

2024年10月11日

各位

会社名 三菱UFJアセットマネジメント株式会社
(管理会社コード13444)
代表者名 取締役社長 横川 直
問合せ先 商品ディスクロージャー部 岩渕 直美
(TEL. 03-4223-3038)

「MAXIS HuaAn中国株式(上海180A株)上場投信」の 値動きに関するお知らせ

当社で運用を行なっているETF(上場投資信託)「MAXIS HuaAn中国株式(上海180A株)(銘柄コード2530)」(以下、「当ETF」といいます。)の値動きについてお知らせします。

1. 当ETFの基準価額騰落率と対象指数騰落率の乖離について(10月9日)

10月9日における当ETFの基準価額は前日比0.1%の上昇、対象指数であるSSE1800インデックス(円換算ベース)は同3.8%の上昇でした。基準価額と指数の騰落率の乖離(ファンド騰落率-指数騰落率)は▲3.7%となりました。乖離の背景は以下の通りです。

当ETFは中国の連休に伴い9月27日から設定受付を停止していました。10月8日に受付を再開した際に純資産総額と同程度の大口設定が発生しました。当ETF内の組入比率維持のために先物の買付を行ないましたが、この先物の買付価格と評価価格(終値)に差が生じたことが乖離の主な原因となりました。

2. 当ETFの市場価格と基準価額の水準の差異について(10月10日)

10月10日における当ETFの市場価格(終値)はストップ安の38,040円、基準価額は14,624円でした。

中国の株式市場の上昇期待を背景に、中国の連休中は市場価格が基準価額を大きく上回る水準となりました。中国の連休明けには設定が再開したことなどで乖離は縮小方向となりましたが、10月10日現在では依然として高水準となっています。

一般に、ETFの市場価格は、設定もしくは交換により基準価額に収れんする性質がありますが、投資対象有価証券の取引市場が休場の場合などは設定や交換ができません。当ETFも、約款の定めに従い中国の連休中は設定・交換が停止されていたことで、市場価格と基準価額の乖離が一時的に拡大しました。なお、10月11日は10月14日がニューヨークの銀行休日となる影響で設定不可日となることにご留意ください。(※)10月15日からは、設定が可能となります。

※当 ETF の設定・交換可能日は、投資対象である中国市場のほか、人民元の為替取引において米ドルを経由していることからニューヨークの銀行休日も反映しています。詳細な設定・交換可能日のスケジュールは当社ウェブサイトの「設定・交換/解約カレンダー」をご覧ください。<https://www.am.mufg.jp/fund/180014.html>

当 ETF の情報につきましては、以下をご覧ください。

三菱 UFJ アセットマネジメントの MAXIS ウェブサイト：<https://maxis.am.mufg.jp>

以上