

2016年12月5日

関係各位

野村證券株式会社

野村AIビジネス70および野村日本株ベータ・セレクト指数の算出・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、新たな株価指数である野村AIビジネス70および野村日本株ベータ・セレクト指数を算出し、2017年1月を目途に公表する予定です。

野村AIビジネス70は、人工知能(AI)に関連するビジネスについて、マスメディアを通して報道された企業70銘柄を構成銘柄とする、等金額型の指数です。組入対象となる銘柄は、国内金融商品取引所に上場するすべての普通株式から、各種ニュース、雑誌、新聞等の媒体に対する記事検索結果を基にした定量的な評価指標により選定されます。記事検索には「人工知能」と、AIを活用して選んだ複数の関連キーワードを用います。等金額型の指数とすることで、大型のみならず中小型の人工知能関連銘柄に対しても一定比率で投資を行います。投資可能性に配慮し、時価総額が極端に小さい銘柄や流動性の低い銘柄は組み入れません。構成銘柄は年1回見直されます。

野村日本株ベータ・セレクト指数は、野村日本株高ベータ・セレクト30と野村日本株低ベータ・セレクト50という2指数の総称です。それぞれの指数の構成銘柄は、国内金融商品取引所に上場するすべての普通株式の中から、日本株市場リターンおよびドル円為替レートリターンに対する感応度(ベータ)等に基づいた定量的な指標により選定されます。野村日本株高ベータ・セレクト30では市場ベータ、為替ベータ、モメンタムに基づく指標値の高い30銘柄が、野村日本株低ベータ・セレクト50では市場ベータ、為替ベータ、銘柄固有リスクに基づく指標値の低い50銘柄が組入対象となります。浮動株調整済時価総額加重型(5%ウェイト上限付き)の指数で、構成銘柄は年2回見直されます。

これらの指数は野村證券金融工学研究センター クオantz・リサーチ部が開発し、算出は同インデックス業務室が行います。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/index.html>)にて、今後、順次公開する予定です。

当社は今後も、指数の開発を通じて、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