

～ NPM関連データサービス ～

— 日本上場株式 日次リターンデータ —
(日次+週次+月次)

データ仕様書

※本資料は、「日本上場株式日次リターンデータ(日次+週次+月次)」の仕様書です。提供する各種加工データは、信頼できると思われるデータソースから十分な注意を払い、加工・作成しておりますが、その完全性・正確性を保証するものではありません。また、本情報の利用によって生じた直接的又は間接的な損害については、その内容、態様の如何を問わず、弊社はその一切の責任を負うものではありません。

2021年10月

株式会社金融データソリューションズ

～ NPM関連データサービス ～

日本上場株式 日次リターンデータ

株式会社金融データソリューションズ

本資料は、「日本上場株式 日次リターンデータ」に収録されるデータ項目の仕様書になります。実際のデータは、付随の「NPM 関連データベースDataViewer」を通じて閲覧、抜粋、ファイル出力などをお願いします。DataViewer の利用方法につきましては、「DataViewerGuide.pdf」をご参照下さい。

収録期間 1976年12月28日 ～ 2021年9月30日 (11,441証券営業日)
 収録銘柄 取引所上場全銘柄 (JDR等は除く) 延べ6,648銘柄
 + TOPIX/東証業種別指数/JASDAQ指数等 計82指数
 ※ データ日付=2012年10月1日からETF/ETNの収録を開始しました。
 収録件数 34,856,674 records

データ仕様

データ名称	NPM DataViewerの項目名	単位	定義
1 FDS 会社コード	NKCODE		【第1KEY】。7桁コード。 指数レコードは独自に割り振っている (5～6ページ目参照)。
2 データ日付	DATA_DATE		【第2KEY】。YYYYMMDD形式。
3 証券コード	SECCODE		4桁コード。証券コードの変更・再附番などもそのまま収録。 指数レコードは独自に割り振っている (5～6ページ目参照)。
4 東証 33 業種分類業種コード	TSE33		1～33。7ページ目の「業種分類一覧」を参照。 外国株式(含カントリーファンド)の一部・優先出資証券・JREIT(不動産投信)・インフラファンド・特殊投資法人、合併上場廃止期間は欠損値。 東証業種別指数は、当該業種を表す1～33の数字を収録。
5 中分類業種コード	NK36		1～36。7ページ目の「業種分類一覧」を参照。 1993年12月30日以前、及び合併上場廃止期間、および指数レコードは欠損値。 2012年10月1日以降は未収録。
6 厚生年金主市場コード	MAIN_MKT		‘01’:東京 ‘02’:大阪 ‘03’:名古屋 ‘04’:京都 ‘05’:広島 ‘06’:福岡 ‘07’:新潟 ‘08’:札幌 ‘09’:JASDAQ (旧店頭) ‘11’:ヘラクレス (旧ナスダック・ジャパン) 株価を採用した市場を収録。指数レコードは一律で‘99’を収録。 詳細は「<ご参考>配当込み収益率の計算定義.doc」を参照。
7 東京上場部	M1		0:非上場(or 指数) 1:1部 2:2部 3:外国部 5: TOKYO PRO Market 8:マザーズ 9:ETF/ETN マザーズは 19991222～、TOKYO PRO Market (TOKYO AIM が 20120701 付で改称) は 20110715～収録。 信金中金は1で収録。 以下は 20130716～の追加定義 (東証大証の現物市場統合以降) 6:JASDAQ スタンダード 7:JASDAQ グロース ベンチャーファンドは2で収録。

			<p>カンントリーファンドは3で収録。 日本銀行は6で収録。</p>
8	大阪上場部	M2	<p>0:非上場(or 指数) 1:1部 2:2部 3:カンントリーファンド 5:新2部 8:新市場部 9:ETF/ETN カンントリーファンドは19911220～収録。 新2部は19860830～19951229まで収録。 新市場部は19971222～20030331まで収録。 ベンチャーファンドは2で収録。 20130712(東証大証の現物市場統合の前営業日)まで収録。</p>
9	名古屋上場部	M3	<p>0:非上場(or 指数) 1:1部 2:2部 4:上場 8:セントレックス 9:ETF/ETN 19790402～収録。 19790402～19971219は上場部の区分なしですべて上場は4。 セントレックスは20010730～。</p>
10	京都上場部	M4	<p>0:非上場(or 指数) 4:上場 19860830～20010228まで収録。</p>
11	広島上場部	M5	<p>0:非上場(or 指数) 4:上場 19860830～20000229まで収録。</p>
12	福岡上場部	M6	<p>0:非上場(or 指数) 4:上場 8:Qボード 9:ETF/ETN 19860830～収録。 Qボードは20030214～収録。</p>
13	新潟上場部	M7	<p>0:非上場(or 指数) 4:上場 19860830～20000229まで収録。</p>
14	札幌上場部	M8	<p>0:非上場(or 指数) 4:上場 8:アンビシヤス 9:ETF/ETN 19860830～収録。 アンビシヤスは20010730～収録。</p>
15	JASDAQ上場部 (旧店頭)	M9	<p>19860901～20041210 0:未登録(or 指数) 1:店頭登録 3:店頭管理 20041213～20101008 0:非上場(or 指数) 1:上場 8:NEO 20101012～ 0:非上場(or 指数) 1:JASDAQスタンダード(内国株) 2:JASDAQ グロス(内国株) 3:JASDAQスタンダード(外国株) 4:JASDAQ グロス(外国株) 日本銀行は1で収録。 20130712(東証大証の現物市場統合の前営業日)まで収録。</p>
16	ヘラクレス上場部	M10	<p>0:非上場(or 指数) 3:スタンダード外国株 4:スタンダード(内国株) 8:グロス(内国株) 9:グロス外国株 20000619～20101008まで収録。</p>
17	評価株価	CLOSE_P	<p>[円] 厚生年金評価価格に準拠した評価株価。 詳細は「<ご参考>配当込み収益率の計算定義.doc」を参照。 TOPIX等の指数は配当込み指数値。但し、JASDAQとヘラクレスの配当込み指数は金融データソリューションズの計算値を収録。 また、下記の指数は、公表されていない過去分について一部金融データソリューションズの推定計算値を収録している。 TOPIX → 19890104以降は取引所公表値、それ以前は推定値 33業種指数 → 19930705以降は取引所公表値、それ以前は推定値</p>
18	普通株発行済株式数	CMSHARE	<p>[株] 優先株等の種類株式を除いた普通株発行済株式数。 外国株式(含カンントリーファンド)の一部・合併上場廃止期間・指数レコードは欠損値。</p>

			※ADRの外国株は、2007/4/9より本国市場の株式数からADR数へ変更。 1976年12月28日は未収録。
19	現金配当修正係数	COEFF_DIV	現金配当を含む修正係数。 詳細は「<ご参考>配当込み収益率の計算定義.doc」を参照。 権利落ち日以外は、1が収録される。指数レコードは一律で1。
20	現金配当なし修正係数	COEFF_NON DIV	現金配当を含まない修正係数。 権利落ち日以外は、1が収録される。指数レコードは一律で1。
21	配当込み収益率	ROR	[%] 当該データ日付をtとすると「(t-1)～t」までの期間における配当込み収益率。新規上場初日はIPOの売出・公募価格を基準とした収益率を収録(但し、次ページの「ご注意点3」を参照)。 詳細は「<ご参考>配当込み収益率の計算定義.doc」を参照。
22	出来区分	V_FLAG	収益率計算に使用した評価時価の種類。 ～20120928 10:終値 20:店頭翌日基準値段 30:最終気配 31:売気配 32:買気配 50:権利落ち理論値 or 引継値 55:気配の平均値 60:廃止銘柄加工算出値 65:廃止銘柄金銭交付額 99:採用値無し 20121001～ 10:終値 31:特別売気配 32:特別買気配 50:権利落ち理論値 or 引継値 60:廃止銘柄加工算出値 65:廃止銘柄金銭交付額 99:採用値無し 指数レコードは一律で10を収録。
23	出来高	VOLUME	[株] 「厚生年金主市場コード」の市場における出来高。 指数レコードは欠損値。 1976年12月28日は厚生年金主市場が大阪の銘柄が未収録。
24	修正株価	ADJ_CLOSE _P	[円] 当該銘柄の最新日付(T)における「評価株価」(P)を基準とした修正株価。修正株価(t)=P(t)×累積現金配当込み修正係数(t)/累積現金配当込み修正係数(T)。

ご注意点

- 全期間に上場登録していない銘柄は、存在期間のみの収録となります。
- 収録期間中の被合併銘柄は、上場廃止以降合併期日まで、終値・修正係数(配当込み&配当無し)・配当込み収益率が収録されます。この期間に該当するレコードは、出来区分='60' or '65' となります。
- 新規上場初日の「配当込み収益率」は、IPOの売出価格、または公募価格を基準とした収益率を計算・収録していますが、以下の点にご注意ください。
 - 売出か公募(あるいは双方)を行い、売出や公募の価格が存在する銘柄に限り、①合併により持株会社等の新設会社が新規上場した場合、②会社分割でその一部の会社が新規上場した場合、③公募・売出し無しで新規上場した場合、などはIPO価格が存在しないため、収益率は欠損値になります。
 - 外国株式やカンツリーファンド、特殊投資法人の一部は、収録対象外(欠損値)となります。
 - 1989年以前は、売出・公募価格の情報が無い銘柄も存在します(欠損値で収録)。
 - 1986年8月以前の地方単独上場(広島・京都・福岡・新潟・札幌)、旧店頭登録(東京・大阪・名古屋)は本データの収録対象外となっていますが、これらの銘柄が、売出・公募を伴って東証・大証・名証へ上場した場合は、当該上場初日の収益率も計算・収録対象としています。
 - 再上場銘柄は、再上場時に売出 or 公募を伴えば、再上場初日収益率を計算・収録しています。
 - 売出・公募価格決定から新規上場前日までに発生した権利落ちや配当は考慮されません。
 - 2012年10月以降に上場した銘柄でIPO価格が無い場合、取引所基準値からの収益率を収録しています。
- 指数レコードは、次ページのように「FDS会社コード」と「証券コード」を独自に割当てています。
- 2020年10月1日は東京証券取引所が全銘柄の売買を終日停止したため、証券休日として扱います。

データ日付=2012年10月1日以降の変更点(データソース変更後)

1. 会社コードについては、2012年10月1日以降、金融データソリューションズが定義する会社コード体系(FDS会社コード)となります。但し、過去遡及は致しませんので過去(2012年9月30日以前)のコード体系に関しましては、実質的に変更はございません。
2. ETF/ETNは2012年10月1日からの収録です。この日の配当込み収益率は、前営業日の価格の有無に関わらず欠損値となります。また、配当込み収益率は、1口当り予想分配金を用いて計算します。
3. 合併上場廃止期間(上場廃止翌日～合併期日当日まで)の間の被合併銘柄の収録は、上場会社への合併・株式交換・株式移転・三角合併・三角株式交換・三角株式移転、および金銭交付による合併のケースに限定します。従いまして、2012年9月以前に収録されていた「MBOによる株式非公開化」や「種類株発行による完全子会社化のケース」などの合併上場廃止期間のデータは、未収録となります。
4. 普通株発行済株式数を算出するためのコーポレートアクションの反映タイミングが少し変わります。具体的には、自社株買い(異動終了日または確定日を含む月末日へ変更)・第三者割当(払込期日 2営業日後へ変更)については反映タイミングが少し遅くなります。また、株主割当増資の有償割当増加分は、新株の払込期日までは株式数を増やさない方式に変更します(これまでは権利落日に株数を増加させていました)。それ以外の「その他調整」部分については、同時もしくは反映が早くなります。
5. 厚生年金主市場や評価株価の決定方法、現金配当込み修正係数や配当込み収益率の計算方法の変更点に関しては、別途ご提供の「<ご参考>配当込み収益率の計算定義.doc」をご参照ください。

収録されている指数レコード一覧

FDS 会社コード	証券 コード	指数名	データ 期間
IDX1000	1000	東証株価指数(TOPIX)	19821001～
IDX1001	1001	東証業種別株価指数(水産・農林業)	19821001～
IDX1002	1002	東証業種別株価指数(鉱業)	19821001～
IDX1003	1003	東証業種別株価指数(建設業)	19821001～
IDX1004	1004	東証業種別株価指数(食料品)	19821001～
IDX1005	1005	東証業種別株価指数(繊維製品)	19821001～
IDX1006	1006	東証業種別株価指数(パルプ・紙)	19821001～
IDX1007	1007	東証業種別株価指数(化学)	19821001～
IDX1008	1008	東証業種別株価指数(医薬品)	19821001～
IDX1009	1009	東証業種別株価指数(石油・石炭製品)	19821001～
IDX1010	1010	東証業種別株価指数(ゴム製品)	19821001～
IDX1011	1011	東証業種別株価指数(ガラス・土石製品)	19821001～
IDX1012	1012	東証業種別株価指数(鉄鋼)	19821001～
IDX1013	1013	東証業種別株価指数(非鉄金属)	19821001～
IDX1014	1014	東証業種別株価指数(金属製品)	19821001～
IDX1015	1015	東証業種別株価指数(機械)	19821001～
IDX1016	1016	東証業種別株価指数(電気機器)	19821001～
IDX1017	1017	東証業種別株価指数(輸送用機器)	19821001～
IDX1018	1018	東証業種別株価指数(精密機器)	19821001～
IDX1019	1019	東証業種別株価指数(その他製品)	19821001～
IDX1020	1020	東証業種別株価指数(電気・ガス業)	19821001～
IDX1021	1021	東証業種別株価指数(陸運業)	19821001～
IDX1022	1022	東証業種別株価指数(海運業)	19821001～
IDX1023	1023	東証業種別株価指数(空運業)	19821001～
IDX1024	1024	東証業種別株価指数(倉庫・運輸関連業)	19821001～
IDX1025	1025	東証業種別株価指数(情報・通信業)	19821001～
IDX1026	1026	東証業種別株価指数(卸売業)	19821001～
IDX1027	1027	東証業種別株価指数(小売業)	19821001～
IDX1028	1028	東証業種別株価指数(銀行業)	19821001～
IDX1029	1029	東証業種別株価指数(証券・商品先物取引業)	19821001～
IDX1030	1030	東証業種別株価指数(保険業)	19821001～
IDX1031	1031	東証業種別株価指数(その他金融業)	19821001～
IDX1032	1032	東証業種別株価指数(不動産業)	19821001～
IDX1033	1033	東証業種別株価指数(サービス業)	19821001～
IDX1034	1034	東証規模別株価指数 大型株	19930705～
IDX1035	1035	東証規模別株価指数 中型株	19930705～
IDX1036	1036	東証規模別株価指数 小型株	19930705～
IDX1037	1037	東証第二部株価指数	19930705～
IDX1038	1038	東証マザーズ指数	20000331～
IDX1039	1039	東証REIT指数	20030331～

FDS 会社コード	証券 コード	指数名	データ 期間
IDX1040	1040	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX Core30	19990618～
IDX1041	1041	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX Large70	19990618～
IDX1042	1042	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX 100	19990618～
IDX1043	1043	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX Mid400	19990618～
IDX1044	1044	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX 500	19990618～
IDX1045	1045	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX 1000	19980911～
IDX1046	1046	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX Small	19990618～
IDX1047	1047	TOPIX コンポジット	20111011～
IDX1048	1048	TOPIX コンポジット1500	20111011～ 20180831
IDX1049	1049	東証二部コンポジット指数	20111011～
IDX1050	1050	マザーズコンポジット	20111011～
IDX1051	1051	TOPIX-17シリーズ 食品	20111011～
IDX1052	1052	TOPIX-17シリーズ エネルギー資源	20111011～
IDX1053	1053	TOPIX-17シリーズ 建設・資材	20111011～
IDX1054	1054	TOPIX-17シリーズ 素材・化学	20111011～
IDX1055	1055	TOPIX-17シリーズ 医薬品	20111011～
IDX1056	1056	TOPIX-17シリーズ 自動車・輸送機	20111011～
IDX1057	1057	TOPIX-17シリーズ 鉄鋼・非鉄	20111011～
IDX1058	1058	TOPIX-17シリーズ 機械	20111011～
IDX1059	1059	TOPIX-17シリーズ 電機・精密	20111011～
IDX1060	1060	TOPIX-17シリーズ 情報通信・サービスその他	20111011～
IDX1061	1061	TOPIX-17シリーズ 電力・ガス	20111011～
IDX1062	1062	TOPIX-17シリーズ 運輸・物流	20111011～
IDX1063	1063	TOPIX-17シリーズ 商社・卸売	20111011～
IDX1064	1064	TOPIX-17シリーズ 小売	20111011～
IDX1065	1065	TOPIX-17シリーズ 銀行	20111011～
IDX1066	1066	TOPIX-17シリーズ 金融(除く銀行)	20111011～
IDX1067	1067	TOPIX-17シリーズ 不動産	20111011～
IDX1068	1068	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX バリュウ	20111011～
IDX1069	1069	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX 500 バリュウ	20111011～
IDX1070	1070	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX small バリュウ	20111011～
IDX1071	1071	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX グロウ	20111011～
IDX1072	1072	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX 500 グロウ	20111011～
IDX1073	1073	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX small グロウ	20111011～
IDX1074	1074	東証配当フォーカス100 指数	20111011～
IDX1075	1075	東証REIT用途別指数シリーズ オフィス	20111011～
IDX1076	1076	東証REIT用途別指数シリーズ 住宅	20111011～
IDX1077	1077	東証REIT用途別指数シリーズ 商業・物流等	20111011～
IDX1078	1078	TOPIX アジア関連株指数	20111007～ 20160826
IDX1079	1079	東証マザーズCore 指数	20111007～
IDX1080	1080	JASDAQ 指数(FDS算出の配当込指数値)	19921228～
IDX1081	1081	ヘラクレス 指数(FDS算出の配当込指数値)	20000619～ 20101008

業種分類一覧

※ 「中分類業種」は、2012年10月1日以降、未収録となります。

東証33業種分類

業種 コード	業種名
1	水産・農林
2	鉱業
3	建設
4	食料品
5	繊維製品
6	パルプ・紙
7	化学
8	医薬品
9	石油・石炭製品
10	ゴム製品
11	ガラス・土石製品
12	鉄鋼
13	非鉄金属
14	金属製品
15	機械
16	電気機器
17	輸送用機器
18	精密機器
19	その他製品
20	電気・ガス
21	陸運
22	海運
23	空運
24	倉庫・輸送関連
25	情報・通信
26	卸売
27	小売
28	銀行
29	証券・商品先物取引
30	保険
31	その他金融
32	不動産
33	サービス

中分類業種

業種 コード	業種名
1	食品
2	繊維
3	パルプ・紙
4	化学工業
5	医薬品
6	石油
7	ゴム
8	窯業
9	鉄鋼業
10	非鉄製品および金属製品
11	機械
12	電気機器
13	造船
14	自動車・自動車部品
15	その他輸送機器
16	精密機器
17	その他製造業
18	水産
19	鉱業
20	建設
21	商社
22	小売業
23	銀行
24	証券
25	保険
26	その他金融
27	不動産
28	鉄道・バス
29	陸運
30	海運
31	空運
32	倉庫・運輸関連
33	通信
34	電力
35	ガス
36	サービス

～ NPM関連データサービス ～

日本上場株式 週次リターンデータ

株式会社金融データソリューションズ

本資料は、「日本上場株式 週次リターンデータ」に収録されるデータ項目の仕様書になります。実際のデータは、付随の「NPM 関連データベース DataViewer」を通じて閲覧、抜粋、ファイル出力などをお願いします。DataViewer の利用方法につきましては、「DataViewerGuide.pdf」をご参照下さい。

収録期間 1976年12月第5週 ～ 2021年9月第4週 (2,332週)
 収録銘柄 取引所上場全銘柄 (JDR 等は除く) 延べ 6,638 銘柄
 + TOPIX/東証業種別指数/JASDAQ 指数等 計 82 指数
 ※ データ日付=2012年10月第1週からETF/ETNの収録を開始しました。
 収録件数 7,230,873 records

データ仕様

データ名称	NPM DataViewer の項目名	単 位	定 義
1 FDS 会社コード	NKCODE		【第1ソートKEY】。7桁コード。 指数レコードは独自に割り振っている (13～14 ページ目参照)。
2 データ日付	DATA_DATE		【第2ソートKEY】。YYYYMMW形式。 (例) "2012124" → 2012年12月第4週
3 証券コード	SECCODE		4桁コード。証券コードの変更・再附番などもそのまま収録。 週末最終営業日時点 (上場廃止は最終売買日時点)。 指数レコードは独自に割り振っている (13～14 ページ目参照)。
4 リターン終 業日付	TO_DATA_D ATE		リターン計算の終日付。YYYYMMDD形式。
5 リターン起 業日付	FROM_DATA _DATE		リターン計算の起日付。YYYYMMDD形式。
6 東証 33 業種分 類業種コード	TSE33		1～33。7ページ目の「業種分類一覧」を参照。 外国株式(含カントリーファンド)の一部・優先出資証券・JREIT(不動産投信)・インフラファンド・特殊投資法人、合併上場廃止期間は欠損値。 週末最終営業日時点 (合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 東証業種別指数は、当該業種を表す1～33の数字を収録。
7 中分類業種 コード	NK36		1～36。7ページ目の「業種分類一覧」を参照。 1993年12月第5週以前、及び合併上場廃止期間、および指数レコードは欠損値。 週末最終営業日時点 (合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 2012年10月第1週以降は未収録。
8 厚生年金主 市場コード	MAIN_MKT		'01':東京 '02':大阪 '03':名古屋 '04':京都 '05':広島 '06':福岡 '07':新潟 '08':札幌 '09':JASDAQ (旧店頭) '11':ヘラクレス (旧ナスダック・ジャパン) 株価を採用した市場を収録。指数レコードは一律で'99'を収録。

			週末最終営業日時点（合併以外の上場廃止は最終売買日時点）。 詳細は「<ご参考>配当込み収益率の計算定義.doc」を参照。
9	東京上場部	M1	0:非上場(or 指数) 1:1部 2:2部 3:外国部 9:ETF/ETN 5:TOKYO PRO Market 8:マザーズ マザーズは1999年12月第4週～、TOKYO PRO Market(TOKYO AIM が20120701付で改称)は2011年7月第3週～収録。 週末最終営業日時点（合併以外の上場廃止は最終売買日時点）。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。 信金中金は1で収録。 以下は2013年7月第3週～（東証大証の現物市場統合以降） の追加定義 6:JASDAQスタンダード 7:JASDAQ グロース ベンチャーファンドは2で収録。 カントリーファンドは3で収録。 日本銀行は6で収録。
10	大阪上場部	M2	0:非上場(or 指数) 1:1部 2:2部 3:カントリーファンド 9:ETF/ETN 5:新2部 8:新市場部 カントリーファンドは1991年12月第3週～収録。 新2部は1986年8月第5週～1995年12月第5週まで収録。 新市場部は1997年12月第4週～2003年3月第4週まで収録。 週末最終営業日時点（合併以外の上場廃止は最終売買日時点）。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。 ベンチャーファンドは2で収録。 2013年7月第2週（東証大証の現物市場統合の前営業日）まで収録。
11	名古屋上場部	M3	0:非上場(or 指数) 1:1部 2:2部 4:上場 8:セントレックス 9:ETF/ ETN 1979年4月第1週～収録。 1979年4月第1週～1997年12月第3週は上場部の区分なしですべ て上場は4。 セントレックスは2001年8月第1週～。 週末最終営業日時点（合併以外の上場廃止は最終売買日時点）。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。
12	京都上場部	M4	0:非上場(or 指数) 4:上場 1986年8月第5週～2001年2月第4週まで収録。 週末最終営業日時点（合併以外の上場廃止は最終売買日時点）。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。
13	広島上場部	M5	0:非上場(or 指数) 4:上場 1986年8月第5週～2000年2月第4週まで収録。 週末最終営業日時点（合併以外の上場廃止は最終売買日時点）。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。
14	福岡上場部	M6	0:非上場(or 指数) 4:上場 8:Qボード 9:ETF/ETN 1986年8月第5週～収録。 Qボードは2003年2月第2週～収録。 週末最終営業日時点（合併以外の上場廃止は最終売買日時点）。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。
15	新潟上場部	M7	0:非上場(or 指数) 4:上場 1986年8月第5週～2000年2月第4週まで収録。 週末最終営業日時点（合併以外の上場廃止は最終売買日時点）。

			合併上場廃止期間は非上場'0'となる。
16	札幌上場部	M8	0:非上場(or 指数) 4:上場 8:アンビシャス 9:ETF/ETN 1986年8月第5週～収録。 アンビシャスは2001年8月第1週～収録。 週末最終営業日時点(合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。
17	JASDAQ 上場部 (旧店頭)	M9	1986年9月第1週～2004年12月第2週 0:未登録(or 指数) 1:店頭登録 3:店頭管理 2004年12月第3週～2010年10月第2週 0:非上場(or 指数) 1:上場 8:NEO 2010年10月第3週～ 0:非上場(or 指数) 1:JASDAQスタンダード(内国株) 2:JASDAQグロース(内国株) 3:JASDAQスタンダード(外国株) 4:JASDAQグロース(外国株) 週末最終営業日時点(合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。 日本銀行は1で収録。 2013年7月第2週(東証大証の現物市場統合の前営業日)まで収録。
18	ヘラクレス上場部	M10	0:非上場(or 指数) 3:スタンダード外国株 4:スタンダード(内国株) 8:グロース(内国株) 9:グロース外国株 2000年6月第4週～2010年10月第2週まで収録。 週末最終営業日時点(合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。
19	評価株価	CLOSE_P	[円] 厚生年金評価価格に準拠した評価株価。 詳細は「<ご参考>配当込み収益率の計算定義.doc」を参照。 週末最終営業日時点(合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 TOPIX等の指数は配当込み指数値。但し、JASDAQとヘラクレスの配当込み指数は金融データソリューションズの計算値を収録。また、下記の指数は、公表されていない過去分について一部金融データソリューションズの推定計算値を収録している。 TOPIX → 1989年1月第1週以降は取引所公表値、それ以前は推定値 33業種指数→ 1993年7月第2週以降は取引所公表値、それ以前は推定値
20	普通株発行済株式数	CMSHARE	[株] 優先株等の種類株式を除いた普通株発行済株式数。 外国株式(含カントリーファンド)の一部はNA。 ※ADR外国株は2007年4月第2週より本国市場株式数からADR数へ変更。 週末最終営業日時点(合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 合併上場廃止期間、および指数レコードは欠損値。 1976年12月第5週は未収録。
21	現金配当込修正係数	COEFF_DIV	現金配当を含む週次の修正係数。 詳細は「<ご参考>配当込み収益率の計算定義.doc」を参照。 週中に権利落ち(配当含む)が無い場合は、1が収録される。 週中に権利落ち(配当含む)があった場合は、日次の配当込み修正係数を累積し、週次の修正係数に変換。 指数レコードは一律で1を収録。 1976年12月第5週は未収録。
22	現金配当なし修正係数	COEFF_NON	現金配当を含まない週次の修正係数。

正係数	DIV		週中に権利落ち(配当含まず)が無い場合は、1が収録される。 週中に権利落ち(配当含まず)があった場合は、日次の配当無し修正係数を累積し、週次の修正係数に変換。 指数レコードは一律で1を収録。 1976年12月第5週は未収録。
23 配当込み収益率	ROR	[%]	前週末最終営業日を(t-1)、当週末最終営業日をtとすると「(t-1)～t」までの期間における配当込み収益率。 但し、週中の新規上場(再上場含む)、及び合併以外の上場廃止に関しては、上場している期間で収益率を計算。 合併による上場廃止は、合併期日までの収益率を計算。 ① 週中の新規上場(再上場含む)の場合 → IPO価格(売出・公募価格)～当週末までの収益率 (IPO価格が存在しない場合は上場初日終値からの収益率) ② 週中の合併を伴わない上場廃止の場合 → 前週末～最終売買日までの収益率 ③ 週中の合併を伴う上場廃止の場合 → 前週末～合併期日までの収益率 ※ IPO価格については、後述の「ご注意点3」を参照。 詳細は「<ご参考>配当込み収益率の計算定義.doc」を参照。 1976年12月第5週は未収録。
24 出来区分	V_FLAG		収益率計算に使用した評価時価の種類。 ～2012年9月第4週 10:終値 20:店頭翌日基準値段 30:最終気配 31:売気配 32:買気配 50:権利落ち理論値 or 引継値 55:気配の平均値 60:廃止銘柄加工算出値 65:廃止銘柄金銭交付額 99:採用値無し 2012年10月第1週～ 10:終値 31:特別売気配 32:特別買気配 50:権利落ち理論値 or 引継値 60:廃止銘柄加工算出値 65:廃止銘柄金銭交付額 99:採用値無し 週末最終営業日時点(合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 指数レコードは一律で10を収録。
25 出来高	VOLUME	[株]	「厚生年金主市場コード」の市場における出来高の週間合計値。 但し、週中に株式分割・併合等の権利落ちがあった場合は、当該権利修正を考慮して日々の出来高を権利落ち後に変換した後で合計値を計算。指数レコードは欠損値。 1976年12月第5週は未収録。
26 存在フラグ	EXIST_FLAG		1:週中に 新規上場(再上場含む)がある or 上場廃止がある or 合併期日がある or 1976年12月第5週 or 2012年10月第1週のETF 0:上記以外 0は前週末、及び当週末の株価が存在し、前週末～当週末の週次リターンが計算されているレコードであることを示す。 指数レコードは一律で0を収録。
27 合併先企業のFDS会社コード	MERGER_NK CODE		他の上場会社に合併されて上場廃止になるケースにおいて、合併期日を含む収録週に限り、合併先企業のFDS会社コードを収録。

			詳しくは、付属の『合併情報一覧.xls』を参照。 上記以外のケース、および指数レコードはブランク(7バイト)。 ※後述の「ご注意点2」を参照。
28	合併比率	MERGER_RATIO [株]	他の上場会社に合併されて上場廃止になるケースにおいて、合併期日を含む収録週に限り、被合併企業の株式1株につき割り当てられる合併先企業の株式数(合併比率)を収録。 詳しくは、付属の『合併情報一覧.xls』を参照。 上記以外のケース、および指数レコードは欠損値。 ※後述の「ご注意点2」を参照。
29	修正株価	ADJ_CLOSE_P [円]	当該銘柄の最新日付(T)における「評価株価」(P)を基準とした修正株価。修正株価(t)=P(t)×累積現金配当修正係数(t)／累積現金配当修正係数(T)。

ご注意点

- 全期間に上場登録していない銘柄は、存在期間のみの収録となります。
- 「合併先企業の FDS 会社コード」と「合併比率」が収録されるレコードは、合併先銘柄が合併期日(休日の場合は翌営業日)時点で上場(新設会社の新規上場含む)しており、かつ合併期日を境に日次データが連続する合併事象に限ります。従いまして、非上場会社への合併、上場廃止から合併まで期間が開いている、株式移転先の完全親会社が非上場、合併と同時に株式非公開化、その他特殊な合併のケースについては、収録対象外となります。また、金銭交付など、合併先企業の株式の割り当ての無い合併のケースでは、「合併比率」=0 で収録されます。
- 新規上場した週の「配当込み収益率」は、IPO の売出価格、または公募価格を基準とした収益率を計算・収録していますが、以下の点にご注意ください。
 - ▶ IPO 価格からの週次収益率が計算できる銘柄は、売出か公募(あるいは双方)を行い、売出や公募の価格が存在する銘柄に限ります。①合併により持株会社等の新設会社が新規上場した場合、②会社分割でその一部の会社が新規上場した場合、③公募・売出無しで新規上場した場合、などは IPO 価格が存在しないため、上場初日終値からの週次収益率となります。
 - ▶ 外国株式やカントリーファンド、特殊投資法人の一部は、IPO 価格の収録対象外となるため、上場初日終値からの週次収益率となります。
 - ▶ 1989 年以前は、売出・公募価格の情報が無い銘柄も存在します。この場合は上場初日終値からの週次収益率となります。
 - ▶ 1986 年 8 月以前の地方単独上場(広島・京都・福岡・新潟・札幌)、旧店頭登録(東京・大阪・名古屋)は本データの収録対象外となっていますが、これらの銘柄が、売出・公募を伴って東証・大証・名証へ上場した場合の上場週の週次収益率は、売出・公募価格を基準とした収益率を計算しています。
 - ▶ 再上場銘柄は、再上場時に売出 or 公募を伴えば、当該 IPO 価格からの週次収益率を計算・収録しています。
 - ▶ 2012 年 10 月第 1 週以降に上場した銘柄で IPO 価格が無い場合、取引所基準値段からの収益率を収録しています。
 - ▶ 売出・公募価格決定から新規上場日前日までに発生した権利落ちや配当は考慮されません。
- 指数レコードは、次ページのように「FDS 会社コード」と「証券コード」を独自に割当てています。
- 2019 年の 4 月 27 日～5 月 6 日は証券休日(10 連休)であったため、2019 年 5 月第 1 週の「週次配当込み収益率」は、4 月 26 日(起日付)～5 月 10 日(終日付)までの 2 週間の収益率となります。
- 2020 年 10 月 1 日は東京証券取引所が全銘柄の売買を終日停止したため、証券休日として扱います。

データ日付=2012 年 10 月以降の全般的な変更点

※ 4 ページ目に記載の「データ日付=2012 年 10 月以降の全般的な変更点」をご参照ください。

収録されている指数レコード一覧

FDS 会社コード	証券 コード	指数名	データ 期間
IDX1000	1000	東証株価指数(TOPIX)	1982101～
IDX1001	1001	東証業種別株価指数(水産・農林業)	1982101～
IDX1002	1002	東証業種別株価指数(鉱業)	1982101～
IDX1003	1003	東証業種別株価指数(建設業)	1982101～
IDX1004	1004	東証業種別株価指数(食料品)	1982101～
IDX1005	1005	東証業種別株価指数(繊維製品)	1982101～
IDX1006	1006	東証業種別株価指数(パルプ・紙)	1982101～
IDX1007	1007	東証業種別株価指数(化学)	1982101～
IDX1008	1008	東証業種別株価指数(医薬品)	1982101～
IDX1009	1009	東証業種別株価指数(石油・石炭製品)	1982101～
IDX1010	1010	東証業種別株価指数(ゴム製品)	1982101～
IDX1011	1011	東証業種別株価指数(ガラス・土石製品)	1982101～
IDX1012	1012	東証業種別株価指数(鉄鋼)	1982101～
IDX1013	1013	東証業種別株価指数(非鉄金属)	1982101～
IDX1014	1014	東証業種別株価指数(金属製品)	1982101～
IDX1015	1015	東証業種別株価指数(機械)	1982101～
IDX1016	1016	東証業種別株価指数(電気機器)	1982101～
IDX1017	1017	東証業種別株価指数(輸送用機器)	1982101～
IDX1018	1018	東証業種別株価指数(精密機器)	1982101～
IDX1019	1019	東証業種別株価指数(その他製品)	1982101～
IDX1020	1020	東証業種別株価指数(電気・ガス業)	1982101～
IDX1021	1021	東証業種別株価指数(陸運業)	1982101～
IDX1022	1022	東証業種別株価指数(海運業)	1982101～
IDX1023	1023	東証業種別株価指数(空運業)	1982101～
IDX1024	1024	東証業種別株価指数(倉庫・運輸関連業)	1982101～
IDX1025	1025	東証業種別株価指数(情報・通信業)	1982101～
IDX1026	1026	東証業種別株価指数(卸売業)	1982101～
IDX1027	1027	東証業種別株価指数(小売業)	1982101～
IDX1028	1028	東証業種別株価指数(銀行業)	1982101～
IDX1029	1029	東証業種別株価指数(証券・商品先物取引業)	1982101～
IDX1030	1030	東証業種別株価指数(保険業)	1982101～
IDX1031	1031	東証業種別株価指数(その他金融業)	1982101～
IDX1032	1032	東証業種別株価指数(不動産業)	1982101～
IDX1033	1033	東証業種別株価指数(サービス業)	1982101～
IDX1034	1034	東証規模別株価指数 大型株	1993072～
IDX1035	1035	東証規模別株価指数 中型株	1993072～
IDX1036	1036	東証規模別株価指数 小型株	1993072～
IDX1037	1037	東証第二部株価指数	1993072～
IDX1038	1038	東証マザーズ指数	2000035～
IDX1039	1039	東証REIT指数	2003041～

FDS 会社コード	証券 コード	指数名	データ 期間
IDX1040	1040	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX Core30	1999063~
IDX1041	1041	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX Large70	1999063~
IDX1042	1042	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX 100	1999063~
IDX1043	1043	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX Mid400	1999063~
IDX1044	1044	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX 500	1999063~
IDX1045	1045	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX 1000	1998092~
IDX1046	1046	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX Small	1999063~
IDX1047	1047	TOPIX コンポジット	2011102~
IDX1048	1048	TOPIX コンポジット1500	2011102~ 2018085
IDX1049	1049	東証二部コンポジット指数	2011102~
IDX1050	1050	マザーズコンポジット	2011102~
IDX1051	1051	TOPIX-17シリーズ 食品	2011102~
IDX1052	1052	TOPIX-17シリーズ エネルギー資源	2011102~
IDX1053	1053	TOPIX-17シリーズ 建設・資材	2011102~
IDX1054	1054	TOPIX-17シリーズ 素材・化学	2011102~
IDX1055	1055	TOPIX-17シリーズ 医薬品	2011102~
IDX1056	1056	TOPIX-17シリーズ 自動車・輸送機	2011102~
IDX1057	1057	TOPIX-17シリーズ 鉄鋼・非鉄	2011102~
IDX1058	1058	TOPIX-17シリーズ 機械	2011102~
IDX1059	1059	TOPIX-17シリーズ 電機・精密	2011102~
IDX1060	1060	TOPIX-17シリーズ 情報通信・サービスその他	2011102~
IDX1061	1061	TOPIX-17シリーズ 電力・ガス	2011102~
IDX1062	1062	TOPIX-17シリーズ 運輸・物流	2011102~
IDX1063	1063	TOPIX-17シリーズ 商社・卸売	2011102~
IDX1064	1064	TOPIX-17シリーズ 小売	2011102~
IDX1065	1065	TOPIX-17シリーズ 銀行	2011102~
IDX1066	1066	TOPIX-17シリーズ 金融(除く銀行)	2011102~
IDX1067	1067	TOPIX-17シリーズ 不動産	2011102~
IDX1068	1068	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX バリュウ	2011102~
IDX1069	1069	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX 500 バリュウ	2011102~
IDX1070	1070	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX small バリュウ	2011102~
IDX1071	1071	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX グロウス	2011102~
IDX1072	1072	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX 500 グロウス	2011102~
IDX1073	1073	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX small グロウス	2011102~
IDX1074	1074	東証配当フォーカス100 指数	2011102~
IDX1075	1075	東証REIT用途別指数シリーズ オフィス	2011102~
IDX1076	1076	東証REIT用途別指数シリーズ 住宅	2011102~
IDX1077	1077	東証REIT用途別指数シリーズ 商業・物流等	2011102~
IDX1078	1078	TOPIX アジア関連株指数	2011101~ 2016084
IDX1079	1079	東証マザーズCore 指数	2011101~
IDX1080	1080	JASDAQ 指数(FDS算出の配当込指数値)	1992125~
IDX1081	1081	ヘラクレス 指数(FDS算出の配当込指数値)	2000064~ 2010102

～ NPM関連データサービス ～

日本上場株式 月次リターンデータ

株式会社金融データソリューションズ

本資料は、「日本上場株式 月次リターンデータ」に収録されるデータ項目の仕様書になります。実際のデータは、付随の「NPM 関連データベース DataViewer」を通じて閲覧、抜粋、ファイル出力などをお願いします。DataViewer の利用方法につきましては、「DataViewerGuide.pdf」をご参照下さい。

収録期間 1976年12月 ～ 2021年9月 (538ヶ月)
 収録銘柄 取引所上場全銘柄 (JDR 等は除く) 延べ 6,648 銘柄
 + TOPIX/東証業種別指数/JASDAQ 指数等 計 85 指数
 ※ データ日付=2012年10月からETF/ETNの収録を開始しました。
 収録件数 1,671,555 records

データ仕様

データ名称	NPM DataViewer の項目名	単 位	定 義
1 FDS 会社コード	NKCODE		【第1ソートKEY】。7桁コード。 指数レコードは独自に割り振っている (20～21 ページ目参照)。
2 データ日付	DATA_DATE		【第2ソートKEY】。YYYYMM形式。
3 証券コード	SECCODE		4桁コード。証券コードの変更・再附番などもそのまま収録。 月末最終営業日時点 (上場廃止は最終売買日時点)。 指数レコードは独自に割り振っている (20～21 ページ目参照)。
4 リターン終点 営業日付	TO_DATA_D ATE		リターン計算の終点日付。YYYYMMDD形式。
5 リターン起点 営業日付	FROM_DATA _DATE		リターン計算の起点日付。YYYYMMDD形式。
6 東証 33 業種分 類業種コード	TSE33		1～33。7ページ目の「業種分類一覧」を参照。 外国株式(含カントリーファンド)の一部・優先出資証券・JREIT(不動産投信)・インフラファンド・特殊投資法人、合併上場廃止期間は欠損値。 月末最終営業日時点 (合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 東証業種別指数は、当該業種を表す1～33の数字を収録。
7 中分類業種コード	NK36		1～36。7ページ目の「業種分類一覧」を参照。 1993年12月以前、及び合併上場廃止期間、および指数レコードは欠損値。 月末最終営業日時点 (合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 2012年10月以降は未収録
8 厚生年金主市場コード	MAIN_MKT		‘01’:東京 ‘02’:大阪 ‘03’:名古屋 ‘04’:京都 ‘05’:広島 ‘06’:福岡 ‘07’:新潟 ‘08’:札幌 ‘09’:JASDAQ (旧店頭) ‘11’:ヘラクレス (旧ナスダック・ジャパン) 株価を採用した市場を収録。指数レコードは一律で‘99’を収録。 月末最終営業日時点 (合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。

			詳細は「<ご参考>配当込み収益率の計算定義.doc」を参照。
9	東京上場部	M1	<p>0:非上場(or 指数) 1:1部 2:2部 3:外国部 9:ETF/ETN 5:TOKYO PRO Market 8:マザーズ</p> <p>マザーズは 199912～、TOKYO PRO Market (TOKYO AIM が 20120701 付で改称) は 201107～収録。</p> <p>月末最終営業日時点 (合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。</p> <p>信金中金は 1 で収録。</p> <p>以下は 201307～ (東証大証の現物市場統合以降) の追加定義 6:JASDAQ スタンダード 7:JASDAQ グロース ベンチャーファンドは 2 で収録。 カンントリーファンドは 3 で収録。 日本銀行は 6 で収録。</p>
10	大阪上場部	M2	<p>0:非上場(or 指数) 1:1部 2:2部 3:カンントリーファンド 9:ETF/ETN 5: 新2部 8: 新市場部</p> <p>カンントリーファンドは 199112～収録。</p> <p>新2部は 198608～199512 まで収録。 新市場部は 199712～200303 まで収録。</p> <p>月末最終営業日時点 (合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。</p> <p>ベンチャーファンドは 2 で収録。 201306 (東証大証の現物市場統合の前営業日) まで収録。</p>
11	名古屋上場部	M3	<p>0:非上場(or 指数) 1:1部 2:2部 4:上場 8:セントレックス 9:ETF/ETN 197904～収録。</p> <p>197904～199711 は上場部の区分なしですべて上場は 4。 セントレックスは 200107～。</p> <p>月末最終営業日時点 (合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。</p>
12	京都上場部	M4	<p>0:非上場(or 指数) 4:上場 198608～200102 まで収録。</p> <p>月末最終営業日時点 (合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。</p>
13	広島上場部	M5	<p>0:非上場(or 指数) 4:上場 198608～200002 まで収録。</p> <p>月末最終営業日時点 (合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。</p>
14	福岡上場部	M6	<p>0:非上場(or 指数) 4:上場 8:Q ボード 9:ETF/ETN 198608～収録。</p> <p>Q ボードは 200302～収録。</p> <p>月末最終営業日時点 (合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。</p>
15	新潟上場部	M7	<p>0:非上場(or 指数) 4:上場 198608～200002 まで収録。</p> <p>月末最終営業日時点 (合併以外の上場廃止は最終売買日時点)。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。</p>
16	札幌上場部	M8	<p>0:非上場(or 指数) 4:上場 8:アンビシャス 9:ETF/ETN 198608～収録。</p>

			アンビシャスは 200107～収録。 月末最終営業日時点（合併以外の上場廃止は最終売買日時点）。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。
17	JASDAQ 上場部 (旧店頭)	M9	198609～200411 0:未登録(or 指数) 1:店頭登録 3:店頭管理 200412～201009 0:非上場(or 指数) 1:上場 8:NEO 201010～ 0:非上場(or 指数) 1:JASDAQ スタンダード (内国株) 2:JASDAQ グロース (内国株) 3:JASDAQ スタンダード (外国株) 4:JASDAQ グロース (外国株) 月末最終営業日時点（合併以外の上場廃止は最終売買日時点）。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。 日本銀行は 1 で収録。 201306（東証大証の現物市場統合の前営業日）まで収録。
18	ヘラクレス上場部	M10	0:非上場(or 指数) 3:スタンダード外国株 4:スタンダード (内国株) 8:グロース (内国株) 9:グロース外国株 200006～201009 まで収録。 月末最終営業日時点（合併以外の上場廃止は最終売買日時点）。 合併上場廃止期間は非上場'0'となる。
19	評価株価	CLOSE_P	[円] 厚生年金評価価格に準拠した評価株価。 詳細は「<ご参考>配当込み収益率の計算定義.doc」を参照。 月末最終営業日時点（合併以外の上場廃止は最終売買日時点）。 TOPIX 等の指数は配当込み指数値。但し、JASDAQ とヘラクレスの配当込み指数は金融データソリューションズの計算値を収録。また、下記の指数は、公表されていない過去分について一部金融データソリューションズの推定計算値を収録している。 TOPIX → 198901 以降は取引所公表値、それ以前は推定値 33 業種指数 → 199307 以降は取引所公表値、それ以前は推定値
20	普通株発行済株式数	CMSHARE	[株] 優先株等の種類株式を除いた普通株発行済株式数。 外国株式(含カントリーファンド)の一部は NA。 ※ADR の外国株は、200704 より本国市場の株式数から ADR 数へ変更。 月末最終営業日時点（合併以外の上場廃止は最終売買日時点）。 合併上場廃止期間、および指数レコードは欠損値。 1976 年 12 月は未収録。
21	現金配当込修正係数	COEFF_DIV	現金配当を含む月次の修正係数。 詳細は「<ご参考>配当込み収益率の計算定義.doc」を参照。 月中に権利落ち(配当含む)が無い場合は、1 が収録される。 月中に権利落ち(配当含む)があった場合は、日次の配当込み修正係数を累積し、月次の修正係数に変換。 指数レコードは一律で 1 を収録。 1976 年 12 月は未収録。
22	現金配当なし修正係数	COEFF_NON DIV	現金配当を含まない月次の修正係数。 月中に権利落ち(配当含まず)が無い場合は、1 が収録される。 月中に権利落ち(配当含まず)があった場合は、日次の配当無し修正係数を累積し、月次の修正係数に変換。 指数レコードは一律で 1 を収録。 1976 年 12 月は未収録。

23	配当込み収益率	ROR	[%]	<p>前月末最終営業日を (t-1)、当月末最終営業日を t とすると「(t-1) ~ t」までの期間における配当込み収益率。</p> <p>但し、月中の新規上場（再上場含む）、及び合併以外の上場廃止に関しては、上場している期間で収益率を計算。</p> <p>合併による上場廃止は、合併期日までの収益率を計算。</p> <p>① 月中の新規上場（再上場含む）の場合 → IPO 価格（売出・公募価格）～当月末までの収益率 (IPO 価格が存在しない場合は上場初日終値からの収益率)</p> <p>② 月中の合併を伴わない上場廃止の場合 → 前月末～最終売買日までの収益率</p> <p>③ 月中の合併を伴う上場廃止の場合 → 前月末～合併期日までの収益率</p> <p>※ IPO 価格については、後述の「ご注意点 3」を参照。</p> <p>詳細は「<ご参考>配当込み収益率の計算定義.doc」を参照。</p> <p>1976 年 12 月は未収録。</p>
24	出来区分	V_FLAG		<p>収益率計算に使用した評価時価の種類。</p> <p>～201209</p> <p>10:終値 20:店頭翌日基準値段 30:最終気配 31:売気配 32:買気配 50:権利落ち理論値 or 引継値 55:気配の平均値 60:廃止銘柄加工算出値 65:廃止銘柄金銭交付額 99:採用値無し</p> <p>201210～</p> <p>10:終値 31:特別売気配 32:特別買気配 50:権利落ち理論値 or 引継値 60:廃止銘柄加工算出値 65:廃止銘柄金銭交付額 99:採用値無し</p> <p>月末最終営業日時点（合併以外の上場廃止は最終売買日時点）。</p> <p>指数レコードは一律で 10 を収録。</p>
25	出来高	VOLUME	[株]	<p>「厚生年金主市場コード」の市場における出来高の月間合計値。</p> <p>但し、月中に株式分割・併合等の権利落ちがあった場合は、当該権利修正を考慮して日々の出来高を権利落ち後に変換した後で合計値を計算。指数レコードは欠損値。</p> <p>1976 年 12 月は未収録。</p>
26	存在フラグ	EXIST_FLAG		<p>1：月中に新規上場（再上場含む） or 上場廃止がある or 合併期日がある or 1976 年 12 月 or 2012 年 10 月の ETF</p> <p>0：上記以外</p> <p>0 は前月末、及び当月末の株価が存在し、前月末～当月末の月次リターンが計算されているレコードであることを示す。</p> <p>指数レコードは一律で 0 を収録。</p>
27	合併先企業の FDS 会社コード	MERGER_NK CODE		<p>他の上場会社に合併されて上場廃止になるケースにおいて、合併期日を含む収録月に限り、合併先企業の FDS 会社コードを収録。</p> <p>詳しくは、付属の『合併情報一覧.xls』を参照。</p> <p>上記以外のケース、および指数レコードはブランク(7 バイト)。</p> <p>※後述の「ご注意点 2」を参照。</p>
28	合併比率	MERGER_RA TIO	[株]	<p>他の上場会社に合併されて上場廃止になるケースにおいて、合併期日を含む収録月に限り、被合併企業の株式 1 株につき割り当てられる合併先企業の株式数（合併比率）を収録。</p> <p>詳しくは、付属の『合併情報一覧.xls』を参照。</p> <p>上記以外のケース、および指数レコードは欠損値。</p> <p>※後述の「ご注意点 2」を参照。</p>

29	修正株価	ADJ_CLOSE_ P	[円]	当該銘柄の最新日付(T)における「評価株価」(P)を基準とした修正株価。修正株価(t)=P(t)×累積現金配当込修正係数(t)／累積現金配当込修正係数(T)。
----	------	-----------------	-----	---

ご注意点

- 全期間に上場登録していない銘柄は、存在期間のみの収録となります。
- 「合併先企業の FDS 会社コード」と「合併比率」が収録されるレコードは、合併先銘柄が合併期日(休日の場合は翌営業日)時点で上場(新設会社の新規上場含む)しており、かつ合併期日を境に日次データが連続する合併事象に限ります。従いまして、非上場会社への合併、上場廃止から合併まで期間が開いている、株式移転先の完全親会社が非上場、合併と同時に株式非公開化、その他特殊な合併のケースについては、収録対象外となります。また、金銭交付など、合併先企業の株式の割り当ての無い合併のケースでは、「合併比率」=0 で収録されます。
- 新規上場した月の「配当込み収益率」は、IPO の売出価格、または公募価格を基準とした収益率を計算・収録していますが、以下の点にご注意ください。
 - IPO 価格からの月次収益率が計算できる銘柄は、売出か公募(あるいは双方)を行い、売出や公募の価格が存在する銘柄に限ります。①合併により持株会社等の新設会社が新規上場した場合、②会社分割でその一部の会社が新規上場した場合、③公募・売出無しで新規上場した場合、などは IPO 価格が存在しないため、上場初日終値からの月次収益率となります。
 - 外国株式やカンツリーファンド、特殊投資法人の一部は、IPO 価格の収録対象外となるため、上場初日終値からの月次収益率となります。
 - 1989 年以前は、売出・公募価格の情報が無い銘柄も存在します。この場合は上場初日終値からの月次収益率となります。
 - 1986 年 8 月以前の地方単独上場(広島・京都・福岡・新潟・札幌)、旧店頭登録(東京・大阪・名古屋)は本データの収録対象外となっていますが、これらの銘柄が、売出・公募を伴って東証・大証・名証へ上場した場合の上場月の月次収益率は、売出・公募価格を基準とした収益率を計算しています。
 - 再上場銘柄は、再上場時に売出 or 公募を伴えば、当該 IPO 価格からの月次収益率を計算・収録しています。
 - 2012 年 10 月以降に上場した銘柄で IPO 価格が無い場合、取引所基準値段からの収益率を収録しています。
 - 売出・公募価格決定から新規上場日前日までに発生した権利落ちや配当は考慮されません。
- 指数レコードは、次ページのように「FDS 会社コード」と「証券コード」を独自に割当てています。
- 2020 年 10 月 1 日は東京証券取引所が全銘柄の売買を終日停止したため、証券休日として扱います。

データ日付=2012 年 10 月以降の全般的な変更点

※ 4 ページ目に記載の「データ日付=2012 年 10 月以降の全般的な変更点」をご参照ください。

収録されている指数レコード一覧

FDS 会社コード	証券 コード	指数名	データ 期間
IDX1000	1000	東証株価指数(TOPIX)	198210～
IDX1001	1001	東証業種別株価指数(水産・農林業)	198210～
IDX1002	1002	東証業種別株価指数(鉱業)	198210～
IDX1003	1003	東証業種別株価指数(建設業)	198210～
IDX1004	1004	東証業種別株価指数(食料品)	198210～
IDX1005	1005	東証業種別株価指数(繊維製品)	198210～
IDX1006	1006	東証業種別株価指数(パルプ・紙)	198210～
IDX1007	1007	東証業種別株価指数(化学)	198210～
IDX1008	1008	東証業種別株価指数(医薬品)	198210～
IDX1009	1009	東証業種別株価指数(石油・石炭製品)	198210～
IDX1010	1010	東証業種別株価指数(ゴム製品)	198210～
IDX1011	1011	東証業種別株価指数(ガラス・土石製品)	198210～
IDX1012	1012	東証業種別株価指数(鉄鋼)	198210～
IDX1013	1013	東証業種別株価指数(非鉄金属)	198210～
IDX1014	1014	東証業種別株価指数(金属製品)	198210～
IDX1015	1015	東証業種別株価指数(機械)	198210～
IDX1016	1016	東証業種別株価指数(電気機器)	198210～
IDX1017	1017	東証業種別株価指数(輸送用機器)	198210～
IDX1018	1018	東証業種別株価指数(精密機器)	198210～
IDX1019	1019	東証業種別株価指数(その他製品)	198210～
IDX1020	1020	東証業種別株価指数(電気・ガス業)	198210～
IDX1021	1021	東証業種別株価指数(陸運業)	198210～
IDX1022	1022	東証業種別株価指数(海運業)	198210～
IDX1023	1023	東証業種別株価指数(空運業)	198210～
IDX1024	1024	東証業種別株価指数(倉庫・運輸関連業)	198210～
IDX1025	1025	東証業種別株価指数(情報・通信業)	198210～
IDX1026	1026	東証業種別株価指数(卸売業)	198210～
IDX1027	1027	東証業種別株価指数(小売業)	198210～
IDX1028	1028	東証業種別株価指数(銀行業)	198210～
IDX1029	1029	東証業種別株価指数(証券・商品先物取引業)	198210～
IDX1030	1030	東証業種別株価指数(保険業)	198210～
IDX1031	1031	東証業種別株価指数(その他金融業)	198210～
IDX1032	1032	東証業種別株価指数(不動産業)	198210～
IDX1033	1033	東証業種別株価指数(サービス業)	198210～
IDX1034	1034	東証規模別株価指数 大型株	199307～
IDX1035	1035	東証規模別株価指数 中型株	199307～
IDX1036	1036	東証規模別株価指数 小型株	199307～
IDX1037	1037	東証第二部株価指数	199307～
IDX1038	1038	東証マザーズ指数	200003～
IDX1039	1039	東証REIT指数	200303～

FDS 会社コード	証券 コード	指数名	データ 期間
IDX1040	1040	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX Core30	199906～
IDX1041	1041	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX Large70	199906～
IDX1042	1042	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX 100	199906～
IDX1043	1043	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX Mid400	199906～
IDX1044	1044	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX 500	199906～
IDX1045	1045	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX 1000	199809～
IDX1046	1046	TOPIX ニューインデックスシリーズ TOPIX Small	199906～
IDX1047	1047	TOPIX コンポジット	201110～
IDX1048	1048	TOPIX コンポジット1500	201110～ 201808
IDX1049	1049	東証二部コンポジット指数	201110～
IDX1050	1050	マザーズコンポジット	201110～
IDX1051	1051	TOPIX-17シリーズ 食品	201110～
IDX1052	1052	TOPIX-17シリーズ エネルギー資源	201110～
IDX1053	1053	TOPIX-17シリーズ 建設・資材	201110～
IDX1054	1054	TOPIX-17シリーズ 素材・化学	201110～
IDX1055	1055	TOPIX-17シリーズ 医薬品	201110～
IDX1056	1056	TOPIX-17シリーズ 自動車・輸送機	201110～
IDX1057	1057	TOPIX-17シリーズ 鉄鋼・非鉄	201110～
IDX1058	1058	TOPIX-17シリーズ 機械	201110～
IDX1059	1059	TOPIX-17シリーズ 電機・精密	201110～
IDX1060	1060	TOPIX-17シリーズ 情報通信・サービスその他	201110～
IDX1061	1061	TOPIX-17シリーズ 電力・ガス	201110～
IDX1062	1062	TOPIX-17シリーズ 運輸・物流	201110～
IDX1063	1063	TOPIX-17シリーズ 商社・卸売	201110～
IDX1064	1064	TOPIX-17シリーズ 小売	201110～
IDX1065	1065	TOPIX-17シリーズ 銀行	201110～
IDX1066	1066	TOPIX-17シリーズ 金融(除く銀行)	201110～
IDX1067	1067	TOPIX-17シリーズ 不動産	201110～
IDX1068	1068	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX バリュース	201110～
IDX1069	1069	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX 500 バリュース	201110～
IDX1070	1070	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX small バリュース	201110～
IDX1071	1071	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX グロース	201110～
IDX1072	1072	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX 500 グロース	201110～
IDX1073	1073	TOPIX スタイルインデックスシリーズ TOPIX small グロース	201110～
IDX1074	1074	東証配当フォーカス100 指数	201110～
IDX1075	1075	東証REIT用途別指数シリーズ オフィス	201110～
IDX1076	1076	東証REIT用途別指数シリーズ 住宅	201110～
IDX1077	1077	東証REIT用途別指数シリーズ 商業・物流等	201110～
IDX1078	1078	TOPIX アジア関連株指数	201110～ 201608
IDX1079	1079	東証マザーズCore 指数	201110～
IDX1080	1080	JASDAQ指数(FDS算出の配当込指数値)	199212～
IDX1081	1081	ヘラクレス指数(FDS算出の配当込指数値)	200006～ 201010
IDX1082	1082	国内株式全銘柄の普通株時価総額加重ポートフォリオ(FDS算出)	197701～
IDX1083	1083	東証1部、2部全銘柄の普通株時価総額加重ポートフォリオ(FDS算出)	197701～
IDX1084	1084	東証1部全銘柄の普通株時価総額加重ポートフォリオ(FDS算出)	197701～

以 上。

※ 本資料は、「日本上場株式日次リターンデータ(日次+週次+月次)」の仕様書です。提供する各種加工データは、信頼できると思われるデータソースから、十分な注意を払い、加工・作成しておりますが、その完全性・正確性を保証するものではありません。また、本情報の利用によって生じた直接的又は間接的な損害については、その内容、態様の如何を問わず、弊社はその一切の責任を負うものではありません。