

マーケットメイク制度v2.0の見直し

- 東証REIT指数/東証REIT Core指数/米国投資適格社債指数に係る枠を新設
- 実績を踏まえ、S&P500の最大銘柄数を拡大、日経225の最大銘柄数を縮小
- 2019年10月から開始

対象指数	オブリゲーション (提示金額/スプレッド)	インセンティブ (運用会社分と東証分の合計)	最大銘柄数
日経225/TOPIX	10億円 / 20bps	・マーケットメイカーのうち取引高上位2社に月額50万円 (※1)	日経225 : 1銘柄 TOPIX : 3銘柄
東証REIT指数/ 東証REIT Core指数	1億円 / 30bps	・マーケットメイカーのうち取引高上位2社に月額20万円	東証REIT指数 3銘柄 東証REIT Core指数 : 2銘柄
S&P500	1億円 / 20bps (※2)	・マーケットメイカーのうち取引高上位2社に月額20万円	為替ヘッジの有無を別銘柄として、 指数ごと2銘柄まで
MSCI Kokusai	1億円 / 20bps (※2)	・マーケットメイカーのうち取引高上位2社に月額20万円	為替ヘッジの有無を別銘柄として、 指数ごと1銘柄まで
MSCI Emerging	1億円 / 40bps (※2)	・マーケットメイカーのうち取引高上位2社に月額30万円	為替ヘッジの有無を別銘柄として、 指数ごと1銘柄まで
米国債7-10年	5億円 / 20bps (※2)	・マーケットメイカーのうち取引高上位2社に月額50万円	為替ヘッジの有無を別銘柄として、 指数ごと1銘柄まで
FTSE世界国債インデックス	1億円 / 40bps (※2)	・マーケットメイカーのうち取引高上位2社に月額30万円	為替ヘッジの有無を別銘柄として、 指数ごと1銘柄まで
Markit iBoxx 米ドル建て リキッド投資適格指数	1億円 / 40bps (※2)	・マーケットメイカーのうち取引高上位2社に月額20万円	為替ヘッジの有無を別銘柄として、 指数ごと1銘柄まで
ブルームバーグ・バークレイズ米国投資適 格社債(1-10年)インデックス	1億円 / 40bps (※2)	・マーケットメイカーのうち取引高上位2社に月額20万円	為替ヘッジの有無を別銘柄として、 指数ごと1銘柄まで

※1 運用会社と東証が月額50万円ずつを支出、以下同じ

※2 オブリゲーション(スプレッド)は、所定のスプレッド or 2ticks のいずれか広い方

- 利用を希望する運用会社はカテゴリごとに第2希望まで、銘柄を選定・提出
- 希望順位に沿って制度対象となるETFを決定する
- 既に選定されている銘柄については、原則として延長とし、空き枠が出た場合は別途選定

申請と選定に当たってのプロセス

① 各運用会社は、9月6日(金)までに、「マッチング銘柄申請シート」でカテゴリごとに第2希望までマッチング拠出の利用を希望する銘柄と、各カテゴリでの上限銘柄数/上限金額を申請

【カテゴリ】

REIT指数/
REIT Core指数

S&P500

ブルームバーグ・バークレイズ米国
投資適格社債（1-10年）
インデックス

② 東証は希望順位が高い順に利用銘柄を割り当てし、9月9日(月)までに運用会社に連絡
※順位が同じだった場合にはAUMが大きい銘柄を割り当て。
※希望順位1位が割り当てを受けなかった場合、2位の優先順位を1位として優遇。下位でも同様

③ 運用会社は割り当てを受けた銘柄について、9月13日(金)までにスポンサード利用申請を行う→10月から開始

※運用会社は申請にあたり、スポンサー利用契約を締結している必要がある。
※空き枠については先着順。