

# FT Choe Vest U.S. Equity Buffer ETF-February

## Target Outcome Funds®

※本資料は、Teneo Partners株式会社が作成致しましたが、正文であるFirst Trust社作成資料等をご確認頂きたくお願い致します。

2109CTP

### ファンドの特色

S&P500のリターンを参照し、一定の条件下で利益と損失を限定するオプションに投資するETF

ファンドは、Cboe Vest Financial LLC を投資アドバイザーとして、原資産である「SPDR S&P 500 ETF」のパフォーマンスを参照するフレキシブル・エクスチェンジ・オプションに投資をします(フレキシブル・エクスチェンジ・オプションは、行使価格や権利行使期間などの契約条件をカスタマイズ可能な上場オプション契約です)。

ファンドは原資産のパフォーマンスに対して、予め設定した投資結果を目指す「目標リターン戦略」を採用します。具体的には、2022年2月22日から2023年2月17日までの原資産に係るリターンが0～14.25%の範囲では、ファンドと原資産の目標リターンは概ね同一となり、原資産のリターンが14.25%を上回る場合はファンドの目標リターンは概ね14.25%を上限とします。一方、原資産のリターンがマイナスの場合、-10%まではファンドの目標リターンは概ね0%を維持し、-10%を超過して下回る場合、ファンドの目標リターンは原資産のリターンを概ね10%上回る水準となります。(ファンドの目標リターンは全て費用控除前)

運用会社は米国トップクラスのアクティブ型運用会社で193本の米国上場ETFを運用中、30年の運用実績を誇り、総運用資産は約26兆円です。(2022年3月時点)

### ファンド概要

|       |                       |       |                         |
|-------|-----------------------|-------|-------------------------|
| 投資対象  | フレキシブル・エクスチェンジ・オプションズ | 最低投資額 | 定めなし                    |
| 運用手法  | オプション取引               | 運用報酬  | 0.85%/年                 |
| 上場取引所 | Cboe BZX(ティッカー:FFEB)  | その他費用 | なし                      |
| ファンド籍 | 米国マサチューセッツ州           | 買付申込  | 取引所取引時間中                |
| 運用開始  | 2020年2月               | 売却申込  | 取引所取引時間中                |
| 運用資産  | 2.8億米ドル(2022年3月現在)    | 決算日   | 8月31日                   |
| 通貨    | 米ドル建て                 | 監査法人  | Deloitte & Touche LLP   |
| 指数提供  | なし                    | アドミ   | Bank of New York Mellon |
| 外部評価  | —                     |       |                         |

### 運用会社

|       |                           |         |                      |     |       |      |       |
|-------|---------------------------|---------|----------------------|-----|-------|------|-------|
| 社名    | First Trust Advisors L.P. | 本社所在地   | 米国シカゴ                | 設立年 | 1991年 | 役員員数 | 900名強 |
| 総運用資産 | 2,166億米ドル(2022年3月現在)      | ETF運用資産 | 1,437億米ドル(2022年3月現在) |     |       |      |       |

### 運用実績(米ドル、ネット)

| 2021年  | 2020年  | 2019年  | 2018年 | 2017年  | 2016年 | 2015年 | 2014年 | 2013年 | 2012年 | 2011年 | 2010年 | 2009年 | 2008年 |
|--------|--------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 16.24% | -      | -      | -     | -      | -     | -     | -     | -     | -     | -     | -     | -     | -     |
| 年初来    | 1月     | 2月     | 3月    | 4月     | 5月    | 6月    | 7月    | 8月    | 9月    | 10月   | 11月   | 12月   |       |
| -6.09% | -1.32% | -1.73% | 2.19% | -5.23% |       |       |       |       |       |       |       |       |       |

○ 本資料は、ファンドの状況や関連情報等の提供を目的としておりますが、その正確性・完全性等について保証するもので無く、情報提供者の事由により変更・修正されることがあります。

○ 本資料のお取扱いは貴社関係者限りとし第三者への配布及び弊社の承諾を得ない二次利用はお断りいたします。お問合せは、Teneo Partners 株式会社までお願い致します。