

東証指数算出要領

(東証プライム市場指数、東証スタンダード市場指数、
東証グロース市場指数編)

2022年6月27日版

株式会社JPX総研

2022年6月27日発行

目次

| | |
|---------------------|---|
| 変更履歴 | 3 |
| はじめに | 4 |
| I. 株価指数概要 | 4 |
| II. 指数の算出 | 4 |
| 1. 算出式 | 4 |
| 2. 指数種別 | 5 |
| 3. 算出対象の追加・除外 | 5 |
| III. その他 | 6 |
| 1. 公表、基礎情報の提供 | 6 |
| 2. 利用許諾 | 6 |
| 3. 問い合わせ先 | 6 |

変更履歴

| 公表日 | 変更内容 |
|-----------|--------------|
| 2022/4/4 | ・新設 |
| 2022/6/27 | ・指数値の算出頻度を変更 |

はじめに

- ・ 本資料では、株式会社 J P X 総研（以下、「J P X 総研」という。）が算出・配信を行う、東証プライム市場指数、東証スタンダード市場指数及び東証グロース市場指数（以下、「東証プライム市場指数等」という。）に関する算出方法等を示す。ただし、本資料に記載のない事象が発生した場合や本資料の方法による算出が困難と J P X 総研が判断した場合は、J P X 総研が適当とみなした処理方法により算出することがある。
- ・ 本資料は J P X 総研の著作物であり、本資料の全部又は一部を、いかなる形式によっても、J P X 総研に無断で複製、複製又は転載することはできない。本資料は、指数への理解を高めるために作成された資料であり、有価証券の売買等に関する勧誘等を行うためのものではない。また、J P X 総研は、東証プライム市場指数等の算出若しくは公表に係る誤謬、遅延若しくは中断、その算出若しくは公表の方法の変更、東証プライム市場指数等若しくは本資料に記載された情報の利用又はこれらに類する事由により発生するいかなる費用又は損害等について、その責めを負わない。

I. 株価指数概要

- ・ 東証プライム市場指数等の各株価指数の算出対象は各対象市場（区分）に上場する内国普通株式全銘柄とする。ただし、各指数への追加・除外タイミングは上場制度上の取扱いと一部異なる（II 章参照）。
- ・ 新株予約権証券、優先株式、出資証券等は算出対象外とする。
- ・ ウェイト計算における基準日（以下、「ウェイト基準日」という。）は、毎年 8 月最終営業日とする。
- ・ 各株価指数の基準日・基準値については、以下のとおり。

| 指数名称 | 対象市場（区分） | 基準日 | 基準値 |
|--------------|------------|----------------|-------|
| 東証プライム市場指数 | 東証プライム市場 | 2022 年 4 月 1 日 | 1,000 |
| 東証スタンダード市場指数 | 東証スタンダード市場 | 2022 年 4 月 1 日 | 1,000 |
| 東証グロース市場指数 | 東証グロース市場 | 2022 年 4 月 1 日 | 1,000 |

II. 指数の算出

1. 算出式

- ・ 東証プライム市場指数等は時価総額加重方式により算出される株価指数である。
- ・ 指数の算出式や基準時価総額の修正等については、「指数計算に係る算出要領」に従う。
- ・ 個別銘柄のウェイト上限は 20% とする。
- ・ ウェイト基準日における浮動株時価総額ウェイトが上限を超える銘柄については、10 月最終営業日にキャップ調整係数を設定する。その後に株価の変動等により上限を超

える場合も翌年の10月最終営業日までキャップ調整係数は変更しないものとする。

2. 指数種別

- ・ 東証プライム市場指数等について、それぞれ配当なし株価指数と配当込み株価指数を算出する。
- ・ 配当の指数値への反映方法については、「指数計算に係る算出要領」に従う。

3. 算出対象の追加・除外

(1) 非定期の除外

- ・ 算出対象に上場廃止、整理銘柄への指定、市場区分の変更があった場合、当該銘柄を除外する。

(2) 非定期の追加

- ・ 各対象市場に新規上場した銘柄（テクニカル上場を除く）は、新規上場日の翌月最終営業日に追加する。
- ・ 各対象市場に市場区分を変更した銘柄は、市場変更日に追加する。
- ・ 東証プライム市場指数等の算出対象が株式移転、株式交換、新設合併又は会社分割のため上場廃止となり、当該株式移転等に伴う新設会社、存続会社又は承継会社が遅滞なく上場する場合には、当該新設会社等を追加する。

(3) 選定用データに関する取扱い

- ・ キャップ調整係数の算定あたって利用する浮動株時価総額は、ウェイト基準日における各指数の指数用時価総額とする。

(4) 算出対象の追加及び除外日

| | 修正を要する事項 | 修正日 |
|------|--|-------------------------------|
| 追加 | 新規上場（テクニカル上場を除く） | 新規上場日の翌月末(最終営業日) |
| | 東証プライム市場指数等の算出対象が株式移転等(注 1)のため上場廃止となり、当該株式移転等に伴う新設会社等が東証プライム市場指数等の算出対象に追加される場合 | 新規上場日(注 2) |
| | 市場区分の変更（変更先市場の指数へ追加） | 市場区分の変更日 |
| 上場廃止 | 東証プライム市場指数等の算出対象が株式移転等(注 1)のため上場廃止となり、当該株式移転等に伴う新設会社等が東証プライム市場指数等に追加される場合 | 当該新設会社等の新規上場日（通例、上場廃止日の2営業日後） |

| | | 修正を要する事項 | 修正日 |
|--------|--|-----------------------------------|-------------------------|
| 除 外 | | 上記以外（合併・株式交換などにより非存続会社となる 場合等） | 上場廃止日 |
| | | 市場区分の変更（変更前市場の指数からの除外） | 市場区分の変更日 |
| | | 整理銘柄への指定 | 整理銘柄への指定日（注3）の4営業 日後 |

注1：株式移転、株式交換、新設合併又は会社分割

注2：新規上場日が休業日の場合、翌営業日に繰り下げる。

注3：整理銘柄への指定日が休業日の場合、翌営業日に繰り下げる。

Ⅲ. その他

1. 公表、基礎情報の提供

(1) 指数値

- ・ 東証プライム市場指数等の配当なし株価指数の指数値は、東証相場報道システムを通じてリアルタイム（15秒間隔）で全国の証券会社、報道機関等へ配信する。
- ・ また、東証プライム市場指数等の配当込み株価指数については終値のみを算出する。

(2) 指数基礎情報

- ・ 東証プライム市場指数等に係る日々の指数基礎情報（基準時価総額など）は、「指数基礎情報」において有償による情報提供を行う。

2. 利用許諾

東証プライム市場指数等の算出、数値の公表、利用など東証プライム市場指数等に関する権利はJPX総研又はJPX総研の関連会社が有している。このため、東証プライム市場指数等を使用して、ファンドやリンク債などの金融商品を組成・売り出す（相対契約によるオプション、スワップ、ワラントなどデリバティブ取引の対象にする場合を含む。）又はデータ提供する場合など東証プライム市場指数等を商業的に利用する場合には、JPX総研とのライセンス契約が必要となる。

3. 問い合わせ先

JPX総研 インデックスビジネス部

E-mail : index@jpx.co.jp

以上