2016年11月22日
November 22, 2016

各　　位

管理会社名　中国南方アセット・マネジメント・リミテッド
代表者名　最高経営責任者　丁晨
（銘柄コード　1576）
問合せ先　アンダーソン・毛利・友常法律事務所
担当者　弁護士　平川　修
（TEL 03-6888-1000）

Management Co.　CSOP Asset Management Limited
Representative　Ding Chen, Chief Executive Officer
(Code: 1576)
Contact Person　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（2016年11月21日現在）
1. Number of Listed Beneficiary Right Units of Listed Foreign ETF Trust Beneficiary Certificates (JDR) (as of November 21, 2016)

53,000 口 (units)

2. 信託財産である外国ETFの純資産総額（2016年11月21日現在）
日本円への換算は2016年11月21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＝16.05円）により計算しています。
2. Total Net Asset Value of the Trust Asset Foreign ETF (as of November 21, 2016）
Conversion into Japanese yen is based on the foreign exchange rate between the offshore Chinese yuan and the Japanese yen (CNH-JPY) of 1:16.05 calculated from the middle rates for CNH-USD and USD-JPY as of 17:00 Tokyo time on November 21, 2016 published by Bloomberg.

295,001,591,525 円 JPY　（　18,380,161,466 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（2016年11月21日現在）
日本円への換算は2016年11月21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＝16.05円）により計算しています。
3. Net Asset Value per Unit of Trust Asset Foreign ETF (as of November 21, 2016）
Conversion into Japanese yen is based on the foreign exchange rate between the offshore Chinese yuan and the Japanese yen (CNH-JPY) of 1:16.05 calculated from the middle rates for CNH-USD and USD-JPY as of 17:00 Tokyo time on November 21, 2016 published by Bloomberg.

167 円 JPY　（　10.39 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（2016年11月21日現在）
日本円への換算は2016年11月21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＝16.05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 November 21, 2016）
Conversion into Japanese yen is based on the foreign exchange rate between the offshore Chinese yuan and the Japanese yen (CNH-JPY) of 1:16.05 calculated from the middle rates for CNH-USD and USD-JPY as of 17:00 Tokyo time on November 21, 2016 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　500 円JPY　（　31.17 人民元(CNH)）
Net Asset Value for the number of the Trust Asset Foreign ETF menntioned 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（2016年11月21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 November 21, 2016)

−0.01%

（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