

JPX 日経中小型株指数

ファクトシート

JPX 日経中小型株指数は、上場企業の多数を占めるいわゆる中小型株に分類される企業に対して、JPX 日経 400 と同じコンセプトを適用し、持続的な企業価値の向上、株主を意識した企業経営を行っている企業で構成する株価指数です。日本経済新聞社と東京証券取引所が共同で開発しました。

■（銘柄）

東京証券取引所（第一部、第二部、マザーズ、JASDAQ）を主たる市場とする銘柄（普通株式を原則とする）から選定された 200 銘柄。

■（銘柄入れ替え）

指標性を維持するために毎年 1 回、「定期見直し」で 8 月末に構成銘柄を入れ替えます。選定の基準日時点の時価総額上位 20%および 100 億円以下の銘柄、直近 1 年間の売買代金合計額が 150 億円以下の銘柄を除いたうえで、3 年平均 ROE と 3 年累積営業利益を、それぞれ 70%、30%の割合で点数化したものに、ガバナンスやディスクロージャーの観点から定性的な評価を加えた最終的なランキングで 200 銘柄を選定します。経営再編や経営破綻などで欠員が出る場合も原則として補充はせず、「定期見直し」の際に 200 銘柄に戻します。それまでの間は、200 銘柄未満で指数を算出します。

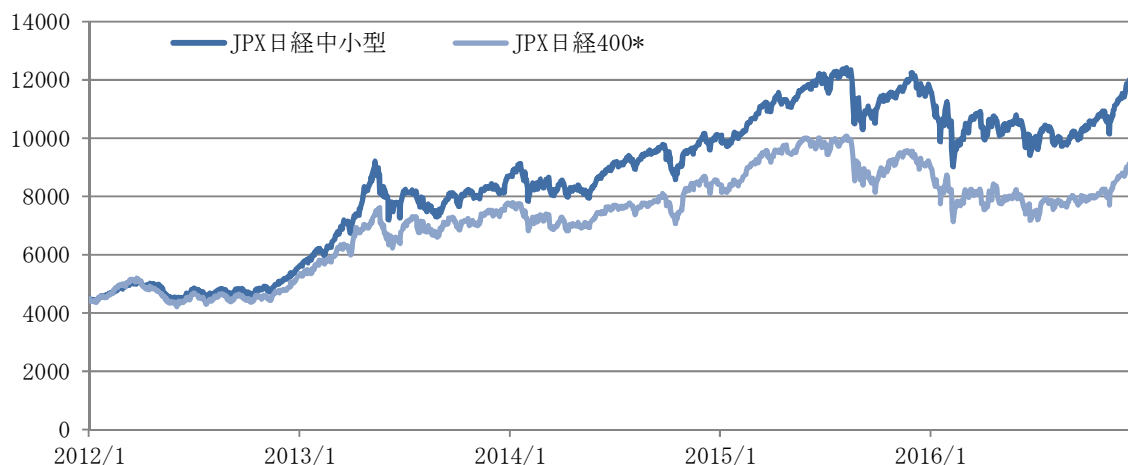
■（算出方法）

浮動株を調整した時価総額型指数で、構成銘柄の浮動株調整済み時価総額合計額を、「基準時価総額」で割って算出します。基準時価総額は、銘柄の増減や構成銘柄の市況によらない時価総額の増減を調整し、連続性を維持するためものです。ウェイトが大きい銘柄については、構成銘柄全体に対する選定基準日時点でのウェイトが 1.5%になるように、キャップ調整を行います。

■（起点など）

算出開始は 2017 年 3 月 13 日（2006 年 8 月 31 日まで遡及算出）。2016 年 8 月 31 日の値を 10,000 ポイントとして、東京証券取引所が開場している時間帯に 1 秒間隔で算出します。

■時系列グラフ（2016/12/30）



(*JPX 日経 400 : 2012/1/4 の JPX 日経中小型の値(4494.14)を起点に基準化)

■パフォーマンス（2016/12/30）

	年間リターン%					累積リターン% (年率)		標準偏差% (年率)	
	2012	2013	2014	2015	2016	3年	5年	3年	5年
JPX 日経中小型株指数	24.36	57.98	15.84	17.48	1.83	11.49	22.18	15.84	18.00
JPX 日経 400	17.65	49.94	8.51	9.27	-2.42	4.98	15.34	16.96	17.74

■ウェイト上位 10 銘柄 (2016/12/30)

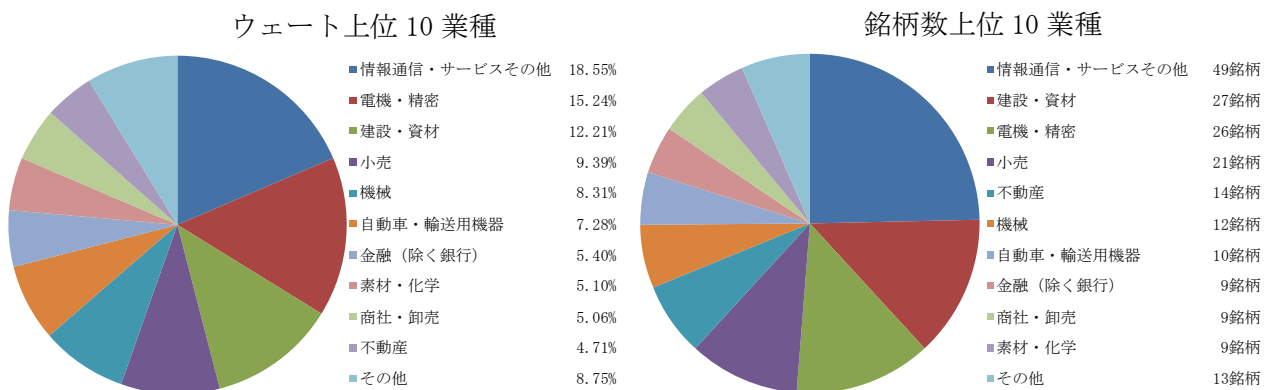
銘柄名	コード	TOPIX-17 シリーズの業種	ウェイト%	キャップ調整あり(*)
東京精密	7729	電機・精密	1.64	
岡三証券グループ	8609	金融 (除く銀行)	1.49	
東京 T Y フィナンシャルグループ	7173	銀行	1.43	
ナカニシ	7716	電機・精密	1.40	
三井住友建設	1821	建設・資材	1.29	
不二越	6474	機械	1.25	
興銀リース	8425	金融 (除く銀行)	1.19	
カドカワ	9468	情報通信・サービスその他	1.18	
竹内製作所	6432	機械	1.17	
東京製鐵	5423	鉄鋼・非鉄	1.16	

(*)キャップ調整の適用銘柄

■市場別銘柄数と 3 年平均 ROE (2016/8/31)

市場区分	銘柄数	3 年平均 ROE% (*)	
市場第一部	178	2016	18.2
市場第二部	3	(*) 定期入替時点の単純平均	
マザーズ	3		
JASDAQ	16		

■業種別ウェイト (2016/12/30) ※TOPIX-17 シリーズの業種による区分に基づく



■ベンダーコード

		(配当込)	(税引後配当込)
QUICK	106	S106/TSX	S106#NR/TSX
Bloomberg	JPNKMS	-	-
THOMSON REUTERS	JPXNKMSC	-	-

■リファレンス

詳しい計算方法や構成銘柄選定ルールは「算出要領」を参照ください。

→(日経サイト) <http://indexes.nikkei.co.jp/nkave/index/profile?idx=jpxnkms>

(東証サイト) <http://www.jpx.co.jp/markets/indices/jpx-nikkei400/01.html>

<p>《免責事項》</p> <p>「JPX 日経中小型株指数」は、株式会社東京証券取引所 (以下、「東証」という。)と株式会社日本経済新聞社 (以下、「日経」という)とによって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、東証と日経は、「JPX 日経中小型株指数」自体及び「JPX 日経中小型株指数」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。「JPX 日経中小型株指数」を示す標準に関する商標権その他の知的財産権は、すべて東証、株式会社日本取引所グループ及び日経に帰属しています。東証と日経は、「JPX 日経中小型株指数」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。東証と日経は、「JPX 日経中小型株指数」の計算方法など、その内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。《本資料について》</p> <p>本資料は日経と東証の著作物であり、本資料の全部又は一部を、いかなる形式によっても日経と東証に無断で複写、複製、転載または流布することができません。本資料は JPX 日経中小型株指数について深く理解いただくことを目的として作成したものであり、JPX 日経中小型株指数を対象とした金融商品等の売買に関する勧誘を行うためのものではありません。本資料は作成時点までの信頼できると思われる各種情報、データに基づいて作成されていますが、その正確性、相当性、完全性などに対して日経と東証は責任を負いません。また本資料に記載された情報を利用したことにより発生するいかなる費用又は損害について、日経と東証は一切その責任を負いません。本資料は、常に最新の情報に更新されていることを保証せず、また予告なく変更することがあります。本資料が対象とする指数の運営において本資料と異なる方法等が適用されることがあります。いずれの場合も日経と東証からの最新の開示に基づく情報が優先されます。</p>	<p>《連絡先》</p> <p>東京証券取引所 情報サービス部 TEL 050-3377-7754 index@jpx.co.jp</p> <p>日本経済新聞社 インデックス事業室 TEL 03-6256-7341 index@nex.nikkei.co.jp</p>
---	--