2020年7月6日

各 位

会　　社　　名　楽天投信投資顧問株式会社
（管理会社コード　14584）
代　表　者　名　代表取締役社長　東　眞之
問　合　せ　先　商品管理部長　石舘　真
TEL　03－6432－7746

# 上場ETF（管理会社：楽天投信投資顧問）に関する日々の開示事項

楽天投信投資顧問株式会社を管理会社として上場するETF銘柄について、以下のとおり2020年7月3日の状況をご報告します。

上場ETF銘柄（2銘柄）

| 掲載番号 | 銘柄名 | 銘柄コード | 上場取引所 |
|---|---|---|---|
| 1 | 楽天ETF-日経レバレッジ指数連動型 | 1458 | 東証 |
| 2 | 楽天ETF-日経ダブルインバース指数連動型 | 1459 | 東証 |

＊ 各銘柄の状況につきましては、次ページ以降をご参照ください。なお、各銘柄名をクリックしていただくと、各銘柄の状況が表示されます。

[掲載番号:1]　　2020年7月6日

各 位

会　　社　　名　楽天投信投資顧問株式会社
代　表　者　名　代表取締役社長　東　眞之
（コード番号　　1458）
問　合　せ　先　商品管理部長　石舘　真
TEL　03－6432－7746

# 楽天ETF-日経レバレッジ指数連動型に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数

（2020年7月3日現在）

811,300　口

2. 上場ETFの純資産総額

（2020年7月3日現在）

8,974,921,073　円

3. 上場ETFの一口当たりの純資産額

（2020年7月3日現在）

11,062.40　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率

（2020年7月3日現在）

△ 0.55　%

以上

**「日経平均レバレッジ・インデックス」に内在する性質に関する注意点**

対象指数とする「日経平均レバレッジ・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「2倍」の値動きになる指数で、「日経平均株価」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「2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。対象指数と原指標は完全な正相関ではないため、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「日経平均株価」の変動率の「2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「日経平均株価」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、「日経平均株価」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、対象指数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、対象指数の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

**対象指数の動きと実際のファンドの値動きの乖離に関する留意点**

実際のファンドの基準価額は、信託報酬等のコスト負担や追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異の影響などにより、運用目標が完全に達成できるとは限りません。

また、ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

[掲載番号:2]　　2020年7月6日

各 位

会　　社　　名　楽天投信投資顧問株式会社
代　表　者　名　代表取締役社長　東　眞之
（コード番号　　1459）
問　合　せ　先　商品管理部長　石舘　真
TEL　03－6432－7746

# 楽天ETF-日経ダブルインバース指数連動型に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数

（2020年7月3日現在）

7,960,100　口

2. 上場ETFの純資産総額

（2020年7月3日現在）

25,181,118,396　円

3. 上場ETFの一口当たりの純資産額

（2020年7月3日現在）

3,163.42　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率

（2020年7月3日現在）

0.55　%

以上

**「日経平均ダブルインバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点**

対象指数とする「日経平均ダブルインバース・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「－2倍」（マイナス2倍）の値動きになる指数で、「日経平均株価」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「－2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。対象指数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「日経平均株価」の変動率の「－2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「日経平均株価」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、「日経平均株価」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、対象指数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、対象指数の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

**対象指数の動きと実際のファンドの値動きの乖離に関する留意点**

実際のファンドの基準価額は、信託報酬等のコスト負担や追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異の影響などにより、運用目標が完全に達成できるとは限りません。

また、ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。