



平成 28 年 2 月 18 日

各 位

管理会社名:

バークレイズ・バンク・ピーエルシー

(管理会社コード: 20214)

代表者名:

デピュティ・グループ・ファイナンス・ディレクター
マーク・マーソン

(銘柄コード: 2023)

問合せ先:

バークレイズ証券株式会社

エクイティ・ファンド・ストラクチャード・マーケット本部
東 華七子

TEL 03-4530-1123

平成 27 年 10 月期 (平成 26 年 11 月 1 日～平成 27 年 10 月 31 日) 信託財産状況報告書

バークレイズ・バンク・ピーエルシーを発行者として上場する下記の ETN 銘柄について、信託財産状況報告書 (以下、「本報告書」といいます) を開示 (※注) 致します。

銘柄	銘柄コード	上場取引所
iPath® 産業用金属指数連動受益証券発行信託 (iメタル)	2023	東

※注

本報告書は、信託業法第 27 条第 1 項の規定に基づき、受託者たる三菱 UFJ 信託銀行株式会社が作成し、東京証券取引所の有価証券上場規程に定める上場外国指標連動証券信託受益証券の発行者たるバークレイズ・バンク・ピーエルシーが開示致します。

以 上

iPath® 産業用金属指数連動受益証券発行信託 信託財産状況報告書

信託契約第 28 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 5 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「iPath® 産業用金属指数連動受益証券発行信託」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
平成 27 年 10 月 31 日現在	
平成 26 年 11 月 1 日～平成 27 年 10 月 31 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	iPath® 産業用金属指数連動受益証券発行信託
銘柄コード	2023
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	パークレイズ証券株式会社
受託者	三菱UFJ信託銀行株式会社、日本マスタートラスト信託銀行株式会社
信託財産	本信託財産は、S&P GSCI®産業用メタル指数トータル・リターン（以下、「本指標」といいます。）に連動する債券（以下、「受託有価証券」といいます。）およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカスタディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

1、2040年満期 iPath® S&P GSCI®産業用メタル指数トータル・リターン連動債

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	2040年満期 iPath® S&P GSCI®産業用メタル指数トータル・リターン連動債
数量	100,000 (平成 27 年 10 月 31 日時点)
価格	352,009,033 円 (平成 27 年 10 月 31 日時点) (注 1)
一口あたりの価格	3,520 円 (平成 27 年 10 月 31 日時点) (注 2)
保管機関	受託者の指定するカスタディアン

注 1：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2、金銭

資産の種類	金銭
価格	0円（平成27年10月31日現在）

※ 上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
352,009,033円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況（自平成26年11月1日至平成27年10月31日）

1、信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数（単位：口）	金額（単位：千円）	口数（単位：口）	金額（単位：千円）
—	—	—	—

2、利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3、信託業務の委託の状況

信託業務(信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。)の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、三菱UFJグローバルカストディー ルクセンブルグに委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末（平成27年10月31日）現在
 （単位：千円）

資産の部		
固定資産		352,009
投資有価証券		352,009
固定資産合計		352,009
資産合計		
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		438,600
元本合計		438,600
留保金		
留保金合計		—
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		△86,590
評価・換算差額等合計		△86,590
元本等合計		352,009

< 損益計算書 (※1) >

当計算期間 (自 平成 26 年 11 月 1 日 至 平成 27 年 10 月 31 日)

(単位: 千円)

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

※1 本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第 19 条第 2 項に定める「収支計算書」を兼ねております。

※2 損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額 (単位: 円)
平成 26 年 11 月 28 日	4,645
平成 26 年 12 月 30 日	4,456
平成 27 年 1 月 30 日	4,145
平成 27 年 2 月 27 日	4,239
平成 27 年 3 月 31 日	4,247
平成 27 年 4 月 30 日	4,570
平成 27 年 5 月 29 日	4,363
平成 27 年 6 月 30 日	4,087
平成 27 年 7 月 31 日	3,849
平成 27 年 8 月 31 日	3,691
平成 27 年 9 月 30 日	3,596
平成 27 年 10 月 30 日	3,520