OTCスワップ型



# 【683A】
# iFFANG+レバ【略称】
## iFreeETF FANG+レバレッジ(OTCスワップ型)【正式名称】

- NYSE FANG+(配当込み、円ベース)2倍レバレッジ指数を対象指標とし、基準価額の変動率を対象指標の変動率に一致させることを目指して運用を行う商品です。
- 国内組成の商品であり、通常の株式と同様に全国の証券会社にてお取扱いしています。

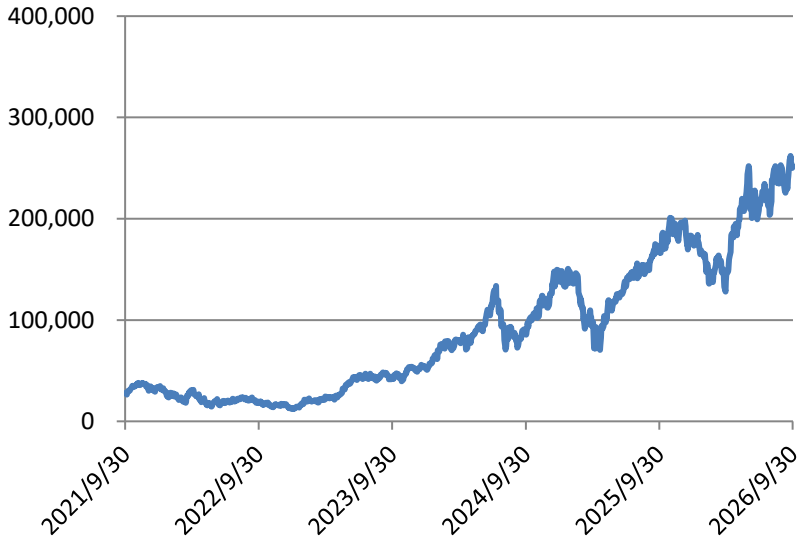
## 1. iFreeETF FANG+レバレッジ(OTCスワップ型)の概要　(2026年11月13日　現在)

| | | | |
|---|---|---|---|
| 銘柄名 | iFreeETF FANG+レバレッジ(OTCスワップ型) | | |
| 銘柄コード | 683A | | |
| 対象指標 | NYSE FANG+(配当込み、円ベース)2倍レバレッジ指数 | | |
| 計算期間(※1) | 毎年6月11日から12月10日、12月11日から翌年6月10日 | | |
| 分配金支払基準日 | 毎年6月10日、12月10日(年2回) | | |
| 管理会社 | 大和アセットマネジメント株式会社 | | |
| 信託受託会社 | みずほ信託銀行株式会社 | | |
| 上場取引所 | 東京証券取引所 | | |
| 売買単位 | 1口単位 | Indicative NAV/PCFの開示(※2) | あり(PCFのみ)(予定) |
| 信託報酬 | 年率0.9475%(税込)程度 | 上場日 | 2026/12/2(予定) |

※1　ただし、第1計算期間は、2026年11月30日から2027年6月10日までとします。

※2　Indicative NAVとは、PCF情報に現時点の株価を乗じることによって算出されるリアルタイムの推定純資産額(1口あたり)、PCFとは、管理会社よりご提供をいただいたポートフォリオ構成銘柄情報ファイルのことを指します。ここでは東証を通じて開示しているIndicative NAV/PCF情報の有無を記載しています。

## 2. 対象指標の推移(2021年9月30日～2026年9月30日)




■ 対象指標(USDベース)の騰落率

| 期間 | 対象指標 |
|---|---|
| 過去1ヶ月 | +0.84% |
| 過去3ヶ月 | +18.49% |
| 過去6ヶ月 | +81.75% |
| 過去1年 | +49.74% |
| 過去3年 | +487.76% |
| 過去5年 | +798.72% |

## 3. 投資対象について

主として、ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券に投資するとともに、担保付スワップ取引を行なうことで、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象指数の変動率に一致させることをめざします。

## 4. 対象指標の概要

NYSE FANG+(配当込み、円ベース)2倍レバレッジ指数は、日々の騰落率をNYSE FANG+指数(配当込み、円ベース)の騰落率の2倍として計算された指数です。
NYSE FANG+指数(配当込み、円ベース)の算出にあたってはニューヨーク時間午後4時時点の為替レートが用いられます。このため、NYSE FANG+(配当込み、円ベース)2倍レバレッジ指数においてもニューヨーク時間午後4時時点の為替レートの変動の2倍相当の影響を受けることになります。
※NYSE FANG+指数は、次世代テクノロジーをベースに、グローバルな現代社会において人々の生活に大きな影響力を持ち、高い知名度を有する米国上場企業を対象に構成された株価指数です。
NYSE FANG+指数は、これらの企業に等金額投資したポートフォリオで構成されています。なお、「FANG」とは、主要銘柄であるフェイスブック(Facebook(Meta Platforms))、アマゾン・ドット・コム(Amazon.com)、ネットフリックス(Netflix)、グーグル(Google(Alphabet))の頭文字をつないだものです。当指数は、四半期(3・6・9・12月)ごとに等金額となるようリバランスを行ないます。

## 5. 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倍となりますが、2営業日以上離れた日との比較においては、複利効果により、原指標の変動率の2倍超又は未満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逓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説明はこちら＞
  https://www.jpx.co.jp/equities/products/etfs/indicators/05.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。

## 6. OTCスワップ型ETFの信用リスク

- 当ETFはOTCスワップ型ETFです。
- OTCスワップ型ETFとは、連動対象の指標のリターンを交換するトータルリターンスワップ契約を活用することで、ETFの一口あたり純資産額の変動率と対象指標の変動率を一致させる運用手法を採るETFを指します。OTCスワップ型ETFでは、従来の指標連動型ETFと比較してトラッキングエラーの低減が期待できる反面、スワップ契約のカウンターパーティーの信用リスクが存在します。

- OTCスワップ型ETFの多くは、スワップ契約締結にあたり、契約担保を双方が出し合う内容となっており、万が一、スワップ契約の相手方が破綻しても、スワップ契約の相手方が提供した受入担保を換金することで損失が生じない仕組みとなっていますが、スワップ契約の相手方の破綻により連動対象指標のリターンの交換が停止されるため、ETFの一口あたり純資産額の変動率と対象指標の変動率が維持できなくなります。その結果、ETFの基準価額が下落することもありえます。

- また、スワップ契約の相手方が提供する担保の種類によっては、ETFが相手方に差し入れた提供担保と同額の換価を得られない場合もあり、その結果、ETFの価値が下落又は無価値になることもあります。OTCスワップ型ETFの投資にあたっては、スワップ契約の相手方の健全性を確認し、スワップ契約の相手方の信用状況を十分に把握することが重要です。

- OTCスワップ型ETFは、信用リスクへの対応として、変動証拠金の日次での授受など、非清算店頭デリバティブ取引の証拠金の適切な管理に係る態勢の整備や、OTCスワップ契約を別の資産へ迅速に切り替えを行う体制の整備などのリスク低減策を講じています。これらの情報や、スワップ契約相手方は、「指標連動有価証券等組入型ETFに係る管理体制等に関する報告書」に記載されています。投資に当たっては、これらの情報にご留意いただく必要があります。

## 7. ETF情報入手一覧

- 当ETFに関するより詳細な商品概要
  「大和アセットマネジメント株式会社 ETF専用ホームページ」 https://www.daiwa-am.co.jp/etf/index.html

- 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

- 情報ベンダーコード

| 情報ベンダー名 | QUICK | Bloomberg | Refinitiv |
|---|---|---|---|
| ETFコード | 683A/T | 683A JP Equity | 683A.T |
| 対象指標 | - | FNGJN2XI Index | - |

- NYSE FANG+（配当込み、円ベース）2倍レバレッジ指数の算出要領
  https://indices.ice.com/

## 8. 免責事項

- 当資料は、作成時におけるETF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ございません。
- ETFは値動きのある有価証券等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、組入有価証券等の価格の変動、組入有価証券等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。
- ETF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。
- 当資料は、2026年11月現在の内容です。その以後、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。

＜お問い合わせ＞
株式会社東京証券取引所 上場推進部 ｜〒103-8220 東京都中央区日本橋兜町2-1｜ Tel:03-3666-0141（代）

Copyright © 2026 Tokyo Stock Exchange, Inc. All rights reserved.