



【2869】

iFナス100ダブル

iFreeETF NASDAQ100レバレッジ【正式名称】



- 米国を代表する株価指数である「NASDAQ-100®指数」を原指標とし、指標の変動率が原指標の日々の騰落率の2倍を基本として計算された米ドル建て指数である「NASDAQ100レバレッジ指数」に連動する投資成果を目指す商品です。

1.概要

(2023年6月30日 現在)

銘柄名	iFreeETF NASDAQ100レバレッジ		
対象指標	NASDAQ100レバレッジ指数		
計算期間	毎年3月11日から9月10日、9月11日から翌年3月10日		
分配金支払基準日	毎年3月10日、9月10日(年2回)		
管理会社	大和アセットマネジメント		
銘柄コード	2869	市場価格(終値)(※1)	29,665 円
売買単位	1口単位	1口あたり分配金(※2)	5円
信託報酬(税込)	0.825%	分配金利回り(※3)	0.02%
純資産総額	29 億円	東証マーケットメイク制度(※4)	対象
受益権口数	98,511 口	1売買単位あたりの投資金額(※1)	29,665 円

※1 上記の期日において約定がない場合、「市場価格(終値)」及び「1売買単位あたりの投資金額」には、直近時点の市場価格を記載しています。

※2 直近12か月の実績分配金を記載しています。

※3 直近12か月の実績分配金及び作成日の終値をもとに算出した分配金利回りを記載しています。

※4 東証が2018年7月2日に導入したETF市場におけるマーケットメイク制度の対象銘柄が否かを記載しています。マーケットメイクとはマーケットメイカーが気配を提示して取引の流動性を提供することです。

2.パフォーマンス

(2023年6月30日 現在)



※ 2022年11月16日 の市場価格を基準値とし、TOPIXの値を再換算しています。

■ 騰落率

期間	当銘柄	(参考)TOPIX
過去3か月	+28.95%	+14.23%
過去6か月	+75.79%	+20.98%
過去1年	-	+22.33%
過去3年	-	+46.82%
過去5年	-	+32.22%

3.ファンド組入銘柄

	証券コード	銘柄名	構成比
1		MICRO E-MINI NASDAQ 100 JUN 23	
2			
3			
4			
5			

4.情報ベンダーコード

情報ベンダー名	ETFコード	対象指標
QUICK	2869/T	-
Bloomberg	2869 JP Equity	NDXL
Refinitiv	2869.T	-

5.対象指標の概要

NASDAQ100レバレッジ指数は、NASDAQ-100®指数の日々の騰落率の2倍を基本として、理論上発生し得る金利コスト等を反映して計算された米ドル建ての指数です。NASDAQ100レバレッジ指数の基準日は2009年11月18日であり、基準値は1,000ポイントであるため、原指標であるNASDAQ-100®指数の値とは異なります。

6. 対象指標の特徴及び留意点

- レバレッジ型指標は、変動率が原指標の日々の変動率の2倍となるように算出されているため、前営業日と比較するとその変動率は原指標の2倍となり、仮に原指標が一日で50%以上値下がりした場合は、投資金額の全額を失います。また、2営業日以上離れた期間での比較においては、複利効果により、原指標の変動率の2倍以上又は未滿となる場合があります。
- レバレッジ型指標は、原指標が上昇トレンドにある場合において、収益をさらに強く求める指標であるため、原指標の上昇を見込む場合には有用ですが、原指標が上昇・下落を相互に繰り返す場合、上記の複利効果によりレバレッジ型指標は逡減していくという特性があり、このような場合、投資者は利益を得にくくなりますので留意が必要です。また、中長期にわたって投資をする場合、原指標の変動率とレバレッジ型指標の変動率の乖離が大きくなる可能性があり、留意が必要です。
- レバレッジ型指標に連動する商品は原指標が上昇(下落)を続けた場合、市場価格と理論価格が乖離し、その結果理論価格に近い価格で売買することが出来なくなる可能性がより高くなるため、留意が必要です。なお、このような市場価格と理論価格の乖離は一般的には理論価格が呼値の制限値幅内の値となった際に解消されると考えられます。
- <レバレッジ型指標の詳細>
<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etfs/etf-outline/04-04.html>
- レバレッジ型商品は、参照する指数・指標に連動させるため、一般的に先物取引を用いた運用を行っています。このため、一般的にレバレッジ型商品は先物取引コストを負担しているほか、先物取引の期限(限月)を乗り換える際に、リスクが生じることに注意が必要です。

7. 情報入手方法

- 現在値、インディカティブNAV・PCF
<http://tse.factsetdigitalsolutions.com/iopv/table?language=jp>
- 基準価額(一口あたりの純資産額)等に関する情報
<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etfs/base-price/index.html>
- ETF/ETN銘柄検索
<https://money-bu-jpx.com/search/> (東証マネ部!)

8. 免責事項

- 当資料は、作成時における当商品の概要説明のみを目的としており、投資勧誘を目的としているものではなく、また金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。
- 当商品は値動きのある有価証券を投資対象としますので、連動対象である指標及び外国為替相場の変動、組入有価証券の価格の変動、組入有価証券の発行会社の倒産や財務状況等の悪化、その他の市場要因の影響等により、市場取引価格又は基準価額が値下がりし、それにより損失が生じることがあります。したがって、投資元本が保証されているものではありません。また、信用取引を利用する場合には、差し入れた保証金以上の損失が生ずるおそれがあります。
- 当商品の売買を行われるに際しては、あらかじめお取引先の金融商品取引業者等より交付される契約締結前交付書面等の書面の内容を十分にお読みいただき、商品の性質、取引の仕組み、リスクの存在、販売手数料、信託報酬などの手数料等を十分に御理解いただいたうえで、御自身の判断と責任で行っていただきますよう、お願い申し上げます。
- 当資料の実績数値は過去のものであり、将来の運用成果等を保証するものではありません。
- 当資料は、更新日現在の内容です。その後、制度の改正等により、当資料に掲載した内容が予告なく変更される場合があります。また、この資料に掲載されている情報の作成には万全を期していますが、当該情報の完全性を保証するものではありません。当社は、当資料及び当資料から得た情報を利用したことにより発生するいかなる費用又は損害等の一切について責任を負いません。
- 本資料の一切の権利は当社に属しており、いかなる目的を問わず、無断複製・転載を禁じます。