

WTI原油価格連動型上場投信

追加型／海外／その他資産(商品先物)／ETF／インデックス型

ページ: 1/2

2017年6月30日 現在

ファンドの特色

WTI原油価格連動型上場投信(以下、「当ファンド」といいます。)は、対象指標※(以下に定義します。)に連動する投資成果を目的として、米国政府または国際機関の発行する有価証券および対象指標に関連した商品先物取引等を行い、対象指標の変動率に連動する投資成果を目指す追加型株式投資信託です。

※ 対象指標は、ニューヨーク商業取引所(以下「NYMEX」といいます。)におけるLight, Sweet Crude Oil Futures(以下「WTI原油先物」といいます。)の直近限月の清算値を円換算で表示した価格です。

WTI原油先物の価格は、1バレル当たり、米ドルで表示されます。

円換算には、原則として対顧客相場の仲値を用います。

なお、West Texas Intermediate 原油、通称 WTI 原油はNYMEX のLight, Sweet Crude Oil Futures の受渡供用品の代表的なものです。

【設定日】 2009年7月31日
【決算日】 年2回、毎年1月15日および7月15日
【信託期間】 無期限

【上場取引所】 東京証券取引所
【証券コード】 1671
【上場日】 2009年8月3日
【売買単位】 1口

運用状況

基準価額等の推移



【基準価額】 1,970 円
【純資産総額】 41,264 百万円

期間別騰落率
1か月騰落率 -9.13%
3か月騰落率 -12.87%
6か月騰落率 -24.69%
1年騰落率 -15.63%
3年騰落率 -71.88%
設定来騰落率(※) -67.31%

※ 設定来騰落率は2009年7月31日から直近までの騰落率です。

資産構成比
組入比率
外国債券 57.29%
原油先物 100.00%
実質原油先物比率 100.00%

※ 組入比率は、純資産総額に対するものです。

分配金の推移(税引前、1口当たり)

2010年1月期～2014年1月期までの合計 0.00 円
2014年7月期(2014年7月15日決算日) 0.00 円
2015年1月期(2015年1月15日決算日) 0.00 円
2015年7月期(2015年7月15日決算日) 0.00 円
2016年1月期(2016年1月15日決算日) 0.00 円
2016年7月期(2016年7月15日決算日) 0.00 円
2017年1月期(2017年1月15日決算日) 0.00 円

組入債券の格付別配分
組入比率
AAA 0.00%
AA+ 57.29%
A 0.00%
BBB以下 0.00%

※ 格付は、S&P社またはムーディーズ社のいずれかの格付機関の低い方の格付によります。

※ 上記は過去のものであり、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

平均デュレーション 0.4年

※ 期間別騰落率は、基準価額の騰落率です。投資家利回りとは異なります。

※ 基準価額は、計算において信託報酬等は控除されています。

※ 運用状況は、過去の実績を示したものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。

※ デュレーションは、債券の金利変化に対する価格感応度の指標として用いられます。

当資料は、シンプレス・アセット・マネジメント株式会社が作成した資料であり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。当資料は、信頼できると判断した情報に基づき作成されていますが、情報の正確性・完全性について弊社が保証するものではありません。当資料に掲載されている内容等は、当資料作成時点のものです。また、当資料に示された見解は、当資料作成時点における弊社の判断によるものです。当資料中のいかなる内容も、将来の市場環境等の変動を保証するものではありません。当資料中のいかなる内容も、将来の運用成果等を保証するものではありません。投資信託の受益権の基準価額は、投資信託に組入れられている有価証券等の特性による値動きにより影響や又、為替相場の変動等の影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資家の皆様に帰属します。従いまして、投資信託は元本が保証されるものではありません。また、投資成果を事前に保証するものではありません。投資信託をお申込みの際は、最新の投資信託説明書(交付目論見書)をあらかじめまたは同時にお渡しいたしますので、必ず、運用方針及びリスク要因等、手数料の合計、報酬等の内容をご確認のうえ、ご自身でご判断ください。投資信託説明書(交付目論見書)につきましては、販売会社にご請求下さい。投資信託は、預金保険機構及び保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、証券会社以外の登録金融機関で購入された投資信託は、投資者保護基金の支払対象にはなりません。投資信託は預貯金と異なります。

■当ファンドに係るリスクについて

当ファンドは、主に米国債等または国際機関の発行する債券等の公社債等や短期金融資産および商品等を投資対象としているため、また、外貨建資産に投資しますので、これら投資対象の価格変動および為替の変動の影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。したがって、投資家の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の変動により、損失を被り、投資元金が割り込むことがあります。投資信託は預貯金と異なります。当ファンドの基準価額の変動要因としては、主に「WTI原油先物価格の変動リスク」、「為替変動リスク」、「金利変動リスク」、「信用リスク」、「有価証券の貸付等におけるリスク」、「WTI原油先物取引の価格(円換算表示価格)と基準価額のかい離リスク」、「流動性リスク」などがあります。

以下のリスクは、投資信託説明書(交付目論見書)に記載するものの一部です。詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)をご参照ください。

◆WTI原油先物価格変動リスク

当ファンドは、基準価額の変動率がWTI原油先物直近限月清算値の円換算表示の変動率に連動する投資成果を目的として原油先物取引を活用しますので、原油先物価格の変動の影響を受けます。

原油先物の価格は、原油の生産・在庫・需要といった需給関係や天候、貿易動向、為替レート、金利、各国の政治・経済状況など様々な要因の影響を受けます。それらの要因等によって原油先物の価格が大幅に下落した場合、投資成果に重大な損失が生じることとなります。

◆為替変動リスク

当ファンドは、外貨建資産を保有するため、当該通貨と円との為替相場変動の影響を受け、損失が生じることがあります。

◆金利変動リスク

当ファンドは、米国債等または国際機関の発行する債券等の公社債等に投資します。一般に金利が上昇した場合には、債券価格は下落します。また、金利水準の大きな変動は株式市場に影響を及ぼす場合があり、当ファンドの基準価額の変動要因となります。

◆WTI原油先物取引の価格(円換算表示価格)と基準価額のかい離リスク

当ファンドは、原油先物取引を活用し、基準価額の変動率がWTI原油先物直近限月清算値の円換算表示の変動率に連動することを目指しますが、対象指標の変動率と完全に一致した運用成果をお約束するものではありません。また、対象指標と基準価額が一致することを保証することはできません。

例えば、原油先物取引には先物満期日(以下「限月」)があるため、投資する原油先物取引を異なる限月の取引に乗り換えていくこと(「ロールオーバー」といいます。)となります。このとき、投資している原油先物を売却し、乗り換え対象となる限月の原油先物を買付けることとなりますが、限月が異なるため2つの先物取引には元来価格差があります。それにより、WTI原油先物取引の価格と基準価額およびその変動率がかい離することがあります。また、資金の流入から実際に上場原油先物を買付けるためのタイミングのずれの発生、売買コストや信託報酬等のコスト負担などもかい離の要因となります。

■当ファンドに係る手数料等について

◆申込手数料

販売会社が独自に定める額とします。※詳しくは販売会社にてご確認ください。

◆解約手数料

販売会社が独自に定める額とします。※詳しくは販売会社にてご確認ください。

◆信託報酬

ファンドの純資産総額に年0.918%(税抜0.85%)の率を乗じて得た額とします。

◆信託財産留保額

当ファンドには信託財産留保額はありませぬ。

◆その他の費用

・ファンドの上場に係る費用*、信託財産に関する租税、信託事務等の諸費用、監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料等をファンドより実費として間接的にご負担いただきます。

(その他費用については、資産規模および運用状況等により、変動しますので、事前に料率、上限等の記載をしておりませぬ。)

*ファンドの上場に係る費用

・新規上場および追加上場料: 新規上場時の純資産総額に対して、及び追加上場時の増加額(毎年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額)に対して、0.0081%(税抜0.0075%)。

・上場の年賦課金: 毎年末の純資産総額に対して、0.0081%(税抜0.0075%)及びTDnet 利用料。

※当該手数料等の合計額につきましては、投資家の皆様が保有される期間等により異なりますので記載しておりませぬ。

※詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)の「手数料等及び税金」をご覧ください。

設定・運用は

シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第341号

加入協会 一般社団法人投資信託協会、一般社団法人日本投資顧問業協会

当資料は、シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社が作成した資料であり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。当資料は、信頼できると判断した情報に基づき作成されていますが、情報の正確性・完全性について弊社が保証するものではありません。当資料に掲載されている内容等は、当資料作成時点のもので、また、当資料に示された見解は、当資料作成時点における弊社の判断によるものです。当資料中のいかなる内容も、将来の市場環境等の変動を保証するものではありません。当資料中のいかなる内容も、将来の運用成果等を保証するものではありません。投資信託の受益権の基準価額は、投資信託に組入れられている有価証券等の特性による値動きにより影響や又、為替相場の変動等の影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資家の皆様に帰属します。従いまして、投資信託は元本が保証されるものではありません。また、投資成果を事前に保証するものではありません。投資信託をお申込みの際は、最新の投資信託説明書(交付目論見書)をあらかじめまたは同時にお渡しいたしますので、必ず、運用方針及びリスク要因等、手数料の合計、報酬等の内容をご確認のうえ、ご自身でご判断ください。投資信託説明書(交付目論見書)につきましては、販売会社にご請求下さい。投資信託は、預金保険機構及び保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、証券会社以外の登録金融機関で購入された投資信託は、投資者保護基金の支払対象にはなりません。投資信託は預貯金と異なります。