

各位

委託会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者の役職氏名 代表取締役社長 小松 幹太
担当者の役職氏名 ラップ・ETF ビジネス部 長尾 健司
(連絡先 0120-106212)

「iFreeETF 中国グレーターベイエリア・イノベーション 100 (GBA100)」の
値動きに関するお知らせ

当社が設定・運用しております「iFreeETF 中国グレーターベイエリア・イノベーション 100 (GBA100)」(銘柄コード 2629) は、市場価格が大きく下落し、10月9日はストップ安となりました。

国慶節による連休明けに中国の株式市場が上昇することへの期待から10月7日までは買いが優勢となり、当ETFの市場価格が大幅に上昇しておりました。また、買い需要に対して当ETFの設定*を通じた市場供給が停止していることも上昇の原因となりました。

※ETFの設定とは、証券会社が運用会社(当社)に申込をおこないETFを取得することを指します。

	市場価格(終値)	基準価額(1口当たり)	乖離率
2024年10月02日(水)	3,010	2,813.5	7.0%
2024年10月03日(木)	3,710	2,875.4	29.0%
2024年10月04日(金)	6,510	2,868.4	127.0%
2024年10月07日(月)	10,510	2,902.5	262.1%
2024年10月08日(火)	7,510	2,890.7	159.8%
2024年10月09日(水)	6,010	3,067.1	96.0%

市場価格(終値)と基準価額(1口当たり)の単位は円

中国の株式市場は、国慶節による連休が終了した10月8日より再開しましたが、10月8日から当ETFは売りが優勢となり市場価格が下落しました。10月9日時点の市場価格(終値)と基準価額との乖離率は96.0%となり、依然高い水準となっております。

一般に、ETFの市場価格は、設定もしくは解約により基準価額に収れんする性質がありますが、ETFの設定や解約ができないことで乖離が継続する可能性があります。

中国の株式市場は10月8日より再開しましたが、当ETFは設定・解約の申込について10月15日より受付可能になります。従いまして、10月11日までは市場に対する当ETFの供給量を増加・減少させることができず、市場価格が基準価額から大幅に乖離する可能性があります。

お取引の際には当ETFの市場価格が基準価額から大きく乖離する可能性を十分ご注意ください。

取引時間中のETFの推定価値につきましては、東証のホームページをご参照ください。
インディカティブNAV・PCF情報

<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etfs/inav/index.html>

当ETFの情報につきましては、以下をご参照ください。
ダイワのiFreeETFウェブサイト

<https://www.daiwa-am.co.jp/etf/index.html>

以上