

2018 年 12 月 17 日

株式会社 東京証券取引所
株式会社 日本経済新聞社

「JPX 日経インデックス 400」及び「JPX 日経中小型株指数」の算出要領の改定について

株式会社東京証券取引所及び株式会社日本経済新聞社が共同で算出を行う「JPX 日経インデックス 400」及び「JPX 日経中小型株指数」について、算出要領を下記のとおり改定いたします。

記

1. 「JPX 日経インデックス 400」の改定内容

(1) 定性スコア算定に用いる項目の変更

定性スコア算定に用いる項目「決算情報の英文開示」について以下のとおり変更します。

改定箇所	新	旧
Ⅲ. JPX 日経インデックス 400 の銘柄選定 1. (2)⑤	(項目) 決算情報・「<u>コーポレート・ガバナンスに関する報告書</u>」の英文開示 (判定基準) 基準日において直近の決算情報・「<u>コーポレート・ガバナンスに関する報告書</u>」に係る英文資料が TDnet (英文資料配信サービス) を通じて開示されている	(項目) 決算情報の英文開示 (判定基準) 基準日において直近の決算情報に係る英文資料が TDnet (英文資料配信サービス) を通じて開示されている

※なお、その他の定性スコア算定に用いる 2 項目（独立した社外取締役の選任、IFRS 採用）については、今回の見直しの対象とはいたしません。

(2) 定期入替時における追加銘柄決定手順の見直し

定期入替時における追加銘柄決定手順について、以下のとおり改定いたします。

改定箇所	新	旧
Ⅲ. JPX 日経インデックス 400 の銘柄選定 1. (2)⑦(b) 定期入替	ii 前項 i によっても、銘柄数が 400 に不足する場合には、上記⑥の最終スコア順位の上位から <u>以下の二つの条件を満</u>	ii 前項 i によっても、銘柄数が 400 に不足する場合には、上記⑥の最終スコア順位の上位から 400 銘柄

改定箇所	新	旧
	<u>たす銘柄を 400 銘柄になるまで採用する。</u> <u>・3年平均 ROE または直近 ROE のいずれかが上記③の銘柄の中央値を上回っていること</u> <u>・上記⑥の最終スコア順位が 400 位以内であること</u> <u>iii 前項 ii によっても、銘柄数が 400 に不足する場合には、上記⑥の最終スコア順位が 400 位以内の未採用銘柄の上位から 400 銘柄になるまで採用する。</u>	柄になるまで選定する。 (新設)

2. 「JPX 日経中小型株指数」の改定内容

(1) 定性スコア算定に用いる項目について

定期入替にかかる定性スコア算定に用いる項目のうち、「独立した社外取締役の選任」及び「決算情報の英文開示」について、以下のとおり JPX 日経インデックス 400 と同一の判定基準に変更します。

項目	新判定基準	旧判定基準
Ⅲ. JPX 日経中小型株指数の銘柄選定 1. (2)⑥	(項目) 独立した社外取締役の選任 (判定基準) 基準日において社外取締役のうち独立役員に指定されている人数が<u>取締役の総数の 1/3 以上又は 3 人以上。</u> <u>ただし取締役の総数の 1/3 が 2 人に満たない場合は、2 人以上</u>	(項目) 独立した社外取締役の選任 (判定基準) 基準日において社外取締役のうち独立役員に指定されている人数が <u>2 人以上</u>
	(項目) 決算情報・「<u>コーポレート・ガバナンスに関する報告書</u>」の英文開示 (判定基準) 基準日において直近の決算情報・「<u>コーポレート・ガバナンスに関する報告書</u>」に係る英文資料が TDnet (英文資料配信サービス) を通じて開示されている	(項目) 決算情報の英文開示 (判定基準) 基準日において直近の決算情報に係る英文資料が TDnet (英文資料配信サービス) を通じて開示されている

※なお、その他の定性スコア算定に用いる項目 (IFRS 採用) については、今回の見直しの対象とはいたしません。

(2) 定期入替時における追加銘柄決定手順の見直し

定期入替時における追加銘柄決定手順について、以下のとおり JPX 日経インデックス 400 と同様の手順に改定いたします。

改定箇所	新	旧
Ⅲ. JPX 日経中小型株 指数の銘柄選定 1. (2)⑧(b)定期入替	ii 前項 i によっても、銘柄数が 200 に不足する場合には、上記⑦の最終スコア順位の上位から<u>以下の二つの条件を満たす銘柄を 200 銘柄になるまで採用する。</u> ・<u>3 年平均 ROE または直近 ROE のいずれかが上記④の銘柄の中央値を上回っていること</u> ・<u>上記⑦の最終スコア順位が 200 位以内であること</u> iii 前項 ii によっても、銘柄数が 200 に不足する場合には、<u>上記⑦の最終スコア順位が 200 位以内の未採用銘柄の上位から 200 銘柄になるまで採用する。</u>	ii 前項 i によっても、銘柄数が 200 に不足する場合には、上記⑦の最終スコア順位の上位から 200 銘柄になるまで選定する。 (新設)

3. 適用時期

2019 年 8 月実施の定期入替から適用します。

【お問い合わせ】

株式会社 東京証券取引所
情報サービス部

電話：050-3377-7754

Email : index@jpx.co.jp

株式会社 日本経済新聞社
インデックス事業室

電話：03-6256-7341

Email: index@nex.nikkei.co.jp

以上