

## 新経連株価指数メソドロジー改定履歴

2019年9月13日改定

「銘柄入替え方法」、「ウェイト調整」の項目につき、実施日・適用日等を明確にしました。

	変更前	変更後
名称	新経連株価指数 (Japan New Economy Index)	新経連株価指数 (Japan New Economy Index)
構成銘柄数	96社 (2019年6月5日現在)	<u>98社 (2019年8月1日現在) ※2019年9月23日 (月) から計算式に反映。</u>
対象銘柄	毎年8月1日時点で、以下の1および2のいずれにも該当する全ての銘柄を構成銘柄として採用。 1. 一般社団法人新経済連盟に加盟する一般会員であること。 2. 東京証券取引所の市場第一部、市場第二部、マザーズ、JASDAQに上場する銘柄であること。	毎年8月1日時点で、以下の1および2のいずれにも該当する全ての銘柄を構成銘柄として採用。 1. 一般社団法人新経済連盟に加盟する一般会員であること 2. 東京証券取引所の市場第一部、市場第二部、マザーズ、JASDAQに上場する銘柄であること。
銘柄入替え方法	毎年8月1日を基準日として、上記要件を満たす銘柄を確定。9月に入替えを実施。	毎年8月1日を基準日として、上記要件を満たす銘柄を確定。 <u>9月第三金曜日 (祝日の場合は前営業日) 取引終了後に銘柄入替えを実施し、翌営業日から計算式に反映。(※1)</u>
算出方法	浮動株調整時価総額加重平均型 (3%キャップ付き)	浮動株調整時価総額加重平均型 (3%キャップ付き)
ウェイト調整 (指数リバランス)	ウェイトを調整する指数リバランスを四半期に一度実施 (3月、6月、9月、12月)。	<u>ウェイトを調整する指数リバランスを四半期 (3月、6月、9月、12月) に一度実施。リバランス月の第二金曜日の前営業日の終値に基づき、各銘柄につき3%の組入れ上限 (キャップ) を計算し、第三金曜日の取引終了後に実施。翌営業日から計算式に反映。(※2)</u>
算出開始日	2019年6月5日 (水) 新経済連盟のウェブサイトにて、毎営業日の終値をもとに翌朝更新	2019年6月5日 (水) 新経済連盟のウェブサイトにて、毎営業日の終値をもとに翌朝更新
起算日	2012年6月1日 (終値)	2012年6月1日 (終値)
基準値	1,000ポイント	1,000ポイント
算出委託先	STOXXリミテッド社 (ドイツ取引所グループ)	STOXXリミテッド社 (ドイツ取引所グループ)

(※1) 2019年度は、9月23日 (月) から新たな構成銘柄が計算式に反映されます。

新たな構成銘柄を基にした指数値 (9月23日 (月) の終値) が新経済連盟のウェブサイトに表示されるのは翌朝9月24日 (火) となります。

(※2) 2019年9月については、9月12日 (木) の終値に基づき、ウェイト調整を行い、9月23日 (月) の計算式から反映いたします。調整後の指数値 (9月23日 (月) の終値) が新経済連盟のウェブサイトに表示されるのは翌朝9月24日 (火) となります。

注) 「営業日」について、新経連株価指数はSTOXXアジアカレンダー (1月1日を除く平日を取引日とし、指数を算出) を採用しています。

# 新経連株価指数メソドロジー改定履歴

2019年7月11日改定

メソドロジーの内容をより明確にしました。

	変更前	変更後
名称	新経連株価指数 (Japan New Economy Index)	新経連株価指数 (Japan New Economy Index)
構成銘柄数	96社 (2019年6月5日現在)	96社 (2019年6月5日現在)
対象銘柄	一般社団法人新経済連盟に加盟する一般会員のうち、東京証券取引所上場銘柄 (市場第一部、市場第二部、マザーズ、JASDAQ)	<u>毎年8月1日時点で、以下の1および2のいずれにも該当する全ての銘柄を構成銘柄として採用。</u> <u>1. 一般社団法人新経済連盟に加盟する一般会員であること。</u> <u>2. 東京証券取引所の市場第一部、市場第二部、マザーズ、JASDAQに上場する銘柄であること。</u>
銘柄の定期見直し	毎年8月1日を基準日として上記対象銘柄に該当するものを確定し、9月1日より入替えを実施	<u>毎年8月1日を基準日として、上記要件を満たす銘柄を確定。9月に入替えを実施。</u>
算出方法	浮動株調整時価総額加重平均型 (3%キャップ付き)	浮動株調整時価総額加重平均型 (3%キャップ付き)
<u>ウェイト調整</u> <u>(指数リバランス)</u>	(新設)	<u>ウェイトを調整する指数リバランスを四半期に一度実施 (3月、6月、9月、12月)。</u>
算出開始日	2019年6月5日 (水) 新経済連盟のウェブサイトにて、毎営業日の終値をもとに翌朝更新	2019年6月5日 (水) 新経済連盟のウェブサイトにて、毎営業日の終値をもとに翌朝更新
起算日	2012年6月1日 (終値)	2012年6月1日 (終値)
基準値	1,000ポイント	1,000ポイント
算出委託先	STOXXリミテッド社 (ドイツ証券取引所グループ)	STOXXリミテッド社 (ドイツ取引所グループ)