

お客様 各位

2013 年 8 月 6 日

配当込指数値計算における配当の反映ルールの変更
(Russell/Nomura 日本株インデックス)

今般、ラッセル・インベストメントと野村証券金融工学研究センターは、Russell/Nomura 日本株インデックスの配当込指数値計算における配当の反映ルールを次のように変更いたします。

インデックス・ルールの変更

「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 (2013 年 7 月 1 日発行)」p. 16 「6. 1. 2. 指数値の計算 - 配当の反映方法」

【変更前】

配当込み指数では、配当を配当落ち日に指数値に反映させる。配当落ち日には配当額が確定していないため、**野村証券金融経済研究所の予想配当**(なければ東洋経済新報社の予想配当)を用いる。後に予想配当と実績配当に差異が生じた場合には、決算発表の当月末営業日¹(決算発表が月末営業日の場合は翌月末営業日)に基準時価総額の修正を行う。

【変更後】

配当込み指数では、配当を配当落ち日に指数値に反映させる。配当落ち日には配当額が確定していないため、**会社発表の予想配当**(なければ東洋経済新報社の予想配当)を用いる。後に予想配当と実績配当に差異が生じた場合には、決算発表の当月末営業日¹(決算発表が月末営業日の場合は翌月末営業日)に基準時価総額の修正を行う。

なお、「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」は以下のリンクをご参照ください。

http://qr.nomura.co.jp/jp/frcnri/docs/RN_rule201307.pdf

適用時期

2013 年 9 月 26 日より、このルールを適用します。

¹ 2007 年 6 月末より実施。それ以前は決算発表の翌月初第一営業日に修正していた。

(ご連絡先)

野村證券 金融工学研究センター

クオন্ツ・リサーチ部

インデックス・プロダクツ・グループ

idx_mgr@frc.nomura.co.jp

03-6703-3986