

Russell/Nomura Small Cap Core インデックス（以下R/N SCC）は、全上場銘柄のうち小型株を対象とするインデックスであり、Total Marketインデックスの修正時価総額下位約15%の銘柄から下位約5%の銘柄を除いた銘柄からなる。

時点 2023年11月末

円建てインデックス

銘柄数 350
 定期入替 毎年11月
 基準日 1999年12月30日
 (基準時点の指数値) (=100)
 加重方法 時価総額加重型

代表的な上場商品

Bloomberg —
 上場市場 —
 通貨 —
 上場日 —
 運用会社 —
 (ETNは発行会社) —

インデックスに関するお問い合わせ先

野村フィデューシャリー・リサーチ &
 コンサルティング株式会社
 インデックス事業部
 e-mail : idx_mgr@nfrco.jp

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
 LSEG FRCNRI01, FRCNRI02,
 FRCNRI03, FRCNRI04,
 ,JRNP, ,JRNS
 ウェブサイト <http://qr.nomuraholdings.com/jp/frcnri/index.html>

日中の指数値は以下の媒体で公開されている。

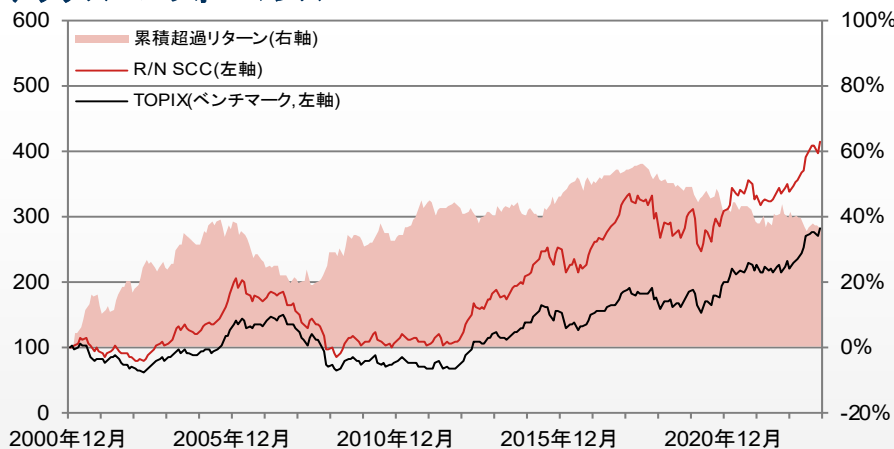
R/N Prime インデックス

Bloomberg RNPJ <Index>
 時事通信 RNP/NOMURA
 QUICK 140

概要

- 日本国内の全上場銘柄の修正時価総額上位98%の銘柄からなるRussell/Nomura Total Marketインデックスをユニバースとする。
- Total Marketインデックスの修正時価総額下位約15%の銘柄から下位約5%の銘柄を除いた銘柄からなる。
- 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。

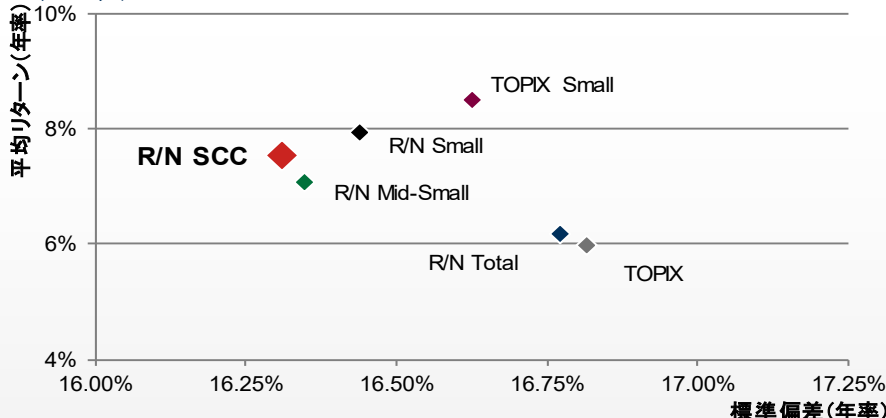
インデックス・パフォーマンス



((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カ月	3カ月	年度ペース	1年	2年	5年	01年01月~
R/N SCC	4.4%	1.2%	16.1%	17.6%	12.5%	7.2%	7.6%
TOPIX	5.4%	2.8%	19.9%	21.2%	13.8%	10.6%	6.0%
R/N SCC - TOPIX	-1.0%	-1.5%	-3.8%	-3.6%	-1.2%	-3.4%	1.6%
IR	-	-	-	-0.75	-0.20	-0.61	0.28

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 SCC	TOPIX	R/N Total	R/N Small	R/N Mid-Small	TOPIX Small
平均リターン	7.55%	5.97%	6.18%	7.93%	7.07%	8.49%
標準偏差	16.31%	16.82%	16.77%	16.44%	16.35%	16.63%
リターン/標準偏差	0.46	0.36	0.37	0.48	0.43	0.51

時点

2023年11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 SCC	15.48	1.12	2.38	7.42
R/N Total	15.69	1.37	2.30	8.98
R/N Small	15.15	1.07	2.42	7.23
R/N Mid-Small	14.66	1.20	2.37	8.40

(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
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
マンスリーレポート

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 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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下、NFRC)およびFrank Russell Company(以下、Russell)に帰属します。なお、NFRCおよびRussell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。

インデックスの算出において、電子計算機の障害もしくは天災地変その他やむを得ない事由が発生した場合は、インデックスの公表を延期または中止することがあります。

インデックス・データを取得した経路(当社ウェブサイト、情報ベンダー各社のサービスを通じた取得、等)に関わらず、これらのインデックスをご利用の際は、「インデックス・ライセンスについて」をご確認ください。

「インデックス・ライセンスについて」<http://qr.nomuraholdings.com/jp/indexlicense.html>

TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

■ 本資料は、お客様への情報提供を目的として、NFRCが作成したものです。

■ 本資料に掲載された全ての意見や予想はNFRCの本資料作成時点での判断に基づいており、通知なく変更されることがあります。また、本資料における将来の予測に関する意見が実際に生ずるといことを担保あるいは保証するものではありません。本資料の内容の一部は、NFRCが信頼性があると判断した様々な入手可能な情報に基づいています。しかし、NFRCはその正確さを保証するものではなく、これらの情報は要約された不完全なものである可能性があります。過去の投資実績は将来の結果を示唆するものではありません。

■ 本資料は特定の証券取引に関する投資勧誘や投資アドバイスを目的としたものではありません。

■ NFRCが開発・提供する市場インデックス(自社関連インデックス)が使用されている運用商品等をお客様が投資対象とする場合、当該インデックス利用料の一部が直接的・間接的問わずNFRCに帰属する可能性があります。自社関連インデックスの詳細は以下のウェブサイトをご参照ください。

証券市場インデックス <http://qr.nomuraholdings.com/jp/>

■ 本資料は、配布されたお客様限りでご使用ください。本資料はNFRCの著作物であり、NFRCの書面による事前の承諾なく、本資料の全部もしくは一部を複製、転送または再配布することはご遠慮ください。

野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長(金商) 第451号

加入協会 一般社団法人日本投資顧問業協会 会員番号(第011-00961号)