

野村日本株高配当70・米ドルヘッジ指数 (ネットトータルリターン)

NOMURA

本インデックスは、米ドル建てで投資を行う投資家が為替リスクを回避しつつ「野村日本株高配当70の円建てネットトータルリターン指数」に投資する際のパフォーマンスを表す。
月末時点の投資残高を1カ月のドル円為替フォワード取引を用いて毎月末ヘッジしたものとして算出される。

時点 2020年12月末

米ドル建てインデックス

銘柄数 70
 定期入替 毎年12月
 基準日 2000年12月29日
 (基準時点の指数値) (=10000)
 加重方法 等金額型

代表的なETN

Bloomberg 2048
 上場市場 東証
 通貨 JPY
 上場日 2015年3月16日
 ETN発行会社 ノムラ・ヨーロッパ・
 ファイナンス・エヌ・ブイ

インデックスに関するお問い合わせ先

野村証券株式会社 金融工学研究センター
 インデックス業務室
 電話 : 03-6703-3986
 e-mail : idx_mgr@jp.nomura.com

野村日本株高配当70・米ドルヘッジ指数
 提供メディア

野村日本株高配当70・米ドルヘッジ指数
 は以下の媒体で公表されている。

INTERNET [http://qr.nomura.co.jp/
jp/nhdiv/index.html](http://qr.nomura.co.jp/jp/nhdiv/index.html)

日次の指数値は以下の媒体で公開されて
 いる。

Bloomberg NMRIUHHD<INDEX>

QUICK SNJPHD#NRDH/NRIJ

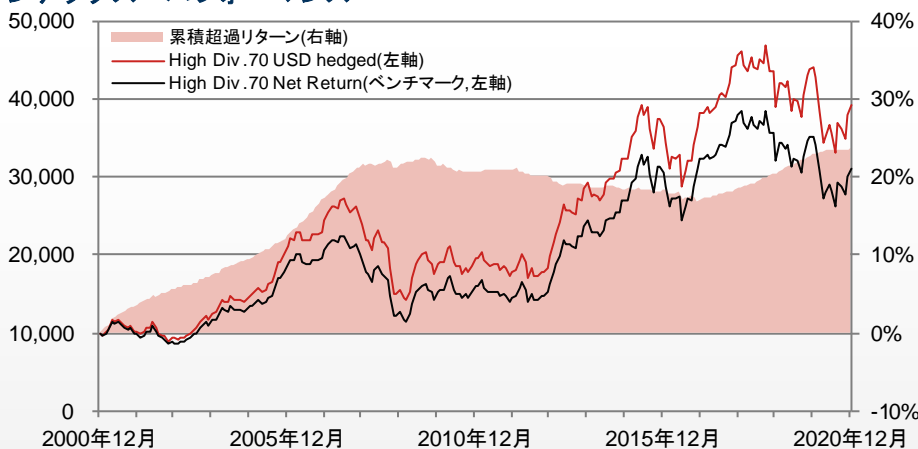
REUTERS .NHDIV70UNH

INTERNET [http://qr.nomura.co.jp/
jp/nhdiv/index.html](http://qr.nomura.co.jp/jp/nhdiv/index.html)

概要

- 野村日本株高配当70は今期予想配当利回りが高い日本株70銘柄に集中投資する等金額型の指数である。そのネットトータルリターン指数とは、税引後の配当金を指数構成銘柄に再投資した場合のパフォーマンスを表す。
- 本インデックスでは、配当に対する源泉徴収税率として国内非居住者に対する税率を用いており、米ドル建てで投資を行う海外投資家が、為替リスクをヘッジしながら日本株高配当銘柄に集中投資することを容易かつ低コストで実現可能とするように配慮している。本インデックスは米ドル建てで算出される。
- 米ドルヘッジ指数で用いるドル円為替レートは、WMロイターのスポットレートおよび1ヵ月フォワードレートの終値(ロンドン時間16時の仲値、1米ドル当たりの円レート)を使用する。

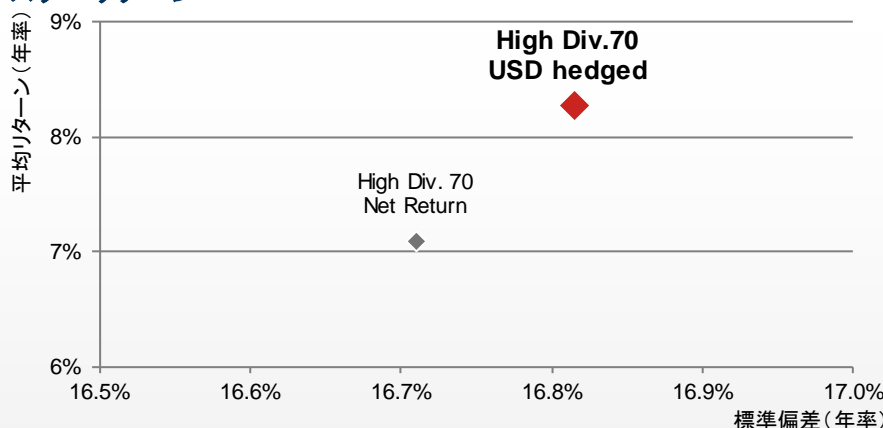
インデックス・パフォーマンス



(上)指数値は2000年12月末を10,000とする。米ドルヘッジ指数は米ドルベース、高配当70(ネットリターン)は円ベース、のそれぞれネットトータルリターン指数を使用。(下)注1参照。)

	1ヵ月	3ヵ月	年度ベース	1年	2年	5年	01年01月~
High Div. 70 USD hedged	3.4%	8.2%	14.6%	-8.6%	2.3%	3.1%	8.3%
High Div. 70 Net Return	3.3%	8.0%	14.2%	-9.4%	0.6%	2.0%	7.1%
High Div. 70 USD hedged - High Div. 70 Net Return	0.1%	0.2%	0.4%	0.8%	1.6%	1.1%	1.2%
IR	-	-	-	2.62	4.14	1.64	1.62

リスク・リターン



(期間は2001年1月~現在、米ドルヘッジ指数は米ドルベース、高配当70(ネットリターン)は円ベース、ネットトータルリターン指数を使用、月次リターンを元に年率換算 注2参照)

	High Div. 70 USD hedged	High Div. 70 Net Return
平均リターン	8.28%	7.09%
標準偏差	16.81%	16.71%
リターン/標準偏差	0.49	0.42

野村日本株高配当70・米ドルヘッジ指数 (ネットトータルリターン)

NOMURA

時点 2020年12月末

バリュエーション

(今期予想ベース、連結優先 注3参照)

	PER(倍)	PBR(倍)	配当利回り(%)	ROE(%)
High Div. 70	13.97	0.74	3.88	5.37
R/N Total	25.47	1.39	2.01	5.48
R/N Large Value	21.32	0.89	2.91	4.19

(注1)

- ・1年未満は期間内のリターン、1年以上の期間は月次リターンを元に年率換算(ドルヘッジ指数は米ドルベース、高配当70(ネットリターン)は円ベース、のそれぞれネットトータルリターン指数)
- ・年率換算リターン(当該指数、ベンチマーク指数)は、期間中の月次リターンの平均値を12倍して算出。
- ・超過リターン(3行目)は、各期について計算した当該指数リターン(1行目)から同様に計算したベンチマーク指数リターン(2行目)をマイナスして算出。
- ・IR(Information Ratio 情報比)は、期間中の当該指数の対ベンチマーク指数月次超過リターンの平均値の12倍を、月次超過リターンの標準偏差に12の正の平方根を乗じた数値で除して算出。

(注2)

- ・平均リターン(1行目)は、期間中の月次リターンの平均値を12倍して算出。
- ・標準偏差(2行目)は、期間中の月次リターンの標準偏差に12の正の平方根を乗じて算出。
- ・リターン/標準偏差(3行目)は、1行目の値を2行目の値で除して算出。

(注3)

- ・今年度(4月～翌3月)に到来する年次決算を同一の期として集計している。
- ・財務指標の集計上は、各指数構成銘柄の指数組入比率を考慮している。
ただし、親会社と子会社が同一指数に含まれる場合は、子会社を計算対象から除く。
- ・各指標の算出は、以下の計算式による。

PER(Price Earnings Ratio 株価収益率) = 時価総額合計 ÷ 税引利益合計

PBR(Price Book-value Ratio 株価純資産倍率) = 時価総額合計 ÷ 自己資本合計

配当利回り = 配当総額合計 ÷ 時価総額合計

ROE(Return On Equity 自己資本利益率) = 税引利益合計 ÷ ((自己資本 + 前期自己資本) ÷ 2)

その他レポート

インデックス構成の詳細

野村日本株高配当70 ルールブック

WMロイター為替レートに関するディスクレイマー

WM/Reuters Closing Spot and Forward Rates are provided by The World Markets Company plc ("WM") in conjunction with Reuters. WM shall not be liable for any errors in or delays in providing or making available the data contained within this service or for any actions taken in reliance on the same, except to the extent that the same is directly caused by its or its employees' negligence.

野村日本株高配当70の知的財産権およびその他一切の権利は野村証券株式会社には帰属します。なお、野村証券株式会社は、当インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、インデックスの利用者およびその関連会社が当インデックスを用いて行う事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

Russell/Nomura 日本株インデックスの知的財産権およびその他一切の権利は野村証券株式会社およびFrank Russell Companyに帰属します。なお、野村証券株式会社およびFrank Russell Companyは、当インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、インデックスの利用者およびその関連会社が当インデックスを用いて行う事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

本資料のいかなる部分についても、野村グループ会社から事前に書面での同意を得ることなく、(i)その形態あるいは方法の如何にかかわらず複製する、あるいは(ii)配布することを禁じます。本資料が、電子メール等によって電子的に配布された場合には、情報の傍受、変造、紛失、破壊、あるいは遅延もしくは不完全な状態での受信、またはウイルスへの感染の可能性があることから、安全あるいは誤りがない旨の保証は致しかねます。従いまして、送信者は電子的に送信したために発生する可能性のある本資料の内容の誤りあるいは欠落に対する責任を負いません。

当社で取り扱う商品等へのご投資には、各商品等に所定の手数料等(国内株式取引の場合は約定代金に対して最大1.43%(税込み)(20万円以下の場合には、2,860円(税込み))の売買手数料、投資信託の場合は銘柄ごとに設定された購入時手数料(換金時手数料)および運用管理費用(信託報酬)等の諸経費、等)をご負担いただく場合があります。また、各商品等には価格の変動等による損失が生じるおそれがあります。商品ごとに手数料等およびリスクは異なりますので、当該商品等の契約締結前交付書面、上場有価証券等書面、目論見書、等をよくお読みください。

野村証券株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長(金商) 第142号

加入協会 / 日本証券業協会、一般社団法人 日本投資顧問業協会、一般社団法人 金融先物取引業協会、一般社団法人 第二種金融商品取引業協会