

お客様 各位

2009 年 4 月 23 日

Russell/Nomura 日本株インデックスのルール改定
～6.2.2. 臨時入替 株式移転などの場合の但し書きの追加～

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、6.2.2.臨時入替の株式移転などの場合の対応について、下記の通り、但し書きを追加いたします。

1. 6.2.2.臨時入替 株式移転などの場合の但し書きの追加

(1) 現行ルール

事業承継される完全親会社が非上場でかつ短期間のうちに上場される銘柄については、完全親会社の新規上場日に完全子会社を除外する。上場廃止後の完全子会社の評価価格には上場廃止日前日の評価価格を用いる。また完全親会社を新規上場日に採用する。また新規採用になる完全親会社に関して、完全子会社が属する規模別インデックスのうち最も上位の規模別インデックスの構成銘柄とする。

(2) 但し書きの追加

ただし、定期入替時に完全親会社が入替後の構成銘柄となっていない場合、完全子会社は上場廃止日に指数から除外される。

2. 適用時期

2009 年 4 月 24 日より、このルールを適用します。

※ 詳しくは 4 月 24 日発行の「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」を御参照ください。

(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