

リクソーETF コモディティーズ CRB (ロイター/ジェフリーズCRB) (2809.HK)

商品

2011年3月31日

EXCHANGE TRADED FUNDS BY
LYXOR
SOCIETE GENERALE GROUP

ETF (上場投資信託)

リクソーETF コモディティーズ CRB(ロイター/ジェフリーズCRB) (2809.HK)

「リクソーETF コモディティーズ CRB (ロイター/ジェフリーズCRB)」は、ジェフリーズとトムソン・ロイターが提供する「ロイター/ジェフリーズCRB指数」を通じ、19品目の商品市場への投資手段を提供します。当該商品指数は、50年にわたり商品市況の代表的な指数として知られています。現在は、エネルギー、貴金属、卑金属、および農・畜産物商品をカバーしています。(出所:ロイター、2011年3月31日現在)

投資目的

「リクソーETF コモディティーズ CRB (ロイター/ジェフリーズCRB)」は、「ロイター/ジェフリーズCRB指数」(ブルームバーグ・ティッカー:CRYTR)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3月31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962億ユーロ(*約11.3兆円)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=117.62円(WMロイター)、2011年3月31日現在。

ETFデータ

インデックス	ロイター/ジェフリーズCRB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1月26日
上場日(香港市場)	2007年4月26日
通貨	米ドル
取引通貨	香港ドル
最低取引単位	250口
管理報酬	0.35%(年率)
取引コスト	0.30%(年率)
分配金	N/A
1口当たり純資産価格	3.4471米ドル
運用資産額	1億2,755万米ドル
	出所:リクソーAM

コード

香港市場	2809
ISIN	FR0010414813
ロイター	2809.HK
ブルームバーグ	2809 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3月31日



年間パフォーマンス

2011 YTD	8.04%
2010	17.60%
2009	23.65%
2008	-35.04%
2007	22.15%

累積パフォーマンス

1年	31.69%
3年	-5.90%
5年	19.29%

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: jefferies.com、2011年3月31日

商品分類別

農・畜産物	41.00%
エネルギー	39.00%
卑金属	13.00%
貴金属	7.00%

取引所別

NYMEX	39.00%
NYBOT	21.00%
CBOT	13.00%
COMEX	13.00%
LME	7.00%
CME	7.00%

インデックス・データ

投資対象国・地域	世界
構成銘柄数	19
通貨	米ドル
ブルームバーグ	CRYTR
ロイター	.CRBTR

ロイター/ジェフリーズCRB指数は商品指数であり、取引所で取引されている各原商品の先物取引(ロング・ポジションのみ)のバスケットです。幅広い商品への投資機会を提供するため、同指数は様々な商品種類で構成されています。また、先物取引に付随する特別な対応(例えば、ロール・オーバーや現物決済など)の必要もありません。ロイター/ジェフリーズCRB指数の構築方法の詳細についてはwww.jefferies.com をご覧ください。

出所: jefferies.com、2011年3月31日

構成銘柄

WTI原油	(NYMEX)	23.00%
アルミニウム	(LME)	6.00%
銅	(COMEX)	6.00%
天然ガス	(NYMEX)	6.00%
金	(COMEX)	6.00%
トウモロコシ	(CBOT)	6.00%
大豆	(CBOT)	6.00%
生牛	(CME)	6.00%
暖房油	(NYMEX)	5.00%
BROBガソリン	(NYMEX)	5.00%
砂糖	(NYBOT)	5.00%
綿	(NYBOT)	5.00%
ココア	(NYBOT)	5.00%
コーヒー	(NYBOT)	5.00%
ニッケル	(LME)	1.00%
銀	(COMEX)	1.00%
小麦	(CBOT)	1.00%
豚赤身肉	(CME)	1.00%
オレンジジュース	(NYBOT)	1.00%

マンスリーレポート

Internet: www.lyxoretf.com.hk

電話: +852 2166 4266

Eメール: info@lyxoretf.com.hk

リクソーETF コモディティーズ CRB (ロイター/ジェフリーズCRB) (2809.HK)

EXCHANGE TRADED FUNDS BY
LYXOR
SOCIETE GENERALE GROUP

商品

2011年3月31日

当資料は、情報提供のみを目的としており、リクソーETFコモディティーズCRB(ロイター/ジェフリーズCRBインデックス)(「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、コモディティ市場におけるリスクを十分に理解するようご注意ください。コモディティ投資のパフォーマンスは市場の状況によって現物商品相場より大きくも小さくもなります。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。

トムソン・ロイターズ・アメリカ(「トムソン・ロイターズ」)、ジェフリーズ・ファイナンシャル・プロダクツ(「ジェフリーズ」)またはその子会社もしくは関連会社(集合的に「ライセンサー」)による商品へのスポンサー提供や保証、また販売促進は一切ありません。ライセンサーは、商品の所有者もしくは一般の誰に対しても、有価証券や一般的なコモディティ商品または特定の商品への投資の妥当性に関して、もしくはロイター/ジェフリーズCRB指数の一般的なコモディティ市況のパフォーマンスへの連動能力について、明示的または暗示的な表明および保証は致しません。ライセンサーの、ソシエテジェネラルやリクソー・インターナショナル・アセットマネジメント(「ライセンサー」)との関係は、ロイター/ジェフリーズCRB指数のライセンス供与のみであり、ライセンサーやその商品に関わらず、ライセンサーが決定、構成または計算したものです。ライセンサーは、ロイター/ジェフリーズCRB指数の決定、構成または計算の際に、ライセンサーや商品の保有者の要望を考慮に入れる義務はありません。

ライセンサーは、この商品の発行時期、発行価格や発行額の決定に関して、もしくはこの商品の換金時の計算方法の決定や算出に関して責任を負わず、関与もいたしません。

ライセンサーやその関係会社、それぞれの取締役、役員、従業員、または代理人は、取引口座の代理人もしくは第一債務者として、ここに言及もしくは考慮されている有価証券もしくはコモディティ商品の売買を行うことがあり、またロイター/ジェフリーズCRB指数に基づく、または連動させた取引を行うこと、もしくは関与することがあります。ライセンサーの取引活動がロイター/ジェフリーズCRB指数の価格に影響を与えることがあります。ロイター/ジェフリーズCRB指数の競合する他の指数に関する営業活動もしくは市場取引をライセンサーが行うことがあります。

ライセンサーは、ロイター/ジェフリーズCRB指数やその中に含まれるいかなるデータの性質、正確性、もしくは完全性について保証いたしません。ライセンサーは、商品の保有者であるライセンサーや、また他のいかなる人や組織がロイター/ジェフリーズCRB指数や下に定めるライセンス権利の使用に関連したいかなるデータを使用することによって得られる結果に関して、明示的、もしくは暗黙的な保証はいたしません。ライセンサーは、明示的または暗示的な保証はいたしません。またロイター/ジェフリーズCRB指数やそこに含まれる全データの使用目的を侵害しないこと、またその商慣習から生じる権利侵害がないことを保証することをここに明確に否定いたします。いかなる出来事においても、いかなる特別な懲罰的、間接的、偶発的、または結果的な損害(限度額の設定されない利益の損失を含む)について、こうした損害の可能性について報告を受けた場合においても、ライセンサーは法的責任を負いません。

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・リプリケーション」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。