



【1456】

大和225ペア【略称】

ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス【正式名称】



- 指数の変動率が、日経平均株価の前日比変動率(%)の-1倍となるように計算された、日経平均インバース・インデックスに連動するETF(上場投資信託)です。

1. ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックスの概要

(2017年7月31日 現在)

銘柄名	ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス		
対象指標	日経平均インバース・インデックス		
計算期間	毎年1月11日～翌年1月10日		
分配金支払基準日	毎年1月10日(年1回)		
管理会社	大和証券投資信託委託株式会社		
銘柄コード	1456	市場価格(終値)(※1)	8,290 円
売買単位	1口単位	1口あたり分配金(※2)	0円
信託報酬	0.75% (税込; 0.81 %)以内	分配金利回り(※3)	0.00%
純資産総額	92 億円	Indicative NAV/PCFの開示(※4)	あり
受益権口数	1,097 千口	1売買単位あたりの投資金額(※1)	8,290 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。

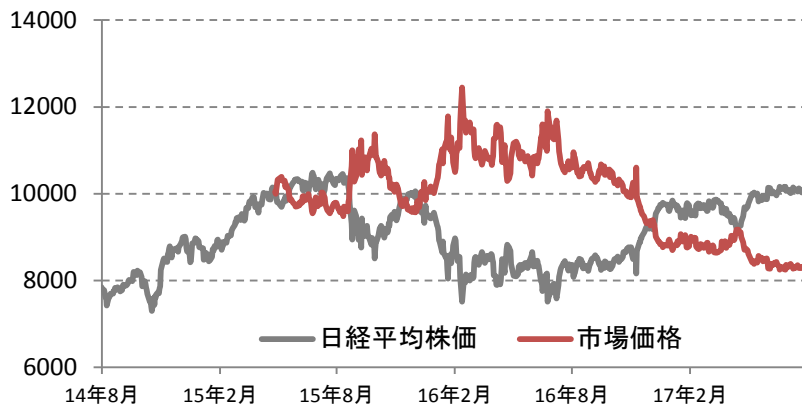
※2 直近12か月の実績分配金を記載しています。

※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 Indicative NAVとは、PCF情報に現時点の株価を乗じることによって算出される、リアルタイムの推定純資産額(1口あたり)、PCFとは、管理会社よりご提供をいただいた、ポートフォリオ構成銘柄情報ファイルのことを指します。ここでは東証を通じて開示しているIndicative NAV/PCF情報の有無を記載しています。

2. パフォーマンス

(2017年7月31日 現在)



※ 2015年4月27日の市場価格を基準値とし、日経平均株価の値を再換算しています。

※当該実績(手数料等含まず)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。

対象指標の現在値 <http://indexes.nikkei.co.jp/nkave/nkidx>

■ 騰落率

期間	当銘柄	(参考)日経平均株価
過去3か月	-5.15%	+3.79%
過去6か月	-7.17%	+4.64%
過去1年	-22.01%	+20.25%
過去3年	-	+27.56%
過去5年	-	+129.16%

■ 当銘柄のボラティリティ

ボラティリティ(過去30日)	7.7%
ボラティリティ(過去90日)	11.2%

※ 対象期間のうち13%以上の日に売買が成立していない場合、上場後の期間が記載の期間に満たない場合は「-」と表示されます。

3. ファンド組入銘柄

(2016年12月30日 現在)

証券コード	銘柄名	構成比
1	日経225先物	-100.10%
2		
3		

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	1456/T	S101 #II/NKNJ
Bloomberg	1456 JP Equity	NKYINV INDEX
Thomson Reuters	1456.T	.N225INV

5. 対象指標の概要

日経平均インバース・インデックスは、下記の計算式を用いて原指標である日経平均株価の前日比変動率(%)*-1倍を乗じた変動率となるように計算された指数です。なお、当該指数は連動するETF等への投資者の利便性を高める観点から、リアルタイム(15秒1回)で算出・公表され、国内外の報道機関や情報ベンダーに配信されます。

当日の指数値 = 前日の指数値 × (1 - 1倍 × 日経平均株価の前日比変動率)

* 前日比変動率(%)は、小数第3位四捨五入

日経平均インバース・インデックスの基準日は2001年12月28日であり、基準値は10,000ポイントであるため、原指標である日経平均株価の値とは異なります。

6. 対象指標の特徴及び留意点

- インバース型指標は、変動率が原指標の日々の変動率の-1倍となるように算出されているため、前営業日と比較するとその変動率は原指標の-1倍となりますが、2営業日以上離れた期間での比較においては、複利効果により、原指標の変動率の-1倍以上又は未滿となる場合があります。
- インバース型指標は、原指標が下落トレンドにある場合において上昇する指標であるため、原指標の下落を見込む場合には有用ですが、原指標が上昇・下落を相互に繰り返す場合、上記の複利効果によりインバース型指標は逓減していくという特性があり、このような場合、投資者は利益を得にくくなりますので留意が必要です。また、インバース型指標は、中長期にわたって投資をする場合、原指標の変動率とインバース型指標の変動率の乖離が大きくなる可能性があり、留意が必要です。

<インバース型指標の説明はこちら>

<http://indexes.nikkei.co.jp/nkave/index/profile?idx=nk225in>

7. ETF情報入手一覧

- 各ETFに関するより詳細な商品概要
「大和証券投資信託委託株式会社 ETF専用ホームページ」 <http://etf.daiwa-am.co.jp>
- ETFの現在値・前日比・売買高・PCF情報・インディカティブNAV・分配金
<http://www.tse.idmanagedsolutions.com/iopv/table?language=jp&iopv=0>
- 一口あたりの純資産総額、対象指数との乖離率、ファンドの組入銘柄等
(注)検索される場合には、検索条件に検索コード5ケタの管理会社コード「13064」を入力してください。
「適時開示情報閲覧サービス」 https://www.release.tdnet.info/inbs/I_main_00.html

8. 免責事項

- 当資料は、作成時におけるETF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は値動きのある有価証券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、組入有価証券の価格の変動、組入有価証券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の売買を行われるに際しては、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。
- 当資料は、2017年7月現在の内容です。その後、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。