

外国証券内容説明書

楽天証券株式会社
2007/12/27 更新

第一部 証券情報

ティッカー（証券コード）		GSG	
(1) ファンドの名称	iSHARES S&P GSCI COMMODITY INDEXED TRUST		
	ファンドの名称（カナ）	iシェアーズ・S&P GSCI・コモディティ・インデックス・トラスト	
(2) ファンドの形態等	オープンエンド型の投資信託		
(3) 発行地	米国		
(4) 発行日	2006年7月10日		
(5) 発行数及び発行総額	発行数	4,700,000（口）	2007年4月30日現在
	発行総額	197,270,000(米ドル)	2007年4月30日現在
(6) 売買単位	最低取引単位：1口		
(7) 主たる上場取引所又は登録金融商品取引業協会の名称	ニューヨーク証券取引所 Arca		

当社でのお申込みは、買いの場合10口以上10口単位、売りの場合1口以上1口単位といたします。

第二部 発行者情報

(1) ファンドに係る法制度の概要	デラウェア州法、1933年証券法、1934年証券取引法		
(2) ファンドの目的及び基本的性格	S&P GSCI トータルリターン指数の価格と利回りに連動する投資結果を提供		
(3) 管理会社又は運用会社の自己資本の額	N/A		
(4) ファンドの関係法人の概要	管理（運用）会社	名称	パークレイズ・グローバル・インベスターズ・インターナショナル・インク BARCLAYS GLOBAL INVESTORS INTERNATIONAL INC
		関係業務	当該ファンドの運用等
	受託者	名称	パークレイズ・グローバル・インベスターズ・エヌエイ BARCLAYS GLOBAL INVESTORS N.A.
		関係業務	カストディ業務、名義書換代理人業務、アドミニストレータ業務、事務代行業務
(5) 投資の基本方針	投資プールにより受領された証拠金として利用された資産についての利息および分配は追加的にCERF（ ）を取得するために利用されるか、または、運用会社の裁量により、受益者に分配されます。運用会社は、受益者に対して定期的に分配を行う義務を負いません。 当ファンドは、当指数の価格及び利回りの実績に対応する投資実績をあげることを目標としています。		
(6) 投資制限	1940年投資会社法による制限		
(7) ファンド資産の管理の概要及びその報酬	純資産価額の年率0.75%		

CERF CME（シカゴ商品取引所）に上場されている先物取引契約で上場後約5年満期の、契約終了時における決済がS&P GSCI Excess Return Indexの当該時点での価額を基礎とするもの

(8) ファンドの運用状況

単位：米ドル

投資状況		2006年12月31日現在	
投資有価証券	2006年	投資有価証券の明細は、投資有価証券明細票を参照	
	143,425,669		
運用実績			
純資産額の推移	2006年 2006年12月31日現在	2005年 2005年12月31日現在	
	純資産総額	143,425,669	N/A
	1口当たり純資産総額	39.84	N/A
配当(分配)状況	2006年 2006年7月～2006年12月	2005年 2005年1月～2005年12月	
	1口当たり分配金	N/A	N/A

(9) ファンドの経理状況

単位：米ドル

直近2計算期間の貸借対照表		2006年 2006年12月31日現在	2005年 2005年12月31日現在
	総資産	143,425,669	N/A
	負債	0	N/A
直近2計算期間の損益計算書		2006年 2006年7月～2006年12月	2006年 2005年1月～2005年12月
	投資収益	1,713,414	N/A
	純投資収益	1,462,513	N/A

N/A：現地非開示である

備考

米国会計基準に準拠

直近計算期間の投資有価証券明細票

◎直近計算期間の投資有価証券明細票

S&P GSCI™ Commodity-Indexed Investing Pool's Holdings

Futures - as of 12/29/2006

% Net Assets	Name	Bloomberg Ticker	Market	Maturity	Market Price	Contracts Held	Contract Size	Notional Value of Contracts
99.89%	GSCI Excess Return	BBH1	Chicago Mercantile Exchange	2011/3/11	586.5	2,443	100	143,281,950.00

Collateral & Cash - as of 12/29/2006

% Net Assets	Name	Coupon	Date of Maturity	Security CUSIP	S&P Rating	Moody's Rating	Security Price	Security Market Value (par*price/100)	Security Par Value	Effective Duration	Yield to Maturity
0.06%	IBT CASH DEP ACCT	5	2007/1/2	2402208A3	NR	NR	100	83,656	83,656	0.01	5
13.79%	UNITED STATES TREASURY BILL	0	2007/1/4	912795YM7	TSY	TSY	99.93	19,781,395	19,795,000	0.01	4.95
22.54%	UNITED STATES TREASURY BILL	0	2007/2/8	912795YS4	TSY	TSY	99.45	32,338,444	32,517,000	0.11	5.1
28.71%	UNITED STATES TREASURY BILL	0	2007/3/8	912795YW5	TSY	TSY	99.09	41,190,333	41,568,000	0.19	4.78
14.09%	UNITED STATES TREASURY BILL	0	2007/4/12	912795ZB0	TSY	TSY	98.59	20,209,962	20,500,000	0.28	5.02
21.73%	UNITED STATES TREASURY BILL	0	2007/5/24	912795ZH7	TSY	TSY	98.04	31,168,351	31,790,000	0.39	4.95

当該証券については我が国の金融商品取引法に基づいた発行者開示は行われていません。
 本説明書は、日本証券業協会による「外国証券の取引に関する規則」に従って作成したものであり、当該証券に関する詳細かつ完全な情報が記載されているものではありません。
 株価の下落や発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により、損失を被ることがあります。さらに為替相場の変動により、損失を被ることがあります。
 本説明書は目論見書、年次報告書などに基づいて作成するため、記載された決算期が直近に終了した決算期より古い場合や、年次報告書などがリリースされた後の決算数字修正を反映していない場合がありますので、ご了承ください。