

379A

グローバル X S&P500 ETF  
(ダイナミック・プロテクション)

## 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「S&P 500 Dynamic Covered Call Index（配当込み）」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



## 機動的なカバード・コール戦略

カバードコール戦略実施の判断は過次で行います。カバードコール戦略実施時はS&P500指数の終値に対して3%上乗せした水準の権利行使価格で、翌週金曜日に満期を迎えるコール・オプションを売却し、満期日の前営業日にポジションを解消します。



## より良い投資効率の提供

機動的にカバード・コール戦略を構築することで、相場急落時には獲得したプレミアムによる損失の一部相殺が期待できます。また、カバード・コール戦略構築時において、3%までの原資産価格の上昇に追従可能な設計となっており、長期的に見て原資産のロングポジションよりも良好なパフォーマンスが期待できます。



## 戦略へのアクセス

ETFを通じて、容易にオプション戦略への投資が可能となります。

2025年7月31日時点



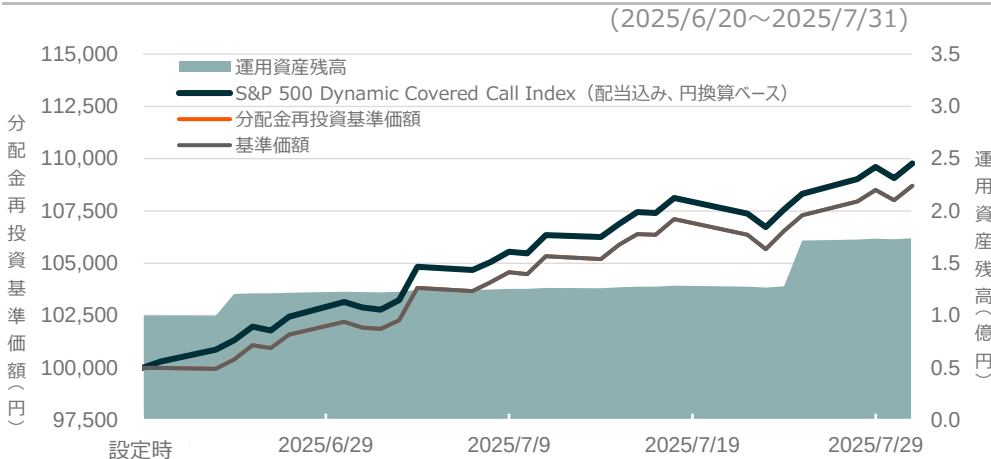
## ファンド概要

|               |                                                 |
|---------------|-------------------------------------------------|
| 設定日           | 2025年6月20日                                      |
| インデックス        | S&P 500 Dynamic Covered Call Index(配当込み、円換算ベース) |
| 保有銘柄数         | 1                                               |
| 運用資産残高        | 1.73億円                                          |
| 基準価額（100口当たり） | 108,705円                                        |
| 運用管理費用（実質）    | 年率0.11%<br>(税抜0.10%)                            |
| 分配頻度          | 年4回                                             |
| 決算日           | 毎年1,4,7,10月の各10日                                |

## 取引情報

|                   |               |
|-------------------|---------------|
| 証券コード             | 379A          |
| ISIN              | JP3050770001  |
| 取引所               | 東京証券取引所       |
| ブルームバーグ INAVティッカー | 379AJPIV      |
| インデックス ティッカー      | SPXDCC3 Index |

## 基準価額・純資産の推移



## 直近12期の分配の推移 100口当たり、税引前

|           |    |
|-----------|----|
| 設定来分配金合計額 | 0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                                            | +6.36 % | ----- | ----- | ----- | +8.71 % |
| 分配金再投資基準価額                                      | +6.36 % | ----- | ----- | ----- | +8.71 % |
| S&P 500 Dynamic Covered Call Index（配当込み、円換算ベース） | +6.42 % | ----- | ----- | ----- | +9.77 % |

## 組入上位10銘柄

| 組入上位10銘柄                   | 対運用資産残高比   |
|----------------------------|------------|
| SPDR PORTFOLIO S&P 500 ETF | 80.79% --- |
| ---                        | ---        |
| ---                        | ---        |
| ---                        | ---        |
| ---                        | ---        |
| ---                        | ---        |
| ---                        | ---        |
| ---                        | ---        |
| ---                        | ---        |
| ---                        | ---        |

※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

| 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 80.79% |
| 外国株式先物     | 1 19.23% |
| ---        | ---      |
| コールローン、その他 | 19.21%   |
| 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S&P 500 Dynamic Covered Call Index（配当込み、円換算ベース）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

## 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>

購入時手数料：販売会社が定めるものとします。（購入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。

換金時手数料：販売会社が定めるものとします。（受益権の換金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 0.11％（税抜 0.10％）以内を乗じて得た額

2.信託財産に属する有価証券の貸付けにかかる品賃料に55％（税抜50％）以内の率を乗じて得た額

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

S&P 500 DYNAMIC COVERED CALL INDEX（配当込み）はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これの使用ライセンスがGlobal X Japan株式会社に付与されています。S&P®、S&P 500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびCDX®は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S&P」）の商標です。Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJIに付与されており、Global X Japan株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。グローバルX S&P500 ETF（ダイナミック・プロテクション）は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P 500 DYNAMIC COVERED CALL INDEX（配当込み）のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

## 当資料のお取り扱いにおけるご注意

当資料は、Global X Japan株式会社が作成した情報提供資料です。ETFを金融商品取引所で売買される場合には、委託会社作成の投資信託説明書（交付目論見書）は交付されません。売買をお申込みになる証券会社に、当該取引の内容についてご確認ください。金融商品取引所における取引価格と基準価額は異なります。金融商品取引所における価格情報等については、売買をお申込みになる証券会社にお問い合わせになるか、ETFが上場する金融商品取引所のウェブサイト等をご覧ください。株式または金銭の抛出により当ファンドの取得（応募、追加設定）をご希望の場合には投資信託説明書（交付目論見書）を販売会社（指定参加者）よりお渡しいたしますので、必ず内容をご確認ください。

当ETFは、値動きのある有価証券等に投資しますので、取引価格、基準価額は大きく変動します。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・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。

当資料は、各種の信頼できると考えられる情報源から作成しておりますが、その正確性・完全性が保証されているものではありません。記載されている内容、数値、図表、意見等は当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。また、当資料中における運用実績等は参考とする目的で過去の実績および結果を示したものであり、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。また、当資料で掲載した画像等はイメージです。

分配金額は、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。

当資料でご紹介した企業はあくまでも参考のために掲載したものであり、個別企業の推奨を目的とするものではありません。また、ETFに組入れることを示唆・保証するものではありません。

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