

別紙 6.JPX 日経中小型株指数の概要(詳細につきましては、算出要領をご覧ください。)

名称	JPX 日経中小型株指数(JPX-Nikkei Mid and Small Cap Index) (略称:JPX 日経中小型(JPX-Nikkei Mid Small))
構成銘柄数	200 銘柄
銘柄選定にかかる母集団	東証の市場第一部、市場第二部、マザーズ、JASDAQ を主市場とする普通株式
銘柄選定及び銘柄入替方法	<p>【選定基準】</p> <p>以下の手順及び基準に従い、銘柄選定を行います。</p> <p>(1) スクリーニング</p> <p>① 適格基準によるスクリーニング</p> <p>下記のいずれかに該当する場合は銘柄選定の対象としない。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 上場後 3 年未満(テクニカル上場を除く) ・ 過去 3 期いずれかの期で債務超過 ・ 過去 3 期すべての期で営業赤字 ・ 過去 3 期すべての期で最終赤字 ・ 整理銘柄等に該当 <p>② 大型株の除外</p> <p>上記①の銘柄から、基準日における時価総額順位が上位 20% 以内となる大型銘柄を除外します。ただし、基準日において JPX 日経中小型株指数算出対象銘柄については、上位 18% 以内の銘柄のみを除外します。</p> <p>③ 市場流動性指標によるスクリーニング</p> <p>上記②の銘柄から、基準日から起算して直近 1 年間の売買代金合計額が 150 億円以下の銘柄及び基準日における時価総額が 100 億円以下の銘柄を除外します。ただし、その結果として選定対象候補となる銘柄数が 500 銘柄に満たない場合、500 銘柄を超えるまで売買代金及び時価総額の基準を 10 億円刻みで引き下げます。</p> <p>(2) 定量的な指標によるスコアリング</p> <p>(1)により選定した銘柄に対して、以下の項目に基づいてそれぞれの順位スコアを付与した上で、以下の比率で合算し、総合スコアを算出します。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 3 年平均 ROE: 70% ・ 3 年累積営業利益: 30%

本資料は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」という。）及び株式会社日本経済新聞社（以下「日経」という。）が、JPX 日経中小型への理解を高めるために作成した資料であり、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、東証及び日経は、JPX 日経中小型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、JPX 日経中小型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。

	<p>(3) 定性的な要素による加点</p> <p>(2)のスコア付けの後、以下の定性 3 項目を勘案してスコアの加点を行います。</p> <p>定性項目による加点は、総合スコアのみによる選定の場合との差異が最大でも 10 銘柄程度となるように設定します。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 独立した社外取締役の選任(2 人以上) ・ IFRS 採用または採用の決定を公表 ・ 決算情報英文資料の TDnet(英文資料配信サービス)を通じた開示 <p>(4) 構成銘柄の決定</p> <p>(3)の加点の後、上位 200 銘柄を構成銘柄とします。ただし、定期入替においては、基準日における JPX 日経中小型株指数算出対象銘柄のうち、スコア順位が 250 位より低い場合に除外し、非採用銘柄のうち、スコアが高い順に 200 銘柄となるよう補充します。</p> <p>【銘柄入替え】</p> <p>毎年 6 月最終営業日を選定基準日とし、毎年 8 月第 5 営業日に入替銘柄を公表のうえ、毎年 8 月最終営業日に銘柄定期入替を実施します。</p>
算出方法	浮動株調整時価総額加重型(1.5%キャップ付き)
算出開始日	2017 年 3 月 13 日(月) 東京証券取引所の相場報道システムからリアルタイム(1 秒毎)で配信
起算日・基準値	2016 年 8 月 31 日(水)・10,000 ポイント