2865 グローバルX NASDAQ100・カバード・コール ETF

2024年6月28日時点

ファンドの目的

信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を「Cboe NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index」を円換算した値の変動率に一致させることを目的とします。

キーポイント

高い潜在インカム
カバード・コール戦略を構築することにより、ボラティリティの高い局面において高水準のインカムの獲得を目指します。

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。

カバード・コール戦略へのアクセス
ETFに投資することで、NASDAQ100指数を対象とするカバード・コール戦略のリターンを容易に享受することができます。

ファンド概要

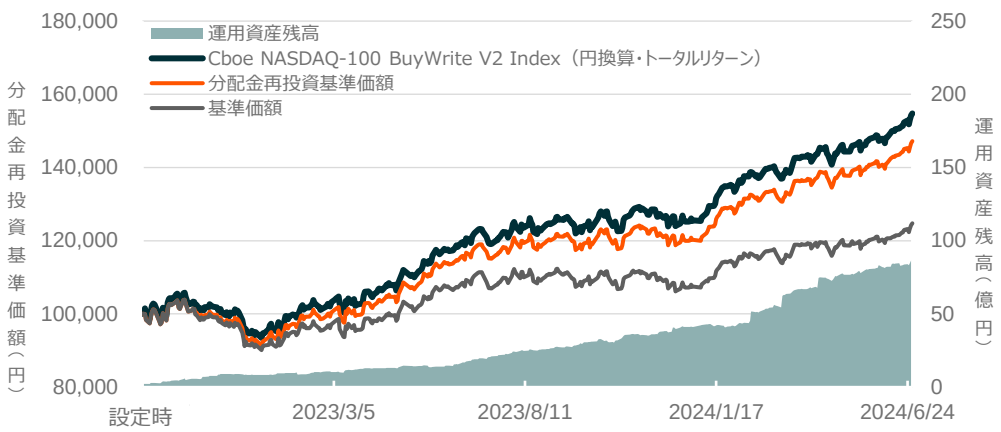
設定日	2022年9月28日
インデックス	Cboe NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index（円換算）
保有銘柄数	1
運用資産残高	86.83億円
基準価額（100口当たり）	124,760円
運用管理費用（実質）	年率0.6275%（税抜0.625%）
分配頻度	月1回
決算日	毎月10日

取引情報

証券コード	2865
ISIN	JP3049720000
取引所	東京証券取引所
インデックス ティッカー	BXNT

基準価額・純資産の推移

(2022/9/28～2024/6/28)



直近12期の分配の推移

100口当たり、税引前

2023/7/10	800円
2023/8/10	900円
2023/9/10	900円
2023/10/10	900円
2023/11/10	800円
2023/12/10	800円
2024/1/10	900円
2024/2/10	1,000円
2024/3/10	900円
2024/4/10	1,400円
2024/5/10	1,000円
2024/6/10	1,000円
設定来分配金合計額	17,800円

パフォーマンス

	1ヶ月	年初来	1年	3年	設定来
基準価額	+4.15 %	+16.09 %	+12.94 %	-----	+24.76 %
分配金再投資基準価額	+5.01 %	+22.42 %	+24.75 %	-----	+47.21 %
Cboe NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index（円換算・トータルリターン）	+5.09 %	+23.28 %	+26.74 %	-----	+54.77 %

組入上位10銘柄

対運用資産残高比

合計: 99.75%

GLOBAL X NASD 100 COV CALL	99.75%	---	---
---	---	---	---
---	---	---	---
---	---	---	---
---	---	---	---

※上記の投資対象ETFの詳細は当該ETFのFactsheetをご参照ください。

資産別構成

対運用資産残高比

資産	銘柄数	比率
外国投資信託	1	99.75%
---	---	---
---	---	---
コールローン、その他		0.25%
合計	1	---

「分配金再投資基準価額」は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。基準価額の計算において、運用管理費用（信託報酬）は控除しています。グラフ上のCboe NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index（円換算）は、グラフの起点時の基準価額に基づき指数化しています。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、投資者はそうしたパフォーマンスの再現を期待することはできません。

GLOBAL X

Global X Japan株式会社 金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第3174号 一般社団法人日本投資顧問業協会会員 一般社団法人投資信託協会会員

東京都千代田区永田町二丁目11番1号
山王パークタワー 21階

✓当ETFの特徴

1．米国籍投資信託であるGlobal X Nasdaq 100 Covered Call ETFに投資

2．NASDAQ-100インデックスを対象にするカバード・コール戦略を構築

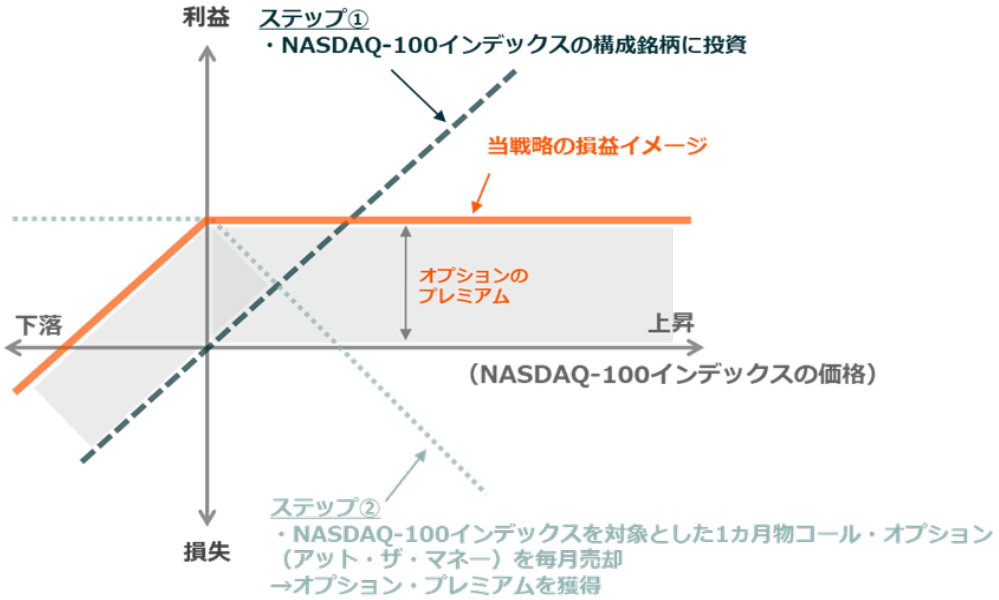
・NASDAQ-100インデックス構成銘柄を保有しつつ、同指数の１ヵ月物アット・ザ・マネーのコール・ オプションを売却する戦略です。

3．市場が不安定な時期や方向感に乏しい時期に大きな効果を発揮する傾向

・市場のボラティリティが上昇する時期にはコール・オプションの売却により得られるオプション・プレミアムが上昇する傾向にあり、カバード・コール戦略は市場の大勢が強気か弱気の一辺倒な時期よりも、不確実性の高い環境下で大きな効果を発揮する傾向にあります。

4．毎月分配により定期的なインカム提供

✓NASDAQ-100インデックスを対象としたカバード・コール戦略のコンセプト



※ 上記はイメージであり、実際の株価、配当金、オプション・プレミアムとは異なります。また、投資成果を示唆または保証するものではありません。
※ 上記はファンドが保有する株式の評価額の100%程度にかかるコール・オプションを売却した場合の１つの権利行使期間における損益を表したものであり、当ファンド全体の損益を表したものではありません。
※ 上記は株式の配当金の支払いおよびオプション・プレミアムの獲得があったことを前提として損益を表したものです。
※ 当ファンドにおいて、株式カバード・コール戦略の損益は毎営業日に時価評価され、基準価額に反映されます。

投資リスク
当ファンドは、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。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。基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。
「価格変動リスク・信用リスク（株価の変動）」、「為替リスク」、「カントリー・リスク」、「カバードコール戦略の利用に伴うリスク」、「その他」
※基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。
※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。
※くわしくは「投資信託説明書（交付目論見書）」の「投資リスク」をご覧ください。

ファンドの費用
<投資者が直接的に負担する費用>
取得時手数料：販売会社が定めるものとします。（取得時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。）
信託財産留保額：ありません。
交換時手数料：販売会社が定めるものとします。（受益権の交換に関する事務等の対価です。）
<投資者が信託財産で間接的に負担する費用>
運用管理費用（信 託 報 酬）：
毎日、次の１．の額に２．の額を加算して得た額
1.信託財産の純資産総額に年率 0.0275%（税抜 0.025%）以内を乗じて得た額
2.信託財産に属する株式の貸付けにかかる品貸料に55%（税抜50%）以内の率を乗じて得た額
投資対象ファンドにおける運用管理費用等：年率 0.6%程度
※なお、投資対象ファンドの信託報酬等を含めた実質的な信託報酬率の概算値
は以下の通りです。
実質的な信託報酬率：純資産総額に対して年率 0.6275%（消費税込）程度
その他の費用・手 数 料
受益権の上場にかかる費用および対象指数の商標の使用料（商標使用料）ならびにこれらにかかる消費税等に相当する金額を、受益者の負担として信託財産から支払うことができます。
有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、監査報酬等を信託財産でご負担いただきます。
※売買委託手数料などの「その他の費用・手数料」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。
※手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。
※くわしくは「投資信託説明書（交付目論見書）」の「手続・手数料等」をご覧ください。

インデックスの著作権について
本製品は、Nasdaq, Inc.およびその関連会社（以下、Nasdaqおよびその関連会社を「企業」といいます）がスポンサー、保証、販売または宣伝しているものではありません。企業は、本商品の合法性、適合性、説明および開示の正確性または妥当性について、何ら見解を示しておりません。企業は、本商品の所有者または一般投資家に対し、一般的な証券投資または本商品への投資の是非、あるいはCboe NASDAQ-100 BuyWrite V2 Indexが一般の株式市場のパフォーマンスを追跡する能力について、明示または黙示の表明または保証を行うものではありません。Global X Japan株式会社（以下「ライセンシー」）との関係は、Nasdaq®、Cboe NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index™、BXNT™、およびライセンシーの特定の商号の使用許諾、およびライセンシーまたは本製品に関係なくNasdaqが決定、構成、計算するCboe NASDAQ-100 BuyWrite V2 Indexの使用のみとなっています。Nasdaqは、Cboe NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index の決定、構成、計算において、ライセンシーまたは本製品の所有者のニーズを考慮する義務を負わない。企業は、本商品の発行時期、価格、数量の決定、または本商品を現金化するための方程式の決定もしくは計算について責任を負わず、またそれらに関与していない。企業は、本商品の管理、販売または取引に関して、いかなる責任も負いません。
企業は、Cboe NASDAQ-100 BuyWrite V2 Indexまたはそれに含まれるデータの正確性および中断のない計算を保証するものではありません。企業は、ライセンシー、製品の所有者、またはその他の人物や団体が、Cboe NASDAQ-100 BuyWrite V2 Indexまたはそこに含まれるデータの使用によって得られる結果について、明示または黙示を問わず、いかなる保証も行いません。企業は、Cboe NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index ®またはそこに含まれるデータに関して、明示または黙示の保証を行わず、特定の目的または使用に対する商品性または適合性のすべての保証を明示的に放棄します。上記を制限することなく、たとえそのような損害の可能性を通知されていたとしても、いかなる場合も、会社は、逸失利益、特別損害、付随的損害、懲罰的損害、間接損害、結果的損害について、いかなる責任も負わないものとします。

当資料のお取り扱いにおけるご注意
当資料は、ファンドの状況や関連する情報等をお知らせするためにGlobal X Japan 株式会社により作成されたものです。
当ファンドのお申込みにあたっては、「投資信託説明書（交付目論見書）」の内容を必ずご確認のうえ、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。
投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。証券会社以外でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。
当資料は、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。
当資料の中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、今後予告なく変更されることがあります。
分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。
GLOBAL X は、GLOBAL X MANAGEMENT COMPANY LLC 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。

GLOBAL X
Global X Japan株式会社 金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第3174号 一般社団法人日本投資顧問業協会会員
一般社団法人投資信託協会会員
東京都千代田区永田町二丁目11番1号
山王パークタワー 21階