

お客様 各位

2006 年 6 月 29 日

Russell/Nomura 日本株インデックス米ドルベース指数値の提供開始について

日頃より、Russell/Nomura 日本株インデックスをご利用頂き誠にありがとうございます。
ラッセル・インベストメント・グループと野村證券金融経済研究所は、Russell/Nomura 日本株インデックスにおいて米ドルベースに換算した指数値を算出し公表していきことにしました。海外ユーザが日本株への投資を検討する際の参考情報として容易に利用出来るように利便性向上を目的としております。下に米ドルベースの指数値の算出方法を記します。なお、米ドルベース指数値の提供開始は7月を予定しております。

● 米ドルベース指数値の定義

(1) 計算方法

米ドルベース指数値は日本円ベースの指数値と為替レートから次の式によって算出します。配当を含む指数値と除いた指数値の両方をそれぞれ計算します。

$$\text{ドルベース指数値} = \frac{\text{円ベース株価指数} \times \text{各インデックスの基準日の為替レート}}{\text{為替レート}}$$

(各インデックスの基準日はルールブックをご参照下さい。)

(2) 為替レート

日本銀行が公表する外国為替相場(円/米ドル 17時現在)の仲値を使用します。

ご質問、ご要望等ございましたら下記までご連絡を頂ければ幸いです。インデックスの改善等の参考にさせて頂きたいと考えております。これからも Russell/Nomura 日本株インデックスをご利用頂けますよう、よろしくお願いいたします。

(ご連絡先)

野村證券 金融経済研究所 金融工学研究センター
インデックス・プロダクツ・グループ
idx_mgr@frc.nomura.co.jp
03-3274-0924