

「日経平均先物インデックス・シリーズ」等の開発について

日本経済新聞社は、高度化が進む市場参加者の投資戦略の新たな参考指標として「日経平均先物インデックス・シリーズ」を開発します。新しいシリーズは、大阪取引所に上場する日経平均先物の期近物の変動率を繫いだ「日経平均先物インデックス」と、その派生指数である「日経平均先物レバレッジ・インデックス」、「日経平均先物インバース・インデックス」、「日経平均先物ダブルインバース・インデックス」の計4本で構成します。

配当落ちの際などには、現物の指数値と先物の値動きに差が生じることがあります。そのため、日経平均株価に対する連動運用の際に、現物の株式の代わりに日経平均先物を用いている海外の投資家を中心に先物指数を求める声が強まっており、こうした市場ニーズに応えました。本年7月の算出・公表開始を目標に開発します。

また、本日から「日経平均ストラテジー・インデックス・シリーズ」に、「日経平均トータルリターン・インデックス」(日経平均TR)をベースとした派生指数である「日経平均トータルリターン・レバレッジ・インデックス」、「日経平均トータルリターン・インバース・インデックス」、「日経平均トータルリターン・ダブルインバース・インデックス」の3指数を追加します。

日本経済新聞社は多様化する投資戦略にあわせ、2011年6月から「日経平均ストラテジー・インデックス・シリーズ」を算出・公表しています。現在は「日経平均レバレッジ・インデックス」など6指数で構成しますが、今回の新指数追加で同シリーズは9指数となります。

新指数の算出方法などの詳細については、別途作成する「算出要領」をご参照ください。

ニュースタグ：新指数、重要なお知らせ

本件に対する問い合わせ

日本経済新聞社 インデックス事業室 (index@nex.nikkei.co.jp)

§ 「日経平均先物インデックス・シリーズ」の概要

(1) 日経平均先物インデックス

- ・ 大阪取引所に上場する日経平均先物（ラージ取引）の期近物が対象
- ・ 取引最終日の3営業日前に翌限月に切り替え
- ・ 対象とする先物の前日終値からの変動率を前日指数値に乗じて算出
- ・ 平日の日中取引時間中、5秒間隔で算出
- ・ 2001年末を10,000として遡及算出

(2) 同派生指数

- ・ 日経平均先物レバレッジ・インデックスは、日経平均先物インデックスの2倍の変動率
- ・ 日経平均先物インバース・インデックスは、日経平均先物インデックスとは逆の変動率
- ・ 日経平均先物ダブルインバース・インデックスは、日経平均先物インデックスとは2倍の逆（マイナス2倍）の変動率
- ・ いずれも平日の日中取引時間中、5秒間隔で算出
- ・ 日経平均先物レバレッジ・インデックス、日経平均先物インバース・インデックスは、2001年末の値を10,000として遡及算出
- ・ 日経平均先物ダブルインバース指数は、2001年末の値を100,000として遡及算出

§ 「日経平均トータルリターン・インデックス」派生指数の概要

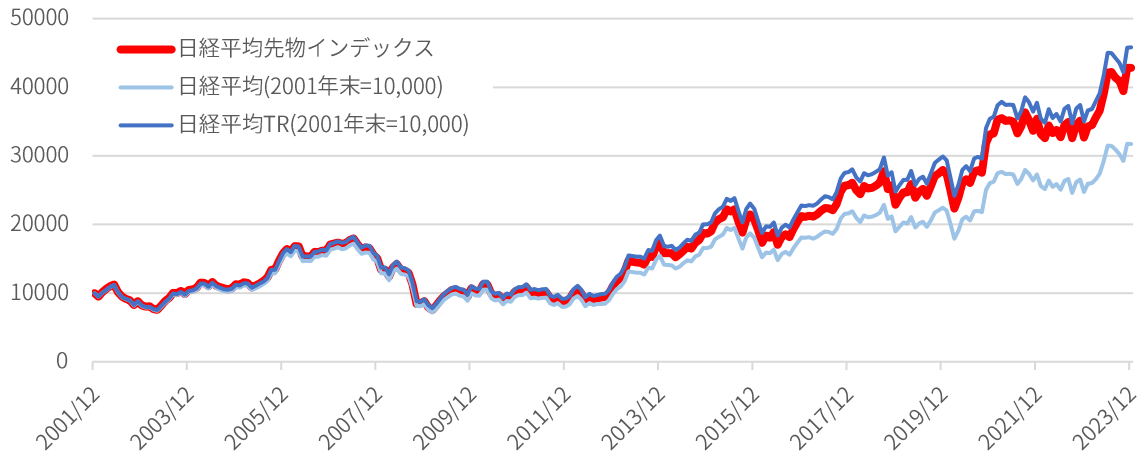
- ・ 日経平均トータルリターン・レバレッジ・インデックスは、日経平均TRの2倍の変動率
- ・ 日経平均トータルリターン・インバース・インデックスは、日経平均TRとは逆の変動率
- ・ 日経平均トータルリターン・ダブルインバース・インデックスは、日経平均TRとは2倍の逆（マイナス2倍）の変動率
- ・ いずれも1日1回終値ベースで算出
- ・ 日経平均トータルリターン・レバレッジ・インデックス、日経平均トータルリターン・インバース・インデックスは、2001年末の値を10,000として遡及算出
- ・ 日経平均トータルリターン・ダブルインバース・インデックスは、2001年末の値を100,000として遡及算出

ニュースタグ：新指数、重要なお知らせ

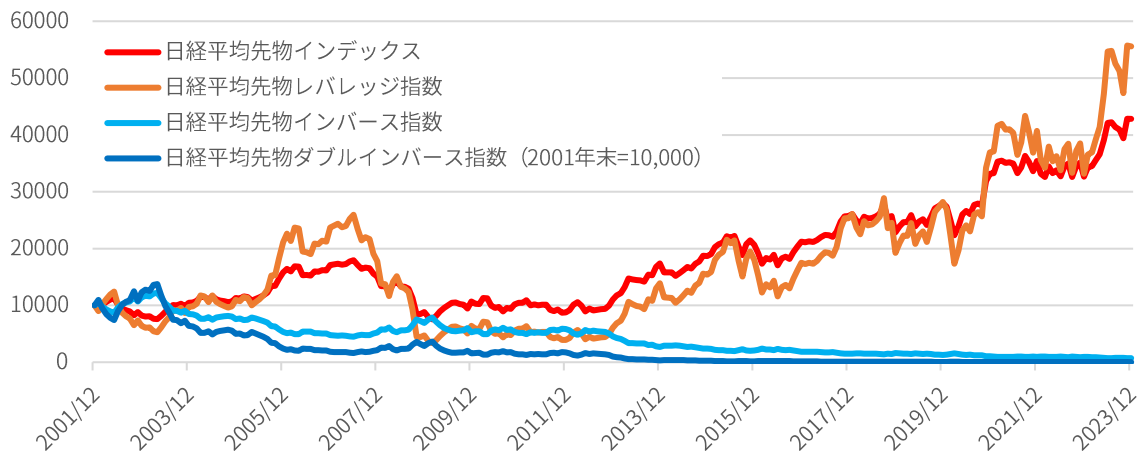
本件に対する問い合わせ

日本経済新聞社 インデックス事業室 (index@nex.nikkei.co.jp)

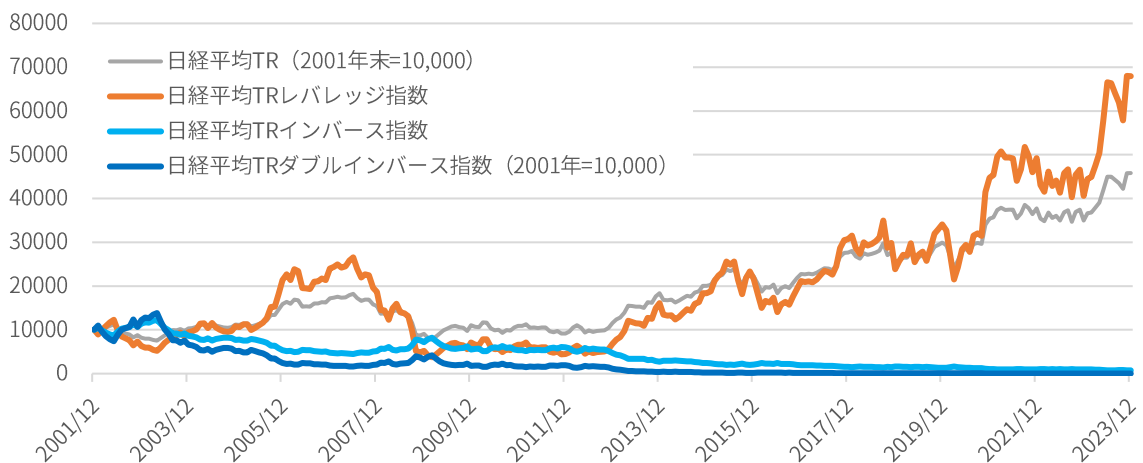
§ 「日経平均先物インデックス」の試算値



§ 「日経平均先物インデックス」派生指数の試算値



§ 「日経平均トータルリターン・インデックス」派生指数の試算値



ニュースタグ：新指数、重要なお知らせ

本件に対する問い合わせ

日本経済新聞社 インデックス事業室 (index@nex.nikkei.co.jp)