

2006 年 11 月 15 日(木)

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

Russell/Nomura 日本株インデックスの定期入替えのお知らせ

Russell/Nomura 日本株インデックスの定期銘柄入替えを 2006 年 12 月 1 日に実施します。

入替後の個別銘柄情報は次の URL で参照できます。

<http://qr.nomura.co.jp/jp/frcnri/docs/eq200612j.txt>

定期入替えのサマリーは以下の通りです。

【リバランス・サマリー】

	採用銘柄数					時価構成比率			回転率 (片側)
	入替前	入替後	差	OUT	IN	入替前	入替後	差	
Total	1,771	1,700	-71	181	110	100.0%	100.0%	-	2.5%
Value	1,205	1,241	36	157	193	48.6%	50.0%	1.4%	18.5%
Growth	899	766	-133	267	134	51.4%	50.0%	-1.4%	17.6%
Large	397	350	-47	55	8	86.7%	84.9%	-1.9%	3.1%
Value	253	237	-16	51	35	40.3%	40.2%	-0.2%	20.3%
Growth	251	214	-37	58	21	46.4%	44.7%	-1.7%	17.7%
Top	70	60	-10	12	2	53.4%	49.9%	-3.5%	7.1%
Value	45	38	-7	12	5	23.2%	20.7%	-2.5%	27.3%
Growth	48	44	-4	9	5	30.3%	29.2%	-1.1%	18.9%
Mid	327	290	-37	57	20	33.3%	35.0%	1.7%	13.1%
Value	208	199	-9	48	39	17.1%	19.4%	2.3%	28.2%
Growth	203	170	-33	56	23	16.1%	15.5%	-0.6%	25.8%
Mid-Small	1,701	1,640	-61	183	122	46.6%	50.1%	3.5%	9.7%
Value	1,160	1,203	43	154	197	25.4%	29.3%	3.9%	22.8%
Growth	851	722	-129	265	136	21.2%	20.8%	-0.3%	23.3%
Small	1,374	1,350	-24	188	164	13.3%	15.1%	1.9%	16.5%
Value	952	1,004	52	143	195	8.3%	9.8%	1.6%	24.7%
Growth	648	552	-96	234	138	5.0%	5.3%	0.3%	29.7%
Small Core	490	450	-40	126	86	9.1%	10.1%	1.0%	23.5%
Value	341	321	-20	100	80	5.5%	6.3%	0.7%	30.8%
Growth	254	223	-31	97	66	3.5%	3.8%	0.3%	35.2%
Micro	884	900	16	200	216	4.2%	5.0%	0.9%	28.0%
Value	611	683	72	131	203	2.7%	3.6%	0.8%	34.4%
Growth	394	329	-65	177	112	1.5%	1.5%	0.0%	38.4%
Prime	985	1,000	15	44	59	96.6%	96.8%	0.2%	2.5%
Value	670	716	46	58	104	46.4%	47.7%	1.3%	18.7%
Growth	540	503	-37	122	85	50.2%	49.0%	-1.1%	17.6%

(注)時価構成比率の計算は 2006 年 10 月末の株価による。

【業種別銘柄数と構成比】

	Total Market						Prime					
	構成銘柄数			構成比			構成銘柄数			構成比		
	入替前	入替後	差	入替前	入替後	差	入替前	入替後	差	入替前	入替後	差
水産・農林業	6	6	0	0.1%	0.1%	0.0%	5	4	-1	0.1%	0.1%	0.0%
鉱業	6	5	-1	0.2%	0.4%	0.2%	2	3	1	0.2%	0.4%	0.2%
建設業	90	74	-16	2.1%	2.0%	-0.1%	41	38	-3	2.0%	1.9%	-0.1%
食料品	77	72	-5	2.5%	2.5%	0.0%	44	43	-1	2.5%	2.4%	-0.1%
繊維製品	42	33	-9	1.1%	1.1%	0.0%	21	22	1	1.1%	1.1%	0.0%
パルプ・紙	14	12	-2	0.4%	0.3%	-0.1%	6	6	0	0.3%	0.3%	0.0%
化学	118	113	-5	5.4%	5.3%	-0.1%	64	66	2	5.3%	5.3%	0.0%
医薬品	40	38	-2	4.7%	4.6%	-0.1%	28	28	0	4.8%	4.7%	-0.1%
石油・石炭製品	10	7	-3	0.7%	0.7%	0.0%	6	6	0	0.7%	0.8%	0.1%
ゴム製品	11	10	-1	0.6%	0.6%	0.0%	9	9	0	0.6%	0.6%	0.0%
ガラス・土石製品	24	27	3	1.1%	1.1%	0.0%	16	19	3	1.1%	1.1%	0.0%
鉄鋼	33	30	-3	2.5%	2.5%	0.0%	20	21	1	2.6%	2.6%	0.0%
非鉄金属	25	26	1	1.4%	1.4%	0.0%	18	20	2	1.4%	1.4%	0.0%
金属製品	35	28	-7	0.7%	0.6%	-0.1%	12	14	2	0.6%	0.6%	0.0%
機械	119	118	-1	4.0%	4.0%	0.0%	68	66	-2	3.9%	3.9%	0.0%
電気機器	176	173	-3	14.9%	14.8%	-0.1%	105	102	-3	15.1%	14.9%	-0.2%
輸送用機器	62	61	-1	9.2%	9.3%	0.1%	44	44	0	9.5%	9.5%	0.0%
精密機器	25	25	0	1.4%	1.4%	0.0%	15	17	2	1.4%	1.4%	0.0%
その他製品	42	42	0	1.8%	1.8%	0.0%	23	25	2	1.7%	1.8%	0.1%
電気・ガス業	20	18	-2	4.2%	4.1%	-0.1%	16	16	0	4.3%	4.2%	-0.1%
陸運業	37	36	-1	3.4%	3.3%	-0.1%	24	23	-1	3.5%	3.3%	-0.2%
海運業	6	6	0	0.5%	0.5%	0.0%	5	5	0	0.5%	0.5%	0.0%
空運業	3	2	-1	0.3%	0.3%	0.0%	2	2	0	0.3%	0.3%	0.0%
倉庫・運輸関連業	18	15	-3	0.2%	0.2%	0.0%	5	6	1	0.2%	0.2%	0.0%
情報・通信業	123	116	-7	5.7%	5.6%	-0.1%	57	59	2	5.7%	5.6%	-0.1%
卸売業	133	128	-5	3.7%	3.7%	0.0%	52	51	-1	3.5%	3.5%	0.0%
小売業	139	141	2	3.7%	3.9%	0.2%	72	72	0	3.6%	3.7%	0.1%
銀行業	93	94	1	11.7%	12.1%	0.4%	74	77	3	12.0%	12.4%	0.4%
証券・商品先物取引業	22	24	2	2.3%	2.3%	0.0%	18	19	1	2.4%	2.4%	0.0%
保険業	9	8	-1	2.6%	2.5%	-0.1%	8	8	0	2.6%	2.6%	0.0%
その他金融業	45	43	-2	2.1%	2.1%	0.0%	32	30	-2	2.1%	2.1%	0.0%
不動産業	68	79	11	3.1%	3.1%	0.0%	34	39	5	3.0%	3.0%	0.0%
サービス業	100	90	-10	1.6%	1.7%	0.1%	39	40	1	1.4%	1.5%	0.1%
合計	1771	1700	-71	100.0%	100.0%	—	985	1000	15	100.0%	100.0%	—

	Total Market Value						Total Market Growth					
	構成銘柄数			構成比			構成銘柄数			構成比		
	入替前	入替後	差	入替前	入替後	差	入替前	入替後	差	入替前	入替後	差
水産・農林業	3	6	3	0.1%	0.2%	0.1%	4	2	-2	0.1%	0.0%	-0.1%
鉱業	4	3	-1	0.2%	0.1%	-0.1%	3	2	-1	0.2%	0.8%	0.6%
建設業	74	62	-12	2.7%	2.7%	0.0%	24	19	-5	1.5%	1.3%	-0.2%
食料品	65	64	-1	3.2%	3.2%	0.0%	23	15	-8	1.9%	1.8%	-0.1%
繊維製品	36	29	-7	1.5%	1.6%	0.1%	17	11	-6	0.8%	0.5%	-0.3%
パルプ・紙	14	12	-2	0.7%	0.7%	0.0%	2	1	-1	0.0%	0.0%	0.0%
化学	91	89	-2	5.2%	5.3%	0.1%	53	46	-7	5.5%	5.4%	-0.1%
医薬品	26	28	2	3.8%	2.2%	-1.6%	23	19	-4	5.6%	7.0%	1.4%
石油・石炭製品	8	6	-2	1.1%	1.3%	0.2%	7	1	-6	0.4%	0.2%	-0.2%
ゴム製品	10	10	0	0.8%	1.1%	0.3%	3	1	-2	0.3%	0.0%	-0.3%
ガラス・土石製品	20	22	2	1.4%	1.5%	0.1%	11	14	3	0.7%	0.7%	0.0%
鉄鋼	28	27	-1	1.0%	2.8%	1.8%	12	9	-3	3.9%	2.2%	-1.7%
非鉄金属	16	17	1	1.6%	1.4%	-0.2%	16	16	0	1.2%	1.4%	0.2%
金属製品	31	22	-9	1.0%	0.9%	-0.1%	7	7	0	0.4%	0.4%	0.0%
機械	81	88	7	3.2%	3.4%	0.2%	68	58	-10	4.7%	4.6%	-0.1%
電気機器	119	125	6	16.1%	14.8%	-1.3%	99	87	-12	13.8%	14.8%	1.0%
輸送用機器	50	51	1	10.4%	7.5%	-2.9%	35	30	-5	8.1%	11.1%	3.0%
精密機器	13	14	1	0.3%	0.4%	0.1%	16	16	0	2.4%	2.4%	0.0%
その他製品	36	34	-2	2.8%	1.9%	-0.9%	12	13	1	0.8%	1.7%	0.9%
電気・ガス業	19	18	-1	8.4%	7.7%	-0.7%	3	2	-1	0.2%	0.5%	0.3%
陸運業	22	22	0	1.9%	1.7%	-0.2%	23	21	-2	4.8%	4.8%	0.0%
海運業	2	5	3	0.4%	0.6%	0.2%	6	5	-1	0.6%	0.4%	-0.2%
空運業	1	—	-1	0.3%	—	-0.3%	2	2	0	0.4%	0.6%	0.2%
倉庫・運輸関連業	16	14	-2	0.5%	0.4%	-0.1%	5	3	-2	0.0%	0.0%	0.0%
情報・通信業	51	52	1	4.6%	5.4%	0.8%	93	82	-11	6.8%	5.8%	-1.0%
卸売業	102	111	9	4.6%	6.4%	1.8%	57	31	-26	2.8%	1.0%	-1.8%
小売業	78	94	16	1.9%	3.4%	1.5%	86	81	-5	5.5%	4.4%	-1.1%
銀行業	86	90	4	9.4%	10.9%	1.5%	20	13	-7	13.9%	13.2%	-0.7%
証券・商品先物取引業	14	18	4	3.6%	3.0%	-0.6%	12	12	0	1.1%	1.7%	0.6%
保険業	7	8	1	4.3%	4.4%	0.1%	2	1	-1	0.9%	0.6%	-0.3%
その他金融業	29	33	4	1.3%	1.9%	0.6%	24	17	-7	2.9%	2.4%	-0.5%
不動産業	23	32	9	0.7%	0.5%	-0.2%	51	60	9	5.3%	5.7%	0.4%
サービス業	30	35	5	0.8%	0.9%	0.1%	80	69	-11	2.4%	2.4%	0.0%
合計	1205	1241	36	100.0%	100.0%	—	899	766	-133	99.9%	99.8%	—

(注)構成比の計算は2006年10月末の株価による。

【業種別銘柄数と構成比】《続き》

	Large Cap						Small Cap					
	構成銘柄数			構成比			構成銘柄数			構成比		
	入替前	入替後	差	入替前	入替後	差	入替前	入替後	差	入替前	入替後	差
水産・農林業	—	—	—	—	—	—	6	6	0	0.7%	0.6%	-0.1%
鉱業	1	1	0	0.2%	0.4%	0.2%	5	4	-1	0.5%	0.4%	-0.1%
建設業	15	11	-4	1.8%	1.7%	-0.1%	75	63	-12	3.9%	4.1%	0.2%
食料品	14	12	-2	2.2%	2.1%	-0.1%	63	60	-3	5.0%	4.8%	-0.2%
繊維製品	8	7	-1	1.0%	0.9%	-0.1%	34	26	-8	2.1%	1.9%	-0.2%
パルプ・紙	2	2	0	0.3%	0.3%	0.0%	12	10	-2	0.9%	0.8%	-0.1%
化学	30	27	-3	5.2%	5.1%	-0.1%	88	86	-2	6.3%	6.3%	0.0%
医薬品	15	13	-2	5.2%	5.0%	-0.2%	25	25	0	1.8%	2.1%	0.3%
石油・石炭製品	5	5	0	0.8%	0.9%	0.1%	5	2	-3	0.2%	0.2%	0.0%
ゴム製品	3	2	-1	0.6%	0.6%	0.0%	8	8	0	0.6%	0.8%	0.2%
ガラス・土石製品	8	7	-1	1.0%	1.0%	0.0%	16	20	4	1.3%	1.6%	0.3%
鉄鋼	9	8	-1	2.6%	2.6%	0.0%	24	22	-2	1.9%	1.9%	0.0%
非鉄金属	8	9	1	1.3%	1.4%	0.1%	17	17	0	2.1%	1.5%	-0.6%
金属製品	4	4	0	0.5%	0.5%	0.0%	31	24	-7	1.8%	1.5%	-0.3%
機械	19	20	1	3.2%	3.4%	0.2%	100	98	-2	8.8%	7.4%	-1.4%
電気機器	47	44	-3	15.7%	15.8%	0.1%	129	129	0	10.1%	9.1%	-1.0%
輸送用機器	20	18	-2	10.1%	10.2%	0.1%	42	43	1	3.9%	4.0%	0.1%
精密機器	6	6	0	1.4%	1.4%	0.0%	19	19	0	1.6%	1.4%	-0.2%
その他製品	8	6	-2	1.7%	1.6%	-0.1%	34	36	2	2.5%	2.7%	0.2%
電気・ガス業	13	13	0	4.7%	4.8%	0.1%	7	5	-2	0.4%	0.3%	-0.1%
陸運業	17	17	0	3.7%	3.6%	-0.1%	20	19	-1	1.5%	1.3%	-0.2%
海運業	3	3	0	0.6%	0.6%	0.0%	3	3	0	0.3%	0.2%	-0.1%
空運業	2	2	0	0.3%	0.4%	0.1%	1	—	—	0.0%	—	0.0%
倉庫・運輸関連業	2	2	0	0.1%	0.1%	0.0%	16	13	-3	0.9%	0.8%	-0.1%
情報・通信業	22	19	-3	5.7%	5.5%	-0.2%	101	97	-4	5.7%	6.0%	0.3%
卸売業	11	11	0	3.2%	3.3%	0.1%	122	117	-5	6.7%	6.0%	-0.7%
小売業	21	16	-5	3.1%	3.0%	-0.1%	118	125	7	7.7%	8.7%	1.0%
銀行業	38	29	-9	12.7%	12.9%	0.2%	55	65	10	5.6%	7.3%	1.7%
証券・商品先物取引業	8	6	-2	2.4%	2.4%	0.0%	14	18	4	1.6%	2.0%	0.4%
保険業	7	6	-1	2.9%	2.9%	0.0%	2	2	0	0.2%	0.5%	0.3%
その他金融業	14	8	-6	2.0%	1.8%	-0.2%	31	35	4	2.6%	3.6%	1.0%
不動産業	9	8	-1	2.8%	2.7%	-0.1%	59	71	12	5.1%	5.1%	0.0%
サービス業	8	8	0	1.0%	1.1%	0.1%	92	82	-10	5.4%	5.2%	-0.2%
合計	397	350	-47	100.0%	100.0%	—	1374	1350	-24	100.0%	100.0%	—

(注) 構成比の計算は 2006 年 10 月末の株価による。