



【1552】 VIX短期先物

国際のETF VIX短期先物指数【正式名称】



● 米ドルベースの「S&P500 VIX短期先物指数」を円換算した対象株価指数に連動する投資成果を目的としたETF(上場投資信託)です。
「VIX」とは、ボラティリティ・インデックス(Volatility Index)の略称で、一般的に相場の先行きに対する投資家心理を示すものとして利用されています。

1.概要

(2023年6月30日 現在)

銘柄名	国際のETF VIX短期先物指数		
対象指標	S&P500 VIX短期先物指数(円換算)		
計算期間	毎年11月15日～翌年11月14日		
分配金支払基準日	毎年11月14日(年1回)		
管理会社	三菱UFJアセットマネジメント		
銘柄コード	1552	市場価格(終値)(※1)	723 円
売買単位	1口単位	1口あたり分配金(※2)	2円
信託報酬(税込)	0.396%	分配金利回り(※3)	0.28%
純資産総額	216 億円	東証マーケットメイク制度(※4)	対象
受益権口数	29,707,099 口	1売買単位あたりの投資金額(※1)	723 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が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。

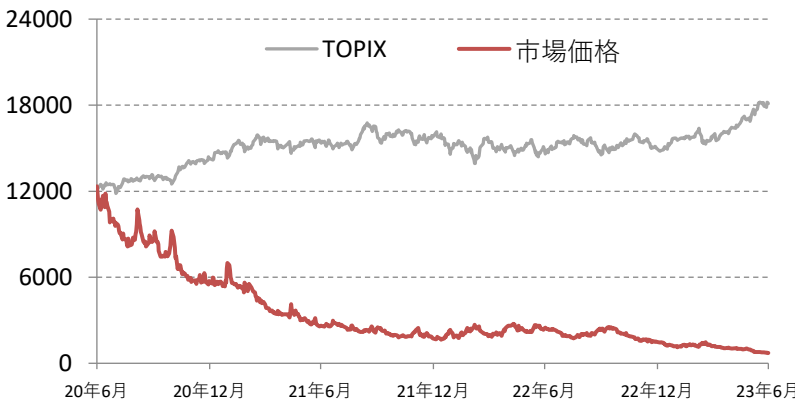
[留意事項]

本銘柄は2017年9月15日に200:1の比率で受益権併合を行っております。権利落ち日の2017年9月12日より1口あたりの価格が200倍となりましたが、受益権口数は200分の1となっておりますので、理論的には当該受益権の資産価値自体が増加した訳ではありませんのでご注意ください。

(注) 監理銘柄: 当ETFは繰上償還および繰上償還にかかる重大な約款変更を提案中です。2023年11月14日を基準日として設定し、当該基準日現在の受益者名簿上の受益者を、書面決議における議決権を行使できる受益者と定めます。当該約款変更に関する書面決議が可決された場合、東京証券取引所における最終売買日は2024年2月9日となる予定です。繰上償還が決定された場合、当ETFを最終売買日までに売却せず償還まで保有されますと、償還金の受取方法・受取時期、税金等に関し、取引所での売却時の取扱いとは異なる点がありますのでご注意ください。

2.パフォーマンス

(2023年6月30日 現在)



※ 2020年6月30日 の市場価格を基準値とし、TOPIXの値を再換算しています。

※ 市場価格は、受益権併合調整済みです。

■ 騰落率

期間	当銘柄	(参考)TOPIX
過去3か月	-39.65%	+14.23%
過去6か月	-51.77%	+20.98%
過去1年	-70.42%	+22.33%
過去3年	-94.14%	+46.82%
過去5年	-94.41%	+32.22%

3.ファンド組入銘柄

(2023年6月28日 現在)

	証券コード	銘柄名	構成比
1	-	CBOE VIX2307	72.08%
2	-	CBOE VIX2308	27.93%
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	1552/T	SSPVIXSTR/SPU
Bloomberg	1552 JP Equity	SPVXSTR INDEX
Refinitiv	1552.T	.SPVIXSTR

5.対象指標の概要

「S&P 500VIX短期先物指数」は、VIX指数先物の第1限月の先物を売却し、第2限月の先物を買付ける取引を日次で行い、加重平均した残存日数を1カ月に維持する取引を行った場合のリターンを指数化し、それを円換した値となります。

6. 対象指標の特徴及び留意点

- 本商品は、「VIX指数」(以下、「原指数」といいます。)ではなく、円換算した「S&P500 VIX短期先物指数」(以下、「対象指標」といいます。)への連動を目指しており、その価値は、仮に本商品が原指数への連動を目指していた場合に有していたであろう価値を下回るおそれがあります。
- 対象指標を計算する元となるS&P500 VIX短期先物の限月間には通常、価格差があるため、本商品の一口当たりの償還価額は、その価格差がなかった場合と比べて、大幅に減少する可能性があります。したがって、本商品は、一般的には長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。
- 対象指標は株式市場の急騰または急落時に大幅に変動する傾向があり、その結果として投資金額が大幅に毀損するおそれがあります。
- <先物型ETFのリスクの詳細>
<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etfs/risk/03.html>

7. 情報入手方法

- 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/ETN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。