

# ROBT ファーストラスト ナスダック AI & ロボティクスETF

3月28日時点

## ≫ ファンドの目的

この上場投資信託(ETF)は、Nasdaq CTA Artificial Intelligence and Robotics Index<sup>SM</sup>と呼ばれる株価指数の価格と利回り(ファンドの手数料および費用控除前)に概ね連動する投資成果を目指します。

## ≫ ファンド概要

ファンドティッカー	ROBT
CUSIP	33738R720
iNAVティッカー	ROBTIV
ファンド設定日	2/21/2018
経費率	0.65%
リバランス頻度	四半期毎
主要取引所	NASDAQ

## ≫ 連動指数の概要

指数ティッカー	NQROBOT
指数設定日	12/18/2017

## ≫ 指数会社による連動指数の説明

- 当指数は、人工知能(AI)、ロボティクス、オートメーションに携わる企業のパフォーマンスを追跡するように設計されています。
- 指数の組入対象証券は、指数適格である世界各国の証券取引所に上場し、全米民生技術協会(CTA)によってAIまたはロボティクスのエンゲイジャー、イネイブラー、エンハンサーに分類されている必要があります。
  - イネイブラー - 先進的な機械、自律システム/自動運転車、半導体、機械学習に使用されるデータベースなど、ロボティクスやAIの構成部品を開発する企業。
  - エンゲイジャー - ロボティクスやAIを製品、ソフトウェア、システムの形で設計、製造、統合、提供する企業。
  - エンハンサー - AIやロボティクスのエコシステムの中で独自の付加価値サービスを提供する企業。
- 各証券は、時価総額が最低2億5,000万ドル、1日取引高の3カ月平均が最低300万ドル、浮動株比率が最低20%である必要があります。
- 対象となる各証券は、エンゲイジャー、イネイブラー、エンハンサーの各カテゴリーにおける関与度合に基づいてスコアリングされ、各カテゴリー内の上位30社が選定されます。
- 各カテゴリーの比率は、エンゲイジャーが60%、イネイブラーが25%、エンハンサーが15%となり、選定された証券は各カテゴリー内で均等に加重されます。
- 当指数は四半期毎にリバランスが行われ、半年毎に再構成されます。

## ≫ パフォーマンス概要 (%)

	3ヶ月	年初来	1年	3年	5年	10年	設定来
ファンド・パフォーマンス*							
基準価額(NAV)	-0.84	-0.84	6.11	-4.35	7.56	-	7.26
市場価格	-0.66	-0.66	6.23	-4.39	7.54	-	7.30
指数パフォーマンス**							
Nasdaq CTA Artificial Intelligence and Robotics <sup>SM</sup> Index	-0.69	-0.69	6.96	-3.86	8.23	-	7.93
S&P 500 <sup>®</sup> Index	10.56	10.56	29.88	11.49	15.05	-	13.46

## ≫ 年次トータルリターン(%)

	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	年初来
ROBT	-	-	-	-	-	33.78	46.07	9.95	-34.56	27.08	-0.84
S&P 500 <sup>®</sup> Index	-	-	-	-	-	31.49	18.40	28.71	-18.11	26.29	10.56

## ≫ 3年間の統計

	標準偏差 (%)	アルファ	ベータ	シャープレシオ	相関関係
ROBT	24.05	-15.95	1.19	-0.17	0.87
S&P 500 <sup>®</sup> Index	17.60	-	1.00	0.56	1.00

パフォーマンスデータは過去のもので、過去のパフォーマンスは将来の結果を保証するものではなく、現在のパフォーマンスは提示されたパフォーマンスよりも高い場合も低い場合もあります。投資リターンおよび元本価値は変動し、株式は売却または償還された場合、当初のコストよりも価値が高くなることも低くなることもあります。直近の月末までのパフォーマンス情報は、[www.ftportfolios.com](http://www.ftportfolios.com)。

\*基準価額(NAV)は、ファンドの純資産(資産から負債を差し引いたもの)をファンド発行口数で割ったものです。リターンは、その他に株式を取引した場合のリターンを表すものではありません。市場価格は、ファンドの基準価額が算出される時点の全米最良気配(INBBO)の midpoint を使用して決定されます。リターンは、1年未満の期間のものを除き、年率平均の総合リターンです。  
\*\*各指数のパフォーマンス情報は例示であり、実際のファンド・パフォーマンスを示すものではありません。指数パフォーマンスには管理手数料や売買委託手数料は含まれておらず、表示されたパフォーマンスからそのような手数料や費用は差し引かれていません。インデックスは非管理型であり、投資家はインデックスに直接投資することはできません。

# ファーストトラスト ナスダック AI & ロボティクスETF

3月28日時点

## ポर्टフォリオ情報

保有銘柄数	108
最大時価総額	31,261億3,000万ドル
時価総額中央値	217億7000万ドル
最小時価総額	3億7200万ドル
株価純資産倍率	2.95
株価キャッシュフロー倍率	16.58
株価売上高倍率	1.93

## 国別内訳上位(%)

アメリカ	54.16
日本	12.94
イギリス	6.76
フランス	4.19
イスラエル	3.97
韓国	2.84
カナダ	2.72
中国	1.95
スウェーデン	1.72
台湾	1.61

## 上位保有10銘柄(%)

モービルアイ・グローバル社(クラ スA)	2.15
ダークトレース	2.08
エアロピロメント社	2.06
アッピアン・コーポレート	1.95
ヴァレオS.A.	1.84
ナイス株式会社(ADR)	1.81
株式会社セレンス	1.80
アップスタート銘柄情報	1.78
ANSYS, Inc.	1.77
ケイデンス・デザイン・システムズ	1.74

## 業種別内訳(%)

情報技術	58.01
資本財	19.20
一般消費財	10.48
ヘルスケア	6.27
通信サービス	2.75
金融	1.78
生活必需品	1.51

投資を行う前に、ファンドの投資目的、リスク、手数料および費用を慎重に検討する必要があります。目論見書または要約目論見書入手するには、First Trust Portfolios L.P.(1-800-621-1675)に連絡するか、[www.ftportfolios.com](http://www.ftportfolios.com)。この目論見書または要約目論見書にはファンドに関するその他情報に記載されています。投資前に目論見書または要約目論見書をよくお読みください。

## リスクに関する考察

ファンドへの投資により損失を被る可能性があります。ファンドへの投資は銀行の預金ではなく、保険も保証もありません。ファンドの目的が達成される保証はありません。投資家が流通市場で株式を売買する場合、通例の仲介手数料が発生する場合があります。ファンドのリスクの詳細については、各ファンドの目論見書および追加情報説明書をご参照ください。以下のリスク要因の順序は、特定のリスク要因の重要性を示すものではありません。

投資信託とは異なり、ファンドの株式は、非常に大口の設定/償還単位で指定参加者がファンドから直接償還することのみが可能です。ファンドの指定参加者が設定/アスク・ディスカントの注文を進めることができず、他の指定参加者が設定や償還に踏み切れない場合、ファンド株式はファンドの純資産価値に対してプレミアムまたはディスカントで取引され、場合によっては上場廃止に直面し、ビッド/アスク・スプレッドが拡大する可能性があります。

通貨為替レートや米国以外の通貨の相対価値の変動は、ファンドの投資価値やファンドの株式価値に影響を与える可能性があります。

市況リスクとは、特定の投資対象またはファンドの株式全般が、現在の市況により値下がりするリスクのことです。インフレに対抗する手段として、米連邦準備制度理事会(FRB)および特定の外国の中央銀行は金利を引き上げたり、今後も引き上げる見込みであり、米連邦準備制度理事会(FRB)は以前に実施した量的緩和を撤回する意向を表明しています。最近および将来起こりうる銀行の破綻は、より広範な銀行業界または市場全般に混乱をもたらす、金融機関および経済全体に対する信頼を低下させ、市場のボラティリティを高め、流動性を低下させる可能性があります。2022年2月、ロシアはウクライナに侵襲し、ロシア、欧州、イギリスの市場において重大な市場の混乱とボラティリティを引き起こし、今後も引き起こす可能性があります。このような敵対行為とそれに起因する制裁措置は、ファンドのパフォーマンスや流動性だけでなく、特定のファンド投資にも大きな影響を及ぼしており、今後もその可能性があります。COVID-19の世界的大流行、または将来の公衆衛生上の危機、および政府機関や中央銀行が制定したそれに伴う政策は、世界の金融市場に大きな変動と不確実性をもたらし、今後ももたらし続ける可能性があります。世界の成長見通しに悪影響を及ぼします。

ファンドはサイバーセキュリティの侵害による運用リスクの影響を受けます。このような事象により、ファンドが規制上の罰則、風評被害、是正措置に伴う追加的なコンプライアンス費用、及び/又は金融損失を被る可能性があります。

預託証券は、主要取引市場における原株よりも流動性が低く、分配金に手数料がかかる場合があります。保有者は議決権を制限される可能性があり、特定の国における投資規制がその価値に悪影響を及ぼす可能性があります。

新興市場証券への投資は一般的に投機的とみなされ、政治、経済、規制状況に関する追加的なリスクを伴います。

株式は短期間または長期間にわたって大幅に価格が下落する可能性があり、そのような下落は株式市場全体で発生する場合もあれば、特定の国、企業、業界、または市場のセクターのみで発生する場合もあります。

インデックス・ファンドは、インデックスが集中する範囲内、ある産業または産業グループに集中します。単一のアセットクラス、または同じ国、州、地域、産業、またはセクター内の発行体の証券に大きなエクスポージャーを持つファンドは、幅広く分散されたファンドよりも、経済、ビジネス、または政治的な不利益な展開によってその価値がより大きな影響を受ける可能性があります。

ファンドは、ファンドの取引活動、規模、ボラティリティに大きな影響を与える可能性のある1つまたは複数の指数またはモデルの構成要素である可能性があります。

インデックス・プロバイダーまたはその代理人がインデックスを正確に作成または維持する保証はありません。インデックス・プロバイダーのエラーに伴う損失やコストは、一般的にファンドとその株主が負担することになります。

一般産業、耐久消費財企業は、経済全般、激しい競争、統合、国内外の政治、過剰生産能力、消費者の需要や消費動向など、特定のリスクにさらされています。また、全体的な資本支出レベル、景気サイクル、技術的陳腐化、近代化の遅れ、労使関係、政府機関の規制などによっても大きな影響を受ける可能性があります。

情報技術企業は、急速に変化する技術、短い製品ライフサイクル、熾烈な競争、積極的な価格設定と利益率の低下、特許・著作権・商標保護の喪失、周期的な市場パニック、進化する業界標準と規制、頻繁な新製品の導入など、特定のリスクにさらされています。

市場リスクとは、特定の証券やファンドの株式全般が値下がりするリスクのことです。証券は、一般的な経済情勢、政治的な出来事、規制や市場の動向、金利の変化、証券価格のトレンドの認識などの要因によって引き起こされる市場変動の影響を受けます。その結果、ファンドの株式が値下がりしたり、他の投資を下回る可能性があります。また、戦争、テロ行為、感染症の蔓延、その他公衆衛生上の問題、景気後退、自然災害、その他の事象など、地域的、地域的、世界的な事象がファンドに重大な悪影響を及ぼす可能性があります。

ファンドは、マーケットメーカーの数が限られているためにファンド株式の市場が活発でない可能性があるなど、多くの市場取引リスクに直面しています。マーケットメーカーや指定参加者が市場ストレス時にその役割を縮小したり退いたりすることを決定しない限り、ファンドのポートフォリオ証券の基礎的価値とファンドの市場価格との関係を維持する裁定プロセスの有効性が阻害される可能性があります。

インデックス・ファンドのリターンは、運用経費、インデックスの変動を反映するための証券の売買コスト、ファンドの保有残高がインデックスを正確に再現していない可能性があることなど、さまざまな理由により、インデックスのリターンと一致しない場合があります。

米国以外の発行体の証券には、為替変動、政治的リスク、源泉徴収、流動性の欠如、適切な金融情報の欠如、米国以外の発行体に影響を与える為替管理規制などのリスクがあります。

ファンドおよびファンド・アドバイザーは、統制や手続きを通じて様々な運用リスクの軽減を図ることがありますが、そのようなリスクから完全に保護することは不可能です。また、ファンドはカスタディを含む様々なサービスを第三者に依存しており、これらのサービスに関連する遅延や障害が発生した場合、ファンドの目的達成能力に影響を与える可能性があります。

インデックスに含まれる証券またはインデックスを代表する証券に投資するファンドは、投資メトリックの有無にかかわらずそれらの証券を保有し、ファンドが下落相場で守りのポジションを取ることは一般的にあります。

ポートフォリオの回転率が高い場合、取引コストが高くなり、株主の税負担が大きくなる可能性があります。

ファンドの株式の市場価格は、一般に、ファンドの純資産額(以下「NAV」)の変動および取引所における株式の相対的な需給に応じて変動し、ファンドのインベストメント・アドバイザーは、株式がNAVを上回る価格で取引されるか、NAVの水準で取引されるか、またはNAVを上回る価格で取引されるかを予測することはできません。

ロボティクスや人工知能を扱う企業は変動が激しい傾向があり、製品ライン、市場、金融資源、人材に限られている可能性があり、ビジネスサイクル、世界経済の成長、技術進歩、研究開発コスト、政府機関の規制の変化によるリスクにさらされています。また、これらの企業は知的財産権に大きく依存しており、そのような権利に対する異議申し立てや不正流用は、これらの企業に重大な悪影響を及ぼす可能性があります。

中堅・中小企業の価格は、大企業に比べて変動が大きく、流動性が低い場合があります。

取引所での取引は、市場の状況やその他の理由により停止されることがあります。取引所上場を維持するためファンドの要件が引き続き満たされる、または変更されないという保証はありません。

First Trust Advisors L.P.は当ファンドのアドバイザーです。First Trust Advisors L.P.は当ファンドの販売会社であるFirst Trust Portfolios L.P.の関連会社です。

本情報は、特定の個人に対する投資推奨や助言を意図したものではありません。本情報を提供することにより、ファーストトラストは、ERISA、内国歳入法、その他いかなる規制の枠組みにおいても、受託者の立場で助言を行うことを約束するものではありません。金融の専門家は、投資リスクを独自に評価し、顧客にとって投資が適切かどうかを判断する際に独自の判断を下す責任があります。

## 定義

標準偏差は、価格の変動性(リスク)の尺度である。アルファは、投資対象がベンチマークに対してリスク調整後でどれだけアウトパフォームまたはアンダーパフォームしているかを示す指標である。ベータは、市場に対する価格変動性の尺度である。シャープレシオは、ボラティリティの単位当たりの超過報酬の尺度である。相関は、パフォーマンスの類似性の尺度である。S&P 500®インデックスは、米国株式市場の大型株のバフォーマンスを測定するために使用される、500社から構成される非管理インデックスです。

Nasdaq®およびNasdaq CTA Artificial Intelligence and Robotics Index™は、Nasdaq, Inc.(以下、その関連会社とともに「コーポレート」といいます)の登録商標およびサービスマークであり、First Trustが使用を許諾されています。本ファンドは、その合法性または適合性についてコーポレートから見解が示されたものではありません。ファンドは、コーポレートにより発行、保証、販売または販売促進されていません。コーポレートはファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。

FDIC保険ではありません - 銀行保証ではありません - 価値を失う可能性があります。

ROBTFS041024

# ROBT

As of 3/28/24

## First Trust Nasdaq Artificial Intelligence and Robotics ETF

### >> Fund Objective

This exchange-traded fund seeks investment results that correspond generally to the price and yield (before the fund's fees and expenses) of an equity index called the Nasdaq CTA Artificial Intelligence and Robotics Index<sup>SM</sup>.

### >> Fund Facts

Fund Ticker	ROBT
CUSIP	33738R720
Intraday NAV	ROBTIV
Fund Inception Date	2/21/18
Expense Ratio	0.65%
Rebalance Frequency	Quarterly
Primary Listing	Nasdaq

### >> Index Facts

Index Ticker	NQROBOT
Index Inception Date	12/18/17

### >> Index Description According to the Index Provider

- >> The Nasdaq CTA Artificial Intelligence and Robotics Index<sup>SM</sup> is designed to track the performance of companies engaged in Artificial intelligence (AI), robotics and automation.
- >> To be included in the index, a security must be listed on an index-eligible global stock exchange and classified as AI or robotics engagers, enablers or enhancers, as determined by the Consumer Technology Association (CTA):
  - Enablers – Companies that develop the building block components for robotics or AI, such as advanced machinery, autonomous systems/self-driving vehicles, semiconductors, and databases used for machine learning.
  - Engagers – Companies that design, create, integrate, or deliver robotics and/or AI in the form of products, software, or systems.
  - Enhancers – Companies that provide their own value-added services within the AI and robotics ecosystem, but which are not core to their product or service offering.
- >> Each security must have a minimum market capitalization of \$250 million, have a minimum three-month average daily dollar trading volume of at least \$3 million, and have a minimum free float of 20%.
- >> Each eligible security is scored based on its involvement within its respective engager, enabler or enhancer category. The top 30 companies within each category are selected.
- >> Each category is weighted with engagers receiving 60%, enablers receiving 25% and enhancers receiving 15%. The selected companies are weighted equally within each category.
- >> The index is rebalanced quarterly and reconstituted semi-annually.

### >> Performance Summary (%)

	3 Month	YTD	1 Year	3 Year	5 Year	10 Year	Since Fund Inception
<b>Fund Performance*</b>							
Net Asset Value (NAV)	-0.84	-0.84	6.11	-4.35	7.56	—	7.26
After Tax Held	-0.84	-0.84	6.02	-4.43	7.45	—	7.14
After Tax Sold	-0.49	-0.49	3.62	-3.32	5.89	—	5.69
Market Price	-0.66	-0.66	6.23	-4.39	7.54	—	7.30
<b>Index Performance**</b>							
Nasdaq CTA Artificial Intelligence and Robotics Index <sup>SM</sup>	-0.69	-0.69	6.96	-3.86	8.23	—	7.93
S&P 500 <sup>®</sup> Index	10.56	10.56	29.88	11.49	15.05	—	13.46

### >> Calendar Year Total Returns (%)

	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	YTD
ROBT	—	—	—	—	—	33.78	46.07	9.95	-34.56	27.08	-0.84
S&P 500 <sup>®</sup> Index	—	—	—	—	—	31.49	18.40	28.71	-18.11	26.29	10.56

### >> 3-Year Statistics

	Standard Deviation (%)	Alpha	Beta	Sharpe Ratio	Correlation
ROBT	24.05	-15.95	1.19	-0.17	0.87
S&P 500 <sup>®</sup> Index	17.60	—	1.00	0.56	1.00

*Performance data quoted represents past performance. Past performance is not a guarantee of future results and current performance may be higher or lower than performance quoted. Investment returns and principal value will fluctuate and shares when sold or redeemed, may be worth more or less than their original cost. You can obtain performance information which is current through the most recent month-end by visiting [www.ftportfolios.com](http://www.ftportfolios.com).*

\*NAV returns are based on the fund's net asset value which represents the fund's net assets (assets less liabilities) divided by the fund's outstanding shares. After Tax Held returns represent return after taxes on distributions. Assumes shares have not been sold. After Tax Sold returns represent the return after taxes on distributions and the sale of fund shares. Returns do not represent the returns you would receive if you traded shares at other times. Market Price returns are determined by using the midpoint of the national best bid offer price ("NBBO") as of the time that the fund's NAV is calculated. Returns are average annualized total returns, except those for periods of less than one year, which are cumulative. Actual after-tax returns depend on the investor's tax situation and may differ from those shown. The after-tax returns shown are not relevant to investors who hold their fund shares through tax-deferred arrangements such as 401(k) plans or individual retirement accounts.

\*\*Performance information for each listed index is for illustrative purposes only and does not represent actual fund performance. Indexes do not charge management fees or brokerage expenses, and no such fees or expenses were deducted from the performance shown. Indexes are unmanaged and an investor cannot invest directly in an index.

## >> Portfolio Information

Number Of Holdings	108
Maximum Market Cap.	\$3,126.13 Billion
Median Market Cap.	\$21.77 Billion
Minimum Market Cap.	\$372 Million
Price/Book	2.95
Price/Cash Flow	16.58
Price/Sales	1.93

## >> Top Country Exposure (%)

United States	54.16
Japan	12.94
United Kingdom	6.76
France	4.19
Israel	3.97
South Korea	2.84
Canada	2.72
China	1.95
Sweden	1.72
Taiwan	1.61

## >> Top Holdings (%)

Mobileye Global Inc. (Class A)	2.15
Darktrace Plc	2.08
AeroVironment, Inc.	2.06
Appian Corporation	1.95
Valeo S.A.	1.84
NICE Ltd. (ADR)	1.81
Cerence Inc.	1.80
Upstart Holdings, Inc.	1.78
ANSYS, Inc.	1.77
Cadence Design Systems, Inc.	1.74

## >> Top Sector Exposure (%)

Information Technology	58.01
Industrials	19.20
Consumer Discretionary	10.48
Health Care	6.27
Communication Services	2.75
Financials	1.78
Consumer Staples	1.51

You should consider the fund's investment objectives, risks, and charges and expenses carefully before investing. Contact First Trust Portfolios L.P. at 1-800-621-1675 or visit [www.ftportfolios.com](http://www.ftportfolios.com) to obtain a prospectus or summary prospectus which contains this and other information about the fund. The prospectus or summary prospectus should be read carefully before investing.

## Risk Considerations

You could lose money by investing in a fund. An investment in a fund is not a deposit of a bank and is not insured or guaranteed. There can be no assurance that a fund's objective(s) will be achieved. Investors buying or selling shares on the secondary market may incur customary brokerage commissions. Please refer to each fund's prospectus and Statement of Additional Information for additional details on a fund's risks. The order of the below risk factors does not indicate the significance of any particular risk factor.

Unlike mutual funds, shares of the fund may only be redeemed directly from a fund by authorized participants in very large creation/redemption units. If a fund's authorized participants are unable to proceed with creation/redemption orders and no other authorized participant is able to step forward to create or redeem, fund shares may trade at a premium or discount to a fund's net asset value and possibly face delisting and the bid/ask spread may widen.

Changes in currency exchange rates and the relative value of non-US currencies may affect the value of a fund's investments and the value of a fund's shares.

Current market conditions risk is the risk that a particular investment, or shares of the fund in general, may fall in value due to current market conditions. As a means to fight inflation, the Federal Reserve and certain foreign central banks have raised interest rates and expect to continue to do so, and the Federal Reserve has announced that it intends to reverse previously implemented quantitative easing. Recent and potential future bank failures could result in disruption to the broader banking industry or markets generally and reduce confidence in financial institutions and the economy as a whole, which may also heighten market volatility and reduce liquidity. Ongoing armed conflicts between Russia and Ukraine in Europe and among Israel, Hamas and other militant groups in the Middle East, have caused and could continue to cause significant market disruptions and volatility within the markets in Russia, Europe, the Middle East and the United States. The hostilities and sanctions resulting from those hostilities have and could continue to have a significant impact on certain fund investments as well as fund performance and liquidity. The COVID-19 global pandemic, or any future public health crisis, and the ensuing policies enacted by governments and central banks have caused and may continue to cause significant volatility and uncertainty in global financial markets, negatively impacting global growth prospects.

A fund is susceptible to operational risks through breaches in cyber security. Such events could cause a fund to incur regulatory penalties, reputational damage, additional compliance costs associated with corrective measures and/or financial loss.

Depository receipts may be less liquid than the underlying shares in their primary trading market and distributions may be subject to a fee. Holders may have limited voting rights, and investment restrictions in certain countries may adversely impact their value.

Investments in emerging market securities are generally considered speculative and involve additional risks relating to political, economic and regulatory conditions.

Equity securities may decline significantly in price over short or extended periods of time, and such declines may occur in the equity market as a whole, or they may occur in only a particular country, company, industry or sector of the market.

An index fund will be concentrated in an industry or a group of industries to the extent that the index is so concentrated. A fund with significant exposure to a single asset class, or the securities of issuers within the same country, state, region, industry, or sector may have its value more affected by an adverse economic, business or political development than a broadly diversified fund.

A fund may be a constituent of one or more indices or models which could greatly affect a fund's trading activity, size and volatility.

There is no assurance that the index provider or its agents will compile or maintain the index accurately. Losses or costs associated with any index provider errors generally will be borne by a fund and its shareholders.

Industrials and producer durables companies are subject to certain risks, including the general state of the economy, intense competition, consolidation, domestic and international politics, excess capacity and consumer demand and spending trends. They may also be significantly affected by overall capital spending levels, economic cycles, technical obsolescence, delays in modernization, labor relations, and government regulations.

Information technology companies are subject to certain risks, including rapidly changing technologies, short product life cycles, fierce competition, aggressive pricing and reduced profit margins, loss of patent, copyright and trademark protections, cyclical market patterns, evolving industry standards and regulation and frequent new product introductions.

Market risk is the risk that a particular security, or shares of a fund in general may fall in value. Securities are subject to market fluctuations caused by such factors as general economic conditions, political events, regulatory or market developments, changes in interest rates and perceived trends in securities prices. Shares of a fund could decline in value or underperform other investments as a result. In addition, local, regional or global events such as war, acts of terrorism, spread of infectious disease or other public health issues, recessions, natural disasters or other events could have significant negative impact on a fund.

A fund faces numerous market trading risks, including the potential lack of an active market for fund shares due to a limited number of market makers. Decisions by market makers or authorized participants to reduce their role or step away in times of market stress could inhibit the effectiveness of the arbitrage process in maintaining the relationship between the underlying values of a fund's portfolio securities and a fund's market price.

An index fund's return may not match the return of the index for a number of reasons including operating expenses, costs of buying and selling securities to reflect changes in the index, and the fact that a fund's portfolio holdings may not exactly replicate the index.

Securities of non-U.S. issuers are subject to additional risks, including currency fluctuations, political risks, withholding, lack of liquidity, lack of adequate financial information, and exchange control restrictions impacting non-U.S. issuers.

A fund and a fund's advisor may seek to reduce various operational risks through controls and procedures, but it is not possible to completely protect against such risks. The fund also relies on third parties for a range of services, including custody, and any delay or failure related to those services may affect the fund's ability to meet its objective.

A fund that invests in securities included in or representative of an index will hold those securities regardless of investment merit and the fund generally will not take defensive positions in declining markets.

High portfolio turnover may result in higher levels of transaction costs and may generate greater tax liabilities for shareholders.

The market price of a fund's shares will generally fluctuate in accordance with changes in the fund's net asset value ("NAV") as well as the relative supply of and demand for shares on the exchange, and a fund's investment advisor cannot predict whether shares will trade below, at or above their NAV.

Robotics and artificial intelligence companies tend to be more volatile and they may have limited product lines, markets, financial resources or personnel and are subject to the risks of changes in business cycles, world economic growth, technological progress, costs of research and development, and government regulation. These companies are also heavily dependent on intellectual property rights, and challenges to or misappropriation of such rights could have a material adverse effect on such companies.

Securities of small- and mid-capitalization companies may experience greater price volatility and be less liquid than larger, more established companies.

Trading on an exchange may be halted due to market conditions or other reasons. There can be no assurance that a fund's requirements to maintain the exchange listing will continue to be met or be unchanged.

First Trust Advisors L.P. is the adviser to the fund. First Trust Advisors L.P. is an affiliate of First Trust Portfolios L.P., the fund's distributor.

The information presented is not intended to constitute an investment recommendation for, or advice to, any specific person. By providing this information, First Trust is not undertaking to give advice in any fiduciary capacity within the meaning of ERISA, the Internal Revenue Code or any other regulatory framework. Financial professionals are responsible for evaluating investment risks independently and for exercising independent judgment in determining whether investments are appropriate for their clients.

## Definitions

**Standard Deviation** is a measure of price variability (risk). **Alpha** is an indication of how much an investment outperforms or underperforms on a risk-adjusted basis relative to its benchmark. **Beta** is a measure of price variability relative to the market. **Sharpe Ratio** is a measure of excess reward per unit of volatility. **Correlation** is a measure of the similarity of performance. The **S&P 500® Index** is an unmanaged index of 500 companies used to measure large-cap U.S. stock market performance.

Nasdaq® and Nasdaq CTA Artificial Intelligence and Robotics Index™ are registered trademarks and service marks of Nasdaq, Inc. (together with its affiliates hereinafter referred to as the "Corporations") and are licensed for use by First Trust. The Fund has not been passed on by the Corporations as to its legality or suitability. The Fund is not issued, endorsed, sold or promoted by the Corporations. THE CORPORATIONS MAKE NO WARRANTIES AND BEAR NO LIABILITY WITH RESPECT TO THE FUND.

## ご留意事項

- ◆ 本資料は、ファンドの状況及び関連情報のご提供を目的としており、金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。
- ◆ ファンド投資には、運用会社提供資料及び／又は、「P P M（目論見書）」などをご確認の上ご自身の責任のもとご判断ください。
- ◆ 本資料は、運用会社提供資料及び／又は、弊社が作成・編集・和訳をしたもので、正文は運用会社提供資料とします。
- ◆ 本資料のお取扱いは、お客さま／貴社関係者限りとし第三者への配布及び、情報提供者の承諾を得ない二次利用はできません。
- ◆ 本資料は、信頼できると考えられるデータ・情報に基づいて作成しておりますが、その正確性、完全性及び将来の運用成果等について保証するものではなく、記載内容は予告なく変更されることがあります。
- ◆ 本資料の金融商品は、値動きのある有価証券等に投資しますので基準価格は変動するため、投資元本や利回りが保証されているものではありません。
- ◆ ファンドは、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- ◆ 本資料の運用会社へのコンタクトをご希望される場合は、事前に弊社までご連絡をお願いいたします。又、ファンドの詳細情報は、弊社までお問い合わせください。

TP2024061208

---

**Teneo Partners 株式会社（テネオ・パートナーズ）**

第一種及び第二種金融商品取引業 関東財務局長（金商）第2315号 加入協会：日本証券業協会  
住所：〒104-0031 東京都中央区京橋3-3-2 小松ビル3階 Tel：03-4550-2518（代）  
E-mail：info@teneopartners.co.jp HP：www.teneopartners.co.jp