

日経ESG-REIT指数 月次ファクトシート

日経ESG-REIT指数は東京証券取引所に上場するREITを対象に、GRESBによるESG評価に応じて設定する係数（ESG係数）を適用した時価総額×ESG係数ウェイト方式の指数です。

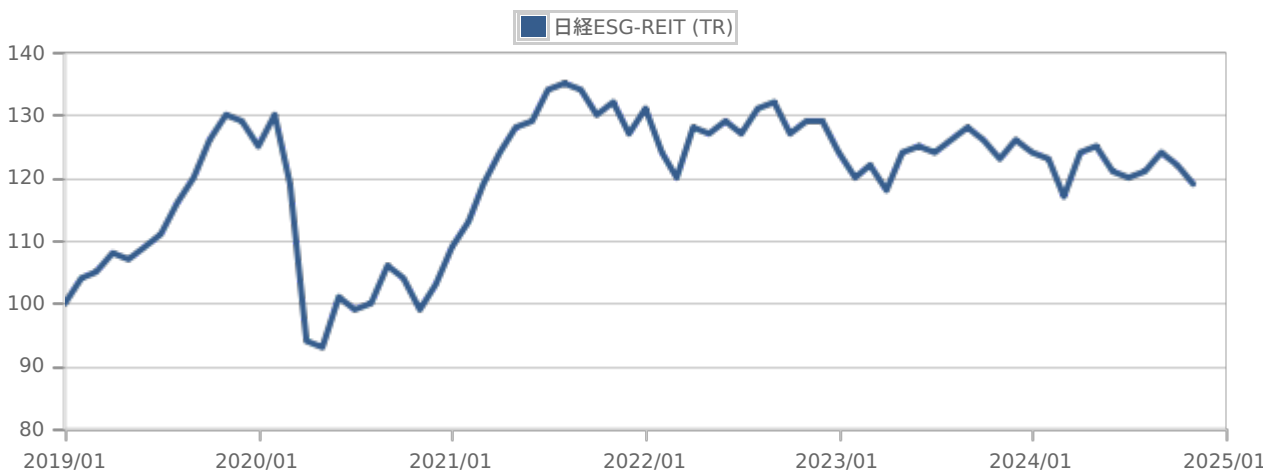
■銘柄選定

東京証券取引所に上場する全REITが対象です。ただし、流動性の低い銘柄は除外します。

■基本情報

銘柄入れ替え	年1回(11月)
ウェイト	時価総額×ESG係数
算出開始日	2020年7月20日(2016年11月30日まで遡及算出)
基準日	2016年11月30日=1,000ポイント
計算頻度	リアルタイム(15秒間隔)

■パフォーマンス



■年間リターン

	年間リターン%					YTD
	2019	2020	2021	2022	2023	
日経ESG-REIT (TR)	25.42	-12.75	20.09	-5.14	-0.51	-3.25

■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ESG-REIT (TR)	-3.02	-3.20	-1.64	10.06	10.41	15.03

■ファンダメンタルズ

	配当利回り%	PER	PBR	ROE%
日経ESG-REIT	4.96	20.15	1.21	6.04

(※) 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。

■ウェート上位10銘柄

銘柄名	コード	業種	ウェート%
日本ビルファンド投資法人	8951	その他金融	7.55
ジャパンリアルエステイト投資法人	8952	その他金融	5.75
日本プロロジスリート投資法人	3283	その他金融	5.07
G L P 投資法人	3281	その他金融	4.79
日本都市ファンド投資法人	8953	その他金融	4.75
野村不動産マスターファンド投資法人	3462	その他金融	4.62
K D X 不動産投資法人	8972	その他金融	4.32
大和ハウスリート投資法人	8984	その他金融	3.91
オリックス不動産投資法人	8954	その他金融	3.16
インヴィンシブル投資法人	8963	その他金融	3.00

■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	107	S155#ESTR/NKNJ	S155#ESNR/NKNJ
Bloomberg	NKYER	NKYERTR	NKYERNTR
Refinitiv	.NKNESR	.NKNESRTR	.NKNESRTR

■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=nkesgreit>

(※) 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ESG-REIT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ESG-REIT指数自体及び日経ESG-REIT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ESG-REIT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ESG-REIT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ESG-REIT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ESG-REIT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ESG-REIT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ESG-REIT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
index@nex.nikkei.co.jp