

2019年1月21日

関係各位

野村證券株式会社

## 「野村日本株成長余力インデックス」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、新たな株価指数である「野村日本株成長余力インデックス」(英語表記:Nomura Japan Equity Growth Potential Index、以下「本インデックス」)の算出を開始します。

近年、投資家は企業の資本効率改善や持続的成長に高い関心を示しており、特に機関投資家は議決権行使やエンゲージメント(企業との対話)など、企業価値向上のために積極的な働きかけを行っています。こうした投資家からの働きかけに応じて成長を実現する力(成長余力)のある企業を選定し、効率的に投資することで、将来期待される企業価値向上がもたらすリターンを享受することが、本インデックスの狙いです。

本インデックスにおける「成長余力」とは、成長に向けた取り組みを可能にする「資金余力」と、現在の企業価値を更に高めうる「成長余地」の双方を兼ね備えた概念です。具体的には、東証一部上場銘柄を母集団として、超大型銘柄と金融業種銘柄<sup>※1</sup>を除外した後、投資可能性にも配慮しながら財務指標を元にした5つのファクターを用いて、資金余力がある企業のうち業績面で成長余地のある銘柄を体系的に選定します。各構成銘柄のウエイトは、時価総額加重を基本としつつ、一部の銘柄への過度なウエイト集中の回避や売買インパクト抑制の観点から、ルールに基づいて決定します。構成銘柄は年1回見直します。

本インデックス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/ngrw/index.html>)にて公開しています。

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。

※1 金融業種銘柄は、東証33業種分類の「銀行業」、「証券、商品先物取引業」、「保険業」、「その他金融業」に属する銘柄群です。

以上