

2024年1月期 中間決算短信 (2023年3月14日～2023年9月13日)

Interim Earnings Report for Fiscal Year ending January 2024 (March 14, 2023 – September 13, 2023)

2023年10月27日
上場取引所 東証
Oct. 27, 2023
Listed Exchange: TSE

ファンド名 上場インデックスファンド S&P500 先物インバース
コード番号 2240
連動対象指標 S&P500 先物インバース日次指数 (エクセスリターン)
主要投資資産 公社債
売買単位 10口
管理会社 日興アセットマネジメント株式会社 URL www.nikkoam.com/
代表者名 代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
問合せ先責任者 ETF ビジネス開発部 花村 憲治 TEL (03)6447-6449
Fund name: Listed Index Fund S&P500 Futures Inverse
Code: 2240
Underlying Index: S&P 500 Futures Inverse Daily Index Excess Return
Primary invested assets: Public and corporate bonds
Trading unit: 10 units
Management co.: Nikko Asset Management Co., Ltd. URL www.nikkoam.com/
Representative: Stefanie Drews Representative Director, President and COO
Contact person: Kenji Hanamura, ETF Business Development Department TEL +81-3-6447-6449

半期報告書提出予定日 2023年12月13日
Scheduled date of submission of semi-annual securities report: Dec. 13, 2023

I ファンドの運用状況

I Fund Management

1. 2023年9月中間期の運用状況 (2023年3月14日～2023年9月13日)
I. Management Status for Half-Year ended September 2023 (March 14, 2023 – September 13, 2023)

(1) 資産内訳 (百万円未満切捨て)
(1) Assets (fractions of less than JPY mil. shall be rounded down)

	主要投資資産 Primary Invested Assets		現金・預金・その他の資産 (負債控除後) Cash/Deposits/Other Assets (excluding liabilities)		合計 (純資産) Total (Net Assets)	
	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio
2023年9月中間期 HY ended Sep. 2023	百万円 JPY mil. 470	% % (13.6)	百万円 JPY mil. 2,998	% % (86.4)	百万円 JPY mil. 3,468	% % (100.0)

(2) 設定・解約実績

(2) Creation and Redemption

	前計算期間末発行済口数 No. of Issued Units at End of Previous Fiscal Period (①)	設定口数 No. of Units Created (②)	解約口数 No. of Units Redeemed (③)	当中間計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Semiannual Period (①+②-③)
	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units
2023年9月中間期 HY ended Sep. 2023	-	462	68	393

(3) 基準価額

(3) Net Asset Value

	総資産 Total Assets (①)	負債 Liabilities (②)	純資産 Net Assets (③(①-②))	10口当たり基準価額 ((③/当中間計算期間末発行済口数) × 10) Net Asset Value per 10 units (((③/No. of Issued Units at End of Semiannual Period)×10)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2023年9月中間期 HY ended Sep. 2023	3,476	8	3,468	88,234.1

2. 会計方針の変更

2. Change in Accounting Policies

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
- ① Changes accompanying revision to accounting standards, etc. No
- ② ①以外の変更 無
- ② Changes other than those in ① No