

リクソーETF FTSE RAFI ヨーロッパ (2806.HK)

株式 (国・地域)

2011年2月28日

ETF (上場投資信託)

リクソーETF FTSE RAFI ヨーロッパ (2806.HK)

「リクソーETF FTSE RAFI ヨーロッパ」は、世界的に有名な株価指数「FTSE RAFI ヨーロッパ指数」を通じ、ヨーロッパの株式市場への投資手段を提供します。当該株価指数は、「FTSE 先進国 (除く米国) 指数」の構成銘柄のうち、目論見書にて定義された投資基準と最も相関性の高いヨーロッパ諸国の上場企業1000社から選ばれた銘柄で構成され、時価総額ベースで9兆4,600億米ドルを表象しています。(出所: FTSE、2011年2月28日現在)

投資目的

「リクソーETF FTSE RAFI ヨーロッパ」は、「FTSE RAFI ヨーロッパ指数」(ブルームバーグ・ティッカー: FREU) 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

2011年2月28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961億ユーロ(*約10.9兆円)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=113.16円(WMロイター)、2011年2月28日現在。

ETFデータ

インデックス	FTSE RAFI ヨーロッパ指数
法的形態	フランス籍投資信託
	UCIT I & III適格
設定日	2007年1月24日
上場日 (香港市場)	2008年6月3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	0.60% (年率)
分配金	年次
1口当たり純資産価格	6.82米ドル
運用資産額	809万米ドル

出所: リクソーAM

コード

香港市場	2806
ISIN	FR0010568857
ロイター	2806.HK
ブルームバーグ	2806 HK

インデックス

インデックスの推移

出所: ブルームバーグ、2011年2月28日



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: FTSE、2011年2月28日

業種別

銀行	16.15%
石油・ガス	12.39%
保険	10.87%
通信	8.47%
工業製品・サービス	7.52%
公益事業	5.57%
原材料・素材	5.50%
自動車・自動車部品	4.68%
ヘルスケア	4.59%
食品・飲料	4.23%
小売	3.42%
化学	3.03%
建設・資材	2.96%
家庭用品	2.87%
メディア	2.16%
旅行・レジャー	1.97%
テクノロジー	1.66%
金融	1.23%
不動産	0.76%

国別

イギリス	30.75%
フランス	16.55%
ドイツ	14.18%
イタリア	7.14%
スイス	6.66%
オランダ	6.43%
スペイン	5.95%
スウェーデン	4.25%
フィンランド	1.79%
ノルウェー	1.55%
ベルギー	1.49%
デンマーク	1.09%
オーストリア	0.72%
ギリシャ	0.54%
ポルトガル	0.52%
アイルランド	0.42%

インデックス・データ

投資対象国・地域

ヨーロッパ

投資対象資産	株式
構成銘柄数	502
通貨	ユーロ
ブルームバーグ	FREU
ロイター	.FTFREU

FTSE RAFI ヨーロッパ指数は、FTSE 先進国 (除く米国) 指数の構成銘柄のうち、目論見書にて定義された投資基準に最も相関性の高い、ヨーロッパ諸国の1000銘柄より構成されております。指数の構築方法の詳細については www.ftse.com をご覧ください。

指数上位構成銘柄

出所: FTSE、2011年2月28日

ING Group CVA	(保険)	2.92%
Vodafone Group	(通信)	2.43%
BP	(石油・ガス)	2.35%
Royal Dutch Shell A	(石油・ガス)	2.25%
Total	(石油・ガス)	2.18%
HSBC Hldgs	(銀行)	1.97%
Daimler AG	(自動車・自動車部品)	1.86%
Royal Dutch Shell B	(石油・ガス)	1.71%
Banco Santander S.A.	(銀行)	1.57%
ENI	(石油・ガス)	1.27%
Allianz SE	(保険)	1.23%
Telefonica	(通信)	1.16%
Telefonica	(通信)	1.16%
Siemens AG	(工業製品・サービス)	1.14%
Nestle	(食品・飲料)	1.02%
Nestle	(食品・飲料)	1.02%
Barclays	(銀行)	0.99%
BASF	(化学)	0.97%
AXA	(保険)	0.96%
Deutsche Telekom	(通信)	0.95%

リクソーETF FTSE RAFI ヨーロッパ (2806.HK)

株式 (国・地域)

2011年2月28日

当資料は、情報提供のみを目的としており、リクソーETF FTSE RAFI ヨーロッパ(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。投資家の皆様は、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。

FTSEインターナショナル・リミテッド(「FTSE」)、ロンドン証券取引所Plc、フィナンシャル・タイムズ・リミテッド、リサーチ・アフィリエイトLLC(総称して「所有者」)のいずれも、リクソーETF FTSE RAFI US 1000に関して出資、保証、販売および販売の促進を行っているものではありません。

所有者は、いついかなる時にも、「FTSE RAFI ヨーロッパ™戦略インデックス」の使用において得られる利益、およびインデックス値の水準について、保証することも、明示的または暗示的な約束をすることもありません。インデックスはFTSEまたは同社の代理人が算出しています。過失に由来するものであれ、その他いかなる原因によるものであれ、インデックスに影響を与えるいかなる誤りについて、誰に帰するものであれ、所有者は責任を負いません。また、その情報を提供する義務はありません。

「FTSE®」、「FT-SE®」、「Footsie®」はロンドン証券取引所Plcとフィナンシャル・タイムズ・リミテッドとの登録商標であり、FTSEインターナショナル・リミテッドによるライセンス供与に従って使用しています。「RAFI™」、「Research Affiliates™」はリサーチ・アフィリエイトLLCの所有する商標であり、FTSEによるライセンス供与に従って使用しています。

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、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・リプロケーション」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。