

用語集(株式)

2024年11月29日

株式インデックス 用語集

用語	定義
5%ルール	Value/Growth に振り分けられた銘柄の時価総額が極端に小さくなるのを避けることを目的としたルール。
Growth インデックス	高 PBR の銘柄で構成されるインデックス。
Russell Nomura Prime インデックス	Total Market インデックスのうち、浮動株調整時価総額上位 1,000 銘柄から構成される投資可能性に配慮したインデックス。
Total Market インデックス	Russell/Nomura 日本株インデックス体系の 1 指数。全上場銘柄の浮動株時価総額上位 98%の銘柄、かつ、銘柄数が 100 の倍数になる銘柄から構成された指数。
Value インデックス	低 PBR の銘柄で構成されるインデックス。
安定持株数	株式の持ち合いや安定保有などによって市場で取引されない株数。
安定持株比率	発行済株式数の中で、大株主が保有していて市場に流通しない株式の割合。
入替日	構成銘柄を変更する日。例えば Russell/Nomura 日本株インデックスの定期入替の場合は、11 月 20 日（休日の場合は翌営業日）が定期入替日となる。
大株主データ	東洋経済新報社が有償で公表している、上場会社の株主情報。
監理銘柄（確認中）	監理銘柄のうち、監理銘柄（審査中）以外に該当する場合に指定。
監理銘柄（審査中）	監理銘柄のうち、有価証券報告書等への虚偽記載や監査報告で不適正意見が示された場合、あるいは上場契約等に対して重大な違反が疑われる場合などに指定。
基準時価総額	指数値の計算で用いる時価総額。資本異動や構成銘柄の変更など市場変動が要因でない時価総額の変動によって指数が変化することを防ぐために算出している。
基準値	各指数値を計算する際に用いる基準の値（例、Prime インデックスの基準日は 1996 年 12 月 30 日で、その日の指数値（=基準値）は 1000）。

基準日	各指数値を計算する際に用いる基準の日（例、Prime インデックスの基準日は 1996 年 12 月 30 日で、その日の指数値（＝基準値）は 1000）。
期中除外ルール	Prime インデックス構成銘柄に関して、時価総額の大幅な下落により、定期入替時に除外する可能性がある銘柄を早期に除外することを目的としたルール。
規模別インデックス	浮動株調整時価総額の割合（サイズ）によって区分した指数。
吸収合併	会社が他の会社とする合併であって、合併により消滅する会社の権利義務の全部を合併後存続する会社に承継させるもの。
業種分類	証券コード協議会が各銘柄を 33 の業種に区分したものの。
組入ウェイト	1 つの銘柄が指数の中で占める時価総額の割合。
組入ウェイトの上限	特定の銘柄に組入ウェイトが偏ってしまうことを抑制するためのルール。
組入株数	発行済株式数のうち、組入比率に応じて指数に組み入れる株数（組入時価総額 ÷ 野村コンポジット株価）。
組入時価総額	組入株数と組入比率の計算に使用する値。指数時価総額に組入ウェイトを乗じたもの。
組入比率	指数計算用発行済株式数に対する組入株数の割合。
公開買付対象会社	株券等の発行会社または第三者が、不特定かつ多数の人に対して、公告等により買付期間・買付数量・買付価格等を提示し、株券等の買付けの申込み又は売付けの申込みの勧誘をおこない、市場外で株券等の買付けをおこなうことを公開買付といい、公開買付の対象となっている会社（銘柄）のことを指す。
構成銘柄	指数に組み込まれている銘柄。
公表開始日	指数の公表を開始した日。
採用日	構成銘柄ではない銘柄を新たに組み入れる日。
指数計算用発行済株式数	発行済株式数を、資本異動ごとに定められた修正のタイミングに従って調整した株式数。
指数時価総額	指数値の計算の際に使用する時価総額。各インデックスで定めているルールに則り計算している。
資本異動	会社の株主資本構成や発行済株式数に対する変更。例えば、株式分割、合併、有償増資、移転など。

修正 PBR	投資スタイル別インデックスの構成銘柄を選定するために用いる基準。バランスシートに記載されている簿価と市場評価額に乖離があるため、その乖離を可能な限りなくすことを目的としている。
上場廃止	上場により取引所の開設する市場における売買の対象であった株式や債券などについて市場の売買対象から除外すること。
除外日	構成銘柄から該当銘柄を除外する日。
新規上場	企業が自社の株を取引所が開設する市場で不特定多数に売買可能にすること。
新設合併	二社以上の会社が行う合併であって、合併により消滅する会社の権利義務の全部を合併により設立した会社に承継させるもの。
推定時価	決算報告書の決算日時点から定期入替基準日の期間の有価証券の含み損益と未認識退職給付債務で修正を加えた値。
スクリーニング	ルールに則り銘柄を選別、選定すること。
スコア	銘柄を選定するための指標。各インデックスで定めているルールによって異なる。
スタイル・プロバビリティ	各銘柄における Value と Growth に振り分ける時価総額の割合。修正 PBR を用いて算出。
全上場銘柄	国内市場に上場している全ての銘柄。
定期入替	定期入替のルールに則り実施する構成銘柄の全入替え。定期入替後に合併・買収やその他の事由によって銘柄が除外される場合は、次回の定期入替まで補充されることなく、構成銘柄は減少する。指数によって定期入替の実施日、実施回数は異なる。
定期入替基準日	定期入替の際に基準となる日。例えば Russell/Nomura 日本株インデックスの定期入替の場合、定期入替基準日 10 月 15 日（休日の場合は前営業日）のデータを用いて指数計算を行う。
投資スタイル別インデックス	修正 PBR を判定基準に、Value（割安）/Growth（成長）といった投資スタイルを反映させた指数。
ネガティブリスト	流動性が著しく低い銘柄の組入を抑制することを目的としたルール。

野村コンポジット株価	直近 60 営業日の値付き率と出来高をもとに、銘柄ごとに適正に値付けされていると考えられる取引所における株価。
配当課税考慮済指数	配当は課税対象であるため、配当課税を考慮した配当総額に基づき算出した指数値。
(安定持株比率考慮後) 浮動株調整時価総額	一般の投資家が市場で取引可能と推計される時価総額。安定持株比率を推計の上、算出される。
米ドルベース指数値	日本円ベース指数値と各インデックス基準日及び計算日の米ドル為替レートを使用して算出した指数値。
銘柄選定母集団	構成銘柄を選定する際に対象となる銘柄群。
リバランスバンド	頻繁な銘柄の入替を抑制することを目的としたルール。
臨時入替	臨時入替のルールに則り実施する構成銘柄の一部入替。定期入替とは異なり、ルールに該当する銘柄のみ入替を実施し、全銘柄の入替は実施しない。
臨時修正	資本異動により株式数に変更が生じた場合、資本移動前後で指数計算上の安定持株比率考慮後の組入株数が変わらないように安定持株比率を修正すること。定期入替、臨時入替とは別に、適宜実施する。