

# 東証指数マンスリーインデックスレポート

2012/4/27

- ・ 今月末の東証株価指数・TOPIXの終値は804.27ポイントとなり、先月末に比べ-5.86% (-50.08ポイント) 下落しました。
- ・ 今月末の東証REIT指数の終値は970.61ポイントとなり、先月末に比べ-1.92% (-19.03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 Small」であり、先月末に比べ-4.23% (-42.21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「その他金融業」であり、先月末に比べ-1.95% (-5.6ポイント) 下落しました。次いで「サービス業」「小売業」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 小売」であり、先月末に比べ-2.66% (-2.68ポイント) 下落しました。次いで「TOPIX-17 食品」「TOPIX-17 素材・化学」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	今月末	前月末比較	2011年末との比較
東証株価指数・TOPIX	804.27	-50.08 -5.86%	+75.66 10.38%
東証第二部株価指数	2,411.51	-23.07 -0.95%	+300.08 14.21%
東証マザーズ指数	391.62	+5.34 1.38%	-4.59 -1.16%
東証REIT指数	970.61	-19.03 -1.92%	+136.25 16.33%

## 2. 規模別指数

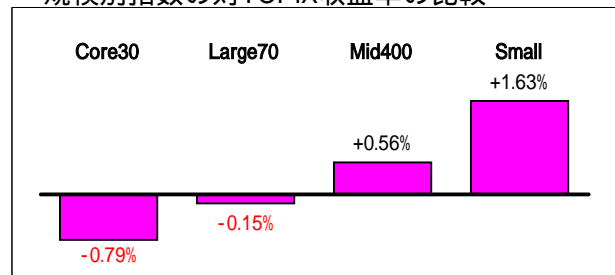
指数名称	今月末	前月末比較	2011年末との比較
TOPIX Core30	417.31	-29.72 -6.65%	+48.53 13.16%
TOPIX Large70	770.85	-49.33 -6.01%	+68.37 9.73%
TOPIX 100	536.32	-36.56 -6.38%	+56.09 11.68%
TOPIX Mid400	853.61	-47.75 -5.30%	+57.67 7.25%
TOPIX 500	625.98	-40.12 -6.02%	+57.77 10.17%
TOPIX Small	955.40	-42.21 -4.23%	+107.03 12.62%
TOPIX 1000	760.94	-47.90 -5.92%	+70.91 10.28%
大型株	773.16	-52.70 -6.38%	+80.86 11.68%
中型株	898.22	-50.24 -5.30%	+60.69 7.25%
小型株	1,410.46	-62.31 -4.23%	+158.00 12.62%

### 規模別指数のラインナップ



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

### 規模別指数の対TOPIX収益率の比較<sup>(1)</sup>



### 3. スタイル指数

指数名称	今月末		前月末比較		2011年末との比較
TOPIX バリュウ	945.44	-71.16	-7.00%	-	+83.67 9.71%
TOPIX グロウ	989.54	-47.42	-4.57%		+99.19 11.14%
TOPIX 500 バリュウ	924.79	-71.53	-7.18%		+79.21 9.37%
TOPIX 500 グロウ	982.68	-48.53	-4.71%		+97.90 11.06%
TOPIX Small バリュウ	1,186.33	-64.18	-5.13%		+139.52 13.33%
TOPIX Small グロウ	1,067.60	-36.02	-3.26%		+113.26 11.87%

### 4. 東証業種別株価指数 (33業種)

指数名称	今月末		前月末比較		2011年末との比較
その他金融業	281.47	-5.60	-1.95%	-	+42.59 17.83%
サービス業	763.04	-18.32	-2.34%		+65.92 9.46%
小売業	563.96	-15.43	-2.66%		+51.34 10.02%
情報・通信業	1,291.43	-37.51	-2.82%		+9.03 0.70%
食料品	849.68	-26.13	-2.98%		+87.92 11.54%
繊維製品	429.74	-14.42	-3.25%		+37.72 9.62%
化学	755.64	-30.09	-3.83%		+55.20 7.88%
ゴム製品	1,487.42	-62.09	-4.01%		+163.84 12.38%
陸運業	997.20	-42.07	-4.05%		+15.24 1.55%
精密機器	2,440.47	-109.43	-4.29%		+351.93 16.85%
水産・農林業	240.05	-11.20	-4.46%		+0.32 0.13%
機械	883.29	-43.14	-4.66%		+108.26 13.97%
不動産業	796.32	-39.99	-4.78%		+174.02 27.96%
医薬品	1,253.27	-67.28	-5.09%		+26.21 2.14%
卸売業	830.28	-46.79	-5.33%		+85.67 11.51%
鉱業	377.43	-21.42	-5.37%		+35.04 10.23%
パルプ・紙	337.25	-20.73	-5.79%		-7.54 -2.19%
空運業	211.69	-14.61	-6.46%		+16.85 8.65%
輸送用機器	1,609.02	-112.02	-6.51%		+307.26 23.60%
倉庫・運輸関連業	980.54	-70.27	-6.69%		+54.18 5.85%
銀行業	112.24	-8.26	-6.85%		+12.07 12.05%
金属製品	712.43	-53.08	-6.93%		+75.96 11.93%
建設業	458.01	-34.89	-7.08%		+35.14 8.31%
非鉄金属	644.62	-51.21	-7.36%		+79.90 14.15%
電気・ガス業	349.58	-27.89	-7.39%		+3.59 1.04%
電気機器	1,091.68	-89.90	-7.61%		+90.72 9.06%
ガラス・土石製品	613.88	-51.52	-7.74%		+11.87 1.97%
石油・石炭製品	826.03	-84.21	-9.25%		-30.80 -3.59%
海運業	314.67	-32.63	-9.40%		+40.19 14.64%
証券、商品先物取引業	189.64	-20.13	-9.60%		+49.84 35.65%
その他製品	924.17	-104.32	-10.14%		+31.81 3.56%
保険業	441.38	-52.71	-10.67%		+67.32 18.00%
鉄鋼	425.93	-60.65	-12.46%		+17.94 4.40%

## 5. TOPIX-17シリーズ

指数名称	今月末	前月末比較			2011年末との比較	
TOPIX-17 小売	97.97	-2.68	-2.66%	-	+	+8.92 10.02%
TOPIX-17 食品	146.16	-4.56	-3.03%			+14.73 11.21%
TOPIX-17 素材・化学	105.46	-4.23	-3.86%			+7.40 7.55%
TOPIX-17 情報通信・サービスその他	79.32	-3.27	-3.96%			+2.17 2.81%
TOPIX-17 機械	174.07	-8.51	-4.66%			+21.33 13.96%
TOPIX-17 不動産	166.56	-8.37	-4.78%			+36.40 27.97%
TOPIX-17 運輸・物流	88.20	-4.44	-4.79%			+2.69 3.15%
TOPIX-17 医薬品	96.88	-5.21	-5.10%			+2.02 2.13%
TOPIX-17 商社・卸売	201.74	-11.37	-5.34%			+20.81 11.50%
TOPIX-17 自動車・輸送機	118.78	-8.04	-6.34%			+22.00 22.73%
TOPIX-17 銀行	72.18	-5.32	-6.86%			+7.76 12.05%
TOPIX-17 建設・資材	110.99	-8.65	-7.23%			+7.39 7.13%
TOPIX-17 電機・精密	85.72	-6.75	-7.30%			+7.63 9.77%
TOPIX-17 電力・ガス	57.89	-4.62	-7.39%			+0.59 1.03%
TOPIX-17 エネルギー資源	115.34	-9.25	-7.42%			+2.91 2.59%
TOPIX-17 金融(除く銀行)	59.24	-5.71	-8.79%			+10.76 22.19%
TOPIX-17 鉄鋼・非鉄	155.10	-18.18	-10.49%			+11.61 8.09%

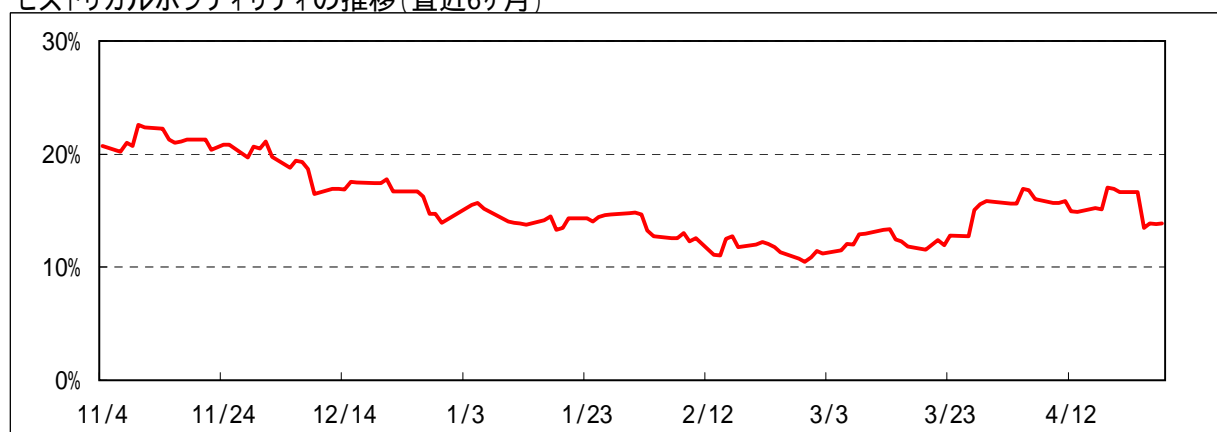
## 6. 東証コンポジットインデックスシリーズ

指数名称	今月末	前月末比較			2011年末との比較	
TOPIX コンポジット	1,016.94	-63.29	-5.86%	-	+	+95.62 10.38%
TOPIX コンポジット 1500	1,016.41	-63.38	-5.87%			+95.38 10.36%
東証第二部コンポジット指数	1,287.58	-12.31	-0.95%			+160.22 14.21%
東証マザーズコンポジット指数	1,175.78	+16.04	1.38%			-13.65 -1.15%

## 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 4/27 現在	前月末比
TOPIX	13.89%	-1.88%

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(前月末比較)から、TOPIXの騰落率(前月末比較)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日分の終値から算出したヒストリカルボラティリティ。

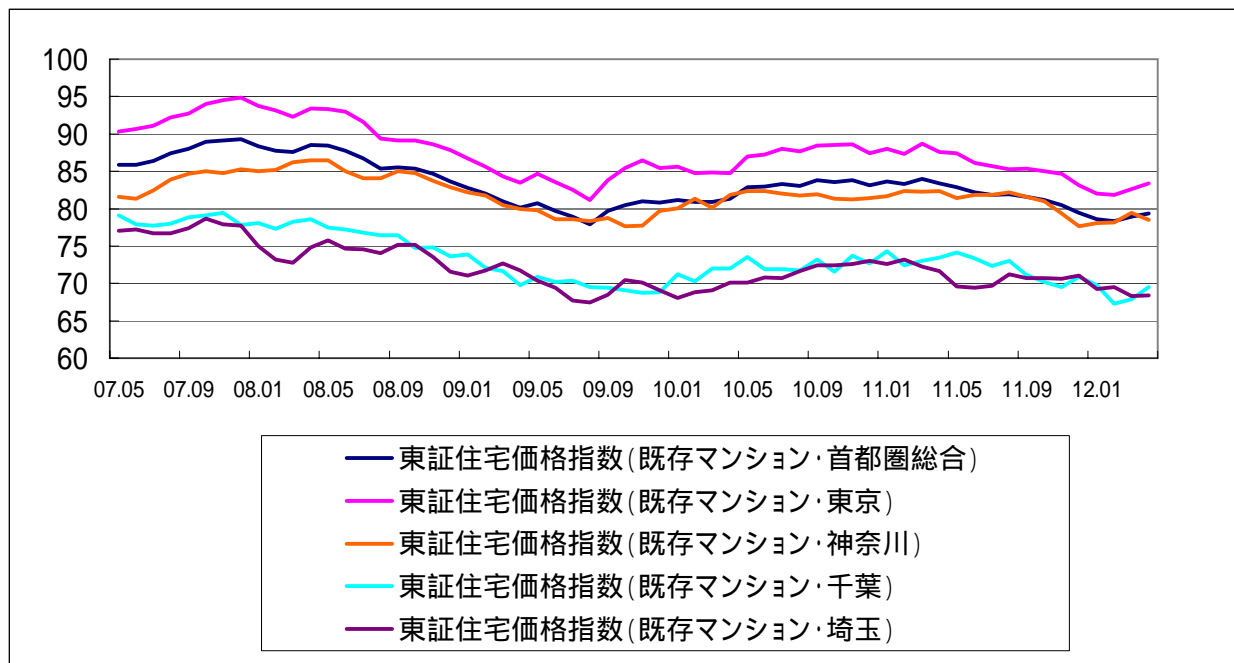
$$HV = \sqrt{250 \times \left( \sum (x_t - x_a)^2 / (n-1) \right)}$$

$$X_t = \log(P/P-1) \quad X_a = (\sum X_t) / n$$

$$n=20 \quad P=\text{TOPIX終値} \quad t=1 \sim n$$

## 8.住宅価格指数

指数名	今月末
東証住宅価格指数(既存マンション・首都圏総合)	79.35
東証住宅価格指数(既存マンション・東京)	83.36
東証住宅価格指数(既存マンション・神奈川)	78.51
東証住宅価格指数(既存マンション・千葉)	69.55
東証住宅価格指数(既存マンション・埼玉)	68.41



### 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 index@tse.or.jp