



【1399】

上場高配当低ボラ

上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティ【正式名称】



- 流動性基準及び配当利回り基準により銘柄を抽出し、当該銘柄で構成される株式ポートフォリオのリスクを最小化するように銘柄選定及び銘柄のウェイト設定を行う最小分散戦略を用いた指数「MSCIジャパンIMIカスタム高流動性高利回り低ボラティリティ指数」との連動を目指すETF(上場投資信託)です。

1.概要

(2024年1月31日 現在)

銘柄名	上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティ		
対象指標	MSCIジャパンIMIカスタム高流動性高利回り低ボラティリティ指数		
計算期間	毎年1月9日～4月8日、4月9日～7月8日、7月9日～10月8日、10月9日～翌年1月8日		
分配金支払基準日	毎年1月8日、4月8日、7月8日、10月8日(年4回)		
管理会社	日興アセットマネジメント		
銘柄コード	1399	市場価格(終値)(※1)	2,078 円
売買単位	10口単位	1口あたり分配金(※2)	52.5円
信託報酬(税込)	0.385%	分配金利回り(※3)	2.53%
純資産総額	48 億円	東証マーケットメイク制度(※4)	対象
受益権口数	2,299,842 口	1売買単位あたりの投資金額(※1)	20,780 円

※1 上記の期日において約定がない場合、「市場価格(終値)」及び「1売買単位あたりの投資金額」には、直近時点の市場価格を記載しています。

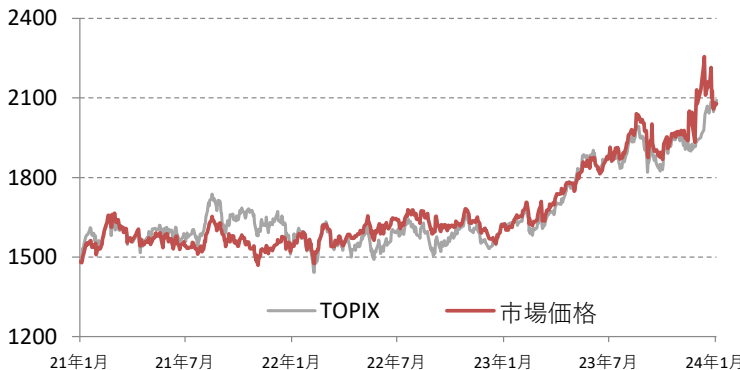
※2 直近12か月の実績分配金を記載しています。

※3 直近12か月の実績分配金及び作成日の終値をもとに算出した分配金利回りを記載しています。

※4 東証が2018年7月2日に導入したETF市場におけるマーケットメイク制度の対象銘柄か否かを記載しています。マーケットメイクとはマーケットメイカーが気配を提示して取引の流動性を提供することです。

2.パフォーマンス

(2024年1月31日 現在)



※ 2021年1月29日 の市場価格を基準値とし、TOPIXの値を再換算しています。

■ 騰落率

期間	当銘柄	(参考)TOPIX
過去3か月	+10.03%	+13.20%
過去6か月	+10.06%	+9.84%
過去1年	+27.84%	+29.15%
過去3年	+40.12%	+41.04%
過去5年	+34.06%	+62.75%

3.ファンド組入銘柄

(2024年1月31日 現在)

	証券コード	銘柄名	構成比
1	6417	SANKYO	1.40%
2	1959	九電工	1.20%
3	7974	任天堂	1.15%
4	9404	日本テレビホールディングス	1.14%
5	2282	日本ハム	1.10%

4.情報ベンダーコード

情報ベンダー名	ETFコード	対象指標
QUICK	1399/T	-
Bloomberg	1399 JP Equity	M9CXNIKA
Refinitiv	1399.T	-

5.対象指標の概要

日本国内の取引所に上場している大型・中型・小型株を対象としたMSCIジャパンIMI指数から金融株と不動産投信(J-REIT)を除外した銘柄をユニバースとします。流動性基準(売買頻度及び売買代金)により選択された400銘柄の中から、配当利回りの上位150銘柄を抽出し、当該銘柄のポートフォリオに対して最適化(銘柄選定及び銘柄のウェイト設定)を行います。当該最適化は、銘柄間・ファクター間の相関関係等を考慮した上で株式ポートフォリオのリスクを最小化することを目的としており、Barraグローバル株式モデル(※)を使用しています。

※Barraグローバル株式モデルは、MSCIグループのBarra社が開発した、株価・債券価格等の変動要因を説明するマルチファクター・モデルの手法を用いた分析モデルです。マルチファクター・モデルを利用することで、個別銘柄やポートフォリオのリターンを要因別に分解し、要因毎のリターンを利用してリスクを推定することが可能です。

6. 情報入手一覧

- 現在値、インディカティブNAV・PCF
<http://tse.factsetdigitalsolutions.com/iopv/table?language=jp>
- 基準価額(一口あたりの純資産額)等に関する情報
<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etfs/base-price/index.html>
- ETF/ETN銘柄検索
<https://money-bu-jpx.com/search/> (東証マネ部！)

7. 免責事項

- 当資料は、作成時におけるETF/ETNの概要説明のみを目的としており、投資勧誘を目的としているものではなく、また金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。
- ETF/ETNは値動きのある有価証券等を投資対象としますので、連動対象である指標及び外国為替相場の変動、組入有価証券等の価格の変動、組入有価証券等の発行会社の倒産や財務状況等の悪化、その他の市場要因の影響等により、市場取引価格又は基準価額が値下がりし、それにより損失が生じることがあります。したがって、投資元本が保証されているものではありません。また、信用取引を利用する場合には、差し入れた保証金以上の損失が生ずるおそれがあります。
- ETF/ETNの売買が行われる際には、あらかじめお取引先の金融商品取引業者等より交付される契約締結前交付書面等の書面の内容を十分にお読みいただき、商品の性質、取引の仕組み、リスクの存在、販売手数料、信託報酬などの手数料等を十分に御理解いただいたうえで、御自身の判断と責任で行っていただきますよう、お願い申し上げます。
- 当資料の実績数値は過去のものであり、将来の運用成果等を保証するものではありません。
- 当資料は、更新日現在の内容です。その以後、制度の改正等により、当資料に掲載した内容が予告なく変更される場合があります。また、この資料に掲載されている情報の作成には万全を期していますが、当該情報の完全性を保証するものではありません。当社は、当資料及び当資料から得た情報を利用したことにより発生するいかなる費用又は損害等の一切について責任を負いません。
- 本資料の一切の権利は当社に属しており、いかなる目的を問わず、無断複製・転載を禁じます。