

2024年10月8日

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) (以下、当 ETF といいます。) は、市場価格が大きく下落し、10月8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前営業日の10月7日まで買いが優勢となっており、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%

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本日10月8日より再開しましたが、当 ETF は売りが優勢となり市場価格が下落しました。10月8日時点の市場価格(終値)と基準価額との乖離率は159.8%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。

投資家のみなさまにおきましては、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