

お客様 各位

2004年6月18日

第三者割当における安定持株比率の修正と
安定持株比率の算出方法の変更について
(RUSSELL/NOMURA 日本株インデックス)

今般、フランク・ラッセル・カンパニーと野村証券金融研究所では、RUSSELL/NOMURA 日本株インデックスの安定持株比率について、下記の通りインデックスのルールを変更します。

1. 改正内容

(1) 第三者割当における安定持株比率の修正

「第三者割当による新株式発行」に係る株式数の修正日(変更上場日の5営業日後)に、以下の通り安定持株比率を修正します¹。

修正後の安定持株比率

$$= (\text{修正前の安定持株比率} \times \text{第三者割当実施前の指数計算用発行済株式数} + \text{第三者割当による異動株式数}) \\ / (\text{第三者割当実施前の指数計算用発行済株式数} + \text{第三者割当による異動株式数})$$

(2) 安定持株比率の算出方法の変更

インデックスの定期入替毎に新たに適用される安定持株比率について、以下の通り算出方法を変更します。

- ・ 変更前：単年の安定持株比率の3年移動平均を使用
- ・ 変更後：単年の安定持株比率の2年移動平均を使用

2. ルール変更の適用日

(1) 第三者割当における安定持株比率の修正

次回定期入替(2004年12月1日)以降、第三者割当による変更上場が行われる銘柄より適用します。

(2) 安定持株比率の算出方法の変更

次回定期入替(2004年12月1日)時から適用します。

(ご連絡先)

野村証券 金融経済研究所 金融工学研究センター
インデックス・プロダクツ・グループ
idx_mgr@ms.frc.nomura.co.jp
03-3274-0924

¹ 第三者割当による増資株式は安定持株とみなすことができ、このルール変更により、第三者割当の際に、指数計算上の安定持株考慮後の組入株数が変わらないようになります。