

2005年8月26日

関係各位

野村證券株式会社

NOMURA日本株地域別インデックス構築について

野村證券株式会社は、当社金融経済研究所金融工学研究センターが、「NOMURA日本株地域別インデックス」を開発・構築いたしましたので、ご連絡申し上げます。

NOMURA日本株地域別インデックスは、日本全国の任意の地域の経済動静を反映する株価指数として開発されたものです。地元企業の応援を通じて、地域経済の発展につながるような投資商品のベンチマーク・インデックスとして利用されることを目指します。

同インデックスは、全上場銘柄を対象とし、各企業が活動を行っている地域を基準に各都道府県に株式時価総額を配分することによって作成されますが、日本全国の任意の都道府県を複数組み合わせることで「地域」を指定することが出来る、いわゆるカスタマイズド・インデックスです。これにより、任意の地域をテーマとした投資運用商品の組成に合わせたインデックス構築が可能となります。なお、指数構築に当たっては、投資商品の運用における実現性を考え、流動性スクリーニングを行います。

指数構成にあたっては、各地域における住民、企業の従業員、取引先企業、地元経済界、地方自治体など企業を取り巻くステークホルダー(利害関係者)との関係を考慮し、地元との関わりが深い企業をインデックス構成銘柄として採用します。具体的には、企業と地元経済の発展の歴史的経緯などの理由から、「企業の本店所在地」を重要な構成銘柄の採用基準として考え、また、特に大規模企業については、工場や研究所施設などの立地、販売や営業支援の拠点等の存在をも採用基準として重視します。採用銘柄の見直しは原則年一回(通常は3月末)です。

今後、いわゆる「地域ファンド」などの投資運用商品の商品企画、ベンチマーク・インデックスとしての利用など、NOMURA日本株地域別インデックスをご活用いただく機会を模索していく所存です。

以上