

JPX 日経中小型株指数の算出要領の改定に関する 指数コンサルテーションへの対応について

株式会社JPX総研及び株式会社日本経済新聞社(以下、「指数算出者」という。)は、JPX日経中小型株指数の算出要領の改定について指数コンサルテーションを実施しました。

本指数コンサルテーションで寄せられたご意見の概要と、指数算出者における検討の概要は下記のとおりです。

記

1. 寄せられたご意見及び検討の概要

今般の改定は、JPX日経中小型株指数のコンセプトや連続性を維持しつつ、定期入替における回転率を低減し、投資対象としての機能性を高めることを目指したものです。

今般、指数コンサルテーションを通じ本案について複数の賛成のご意見を受領しており、反対のご意見はありませんでした。

以上を踏まえ、本指数コンサルテーションでお示した提案内容のとおり算出要領を改定いたします。

2. 決定内容

・基準日時点における算出対象銘柄の除外基準の見直し

改定箇所	新	現
Ⅲ. JPX 日経中小型株指数の銘柄選定 1. (2)③	上記②の銘柄のうち、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する。ただし基準日においてJPX日経中小型の算出対象となっている銘柄については、上位 14% 以内の銘柄のみを除外する。	上記②の銘柄のうち、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する。ただし基準日においてJPX日経中小型の算出対象となっている銘柄については、上位 18% 以内の銘柄のみを除外する。

3. 実施時期

2023年8月の定期入替から適用します。

以上