

各位

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  
問合せ先 業務プロセス管理部 鈴木 俊直  
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

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、以下のとおり令和元年11月12日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(10銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	<a href="#">One ETF 日経225</a>	1369	東
2	<a href="#">One ETF トピックス</a>	1473	東
3	<a href="#">One ETF JPX日経400</a>	1474	東
4	<a href="#">One ETF JPX/S&amp;P 設備・人材投資指数</a>	1484	東
5	<a href="#">One ETF JPX日経中小型</a>	1493	東
6	<a href="#">One ETF 高配当日本株</a>	1494	東
7	<a href="#">One ETF ESG</a>	1498	東
8	<a href="#">One ETF 南方 中国A株 CSI500</a>	2553	東
9	<a href="#">One ETF 東証REIT指数</a>	2556	東
10	<a href="#">One ETF 国内金先物</a>	1683	東

※各銘柄の状況につきましては、次ページ以降をご参照ください。なお、各銘柄名をクリックいただくと、各銘柄の状況が表示されます。

以上

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) 1369  
問合せ先 業務プロセス管理部 鈴木 俊直  
TEL 03-6774-5065

## One ETF 日経225に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (令和元年11月12日現在)

12,186,150 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和元年11月12日現在)

288,686,330,236 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和元年11月12日現在)

23,690 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と日経平均株価(日経225)の終値の変動率に係る乖離率  
(令和元年11月12日現在)

0.01 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[ \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経225の終値}}{\text{前営業日の日経225の終値}} \right] \times 100(\%)$$

5. 交換にかかる交換口数(別紙参照)

6. 設定にかかる株式のポートフォリオ(別紙参照)

### 日経平均株価(日経225)とは

「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体及び「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

### 指数の著作権等

「日経」及び「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属しています。当ファンドは、委託会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他、「日経平均株価」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

## One ETF 日経225

日付	日経平均株価(日経225)		One ETF 日経225				
	指数終値	日次騰落率	一口あたりの 純資産額	日次騰落率	乖離率	上場受益権口数	純資産総額
2019/10/11	21,798.87	1.15%	21,957	1.15%	0.00%	11,496,997	252,442,402,855
2019/10/15	22,207.21	1.87%	22,368	1.87%	-0.00%	11,496,997	257,164,091,797
2019/10/16	22,472.92	1.20%	22,636	1.20%	0.00%	11,496,997	260,244,313,843
2019/10/17	22,451.86	-0.09%	22,614	-0.10%	-0.00%	11,496,997	259,997,118,172
2019/10/18	22,492.68	0.18%	22,655	0.18%	-0.00%	11,496,997	260,460,238,178
2019/10/21	22,548.90	0.25%	22,712	0.25%	0.00%	11,607,243	263,621,883,986
2019/10/23	22,625.38	0.34%	22,789	0.34%	-0.00%	11,552,136	263,258,183,310
2019/10/24	22,750.60	0.55%	22,915	0.55%	-0.00%	11,552,136	264,714,597,254
2019/10/25	22,799.81	0.22%	22,963	0.21%	-0.01%	11,497,014	264,007,970,653
2019/10/28	22,867.27	0.30%	23,031	0.30%	0.00%	11,331,681	260,979,803,987
2019/10/29	22,974.13	0.47%	23,140	0.47%	0.01%	11,331,681	262,209,441,449
2019/10/30	22,843.12	-0.57%	23,008	-0.57%	-0.00%	11,331,681	260,717,187,251
2019/10/31	22,927.04	0.37%	23,092	0.37%	-0.00%	11,359,233	262,307,354,437
2019/11/1	22,850.77	-0.33%	23,016	-0.33%	0.00%	11,359,233	261,449,624,501
2019/11/5	23,251.99	1.76%	23,421	1.76%	0.00%	11,359,233	266,046,348,958
2019/11/6	23,303.82	0.22%	23,472	0.22%	-0.01%	11,359,233	266,623,582,562
2019/11/7	23,330.32	0.11%	23,499	0.12%	0.00%	12,241,231	287,658,537,004
2019/11/8	23,391.87	0.26%	23,560	0.26%	-0.00%	12,241,231	288,408,579,083
2019/11/11	23,331.84	-0.26%	23,499	-0.26%	-0.00%	12,186,150	286,365,840,234
2019/11/12	23,520.01	0.81%	23,690	0.81%	0.01%	12,186,150	288,686,330,236

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(令和元年11月18日)、交換受付日(令和元年11月18日)分の  
交換口数は以下の通りです。

交換口数 55,300 口の整数倍

## 設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(令和元年11月18日)、設定受付日(令和元年11月18日)分の  
設定ポートフォリオは以下の通りです。

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
1	1332	日本水産	2,000
2	1333	マルハニチロ	200
3	1605	国際石油開発帝石	800
4	1721	コムシスホールディングス	2,000
5	1801	大成建設	400
6	1802	大林組	2,000
7	1803	清水建設	2,000
8	1808	長谷工コーポレーション	400
9	1812	鹿島建設	1,000
10	1925	大和ハウス工業	2,000
11	1928	積水ハウス	2,000
12	1963	日揮ホールディングス	2,000
13	2002	日清製粉グループ本社	2,000
14	2269	明治ホールディングス	400
15	2282	日本ハム	1,000
16	2413	エムスリー	4,800
17	2432	ディー・エヌ・エー	600
18	2501	サッポロホールディングス	400
19	2502	アサヒグループホールディングス	2,000
20	2503	麒麟ホールディングス	2,000
21	2531	宝ホールディングス	2,000
22	2768	双日	200
23	2801	キッコーマン	2,000
24	2802	味の素	2,000
25	2871	ニチレイ	1,000
26	2914	日本たばこ産業	2,000
27	3086	J. フロント リテイリング	1,000
28	3099	三越伊勢丹ホールディングス	2,000
29	3101	東洋紡	200
30	3103	ユニチカ	200
31	3105	日清紡ホールディングス	2,000
32	3289	東急不動産ホールディングス	2,000
33	3382	セブン&アイ・ホールディングス	2,000
34	3401	帝人	400
35	3402	東レ	2,000
36	3405	クラレ	2,000
37	3407	旭化成	2,000
38	3436	SUMCO	200
39	3861	王子ホールディングス	2,000
40	3863	日本製紙	200
41	4004	昭和電工	200
42	4005	住友化学	2,000
43	4021	日産化学	2,000
44	4042	東ソー	1,000
45	4043	トクヤマ	400
46	4061	デンカ	400
47	4063	信越化学工業	2,000
48	4151	協和キリン	2,000
49	4183	三井化学	400
50	4188	三菱ケミカルホールディングス	1,000

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
51	4208	宇部興産	200
52	4272	日本化薬	2,000
53	4324	電通	2,000
54	4452	花王	2,000
55	4502	武田薬品工業	2,000
56	4503	アステラス製薬	10,000
57	4506	大日本住友製薬	2,000
58	4507	塩野義製薬	2,000
59	4519	中外製薬	2,000
60	4523	エーザイ	2,000
61	4543	テルモ	8,000
62	4568	第一三共	2,000
63	4578	大塚ホールディングス	2,000
64	4631	DIC	200
65	4689	Zホールディングス	800
66	4704	トレンドマイクロ	2,000
67	4751	サイバーエージェント	400
68	4755	楽天	2,000
69	4901	富士フイルムホールディングス	2,000
70	4902	ユニカミノルタ	2,000
71	4911	資生堂	2,000
72	5019	出光興産	800
73	5020	JXTGホールディングス	2,000
74	5101	横浜ゴム	1,000
75	5108	ブリヂストン	2,000
76	5201	AGC	400
77	5202	日本板硝子	200
78	5214	日本電気硝子	600
79	5232	住友大阪セメント	200
80	5233	太平洋セメント	200
81	5301	東海カーボン	2,000
82	5332	TOTO	1,000
83	5333	日本碍子	2,000
84	5401	日本製鉄	200
85	5406	神戸製鋼所	200
86	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	200
87	5541	大太平洋金属	200
88	5631	日本製鋼所	400
89	5703	日本軽金属ホールディングス	2,000
90	5706	三井金属鉱業	200
91	5707	東邦亜鉛	200
92	5711	三菱マテリアル	200
93	5713	住友金属鉱山	1,000
94	5714	DOWAホールディングス	400
95	5801	古河電気工業	200
96	5802	住友電気工業	2,000
97	5803	フジクラ	2,000
98	5901	東洋製罐グループホールディングス	2,000
99	6098	リクルートホールディングス	6,000
100	6103	オークマ	400
101	6113	アマダホールディングス	2,000
102	6178	日本郵政	2,000
103	6301	小松製作所	2,000
104	6302	住友重機械工業	400
105	6305	日立建機	2,000
106	6326	クボタ	2,000
107	6361	荏原製作所	400
108	6367	ダイキン工業	2,000
109	6471	日本精工	2,000
110	6472	NTN	2,000

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
111	6473	ジェイテクト	2,000
112	6479	ミネベアミツミ	2,000
113	6501	日立製作所	400
114	6503	三菱電機	2,000
115	6504	富士電機	400
116	6506	安川電機	2,000
117	6645	オムロン	2,000
118	6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	400
119	6701	日本電気	200
120	6702	富士通	200
121	6703	沖電気工業	200
122	6724	セイコーエプソン	4,000
123	6752	パナソニック	2,000
124	6758	ソニー	2,000
125	6762	TDK	2,000
126	6770	アルプスアルパイン	2,000
127	6841	横河電機	2,000
128	6857	アドバンテスト	4,000
129	6902	デンソー	2,000
130	6952	カシオ計算機	2,000
131	6954	ファナック	2,000
132	6971	京セラ	4,000
133	6976	太陽誘電	2,000
134	6988	日東電工	2,000
135	7003	三井E&Sホールディングス	200
136	7004	日立造船	400
137	7011	三菱重工業	200
138	7012	川崎重工業	200
139	7013	IHI	200
140	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,000
141	7201	日産自動車	2,000
142	7202	いすゞ自動車	1,000
143	7203	トヨタ自動車	2,000
144	7205	日野自動車	2,000
145	7211	三菱自動車工業	200
146	7261	マツダ	400
147	7267	本田技研工業	4,000
148	7269	スズキ	2,000
149	7270	SUBARU	2,000
150	7272	ヤマハ発動機	2,000
151	7731	ニコン	2,000
152	7733	オリンパス	8,000
153	7735	SCREENホールディングス	400
154	7751	キヤノン	3,000
155	7752	リコー	2,000
156	7762	シチズン時計	2,000
157	7832	バンダイナムコホールディングス	2,000
158	7911	凸版印刷	1,000
159	7912	大日本印刷	1,000
160	7951	ヤマハ	2,000
161	8001	伊藤忠商事	2,000
162	8002	丸紅	2,000
163	8015	豊田通商	2,000
164	8028	ファミリーマート	8,000
165	8031	三井物産	2,000
166	8035	東京エレクトロン	2,000
167	8053	住友商事	2,000
168	8058	三菱商事	2,000
169	8233	高島屋	1,000
170	8252	丸井グループ	2,000

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
171	8253	クレディセゾン	2,000
172	8267	イオン	2,000
173	8303	新生銀行	200
174	8304	あおぞら銀行	200
175	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,000
176	8308	りそなホールディングス	200
177	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	200
178	8316	三井住友フィナンシャルグループ	200
179	8331	千葉銀行	2,000
180	8354	ふくおかフィナンシャルグループ	400
181	8355	静岡銀行	2,000
182	8411	みずほフィナンシャルグループ	2,000
183	8601	大和証券グループ本社	2,000
184	8604	野村ホールディングス	2,000
185	8628	松井証券	2,000
186	8630	SOMPOホールディングス	500
187	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	600
188	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	400
189	8750	第一生命ホールディングス	200
190	8766	東京海上ホールディングス	1,000
191	8795	T&Dホールディングス	400
192	8801	三井不動産	2,000
193	8802	三菱地所	2,000
194	8804	東京建物	1,000
195	8830	住友不動産	2,000
196	9001	東武鉄道	400
197	9005	東急	1,000
198	9007	小田急電鉄	1,000
199	9008	京王電鉄	400
200	9009	京成電鉄	1,000
201	9020	東日本旅客鉄道	200
202	9021	西日本旅客鉄道	200
203	9022	東海旅客鉄道	200
204	9062	日本通運	200
205	9064	ヤマトホールディングス	2,000
206	9101	日本郵船	200
207	9104	商船三井	200
208	9107	川崎汽船	200
209	9202	ANAホールディングス	200
210	9301	三菱倉庫	1,000
211	9412	スカパーJSATホールディングス	200
212	9432	日本電信電話	400
213	9433	KDDI	12,000
214	9437	NTTドコモ	200
215	9501	東京電力ホールディングス	200
216	9502	中部電力	200
217	9503	関西電力	200
218	9531	東京瓦斯	400
219	9532	大阪瓦斯	400
220	9602	東宝	200
221	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	10,000
222	9735	セコム	2,000
223	9766	コナミホールディングス	2,000
224	9983	ファーストリテイリング	2,000
225	9984	ソフトバンクグループ	12,000

以上

各位

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 1473)  
問合せ先 業務プロセス管理部 鈴木 俊直  
TEL 03-6774-5065

## One ETF トピックスに関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (令和元年11月12日現在)

116,902,833 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和元年11月12日現在)

202,815,674,930 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和元年11月12日現在)

1,734.91 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と東証株価指数(TOPIX)の終値の変動率に係る乖離率  
(令和元年11月12日現在)

0.01 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[ \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{TOPIXの終値}}{\text{前営業日のTOPIXの終値}} \right] \times 100(\%)$$

5. 交換にかかる交換口数(別紙参照)  
6. 設定にかかる株式のポートフォリオ(別紙参照)

### 東証株価指数(TOPIX)について

- ・TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「㈱東京証券取引所」という。)の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。
- ・㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。
- ・㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ・㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
- ・当ファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。
- ・㈱東京証券取引所は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ・㈱東京証券取引所は、当社又は本件商品の購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ・以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。



## One ETF トピックス

日付	東証株価指数 (TOPIX)		One ETF トピックス				
	指数終値	日次騰落率	一口あたりの 純資産額	日次騰落率	乖離率	上場受益権口数	純資産総額
2019/10/11	1,595.27	0.88%	1,618.67	0.88%	-0.00%	116,902,833	189,227,142,402
2019/10/15	1,620.20	1.56%	1,643.91	1.56%	-0.00%	116,902,833	192,177,972,872
2019/10/16	1,631.51	0.70%	1,655.33	0.69%	-0.00%	116,902,833	193,513,034,994
2019/10/17	1,624.16	-0.45%	1,647.88	-0.45%	0.00%	116,902,833	192,642,044,496
2019/10/18	1,621.99	-0.13%	1,645.64	-0.14%	-0.00%	116,902,833	192,379,716,694
2019/10/21	1,628.60	0.41%	1,652.42	0.41%	0.00%	116,902,833	193,172,841,103
2019/10/23	1,638.14	0.59%	1,662.05	0.58%	-0.00%	116,902,833	194,298,205,071
2019/10/24	1,643.74	0.34%	1,667.81	0.35%	0.00%	116,902,833	194,971,400,867
2019/10/25	1,648.44	0.29%	1,672.46	0.28%	-0.01%	116,902,833	195,515,736,268
2019/10/28	1,648.43	-0.00%	1,672.48	0.00%	0.00%	116,902,833	195,518,135,460
2019/10/29	1,662.68	0.86%	1,686.99	0.87%	0.00%	116,902,833	197,214,471,935
2019/10/30	1,665.90	0.19%	1,690.37	0.20%	0.01%	116,902,833	197,609,043,766
2019/10/31	1,667.01	0.07%	1,691.58	0.07%	0.00%	116,902,833	197,750,146,046
2019/11/1	1,666.50	-0.03%	1,691.11	-0.03%	0.00%	116,902,833	197,695,782,702
2019/11/5	1,694.16	1.66%	1,719.25	1.66%	0.00%	116,902,833	200,984,660,078
2019/11/6	1,694.45	0.02%	1,719.46	0.01%	-0.00%	116,902,833	201,009,220,075
2019/11/7	1,698.13	0.22%	1,723.27	0.22%	0.00%	116,902,833	201,455,376,070
2019/11/8	1,702.77	0.27%	1,727.89	0.27%	-0.01%	116,902,833	201,995,134,673
2019/11/11	1,704.03	0.07%	1,729.04	0.07%	-0.01%	116,902,833	202,129,191,999
2019/11/12	1,709.67	0.33%	1,734.91	0.34%	0.01%	116,902,833	202,815,674,930

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(令和元年11月18日)、交換受付日(令和元年11月18日)分の交換口数は以下の通りです。

交換申込不可日のため受け付けておりません。

## 設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(令和元年11月18日)、設定受付日(令和元年11月18日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

設定申込不可日のため受け付けておりません。

以上

各位

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 1474)  
 問合せ先 業務プロセス管理部 鈴木 俊直  
 TEL 03-6774-5065

## One ETF JPX日経400に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (令和元年11月12日現在)

9,420,770      口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和元年11月12日現在)

145,661,197,363      円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和元年11月12日現在)

15,462      円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とJPX日経インデックス400 (JPX日経400)の終値の変動率に係る乖離率 (令和元年11月12日現在)

0.01      %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[ \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{JPX日経400の終値}}{\text{前営業日のJPX日経400の終値}} \right] \times 100(\%)$$

5. 交換にかかる交換口数 (別紙参照)

6. 設定にかかる株式のポートフォリオ (別紙参照)

### JPX日経インデックス400 (JPX日経400) について

・「JPX日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所 (以下、総称して「JPXグループ」という。)並びに株式会社日本経済新聞社 (以下、「日経」という。)によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」自体及び「JPX日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。  
 ・「JPX日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て「JPXグループ」及び「日経」に帰属しています。  
 ・当ファンドは、委託会社の責任のもとで運用されるものであり、「JPXグループ」及び「日経」は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。  
 ・「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。  
 ・「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

## One ETF JPX日経400

日付	JPX日経インデックス400 (JPX日経400)		One ETF JPX日経400				
	指数終値	日次騰落率	一口あたりの 純資産額	日次騰落率	乖離率	上場受益権口数	純資産総額
2019/10/11	14,269.83	0.93%	14,451	0.93%	0.00%	9,282,716	134,145,235,491
2019/10/15	14,492.79	1.56%	14,676	1.56%	-0.01%	9,292,480	136,377,405,559
2019/10/16	14,591.56	0.68%	14,775	0.67%	-0.01%	9,302,247	137,445,238,598
2019/10/17	14,528.89	-0.43%	14,712	-0.43%	0.00%	9,302,247	136,851,352,998
2019/10/18	14,510.17	-0.13%	14,692	-0.14%	-0.01%	9,312,019	136,811,783,617
2019/10/21	14,565.67	0.38%	14,749	0.39%	0.01%	9,321,791	137,491,112,389
2019/10/23	14,652.40	0.60%	14,837	0.60%	0.00%	9,321,791	138,306,711,438
2019/10/24	14,706.93	0.37%	14,892	0.37%	-0.00%	9,351,116	139,261,145,523
2019/10/25	14,749.99	0.29%	14,935	0.29%	-0.00%	9,351,116	139,657,440,065
2019/10/28	14,747.26	-0.02%	14,932	-0.02%	-0.00%	9,351,116	139,635,181,209
2019/10/29	14,874.20	0.86%	15,061	0.86%	0.00%	9,351,116	140,839,907,064
2019/10/30	14,900.45	0.18%	15,089	0.19%	0.01%	9,351,116	141,097,192,393
2019/10/31	14,913.13	0.09%	15,102	0.09%	0.00%	9,351,116	141,223,865,646
2019/11/1	14,906.89	-0.04%	15,097	-0.03%	0.01%	9,361,064	141,321,084,703
2019/11/5	15,146.90	1.61%	15,341	1.62%	0.01%	9,371,008	143,759,453,351
2019/11/6	15,145.41	-0.01%	15,338	-0.02%	-0.01%	9,371,008	143,730,117,902
2019/11/7	15,184.99	0.26%	15,379	0.27%	0.01%	9,380,966	144,271,092,995
2019/11/8	15,213.42	0.19%	15,406	0.18%	-0.01%	9,380,966	144,525,386,854
2019/11/11	15,215.97	0.02%	15,408	0.01%	-0.00%	9,390,920	144,695,585,661
2019/11/12	15,267.68	0.34%	15,462	0.35%	0.01%	9,420,770	145,661,197,363

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(令和元年11月18日)、交換受付日(令和元年11月18日)分の交換口数は以下の通りです。

交換申込不可日のため受け付けておりません。

## 設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(令和元年11月18日)、設定受付日(令和元年11月18日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

設定申込不可日のため受け付けておりません。

以上

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 1484)  
問合せ先 業務プロセス管理部 鈴木 俊直  
TEL 03-6774-5065

## One ETF JPX/S&P 設備・人材投資指数に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (令和元年11月12日現在)

29,541,771 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和元年11月12日現在)

47,739,899,568 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和元年11月12日現在)

1,616.01 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とJPX/S&P 設備・人材投資指数の終値の変動率に係る乖離率  
(令和元年11月12日現在)

0.01 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[ \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{JPX/S\&P 設備・人材投資指数の終値}}{\text{前営業日のJPX/S\&P 設備・人材投資指数の終値}} \right] \times 100(\%)$$

5. 交換にかかる交換口数(別紙参照)

6. 設定にかかる株式のポートフォリオ(別紙参照)

## One ETF JPX/S&P 設備・人材投資指数

日付	JPX/S&P 設備・人材投資指数		One ETF JPX/S&P 設備・人材投資指数				
	指数終値	日次騰落率	一口あたりの 純資産額	日次騰落率	乖離率	上場受益権口数	純資産総額
2019/10/11	1,511.14	0.75%	1,521.87	0.75%	0.00%	29,541,771	44,958,852,096
2019/10/15	1,533.01	1.45%	1,543.86	1.44%	-0.00%	29,541,771	45,608,456,210
2019/10/16	1,542.80	0.64%	1,553.69	0.64%	-0.00%	29,541,771	45,898,609,209
2019/10/17	1,534.63	-0.53%	1,545.49	-0.53%	0.00%	29,541,771	45,656,423,780
2019/10/18	1,528.66	-0.39%	1,539.52	-0.39%	0.00%	29,541,771	45,480,176,734
2019/10/21	1,534.54	0.38%	1,545.52	0.39%	0.00%	29,541,771	45,657,393,293
2019/10/23	1,542.29	0.51%	1,553.29	0.50%	-0.00%	29,541,771	45,886,998,543
2019/10/24	1,546.48	0.27%	1,557.61	0.28%	0.01%	29,541,771	46,014,662,136
2019/10/25	1,551.99	0.36%	1,563.01	0.35%	-0.01%	29,541,771	46,174,074,912
2019/10/28	1,548.50	-0.23%	1,559.59	-0.22%	0.01%	29,541,771	46,073,082,757
2019/10/29	1,560.13	0.75%	1,571.38	0.76%	0.00%	29,541,771	46,421,284,140
2019/10/30	1,567.21	0.45%	1,578.41	0.45%	-0.01%	29,541,771	46,628,922,935
2019/10/31	1,569.29	0.13%	1,580.54	0.13%	0.00%	29,541,771	46,692,011,535
2019/11/1	1,572.50	0.20%	1,583.86	0.21%	0.01%	29,541,771	46,790,067,511
2019/11/5	1,596.26	1.51%	1,607.86	1.52%	0.00%	29,541,771	47,499,087,421
2019/11/6	1,591.29	-0.31%	1,602.90	-0.31%	0.00%	29,541,771	47,352,558,054
2019/11/7	1,598.17	0.43%	1,609.84	0.43%	0.00%	29,541,771	47,557,412,717
2019/11/8	1,597.91	-0.02%	1,609.58	-0.02%	0.00%	29,541,771	47,549,951,216
2019/11/11	1,600.40	0.16%	1,611.91	0.14%	-0.01%	29,541,771	47,618,564,713
2019/11/12	1,604.30	0.24%	1,616.01	0.25%	0.01%	29,541,771	47,739,899,568

### JPX/S&P 設備・人材投資指数とは

JPX/S&P 設備・人材投資指数とは、東証株価指数(TOPIX)の構成銘柄の中から流動性、信用力及び市場評価の安定性によりスクリーニングされたユニバースのうち、「設備投資の成長性」「設備投資の効率性」「人材投資の充実度」の3要素からスコアリング評価をして200銘柄を選定し算出される株価指数です。本指数は株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所(JPXグループ)とS&P ダウ・ジョーンズ・インデックスが「設備投資・人材投資」に積極的に取り組む企業を対象とする指数として共同開発し、2005年9月16日を基準値1000として算出・公表するものです。

### 指数の著作権等

JPX/S&P 設備・人材投資指数はS&P ダウ・ジョーンズ・インデックスまたはその関連会社(「SPDJ」)、株式会社日本取引所グループ(「JPX」)および株式会社東京証券取引所(「東証」)の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが委託会社にそれぞれ付与されています。JPX®はJPXの登録商標であり、これを利用するライセンスがSPDJおよび委託会社に付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P、それぞれの関連会社、JPXまたは東証によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、JPX/S&P 設備・人材投資指数に関するデータの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任を負いません。JPX/S&P設備・人材投資指数はユニバースに東証株価指数(TOPIX)を使用しています。東証株価指数(TOPIX)は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)の商標または標準に関するすべての権利は東証が有しています。

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(令和元年11月18日)、交換受付日(令和元年11月18日)分の交換口数は以下の通りです。

交換申込不可日のため受け付けておりません。

## 設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(令和元年11月18日)、設定受付日(令和元年11月18日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

設定申込不可日のため受け付けておりません。

以上



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 1493)  
問合せ先 業務プロセス管理部 鈴木 俊直  
TEL 03-6774-5065

## One ETF JPX日経中小型に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (令和元年11月12日現在)

666,167 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和元年11月12日現在)

9,788,701,568 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和元年11月12日現在)

14,694 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とJPX日経中小型株指数(JPX日経中小型)の終値の変動率に係る乖離率  
(令和元年11月12日現在)

-0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[ \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{JPX日経中小型の終値}}{\text{前営業日のJPX日経中小型の終値}} \right] \times 100(\%)$$

5. 交換にかかる交換口数(別紙参照)

6. 設定にかかる株式のポートフォリオ(別紙参照)

## One ETF JPX日経中小型

日付	JPX日経中小型株指数 (JPX日経中小型)		One ETF JPX日経中小型				
	指数終値	日次騰落率	一口あたりの 純資産額	日次騰落率	乖離率	上場受益権口数	純資産総額
2019/10/11	13,598.65	0.29%	13,641	0.30%	0.01%	666,167	9,087,400,794
2019/10/15	13,804.05	1.51%	13,846	1.50%	-0.01%	666,167	9,224,004,586
2019/10/16	13,868.73	0.47%	13,911	0.47%	0.00%	666,167	9,267,292,389
2019/10/17	13,844.99	-0.17%	13,886	-0.18%	-0.01%	666,167	9,250,642,096
2019/10/18	13,873.10	0.20%	13,913	0.19%	-0.01%	666,167	9,268,091,369
2019/10/21	13,982.46	0.79%	14,021	0.78%	-0.01%	666,167	9,340,496,874
2019/10/23	14,139.25	1.12%	14,175	1.10%	-0.02%	666,167	9,443,207,296
2019/10/24	14,175.12	0.25%	14,212	0.26%	0.01%	666,167	9,467,853,788
2019/10/25	14,242.05	0.47%	14,277	0.46%	-0.01%	666,167	9,511,113,765
2019/10/28	14,225.82	-0.11%	14,262	-0.11%	0.01%	666,167	9,500,654,593
2019/10/29	14,318.40	0.65%	14,356	0.66%	0.01%	666,167	9,563,179,756
2019/10/30	14,372.64	0.38%	14,411	0.38%	0.00%	666,167	9,600,265,985
2019/10/31	14,366.26	-0.04%	14,406	-0.03%	0.01%	666,167	9,596,726,027
2019/11/1	14,342.37	-0.17%	14,382	-0.17%	-0.00%	666,167	9,581,067,833
2019/11/5	14,529.60	1.31%	14,572	1.32%	0.02%	666,167	9,707,261,819
2019/11/6	14,483.58	-0.32%	14,526	-0.32%	0.00%	666,167	9,676,797,625
2019/11/7	14,509.46	0.18%	14,553	0.19%	0.01%	666,167	9,694,929,848
2019/11/8	14,483.72	-0.18%	14,528	-0.17%	0.01%	666,167	9,678,185,415
2019/11/11	14,563.74	0.55%	14,605	0.53%	-0.02%	666,167	9,729,083,654
2019/11/12	14,652.89	0.61%	14,694	0.61%	-0.00%	666,167	9,788,701,568

### JPX日経中小型株指数(JPX日経中小型)とは

JPX日経中小型株指数とは、株式会社東京証券取引所と株式会社日本経済新聞社が公表する株価指数です。東京証券取引所の市場第一部、市場第二部、マザーズ、JASDAQを主たる市場とする普通株式等のうち、時価総額、売買代金、ROE等を基に原則200銘柄を選定し、時価総額加重平均を用いて2016年8月31日を基準値10,000として計算されています。

### 指数の著作権等

「JPX日経中小型株指数」は、株式会社東京証券取引所(以下、「東証」という。)及び株式会社日本経済新聞社(以下、「日経」という。)によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、「東証」及び「日経」は、「JPX日経中小型株指数」自体及び「JPX日経中小型株指数」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。「JPX日経中小型株指数」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て「東証」、株式会社日本取引所グループ及び「日経」に帰属しています。当ファンドは、委託会社の責任のもとで運用されるものであり、「東証」及び「日経」は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。「東証」及び「日経」は、「JPX日経中小型株指数」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。「東証」及び「日経」は、「JPX日経中小型株指数」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経中小型株指数」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(令和元年11月18日)、交換受付日(令和元年11月18日)分の交換口数は以下の通りです。

交換口数 4,000 口以上 4000 口単位

## 設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(令和元年11月18日)、設定受付日(令和元年11月18日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

なお、以下のポートフォリオは、最小設定口数となる設定ポートフォリオです。

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
1	1407	ウエストホールディングス	100
2	1430	ファーストコーポレーション	100
3	1720	東急建設	600
4	1805	飛鳥建設	100
5	1821	三井住友建設	1,100
6	1822	大豊建設	100
7	1835	東鉄工業	200
8	1852	浅沼組	100
9	1871	ビーエス三菱	100
10	1879	新日本建設	200
11	1890	東洋建設	500
12	1898	世紀東急工業	200
13	1926	ライト工業	300
14	2120	LIFULL	500
15	2124	ジェイエイシーリクルートメント	100
16	2146	UTグループ	200
17	2154	トラスト・テック	200
18	2170	リンクアンドモチベーション	300
19	2183	リニカル	100
20	2281	プリマハム	200
21	2353	日本駐車場開発	1,600
22	2362	夢真ホールディングス	400
23	2378	ルネサンス	100
24	2379	ディップ	200
25	2384	SBSホールディングス	100
26	2440	ぐるなび	200
27	2461	ファンコミュニケーションズ	400
28	2471	エスプール	400
29	2475	WDBホールディングス	100
30	2491	バリューコマース	100
31	2497	ユナイテッド	100
32	2681	ゲオホールディングス	300
33	2685	アダストリア	200
34	2695	くら寿司	100
35	2930	北の達人コーポレーション	500
36	3034	クオールホールディングス	200
37	3036	アルコニックス	200
38	3053	ベッパーフードサービス	100
39	3073	DDホールディングス	100
40	3076	あい ホールディングス	200
41	3085	アークランドサービスホールディングス	100
42	3103	ユニチカ	400
43	3107	ダイワボウホールディングス	100
44	3167	TOKAIホールディングス	800
45	3179	シュッピン	100
46	3186	ネクステージ	200
47	3228	三栄建築設計	100
48	3244	サムティ	200
49	3245	ディア・ライフ	200
50	3252	日本商業開発	100

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
51	3254	プレサンスコーポレーション	200
52	3258	ユニゾホールディングス	200
53	3276	日本管理センター	100
54	3284	フージャースホールディングス	300
55	3299	ムゲンエステート	100
56	3387	クリエイト・レストランツ・ホールディングス	400
57	3397	トリドールホールディングス	200
58	3415	TOKYO BASE	100
59	3433	トーカロ	400
60	3457	ハウストウ	100
61	3543	コメダホールディングス	300
62	3656	KLab	300
63	3662	エイチーム	100
64	3665	エニグモ	100
65	3668	コロプラ	500
66	3676	デジタルハーツホールディングス	100
67	3677	システム情報	100
68	3679	じげん	400
69	3687	フィックスターズ	200
70	3756	豆蔵ホールディングス	100
71	3762	テクマトリックス	100
72	3836	アバント	100
73	3844	コムチュア	200
74	3901	マークライNZ	100
75	3926	オーブンドア	100
76	3932	アカツキ	100
77	4047	関東電化工業	300
78	4082	第一稀元素化学工業	200
79	4246	ダイキョーニシカワ	300
80	4290	プレステージ・インターナショナル	500
81	4318	クイック	100
82	4368	扶桑化学工業	100
83	4641	アルプス技研	100
84	4714	リソー教育	600
85	4722	フューチャー	200
86	4792	山田コンサルティンググループ	100
87	4839	WOWOW	100
88	4845	スカラ	100
89	4848	フルキャストホールディングス	100
90	4975	JCU	200
91	5017	富士石油	400
92	5122	オカモト	100
93	5184	ニチリン	100
94	5358	イノライト工業	100
95	5423	東京製鐵	700
96	5702	大紀アルミニウム工業所	200
97	5857	アサヒホールディングス	300
98	5949	ユニプレス	300
99	5975	東プレ	300
100	6013	タクマ	500
101	6035	アイ・アールジャパンホールディングス	100
102	6050	イー・ガーディアン	100
103	6071	IBJ	100
104	6089	ウィルグループ	100
105	6101	ツガミ	300
106	6183	ベルシステム24ホールディングス	200
107	6191	エボラブルアジア	100
108	6196	ストライク	100
109	6197	ソラスト	400
110	6258	平田機工	100

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
111	6266	タツモ	100
112	6323	ローツェ	100
113	6340	澁谷工業	100
114	6364	北越工業	100
115	6379	レイズネクスト	200
116	6406	フジテック	500
117	6409	キトー	100
118	6420	福島工業	100
119	6432	竹内製作所	200
120	6440	JUKI	200
121	6463	TPR	200
122	6464	ツバキ・ナカシマ	300
123	6486	イーグル工業	200
124	6630	ヤーマン	200
125	6641	日新電機	300
126	6670	MCJ	400
127	6787	メイコー	100
128	6817	スミダコーポレーション	100
129	6877	OBARA GROUP	100
130	7148	FPG	400
131	7172	ジャパンインベストメントアドバイザー	100
132	7177	GMOフィナンシャルホールディングス	300
133	7220	武蔵精密工業	300
134	7244	市光工業	200
135	7256	河西工業	200
136	7419	ノジマ	300
137	7593	VTホールディングス	600
138	7606	ユナイテッドアローズ	100
139	7611	ハイデイ日高	200
140	7613	シークス	200
141	7679	薬王堂ホールディングス	100
142	7717	ブイ・テクノロジー	100
143	7718	スター精密	200
144	7839	SHOEI	100
145	7844	マーベラス	200
146	7943	ニチハ	200
147	8020	兼松	500
148	8051	山善	600
149	8074	ユアサ商事	100
150	8096	兼松エレクトロニクス	100
151	8133	伊藤忠エネクス	300
152	8255	アクシアル リテイリング	200
153	8739	スパークス・グループ	700
154	8771	イー・ギャランティ	200
155	8841	テーオーシー	300
156	8890	レーサム	100
157	8892	日本エスコン	300
158	8897	タカラレーベン	700
159	8909	シノケングループ	200
160	8920	東祥	100
161	8923	トーセイ	200
162	8934	サンフロンティア不動産	200
163	8935	エフ・ジェー・ネクスト	100
164	9037	ハマキョウレックス	100
165	9058	トランコム	100
166	9069	センコーグループホールディングス	800
167	9267	Genky DrugStores	100
168	9422	コネクシオ	100
169	9514	エフオン	100
170	9517	イーレックス	200

## 設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
171	9678	カナモト	200
172	9682	DTS	300
173	9699	西尾レントオール	100
174	9743	丹青社	300
175	9790	福井コンピュータホールディングス	100
176	9928	ミロク情報サービス	100
177	9974	ベルク	100

以上

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 1494)  
問合せ先 業務プロセス管理部 鈴木 俊直  
TEL 03-6774-5065

## One ETF 高配当日本株に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (令和元年11月12日現在)

802,715 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和元年11月12日現在)

14,840,636,445 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和元年11月12日現在)

18,488 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とS&P/JPX 配当貴族指数の終値の変動率に係る乖離率  
(令和元年11月12日現在)

0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[ \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{S\&P/JPX 配当貴族指数の終値}}{\text{前営業日のS\&P/JPX 配当貴族指数の終値}} \right] \times 100(\%)$$

5. 交換にかかる交換口数(別紙参照)

6. 設定にかかる株式のポートフォリオ(別紙参照)

## One ETF 高配当日本株

日付	S&P/JPX 配当貴族指数		One ETF 高配当日本株				
	指数終値	日次騰落率	一口あたりの 純資産額	日次騰落率	乖離率	上場受益権口数	純資産総額
2019/10/11	168.70	1.08%	16,961	1.07%	-0.01%	674,564	11,441,436,395
2019/10/15	171.48	1.65%	17,239	1.64%	-0.01%	674,564	11,628,655,869
2019/10/16	172.77	0.75%	17,367	0.74%	-0.01%	674,564	11,715,082,731
2019/10/17	172.02	-0.43%	17,292	-0.43%	-0.00%	674,564	11,664,493,978
2019/10/18	171.83	-0.11%	17,272	-0.12%	-0.00%	704,364	12,165,516,875
2019/10/21	173.14	0.77%	17,403	0.76%	-0.01%	704,364	12,257,897,634
2019/10/23	174.95	1.04%	17,581	1.02%	-0.02%	704,364	12,383,352,354
2019/10/24	176.16	0.69%	17,702	0.69%	-0.01%	701,387	12,416,054,545
2019/10/25	175.80	-0.20%	17,667	-0.20%	0.01%	701,387	12,391,160,359
2019/10/28	175.68	-0.07%	17,655	-0.07%	-0.00%	701,387	12,383,037,505
2019/10/29	177.59	1.09%	17,846	1.08%	-0.01%	689,475	12,304,574,036
2019/10/30	177.03	-0.32%	17,800	-0.26%	0.06%	689,475	12,272,381,917
2019/10/31	177.31	0.16%	17,828	0.16%	0.00%	802,715	14,310,698,257
2019/11/1	177.01	-0.17%	17,798	-0.17%	0.00%	802,715	14,286,804,961
2019/11/5	180.29	1.85%	18,127	1.85%	-0.00%	802,715	14,551,152,105
2019/11/6	180.88	0.33%	18,184	0.31%	-0.01%	802,715	14,596,877,787
2019/11/7	181.14	0.15%	18,212	0.15%	0.01%	802,715	14,619,101,747
2019/11/8	182.36	0.67%	18,331	0.65%	-0.02%	802,715	14,714,931,491
2019/11/11	182.61	0.14%	18,354	0.13%	-0.01%	802,715	14,733,384,090
2019/11/12	183.94	0.73%	18,488	0.73%	0.00%	802,715	14,840,636,445

### S&P/JPX配当貴族指数とは

S&P/JPX配当貴族指数とは、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックス、株式会社日本取引所グループおよび株式会社東京証券取引所が公表する株価指数です。東証株価指数(TOPIX)の構成銘柄のうち10年以上毎年増配しているか、安定した配当を維持している40〜50銘柄を対象とし、配当利回り加重平均を用いて2006年7月31日を基準値100として計算されています。

### 指数の著作権等

S&P/JPX配当貴族指数(以下「当インデックス」)はS&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)、株式会社日本取引所グループ(以下「JPX」)および株式会社東京証券取引所(以下「東証」)の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。JPX®はJPXの登録商標であり、これを利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社に付与されています。東証株価指数(TOPIX)の指数値及び東証株価指数(TOPIX)の商標は、東証の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数(TOPIX)の商標に関するすべての権利は東証が有します。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&Pもしくはそれぞれの関連会社、JPXまたは東証によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。



## 交換にかかる交換口数

交換申込日(令和元年11月18日)、交換受付日(令和元年11月18日)分の  
交換口数は以下の通りです。

交換口数 3,000 口以上 3000 口単位

## 設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(令和元年11月18日)、設定受付日(令和元年11月18日)分の  
設定ポートフォリオは以下の通りです。

なお、以下のポートフォリオは、最小設定口数となる設定ポートフォリオです。

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
1	1801	大成建設	300
2	1802	大林組	900
3	1878	大東建託	100
4	1911	住友林業	700
5	2651	ローソン	300
6	2914	日本たばこ産業	800
7	3050	DCMホールディングス	700
8	3107	ダイワボウホールディングス	200
9	4042	東ソー	700
10	4061	デンカ	400
11	4202	ダイセル	1,100
12	4206	アイカ工業	300
13	4208	宇部興産	500
14	4503	アステラス製薬	500
15	4521	科研製薬	200
16	4666	パーク24	400
17	4689	Zホールディングス	2,700
18	4732	ユー・エス・エス	300
19	5019	出光興産	300
20	5393	ニチアス	600
21	5802	住友電気工業	800
22	5949	ユニプレス	500
23	6412	平和	500
24	6417	SANKYO	300
25	7224	新明和工業	800
26	8078	阪和興業	500
27	8253	クレディセゾン	600
28	8282	ケーズホールディングス	900
29	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,900
30	8308	りそなホールディングス	2,400
31	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	200
32	8316	三井住友フィナンシャルグループ	300
33	8331	千葉銀行	1,300
34	8354	ふくおかフィナンシャルグループ	500
35	8355	静岡銀行	800
36	8377	ほくほくフィナンシャルグループ	800
37	8410	セブン銀行	3,100
38	8570	イオンフィナンシャルサービス	500
39	8591	オリックス	700
40	8593	三菱UFJリース	1,600
41	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	300
42	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	200
43	8766	東京海上ホールディングス	100
44	8795	T&Dホールディングス	700
45	9069	センコーグループホールディングス	1,100
46	9432	日本電信電話	200
47	9433	KDDI	400
48	9437	NTTドコモ	500
49	9513	電源開発	400
50	9532	大阪瓦斯	400

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
-----	-------	-----	----

以上

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 1498)  
問合せ先 業務プロセス管理部 鈴木 俊直  
TEL 03-6774-5065

## One ETF ESGに関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (令和元年11月12日現在)

888,061 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和元年11月12日現在)

11,643,260,291 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和元年11月12日現在)

13,111.00 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とFTSE Blossom Japan Indexの終値の変動率に係る乖離率  
(令和元年11月12日現在)

0.01 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[ \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{FTSE Blossom Japan Indexの終値}}{\text{前営業日のFTSE Blossom Japan Indexの終値}} \right] \times 100(\%)$$

5. 交換にかかる交換口数(別紙参照)

6. 設定にかかる株式のポートフォリオ(別紙参照)

## One ETF ESG

日付	FTSE Blossom Japan Index		One ETF ESG				
	指数終値	日次騰落率	一口あたりの 純資産額	日次騰落率	乖離率	上場受益権口数	純資産総額
2019/10/11	120.94	1.16%	12,250.00	1.16%	-0.01%	884,071	10,829,645,265
2019/10/15	122.86	1.59%	12,444.00	1.58%	-0.00%	884,071	11,000,947,869
2019/10/16	123.78	0.75%	12,536.00	0.74%	-0.01%	884,071	11,082,663,674
2019/10/17	123.37	-0.33%	12,494.00	-0.34%	-0.00%	884,071	11,045,625,529
2019/10/18	123.16	-0.17%	12,472.00	-0.18%	-0.01%	884,071	11,026,528,574
2019/10/21	123.78	0.50%	12,535.00	0.51%	0.00%	884,071	11,082,128,114
2019/10/23	124.53	0.61%	12,611.00	0.61%	-0.01%	884,071	11,149,317,742
2019/10/24	125.14	0.49%	12,673.00	0.49%	0.00%	884,071	11,204,198,946
2019/10/25	125.41	0.21%	12,700.00	0.21%	-0.00%	884,071	11,227,495,912
2019/10/28	125.40	-0.01%	12,699.00	-0.01%	-0.00%	888,061	11,277,496,158
2019/10/29	126.45	0.83%	12,805.00	0.83%	0.00%	888,061	11,371,507,421
2019/10/30	126.52	0.06%	12,814.00	0.07%	0.01%	888,061	11,379,814,294
2019/10/31	126.53	0.00%	12,815.00	0.01%	0.00%	888,061	11,380,874,395
2019/11/1	126.20	-0.26%	12,783.00	-0.25%	0.01%	888,061	11,351,672,396
2019/11/5	128.50	1.83%	13,016.00	1.82%	-0.00%	888,061	11,558,877,200
2019/11/6	128.60	0.08%	13,025.00	0.07%	-0.01%	888,061	11,566,827,056
2019/11/7	129.02	0.33%	13,068.00	0.33%	0.00%	888,061	11,604,909,484
2019/11/8	129.23	0.16%	13,088.00	0.15%	-0.01%	888,061	11,623,072,500
2019/11/11	129.08	-0.11%	13,073.00	-0.11%	0.00%	888,061	11,609,302,118
2019/11/12	129.44	0.28%	13,111.00	0.29%	0.01%	888,061	11,643,260,291

### FTSE Blossom Japan Indexとは

FTSE Blossom Japan Indexは、ESG(環境、社会、ガバナンス) 要因への対応力が優れた企業で構成する株価指数で、FTSE International Limitedが2014年9月22日を基準値100として算出・公表するものです。ESG総合評価に用いる項目は、企業が行う事業活動毎に対応する業種、地域などの特性に合わせて決定されます。銘柄の選定は、市場参加者がステークホルダーシップ活動および対話(エンゲージメント)に活用できる明確なESG総合評価に基づいて行われます。構成銘柄の定期見直しは原則として年2回(6月、12月)行われます。

詳しくは、FTSE社のホームページ([http://www.ftserussell.com/blossom\\_japan](http://www.ftserussell.com/blossom_japan))をご確認ください。

### 指数の著作権等

FTSE International Limited ("FTSE") © FTSE 2017. "FTSE®" is a trade mark of the London Stock Exchange Group companies and is used by FTSE International Limited under licence. All rights in the FTSE indices and / or FTSE ratings vest in FTSE and/or its licensors. Neither FTSE nor its licensors accept any liability for any errors or omissions in the FTSE indices and / or FTSE ratings or underlying data and no party may rely on any FTSE indices, ratings and / or data underlying data contained in this communication. No further distribution of FTSE Data is permitted without FTSE's express written consent. FTSE does not promote, sponsor or endorse the content of this communication.

FTSE International Limited(以下、「FTSE」) © FTSE 2017. FTSE®は、London Stock Exchange Group企業が所有する商標であり、ライセンスに基づきFTSE International Limitedによって使用されています。FTSEのインデックスおよびFTSEの格付けに関する全ての権利はFTSEおよびライセンサ各社に帰属します。FTSEおよびライセンサ各社はFTSEのインデックスおよびFTSEの格付けまたは基礎データに関する瑕疵または不作為に対して如何なる責任も負いません。また、何人も本媒体に含まれるFTSEのインデックス、格付け、または基礎データに依存することは許されません。書面に基づくFTSEの同意がない限りFTSEのデータを再配信することは許されません。FTSEは本媒体の内容について販売促進や出資、保証することはありません。

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(令和元年11月18日)、交換受付日(令和元年11月18日)分の  
交換口数は以下の通りです。

交換口数 4,000 口以上 4000 口単位

## 設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(令和元年11月18日)、設定受付日(令和元年11月18日)分の  
設定ポートフォリオは以下の通りです。

なお、以下のポートフォリオは、最小設定口数となる設定ポートフォリオです。

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
1	1605	国際石油開発帝石	200
2	1801	大成建設	100
3	1802	大林組	200
4	1803	清水建設	100
5	1812	鹿島建設	100
6	1925	大和ハウス工業	100
7	1928	積水ハウス	100
8	2433	博報堂DYホールディングス	100
9	2502	アサヒグループホールディングス	100
10	2503	麒麟ホールディングス	200
11	2768	双日	300
12	2802	味の素	100
13	2914	日本たばこ産業	200
14	3003	ヒューリック	100
15	3289	東急不動産ホールディングス	100
16	3382	セブン&アイ・ホールディングス	300
17	3402	東レ	300
18	3405	クラレ	100
19	3407	旭化成	300
20	3861	王子ホールディングス	200
21	4005	住友化学	300
22	4063	信越化学工業	100
23	4151	協和キリン	100
24	4188	三菱ケミカルホールディングス	300
25	4204	積水化学工業	100
26	4324	電通	100
27	4452	花王	100
28	4502	武田薬品工業	300
29	4503	アステラス製薬	400
30	4523	エーザイ	100
31	4528	小野薬品工業	100
32	4536	参天製薬	100
33	4568	第一三共	100
34	4661	オリエンタルランド	100
35	4689	Zホールディングス	400
36	4755	楽天	300
37	4901	富士フイルムホールディングス	100
38	4902	ユニカミノルタ	100
39	4911	資生堂	100
40	5020	JXTGホールディングス	500
41	5108	ブリヂストン	100
42	5401	日本製鉄	200
43	5802	住友電気工業	100
44	5803	フジクラ	100
45	5938	LIXILグループ	100
46	6098	リクルートホールディングス	300
47	6301	小松製作所	200
48	6326	クボタ	300
49	6367	ダイキン工業	100
50	6471	日本精工	100

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
51	6472	NTN	100
52	6502	東芝	100
53	6503	三菱電機	500
54	6594	日本電産	100
55	6752	パナソニック	400
56	6758	ソニー	200
57	6841	横河電機	100
58	6902	デンソー	100
59	6981	村田製作所	100
60	7011	三菱重工業	100
61	7201	日産自動車	400
62	7203	トヨタ自動車	500
63	7205	日野自動車	100
64	7261	マツダ	100
65	7269	スズキ	100
66	7272	ヤマハ発動機	100
67	7731	ニコン	100
68	7733	オリンパス	200
69	7751	キヤノン	200
70	7752	リコー	100
71	7911	凸版印刷	100
72	7912	大日本印刷	100
73	8002	丸紅	400
74	8031	三井物産	400
75	8053	住友商事	300
76	8058	三菱商事	300
77	8113	ユニ・チャーム	100
78	8252	丸井グループ	100
79	8267	イオン	300
80	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,400
81	8308	りそなホールディングス	400
82	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	100
83	8316	三井住友フィナンシャルグループ	300
84	8411	みずほフィナンシャルグループ	4,900
85	8572	アコム	100
86	8593	三菱UFJリース	100
87	8601	大和証券グループ本社	300
88	8604	野村ホールディングス	600
89	8630	SOMPOホールディングス	100
90	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	100
91	8750	第一生命ホールディングス	200
92	8766	東京海上ホールディングス	100
93	8795	T&Dホールディングス	100
94	8801	三井不動産	200
95	8802	三菱地所	200
96	9021	西日本旅客鉄道	100
97	9432	日本電信電話	200
98	9433	KDDI	500
99	9437	NTTドコモ	300
100	9531	東京瓦斯	200
101	9532	大阪瓦斯	200
102	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	100

以上

[掲載番号：8]  
各位

令和元年11月13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 業務プロセス管理部 鈴木 俊直  
TEL 03-6774-5065

## 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 (令和元年11月12日現在)	<u>510,000</u> 口
2.上場ETFの純資産総額 (令和元年11月12日現在)	<u>498,899,807</u> 円
3.上場ETFの1口あたりの純資産額 (令和元年11月12日現在)	<u>978</u> 円
4.上場ETFの1口あたりの純資産額とCSI スモールキャップ 500指数(円換算ベース)の 終値の変動率に係る乖離率 (令和元年11月12日現在)	<u>-0.09</u> %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[ \frac{\text{上場ETFの1口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの1口あたりの純資産額}} - \frac{\text{前営業日のCSI スモールキャップ 500指数終値} \times \text{当日のTTMレート(中国元/円)}}{\text{前々営業日のCSI スモールキャップ 500指数終値} \times \text{前営業日のTTMレート(中国元/円)}} \right] \times 100(\%)$$

### 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教化したものです。

### 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、いかなる責任をも負いません。

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 2556)  
問合せ先 業務プロセス管理部 鈴木 俊直  
TEL 03-6774-5065

## One ETF 東証REIT指数に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (令和元年11月12日現在)

9,832,600 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和元年11月12日現在)

21,024,486,149 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和元年11月12日現在)

2,138.24 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と東証REIT指数の終値の変動率に係る乖離率  
(令和元年11月12日現在)

0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[ \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{東証REIT指数の終値}}{\text{前営業日の東証REIT指数の終値}} \right] \times 100(\%)$$

5. 交換にかかる交換口数(別紙参照)

6. 設定にかかる株式のポートフォリオ(別紙参照)



## One ETF 東証REIT指数

日付	東証REIT指数		One ETF 東証REIT指数				
	指数終値	日次騰落率	一口あたりの 純資産額	日次騰落率	乖離率	上場受益権口数	純資産総額
2019/10/11	2,224.58	-0.05%	2,234.04	-0.05%	-0.00%	7,091,400	15,842,468,009
2019/10/15	2,221.04	-0.16%	2,230.44	-0.16%	-0.00%	7,389,500	16,481,872,940
2019/10/16	2,244.59	1.06%	2,254.08	1.06%	-0.00%	7,687,600	17,328,468,319
2019/10/17	2,238.95	-0.25%	2,248.41	-0.25%	-0.00%	7,985,700	17,955,093,164
2019/10/18	2,231.16	-0.35%	2,240.59	-0.35%	0.00%	7,985,700	17,892,647,421
2019/10/21	2,254.07	1.03%	2,263.55	1.02%	-0.00%	7,985,700	18,076,050,546
2019/10/23	2,254.28	0.01%	2,263.74	0.01%	-0.00%	7,985,700	18,077,571,987
2019/10/24	2,243.28	-0.49%	2,252.69	-0.49%	-0.00%	7,985,700	17,989,281,430
2019/10/25	2,242.87	-0.02%	2,252.26	-0.02%	-0.00%	8,462,100	19,058,818,795
2019/10/28	2,242.39	-0.02%	2,251.75	-0.02%	-0.00%	8,462,100	19,054,498,537
2019/10/29	2,252.67	0.46%	2,262.04	0.46%	-0.00%	8,462,100	19,141,648,241
2019/10/30	2,239.13	-0.60%	2,252.49	-0.42%	0.18%	8,462,100	19,060,787,721
2019/10/31	2,245.01	0.26%	2,258.39	0.26%	-0.00%	8,462,100	19,110,692,175
2019/11/1	2,254.64	0.43%	2,268.05	0.43%	-0.00%	8,462,100	19,192,484,148
2019/11/5	2,257.08	0.11%	2,270.46	0.11%	-0.00%	8,521,800	19,348,385,698
2019/11/6	2,229.29	-1.23%	2,242.50	-1.23%	-0.00%	8,997,800	20,177,606,458
2019/11/7	2,232.72	0.15%	2,245.94	0.15%	-0.00%	8,997,800	20,208,505,130
2019/11/8	2,175.11	-2.58%	2,187.99	-2.58%	0.00%	9,415,700	20,601,472,006
2019/11/11	2,168.21	-0.32%	2,181.02	-0.32%	-0.00%	9,713,600	21,185,574,216
2019/11/12	2,125.68	-1.96%	2,138.24	-1.96%	0.00%	9,832,600	21,024,486,149

### 東証REIT指数とは

東証REIT指数とは、東京証券取引所に上場している不動産投資信託全銘柄を算出対象とした時価総額加重型の指数で、2003年3月31日の時価総額を1,000ポイントとして、東京証券取引所が算出・公表しています。

### 指数の著作権等

- ① 東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所(以下「㈱東京証券取引所」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。
- ② ㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ③ ㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ ㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤ 当ファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ ㈱東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
- ⑦ ㈱東京証券取引所は、委託会社または当ファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ⑧ 以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(令和元年11月18日)、交換受付日(令和元年11月18日)分の交換口数は以下の通りです。

交換口数 6 万口以上 6 万口単位

## 設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(令和元年11月18日)、設定受付日(令和元年11月18日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

なお、以下のポートフォリオは、最小設定口数となる設定ポートフォリオです。

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
1	2971	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	1
2	2972	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	2
3	3226	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	4
4	3227	MCUBS MidCity投資法人 投資証券	14
5	3234	森ヒルズリート投資法人 投資証券	13
6	3249	産業ファンド投資法人 投資証券	14
7	3269	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	11
8	3278	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	7
9	3279	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	6
10	3281	GLP投資法人 投資証券	29
11	3282	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	5
12	3283	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	17
13	3287	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	2
14	3290	Oneリート投資法人 投資証券	2
15	3292	イオンリート投資法人 投資証券	13
16	3295	ヒューリックリート投資法人 投資証券	10
17	3296	日本リート投資法人 投資証券	4
18	3298	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	75
19	3308	日本ヘルスケア投資法人 投資証券	1
20	3309	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	34
21	3451	トーセイ・リート投資法人 投資証券	3
22	3453	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	5
23	3455	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	3
24	3459	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	2
25	3462	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	37
26	3463	いちごホテルリート投資法人 投資証券	2
27	3466	ラサールロジポート投資法人 投資証券	11
28	3468	スターアジア不動産投資法人 投資証券	4
29	3470	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	1
30	3471	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	3
31	3472	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	2
32	3473	さくら総合リート投資法人 投資証券	3
33	3476	投資法人みらい 投資証券	13
34	3478	森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	3
35	3481	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	2
36	3487	CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2
37	3488	ザイマックス・リート投資法人 投資証券	2
38	3492	タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	3
39	3493	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	2
40	8951	日本ビルファンド投資法人 投資証券	11
41	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	12
42	8953	日本リートールファンド投資法人 投資証券	22
43	8954	オリックス不動産投資法人 投資証券	23
44	8955	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	7
45	8956	プレミア投資法人 投資証券	11
46	8957	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	8
47	8958	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	8
48	8960	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	26
49	8961	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	8
50	8963	インヴィンシブル投資法人 投資証券	51

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
51	8964	フロンティア不動産投資法人 投資証券	4
52	8966	平和不動産リート投資法人 投資証券	7
53	8967	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	8
54	8968	福岡リート投資法人 投資証券	6
55	8972	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	4
56	8975	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	9
57	8976	大和証券オフィス投資法人 投資証券	3
58	8977	阪急阪神リート投資法人 投資証券	5
59	8979	スターツプロシード投資法人 投資証券	2
60	8984	大和ハウスリート投資法人 投資証券	16
61	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	38
62	8986	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	13
63	8987	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	11

以上

各位

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  
(令和元年11月12日現在)

14,260 口

2. 上場ETFの純資産総額  
(令和元年11月12日現在)

66,703,511 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額  
(令和元年11月12日現在)

4,678 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  
(令和元年11月12日現在)

0.00 %

### 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。