

【1467】 JPX日経400ブル【略称】 JPX日経400ブル2倍上場投信(レバレッジ)【正式名称】



- 指標の変動率が、JPX日経インデックス400の前日比変動率(%)の2倍となるように計算された、JPX日経400レバレッジ・インデックスに連動するETFです。

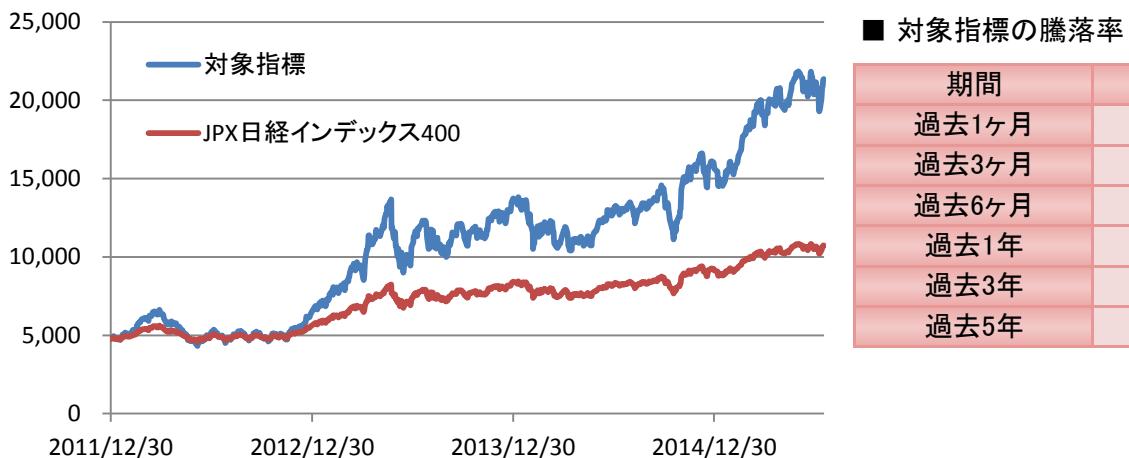
1. JPX日経400ブル2倍上場投信(レバレッジ)の概要

(2015年8月5日 現在)

銘柄名	JPX日経400ブル2倍上場投信(レバレッジ)		
銘柄コード	1467		
対象指標	JPX日経400レバレッジ・インデックス		
計算期間	毎年8月21日～翌年8月20日		
分配金支払基準日	毎年8月20日(年1回)		
管理会社	シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社		
信託受託会社	三井住友信託銀行株式会社		
上場取引所	東京証券取引所	貸借銘柄選定	あり(金銭・証券の貸付)
売買単位	10口単位	iNAV/PCFの開示(※)	あり(予定)
信託報酬	0.75% (税込; 0.81%)以内	上場日	2015/8/24(予定)

※ iNAV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iNAV/PCF情報の有無を記載しています。

2. 対象指標の推移 (2011年12月30日～2015年7月17日)



※ 2011年12月30日の対象指標の値を基準値とし、JPX日経インデックス400の値を再換算しています。

3. 投資対象について

JPX日経400先物取引を主要投資対象とします。当該取引の買建て総額が純資産総額に対して約2倍程度になるように調整を行います。

4. 対象指標の概要

JPX日経400レバレッジ・インデックスは、下記の計算式を用いて原指標であるJPX日経インデックス400の前日比変動率(%)*に2倍を乗じた変動率となるように計算された指標です。なお、当該指標は連動する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。

$$\text{当日の指標値} = \text{前日の指標値} \times (1 + 2\text{倍} \times \text{JPX日経インデックス400の前日比変動率})$$

* 前日比変動率(%)は、小数第3位四捨五入

JPX日経400レバレッジ・インデックスの基準日は2013年8月30日であり、基準値は10,000ポイントです。

JPX日経400レバレッジ・インデックスは、2013年8月30日の値を10,000ポイントとして基準化したものであるため、原指標であるJPX日経インデックス400の値とは異なります。

5. 対象指標の特徴及び留意点

- レバレッジ型指標は、変動率が原指標の日々の変動率の2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2倍となります。また、2営業日以上離れた日との比較においては、複利効果により、原指標の変動率の2倍超又は未満となる場合があります。
- レバレッジ型指標は、原指標が上昇トレンドにある場合において上昇し、収益をさらに強く求める指標であるため、原指標の上昇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レバレッジ型指標は過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、中長期にわたって投資をする場合、原指標の変動率とレバレッジ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。
- レバレッジ型指標に連動するETFは原指標に連動するETFに比べ市場価格と理論価格の値動きが大きいため、当該指標に連動するETFの市場価格がストップ高(ストップ安)となったのちも当該指標が上昇(下落)を続けた場合、市場価格と理論価格が乖離し、その結果理論価格に近い価格で売買することが出来なくなる可能性がより高くなるため、留意が必要です。なお、このような市場価格と理論価格の乖離は一般的には理論価格が呼値の制限値幅内の値となつた際に解消されると考えられます。

<レバレッジ型指標の説明はこちら>

<http://www.jpx.co.jp/equities/products/etfs/etf-outline/04-03.html>

6. ETF情報入手一覧

- 当ETFに関するより詳細な商品概要
「シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社 ETF専用ホームページ」 <http://www.simplexasset.com/jp/etf/top/index.html>
 - 一口あたりの純資産総額、対象指標との乖離率、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「16714」を入力してください。
「適時開示情報閲覧サービス」<http://www.ipx.co.jp/listing/disclosure/index.html>
 - 情報ベンダーコード
- | 情報ベンダー名 | QUICK | Bloomberg | Thomson Reuters |
|---------|--------|----------------|-----------------|
| ETFコード | 1467/T | 1467 JT Equity | 1467.T |
| 対象指標 | 580 | JPNK4LV Index | .JPXNK400LEV2 |
- JPX日経400レバレッジ・インデックスの算出要領
http://www.jpx.co.jp/markets/indices/jpx-nikkei400/tvdivq00000031dd-att/20150604_j.pdf
 - JPX日経400レバレッジ・インデックスの指標値
<http://www.ipx.co.jp/markets/indices/realvalues/index.html>

7. 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、2015年8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。

<お問い合わせ>

株式会社東京証券取引所 上場推進部 | 〒103-8220 東京都中央区日本橋兜町2-1 | Tel:03-3666-0141(代)