

平成29年12月期 中間決算短信（平成29年1月1日～平成29年6月30日）

平成29年9月5日

銘柄名	コード番号	連動対象指標	上場取引所 主要投資資産	東京証券取引所 売買単位
ETFS総合上場投資信託 (注1)	1684	ブルームバーグ総合商品指数 (注1)	(注2)	10
ETFSエネルギー上場投資信託(注1)	1685	ブルームバーグエネルギー商品 指数(注1)	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(注1)	1686	ブルームバーグ産業用金属商品 指数(注1)	アルミニウム、銅、 ニッケル、亜鉛	10
ETFS農産物上場投資信託(注1)	1687	ブルームバーグ農産物商品指数 (注1)	(注3)	10
ETFS穀物上場投資信託 (注1)	1688	ブルームバーグ穀物商品指数 (注1)	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(注1)	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 (注1)	WTI原油	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(注1)	ガソリン	10
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(注1)	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(注1)	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(注1)	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 (注1)	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(注1)	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 (注1)	大豆	10

(注1) 平成26年7月1日より、連動対象指標をDJ-UBSCI提供のものからブルームバーグ提供のものに変更し、併せて銘柄名を変更しました。

(注2) 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3) 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 イーディーエフエス・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド

代表者名 グラハム・タックウエル

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 グラハム・タックウエル

問合せ先責任者 TMI 総合法律事務所 (中川秀宣) TEL 03-6438-5660

有価証券報告書提出予定日 平成28年9月29日提出(予定)

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. 2017年6月中間決算期の運用状況（平成29年1月1日～平成29年6月30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 (注1)	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	35,873	(100)	35,873	(100)
ETFSエネルギー上場投資信託(注1)	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	6,618	(100)	6,618	(100)
ETFS産業用金属上場投資信託(注1)	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	32,438	(100)	32,438	(100)
ETFS農産物上場投資信託(注1)	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	23,245	(100)	23,245	(100)
ETFS穀物上場投資信託 (注1)	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	2,793	(100)	2,793	(100)
ETFS天然ガス上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	3,431	(100)	3,431	(100)
ETFSWTI原油上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	5,319	(100)	5,319	(100)
ETFSガンリン上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	6,499	(100)	6,499	(100)
ETFSアルミニウム上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	102,987	(100)	102,987	(100)
ETFS銅上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	80,757	(100)	80,757	(100)
ETFSニッケル上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	587	(100)	587	(100)
ETFS小麦上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	662	(100)	662	(100)
ETFSとうもろこし上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	12,503	(100)	12,503	(100)
ETFS大豆上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	7,240	(100)	7,240	(100)
ETFSとうもろこし上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	31,897	(100)	31,897	(100)
ETFSとうもろこし上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	14,816	(100)	14,816	(100)
ETFSとうもろこし上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	12,846	(100)	12,846	(100)
ETFSとうもろこし上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	10,061	(100)	10,061	(100)
ETFSとうもろこし上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	11,409	(100)	11,409	(100)
ETFSとうもろこし上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	7,716	(100)	7,716	(100)
ETFSとうもろこし上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	4,703	(100)	4,703	(100)
ETFSとうもろこし上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	3,298	(100)	3,298	(100)
ETFSとうもろこし上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	1,057	(100)	1,057	(100)
ETFSとうもろこし上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円	%	百万円	%
	2016年6月 中間決算期	734	(100)	734	(100)

(注1) 平成26年7月1日より、連動対象指標をDJ-UBSCI提供のものからブルームバーグ提供のものに変更し、併せて銘柄名を変更しました。

(注2) 主要投資資産は、平成29年7月1日午前零時（ロンドン時間2017年6月30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=112.33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 (注1)	2017年6月中間決算期	43,990	17,580	22,841	38,728
	2016年6月中間決算期	28,800	16,966	8,106	37,660
ETFSエネルギー上場投資信託(注1)	2017年6月中間決算期	21,496	13,772	16,734	18,533
	2016年6月中間決算期	41,375	11,986	16,014	37,346
ETFS産業用金属上場投資信託(注1)	2017年6月中間決算期	18,119	19,415	11,476	26,058
	2016年6月中間決算期	9,618	6,003	5,874	9,747
ETFS農産物上場投資信託(注1)	2017年6月中間決算期	41,658	14,022	14,108	41,573
	2016年6月中間決算期	45,670	10,509	12,183	43,996
ETFS穀物上場投資信託(注1)	2017年6月中間決算期	9,617	2,075	5,040	6,653
	2016年6月中間決算期	7,917	533	1,231	7,219
ETFS天然ガス上場投資信託	2017年6月中間決算期	1,069,024	571,818	446,425	1,194,417
	2016年6月中間決算期	1,183,694	458,714	481,714	1,160,694
ETFSWTI原油上場投資信託	2017年6月中間決算期	99,899	96,891	58,395	138,394
	2016年6月中間決算期	82,671	71,942	67,704	86,909
ETFSガソリン上場投資信託	2017年6月中間決算期	215	294	258	252
	2016年6月中間決算期	400	505	652	253
ETFSアルミニウム上場投資信託	2017年6月中間決算期	33,526	20,675	17,439	36,763
	2016年6月中間決算期	33,813	8,115	18,037	23,891
ETFS銅上場投資信託	2017年6月中間決算期	7,247	6,887	3,157	10,976
	2016年6月中間決算期	3,547	7,365	4,814	6,098
ETFSニッケル上場投資信託	2017年6月中間決算期	9,974	7,415	4,980	12,409
	2016年6月中間決算期	8,987	2,433	2,022	9,398
ETFS小麦上場投資信託	2017年6月中間決算期	129,663	58,936	60,992	127,607
	2016年6月中間決算期	62,330	42,685	21,847	83,168
ETFSとうもろこし上場投資信託	2017年6月中間決算期	39,349	16,454	13,074	42,729
	2016年6月中間決算期	26,036	8,537	7,857	26,716
ETFS大豆上場投資信託	2017年6月中間決算期	642	319	491	470
	2016年6月中間決算期	381	171	292	260

(注1) 平成26年7月1日より、連動対象指標をDJ-UBSCI提供のものからブルームバーグ提供のものに変更し、併せて銘柄名を変更しました。

(注2) 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 ((③/当営業期間末 発行済口数) × 売買単位)
ETFS総合上場投資 信託 (注1)	2017年6月 中間決算期	百万円 35,873	百万円 -	百万円 35,873	円 9,262
	2016年6月 中間決算期	38,050	-	38,050	10,103
ETFSエネルギー上 場投資信託(注1)	2017年6月 中間決算期	百万円 6,618	百万円 -	百万円 6,618	円 3,570
	2016年6月 中間決算期	16,100	-	16,100	4,311
ETFS産業用金属上 場投資信託(注1)	2017年6月 中間決算期	百万円 32,438	百万円 -	百万円 32,438	円 12,448
	2016年6月 中間決算期	10,473	-	10,473	10,743
ETFS農産物上場投 資信託(注1)	2017年6月 中間決算期	百万円 23,245	百万円 -	百万円 23,245	円 5,591
	2016年6月 中間決算期	28,885	-	28,885	6,565
ETFS穀物上場投資 信託 (注1)	2017年6月 中間決算期	百万円 2,793	百万円 -	百万円 2,793	円 41,981
	2016年6月 中間決算期	3,431	-	3,431	47,530
ETFS天然ガス上場 投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円 5,319	百万円 -	百万円 5,319	円 445
	2016年6月 中間決算期	6,499	-	6,499	559
ETFSWTI原油上場 投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円 102,987	百万円 -	百万円 102,987	円 7,441
	2016年6月 中間決算期	80,757	-	80,757	9,292
ETFSガソリン上場 投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円 587	百万円 -	百万円 587	円 23,322
	2016年6月 中間決算期	662	-	662	26,081
ETFSアルミニウム 上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円 12,503	百万円 -	百万円 12,503	円 34,012
	2016年6月 中間決算期	7,240	-	7,240	30,305
ETFS銅上場投資信 託	2017年6月 中間決算期	百万円 31,897	百万円 -	百万円 31,897	円 29,058
	2016年6月 中間決算期	14,816	-	14,816	24,293
ETFSニッケル上場 投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円 12,846	百万円 -	百万円 12,846	円 10,351
	2016年6月 中間決算期	10,061	-	10,061	10,705
ETFS小麦上場投資 信託	2017年6月 中間決算期	百万円 11,409	百万円 -	百万円 11,409	円 8,941
	2016年6月 中間決算期	7,716	-	7,716	9,278
ETFSとうもろこし 上場投資信託	2017年6月 中間決算期	百万円 4,703	百万円 -	百万円 4,703	円 11,007
	2016年6月 中間決算期	3,298	-	3,298	12,344
ETFS大豆上場投資 信託	2017年6月 中間決算期	百万円 1,057	百万円 -	百万円 1,057	円 22,462
	2016年6月 中間決算期	734	-	734	28,199

(注1) 平成26年7月1日より、連動対象指標をDJ-UBSCI提供のものからブルームバーグ提供のものに変更し、併せて銘柄名を変更しました。

(注2) 売買単位は、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、ガソリン、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3) 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
2017年6月中間決算期	423,028	419,335	3,693
2016年6月中間決算期	363,462	364,482	-1,019

(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