

平成25年7月24日
株式会社 中国銀行

国内初の世界銀行日経平均株価連動デジタルクーポン円建債券の販売について

当行では、世界銀行（国際復興開発銀行）が発行する日経平均株価連動デジタルクーポン円建債券の公募売出しを平成25年7月25日より金融商品仲介業務で取扱いいたします。日本の投資家向け世界銀行の日経平均株価連動デジタルクーポン円建債券の発行は、国内で初の取扱いとなります。

1. 売出期間

平成25年7月25日（木）から平成25年8月1日（木）

2. 委託金融商品取引業者

中銀証券株式会社

3. 販売形態

金融商品仲介口座による窓口での販売

4. 取扱店

金融商品仲介業務取扱店舗（平成25年7月24日現在153か店）

5. 取扱商品

国際復興開発銀行（世界銀行）2018年8月2日満期
期限前償還条項付 日経平均株価連動デジタルクーポン円建債券

6. 商品概要

| | |
|-------|--|
| 商品名 | 期限前償還条項付 日経平均株価連動デジタルクーポン円建債券 |
| 発行通貨 | 円 |
| 発行者 | 国際復興開発銀行（世界銀行） |
| 発行者格付 | Aaa（Moody's） / AAA（S&P） |
| 申込単位 | 100万円以上、100万円単位 |
| 発行日 | 平成25年8月1日 |
| 満期償還日 | 平成30年8月2日（投資期間：最短約3か月、最長約5年） |
| 償還方法 | 【期限前償還】 期限前償還判定日における判定価格が期限前償還判定水準以上である場合、直後の利払日に額面金額の100%で償還される。 【満期償還】 (1)ノックイン事由が発生しなかった場合 額面の100%で償還される。 (2)ノックイン事由が発生した場合 ・最終判定価格が当初価格以上の場合 |

| | |
|-----------|--|
| | <p>額面の100%で償還される。</p> <p>・最終判定価格が当初価格未満の場合は下記の算式にて計算した金額で償還される。</p> <p><u>満期償還金額 = 額面金額 × (最終判定価格 ÷ 当初価格)</u></p> <p>ただし、満期償還額が額面金額を上回ることはありません。</p> |
| 利払日 | 年4回(初回利払日を平成25年11月2日として、以降毎年2月、5月、8月、11月の各2日および満期償還日) |
| 利率 | <p>【当初約3か月】(固定)</p> <p>年率：2.50%～4.00%(仮条件、税引前)</p> <p>【以降約4年9か月】(変動)</p> <p>・ハイクーポン：年率2.50%～4.00%(仮条件、税引前)</p> <p>判定価格 利率判定水準の場合</p> <p>・ロークーポン：年率1.00%(税引前)</p> <p>判定価格 < 利率判定水準の場合</p> <p>30/360ベース</p> |
| ロックイン事由 | 観測期間において、日経平均株価の終値が一度でもロックイン判定水準未満となった場合 |
| 観測期間 | 平成25年8月5日から最終判定日まで(終値のみ観測) |
| 当初価格 | 平成25年8月2日における日経平均株価の終値 |
| 判定価格 | 各判定日における日経平均株価の終値 |
| 判定日 | 各利払日の10予定取引日前の日 |
| 期限前償還判定日 | 各利払日の10予定取引日前の日 |
| 最終判定価格 | 最終判定日における日経平均株価の終値 |
| 最終判定日 | 平成30年7月19日 |
| 期限前償還判定水準 | 当初価格 × 110% (小数点第3位四捨五入) |
| 利率判定水準 | 当初価格 × 85% (小数点第3位四捨五入) |
| ロックイン判定水準 | 当初価格 × 65% (小数点第3位四捨五入) |

7. 世界銀行とは

世界銀行とは、1945年に設立された国際機関です。世界銀行は中所得国および信用力のある貧困国に融資、保証および分析・助言サービスなどの非融資業務を提供し、持続可能な開発を促進することで、これらの国の貧困を削減することを目指しています。

また、資本市場からもっとも高い評価を受けている国際機関の一つで、世界各国の資本市場で債券発行の実績があります。世界銀行の正式名称は国際復興開発銀行ですが、一般的には世銀、債券は世銀債の名称で知られています。

以上

金融商品仲介業務取扱商品についての注意事項

- ・金融商品仲介業務の取扱商品は預金ではなく、預金保険の対象ではありません。ただし、証券取引口座でお取引いただく有価証券は、委託金融商品取引業者にて分別保管され、投資者保護基金の対象となります。
- ・金融商品仲介業務でおこなうお取引は、委託金融商品取引業者が執行するものであり、当行が執行するものではありません。
- ・お客様の属性および取引関係の情報は、業務遂行の目的以外には使用されないことを条件として、お客様が口座開設される委託金融商品取引業者と当行が共有することになります。
- ・金融商品仲介業務の取扱商品においては、株式・債券・商品など（外貨建てを含みます）の価格の変動をともなう金融商品に投資するため、各市場の変動により投資元本を割込むことがあります。したがって、元本が保証されているものではありません。主なりリスクとしては、価格変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性リスク等があります。
- ・金融商品仲介業務の取扱商品には、最大1.365%（消費税等を含みます）の株式売買委託手数料（最低手数料の設定があります）、最大1通貨単位あたり2円の外国為替手数料、また投資信託手数料として、最大3.675%（消費税等を含みます）のお申込み手数料、最大年率2.5%程度（消費税等を含みます）の運用管理費用（信託報酬）、基準価額の最大1.0%（消費税等を含みます）の信託財産留保額、その他の費用（信託事務処理費用など）がかかります。

本債券についての注意事項

- ・本債券を購入する場合には、購入手数料のみをお支払いいただきます。
- ・本債券の売買はクーリング・オフの対象になりません。
- ・本債券への投資をお考えの際には、以下の主なりリスク要因をご検討ください。以下のリスクの説明は販売説明書の記載内容の一部をわかりやすく表現したものです。詳細は販売説明書にてご確認ください。

元本リスク：本債券の満期償還金額は、観測期間中に日経平均株価があらかじめ定められた水準（ロックイン判定水準）未満となった場合、償還時の日経平均株価の水準によっては、投資元本を割込むことがあります。その結果、損失が発生する可能性があります。

価格下落リスク：本債券の価格は、日経平均株価の下落、市場金利の上昇、日経平均株価の予想変動率の上昇などにより、購入価格を下回り損失が生じるおそれがあります。

信用リスク：本債券の発行者または信用保証者等の経営・財務の状況の変化および信用状況の変化などにより投資元本を割込むことがあります。

流動性リスク：本債券は、金利・株式デリバティブ等を内包して組成された仕組債であり、国内において活発な流通市場は確立されておらず、一般の債券に比して流動性（換金性）が劣ります。本債券は、ご購入直後でも評価・算定価格が購入価格を大幅に下回る場合があります。最終償還前に売却する場合は、多額の解約コストがかかることが予想され、実際の売却価格が発行コストで計算された評価・算定価格以下になり、投資元本を大幅に割込む場合があります。また、中途売却時には低い流動性（換金性）により売却価格の提示がすぐにできない場合や、売却ができなくなるおそれがあります。

したがって、本債券に投資しようとする投資家は、最終償還日まで本債券を保有することを前提にご検討ください。

利率低下リスク：本債券は将来の利率が日経平均株価の水準によって変動する条項が付されています。したがって、日経平均株価が下落した場合には低い利率が適用されるリスクがあります。

制度変更リスク：将来において、本債券について税制、会計ルール等の制度変更がおこなわれ、取扱いが変更されることがあります。

期限前償還リスク：本債券は、日経平均株価等があらかじめ定められた条件を満たした場合、満期償還日より前に期限前償還されます。期限前償還された場合、市場環境によっては期待通りの運用成果を得られない可能性があります。

その他、本債券に影響を与える要因：本債券の発行者および本債券の発行・組成にかかる業者がおこなう金融取引、ヘッジ取引が連動する原資産や債券価格の双方に影響を与える可能性があります。

商号 株式会社中国銀行

登録金融機関 中国財務局長（登金）第2号

（加入協会）日本証券業協会、一般社団法人金融先物取引業協会

商号 中銀証券株式会社

金融商品取引業者 中国財務局長（金商）第6号

（加入協会）日本証券業協会