

2017年11月15日

関係各位

野村證券株式会社

## 「野村日本株高配当70マーケットニュートラル指数」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、「野村日本株高配当70マーケットニュートラル指数(英語表記:Nomura Japan Equity High Dividend 70 Market Neutral Index)」の算出を開始します。

本指数は、日本株式市場を対象としたマーケットニュートラル戦略のパフォーマンスを表す指数です。マーケットニュートラル戦略は、株式のロング(買い)とショート(売り)を組み合わせることで株式市場の変動を一定程度相殺させるような運用方法です。本指数では予想配当利回りが高い70銘柄を構成銘柄とする「野村日本株高配当70・配当総額加重型」をロング、市場平均指数としてTOPIX先物をショートすることで、日本株式の相場変動による影響を抑え、安定的な高い配当収入と投資効率を実現できるよう設計されています。

本指数の開発は野村證券金融工学研究センター クオantz・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/nhdivdmn/index.html>)にて、2017年11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