

First Trust Low Duration Opportunities ETF



Taxable Fixed Income 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

金利・クレジット市場の影響を受けにくい短期 エージェンシー債を中心とする米国市場ETF

ファンドは、住宅用不動産担保証券および商業用不動産担保証券に投資し、ポートフォリオの実効デュレーションを3年以下としつつ、魅力的な利息を得ることを目的とします。

特徴としては、①デュレーションが短いため(ネットで1.16年、2022年3月末現在)金利変動リスクが限定的、②主に政府関係機関の不動産担保証券に投資することでクレジット市場の影響が限定的(標準偏差 1.78%、2022年3月現在)、③発行量が多く、流動性の高い資産への投資によりリバランスも容易、が挙げられます。

ポートフォリオは、グローバル経済や債券市場のトレンド、MBS市場の時価評価およびそのトレンドなど、トップダウン型の調査により構築されます。

2022年3月末の組入れ上位は、信用度別では政府およびエージェンシー(79.5%)、AAA～A格(14.0%)、種類別ではエージェンシーMBSパススルー(41.8%)、エージェンシーMBS CMO(26.3%)、エージェンシーCMBS(10.2%)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	米国不動産担保証券	最低投資額	定めなし
運用手法	MBS投資	運用報酬	0.65%/年
上場取引所	Nasdaq(ティッカー:LMBS)	その他費用	0.01%
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11月	売却申込	取引所取引時間中
運用資産	57億米ドル(2022年3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	アドミ	Bank of New York Mellon
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	2,166億米ドル(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
-0.77%	1.81%	4.15%	1.46%	1.76%	6.84%	2.37%	-	-	-	-	-	-	-
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	
-2.06%	-0.42%	-0.37%	-0.95%	-0.33%									

○ 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。