

本指数は、国内金融商品取引所に上場する全ての不動産投資信託の中から、各投資法人が発表する予想分配金利回りが相対的に高い銘柄を構成銘柄とする非時価総額加重型の指数です。銘柄の選定に際して、連動する金融商品組成時の運用実務にも配慮し、時価総額と流動性を考慮します。また、構成銘柄の組入ウエイトの決定に定量的な指標を用いることで、予想分配金利回りが高い銘柄のウエイトを高める一方、個別銘柄の組入ウエイトを最大5%に制限することにより特定銘柄への過度な集中を回避しています。

時点 2018年12月末

円建てインデックス

銘柄数 39
 定期入替 毎年9月
 基準日 2007年8月31日
 (基準時点の指数値) (=10000)
 加重方法 非時価総額加重型

代表的なETF

Bloomberg 1660 JT Equity
 上場市場 東証
 通貨 円建て
 設定日 2017年10月10日
 運用会社 三菱UFJ国際投信

インデックスに関するお問い合わせ先

野村証券株式会社 金融工学研究センター

インデックス業務室

電話 : 03-6703-3986

e-mail : idx_mgr@jp.nomura.com

野村高利回りリート指数
 提供メディア

野村高利回りリート指数は
 以下の媒体で公表されています。

INTERNET <http://qr.nomura.co.jp/jp/nmjri/index.html>

日次の指数値は以下の媒体で
 公開されています。

Bloomberg 円ベース配当除く指数
 NMRCJOJR

円ベース配当含む指数
 NMRCJIR

QUICK 円ベース配当除く指数
 SNJPJR/NRIJ

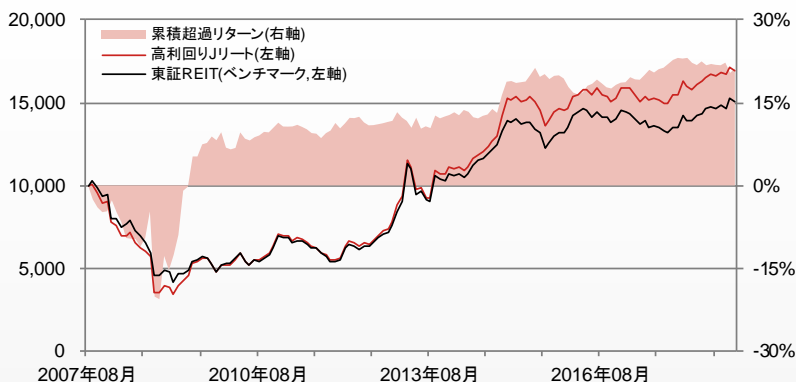
円ベース配当含む指数
 SNJPJR#TR/NRIJ

REUTERS 円ベース配当除く指数
 .NHJYR

円ベース配当含む指数
 .NHJYRTR

インデックス・パフォーマンス

(2007年8月末を10,000とする。円ベース、配当込み指数)



	1カ月	3カ月	年度ベース	1年	2年	5年	07年09月~
高利回りリート	-1.1%	0.3%	7.2%	8.9%	3.3%	8.9%	7.3%
東証REIT	-1.8%	0.9%	8.2%	10.9%	2.0%	7.2%	5.5%
超過リターン	0.8%	-0.5%	-1.0%	-1.9%	1.3%	1.7%	1.9%
IR	-	-	-	-0.76	0.55	0.55	0.26

・1年未満は期間内のリターン、1年以上の期間は月次リターンを元に年率換算

・超過リターン(3行目) = 当該指数リターン - ベンチマーク指数リターン

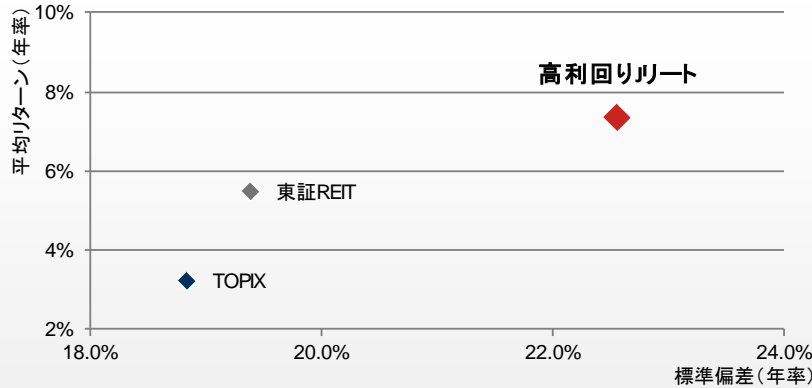
・IR(Information Ratio 情報比)

= 期間中の月次超過リターンの平均値(年率) ÷ 月次超過リターンの標準偏差(年率)

ウエイト上位10銘柄

コード	社名	ウエイト
8953	日本リテールファンド投資法人	5.42%
3283	日本プロロジスリート投資法人	5.17%
8960	ユナイテッド・アーバン投資法人	4.94%
8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人	4.74%
3281	GLP投資法人	4.72%
8963	インヴィンシブル投資法人	4.61%
3462	野村不動産マスターファンド投資法人	4.59%
3292	イオンリート投資法人	4.21%
3309	積水ハウス・リート投資法人	3.36%
8964	フロンティア不動産投資法人	3.26%

リスク・リターン



- ・期間は2007年9月～現在
- ・円ベース、配当込み指数を使用、月次リターンを元に年率換算

予想分配金利回り

予想分配金利回り(%)

高利回りリート

4.64

- ・予想分配金利回りを指数構成銘柄ウエイトで加重平均して算出
- ・月末時点に入手可能な最新の会社予想1株当たり配当金(DPS)を用いて計算(予想DPSは年率換算)
- ・当月を含む将来12ヵ月間において、最も近い本決算期の会社予想DPSを「今期DPS」、最も遠い本決算の会社予想DPSを「来期DPS」として、次の優先順位で採用。
 $(来期DPS + 今期DPS) \div 2 > 今期DPS > 前期DPS$

その他レポート

インデックス構成の詳細

野村高利回りリート指数 指数構成ルールブック

野村高利回りリート指数は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権およびその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、対象指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、指数の利用者およびその関連会社が当指数を用いて行う事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

本資料のいかなる部分についても、野村グループ会社から事前に書面で同意を得ることなく、(i)その形態あるいは方法の如何にかかわらず複製する、あるいは(ii)配布することを禁じます。本資料が、電子メール等によって電子的に配布された場合には、情報の傍受、変造、紛失、破壊、あるいは遅延もしくは不完全な状態での受信、またはウイルスへの感染の可能性があることから、安全あるいは誤りがない旨の保証は致しかねます。従いまして、送信者は電子的に送信したために発生する可能性のある本資料の内容の誤りあるいは欠落に対する責任を負いません。

当社で取り扱う商品等へのご投資には、各商品等に所定の手数料等(国内株式取引の場合は約定代金に対して最大1.404%(税込み)(20万円以下の場合)、2,808円(税込み))の売買手数料、投資信託の場合は銘柄ごとに設定された購入時手数料(換金時手数料)および運用管理費用(信託報酬)等の諸経費、等)をご負担いただく場合があります。また、各商品等には価格の変動等による損失が生じるおそれがあります。商品ごとに手数料等およびリスクは異なりますので、当該商品等の契約締結前交付書面、上場有価証券等書面、目論見書、等をよくお読みください。

野村証券株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長(金商) 第142号

加入協会/日本証券業協会、一般社団法人 日本投資顧問業協会、一般社団法人 金融先物取引業協会、一般社団法人 第二種金融商品取引業協会