

2016 年 8 月 10 日

ルール変更に係るお知らせ (Russell/Nomura 日本株インデックス)

野村證券 金融工学研究センターと Frank Russell Company では、Russell/Nomura 日本株インデックスのルールを次のように改定します。

なお、このルールは 2016 年 11 月定期入替から適用されます。

記

ルールブック 該当項番	現行ルール	新ルール
3.1.定期入替日	10 月 15 日(休日の場合は前営業日)を定期入替基準日とし、基準日時点のデータを用いて計算した結果をもとに構成銘柄を決定する。 12 月第一営業日 を定期入替日とし、年 1 回、定期入替日の前営業日の引け後に定期入替を実施する。	10 月 15 日(休日の場合は前営業日)を定期入替基準日とし、基準日時点のデータを用いて計算した結果をもとに構成銘柄を決定する。 11 月 20 日(休日の場合は翌営業日) を定期入替日とし、年 1 回、定期入替日の前営業日の引け後に定期入替を実施する。
4.2.2.有価証券の 含み損益 4.2.3.未認識退職 給付債務	該当なし	実効税率は定期入替時に見直す。
6.3.3.母集団の定義に著しくそぐわなくなった場合	構成銘柄が「3.4.銘柄選定の母集団」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、規制当局の公式発表をもって除外することができることとする。	構成銘柄が「3.4.銘柄選定の母集団」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、規制当局の公式発表をもって除外することができることとする。 ただし、銘柄を除外した後、定期入替基準日時点でその事由が取り下げられている場合には、母集団不適格を解除する。

詳細につきましては、「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」
<http://qr.nomura.co.jp/jp/frcnri/docs/RN_rule201608.pdf> を参照ください。

今後とも Russell/Nomura 日本株インデックスをどうぞよろしくお願い申し上げます。

【お問い合わせ先】
野村證券 金融工学研究センター
インデックス業務室
idx_mgr@jp.nomura.com
03-6703-3986