

2016年4月15日

関係各位

野村證券株式会社

「野村企業価値分配指数」の公表について

野村證券株式会社(代表執行役社長:永井浩二、以下「当社」)は、「野村企業価値分配指数(英語表記:Nomura Enterprise Value Allocation Index)」の算出を開始します。本指数は、収益性が高く、適切な設備・人材投資などの還元政策に積極的に取り組んでいる日本株銘柄を構成銘柄とする時価総額加重型(3%ウエイト上限付き)指数です。

本指数を構成するのは、積極的な投資活動によって創造された企業価値を株主や従業員に適切に分配することによって、持続的な成長が期待される企業群です。本指数は、そうした企業群の株価動向を反映したパフォーマンスを、パッシブ運用で獲得することを目指しています。

本指数では、国内金融商品取引所に上場する全ての普通株式のうち、利益や配当、設備投資、研究開発費、人件費などを基にした定量的な評価指標の上位銘柄(上限300銘柄)を選定します。銘柄選定には一般に入手可能な実績財務データのみを使用し、客観性・正確性を担保しています。また、連動する金融商品組成時の運用実務に配慮し、時価総額や流動性の観点で売買しやすい銘柄が構成銘柄となるよう設計されています。同時に、個別銘柄のウエイトに上限を課すことで、特定銘柄への過度な集中を回避しています。

本指数の開発は野村證券金融工学研究センター クオন্ツ・リサーチ部が行い、算出は同インデックス業務室が担当しています。指数値および指数構築ルールなどの詳細は当社証券市場インデックスのウェブサイト(<http://qr.nomura.co.jp/jp/neva/index.html>)にて、2016年4月15日16:00より順次公開予定です。

当社は今後も、本指数に連動する金融商品の開発を通じて、投資家のニーズに沿ったサービスの提供に努めていきます。

以上