

ATMX+指数の概要と 銘柄選定方法の詳細

2022年4月中旬～終わりごろ、ATMX+指数の銘柄選定が予定されています。ATMX+指数は香港に上場する銘柄で構成される株価指数であり、年2回銘柄入れ替えを行っています。そこで今回は4月の銘柄選定に先立ち、①ATMX+指数の概要と②銘柄選定の詳細についてご説明いたします。

①ATMX+指数の概要

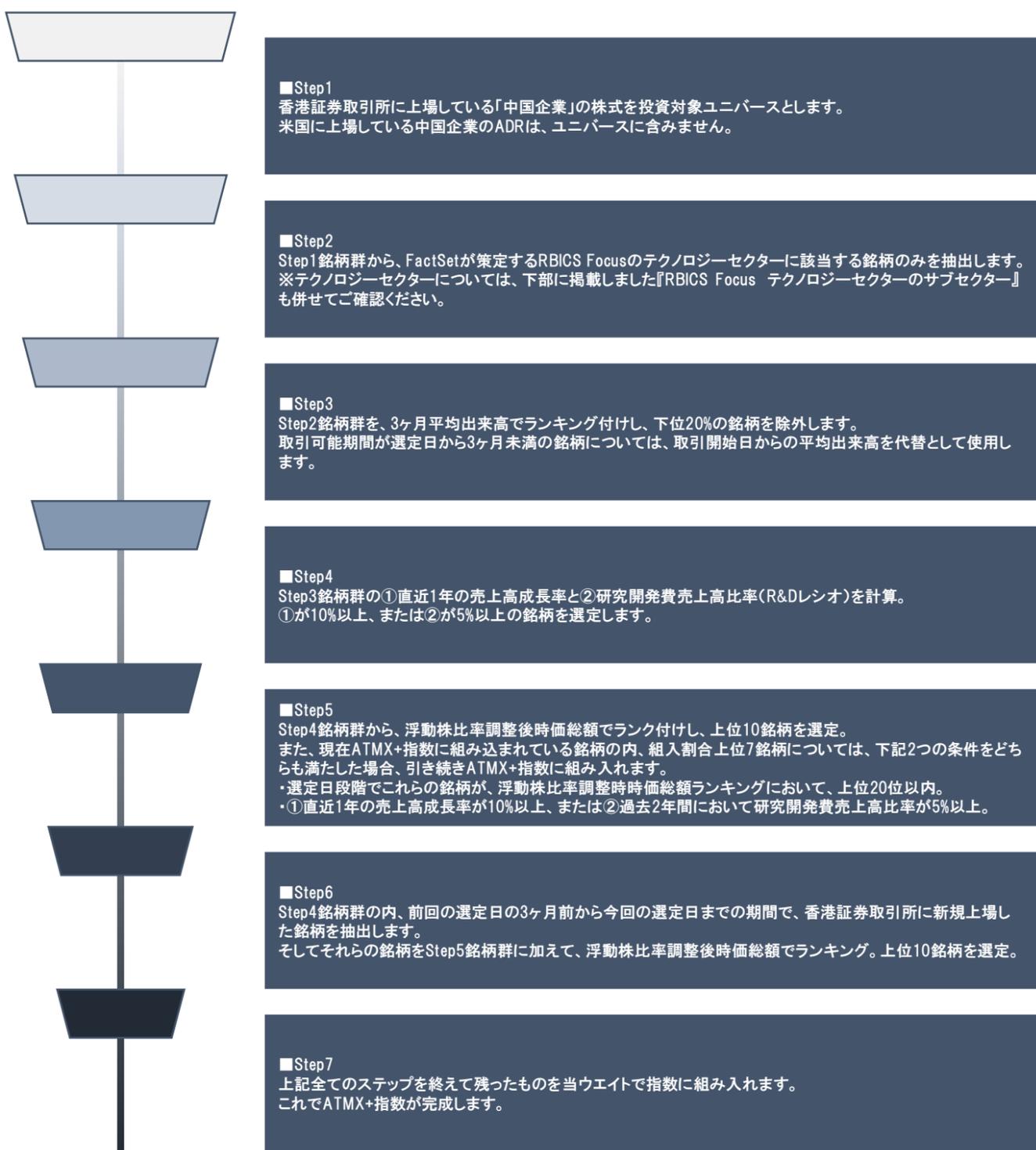
FactSet ATMX+指数(以下、ATMX+指数)は、テクノロジー・EC・電子取引・ソフトウェア・次世代エネルギー輸送などの業種に従事する、中国大型企業で構成された株価指数です。2015年10月23日を100として、指数提供元であるFactSetが定めたメソロジーに基づいて計算されます。

ATMX+指数はリバランス直後は当ウエイトとなっており、「リバランス日」は4月と10月の第4金曜日。リバランスは年2回行われます。リバランス日に香港証券取引所が休場の場合、ATMX+指数のリバランスは翌営業日に実施されます。

リバランスのための銘柄選定やウエイトの決定は、4月と10月の第3金曜日の「選定日」時点の情報をもとに行われます。選定日からリバランス日の間にコーポレートアクションが生じた場合は、銘柄選定やウエイト調整が別途行われる場合があります。

②銘柄選定方法の詳細

続いて、ATMX+指数構成銘柄の選定方法についてご説明します。投資対象ユニバースからATMX+指数構成銘柄決定までの、7つのステップを簡単にまとめましたのでご確認ください。



RBICS Focus テクノロジーセクターのサブセクター

代替エネルギー車	インターネット 自動車用品・部品販売	インターネット 家具・ホームファニシング小売	投資管理・仲介用ソフトウェア
商業銀行・信用組合作用ソフトウェア	インターネット 建築材料・園芸用品店	インターネット 自動車販売	各種電子取引処理
電子決済処理	インターネット 百貨店	インターネット 事務用品販売	インターネット その他健康・化粧品小売
食品配達・出前サービス	インターネット ディスカウントストア	インターネット オフプライスストア	決済処理用ソフトウェア
保険用ソフトウェア	インターネット 家電小売	インターネット ペット・ペット用品販売	小売業向けソフトウェア
インターネット アクセサリ小売	インターネット エンターテインメント関連販売	インターネット 薬局・ドラッグストア	トレーディング用ソフトウェア
インターネット アパレル小売	インターネット フットウェア小売	インターネット ホールセールクラブ・スーパー	旅行代理店

最後に

先月の劉鶴副首相の市場安定化発言により、落ち着きを取り戻したかに見えた中国株式市場。ですが足元では、ロシアによるウクライナ侵攻の影響に加えて、上海での新型コロナウイルスまん延に伴う厳格なロックダウンなどにより、中国株式市場は再びリスクオフムードとなっています。

当社では足元のマーケット情報について継続的に情報発信を行っていますので、併せてご確認くださいませと幸いです。引き続きATMX+指数、大和アセットマネジメントをよろしく願いいたします。

3月入り後の中国株の大幅変動について～劉鶴副首相の異例な発言を受け、悲観のピークは一旦過ぎたか～

チェック ▶

最近の中国株の下落について～コロナの感染状況が落ち着けば、政策支援が株価を支えよう～

チェック ▶

投資環境見通し

チェック ▶

週刊！投資環境

チェック ▶

■ (各種出典) FactSet提供情報より、大和アセットマネジメントが作成。
■ メソッドロジは今後予告なく変更になる場合があります。

FactSetに関するご注意

■ FactSetは、FactSet ATMX+ 指数の正確性および、または完全性を保証するものではありません。また、その中に含まれるデータおよびインデックス使用許諾者は、いかなる誤り、欠落または中断について責任を負うものではありません。
■ FactSetは、インデックスの使用許諾者、当インデックスまたはそれに含まれるすべてのデータの使用に起因する他の人物または組織によって得られる結果について、明示的または黙示的に保証されるものではありません。
■ FactSetは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックスまたはそれに含まれるすべてのデータの商品性、特定の目的または使用への適合性について、一切の保証を明示的に否認します。これに限定されず、FactSetは、たとえそのような損害の可能性について知らされていたとしても、特別損害、懲罰的損害、間接的損害または派生的損害（逸失利益を含む）に対する責任を一切負うものではありません。

当資料のお取り扱いにおけるご注意

■ 当資料は投資判断の参考となる情報提供を目的として大和アセットマネジメント株式会社が作成したものであり、勧誘を目的としたものではありません。投資信託のお申込みにあたっては、販売会社よりお渡しする「投資信託説明書(交付目録見書)」の内容を必ずご確認ください。
■ 当資料は信頼できると考えられる情報源から作成しておりますが、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。記載内容は資料作成時点のものであり、予告なく変更されることがあります。また、記載する指数・統計資料等の知的所有権、その他一切の権利はその発行者および許諾者に帰属します。
■ 当資料の中で個別企業名が記載されている場合、それらはあくまでも参考のために掲載したものであり、各企業の推奨を目的とするものではありません。また、ファンドに今後組み入れることを、示唆・保証するものではありません。
■ お問い合わせ 0120-106212 (受付時間 9:00～17:00) ウェブサイトURL <https://www.daiwa-am.co.jp/>