JPX 日経中小型株指数
月次ファクトシート

JPX-NIKKEI Mid Small

JPX日経中小型株指数は、上場企業の多数を占めるいわゆる中小型株に分類される企業に対して、JPX日経400と同じコンセプトを適用し、持続的な企業価値の向上、株主を意識した企業経営を行っている企業で構成する株価指数です。日本経済新聞社と東京証券取引所が共同で開発しました。

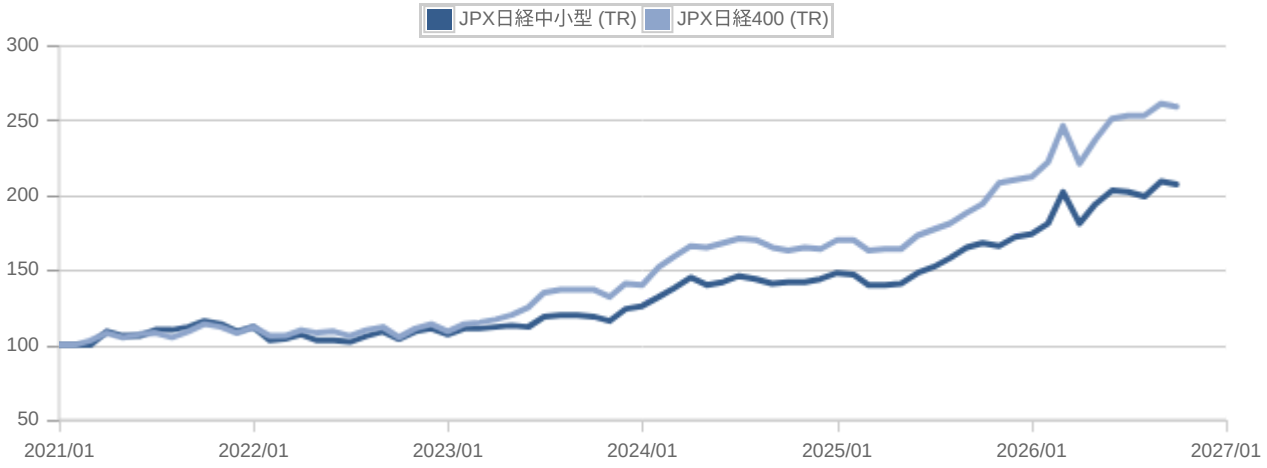
■銘柄選定

東証上場の全銘柄を対象に、選定の基準日時点の時価総額上位20%および100億円以下の銘柄、直近1年間の売買代金合計額が150億円以下の銘柄を除いたうえで、3年平均ROEと3年累積営業利益を、それぞれ70%、30%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200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	200
ウェート	浮動株時価総額(1.5%キャップ)
算出開始日	2017年3月13日(2006年8月31日まで遡及算出)
基準日	2016年8月31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%					
	2021	2022	2023	2024	2025	YTD
JPX日経中小型 (TR)	12.80	-4.31	17.49	17.19	17.22	18.92
JPX日経400 (TR)	12.45	-2.62	28.73	20.64	24.95	22.21

■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日経中小型 (TR)	23.04	20.07	12.25	19.42	13.96	13.19
JPX日経400 (TR)	33.50	23.56	17.87	18.62	13.61	13.09

■ファンダメンタルズ

	配当利回り%	PER	PBR	ROE%
JPX日経中小型	2.93	13.06	1.94	14.85
JPX日経400	2.09	17.31	1.86	10.78

（※）各指標の定義は日経平均プロフィル「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	200
大型株(TOPIX Core30+Large70)	0
中型株(TOPIX Mid400)	5
小型株(TOPIX Small)	161
その他非TOPIX構成銘柄	34

■ウェート上位10銘柄

銘柄名	コード	業種	ウェート%
ＡＲＥホールディングス	5857	鉄鋼・非鉄	1.71
北陸電力	9505	電力・ガス	1.67
物語コーポレーション	3097	小売	1.60
フルヤ金属	7826	情報通信・サービスその他	1.57
加賀電子	8154	商社・卸売	1.56
古野電気	6814	電機・精密	1.44
ＰＩＬＬＡＲ	6490	機械	1.40
カチタス	8919	不動産	1.33
ＤＴＳ	9682	情報通信・サービスその他	1.29
トーカロ	3433	建設・資材	1.24

（※）業種はTOPIX-17シリーズによる

■業種別ウェート・銘柄数

	ウェート%
情報通信・サービスその他	32.22
商社・卸売	13.24
電機・精密	9.14
不動産	8.79
建設・資材	7.83
小売	7.43
機械	4.96
運輸・物流	3.36
素材・化学	3.34
鉄鋼・非鉄	3.31

	銘柄数
情報通信・サービスその他	88
不動産	22
商社・卸売	16
小売	15
建設・資材	13
電機・精密	11
金融（除く銀行）	8
機械	7
運輸・物流	5
素材・化学	4

（※）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	106	S106/TSX	S106#NR/TSX
Bloomberg	JPNKMS	JPNKMSD	-
Refinitiv	.JPXNKMSC	-	-

■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=jpxnkms
(東証サイト) https://www.jpx.co.jp/markets/indices/jpx-nikkei400/01.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 日経中小型株指数」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 日経中小型株指数」自体及び「JPX 日経中小型株指数」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 日経中小型株指数」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 日経中小型株指数」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 日経中小型株指数」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。
「JPX日経インデックス400（JPX日経400）」は、ＪＰＸＩと日経の知的財産であり、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「JPX日経インデックス400（JPX日経400）」の商標又は標章に関するすべての権利はＪＰＸＩと日経が有しています。
<<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に無断で複写、複製、転載または流布することができません。 本資料は JPX 日経中小型株指数 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 日経中小型株指数 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思われる各種情報、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