

東証指数ウィークリーインデックスレポート

2012/5/11

- ・今週末の東証株価指数・TOPIXの終値は758.38ポイントとなり、先週末に比べ-4.35% (-34.49ポイント) 下落しました。
- ・今週末の東証REIT指数の終値は935.42ポイントとなり、先週末に比べ-3.8% (-36.98ポイント) 下落しました。
- ・規模別指数で最もパフォーマンスの高い指数は「TOPIX Core30」であり、先週末に比べ-4.12% (-16.83ポイント) 下落しました。
- ・業種別指数(東証33業種)で最もパフォーマンスの高い指数は「空運業」であり、先週末に比べ-0.54% (-1.07ポイント) 下落しました。次いで「輸送用機器」「精密機器」の順となっています。
- ・TOPIX - 17シリーズで最もパフォーマンスの高い指数は「TOPIX-17 自動車・輸送機」であり、先週末に比べ-1.43% (-1.66ポイント) 下落しました。次いで「TOPIX-17 医薬品」「TOPIX-17 運輸・物流」の順となっています。

：当取引所で上場投資信託(ETF)及び先物が取引可能な指数
 ：当取引所で上場投資信託(ETF)が取引可能な指数

1. 市場別指数

指数名称	今週末	前週末比較	2011年末との比較
東証株価指数・TOPIX	758.38	-34.49 -4.35%	+29.77 4.09%
東証第二部株価指数	2,323.98	-73.17 -3.05%	+212.55 10.07%
東証マザーズ指数	352.68	-41.57 -10.54%	-43.53 -10.99%
東証REIT指数	935.42	-36.98 -3.80%	+101.06 12.11%

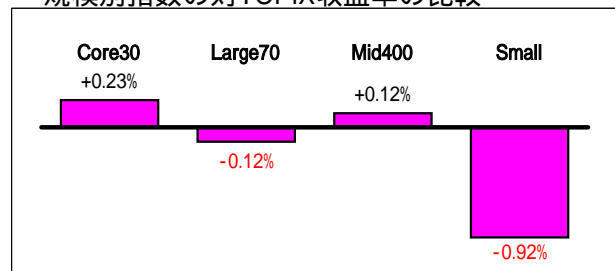
2. 規模別指数

指数名称	今週末	前週末比較	2011年末との比較
TOPIX Core30	392.04	-16.83 -4.12%	+23.26 6.31%
TOPIX Large70	720.54	-33.72 -4.47%	+18.06 2.57%
TOPIX 100	502.77	-22.41 -4.27%	+22.54 4.69%
TOPIX Mid400	813.97	-35.99 -4.23%	+18.03 2.27%
TOPIX 500	590.19	-26.23 -4.26%	+21.98 3.87%
TOPIX Small	901.98	-50.15 -5.27%	+53.61 6.32%
TOPIX 1000	717.63	-32.47 -4.33%	+27.60 4.00%
大型株	724.80	-32.30 -4.27%	+32.50 4.69%
中型株	856.51	-37.87 -4.23%	+18.98 2.27%
小型株	1,331.59	-74.04 -5.27%	+79.13 6.32%

規模別指数のラインナップ



規模別指数の対TOPIX収益率の比較⁽¹⁾



TOPIX Core30
時価総額、流動性の特に高い30銘柄
TOPIX Large70
TOPIX Core30について、時価総額・流動性の高い70銘柄
TOPIX 100 (大型株)
TOPIX Core30とTOPIX Large70の構成銘柄
TOPIX Mid400(中型株)
TOPIX 100について、時価総額、流動性の高い400銘柄
TOPIX 500
TOPIX Core30、TOPIX Large70、TOPIX Mid400の構成銘柄
TOPIX 1000
時価総額、流動性の高い1,000銘柄
TOPIX Small (小型株)
TOPIXの算出対象から、TOPIX 500の構成銘柄を除く

3. スタイル指数

指数名称	今週末		前週末比較		2011年末との比較	
TOPIX バリュース	884.29	-44.53	-4.79%	-		+22.52 2.61%
TOPIX グロース	941.41	-37.81	-3.86%			+51.06 5.73%
TOPIX 500 バリュース	864.45	-42.85	-4.72%			+18.87 2.23%
TOPIX 500 グロース	935.31	-36.36	-3.74%			+50.53 5.71%
TOPIX Small バリュース	1,116.45	-65.22	-5.52%			+69.64 6.65%
TOPIX Small グロース	1,011.25	-53.25	-5.00%			+56.91 5.96%

4. 東証業種別株価指数(33業種)

指数名称	今週末		前週末比較		2011年末との比較	
空運業	197.19	-1.07	-0.54%	-		+2.35 1.21%
輸送用機器	1,549.39	-21.65	-1.38%			+247.63 19.02%
精密機器	2,355.66	-40.20	-1.68%			+267.12 12.79%
陸運業	972.00	-20.44	-2.06%			-9.96 -1.01%
ゴム製品	1,419.64	-31.44	-2.17%			+96.06 7.26%
医薬品	1,229.27	-33.89	-2.68%			+2.21 0.18%
電気・ガス業	333.30	-9.66	-2.82%			-12.69 -3.67%
食料品	825.70	-26.89	-3.15%			+63.94 8.39%
情報・通信業	1,237.74	-44.92	-3.50%			-44.66 -3.48%
化学	721.82	-28.28	-3.77%			+21.38 3.05%
小売業	537.04	-24.57	-4.37%			+24.42 4.76%
金属製品	674.64	-31.45	-4.45%			+38.17 6.00%
サービス業	730.47	-35.44	-4.63%			+33.35 4.78%
卸売業	785.10	-38.56	-4.68%			+40.49 5.44%
電気機器	1,016.08	-51.36	-4.81%			+15.12 1.51%
パルプ・紙	317.48	-16.28	-4.88%			-27.31 -7.92%
機械	823.87	-42.86	-4.95%			+48.84 6.30%
石油・石炭製品	784.91	-41.52	-5.02%			-71.92 -8.39%
繊維製品	404.08	-22.08	-5.18%			+12.06 3.08%
倉庫・運輸関連業	924.28	-51.79	-5.31%			-2.08 -0.22%
その他金融業	259.32	-14.94	-5.45%			+20.44 8.56%
鉄鋼	390.75	-22.63	-5.47%			-17.24 -4.23%
水産・農林業	227.48	-13.27	-5.51%			-12.25 -5.11%
非鉄金属	600.27	-35.09	-5.52%			+35.55 6.30%
ガラス・土石製品	557.61	-36.54	-6.15%			-44.40 -7.38%
銀行業	103.81	-6.80	-6.15%			+3.64 3.63%
不動産業	714.39	-48.30	-6.33%			+92.09 14.80%
その他製品	844.12	-59.18	-6.55%			-48.24 -5.41%
建設業	429.62	-30.64	-6.66%			+6.75 1.60%
鉱業	344.21	-30.81	-8.22%			+1.82 0.53%
保険業	393.67	-37.28	-8.65%			+19.61 5.24%
海運業	271.12	-30.27	-10.04%			-3.36 -1.22%
証券、商品先物取引業	161.43	-20.09	-11.07%			+21.63 15.47%

5. TOPIX-17シリーズ

指数名称	今週末	前週末比較		2011年末との比較	
TOPIX-17 自動車・輸送機	114.31	-1.66	-1.43%	-	+17.53 18.11%
TOPIX-17 医薬品	95.03	-2.62	-2.68%		+0.17 0.18%
TOPIX-17 運輸・物流	84.77	-2.42	-2.78%		-0.74 -0.87%
TOPIX-17 電力・ガス	55.19	-1.60	-2.82%		-2.11 -3.68%
TOPIX-17 食品	141.94	-4.72	-3.22%		+10.51 8.00%
TOPIX-17 素材・化学	100.46	-4.20	-4.01%		+2.40 2.45%
TOPIX-17 情報通信・サービスその他	75.44	-3.31	-4.20%		-1.71 -2.22%
TOPIX-17 小売	93.29	-4.27	-4.38%		+4.24 4.76%
TOPIX-17 電機・精密	80.08	-3.77	-4.50%		+1.99 2.55%
TOPIX-17 商社・卸売	190.76	-9.37	-4.68%		+9.83 5.43%
TOPIX-17 機械	162.36	-8.45	-4.95%		+9.62 6.30%
TOPIX-17 鉄鋼・非鉄	143.15	-8.32	-5.49%		-0.34 -0.24%
TOPIX-17 銀行	66.76	-4.37	-6.14%		+2.34 3.63%
TOPIX-17 建設・資材	103.41	-6.79	-6.16%		-0.19 -0.18%
TOPIX-17 不動産	149.43	-10.10	-6.33%		+19.27 14.80%
TOPIX-17 エネルギー資源	107.48	-7.53	-6.55%		-4.95 -4.40%
TOPIX-17 金融(除く銀行)	52.54	-4.98	-8.66%		+4.06 8.37%

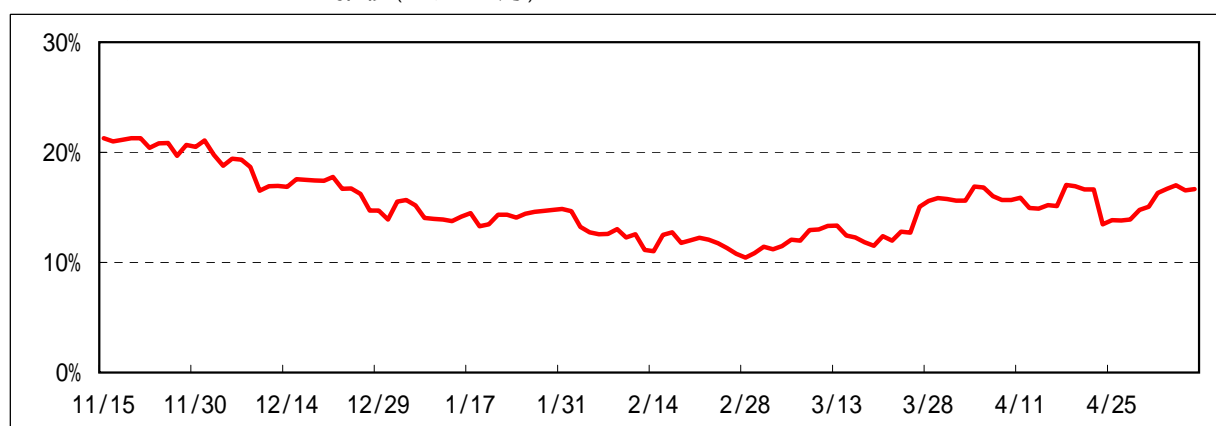
6. 東証コンポジットインデックスシリーズ

指数名称	今週末	前週末比較		2011年末との比較	
TOPIX コンポジット	958.94	-43.58	-4.35%	-	+37.62 4.08%
TOPIX コンポジット 1500	958.49	-43.52	-4.34%		+37.46 4.07%
東証第二部コンポジット指数	1,240.84	-39.07	-3.05%		+113.48 10.07%
東証マザーズコンポジット指数	1,058.97	-124.64	-10.53%		-130.46 -10.97%

7. ヒストリカルボラティリティ

指数名称	ボラティリティ 5/11 現在	前週末比
TOPIX	16.65%	1.60%

ヒストリカルボラティリティの推移(直近6ヶ月)



- 各規模別指数の騰落率(前週末比較)から、TOPIXの騰落率(前週末比較)を除いて算出。規模別指数毎のパフォーマンスの違いを表している。
- 騰落率は小数点第3位四捨五入
- ボラティリティは対象指数20日分の騰落率から算出したヒストリカルボラティリティです。

$$HV = \sqrt{250 \times \left(\sum (x_t - x_a)^2 / (n-1) \right)}$$

$$x_t = \log(P/P-1) \quad x_a = \left(\sum x_t \right) / n$$

n=20 P=TOPIX終値 t=1 ~ n

お問合せ先

株式会社東京証券取引所 情報サービス部 050-3377-7754(直通) index@tse.or.jp

ひろぎんウツミ屋証券株式会社

金融商品取引法に基づく表示事項

本資料をお客様にご提供する金融商品取引業者名等

商号等：ひろぎんウツミ屋証券株式会社

金融商品取引業者：中国財務局長（金商）第 20 号

加入協会：日本証券業協会、一般社団法人金融先物取引業協会

手数料等及びリスクについて

株式の売買取引には、約定代金に対して最大 1.1025%（税込み）（当該金額が 2,625 円に満たない場合には、2,625 円（税込み））の手数料が必要となります。

インターネット取引口座の場合

約定代金に対して最大 8,400 円、最低 157 円（電話注文の場合、約定代金に対して最大 0.60375%、最低手数料 2,625 円）の委託手数料が必要となります。（手数料は何れも税込み）各商品等には価格の変動等による損失を生じるおそれがあります。

コールセンター取引口座の場合

約定代金に対して最大 0.60375%（最低手数料 2,100 円 消費税込）の委託手数料が必要となります。

詳しくは、上場有価証券等書面をお読み下さい。

株式の売買取引については株価の変動により、投資元本を割り込むことがあります。また、発行者の経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化等により、投資元本を割り込むことがあります。外国株式は、為替の変動などにより損失が生じるおそれがあります。

非上場債券（国債、地方債、政府保証債、社債）を当社が相手方となり、お買い付けいただく場合は、購入対価のみお支払いいただきます。

債券は、金利水準の変動等により価格が上下し、損失を生じるおそれがあります。

外国債券は、為替相場及び債券価格の変動等により損失が生じるおそれがあります。

ひろぎんウツミ屋証券免責事項

本資料は、投資判断の参考となる情報の提供のみを目的とし、投資勧誘を目的としておりません。本資料で、言及した銘柄は、投資に関する経験や知識、経済状況及び投資目的が異なる全てのお客様に一律に適合するとは限りません。また株式・債券等の有価証券の投資には「手数料等及びリスク」に記載の通り、損失が生じる恐れがあります。投資判断の最終決定は、お客様のご自身の判断で行っていただくようお願いいたします。

本資料に含まれるデータ等は、信頼しうる情報源から得たものですが、その正確性・完全性については当社が保証するものではありません。

本資料に基づき投資を行った結果、お客様に何らかの損害が発生した場合でも、当社は理由の如何を問わず、一切責任を負いません。