



【1567】 MXSリスク5

MAXISTピックスリスクコントロール(5%)上場投信【正式名称】



● ボラティリティを抑制することによりダウンサイドリスクをコントロールする目的で開発された「S&P/JPX リスク・コントロール指数(5%)」との連動を目指すETF(上場投資信託)です。

1.概要

(2019年8月30日 現在)

銘柄名	MAXISTピックスリスクコントロール(5%)上場投信		
対象指標	S&P/JPX リスク・コントロール指数(5%)		
計算期間	毎年1月17日～7月16日、毎年7月17日～翌年1月16日		
分配金支払基準日	毎年1月16日、7月16日(年2回)		
管理会社	三菱UFJ国際投信		
銘柄コード	1567	市場価格(終値)(※1)	1,160 円
売買単位	10口単位	1口あたり分配金(※2)	2.8円
信託報酬(税込)	0.2592%	分配金利回り(※3)	0.24%
純資産総額	0.1 億円	マーケットメイク(※4)	なし
受益権口数	11,000 口	1売買単位あたりの投資金額(※1)	11,600 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。

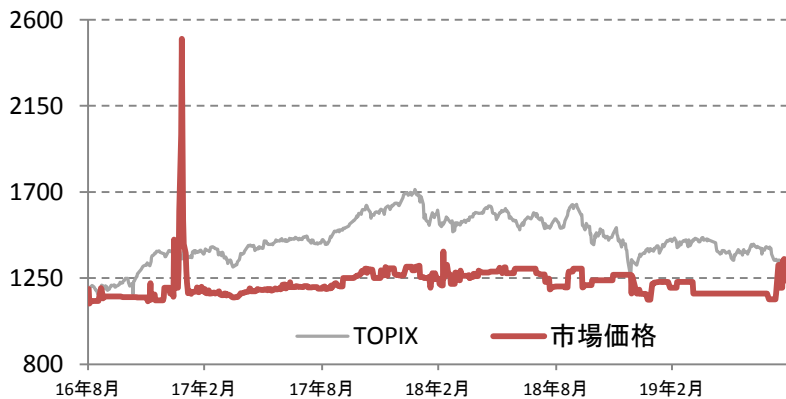
※2 直近12か月の実績分配金を記載しています。

※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 マーケットメイクの対象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。

2.パフォーマンス

(2019年8月30日 現在)



※ 2016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	-0.85%	-0.03%
過去6か月	-3.33%	-5.96%
過去1年	-3.81%	-12.88%
過去3年	-2.68%	+13.71%
過去5年	+1.31%	+18.30%

3.ファンド組入銘柄

(2019年2月28日 現在)

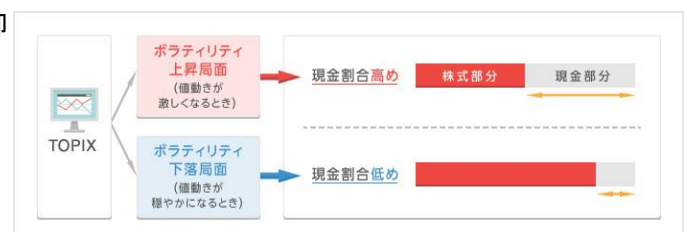
証券コード	銘柄名	構成比
1	コールローン他	77.20%
2	7203 トヨタ自動車	0.16%
3	9984 ソフトバンクグループ	0.09%
4	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.09%
5	4502 武田薬品工業	0.09%

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	1567/T	STPX#RC05/TSEJ
Bloomberg	1567 JP Equity	TPXDR5T INDEX
Refinitiv	1567.T	-

5.対象指標の概要

S&P/JPX リスク・コントロール指数(5%)は、TOPIXのボラティリティを抑制することによりダウンサイドリスクをコントロールする目的で開発された指数です。TOPIXとキャッシュの可変ウェイトで構成され、TOPIX(配当込み)のヒストリカルボラティリティがターゲットボラティリティ(5%)を超えると、超えた割合に応じて株式部分(TOPIX)の割合を減らすことで、指数自体のボラティリティを抑制します。



6. リスクコントロール指標の特徴及び留意点

- <指数の特性>
株式部分(TOPIX)の割合を可変にすることにより、指標の変動率をTOPIXより低く抑えています。
- <TOPIXとの相違>
TOPIXに比べて、日々の変動率が小さくなる傾向があることから、TOPIXに比べ利益・損失の額が小さくなる傾向があります。
- <留意すべき投資スタイル>
相場下落時の損失を低減させる効果が期待できる反面、株価上昇による収益機会も限定されることがあります(TOPIX(配当込み)に比べ収益および損失の両方が限定的となります。)。したがって、短期的に収益を求める投資家は期待する投資成果が得られにくいので留意が必要です。
- <リスクコントロール指標の詳細>
<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etfs/etf-outline/04-02.html>

7. 情報入手一覧

- 現在値、インディカティブNAV・PCF
<http://www.tse.idmanagedsolutions.com/iopv/table?language=jp>
- 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
「適時開示情報閲覧サービス」https://www.release.tdnet.info/inbs/I_main_00.html
- ETF/ETN銘柄検索
「東証マネ部！」<https://money-bu-jpx.com/search/>

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。