

各位

令和1年9月2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 業務プロセス管理部 鈴木 俊直
TEL 03-6774-5065

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(1/3)

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8月30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 国内金先物	1683	東

以上

各位

令和1年9月2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)	1683)
問合わせ先	業務プロセス管理部 鈴木 俊直
	TEL 03-6774-5065

One ETF 国内金先物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8月30日現在)

14,260 口

2. 上場ETFの純資産総額
(令和1年8月30日現在)

68,523,706 円

3. 上場ETFの1口あたりの純資産額
(令和1年8月30日現在)

4,805 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8月30日現在)

-0.04 %

5. 連動対象指標の特徴と留意点

< 原資産の価格を利用する指標との差異 >

当ファンドの対象指標は、現物の金の商品価格ではなく、金の商品先物取引の価格を参照しています。商品先物取引の価格には、保管費用や金利負担等のコストが織り込まれますので、現物の商品価格を参照する場合と比べて価値が下回るおそれがあります。

< ロールオーバー時の損益について >

対象指標とする商品先物取引の価格は、商品の需給見通しに加え、保管費用や金利負担等のコストが織り込まれ、各限月ごとに価格が形成されます。現在取引している限月より新たに取引される期先の限月の方の価格が高い場合(以下「コンタンゴ」といいます。)、現在取引している商品先物取引から、新たに取引される期先の限月に乗換え(以下「ロールオーバー」といいます。)を行う際に損失が発生し、ファンドの基準価額にマイナスの要因となります。

< 留意すべき投資スタイル >

コンタンゴの状態が長期間に亘り一方的に続いた場合、ロールオーバー時の損失が累積されることとなり、この間の商品の現物価格やロールオーバーの影響を考慮しない商品先物価格の値動きとは大きな乖離が生じ、その期間が長いほど影響も大きくなる可能性があります。その結果、ファンドの基準価額と対象指標の清算値(帳入値段)が大きく乖離する可能性があり、中長期的な投資を行う場合には留意が必要です。