



【1327】 EASY商品

S&P GSCI商品指数®エネルギー&メタル・キャップド・コンポーネント35/20・THEAM・イージーUCITS・ETFクラスA米ドル建受益証券【正式名称】

外国籍ETF

OTCスワップ型



● 円換算した「S&P GSCI商品指数®エネルギー&メタル・キャップド・コンポーネント35/20 トータル・リターン指数」との連動を目指すETF(上場投資信託)です。

1.概要

(2021年1月29日 現在)

銘柄名	S&P GSCI商品指数®エネルギー&メタル・キャップド・コンポーネント35/20・THEAM・イージーUCITS・ETFクラスA米ドル建受益証券		
対象指標	S&P GSCI商品指数®エネルギー&メタル・キャップド・コンポーネント35/20 トータル・リターン指数		
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	BNPパリバ・アセットマネジメント・ルクセンブルク		
銘柄コード	1327	1口あたり分配金(※2)	0円
売買単位	1口単位	分配金利回り(※3)	0.00%
信託報酬	0.3%	東証マーケットメイク制度(※4)	対象外
市場価格(終値)(※1)	3,085 円	1売買単位あたりの投資金額(※1)	3,085 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。

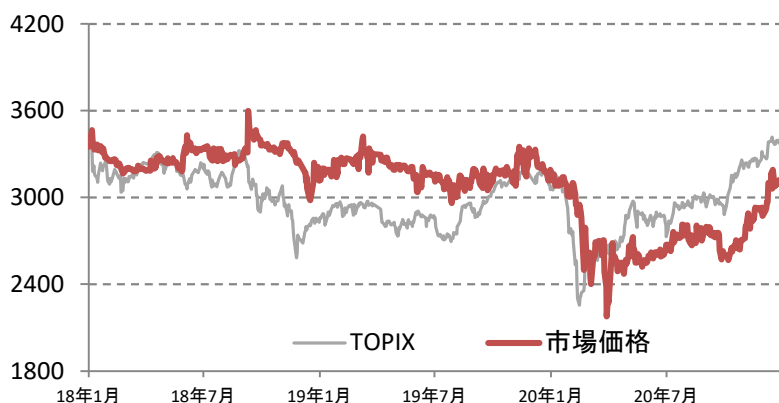
※3 直近12か月の実績分配金及び作成日の終値をもとに算出した分配金利回りを記載しています。

※4 東証が2018年7月2日に導入したETF市場におけるマーケットメイク制度の対象銘柄か否かを記載しています。マーケットメイクとはマーケットメイカーが気配を提示して取引の流動性を提供することです。

(注) 整理銘柄:2021年11月4日が取引最終日となる予定です。なお、本ETFの清算においては、2021年11月12日(清算財産基準日)の最終の本ETFの保有者に対し、同日の純資産価額による清算金が、金銭の支払いによる方法により行われる予定です。

2.パフォーマンス

(2021年1月29日 現在)



※ 2018年1月31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	+18.29%	+14.53%
過去6か月	+15.37%	+20.90%
過去1年	-2.83%	+7.38%
過去3年	-7.91%	-1.52%
過去5年	-10.97%	+26.31%

3.指標組入銘柄

(2020年11月30日 現在)

証券コード	銘柄名	構成比
1	銅	16.75%
2	原油	16.00%
3	金	14.57%
4	アルミニウム	12.54%
5	ブレント原油	10.84%

5.対象指標の概要

S&P GSCI商品指数®エネルギー&メタル・キャップド・コンポーネント35/20 トータル・リターン指数は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが算出している世界のコモディティ市況の総合的な値動きを表すS&P GSCI商品指数®キャップド・コンポーネント35/20トータル・リターン指数コモディティインデックスから、農産物、畜産物を除いた商品で構成される指数です。

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	1327/T	SGSUCETR/SPU
Bloomberg	1327 JP Equity	SPGCNCT INDEX
Refinitiv	1327.T	.SPGSCPTR

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. 情報入手一覧

- 現在値、インディカティブNAV・PCF
<http://tse.factsetdigitalsolutions.com/iopv/table?language=jp>
- 基準価額(一口あたりの純資産額)等に関する情報
<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etfs/base-price/index.html>
- ETF/ETN銘柄検索
<https://money-bu-jpx.com/search/> (東証マネ部！)

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ございません。
- 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、組入る有価証券の価格の変動、組入る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の売買が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、更新日現在の内容です。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。