



【2865】

GXNDXカバコ

グローバルX NASDAQ100・カバード・コール ETF【正式名称】



- NASDAQ100指数を対象に、「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「Cboe NASDAQ-100BuyWrite V2 Index(円換算)」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 NASDAQ100・カバード・コール ETF		
対象指標	Cboe NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index(円換算)		
計算期間	毎月11日から翌月10日		
分配金支払基準日	毎月10日(年12回)		
管理会社	Global X Japan		
銘柄コード	2865	市場価格(終値)(※1)	1,144 円
売買単位	1口単位	1口あたり分配金(※2)	103円
信託報酬(税込)	0.6275%	分配金利回り(※3)	9.00%
純資産総額	42 億円	東証マーケットメイク制度(※4)	対象
受益権口数	3,680,000 口	1売買単位あたりの投資金額(※1)	1,144 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。

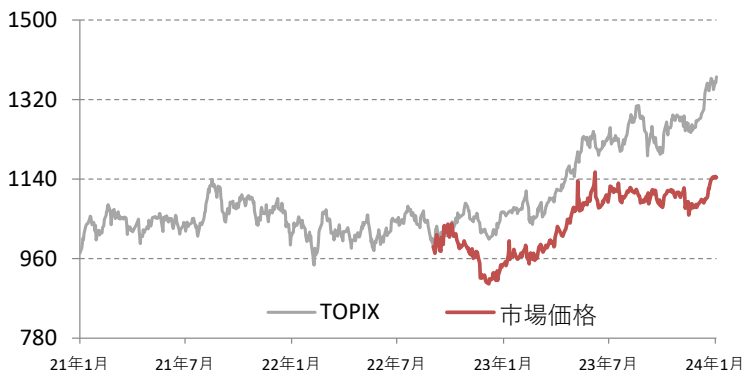
※2 直近12か月の実績分配金を記載しています。

※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9月30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	+5.73%	+13.20%
過去6か月	+2.60%	+9.84%
過去1年	+20.55%	+29.15%
過去3年	-	+41.04%
過去5年	-	+62.75%

3.ファンド組入銘柄

(2023年12月29日 現在)

	証券コード	銘柄名	構成比
1	-	GLOBAL X NASD 100 COV CALL	99.04%
2			
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	2865/T	-
Bloomberg	2865 JP Equity	BXNT Index
Refinitiv	2865.T	-

5.対象指標の概要

「Cboe NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index(円換算)」は、Nasdaq, Inc.が算出する「Cboe NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index」(※)の米ドル建ての値を元にGlobal X Japanが円換算したものです。

※Cboe NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index

NASDAQ100指数を原資産として、1か月ごとに新しく期近のコール・オプションを売り建てる「カバード・コール戦略」を行なった場合の収益を表す指数です。対象となるコール・オプションは毎月第3金曜日の前日の木曜日に清算され、翌金曜日に新たな1か月物のコール・オプションを売却します。

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場合があります。

<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際には、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。