

First Trust Long/Short Equity ETF

Alternative 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

米国上場株式を投資対象とする ロングショート戦略の米国市場ETF

ファンドは、米国市場に上場するグローバル株式、ETF、株価指数先物取引を投資対象に、ロング及びショートポジションを構築して、長期的な収益獲得を目指すETFです。

投資戦略はロングの投資比率を80%~100%、ショートを0%~50%以下としてロングバイアスのポートフォリオを組みます。ショートポジション構築によって得た資金はロングポジションの構築には転用せず、ネットポジションの上限を100%とします。

投資対象とする銘柄の選別は、多様なクオンツ・ツールを用いてロング及びショートがいずれも市場の値動きをアウトパフォーム(ショートはアンダーパフォーム)することを目指します。

2021年6月末の組入れ上位銘柄は(現金を除く)、ロングがApple Inc.(4.39%)、Microsoft Corporation(4.08%)、Amazon.com, Inc.(3.94%)、ショートがSPDR® S&P 500® ETF Trust(-5.13%)、T-Mobile US, Inc.(-0.64%)、Eaton Corporation Plc(-0.63%)等です。

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185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23兆円です。(2021年7月時点)

ファンド概要

投資対象	米国上場株式	最低投資額	定めなし
運用手法	ロングショート	運用報酬	0.95%
上場取引所	NYSE Arca(ティッカー:F TLS)	その他費用	0.60%
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	2014年9月	売却申込	取引所取引時間中
運用資産	3.7億米ドル(2021年6月現在)	決算日	10月31日
通貨	米ドル建て	監査法人	Deloitte & Touche LLP
指数提供	なし	アディ	Brown Brothers Harriman & Co.
外部評価	モーニングスター ★★★★★		

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	役職員数	900名強
総運用資産	2,056億米ドル(2021年6月現在)	ETF運用資産	1,334億米ドル(2021年6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
19.47%	2.36%	16.48%	-4.79%	14.10%	6.84%	5.19%	-	-	-	-	-	-	-
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	
-2.46%	-4.15%	-0.10%	1.87%										

○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。