QYLD

グローバルX NASDAQ100・
カバード・コール ETF

ETFカテゴリー：インカム
–カバード・コール
2020年09月30日時点

キーポイント

高い潜在インカム
カバード・コールの売りで利益を生み出そうとするもので、これまでボラティリティが高い時期には、より高い利回りを生み出しています。※1

毎月分配
毎月分配により、定期的なインカムの提供を目指します。
QYLDは毎月分配を7年間継続しています。

効率的なオプション執行
ナスダック100指数のコール・オプションを売却することにより、時間と潜在的な費用を節約することができます。

ファンド概要

設定日	2013年12月11日※2
インデックス	CBOE Nasdaq-100® BuyWrite V2 Index
保有銘柄数	104
運用資産残高	$1,309.53 mil
経費率（グロス）	0.66%
経費率（ネット）※3	0.60%
30日SEC利回り	0.22%
手数料減免前30日SEC利回り※4	NA
12か月分配金利回り	11.71%
分配頻度	月次

取引詳細

ティッカー	QYLD
CUSIP	37954Y483
取引所	NASDAQ
ブルームバーグ　IOPVティッカー	QYLDIV
インデックス ティッカー	BXNT

パフォーマンス (%)

	今四半期	年初来	1年	3年	設定来
基準価額	5.69%	-0.25%	6.83%	9.81%	7.99%
市場価格	5.89%	-0.26%	6.86%	9.86%	7.98%
CBOE NASDAQ-100®・バイライト・V2・インデックス※5	6.10%	0.97%	8.36%	11.19%	9.04%

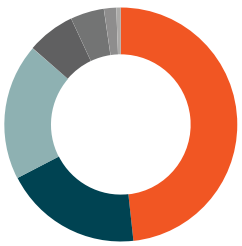
組入上位10銘柄 (%)

保有状況は変動します。

Apple Inc	13.44%	Alphabet Inc Class A	3.43%
Microsoft Corp	10.80%	Alphabet Inc Class C	3.33%
Amazon.com Inc	10.70%	NVIDIA Corp	2.89%
Facebook Inc	4.28%	Adobe Inc	2.04%
Tesla Inc	3.46%	PayPal Holdings Inc	2.00%

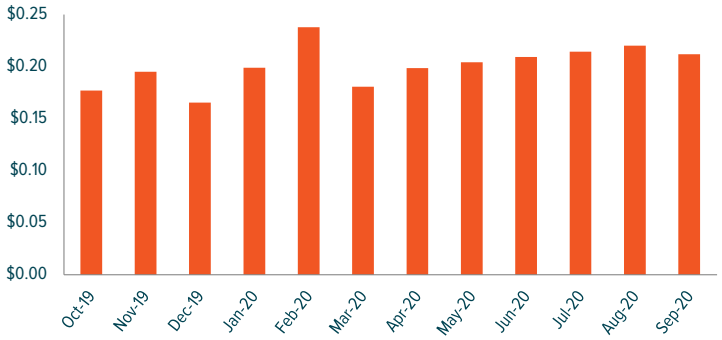
表示されているパフォーマンスデータは過去のパフォーマンスを示しており、将来の成果を保証するものではありません。また値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。短期間での高いパフォーマンスは一般的ではなく、投資家はそうしたパフォーマンスの再来を期待することはできません。1年以上の期間に係るリターンは、年率換算されています。市場価格リターンは、取引所取引終了時点のビッド／アスクスプレッドの仲値であり、他の時点で取引を行った場合に得られるリターンを示すものではありません。

業種内訳 (%)



IT	48.26%
通信サービス	19.17%
一般消費財	18.91%
ヘルスケア	6.67%
生活必需品	4.68%
資本財	1.71%
公益事業	0.60%

過去12か月分配金※6



リスク特性（設定来）

	CBOE NASDAQ-100®・バイライト・V2・インデックス	ナスダック100指数
年率ボラティリティ	15.28%	22.13%
ベータ値	0.68	1.00
シャープレシオ	0.59	0.69

GLOBAL X

ETFの可能性を探る

東京都千代田区麹町四丁目5番21号 紀尾井町
PREX 11F

Global X Japan 株式会社
当資料の内容はGLOBAL X MANAGEMENT COMPANY LLCが作成した資料を参考に、Global X Japan株式会社が抜粋、編集の上、翻訳して作成したものです。

定義

CBOE NASDAQ-100®・バイライト・V2・インデックス	CBOE NASDAQ100® BuyWrite Index (以下、「BXNインデックス」)は、NASDAQ-100®インデックス(以下、「NASDAQ-100インデックス」)に含まれる株式のポートフォリオのパフォーマンスを測定し、1ヶ月物のアット・ザ・マネーのNASDAQ100インデックスカバード・コール・オプションを連続して売却するベンチマーク・インデックスであり、CBOE NASDAQ100® BuyWrite V2インデックス(以下、「BXNTインデックス」)は、BXNインデックスの計算方法を再現したものです。例外として、記述されたNASDAQ100®インデックスカバード・コール・オプションは満期日の1日前まで保有され(通常、月の第3金曜日の前日)、クローズ時に決定された出来高加重平均価格で清算されます。
ナスダック100指数	時価総額ベースでナスダックに上場している国内外の非金融機関大手100社が含まれています。コンピュータのハードウエアとソフトウエア、通信、小売/卸売業、バイオテクノロジーなどの主要な業界グループに属する企業を反映しています。投資会社を含む金融機関の証券は含まれておりません。
12か月分配金利回り	投資家が直近の基準価額をもとに、過去12か月間ファンドを保有していたと想定した場合の利回りです。過去12か月の全インカムを直近の基準価額で除して算出します。
年率ボラティリティ	インデックスの終値による日次リターンの標準偏差の年率換算です。
ベータ値	ベータ値は、市場インデックスの変動に対する価格変動を計測するもので、市場インデックスの1%変動に対する価格変動のパーセンテージと定義することもできます。1未満のベータ値はファンドが市場ベンチマークよりも低価格変動であることを示唆します。.
シャープレシオ	リスク調整後リターンを計測する手法です。ポートフォリオにおける超過リターンがポートフォリオのリスクに占める比率を示しています。

※1 カバードコールの売却により、受益証券の値上げ益が限定される可能性があります。
※2 本ファンドは、Horizons ETF Trust Iシリーズである Horizons NASDAQ 100® Covered Call ETF (プリデセッサー・ファンド)として運用され、2018年12月24日に本ファンドがプリデセッサー・ファンドの資産、負債を取得ました。
※3 手数料減免前経費率。手数料減免は、契約上定められており、少なくとも2021年3月1日まで有効です。
※4手数料減免前利回りの「N/A」はアドバイザーの手数料減免が0.01%未満であることを意味しています。
※5 2015年10月14日、アドバイザーは当ファンドの主要戦略の変更に伴い、当ファンドの主要ベンチマークをBXNインデックスからBXNTインデックスに変更しました。アドバイザーは、BXNTインデックスが当ファンドのパフォーマンスのより良い測定値であると考えています。リターンは両者のベンチマークを反映します。
※6 当ファンドは通常、株式からのインカム配当とオプション・プレミアムからの利息を受け取ります。これらの費用控除後の金額は、通常、純投資収益からの配当としてファンドの株主に還元されます。本ファンドは、オプションで得るプレミアムと有価証券の売却による利益又は損失によりキャピタルゲインを獲得します。実現した長期キャピタルゲインの純益は、「キャピタルゲイン分配金」として株主に分配され、QYLDはNASDAQ100®インデックス会社からの配当金とNASDAQ100® (NDX)インデックス・オプションの売却による月次オプション・プレミアムを集め、その一部を月次分配金として株主に分配されます。分配の一部は、資本の返還を含む場合があります。これらは、将来のいかなる分配金についても、レートを意味するものではありません。ETFは分配を行う必要はありません。

当資料の内容はGLOBAL X MANAGEMENT COMPANY LLC（以下、Global X社）が作成した資料を参考に、Global X Japan株式会社（以下、当社）が抜粋、編集の上、翻訳して作成したものです。本邦の居住者への証券投資一般等に関する情報提供を目的としたものであり、海外ファンド等（本邦での募集の取扱等に係る金融庁への届出等がされていないものを含みます。）についての勧誘を目的としたものではありません。また、当資料は金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。訳文と原文に相違がある場合には、英文の原文が優先します。
当資料で記載されている内容、数値、図表、意見等は資料作成時点のものであり、信頼できると考えられる情報源から作成していますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。運用実績などの記載内容は過去の実績であり、将来の成果を示唆・保証するものでは ありません。また、税金、手数料等を考慮していませんので、投資者のみなさまの実質的な投資成果を示すものではありません。
また、当資料の内容についての著作権は、当社その他当該情報の提供元に帰属しています。電子的または、機械的方法を問わず、いかなる目的であれ、無断で複製、引用、転載または転送等を禁じます。
個別の商品に関して、より詳細な情報が現地のウェブサイトに掲載されていることがありますので、必要に応じてご参照ください。当資料の内容につきましては、設定又は上場されている国、地域の事情により、変更又は更新作業が遅れている場合があります。
海外の証券取引所に上場されている商品の購入を希望される場合は、本邦の取扱い金融商品取引業者へお問い合わせいただき、上場有価証券等書面またはその他の開示資料の内容を必ずご確認の上、ご自身でご判断ください。
投資信託は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではありません。信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。投資信託は預貯金とは異なります。
なお、現時点においては、当社は、いかなる金融商品取引業に係る登録も受けておりません。
GLOBAL Xは、Global X社の登録商標です。電子的または、機械的方法を問わず、いかなる目的であれ、無断で複製、引用、転載または転送等を禁じます。Global X社は、米国証券取引委員会に登録されている投資顧問業者です。

東京都千代田区麹町四丁目5番21号 紀尾井町 PREX 11F
Global X Japan 株式会社
当資料の内容はGLOBAL X MANAGEMENT COMPANY LLCが作成した資料を参考に、Global X Japan株式会社が抜粋、編集の上、翻訳して作成したものです。