

リクソーETF ロシア (DJ RUSINDEX TITANS 10) (2831.HK)

株式 (国・地域)

2010年7月30日

EXCHANGE TRADED FUNDS BY
LYXOR
SOCIETE GENERALE GROUP

ETF (上場投資信託)

リクソーETF ロシア (DJ RUSINDEX TITANS 10) (2831.HK)

「リクソーETF ロシア (DJ RUSINDEX TITANS 10)」は、世界的に有名な株価指数「DJ RUSINDEX Titans 10指数」を通じ、ロシアの国際的な企業の株式への投資手段を提供します。当該株価指数は、ロシアの上場企業を代表する10社、時価総額ベースで995億5,000万米ドルを表しています。(出所: rusindex.com、2010年7月30日現在)

投資目的

「リクソーETF ロシア (DJ RUSINDEX TITANS 10)」は、「DJ RUSINDEX Titans 10指数」(ブルームバーグ・ティッカー: RU10D)とのトラッキング・エラーを最小化しつつ、同指数のパフォーマンスに連動する投資成果を目指します。

リクソー・インターナショナル・アセット・マネジメント 2010年7月30日

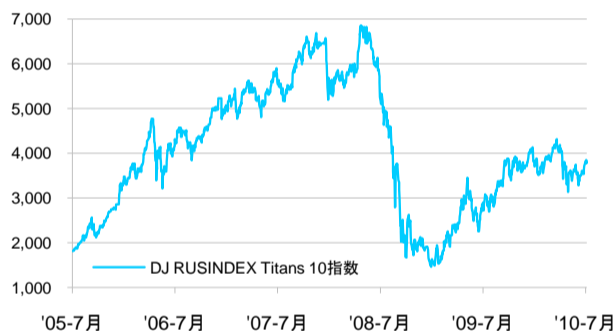
リクソー・アセット・マネジメント・エス・エイはソシエテ ジェネラルの子会社であり、同社のコーポレート&インベストメントバンキング部門の一翼を担っております。現在889億ユーロ(*約10.0兆円)の運用総資産を誇り、オルタナティブ投資、ストラクチャード・ファンド(仕組債ファンド)、ETF等のインデックス・トラッカー・ファンドの3つの分野に特化したビジネスを展開しています。

*1ユーロ=112.90円(WMロイター)、2010年7月30日現在

インデックス

インデックスの推移

出所: ブルームバーグ、2010年7月30日



年間パフォーマンス

2010 YTD	-0.27%
2009	108.00%
2008	-71.71%
2007	23.40%
2006	82.99%

累積パフォーマンス

1年	29.85%
3年	-32.77%
5年	108.30%

このグラフは、リクソーETFの連動先のインデックスの過去の実績を示すものであり、ファンド自体の実績を示すものではありません。リクソーETFは上記のインデックスに連動していますが、管理報酬とトラッキングエラーの影響を受けます(詳細は次ページをご参照ください)。過去の実績は将来のパフォーマンスを明示するものではありません。

資産配分

出所: www.rusindex.com、2010年7月30日

業種別

石油・ガス	74.63%
原材料・素材	21.11%
銀行	4.27%

ETFデータ

インデックス	DJ RUSINDEX Titans 10指数
法的形態	フランス籍投資信託
	UCIT I & III適格
設定日	2006年6月20日
上場日(香港市場)	2007年5月21日
通貨	米ドル
取引通貨	香港ドル
最低取引単位	100口
管理報酬	0.65%(年率)
分配金	年次
1口当たり純資産価格	3.83米ドル
運用資産額	3,063万米ドル

出所:リクソーAM

コード

香港市場	2831
ISIN	FR0010460998
ロイター	2831.HK
ブルームバーグ	2831 HK

インデックス・データ

投資対象国・地域	ロシア
投資対象資産	株式
構成銘柄数	10
通貨	米ドル
ブルームバーグ	RU10D
ロイター	.RU10

DJ RUSINDEX TITANS 10指数は、時価総額が大きく流動性の高い10銘柄のパフォーマンスに基づく指数です。各銘柄の構成比率は、浮動株ベースの総時価総額の15%を上限とします。構成比率は四半期毎に見直しされます。ダウ・ジョーンズTM指数の構築方法の詳細についてはwww.rusindex.comをご覧ください。

指数上位構成銘柄

出所: www.rusindex.com、2010年7月30日

指数上位構成銘柄

Surgutneftegas OJSC	(石油・ガス)	15.59%
Lukoil OAO	(石油・ガス)	15.13%
Gazprom OAO	(石油・ガス)	15.09%
MMC Norilsk Nickel	(原材料・素材)	14.59%
Rosneft Oil Co	(石油・ガス)	11.32%
NovaTek OAO	(石油・ガス)	10.03%
Tatneft	(石油・ガス)	7.47%
VTB Bank OJSC	(銀行)	4.27%
Evraz Group SA	(原材料・素材)	3.54%
Novolipetsk Steel OJSC	(原材料・素材)	2.98%

リクソーETF ロシア (DJ RUSINDEX TITANS 10) (2831.HK)

EXCHANGE TRADED FUNDS BY
LYXOR
SOCIETE GENERALE GROUP

株式（国・地域）

2010年7月30日

当資料は、情報提供のみを目的としており、リクソーETF ロシア (DJ RUSINDEX TITANS 10) (「リクソーETF」) の販売申込や買付申込の勧誘を行うものではありません。連動先のインデックスのパフォーマンスは、リクソーETFの将来の結果を示唆するものではなく、また、過去の実績が将来の結果を保証するものでもありません。投資家の皆様は、投資目的やリスク要因、カウンター・パーティ・リスクや上場廃止時の取決めについて、目論見書にてご確認ください。ソシエテ ジェネラルは、スワップ協定におけるカウンター・パーティの役割を担います。目論見書は www.lyxoretf.com.hk、または www.hkex.com.hk、にてご参照いただけます。投資家はETFが一般的な契約投資信託とは異なり、販売会社によって一口当りのサイズが異なる場合があることにご留意下さい。香港証券取引所におけるリクソーETFの市場価格は一口当りの純資産価格とは異なることがあります。委託手数料の計算はETF単位で行われます。

リクソーETF ロシア(DJ RUSINDEX TITANS 10)はダウ・ジョーンズ社によるスポンサー提供等は一切受けておらず、系列の子会社等によって指数が影響を受けることもありません。ダウ・ジョーンズ指数はダウ・ジョーンズ社の独占的財産で、また同指数はダウ・ジョーンズ社または子会社等に帰属しマネージャーの特定必要条件により使用許可を得られることになっているブランドです。リクソーETF ロシア(DJ RUSINDEX TITANS 10)の投資家の皆様、あるいはより広く一般投資家の皆様に対し、ダウ・ジョーンズ社も、ダウ・ジョーンズ社の子会社も、またはダウ・ジョーンズ指数の発行または算出に関わるいかなる系列会社も、一般的なファンドまたは特にリクソーETF ロシア(DJ RUSINDEX TITANS 10)を売買することの利点について、もしくはダウ・ジョーンズが世界の株式市場のパフォーマンスを反映する能力について、いかなる明示的あるいは暗黙の宣言または保証も致しません。

ダウ・ジョーンズはダウ・ジョーンズ社と系列子会社として確固たる名を有し、登録商標され、またダウ・ジョーンズ指数はマネージャーやリクソーETFロシア(DJ RUSINDEX TITANS 10)との協議もなく、ダウ・ジョーンズ社によって全て決定、構成、算出されます。ダウ・ジョーンズとダウ・ジョーンズの子会社、さらにはダウ・ジョーンズの指数に関わる会社のいずれも、ダウ・ジョーンズ指数について決定、構成または計算をする時、マネージャーあるいはリクソーETFロシアの投資家の要件を考慮することはありません。ダウ・ジョーンズ指数はリクソーETFの運用開始日、価格、ボリュームさらには純資産価額を証明する決断と計算には何ら関与しません。

ダウ・ジョーンズとダウ・ジョーンズの子会社、さらにはダウ・ジョーンズの指数に関わる会社のいずれも、リクソーETFロシア(DJ RUSINDEX TITANS 10)の管理・運用・販売において推測できるいかなる責務も負いません。

この文書は、リクソー・アセット・マネジメントにより発行されたものであり、香港証券先物委員会による検閲は受けていません。

重要事項 投資にはリスクがあります。投資家は、リクソーETFへの投資によって損失を被る可能性があります。投資家は、以下の点にご留意下さい：

- 各リクソーETFは、フランスの法律に基づきFCP(共同投資ファンド)として組成され、契約型ミューチュアル・ファンド(contractual mutual fund)の形態を取っています。
- 各リクソーETFの投資目的は、関連する連動先指数のパフォーマンスに連動する投資成果を提供することにあります。各リクソーETFのパフォーマンスは、関連する連動先指数のパフォーマンスと高い相関を持つ可能性があります。
- 関連する連動先指数によって代表される一部の市場、特に新興市場は、他の市場より大きなリスクを伴います。
- リクソーETFの価格は変動し、短期間に大きく値下がりする可能性があります。投資家は当該リクソーETFへの投資額の一部分、または全てを失う可能性があります。
- 各リクソーETFは「シンセティック・リブリケーション」と呼ばれる投資手法を採用し、当該リクソーETFの資産の10%を上限として、OTC市場で取引される金融派生商品であるエクイティリンク・スワップ契約を、当該リクソーETFの設定に際して締結します。その結果、各リクソーETFは、カウンター・パーティが契約を守れない可能性があるというカウンター・パーティ・リスクを負います。そうしたリスクはリクソーETFの純資産の10%までに限定されており、また過去にそうした上限を順守しなかった例はありません。
- 投資希望者は、取引の性格を十分に理解し、このような取引を行うことによって起こる可能性のあるリスクを含めた自身の目的と状況を踏まえた上で、取引の妥当性に関して独自の評価を行うことを確実にするための措置を講じるべきです。投資希望者はまた、こうした評価を行うにあたって独立した専門家の助言を求めることも考慮すべきです。
- 投資の意思決定は投資家自身のものですが、専門のアドバイザーが、当該リクソーETFが投資家に適していると助言し、かつ投資家の投資目的と一致する理由を方法も含めて説明しない限りは、投資家はいかなるリクソーETFにも投資すべきではありません。