1465

iFreeETF JPX日経400インバース・インデックス

追加型投信/国内/株式/ETF/インデックス型

信託期間 : 2015年8月21日 から 2024年11月12日

※当ファンドは、2024年11月12日をもって繰上償還となります。

決算日 : 毎年1月10日

基 準 日 : 2024年10月31日

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません

≪基準価額・純資産の推移≫

 2024年10月31日現在

 基準価額
 28,906 円

 純資産総額
 80百万円

期間別騰落	率	
期間	ファンド	ベンチマーク
1カ月間	-2.4 %	-1.8 %
3カ月間	-1.8 %	+0.1 %
6カ月間	-5.2 %	-3.1 %
1年間	-25.4 %	-22.5 %
3年間	-41.9 %	-34.3 %
5年間	-58.5 %	-49.5 %
年初来	-20.4 %	-17.6 %
設定来	-71.1 %	-58.8 %

≪分配の推移≫



- ※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。
- ※基準価額の計算において、運用管理費用(信託報酬)は控除しています(後述のファンドの費用をご覧ください)。
- ※「期間別騰落率」の各計算期間は、基準日から過去に遡った期間とし、当該ファンドの「分配金再投資基準価額」を用いた騰落率を表しています。
- ※当ファンドはJPX日経400インバース・インデックスをベンチマークとしておりますが、ベンチマークを上回る運用成果を保証するものではありません。
- ※グラフ上のベンチマークは、グラフの起点時の分配金再投資基準価額に基づき指数化しています。

※実際のファンドでは、課税条件によって投資者ごとの騰落率は異なります。また、換金時の費用・税金等は考慮していません。

(10口当たり 税引前)

(10口当たり、	税引前)
----------	------

決算期(分配金	
第1期	(16/01)	0円
第2期	(17/01)	0円
第3期	(18/01)	0円
第 4 期	(19/01)	0円
第5期	(20/01)	0円
第6期	(21/01)	0円
第7期	(22/01)	0円
第8期	(23/01)	0円
第9期	(24/01)	0円

◎工安は貝座の仏が/	/

貧産別構成		
資産	銘柄数	比率
コール・ローン、その他		100.0%
合計		100.0%

その他資産別構成		
資産	銘柄数	比率

頂 芬悝別 博 戍	
種別	比率

※比率は、純資産総額に対するものです

分配金合計額 設定来: 0円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

組入上位10銘柄		
銘柄名	償還日	比率
		
		
		
		

※バーゼル規制(金融機関の自己資本比率規制)等のリスク算定が必要の際は販売会社にご連絡ください。

■当資料は、ファンドの状況や関連する情報等をお知らせするために大和アセットマネジメントにより作成されたものです。当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は大きく変動します。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。後述の当資料のお取り扱いにおけるご注意をよくお読みください。

設定•運用:

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Managemen

商号等

大和アセットマネジメント株式会社 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第352号

加入協会 一般社団法人投資信託協会

- 一般社団法人日本投資顧問業協会
- 一般社団法人第二種金融商品取引業協会

≪ファンドの目的・特色≫

ファンドの目的

・信託財産の 1 口当たりの純資産額の変動率を「JPX 日経 400 インバース・インデックス」の変動率に一致させることを目的とします。

ファンドの特色

- ・わが国の株価指数先物取引を売建てるとともに、残存期間の短いわが国の債券に投資します。
- ・株価指数先物取引の売建玉の時価総額の合計額が、原則として、信託財産の純資産総額と同程度になるように調整を行ないます。

JPX 日経 400 インバース・インデックスについて

- ①「JPX 日経 400 インバース・インデックス」は、株式会社 J P X 総研(以下「J P X 総研」といいます。)および株式会社日本経済新聞社(以下「日経」といいます。)によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、 J P X 総研および日経は、「JPX 日経 400 インバース・インデックス」自体および「JPX 日経 400 インバース・インデックス」を算定する手法、さらには「JPX 日経 400 インバース・インデックス」を算出する際の根拠となる「JPX 日経インデックス 400」自体および「JPX 日経インデックス 400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。
- ②「JPX 日経 400 インバース・インデックス」および「JPX 日経インデックス 400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべて J P X 総研、株式会社日本取引所グループおよび日経に帰属しています。
- ③本件投資信託は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、JPX総研および日経は、その運用および本件投資信託の取引に関して、一切の責任を負いません。
- ④ J P X 総研および日経は、「JPX 日経 400 インバース・インデックス」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤 謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。
- ⑤ J P X 総研および日経は、「JPX 日経インデックス 400」の構成銘柄、「JPX 日経 400 インバース・インデックス」および「JPX 日経インデックス 400」の計算方法ならびにその他「JPX 日経 400 インバース・インデックス」および「JPX 日経インデックス 400」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

≪投資リスク≫

● 当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。投資信託は預貯金とは異なります。基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

株価指数先物取引の利用に伴う	株価指数先物の価格は、対象とする指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動
リスク	します。先物を売建てている場合の先物価格の上昇により損失が発生し、基準価額が下
	落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。
株価の変動	株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。
(価格変動リスク・信用リスク)	発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあり
	ます。当ファンドの対象指数は日々の騰落率を JPX 日経インデックス 400 の騰落率の –
	1倍(マイナス1倍)として計算された指数であるため、株価が上昇した場合には、基準
	価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。
公社債の価格変動	公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下
(価格変動リスク・信用リスク)	落します。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。
	特に、発行体が債務不履行を発生させた場合、またはその可能性が予想される場合に
	は、公社債の価格は下落します。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が
	下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。
その他	解約資金を手当てするため組入証券を売却する際、市場規模や市場動向によっては市
	場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価
	額が下落する要因となります。
	-

[※]基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。
- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。
- ●「JPX 日経 400 インバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点対象指標とする「JPX 日経 400 インバース・インデックス」は原指標の「JPX 日経インデックス 400」の変動率の「-1 倍」(マイナス 1 倍)の値動きになる指数で、「JPX 日経インデックス 400」の 1 日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-1 倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上の計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「JPX 日経インデックス 400」の変動率の「-1 倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「JPX 日経インデックス 400」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性がありますが、一般に、「JPX 日経インデックス 400」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。
- ●レバレッジ倍率に比した高リスク商品であり、初心者向けの商品ではありません。長期に保有する場合、対象資産の値動きに比べて 基準価額が大幅に値下がりすることがあるため、そのことについてご理解いただける方に適しています。
- 当ファンドは、金融商品取引所に上場され取引が行なわれます。当ファンドの市場価格は需給等を反映し決定されるため、基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

≪ファンドの費用≫

投資者	投資者が直接的に負担する費用					
		料率等	費用の内容			
購入	時手数料	販売会社が独自に 定めるものとします。	購入時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。			
信託則	材産留保額	ありません。	_	-		
換金	時手数料	販売会社が独自に 定めるものとします。	換金に伴う取引執行等の対価です。			
投資者	が信託財産	で間接的に負担する費用				
		料率等	費用の	D内容		
	管理費用託報酬)	年率0.825%(税抜0.75%)以内 (提出日現在は、 <u>年率0.825%(税抜0.75%)</u>)	運用管理費用の総額は、日々の信託財産の純資産総額に対して左記の率を乗じて 得た額とします。運用管理費用は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。			
配分(税抜)		年率0.70%	ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書作成等の対価です。			
(注1)	受託会社	年率0.05%	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価です。			
			 ●有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、 監査報酬等を信託財産でご負担いただきます。 ●受益権の上場にかかる費用および対象指数の商標の使用料(商標使用料)ならびにこれらにかかる消費税等に相当する金額を、受益者の負担として信託財産から支払うことができます。 ※提出日現在、商標使用料は信託財産の純資産総額に、以下の率を乗じて得た額となります。 			
Z 0 4	他の費用・		純資産総額	料率		
手	数料	(注2)	200億円以下の部分	年率0.066%(税抜0.06%)		
			200億円超1,000億円以下の部分	年率0.055%(税抜0.05%)		
			1,000億円超の部分	年率0.044%(税抜0.04%)		
			・追加上場料:追加上場時の増加額(名	付して、最大0.00825%(税抜0.0075%) 毎年末の純資産総額について、新規上場での各年末の純資産総額のうち最大のもの		

⁽注1)「運用管理費用の配分」には、別途消費税率を乗じた額がかかります。上記の配分は提出日現在の配分であり、今後変更されることがあります。

⁽注2) 売買委託手数料などの「その他の費用・手数料」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。 ※購入時手数料・換金時手数料について、くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

[※]運用管理費用の信託財産からの支払いは、毎計算期間の最初の6か月終了日および毎計算期末または信託終了時に行なわれます。

[※]手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を「JPX日経400インバース・インデックス」の変動率に一致させることを目的として運用を行ないます。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

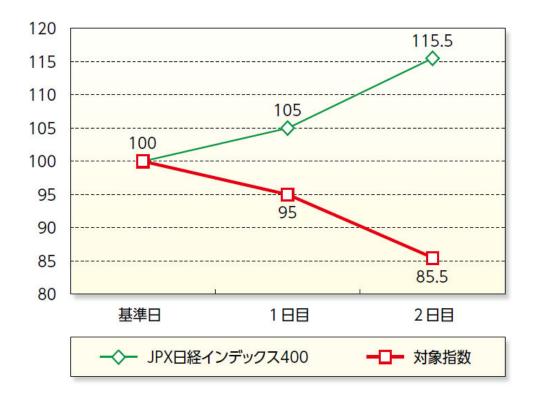
- イ. 株価指数先物取引の売建玉の時価総額の合計額が必ずしも純資産総額と同額とならないこと
- ロ. JPX日経インデックス400の値動きと、利用する株価指数先物の値動きとの差
- ハ. 追加設定および解約に対応した株価指数先物取引の約定価格と終値の差
- 二. 株価指数先物取引をロールオーバーする過程における、限月の異なる先物間の価格差の変動
- ホ. 公社債等の短期有価証券への投資による利子収入等があること
- へ. 運用管理費用(信託報酬)、監査報酬、売買委託手数料等の負担
- ト. 株価指数先物の流動性が低下した場合などにおける売買対応の影響
- チ. 株価指数先物の最低取引単位の影響

JPX日経400インバース・インデックスの値動きについて

●「JPX日経400インバース・インデックス」は、変動率が「JPX日経インデックス400」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「JPX日経インデックス400」の−1倍となりますが、2営業日以上離れた日との比較においては、「JPX日経インデックス400」の変動率の「−1倍」になるわけではありません。

「例1] JPX日経インデックス400が1日目に5%上昇し、2日目に10%上昇した場合

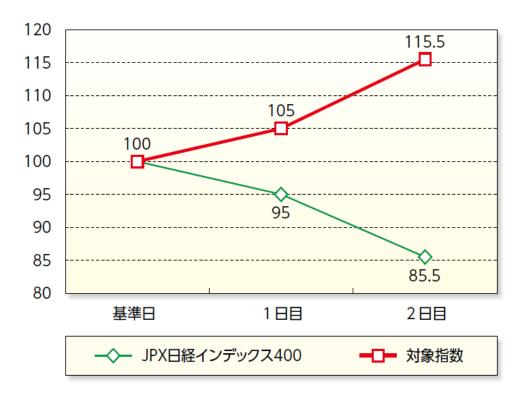
	基準日	1日目	(前日比)	2日目	(前日比)	2日目と 基準日の 比較
JPX日経インデックス400	100	105	5%	115.5	10%	15.50%
JPX日経400インバース・インデックス	100	95	-5%	85.5	-10%	-14.50%



- ◆「2日目」と「基準日」とを比較し、 JPX日経400インバース・インデックスの値動きは (85.5-100)÷100 = -14.5%であり、 JPX日経インデックス400の値動き (115.5-100)÷100 = 15.5%の-1倍とはなっていません。
- ※上記は、対象指数の値動きをわかりやすく説明するため、細部を省略し抽象化して説明した例であり、 実際とは異なりますのでご注意下さい。

[例2] JPX日経インデックス400が1日目に5%下落し、2日目に10%下落した場合

	基準日	1日目	(前日比)	2日目	(前日比)	2日目と 基準日の 比較
JPX日経インデックス400	100	95	-5%	85.5	-10%	-14.50%
JPX日経400インバース・インデックス	100	105	5%	115.5	10%	15.50%



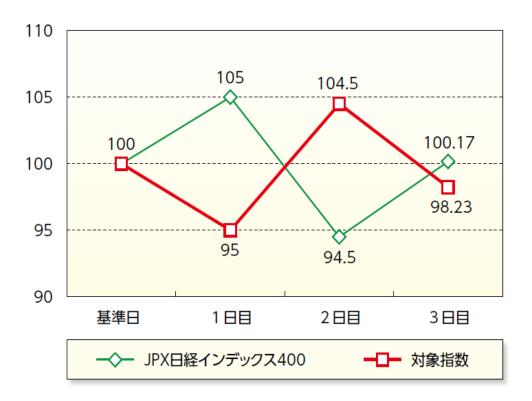
◆「2日目」と「基準日」とを比較し、

JPX日経400インバース・インデックスの値動きは (115.5-100) ÷100 = 15.5%であり、 JPX日経インデックス400の値動き (85.5-100) ÷100 = -14.5% の-1倍とはなっていません。

※上記は、対象指数の値動きをわかりやすく説明するため、細部を省略し抽象化して説明した例であり、 実際とは異なりますのでご注意下さい。

[例3] JPX日経インデックス400が1日目に5%上昇し、2日目に10%下落し、3日目に6%上昇 した場合

	基準日	1日目	(前日比)	2日目	(前日比)	3日目	(前日比)	3日目と 基準日の 比較
JPX日経インデックス400	100	105	5%	94.5	-10%	100.17	6%	0.17%
JPX日経400インバース・インデックス	100	95	-5%	104.5	10%	98.23	-6%	-1.77%



◆「3日目」と「基準日」とを比較し、 JPX日経400インバース・インデックスの値動きは (98.23-100)÷100 = -1.77%であり、 JPX日経インデックス400の値動き (100.17-100)÷100 = 0.17%の-1倍とはなっていません。

※上記は、対象指数の値動きをわかりやすく説明するため、細部を省略し抽象化して説明した例であり、 実際とは異なりますのでご注意下さい。

≪当資料のお取り扱いにおけるご注意≫

- 当資料は、ファンドの状況や関連する情報等をお知らせするために大和アセットマネジメントにより作成されたものです。
- 当ファンドのお申込みにあたっては、「投資信託説明書(交付目論見書)」の内容を必ずご確認のうえ、 ご自身でご判断ください。
- 投資信託は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、 投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではありません。信託財産に生じた利益および損失 は、すべて投資者に帰属します。投資信託は預貯金とは異なります。
- 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。証券会社以外でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。
- 当資料は、信頼できると考えられる情報源から作成していますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。運用実績などの記載内容は過去の実績であり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。また、税金、手数料等を考慮していませんので、投資者のみなさまの実質的な投資成果を示すものではありません。
- 当資料の中で記載されている内容、数値、図表、意見等は資料作成時点のものであり、今後予告なく変更されることがあります。
- 分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

販売会社等についてのお問い合わせ

- ► 大和アセットマネジメント フリーダイヤル 0120-106212(営業日の9:00~17:00) 当社ホームページ
- https://www.daiwa-am.co.jp/