

東証 REIT 指数等の浮動株化実施要項

2016年11月22日
株式会社東京証券取引所

1. 概要

東証 REIT 指数及び東証 REIT 用途別指数シリーズ（以下、東証 REIT 指数等）については、2017年1月31日より段階的に浮動株指数への移行を実施いたします。

なお、当該資料においては、便宜的に受益証券及び投資証券を株式、受益権の口数及び投資口を株と表記します。

2. 移行スケジュール

2017年1月から各月の最終営業日に実施し、2017年5月の最終営業日に完了することとします。

第1回移行日（移行開始日）	2017年1月31日（火）
第2回移行日	2017年2月28日（火）
第3回移行日	2017年3月31日（金）
第4回移行日	2017年4月28日（金）
第5回移行日（移行完了日）	2017年5月31日（水）

各移行では、第5回移行日の最終的な浮動株比率に向けて1/5ずつ浮動株比率を変化させていきます。最終的な浮動株比率が0.8となる場合、1回目0.96、2回目0.92、3回目0.88、4回目0.84、5回目0.8となります。

3. 移行時の浮動株比率について

(1) 浮動株比率の算定方法

移行時の浮動株比率は2016年7月末日までに公表された有価証券報告書に基づき算出し0.05刻みで切り上げた値を用います（算出方法の詳細は、「東証指数算出要領（東証 REIT 指数・東証 REIT 用途別指数編）」参照）。ただし、使用する有価証券報告書の決算期末以降に合併等のコーポレートアクションを実施し、分布の変化が見込まれる場合はこの限りではありません。

(2) 新規上場の取り扱い

新規上場銘柄の浮動株比率は「東証指数算出要領（東証 REIT 指数・東証 REIT 用途別指数編）」に記載のとおり0.6として取り扱いますが、2016年11月までに新規上場し移行開

始前までに東証 REIT 指数等の算出対象となっている銘柄については便宜的に 1.0 とします。ただし、1.0 とする銘柄のうち、浮動株比率公表前までに有価証券報告書が公表されており、浮動株比率の算定が可能なものについては、可能な限り適切な浮動株比率を反映いたします。

(3) 浮動株比率の臨時見直しについて

移行期間中に「東証指数算出要領（東証 REIT 指数・東証 REIT 用途別指数編）」に記載の浮動株比率の臨時見直しの対象となる事象が発生した場合、臨時見直しを実施いたします。

（参考東証 REIT 指数については、2017 年 1 月 31 日以降臨時見直しの対象となります。）

(4) 定期見直しについて

定期見直しは 2018 年 7 月より実施します。（2017 年 7 月の定期見直しは実施しません。）

4. 参考情報の算出

移行の参考情報として、移行完了時の浮動株比率を反映した指数「参考東証 REIT 指数」及び、浮動株比率を反映しない（浮動株比率=1.0）「旧東証 REIT 指数」の算出を行い、指数基礎情報サービス（TMI）にて日次終値を提供します。なお、これらの指数の算出期間は以下のとおりとします。

- ・ 参考東証 REIT 指数： 2016 年 12 月 1 日から 2017 年 5 月 31 日まで（予定）
- ・ 旧東証 REIT 指数： 2017 年 1 月 31 日から 2018 年 12 月 28 日まで（予定）

以上