

2025 年 10 月 8 日

各 位

アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社
代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
問合せ先 E T F ビジネス開発部 花村憲治
(TEL. 050-5785-6306)

「上場インデックスファンド MSCI 日本株高配当低ボラティリティ (βヘッジ)」の
基準価額と市場価格の重要な乖離に関するお知らせ

平素は弊社 E T F をご愛顧賜り、誠にありがとうございます。

さて、当社で運用を行なっている「上場インデックスファンド MSCI 日本株高配当低ボラティリティ (βヘッジ)」(以下「当 E T F」といいます。)(銘柄コード:1490)において、基準価額と市場価格の重要な乖離が発生しております。

＜乖離の状況＞

9 月 29 日から 10 月 7 日までの基準価額と市場価格の重要な乖離が、7 営業日連続で 5%以上となりました。

	基準価額 (円) (1口当たり)	市場価格 (円) (取引最終価格)	基準価額と市場価格の乖離率
9月29日	7,593	8,870	16.82%
9月30日	7,566	8,800	16.31%
10月1日	7,581	8,699	14.75%
10月2日	7,541	8,103	7.45%
10月3日	7,509	8,103	7.91%
10月6日	7,466	8,103	8.53%
10月7日	7,519	8,628	14.75%

＜乖離の要因＞

当 E T F の基準価額と市場価格の間に発生した重要な乖離は、市場の需給によって生じているものと考えられます。

<今後の見通し>

投資家へのプロモーションによる売買の活性化やマーケットメイカーへの流動性提供の働きかけにより、重要な乖離が少なくなるように努めておりますが、今後も市場の需給によって重要な乖離が生じる可能性があります。当ETFを売買する際には、基準価額と市場価格の重要な乖離に十分ご注意ください。

以上

■ 当資料は、アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社が「上場インデックスファンド MSCI 日本株高配当低ボラティリティ (βヘッジ)」の基準価額と市場価格の重要な乖離についてお伝えすることを目的として作成した資料であり、特定ファンドの勧誘資料ではありません。