

パッシブ運用に適した新たなインデックスを開発 ～ RUSSELL/NOMURA Prime インデックス ～

野村證券株式会社（本社：東京都中央区）およびラッセル・インベストメント・グループ（本部：米国ワシントン州タコマ）はこのたび、日本株パッシブ運用のベンチマークに適した「RUSSELL/NOMURA Prime インデックス」（ラッセル野村プライム・インデックス）を開発いたしました。

1995 年に野村證券金融経済研究所（当時、野村総合研究所）とラッセルは、日本株運用のベンチマークである「RUSSELL/NOMURA 日本株インデックス」を共同で開発しました。日本株における初の浮動株調整を施した先進的なインデックスとして、また初の本格的な投資スタイルインデックスとして、これまでに様々な投資家の皆さまにご利用いただいております。特に、小型株投資やバリュース（割安）株投資、グロース（成長）株投資の際のベンチマークや、あるいは投資スタイル管理の際のベンチマークに広くご利用いただいております。今般新たに開発した「RUSSELL/NOMURA Prime インデックス」は、RUSSELL/NOMURA 日本株インデックスのシリーズの一つとして、インデックス連動を目指すパッシブ運用に適したベンチマーク・インデックスです。将来的には、先物や ETF の上場も視野にいれています。

「RUSSELL/NOMURA Prime インデックス」の特徴は以下の通りです。

1. 浮動株調整時価総額上位 1,000 銘柄から構成されており、高い市場カバレッジを実現しています。
2. 東証一部の上場企業のみ構成銘柄を限定せず、JASDAQ を含む全市場の上場銘柄を対象に、広範な銘柄群から選択しています。
3. 浮動株調整を施すことにより、投資可能性に考慮をしています。
4. 年 1 回実施する構成銘柄の定期入替の際に、「リバランスバンド方式」により時価総額の僅かな変動による頻繁な銘柄の入れ替えを抑制しています。また、「ネガティブリスト方式」により、流動性が著しく低い銘柄の組み入れを抑制しています。
5. 合併や株式移転の際の一時的な上場廃止銘柄について、これを連続的にインデックスに組み入れます。

< 本件に関するお問合せ先 >

【野村證券株式会社】

金融経済研究所 金融工学研究センター
電話 03-3274-0924
idx_mgr@ms.frc.nomura.co.jp

【ラッセル・インベストメント・グループ】

（日本窓口）	（米国窓口）
PR 担当 大畑 真由美	PR 担当 Steve Claiborne
電話 03-5411-3538	電話 US, 253-594-1858
Tokyo-FR@russell.com	newsroom@russell.com