

東穀商品別指数(TG Sub-Index)の公表について

平成 21 年 4 月 24 日

東京穀物商品取引所(以下「東穀」という。)は、平成 21 年 4 月 27 日(月)より、「東穀商品別指数(TG Sub-Index)」を公表します。

TG Sub-Index は、特定の銘柄の農産物先物契約に対して、一定の金額を継続的に投資した結果得られるエクセス・リターン(価格水準の変動から生じるスポット・リターンに限月のロール・オーバーに伴い発生するロール・リターンを加えたもの)の変動をトラックする農産物指数です。

東穀は、様々な金融商品の基礎となりうる指数として、金融機関等において商品別指数に対するニーズが高いことに加え、今般の商品取引所法の改正により、商品別指数の上場が可能となる見込みであることを踏まえ、TG Index と同様に、農産物投資における長期的な運用パフォーマンスを図るベンチマークに資する目的で、TG Sub-Index を公表することとしました。

TG Sub-Index は、TG Index の構成銘柄のうち、以下の 8 銘柄について、銘柄別に算出します。なお、いずれの TG Sub-Index も、構成銘柄を 1 銘柄(配分比率 100%)とすることを除いて、対象限月、限月のロール・オーバー、計算方法、基準日、基準値、指数年度、公表方法および公表時間は、TG Index に準じます。なお、TG Index の構成銘柄のうち、コメと小麦については、東穀において上場が実現するまでの間、指数計算の基礎となる価格として、アメリカのシカゴ市場におけるドル建て先物価格に為替を乗じた円換算価格を用いていますが、プレート等の要素が織り込まれていません。したがって、コメと小麦については、実際に上場が実現し、その価格に生産地価格、プレート、為替などの諸要素が全て織り込まれるようになった後に TG Sub-Index を公表することとします。

TG Sub-Index の銘柄別の名称、構成銘柄及び上場市場

名称	構成銘柄	上場市場
東穀とうもろこし指数 (TG Corn Index)	とうもろこし	東京穀物商品取引所
東穀一般大豆指数 (TG Soybean Index)	一般大豆	東京穀物商品取引所
東穀 Non-GMO 大豆指数 (TG Non-GMO Soybean Index)	Non-GMO 大豆	東京穀物商品取引所
東穀小豆指数 (TG Azuki Index)	小豆	東京穀物商品取引所
東穀アラビカコーヒー指数 (TG Arabica Coffee Index)	アラビカコーヒー生豆	東京穀物商品取引所
東穀ロブスタコーヒー指数 (TG Robusta Coffee Index)	ロブスタコーヒー生豆	東京穀物商品取引所
東穀粗糖指数 (TG Raw Sugar Index)	粗糖	東京穀物商品取引所
東穀生糸指数 (TG Raw Silk Index)	生糸	東京穀物商品取引所

お問合せは： 東京穀物商品取引所/営業広報部広報課
tel:03-3668-9318