

各位

令和元年6月27日

会社名 アセットマネジメントOne株式会社
(管理会社コード 13694)
代表者名 取締役社長 菅野 暁
問い合わせ先 投資信託事務部 片岡 昌弘
TEL 03-6774-5712

上場ETF(管理会社:アセットマネジメントOne)に関する日々の開示事項(3/3)

アセットマネジメントOne株式会社を管理会社として上場するETF銘柄について、以下のとおり令和1年6月26日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(1銘柄)

銘柄名	銘柄コード	上場取引所
One ETF 南方 中国A株 CSI500	2553	東

以上

各位

令和元年6月27日

会社名 アセットマネジメントOne株式会社
代表者名 取締役社長 菅野 暁
(コード番号 2553)
問い合わせ先 投資信託事務部 片岡 昌弘
TEL 03-6774-5712

One ETF 南方 中国A株 CSI500に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数
(令和1年6月26日現在)

500,000 口

2. 上場ETFの受益権総額
(令和1年6月26日現在)

499,372,857 円

3. 上場ETFの1口あたりの純資産額
(令和1年6月26日現在)

999 円

4. 上場ETFの1口あたりの純資産額と対象指標の終値の変動率に係る乖離率
(令和1年6月26日現在)

1.02 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{前営業日のCSI スモールキャップ 500 指数終値} \times \text{当日のTTMLレート(中国元/円)}}{\text{前々営業日のCSI スモールキャップ 500 指数終値} \times \text{前営業日のTTMLレート(中国元/円)}} \right] \times 100(\%)$$

CSI スモールキャップ 500指数とは

CSI スモールキャップ 500指数は、上海証券取引所(中国語名称「上海証券交易所」)および深セン証券取引所(中国語名称「深セン証券交易所」)に上場されている中国A株のうち、時価総額および流動性の高い上位300銘柄程度を除く、次の上位500銘柄で構成されており、中国の中小型株式の代表的な株価指数です。指数の算出方法は、浮動株比率を調整した時価総額加重平均方式です。基準時を2004年12月31日とし、その日の時価総額を1,000として、その後の時価総額を指数化したものです。

指数の著作権等

CSI スモールキャップ 500指数は、中証指数有限公司(China Securities Index Co., LTD)が構成し計算します。中証指数有限公司、上海証券取引所および深セン証券取引所はCSI スモールキャップ 500指数の正確性を確保するために一切の必要な手段を講じます。しかしながら、中証指数有限公司、上海証券取引所および深セン証券取引所は、(過失もしくはその他の理由における)CSI スモールキャップ 500指数の過誤に対する責任をいかなる者に対しても負わず、中証指数有限公司、上海証券取引所および深セン証券取引所は、CSI スモールキャップ 500指数の過誤に対して、いかなる者に対しても通知する義務を負いません。また、中証指数有限公司は、CSI スモールキャップ 500指数に基づく上場投資信託に出資、承認、販売、宣伝する立場になく、いかなる責任をも