



Press Release

発信日： 2006年5月25日

ラッセル・野村

国内小型株の指数対象銘柄群を更に細分化したインデックスの発表を開始

「Russell/Nomura Small Cap Core インデックス」

および「Russell/Nomura Micro Cap インデックス」

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）および野村証券株式会社（本社：東京都中央区）は、投資家の小型株投資への関心の高まりを受け、兼ねてより試験的に算出してきた標記2つのインデックスを正式に発表していくことといたしました。野村証券株式会社が発行する月次レポートにその指数値掲載を開始し、6月を目処に野村証券株式会社のWEB上で日次の指数値を発表していく予定です。

1995年にラッセルと野村証券金融経済研究所（当時、野村総合研究所）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指数として、また初の投資スタイル・インデックスとして、これまで様々な投資家の皆さまにご利用いただいております。今般新たに発表を開始するのは、Russell/Nomura 日本株インデックスのシリーズのうちの「Russell/Nomura Small Cap インデックス」を更に細分化した「Russell/Nomura Small Cap Core インデックス」および「Russell/Nomura Micro Cap インデックス」です。

「Russell/Nomura Small Cap Core インデックス」および「Russell/Nomura Micro Cap インデックス」の特徴は、以下の通りです。

1. Russell/Nomura Small Cap Core インデックスは、Russell/Nomura Small Cap インデックス（Total Market インデックスの浮動株調整時価総額下位15%で構成）の上位3分の2の銘柄（2006年3月末現在で497銘柄）、Russell/Nomura Micro Cap インデックスは下位3分の1の銘柄（2006年3月末現在で892銘柄）で構成されています。
2. 東証一部の上場企業のみならず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、取引可能性に考慮をしています。
4. グロースおよびバリューのスタイル・インデックスを有しています。
5. 構成銘柄の定期入替を年1回実施します。
6. 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。

Russell/Nomura 日本株インデックスについて

「Russell/Nomura 日本株インデックス」は、1995年にラッセル・インベストメント・グループと野村証券金融経済研究所（当時、野村総合研究所）によって開発された株式市場インデックスです。東証2部、大証、名証、東証マザーズ、大証ヘラクレス、JASDAQなどの全上場銘柄を広く網羅しており、浮動株修正時価総額で約98%を代表する「Russell/Nomura Total Market インデックス」を中心に、大型/小型といった規模別や、グロース/バリューの投資スタイル別に26種類のサブインデックスが含まれます。インデックスの構成銘柄は、各銘柄の浮動株修正時価総額による公平かつ完全なランキングに基づいて決定されており、年一回12月第一営業日に構成銘柄の定期入れ替えが実施されます。

野村証券株式会社

野村証券株式会社は、持株会社である野村ホールディングス株式会社と、その傘下にある国内外の子会社で構成される「金融サービスグループ」（野村グループ）の中核会社として、証券業務を行っております。野村証券に関するより詳細な情報は <http://www.nomura.co.jp/> をご覧ください。なお、野村グループに関するIR情報とニュースリリースは、野村ホールディングスのサイト <http://www.nomura.com/jp/> にて掲載しております。

ラッセル・インベストメント・グループについて

ラッセル・インベストメント・グループは、「マルチ・マネージャー運用のグローバル・リーダー」として今日世界44カ国で総合的な資産運用管理サービスを提供しています。ラッセルが提供するサービスは、グローバルな運用会社調査をベースに、資産運用コンサルティング、資産運用サービス、売買執行管理サービス、オルタナティブ投資サービス、Russell 1000[®]、Russell 2000[®]、Russell 3000[®]、Russell/Nomura 日本株インデックス等のインデックスの開発など多岐にわたります。ラッセル・インベストメント・グループの創立は1936年。現在当グループが提供する資産運用コンサルティング・サービスの対象資産総額は270兆円^{*}、またマルチ・マネージャー運用の資産総額は約19兆円^{**}となっています。なお、1999年よりノースウェスタン・ミューチュアルが当グループの親会社となっています。詳しくは、www.russell.com をご覧ください。

(※ 2005年9月末現在 ※※ 2006年3月末現在、グループ合算)

お問い合わせ先：

NOMURA

野村証券株式会社
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
Tel:03-3274-0924 E-mail: idx_mgr@frc.nomura.co.jp

 Russell

ラッセル・インベストメント・グループ
(米国)
PR 担当 Steve Claiborne
Tel: US, 253-439-1858 E-mail: newsroom@russell.com
(日本における窓口)
Tel:03-5411-3538 E-mail: Tokyo-RIJ@russell.com