

平成27年12月期 決算短信（平成27年1月1日～平成27年12月31日）

平成28年4月28日

銘柄名	コード番号	連動対象指標	上場取引所	東京証券取引所	売買単位
			主要投資資産		
ETFS総合上場投資信託	1684	ブルームバーグ総合商品指数		(注1)	10
ETFSエネルギー上場投資信託	1685	ブルームバーグエネルギー商品指数	天然ガス、原油、ガソリン、灯油		10
ETFS産業用金属上場投資信託	1686	ブルームバーグ産業用金属商品指数	アルミニウム、銅、ニッケル、亜鉛		10
ETFS農産物上場投資信託	1687	ブルームバーグ農産物商品指数		(注2)	10
ETFS穀物上場投資信託	1688	ブルームバーグ穀物商品指数	小麦、とうもろこし、大豆		10
ETFS天然ガス上場投資信託	1689	ブルームバーグ天然ガス商品指数	天然ガス		100
ETFSWTI原油上場投資信託	1690	ブルームバーグ原油商品指数	WTI石油		10
ETFSガソリン上場投資信託	1691	ブルームバーグガソリン商品指数	ガソリン		1
ETFSアルミニウム上場投資信託	1692	ブルームバーグアルミニウム商品指数	アルミニウム		100
ETFS銅上場投資信託	1693	ブルームバーグ銅商品指数	銅		10
ETFSニッケル上場投資信託	1694	ブルームバーグニッケル商品指数	ニッケル		10
ETFS小麦上場投資信託	1695	ブルームバーグ小麦商品指数	小麦		100
ETFSとうもろこし上場投資信託	1696	ブルームバーグとうもろこし商品指数	とうもろこし		100
ETFS大豆上場投資信託	1697	ブルームバーグ大豆商品指数	大豆		10

(注1) 天然ガス、WTI原油、ブレンド原油、ガソリン、灯油、アルミニウム、銅、亜鉛、ニッケル、金、銀、生体牛、赤身豚肉、小麦、トウモロコシ、大豆、砂糖、綿花、コーヒー、大豆油

(注2) 小麦、トウモロコシ、大豆、砂糖、綿花、コーヒー、大豆油

外国投資法人 イーティーエフエス・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド
 代表者名 ジョゼフ・ロクスバーグ
 管理会社 ETFセキュリティーズ・マネジメント・カンパニー・リミテッド
 URL <http://www.etfsecurities.com/ETFSDocs/APDocuments.aspx>
 代表者名 ジョゼフ・ロクスバーグ
 問合せ先責任者 森・濱田松本法律事務所（大西信治） TEL 03-6212-8316
 有価証券報告書提出予定日 平成28年6月30日提出
 分配金支払い開始予定日 該当なし

I ファンドの運用状況

1. 2015年12月決算期の運用状況（平成27年1月1日～平成27年12月31日）

(1) 資産内訳

（百万円未満切捨て）

		主要投資資産		合計（資産）	
		金額	構成比	金額	構成比
ETFS総合上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 25,773	% (100)	百万円 25,773	% (100)
	2014年12月決算期	37,789	(100)	37,789	(100)
ETFSエネルギー上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 16,126	% (100)	百万円 16,126	% (100)
	2014年12月決算期	13,577	(100)	13,577	(100)
ETFS産業用金属上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 9,623	% (100)	百万円 9,623	% (100)
	2014年12月決算期	19,077	(100)	19,077	(100)
ETFS農産物上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 26,735	% (100)	百万円 26,735	% (100)
	2014年12月決算期	41,201	(100)	41,201	(100)
ETFS穀物上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 3,545	% (100)	百万円 3,545	% (100)
	2014年12月決算期	3,961	(100)	3,961	(100)
ETFS天然ガス上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 6,571	% (100)	百万円 6,571	% (100)
	2014年12月決算期	8,501	(100)	8,501	(100)
ETFSWTI原油上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 71,230	% (100)	百万円 71,230	% (100)
	2014年12月決算期	20,666	(100)	20,666	(100)
ETFSガソリン上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 1,125	% (100)	百万円 1,125	% (100)
	2014年12月決算期	643	(100)	643	(100)
ETFSアルミニウム上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 9,618	% (100)	百万円 9,618	% (100)
	2014年12月決算期	11,557	(100)	11,557	(100)
ETFS銅上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 8,483	% (100)	百万円 8,483	% (100)
	2014年12月決算期	23,448	(100)	23,448	(100)
ETFSニッケル上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 9,115	% (100)	百万円 9,115	% (100)
	2014年12月決算期	18,355	(100)	18,355	(100)
ETFS小麦上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 6,420	% (100)	百万円 6,420	% (100)
	2014年12月決算期	9,703	(100)	9,703	(100)
ETFSとうもろこし上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 3,191	% (100)	百万円 3,191	% (100)
	2014年12月決算期	4,829	(100)	4,829	(100)
ETFS大豆上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 846	% (100)	百万円 846	% (100)
	2014年12月決算期	1,989	(100)	1,989	(100)

（注1）主要投資資産は、平成28年4月1日午前零時（ロンドン時間2016年3月31日午後4時）現在のものとしてブルームバーグによって表示される為替レート（スポット・レート）（1米ドル=112.39円）に基づいて円換算しています。（以下同じ）

(2) 設定・償還実績

		前営業期間末 発行済口数 (①)	設定口数 (②)	償還口数 (③)	当営業期間末 発行済口数 (①+②-③)
		千口	千口	千口	千口
ETFS総合上場投資信託	2015年12月決算期	31,248	15,527	17,975	28,800
	2014年12月決算期	28,407	19,679	16,839	31,248
ETFSエネルギー上場投資信託	2015年12月決算期	20,597	57,990	37,212	41,375
	2014年12月決算期	18,102	8,528	6,032	20,597
ETFS産業用金属上場投資信託	2015年12月決算期	13,783	16,701	20,866	9,618
	2014年12月決算期	12,817	14,671	13,705	13,783
ETFS農産物上場投資信託	2015年12月決算期	57,937	34,236	46,502	45,670
	2014年12月決算期	59,935	26,187	28,186	57,937
ETFS穀物上場投資信託	2015年12月決算期	6,953	4,397	3,433	7,917
	2014年12月決算期	4,672	5,610	3,329	6,953
ETFS天然ガス上場投資信託	2015年12月決算期	861,982	1,903,302	1,581,589	1,183,694
	2014年12月決算期	1,135,204	316,746	589,969	861,982
ETFSWTI原油上場投資信託	2015年12月決算期	17,502	133,416	68,248	82,671
	2014年12月決算期	7,456	17,870	7,824	17,502
ETFSガソリン上場投資信託	2015年12月決算期	199	908	706	400
	2014年12月決算期	263	249	313	199
ETFSアルミニウム上場投資信託	2015年12月決算期	31,134	50,603	47,923	33,813
	2014年12月決算期	11,833	87,962	68,661	31,134
ETFS銅上場投資信託	2015年12月決算期	7,214	8,366	12,033	3,547
	2014年12月決算期	7,158	13,305	13,249	7,214
ETFSニッケル上場投資信託	2015年12月決算期	10,268	6,360	7,641	8,987
	2014年12月決算期	3,122	12,486	5,340	10,268
ETFS小麦上場投資信託	2015年12月決算期	71,088	80,623	89,381	62,330
	2014年12月決算期	46,927	87,172	63,010	71,088
ETFSとうもろこし上場投資信託	2015年12月決算期	30,894	25,880	30,737	26,036
	2014年12月決算期	12,706	54,636	36,448	30,894
ETFS大豆上場投資信託	2015年12月決算期	749	374	742	381
	2014年12月決算期	685	937	873	749

(注1) 上記の設定・償還実績については、営業期末時点の未決済上場投信を含んでいません。

(3) 基準価額

		総資産	負債 (注)	資産	売買単位当たり基準価額 ((資産/当営業期間末 発行済口数) × 売買単位)
ETFS総合上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 25,773	百万円 -	百万円 25,773	円 8,949
	2014年12月決算期	37,789	-	37,789	12,093
ETFSエネルギー上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 16,126	百万円 -	百万円 16,126	円 3,897
	2014年12月決算期	13,577	-	13,577	6,591
ETFS産業用金属上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 9,623	百万円 -	百万円 9,623	円 10,006
	2014年12月決算期	19,077	-	19,077	13,840
ETFS農産物上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 26,735	百万円 -	百万円 26,735	円 5,854
	2014年12月決算期	41,201	-	41,201	7,111
ETFS穀物上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 3,545	百万円 -	百万円 3,545	円 44,787
	2014年12月決算期	3,961	-	3,961	56,981
ETFS天然ガス上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 6,571	百万円 -	百万円 6,571	円 555
	2014年12月決算期	8,501	-	8,501	986
ETFSWTI原油上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 71,230	百万円 -	百万円 71,230	円 8,616
	2014年12月決算期	20,666	-	20,666	11,807
ETFSガソリン上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 1,125	百万円 -	百万円 1,125	円 2,806
	2014年12月決算期	643	-	643	3,231
ETFSアルミニウム上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 9,618	百万円 -	百万円 9,618	円 28,445
	2014年12月決算期	11,557	-	11,557	37,122
ETFS銅上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 8,483	百万円 -	百万円 8,483	円 23,916
	2014年12月決算期	23,448	-	23,448	32,503
ETFSニッケル上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 9,115	百万円 -	百万円 9,115	円 10,142
	2014年12月決算期	18,355	-	18,355	17,875
ETFS小麦上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 6,420	百万円 -	百万円 6,420	円 10,300
	2014年12月決算期	9,703	-	9,703	13,649
ETFSとうもろこし上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 3,191	百万円 -	百万円 3,191	円 12,256
	2014年12月決算期	4,829	-	4,829	15,633
ETFS大豆上場投資信託	2015年12月決算期	百万円 846	百万円 -	百万円 846	円 22,197
	2014年12月決算期	1,989	-	1,989	26,557

(注1) 売買単位は、ガソリンについては1口、総合商品指数、エネルギー商品指数、産業用金属商品指数、農産物商品指数、原油、銅、ニッケル及び大豆については10口、穀物商品指数、天然ガス、アルミニウム、小麦及びとうもろこしについては100口となります。

(注2) 商品上場投資信託1単位当たりの資産は、商品上場投資信託1単位当たりの基準価額に基づいたものとなります。商品上場投資信託1単位当たりの基準価額は、相応する商品上場投資信託1単位当たりの商品契約の価格に相当するものとなります。各々の商品上場投資信託の裏付けとなっている商品契約の総価値は、相応する商品上場投資信託の残高と等しくなります。このために、純資産額は零となり、総資産額は、商品上場投資信託の裏付けとなる商品契約の総額と等しくなります。

[参考] 外国投資法人の財政状態

	総資産額	総負債額	投資主持分額
	百万円	百万円	百万円
2015年12月決算期	321,035	318,034	3,001
2014年12月決算期	367,717	371,382	-3,665

(注1) 商品上場投資信託は、期限の定めのない、請求権の限定されている発行体による債務です。全出資口は、親会社であるイーティーエフ・セキュリティーズ・リミテッドにより保有されています。投資主持分額は、総資産額から総負債額を差し引いたものです。

2. 会計方針の変更

① 会計基準等の改正に伴う変更 有・無

② ①以外の変更 有・無