

お客様 各位

2007 年 5 月 7 日

定期入替以外のスタイル分類 株式移転、株式交換、合併などの取り扱い方法の一部変更
(Russell/Nomura 日本株インデックス)

今般、ラッセル・インベストメント・グループと野村証券金融経済研究所では、定期入替以外のスタイル分類における株式移転、株式交換、合併などの取り扱い方法について、Russell/Nomura 日本株インデックスのルールを次のように改定いたします。

インデックス・ルールの改定

【但書きの追加】

ただし、定期入替日の前々月第 1 営業日以降、定期入替までの株式交換、合併などの場合に伴うスタイル・プロバビリティの計算には上記の 5%ルールを適用しない。

【適用時期】

このルールは 2007 年 10 月第一営業日より開始。

(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@frc.nomura.co.jp

03-3274-0924