

2017年9月4日

関係各位

野村證券株式会社

「野村高利回りJリート指数」の公表について

野村證券株式会社(代表執行役社長:森田敏夫、以下「当社」)は、「野村高利回りJリート指数(英語表記:Nomura High-yield J-REIT Index)」の算出を開始します。本指数は、予想分配金利回りの高い上場不動産投資信託(Jリート)を構成銘柄とする非時価総額加重型^{※1}の指数です。

本指数は、国内金融商品取引所に上場する全ての不動産投資信託の中から、各投資法人が発表する予想分配金利回りが相対的に高い30~40銘柄を選定し構成されます。銘柄の選定に際しては連動する金融商品組成をしやすくするため、時価総額と流動性を考慮します。また、構成銘柄の組入ウエイトの決定に定量的な指標を用いることで、予想分配金利回りが高い銘柄のウエイトを高める一方、個別銘柄の組入ウエイトを最大5%に制限することにより特定銘柄への過度な集中を回避します。なお、構成銘柄は原則年1回見直されます。

本指数は野村證券金融工学研究センター クオンツ・リサーチ部により開発され、同インデックス業務室が算出します。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/nmjr/index.html>)にて、ご覧になれます。

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。

※1 非時価総額加重型指数では、時価総額以外の基準を用いて組入ウエイトを算出します。

以上