



【1688】
穀物ETF【略称】
ETFS 穀物上場投資信託【正式名称】

外国籍ETF
OTCスワップ型

- コモディティ投資の際のベンチマークとして広く利用されている「Bloomberg Grains Subindex」の総合商品指数 に連動する投資成果を目指すETF(上場投資信託)です。

1. ETFS 穀物上場投資信託の概要

(2018年1月31日 現在)

| | | | |
|----------|--------------------------------|-------------------|---------|
| 銘柄名 | ETFS 穀物上場投資信託 | | |
| 対象指標 | Bloomberg Grains Subindex | | |
| 計算期間 | 毎年1月1日～12月31日 | | |
| 分配金支払基準日 | 分配金の支払いはありません | | |
| 管理会社 | ETFセキュリティーズ・マネジメント・カンパニー・リミテッド | | |
| 銘柄コード | 1688 | 市場価格(終値)(※1) | 380 円 |
| 売買単位 | 10口単位 | 1口あたり分配金(※2) | 0円 |
| 信託報酬 | 0.49% | 1売買単位あたりの投資金額(※1) | 3,800 円 |

※1 上記の期日において約定がない場合、「市場価格(終値)」及び「1売買単位あたりの投資金額」には、直近時点の市場価格を記載しています。

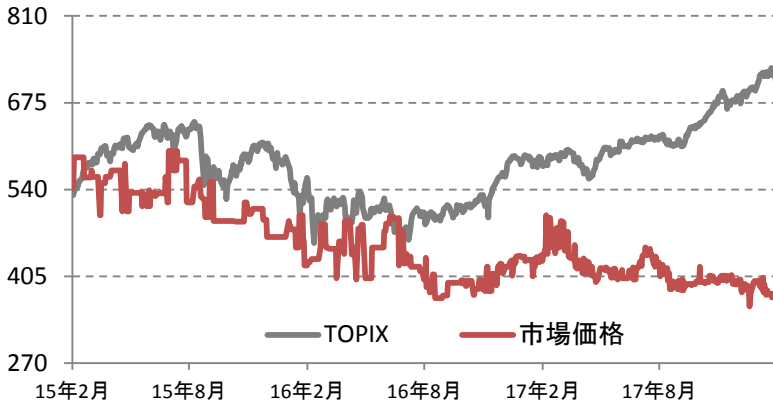
※2 直近12か月の実績分配金を記載しています。

※3 直近12か月の実績分配金及び作成日の終値をもとに算出した分配金利回りを記載しています。

※4 Indicative NAVとは、PCF情報に現時点の株価を乗じることによって算出されるリアルタイムの推定純資産額(1口あたり)、PCFとは、管理会社よりご提供をいただいたポートフォリオ構成銘柄情報ファイルのことを指します。ここでは東証を通じて開示しているIndicative NAV/PCF情報の有無を記載しています。

2. パフォーマンス

(2018年1月31日 現在)



※ 2015年1月30日 の市場価格を基準値とし、TOPIXの値を再換算しています。

■ 騰落率

| 期間 | 当銘柄 | (参考)TOPIX |
|-------|---------|-----------|
| 過去3か月 | -5.0% | +4.01% |
| 過去6か月 | -9.74% | +13.47% |
| 過去1年 | -13.24% | +20.70% |
| 過去3年 | -29.63% | +29.80% |
| 過去5年 | -39.68% | +95.34% |

■ 当銘柄のボラティリティ

| | |
|----------------|-------|
| ボラティリティ(過去30日) | 40.6% |
| ボラティリティ(過去90日) | 33.5% |

※ 対象期間のうち13%以上の日に売買が成立していない場合、上場の期間が記載の期間に満たない場合は「-」と表示されます。

対象指標の現在値(英語) <http://www.bloombergindeces.com/bloomberg-commodity-index-family/>

3. 指標組入銘柄

(2017年7月31日 現在)

| | 証券コード | 銘柄名 | 構成比 |
|---|-------|--------|--------|
| 1 | - | とうもろこし | 41.16% |
| 2 | - | 大豆 | 32.69% |
| 3 | - | 小麦 | 19.42% |
| 4 | - | カンザス小麦 | 6.73% |
| 5 | | | |

4. 情報ベンダーコード

| 情報ベンダー名 | ETFコード | 対象指標 |
|-----------------|----------------|--------------|
| QUICK | 1688/T | @@DJUBSGR/U |
| Bloomberg | 1688 JP Equity | BCOMGR INDEX |
| Thomson Reuters | 1688.T | .BCOMGR |

5. 対象指標の概要

Bloomberg Grains SubindexはBloomberg Commodity Indexのサブ指数です。Bloomberg Grains Subindexに含まれている商品の価格変動を反映します。

指数は米ドル建てです。

6. OTCスワップ型ETFの信用リスク

- 当ETFはOTCスワップ型ETFです。
- OTCスワップ型ETFとは、ETF発行者と主に金融機関との間で、連動対象の指標のリターンを交換するトータルリターンスワップ契約を結ぶことで、ETFの一口あたり純資産額の変動率と対象指標の変動率を一致させる運用手法を採るETFを指します。OTCスワップ型ETFでは、トラッキングエラーがない反面、スワップ契約のカウンターパーティーの信用リスクが存在します。
- OTCスワップ型ETFの多くは、スワップ契約締結にあたり、契約担保を双方が出し合う内容となっており、万が一、スワップ契約の相手方が破綻しても、スワップ契約の相手方が提供した受入担保を換金することで損失が生じない仕組みとなっていますが、スワップ契約の相手方の破綻により連動対象指標のリターンの交換が停止されるため、ETFの一口あたり純資産額の変動率と対象指標の変動率が維持できなくなります。その結果、ETFの基準価額が下落することもあります。
- また、スワップ契約の相手方が提供する担保の種類によっては、ETFが相手方に差し入れた提供担保と同額の換価を得られない場合もあり、その結果、ETFの価値が下落又は無価値になることもあります。OTCスワップ型ETFの投資にあたっては、スワップ契約の相手方の健全性を確認し、スワップ契約の相手方の信用状況を十分に把握することが重要です。
- 当ETFは信用リスクへの対応として、スワップ契約の相手方と担保の授受を行わない、スワップ契約の相手方に提供担保を分別保管させ、ETF発行者にスワップ契約の相手方破綻時の提供担保取戻権を付与する、スワップ契約の相手方からの受入担保を米国債等の換金性が高い商品のみに限るなどのリスク低減策を講じています。
- スワップ契約相手方の金融機関は有価証券報告書に開示されています。投資にあたっては、これらの情報にご留意いただく必要があります。

7. ETF情報入手一覽

- 各ETFに関するより詳細な商品概要
「ETFセキュリティーズ 専用ホームページ」<http://www.etfsecurities.com/jp/welcome.asp>
- ETFの現在値・前日比・売買高
<http://www.tse.idmanagedsolutions.com/iopv/table?language=jp&iopv=0>
- 一口あたりの純資産総額、対象指数との乖離率、ファンドの組入銘柄等
(注)検索される場合には、検索条件に検索コード5ケタの管理会社コードを入力してください。
「適時開示情報閲覧サービス」https://www.release.tdnet.info/inbs/1_main_00.html
「管理会社コードの一覧」<http://www.tse.or.jp/rules/etf/list.html>
- ETF株マップ
<http://etf.kabumap.com/servlets/etf/Action?SRC=page/top>

8. 免責事項

- 当資料は、作成時におけるETF/ETNの概要説明のみを目的としており、投資勧誘を目的としているものではなく、また金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。
- ETF/ETNは値動きのある有価証券を投資対象としますので、連動対象である指標及び外国為替相場の変動、組入有価証券の価格の変動、組入有価証券の発行会社の倒産や財務状況等の悪化、その他の市場要因の影響等により、市場取引価格又は基準価額が値下がりし、それにより損失が生じることがあります。したがって、投資元本が保証されているものではありません。また、信用取引を利用する場合には、差し入れた保証金以上の損失が生ずるおそれがあります。
- ETF/ETNの売買を行われるに際しては、あらかじめお取引先の金融商品取引業者等より交付される契約締結前交付書面等の書面の内容を十分にお読みいただき、商品の性質、取引の仕組み、リスクの存在、販売手数料、信託報酬などの手数料等を十分に御理解いただいたうえで、御自身の判断と責任で行っていただきますよう、お願い申し上げます。
- 当資料の実績数値は過去のものであり、将来の運用成果等を保証するものではありません。
- 当資料は、2018年1月現在の内容です。その以後、制度の改正等により、当資料に掲載した内容が予告なく変更される場合があります。また、この資料に掲載されている情報の作成には万全を期していますが、当該情報の完全性を保証するものではありません。当社は、当資料及び当資料から得た情報を利用したことにより発生するいかなる費用又は損害等の一切について責任を負いません。
- 本資料の一切の権利は当社に属しており、いかなる目的を問わず、無断複製・転載を禁じます。