

個別銘柄情報 - 想定株価レンジについて

最新のコンセンサス予想、財務実績等のファンダメンタルズ・データと、日々の PER、PBR 等の投資指標を統計処理したデータを元に、妥当と考えられる株価のレンジをビジュアルに表現しています。

想定株価レンジ (PBR 基準)

四半期毎の短信発表実績値から算出した BPS と、直近 75 日間の PBR の推移から算出した PBR レンジを元に、想定される株価の上値目途、下値目途を算出しています。

想定株価レンジ (PER 基準)

最新のコンセンサス予想から算出した EPS と、直近 75 日間の PER の推移から算出した PER レンジを元に、想定される株価の上値目途、下値目途を算出しています。

基本的な考え方

想定株価レンジは、PBR、PER の算式を次のように組み替えて算出しています。

$$\text{PBR(PER)} = \text{株価} \div \text{BPS(EPS)}$$



$$\text{株価} = \text{BPS(EPS)} \times \text{PBR(PER)}$$



'株予報' 想定株価レンジの算出式

PBR 基準	最新の実績 BPS × 過去 75 日間の PBR レンジ(±2)
PER 基準	最新の予想 EPS × 過去 75 日間の PER レンジ(±2)

* 予想 EPS および PER は、コンセンサスベースの数値を使用しています。

掲載内容

株価の想定レンジと、株価(前日終値)のレンジ内の相対位置を表示しています。

妥当株価	過去 75 日間の予想 PER 平均値をあてはめた場合の株価水準
上限目途	予想 PER の上限(平均+2)まで買われた場合の株価水準
下限目途	予想 PER の下限(平均-2)まで売られた場合の株価水準

±2 (シグマ) とは

は、データの分布の度合を示す数値である標準偏差を指します。平均値から標準偏差だけ離れていれば 1、標準偏差の 2 倍離れていれば 2 となります。

分布のしかたが正規分布である場合、全体の 68.3% が平均 ±1 の範囲に納まり、95.4% が平均 ±2 の範囲に納まるとされています。

