

野村株主還元70は、国内金融商品取引所に上場する普通株式(ただし、東証33業種分類の「銀行業」、「証券、商品先物取引業」、「保険業」、「その他金融業」に属する銘柄は除外する)の中から、配当及び自社株買い等を基にした定量的な指標によって積極的に株主還元を行っている70銘柄を選定して構成銘柄とする株価指数である。個別銘柄の組入ウエイトは浮動株調整時価総額に比例する(ウエイト上限は2%)。

時点 2019年8月末

円建てインデックス

銘柄数 70
 定期入替 毎年2月
 基準日 2008年1月31日
 (基準時点の指数値) (=10000)
 加重方法 時価総額加重型
 (2%ウエイト上限付き)

ETF

Bloomberg 2529 JT Equity
 上場市場 東証
 通貨 JPY
 設定日 2019年4月18日
 運用会社 野村アセット
 マネジメント

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

野村株主還元70
 提供メディア

野村株主還元70は以下の媒体で公表されています。

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

日次の指数値は以下の媒体で公開されています。

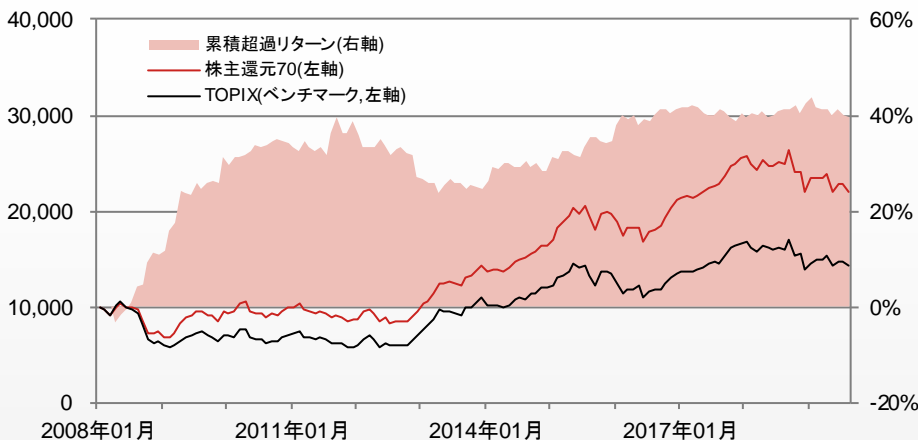
Bloomberg NMRI
 配当除く指数 NMRIJOSY <INDEX>
 配当含む指数 NMRIJISY <INDEX>

QUICK 配当除く指数 SNJPSY/NRIJ
 配当含む指数 SNJPSY#TR/NRIJ

REUTERS 配当除く指数 .NSY70
 配当含む指数 .NSY70TR

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

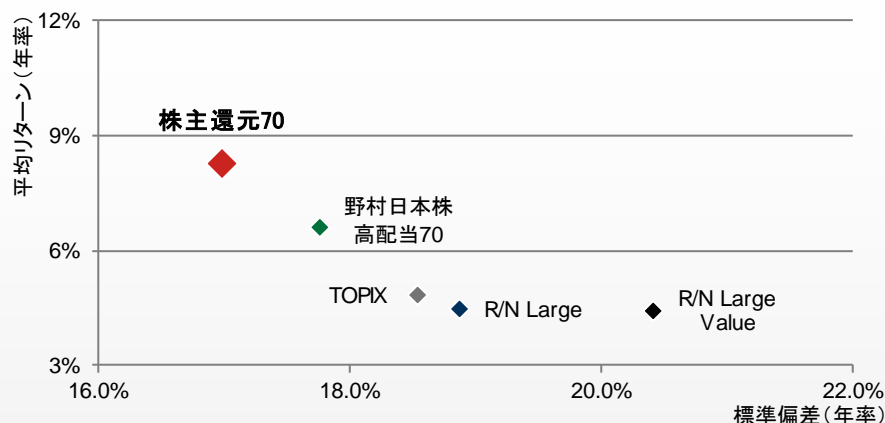
インデックス・パフォーマンス



((上)指数値は2008年1月末を10,000とする。円ベース、配当込み指数を使用。(下)注1参照。)

	1カ月	3カ月	年度ベース	1年	2年	5年	08年02月~
株主還元70	-3.8%	-0.3%	-6.5%	-11.3%	-0.8%	8.5%	8.3%
TOPIX	-3.4%	0.2%	-4.8%	-9.7%	-0.1%	6.7%	4.8%
超過リターン	-0.5%	-0.5%	-1.7%	-1.6%	-0.7%	1.8%	3.4%
IR	-	-	-	-0.38	-0.21	0.46	0.60

リスク・リターン



(期間は2008年2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 注2参照)

	株主還元70	TOPIX	R/N Large	R/N Large Value	野村日本株高配当70
平均リターン	8.27%	4.84%	4.46%	4.43%	6.60%
標準偏差	16.99%	18.54%	18.87%	20.41%	17.76%
リターン／標準偏差	0.49	0.26	0.24	0.22	0.37

時点

2019年8月末

バリュエーション

(今期予想ベース、連結優先 注3参照)

	PER(倍)	PBR(倍)	配当利回り(%)	ROE(%)
株主還元70	12.21	1.01	3.58	8.41
R/N Total	13.19	1.10	2.59	8.52
R/N Large	13.08	1.15	2.56	8.92
R/N Large Value	9.89	0.77	3.35	7.85
野村日本株 高配当70	8.99	0.74	4.26	8.38

(注1)

- ・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(円ベース、配当込み指数)。
- ・年率換算リターン(当該指数、ベンチマーク指数)は、期間中の月次リターンの平均値を12倍して算出。
- ・超過リターン(3行目)は、各期について計算した当該指数リターン(1行目)から同様に計算したベンチマーク指数リターン(2行目)をマイナスして算出。
- ・IR(Information Ratio 情報比)は、期間中の当該指数の対ベンチマーク指数月次超過リターンの平均値の12倍を、月次超過リターンの標準偏差に12の正の平方根を乗じた数値で除して算出。

(注2)

- ・平均リターン(1行目)は、期間中の月次リターンの平均値を12倍して算出。
- ・標準偏差(2行目)は、期間中の月次リターンの標本標準偏差に12の正の平方根を乗じて算出。
- ・リターン/標準偏差(3行目)は、1行目の値を2行目の値で除して算出。

(注3)

- ・今年度(4月～翌3月)に到来する年次決算を同一の期として集計している。
- ・財務指標の集計上は、各指数構成銘柄の指数組入比率を考慮している。
ただし、親会社と子会社が同一指数に含まれる場合は、子会社を計算対象から除く。
- ・各指標の算出は、以下の計算式による。

PER(Price Earnings Ratio 株価収益率) = 時価総額合計 ÷ 税引利益合計

PBR(Price Book-value Ratio 株価純資産倍率) = 時価総額合計 ÷ 自己資本合計

配当利回り = 配当総額合計 ÷ 時価総額合計

ROE(Return On Equity 自己資本利益率) = 税引利益合計 ÷ ((自己資本 + 前期自己資本) ÷ 2)

その他レポート

インデックス構成の詳細

野村株主還元70 指数構成ルールブック

野村株主還元70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、当指数の正確性、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。

Russell/Nomura 日本株インデックス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およびFrank Russell Company に帰属します。なお、野村証券株式会社およびFrank Russell Company は、当インデックスの正確性、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、インデックスの利用者およびその関連会社が当インデックス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、またはウィ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