

JPX日経インデックス400は、資本の効率的活用や投資者を意識した経営観点など、グローバルな投資基準に求められる諸条件を満たした、「投資者にとって投資魅力の高い会社」で構成される株価指数です。日本経済新聞社と日本取引所グループおよび東京証券取引所が、共同で開発しました。

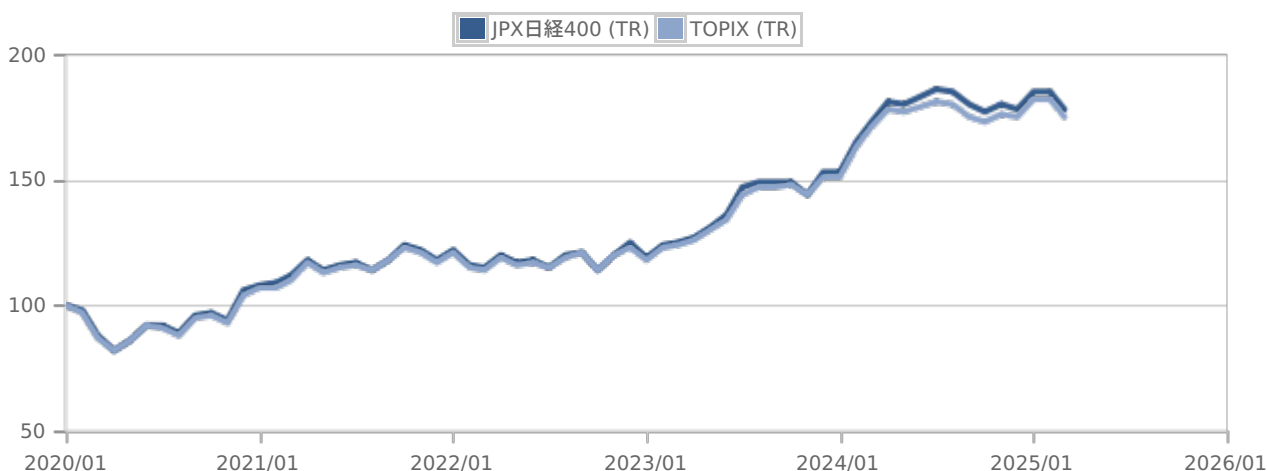
■銘柄選定

東証上場の全銘柄を対象に、過去3年間の売買代金と時価総額を基に市場流動性の高い1000銘柄を選んだうえで、3年平均ROE、3年累積営業利益、時価総額の3つの指標を、それぞれ40%、40%、20%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400銘柄を選定します。

■基本情報

| | |
|--------|-----------------------------|
| 銘柄入れ替え | 年1回(8月) |
| 銘柄数 | 400 |
| ウェイト | 浮動株時価総額(1.5%キャップ) |
| 算出開始日 | 2014年1月6日(2006年8月31日まで遡及算出) |
| 基準日 | 2013年8月30日=10,000ポイント |
| 計算頻度 | リアルタイム(1秒間隔) |

■パフォーマンス



■年間リターン

| | 年間リターン% | | | | | |
|---------------|---------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | 2020 | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | YTD |
| JPX日経400 (TR) | 8.86 | 12.45 | -2.62 | 28.73 | 20.64 | -3.63 |
| TOPIX (TR) | 7.39 | 12.74 | -2.45 | 28.26 | 20.45 | -3.65 |

■リスク・リターン

| | 累積リターン (年率) % | | | 標準偏差 (年率) % | | |
|------------|---------------|-------|-------|-------------|-------|-------|
| | 1年 | 3年 | 5年 | 1年 | 3年 | 5年 |
| | JPX日経400 (TR) | 2.80 | 15.58 | 15.08 | 8.52 | 11.69 |
| TOPIX (TR) | 2.59 | 15.29 | 14.89 | 8.65 | 11.27 | 12.76 |

■ファンダメンタルズ

| | 配当利回り% | PER | PBR | ROE% |
|----------|--------|-------|------|------|
| JPX日経400 | 2.52 | 14.65 | 1.41 | 9.63 |
| TOPIX | 2.48 | 14.49 | 1.29 | 8.94 |

(※) 各指標の定義は日経平均プロフィール「ユーザーズ・ガイド」をご参照ください。

■指数の特性

| | 銘柄数 |
|---------------------------|-----|
| 構成銘柄数 | 398 |
| 大型株(TOPIX Core30+Large70) | 90 |
| 中型株(TOPIX Mid400) | 232 |
| 小型株(TOPIX Small) | 69 |
| その他非TOPIX構成銘柄 | 7 |

■ウェイト上位10銘柄

| 銘柄名 | コード | 業種 | ウェイト% |
|-------------------|------|--------------|-------|
| ソニーグループ | 6758 | 電機・精密 | 2.08 |
| 任天堂 | 7974 | 情報通信・サービスその他 | 2.01 |
| みずほフィナンシャルグループ | 8411 | 銀行 | 1.92 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 8306 | 銀行 | 1.79 |
| リクルートホールディングス | 6098 | 情報通信・サービスその他 | 1.71 |
| 日立製作所 | 6501 | 電機・精密 | 1.70 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 8316 | 銀行 | 1.63 |
| 日本電信電話 | 9432 | 情報通信・サービスその他 | 1.48 |
| 武田薬品工業 | 4502 | 医薬品 | 1.47 |
| KDDI | 9433 | 情報通信・サービスその他 | 1.37 |

(※) 業種はTOPIX-17シリーズによる

■業種別ウェイト・銘柄数

| | ウェイト% | | 銘柄数 |
|--------------|-------|--------------|-----|
| 電機・精密 | 20.40 | 情報通信・サービスその他 | 72 |
| 情報通信・サービスその他 | 15.36 | 電機・精密 | 51 |
| 銀行 | 6.99 | 素材・化学 | 33 |
| 商社・卸売 | 6.64 | 小売 | 31 |
| 金融（除く銀行） | 6.54 | 建設・資材 | 28 |
| 自動車・輸送用機器 | 6.53 | 機械 | 24 |
| 機械 | 6.20 | 商社・卸売 | 23 |
| 素材・化学 | 5.62 | 自動車・輸送用機器 | 20 |
| 医薬品 | 5.44 | 金融（除く銀行） | 20 |
| 小売 | 4.35 | 食品 | 18 |

(※) 業種はTOPIX-17シリーズによる

■ベンダーコード

| | | (配当込) | (税引後配当込) |
|-----------|-----------|-------------|--------------|
| QUICK | 105 | S105/TSX | S105#NR/TSE |
| Bloomberg | JPNK400 | JPNK400D | JPNKNTR |
| Refinitiv | .JPXNK400 | .JPXNK400DV | .JPXNK400NTR |

■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) <https://indexes.nikkei.co.jp/nkave/index/profile?idx=jpxnk400>

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

(※) 月次ファクトシートは前月末時点のデータで作成しています。

<<免責事項>>

「JPX日経インデックス400」は、株式会社JPX総研（以下、「JPXI」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、JPXIと日経は、「JPX日経インデックス400」自体及び「JPX日経インデックス400」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日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべてJPXI、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。JPXIと日経は、「JPX日経インデックス400」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。JPXIと日経は、「JPX日経インデックス400」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。

「東証株価指数（TOPIX）」は、JPXIの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び「東証株価指数(TOPIX)」の商標又は標章に関するすべての権利はJPXIが有しています。

<<本資料について>>

本資料は日経とJPXI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JPXIに無断で複製、複製、転載または流布することができません。本資料はJPX日経インデックス400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日経インデックス400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される各種情報、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JPXI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JPXI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JPXIからの最新の開示に基づく情報が優先されます。

<<連絡先>>

日本経済新聞社
インデックス事業室
index@nex.nikkei.co.jp

JPX総研
インデックスビジネス部
index@jpx.co.jp