

2014年7月28日
July 28, 2014

各 位

| | |
|--|--|
| 管理会社名 代表者名 (銘柄コード 1576) 問合せ先 担当者 | 中国南方アセット・マネジメント・リミテッド 最高経営責任者 丁晨 アンダーソン・毛利・友常法律事務所 弁護士 平川 修 (TEL 03-6888-1000) |
| Management Co. Representative (Code: 1576) Contact Person | CSOP Asset Management Limited Ding Chen, Chief Executive Officer Anderson Mori & Tomotsune Osamu Hirakawa, Attorney-at-law (TEL +81-3-6888-1000) |

南方 FTSE 中国A株50ETFに関する日々の開示事項
Daily Disclosure Matters regarding CSOP FTSE CHINA A50 ETF

1. 上場外国ETF信託受益証券の上場受益権口数(2014年7月25日現在)

1. Number of Listed Beneficiary Right Units of Listed Foreign ETF Trust Beneficiary Certificates (JDR) (as of July 25, 2014)
600,000 口 (units)

2. 信託財産である外国ETFの純資産総額(2014年7月25日現在)

日本円への換算は2014年7月25日東京時間午後5時現在のブルームバーグによる人民元(CNH)/米国ドル及び米国ドル/日本円の仲値から算出する為替相場(1人民元=16.45円)により計算しています。

2. Total Net Asset Value of the Trust Asset Foreign ETF (as of July 25, 2014)

Conversion into Japanese yen is based on the foreign exchange rate between the offshore Chinese yuan and the Japanese yen (CNH-JPY) of 1:16.45 calculated from the middle rates for CNH-USD and USD-JPY as of 17:00 Tokyo time on July 25, 2014 published by Bloomberg.

547,790,556,492 円 JPY (33,300,337,781 人民元 (CNH))

3. 信託財産である外国ETFの一口あたりの純資産額(2014年7月25日現在)

日本円への換算は2014年7月25日東京時間午後5時現在のブルームバーグによる人民元(CNH)/米国ドル及び米国ドル/日本円の仲値から算出する為替相場(1人民元=16.45円)により計算しています。

3. Net Asset Value per Unit of Trust Asset Foreign ETF (as of July 25, 2014)

Conversion into Japanese yen is based on the foreign exchange rate between the offshore Chinese yuan and the Japanese yen (CNH-JPY) of 1:16.45 calculated from the middle rates for CNH-USD and USD-JPY as of 17:00 Tokyo time on July 25, 2014 published by Bloomberg.

120 円 JPY (7.31 人民元 (CNH))

3-1.

上場外国ETF信託受益証券の上場受益権一口に対応する信託財産である外国ETFの数及びその数に対応する純資産額(2014年7月25日現在)

日本円への換算は2014年7月25日東京時間午後5時現在のブルームバーグによる人民元(CNH)/米国ドル及び米国ドル/日本円の仲値から算出する為替相場(1人民元=16.45円)により計算しています。

3-1. Number of the Trust Asset Foreign ETF which is equal in value to one (1) Listed Beneficiary Right Unit of Listed Foreign ETF Trust Beneficiary Certificate (JDR) and Net Asset Value per such number of units of Trust Asset Foreign ETF (as of July 25, 2014)

Conversion into Japanese yen is based on the foreign exchange rate between the offshore Chinese yuan and the Japanese yen (CNH-JPY) of 1:16.45 calculated from the middle rates for CNH-USD and USD-JPY as of 17:00 Tokyo time on July 25, 2014 published by Bloomberg.

外国ETFの数 3 口(Unit)

Number of the Trust Asset Foreign ETF

対応する純資産額 361 円JPY (21.93 人民元(CNH))

Net Asset Value for the number of the Trust Asset Foreign ETF mentioned above

4. 信託財産である外国ETFの一口あたりの純資産額と FTSE 中国 A50 インデックスの終値の変動率に係る乖離率(2014年7月25日現在)
4. Deviation Rate between the Fluctuation Rate of the Net Asset Value per Unit of the Trust Asset Foreign ETF and the Fluctuation Rate of the Closing Price of FTSE China A50 Index (as of July 25, 2014)

-0.03%

(参考) 乖離率の計算式

(Reference) Formula for calculation of deviation rate

$$\left(\frac{\text{信託財産である外国ETFの
一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の信託財産である
外国ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{FTSE 中国 A50 インデックスの
終値}}{\text{前営業日のFTSE 中国 A50
インデックスの終値}} \right) \times 100 (\%)$$

$$\left(\frac{\text{Net Asset Value per Unit of
Trust Asset Foreign ETF}}{\text{Net Asset Value per Unit of Trust
Asset Foreign ETF as of previous
business day}} - \frac{\text{Closing Price of FTSE China A50
Index}}{\text{Closing Price of FTSE China A50
Index on previous business day}} \right) \times 100 (\%)$$

以 上