



【2858】

GX日経カバコ

グローバルX 日経225 カバード・コール ETF(プレミアム再投資型)【正式名称】



- 日経平均株価を対象に、「カバードコール戦略」に基づく運用を行った場合の収益を表す「日経平均カバードコールATMインデックス(トータルリターン)」に連動する投資成果を目指すETF(上場投資信託)です。

1.概要

(2024年1月31日 現在)

銘柄名	グローバルX 日経225 カバード・コール ETF(プレミアム再投資型)		
対象指標	日経平均カバードコールATMインデックス(トータルリターン)		
計算期間	毎年4月25日から10月24日、10月25日から翌年4月24日		
分配金支払基準日	毎年4月24日、10月24日(年2回)		
管理会社	Global X Japan		
銘柄コード	2858	市場価格(終値)(※1)	1,210 円
売買単位	1口単位	1口あたり分配金(※2)	18円
信託報酬(税込)	0.3025%	分配金利回り(※3)	1.49%
純資産総額	10 億円	東証マーケットメイク制度(※4)	対象
受益権口数	800,000 口	1売買単位あたりの投資金額(※1)	1,210 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。

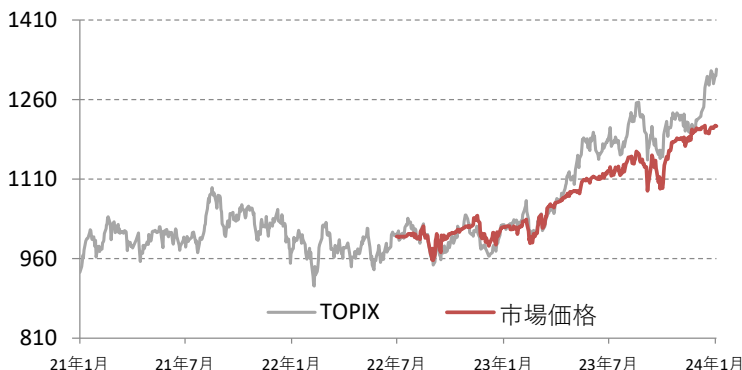
※2 直近12か月の実績分配金を記載しています。

※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か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

(2024年1月31日 現在)



※ 2022年7月29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	+9.70%	+13.20%
過去6か月	+7.27%	+9.84%
過去1年	+18.63%	+29.15%
過去3年	-	+41.04%
過去5年	-	+62.75%

3.ファンド組入銘柄

(2024年1月31日 現在)

	証券コード	銘柄名	構成比
1	1329	iシェアーズ・コア 日経225 ETF	50.27%
2	1320	iFreeETF 日経225(年1回決算型)	49.73%
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	2858/T	S101#ATMTR/NKNJ
Bloomberg	2858 JP Equity	NKYCCATR
Refinitiv	2858.T	.N225CAT

5.対象指標の概要

日経平均カバードコールATMインデックス(トータルリターン)は、日経平均株価を対象に、投資戦略のひとつである「カバードコール戦略」を行った場合の収益を表す、配当込みの指数です。日経平均株価指数(日経平均)から対象となるコール・オプション価格を差し引いた値の1日の変化率を、前日の指数値に乗じて算出します。SQ日ごとに、対象とするコール・オプションの限月と行使価格が変わります。2001年12月28日を基準日とし、当該基準日の指数値を10,000として、株式会社日本経済新聞社が算出・公表しています。オプション・プレミアム分は理論上再投資した形となっています。

6. 対象指標の特徴及び留意点

- 対象指標は、原資産がコール・オプションの行使価格を下回る水準で変動する場合には、対象指標も概ね原資産と同じような変動となりますが、原資産がコール・オプションの行使価格を上回る水準で変動する場合には、対象指標の変動は原資産の変動と異なるものとなります。
- 特に、原資産がコール・オプションの行使価格を上回る水準にあつて更に上昇するような局面においては、対象指標の変動は非常に限定的なものとなるため留意が必要となります。
- コール・オプションは、毎月のSQ日ごとに翌限月に変更となるため、その都度、原資産の変動に対して対象指標の変動が限定的となる水準が変わります。また、SQ日ごとのコール・オプションの売却プレミアムも変わります。
- 原資産の短期的な上昇に対して、原資産がコール・オプションの行使価格を上回った場合、対象指標の上昇が限定的なものとなることがあります。

<カバードコール指標の説明はこちら>

<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etfs/etf-outline/04-01.html>

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。