



【1465】

大和J400ペア

ダイワ上場投信－JPX日経400 インバース・インデックス【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-1倍となるように計算された、JPX日経400インバース・インデックスに連動を目指す商品です。

1.概要

(2021年8月31日 現在)

銘柄名	ダイワ上場投信－JPX日経400 インバース・インデックス		
対象指標	JPX日経400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	大和アセットマネジメント		
銘柄コード	1465	市場価格(終値)(※1)	5,090 円
売買単位	1口単位	1口あたり分配金(※2)	0円
信託報酬(税込)	0.825%	分配金利回り(※3)	0.00%
純資産総額	3 億円	東証マーケットメイク制度(※4)	対象外
受益権口数	52,000 口	1売買単位あたりの投資金額(※1)	5,090 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

(2021年8月31日 現在)



※ 2018年8月31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	-2.12%	+1.96%
過去6か月	-7.12%	+5.16%
過去1年	-22.17%	+21.17%
過去3年	-30.65%	+12.99%
過去5年	-51.43%	+47.47%

3.ファンド組入銘柄

	証券コード	銘柄名	構成比
1		JPX日経400先物	
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	1465/T	581
Bloomberg	1465 JP Equity	JPNK4IV Index
Refinitiv	1465.T	.JPXNK400INV1

5.対象指標の概要

JPX日経400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JPX日経インデックス400の前日比変動率(%)の-1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。

当日の指標値 = 前日の指標値 × (1 - 1倍 × 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インバース・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インバース・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。

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、仮に原指標が一日で100%以上値上がりした場合は、投資金額の全額を失います。また、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倍以上又は未満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効ですが、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詳細>
<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etfs/etf-outline/04-05.html>
- インバース型商品は、参照する指数・指標に連動させるため、一般的に先物取引を用いた運用を行っています。このため、一般的にインバース型商品は先物取引コストを負担しているほか、先物取引の期限(限月)を乗り換える際に、リスクが生じることに注意が必要です。

7. 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！)

8. 免責事項

- 当資料は、作成時における当商品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。
- 当商品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。
- 当商品の売買が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。