

ご意見募集の結果とインデックス構成ルール改定の実施について (野村日本株成長余力インデックス)

2022年6月6日

野村証券金融工学研究センター インデックス業務室では、野村日本株成長余力インデックスの構成ルールの改定について、本年3月29日から5月9日までご意見を募集しました。その結果と、結果を踏まえて実施を決定いたしましたインデックス構成ルール改定の内容につきまして、以下ご報告いたします。

1. ご意見募集の結果

募集期間中にお寄せいただいたご意見は1件(匿名)で、以下の内容でした。

インデックス運用の実務上、特段の懸念点もないものと判断されることから、反対意見等はない。

2. インデックス構成ルール改定の実施について

お寄せいただいた上記ご意見の内容に加え、他に反対やご懸念を表明されるご意見をいただかなかったことを考慮し、以下の通り、インデックス構成ルールの改定を実施することに決定いたしました。

(1) 対象インデックス

野村日本株成長余力インデックス

(2) 改定内容

対象インデックスのインデックス構成ルールブックに、以下の変更を行います。

① 銘柄選定母集団 (ルールブック 2.1.)

現行ルール	変更後
東証一部上場銘柄に限定	国内金融商品取引所の全市場上場銘柄からの選定を可能にする

② 資金余力(合成スコア) (ルールブック 2.2.1. IV)

現行ルール	変更後
基準化スコアの計算に、東証一部上場銘柄全体の平均と標準偏差を使用	基準化スコアの計算に、銘柄選定基準Ⅲを満たす銘柄群の平均と標準偏差を使用

(3) 適用時期

今回の改定内容は、2022年9月の定期入替から適用されます。

以上

【お問い合わせ先】

野村証券 金融工学研究センター
インデックス業務室
idx_mgr@jp.nomura.com