



Russell/Nomura Primeインデックス（以下R/N Prime）は、パッシブ運用に資するようにデザインされた日本株インデックスである。

時点 2020年12月末

円建てインデックス

銘柄数 999
 定期入替 毎年11月
 基準日 1996年12月30日
 (基準時点の指数値) (=1000)
 加重方法 時価総額加重型

代表的なETF

Bloomberg —
 上場市場 —
 通貨 —
 設定日 —
 運用会社 —

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

Russell/NOMURA 日本株インデックス
 提供メディア

Russell/Nomura 日本株インデックスは以下の媒体で公表されている。

Bloomberg RNJI
 時事通信 RNSI/12400,
 RNSIIDV/12400
 QUICK NRIJ500~503,
 NRIJ510~517
 REUTERS FRCNRI01, FRCNRI02,
 FRCNRI03, FRCNRI04,
 ,JRNP, ,JRNS
 INTERNET <http://qr.nomura.co.jp/jp/frcnri/index.html>

日中の指数値は以下の媒体で公開されている。

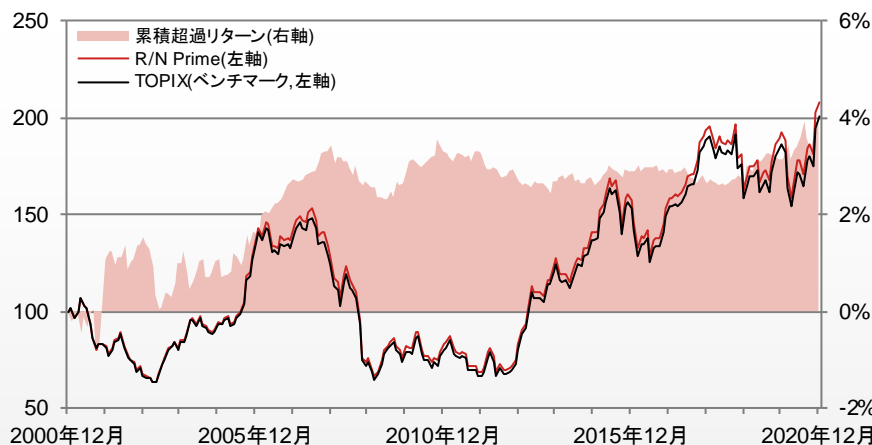
R/N Prime インデックス
 Bloomberg RNPJ <INDEX>
 時事通信 RNP/NOMURA
 QUICK 140

R/N Small Cap Core インデックス
 QUICK 130

概要

- 銘柄の修正時価総額上位98%の銘柄からなるRussell/Nomura Total Marketインデックスを日本国内の全上場ユニバースとする。
- リバランスバンドとネガティブリストを考慮して選ばれた修正時価総額上位1000銘柄から成る修正時価総額加重インデックス。
- インデックス値は、配当除く/配当込み指数双方について日次終値ベースで計算される。また米ドル建てインデックス値も同様に計算される。

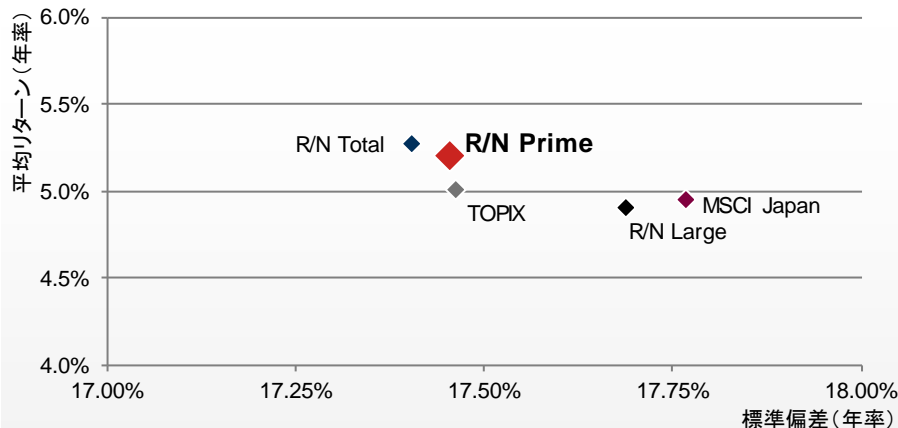
インデックス・パフォーマンス



((上)指数値は2000年12月末を100とする。円ベース、配当込み指数を使用。(下)注1参照。)

| | 1か月 | 3か月 | 年度ベース | 1年 | 2年 | 5年 | 01年01月~ |
|-------------------|------|-------|-------|-------|-------|------|---------|
| R/N Prime | 3.0% | 11.9% | 31.1% | 10.1% | 14.0% | 6.9% | 5.2% |
| TOPIX | 3.0% | 11.2% | 30.1% | 9.3% | 13.4% | 6.7% | 5.0% |
| R/N Prime - TOPIX | 0.0% | 0.7% | 1.0% | 0.8% | 0.6% | 0.2% | 0.2% |
| IR | - | - | - | 0.88 | 0.91 | 0.44 | 0.30 |

リスク・リターン



(期間は2001年1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)

| | R/N Prime | TOPIX | R/N Total | R/N Large | MSCI Japan |
|-----------|-----------|--------|-----------|-----------|------------|
| 平均リターン | 5.21% | 5.01% | 5.27% | 4.91% | 4.95% |
| 標準偏差 | 17.45% | 17.46% | 17.40% | 17.69% | 17.77% |
| リターン/標準偏差 | 0.30 | 0.29 | 0.30 | 0.28 | 0.28 |

時点

2020年12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(%) |
|-----------|--------|--------|----------|--------|
| R/N Prime | 25.44 | 1.40 | 2.01 | 5.56 |
| R/N Total | 25.47 | 1.39 | 2.01 | 5.48 |
| R/N Large | 25.08 | 1.49 | 1.92 | 5.97 |

(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)

より詳細なデータ

指数値及び個別銘柄情報に関するより詳細なデータは野村総合研究所のサービスである「e-AURORA」「IDS」にて利用が可能

お問い合わせ先: 野村総合研究所 投資情報サービス事業部

電話: 045-613-7200 e-mail: ids-sales@nri.co.jp

その他レポート

インデックス構成の詳細

Russell/Nomura 日本株インデックスインデックス 構成ルールブック

Russell/Nomura ファンダメンタル・インデックス ルールブック

マンスリーレポート

Russell/Nomura 日本株インデックス ～パフォーマンスサマリー～

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。

本資料中に含まれるMSCIから得た情報はMSCI Inc. (「MSCI」)の独占的財産です。MSCIによる事前の書面での許可がない限り、当該情報および他のMSCIの知的財産の複製、再配布あるいは指数などのかかる金融商品の作成における利用は認められません。当該情報は現状の形で提供されています。利用者は当該情報の利用に関わるすべてのリスクを負います。これにより、MSCI、その関連会社または当該情報の計算あるいは編集に関与あるいは関係する第三者は当該情報のすべての部分について、獨創性、正確性、完全性、譲渡可能性、特定の目的に対する適性に関する保証を明確に放棄いたします。前述の内容に限定することなく、MSCI、その関連会社、または当該情報の計算あるいは編集に関与あるいは関係する第三者はかかる種類の損失に対する責任をいかなる場合にも一切負いません。MSCIおよびMSCI指数はMSCIおよびその関連会社のサービス商標です。

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1.43%(税込) (20万円以下の場合、2,860円(税込))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