKHN

■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=nk225hdy>

(※) 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>>

日経平均高配当株50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、日経平均高配当株50指数自体及び日経平均高配当株50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「日経平均高配当株50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、日経平均高配当株50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、日経平均高配当株50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。日経は日経平均高配当株50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。本資料は日経平均高配当株50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、日経平均高配当株50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される各種情報、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
TEL 03-6256-7341
index@nex.nikkei.co.jp