

TOPIX500 バリュー

TOPIX500 バリューは、TOPIX500の構成銘柄のうち、PBR等に応じてスタイル区分をバリューに分類した銘柄で構成される指数です。

指数値（配当なし）



基本情報

算出方式	時価総額加重方式（浮動株ベース）
ウエイト上限	—
定期入替	年1回（10月最終営業日）
基準値・基準日	配当なし・配当込み：1,000（2008/11/25）
算出頻度	配当なし：リアルタイム（15秒間隔）、配当込み：終値
シリーズファクトシート	https://www.jpx.co.jp/markets/indices/line-up/index.html

ベンダーコード

QUICK		Bloomberg		Refinitiv	
配当なし	配当込み	配当なし	配当込み	配当なし	配当込み
N213/T	S213/TSX	TPX500V INDEX	TPXD500V INDEX	.TOPX500V	.TOPX500V R

構成銘柄数

383

構成銘柄ウエイト

最大	7.63%
最小	0.01%
中央	0.09%

時価総額

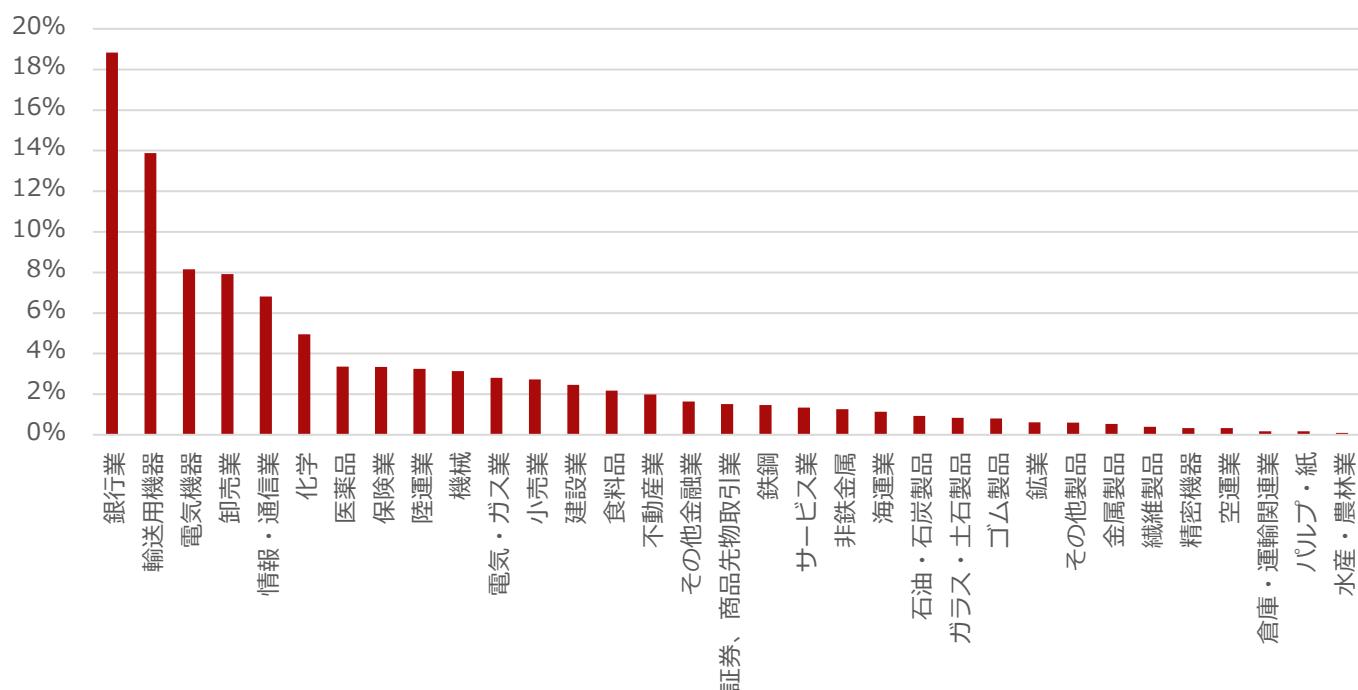
合計	686兆9,157億円
最大	49兆5,647億円
最小	1,281億円
平均	1兆7,935億円
中央	6,546億円

ファンダメンタルズ

配当利回り	2.61%
ROE	8.14%
PER	14.26
PBR	1.16

構成銘柄（ウエイト上位）

コード	銘柄名	業種	ウエイト
1	7203 トヨタ自動車	輸送用機器	7.63%
2	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6.74%
3	8316 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	4.12%
4	8411 みずほフィナンシャルグループ	銀行業	3.29%
5	9984 ソフトバンクグループ	情報・通信業	3.06%
6	9432 NTT	情報・通信業	2.00%
7	8058 三菱商事	卸売業	1.79%
8	4502 武田薬品工業	医薬品	1.70%
9	7267 本田技研工業	輸送用機器	1.55%
10	8001 伊藤忠商事	卸売業	1.45%
合計			33.33%

業種別ウエイト

パフォーマンス（配当込み）

	リターン							リターン(年率換算)		
	1か月	3か月	6か月	1年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
TOPIX500 バリュー (TOPIX)	3.88%	15.67%	27.80%	31.52%	112.43%	209.11%	186.31%	28.55%	25.32%	11.09%
	6.20%	14.30%	26.37%	26.70%	85.84%	138.05%	170.40%	22.95%	18.94%	10.46%

リスク (年率換算)				リターン (年率換算) / リスク (年率換算)				
	1年	3年	5年	10年	1年	3年	5年	10年
TOPIX500 バリュー (TOPIX)	10.26%	11.59%	12.12%	15.47%	3.07	2.46	2.09	0.72
	9.86%	10.47%	11.66%	13.80%	2.71	2.19	1.62	0.76

最大ドローダウン									
	1年		3年		5年		10年		
TOPIX500 バリュー	19.08%			25.14%		25.14%		37.23%	
期間	2025/3/27	-	2025/4/7	2024/7/4	-	2024/8/5	2024/7/4	-	2024/8/5
(TOPIX)	17.82%			23.96%		23.96%		32.17%	
(期間)	2025/3/27	-	2025/4/7	2024/7/11	-	2024/8/5	2024/7/11	-	2024/8/5
	2018/1/23	-	2020/3/16						

関連情報（対TOPIX）				
	1年	3年	5年	10年
トラッキングエラー	1.90%	2.57%	3.10%	3.86%
ベータ	1.00	1.03	1.01	1.03
インフォメーションレシオ	2.54	10.35	22.92	4.12

指數算出要領

<https://www.jpx.co.jp/markets/indices/line-up/index.html>

連動ETF

<https://www.ipx.co.jp/equities/products/etfs/issues/01.html>

お問合せ

株式会社JPX総研 インデックスビジネス部 e-mail: index@jpx.co.jp

本資料について

本資料は、株価指数の概要説明のみを目的としており、投資勧誘を目的としているものではなく、また金融商品取引法に基づく開示資料ではございません。

本資料の一切の権利は株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）に属しております、いかなる目的を問わず、無断複製・転載を禁じます。

本資料は、制度の改正等により、本資料に掲載した内容が予告なく変更される場合があります。また、この資料に掲載されている情報の作成には万全を期していますが、当該情報の完全性を保証するものではありません。当社は、本資料及び本資料から得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等の一切について責任を負いません。

株価指数に連動するE T Fは値動きのある有価証券を投資対象としますので、連動対象である指標及び外国為替相場の変動、組入有価証券の価格の変動、組入有価証券の発行会社の倒産や財務状況等の悪化、その他の市場要因の影響等により、市場取引価格又は基準価額が値下がりし、それにより損失が生じことがあります。したがって、投資元本が保証されているものではありません。また、「信託取引を利用する場合には、差し入れた保証金以上のお損が生じるおそれがあります。

ETFの売買を行われるに際しては、あらかじめ、お取引先の金融商品取引業者等より交付される契約締結前交付書面等の書面の内容を十分にお読みいただき、商品の性質、取引の仕組み、リスクの存在、販売手数料、信託報酬などの手数料等を十分に御理解いただいたうえで、御自身の判断と責任で行っていただきますよう、お願い申し上げます。

JPXが算出する株価指数の指標値及び商標は、JPXの知的財産であり、すべてJPXが所有しています。このため、JPXが算出する株価指数を使用して、ファンドやリンク債などの金融商品の組成・販売などを行う場合（相対契約によるオプション、スワップ又はワントなどデリバティブ取引の対象にする場合を含む。）には、JPXとのライセンス契約が必要となります。

日本取引所グループ

<https://www.ipx.co.jp/>