

2024 年 8 月 13 日

Jトラストグローバル証券株式会社

関係者各位

**米国株価指数連動 ETF の価格リターンに一定幅までの損失を回避しつつリターンを追及する
バッファ ETF の新規取扱いをスタート！（8/13～）**

JTG 証券（本社：東京都渋谷区、代表取締役社長：矢田耕一）は、米国のシカゴ・オプション取引所（CBOE）に上場するファースト・トラスト社の FT Vest 米国株バッファ ETF（以下「本バッファ ETF」といいます。）の決算期の異なる 4 銘柄の取扱いを、2024 年 8 月 13 日（火）から開始いたします。

バッファ ETF は、金融派生商品（オプション）取引を利用することにより、所定の期間における特定の原資産の価格リターンに連動した収益の追求を目指す際に、一定の幅までの損失（損失率）のバッファを設けることで原資産の価格下落リスクの軽減を図りつつ、価格上昇時のリターンを追及する（ただし所与の上限を超えるリターンは享受できない）仕組みをもった ETF です。中長期的視点では米国株式市場の上昇基調を見込むが、景気減速や高金利長期化などによる下落局面が示現した時には下落幅を一定程度抑制したいお客さまにとって、ひとつの選択肢となるものと考えております。

■新規取扱い銘柄

ティッカー	銘柄名	取引所
FFEB	ファースト トラスト 米国株バッファ ETF 2 月	CBOE
	フレックス・オプション取引（*1）を通じて、原資産である SPDR® S&P 500® ETF Trust（SPY）のプライスリターンに連動することを目指します。 特定の期間において、あらかじめ決めた成果を達成することを目指す「ターゲット・アウトカム戦略」をとり、2 月を起点とした 1 年間に、事前に定められた収益の上限（*2）がある一方、SPY の損失率 10%までのバッファ（報酬、費用及び税金控除前）を提供することを目指す ETF です。	
FMAY	ファースト トラスト 米国株バッファ ETF 5 月	CBOE
	フレックス・オプション取引（*1）を通じて、原資産である SPDR® S&P 500® ETF Trust（SPY）のプライスリターンに連動することを目指します。 特定の期間において、あらかじめ決めた成果を達成することを目指す「ターゲット・アウトカム戦略」をとり、5 月を起点とした 1 年間に、事前に定められた収益の上限（*3）がある一方、SPY の損失率 10%までのバッファ（報酬、費用及び税金控除前）を提供することを目指す ETF です。	

FAUG	ファースト トラスト 米国株バッファー ETF 8 月	CBOE
	フレックス・オプション取引（*1）を通じて、原資産である SPDR® S&P 500® ETF Trust（SPY）のプライスリターンに連動することを目指します。 特定の期間において、あらかじめ決めた成果を達成することを目指す「ターゲット・アウトカム戦略」をとり、8 月を起点とした 1 年間に、事前に定められた収益の上限（*4）がある一方、SPY の損失率 10%までのバッファー（報酬、費用及び税金控除前）を提供することを目指す ETF です。	
FNOV	ファースト トラスト 米国株バッファー ETF 11 月	CBOE
	フレックス・オプション取引（*1）を通じて、原資産である SPDR® S&P 500® ETF Trust（SPY）のプライスリターンに連動することを目指します。 特定の期間において、あらかじめ決めた成果を達成することを目指す「ターゲット・アウトカム戦略」をとり、11 月を起点とした 1 年間に、事前に定められた収益の上限（*5）がある一方、SPY の損失率 10%までのバッファー（報酬、費用及び税金控除前）を提供することを目指す ETF です。	

運用会社：ファースト・トラスト社（米国）

外国株式 HP：https://www.jtg-sec.co.jp/foreign_equity/

- *1 フレックス・オプション取引とは、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です。
- *2 ターゲット・アウトカム期間（2024 年 2 月 20 日から 2025 年 2 月 21 日）の間、事前に定められた収益の上限は 16.82%（報酬、費用及び税金控除前）です。
- *3 ターゲット・アウトカム期間（2024 年 5 月 20 日から 2025 年 5 月 16 日）の間、事前に定められた収益の上限は 15.92%（報酬、費用及び税金控除前）です。
- *4 ターゲット・アウトカム期間（2023 年 8 月 21 日から 2024 年 8 月 16 日）の間、事前に定められた収益の上限は 18.70%（報酬、費用及び税金控除前）です。
- *5 ターゲット・アウトカム期間（2023 年 11 月 20 日から 2024 年 11 月 15 日）の間、事前に定められた収益の上限は 17.45%（報酬、費用及び税金控除前）です。

■お取引にあたってのご留意事項

当社で取扱う商品等へのご投資には、所定の手数料や諸経費をご負担いただく場合があります。また、各商品等には為替や価格の変動等により損失を生じるおそれがあります。米国株式等のお取引では、株価の変動、為替相場の変動、発行者等の信用状況の悪化等により、損失が生じるおそれがあります。米国株式のお取引には、現地委託取引の場合、約定代金に対し最大 0.880%（最低 1,650 円／税込）の委託手数料および現地諸費用等がかかります。国内店頭取引の場合は、基準価格から所定のスプレッドを考慮して当社が提示する店頭売買価格でお取引いただきます。商品毎に手数料およびリスクは異なりますので、当該商品等の 契約締結前交付書面や目論見書等をよくお読みください。

■ターゲット・アウトカム・ファンド（バッファETF）の投資リスクについて

ターゲット・アウトカム・ファンド（バッファETF）等のお取引にあたっては、以下の点にご留意ください。

- ・ 本バッファETFは、年1回にリバランスを行い、新しいターゲット・アウトカム期間の初日に、新しいバッファとキャップを設けるために、新しいFLEXオプションに投資します。
- ・ 各ターゲット・アウトカム期間において、プット・オプションとコール・オプションの購入と売却を行います。
- ・ 本バッファETFは、ターゲット・アウトカム期間の全期間にわたり株式を保有する株主のみに対してターゲット・アウトカム期間中、SPYの損失率の10%までバッファ（ターゲット・アウトカム期間の初日にFLEXオプションを締結した時点のSPYの価値に基づく）を設けることを目指します。ターゲット・アウトカム期間終了後もファンドは終了しません。
- ・ ターゲット・アウトカム期間終了後、新たなターゲット・アウトカム期間が始まります。ターゲット・アウトカム期間の成果が実現する保証はありません。後続の各アウトカム期間のキャップは当初のアウトカム期間とは異なる可能性があります。
- ・ 上記のターゲット・アウトカム・ファンド（バッファETF）特有の投資リスク以外の投資リスクとしては、価格変動リスク、信用リスク、為替リスク等があります。詳しくは「上場有価証券等書面」をご確認ください。

■JTG証券について

JTG証券は、創業から60年を超え、2022年にはJトラスト株式会社（東証スタンダード上場 証券コード：8508）グループの一員として新体制でリスタートした、歴史と革新が共存する証券会社です。

「お客さまをはじめとするすべてのステークホルダーから信頼され、金融機関として持続的に社会に貢献できる会社を目指す」という理念のもと、外部環境がどのように変化してもその変化に適切に対応し、既成概念にとらわれない質の高いサービスと革新的なアプローチを通じて、お客さまへ新しい付加価値を提供することを使命としています。

「海外投資のJTG証券」「ベンチャー企業を応援するJTG証券」「ウェルスマネジメントのJTG証券」という3つのコア領域において付加価値創造に取り組んでまいります。

以上

<この件についてのお問い合わせ>

Jトラストグローバル証券株式会社 総務部

電話番号 03-4560-0212

メールアドレス keiei_support@ma.jtg-sec.co.jp

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第35号

貸金業者登録番号 東京都知事(1)第31946号

加入協会:日本証券業協会、日本貸金業協会会員 第006278号