

2016年5月2日

関係各位

野村証券株式会社

「NOMURA FIG Index」の公表について

野村証券株式会社(代表執行役社長:永井浩二)は、「NOMURA FIG Index」の算出を開始しました。本指数は、日本国内で公募発行された銀行債に関する経過利子込時価総額加重型指数です。

世界的な金融危機を教訓に、銀行に対する自己資本規制強化の一環として、「バーゼルIII」が国際的に合意され、各国で導入が進められています。バーゼルIIIでは、自己資本に算入できる資本性証券に関してより厳格な要件が定義されており、このような資本性証券を発行することによって、資本増強を図る流れが、欧州をはじめとして急速に広がっています。日本においても2014年以降、バーゼルIII適格資本性証券が発行されるようになっていきます。

バーゼルIII適格資本性証券市場の拡大が見込まれるなか、年金基金をはじめとした多くの機関投資家にとって、銀行が発行する公募債券市場がより身近な投資対象となることを念頭に、本指数を公表します。本指数は、銀行が発行する公募シニア債に加え、一定条件を満たすバーゼルIII適格資本性証券を組入対象としています。また、同市場のリスク特性を把握するための一助となるよう、本指数やそのサブインデックスに関するデュレーションや複利利回り、国債との利回りスプレッドなども日々算出します。

本指数は野村証券金融工学研究センター インデックス業務室にて算出します。指数値および指数構築ルールなどの詳細につきましては、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/fig/index.html>)をご覧ください。

当社は今後も、運用手法の分析や各種提言等を通じて、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

<指数に関するお問い合わせ>

野村証券(株)金融工学研究センター インデックス業務室

TEL: 03-6703-3986 E-mail: bpi@jp.nomura.com