

お客様 各位

2008年7月30日

Russell/Nomura 日本株インデックスのルール改正

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工学研究センターでは、下記の通り、銘柄選択母集団の定義に著しくそぐわなくなった場合の銘柄除外についてルールを追加いたします。また、自己株式消却における期中の安定持ち株比率の修正ルールを追加いたします。加えて、Russell/Nomura 日本株インデックスの定期入替えにおける銘柄選択母集団に関して、取引所の指定銘柄に関する定義変更に伴い、指定銘柄の取扱方法について、下記の通りインデックスルールの記述を変更いたします。また、銘柄選択の母集団の外国株に関するインデックスルールの記述を変更いたします。

1. 銘柄除外に関するルールの追加

構成銘柄が定期入替えの銘柄選択母集団の定義に著しくそぐわなくなったと考えられる事由が発生した場合、当該会社、証券取引所、政府機関、または、規制当局の正式発表をもって除外することができることとします。

2. 自己株式消却における期中の安定持ち株比率の修正に関するルールの追加

自己株式に係わる株式数の修正日に、下記の通り安定持ち株比率を修正することとします。

修正後の安定持株比率

$$= (\text{修正前の安定持株比率} \times \text{自己株式消却実施前の指数計算用発行済株式数} - \text{自己株式消却による異動株式数}) / (\text{自己株式消却実施前の指数計算用発行済株式数} - \text{自己株式消却による異動株式数})$$

このルールは自己株式消却の前後で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することを意図したものです。

3. 銘柄選択の母集団に関するルールの記述の変更

(1) 取引所の指定銘柄の定義変更に伴う変更内容

定期入替えにおける銘柄選択母集団に関して、取引所の指定銘柄に関する名称変更に伴い、監理銘柄（審査中）、監理銘柄（確認中）および監理ポスト割当銘柄に関する取扱方法、および、整理銘柄および整理ポスト割当銘柄に関する取扱方法について、下記の通り変更します。

変更前：整理ポストに割当てられている銘柄は母集団に加えない。監理ポストの銘柄のうち定期入替え直前のインデックス構成銘柄でないものは母集団に加えない。

変更後：整理銘柄の指定または整理ポストに割当てられている銘柄は母集団に加えない。

監理銘柄（審査中）、監理銘柄（確認中）または監理ポストの銘柄のうち定期入替え直前のインデックス構成銘柄でないものは母集団に加えない。

(2) 外国株に関する記述の変更内容

銘柄選択の母集団の外国株に関する記述を変更いたします。

変更前：(外国部上場株) 日本市場で取引されているが、外国部に上場され、外国企業とみなされる銘柄は除く。

変更後：(外国株) 日本市場で取引されているが、外国部に上場されている、あるいは、外国企業とみなされる銘柄は除く。

4. 適用時期

2008年8月1日より、これらのルールを適用します。

(ご連絡先)

野村証券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