

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2年1月9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	One ETF 日経225	1369	東
2	One ETF トピックス	1473	東
3	One ETF JPX日経400	1474	東
4	One ETF JPX/S&P 設備・人材投資指数	1484	東
5	One ETF JPX日経中小型	1493	東
6	One ETF 高配当日本株	1494	東
7	One ETF ESG	1498	東
8	One ETF 南方 中国A株 CSI500	2553	東
9	One ETF 東証REIT指数	2556	東
10	One ETF 国内金先物	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していただくと、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2年1月9日現在)

9,370,922 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年1月9日現在)

222,270,275,337 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年1月9日現在)

23,719 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2年1月9日現在)

-0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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
2019/12/9	23,430.70	0.33%	23,596	0.32%	-0.01%	11,304,250	266,736,794,559
2019/12/10	23,410.19	-0.09%	23,576	-0.08%	0.00%	11,304,250	266,508,255,822
2019/12/11	23,391.86	-0.08%	23,556	-0.08%	-0.01%	11,304,250	266,285,987,177
2019/12/12	23,424.81	0.14%	23,590	0.14%	0.00%	11,304,250	266,670,629,837
2019/12/13	24,023.10	2.55%	24,192	2.55%	-0.00%	11,304,250	273,472,070,529
2019/12/16	23,952.35	-0.29%	24,121	-0.29%	0.00%	11,304,250	272,672,661,654
2019/12/17	24,066.12	0.47%	24,235	0.47%	-0.00%	11,194,014	271,285,966,733
2019/12/18	23,934.43	-0.55%	24,101	-0.55%	-0.01%	11,194,014	269,786,496,929
2019/12/19	23,864.85	-0.29%	24,032	-0.29%	0.00%	11,910,796	286,243,118,329
2019/12/20	23,816.63	-0.20%	23,983	-0.20%	-0.00%	12,351,868	296,229,466,432
2019/12/23	23,821.11	0.02%	23,987	0.02%	-0.00%	12,903,218	309,511,142,663
2019/12/24	23,830.58	0.04%	23,997	0.04%	0.00%	13,123,766	314,924,900,268
2019/12/25	23,782.87	-0.20%	23,948	-0.20%	-0.00%	13,123,766	314,292,042,532
2019/12/26	23,924.92	0.60%	24,091	0.60%	-0.00%	11,084,251	267,028,963,375
2019/12/27	23,837.72	-0.36%	24,044	-0.20%	0.17%	11,084,251	266,512,364,506
2019/12/30	23,656.62	-0.76%	23,861	-0.76%	-0.00%	10,204,283	243,482,946,670
2020/1/6	23,204.86	-1.91%	23,403	-1.92%	-0.01%	10,204,283	238,806,994,366
2020/1/7	23,575.72	1.60%	23,777	1.60%	-0.00%	10,204,283	242,624,047,796
2020/1/8	23,204.76	-1.57%	23,185	-2.49%	-0.92%	10,204,283	236,581,624,374
2020/1/9	23,739.87	2.31%	23,719	2.30%	-0.00%	9,370,922	222,270,275,337

交換にかかる交換口数

交換申込日(令和2年1月16日)、交換受付日(令和2年1月16日)分の
交換口数は以下の通りです。

交換口数 55,800 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2年1月16日)、設定受付日(令和2年1月16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	電通グループ	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	800
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2年1月9日現在)

117,993,722 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年1月9日現在)

205,203,250,092 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年1月9日現在)

1,739.10 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2年1月9日現在)

0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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
2019/12/9	1,722.07	0.51%	1,747.37	0.50%	-0.00%	114,922,322	200,812,014,091
2019/12/10	1,720.77	-0.08%	1,746.06	-0.07%	0.00%	114,922,322	200,661,486,877
2019/12/11	1,714.95	-0.34%	1,740.08	-0.34%	-0.00%	116,507,022	202,731,182,896
2019/12/12	1,712.83	-0.12%	1,737.97	-0.12%	0.00%	116,507,022	202,485,519,795
2019/12/13	1,739.98	1.59%	1,765.59	1.59%	0.00%	116,507,022	205,703,648,765
2019/12/16	1,736.87	-0.18%	1,762.37	-0.18%	-0.00%	116,507,022	205,328,366,335
2019/12/17	1,747.20	0.59%	1,772.84	0.59%	-0.00%	117,695,922	208,655,895,523
2019/12/18	1,738.40	-0.50%	1,763.81	-0.51%	-0.01%	117,894,522	207,943,794,278
2019/12/19	1,736.11	-0.13%	1,761.59	-0.13%	0.01%	117,894,522	207,681,537,780
2019/12/20	1,733.07	-0.18%	1,758.39	-0.18%	-0.01%	117,993,722	207,478,845,595
2019/12/23	1,729.42	-0.21%	1,754.75	-0.21%	0.00%	117,993,722	207,049,471,387
2019/12/24	1,728.22	-0.07%	1,753.51	-0.07%	-0.00%	117,993,722	206,903,113,999
2019/12/25	1,721.42	-0.39%	1,746.59	-0.39%	-0.00%	117,993,722	206,086,479,595
2019/12/26	1,731.20	0.57%	1,756.52	0.57%	0.00%	117,993,722	207,258,646,105
2019/12/27	1,733.18	0.11%	1,761.15	0.26%	0.15%	117,993,722	207,804,452,373
2019/12/30	1,721.36	-0.68%	1,749.12	-0.68%	-0.00%	117,993,722	206,385,695,033
2020/1/6	1,697.49	-1.39%	1,724.70	-1.40%	-0.01%	117,993,722	203,503,351,737
2020/1/7	1,725.05	1.62%	1,752.77	1.63%	0.00%	117,993,722	206,815,882,439
2020/1/8	1,701.40	-1.37%	1,711.25	-2.37%	-1.00%	117,993,722	201,916,253,501
2020/1/9	1,729.05	1.63%	1,739.10	1.63%	0.00%	117,993,722	205,203,250,092

交換にかかる交換口数

交換申込日(令和2年1月16日)、交換受付日(令和2年1月16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2年1月16日)、設定受付日(令和2年1月16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2年1月9日現在)

9,698,614 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年1月9日現在)

150,565,504,450 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年1月9日現在)

15,524 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2年1月9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
2019/12/9	15,376.11	0.49%	15,569	0.48%	-0.01%	9,698,614	151,000,793,967
2019/12/10	15,368.54	-0.05%	15,561	-0.05%	-0.00%	9,698,614	150,924,032,313
2019/12/11	15,318.07	-0.33%	15,510	-0.33%	0.00%	9,698,614	150,422,013,408
2019/12/12	15,303.49	-0.10%	15,496	-0.09%	0.00%	9,698,614	150,286,450,953
2019/12/13	15,555.58	1.65%	15,751	1.65%	-0.00%	9,698,614	152,766,029,758
2019/12/16	15,520.77	-0.22%	15,715	-0.23%	-0.00%	9,698,614	152,418,460,251
2019/12/17	15,614.91	0.61%	15,811	0.61%	0.00%	9,698,614	153,340,952,682
2019/12/18	15,536.15	-0.50%	15,730	-0.51%	-0.01%	9,698,614	152,555,292,507
2019/12/19	15,509.25	-0.17%	15,703	-0.17%	0.00%	9,698,614	152,298,031,033
2019/12/20	15,481.19	-0.18%	15,674	-0.18%	-0.00%	9,698,614	152,016,772,258
2019/12/23	15,459.98	-0.14%	15,653	-0.13%	0.00%	9,698,614	151,812,584,497
2019/12/24	15,450.08	-0.06%	15,642	-0.07%	-0.01%	9,698,614	151,709,957,889
2019/12/25	15,400.99	-0.32%	15,593	-0.31%	0.00%	9,698,614	151,226,683,708
2019/12/26	15,482.67	0.53%	15,676	0.53%	0.00%	9,698,614	152,031,726,988
2019/12/27	15,481.92	-0.00%	15,701	0.16%	0.16%	9,698,614	152,277,674,866
2019/12/30	15,376.38	-0.68%	15,593	-0.69%	-0.01%	9,698,614	151,232,323,072
2020/1/6	15,170.53	-1.34%	15,382	-1.35%	-0.01%	9,698,614	149,187,805,200
2020/1/7	15,412.52	1.60%	15,629	1.61%	0.01%	9,698,614	151,577,002,457
2020/1/8	15,207.36	-1.33%	15,275	-2.27%	-0.93%	9,698,614	148,141,646,430
2020/1/9	15,455.90	1.63%	15,524	1.63%	-0.00%	9,698,614	150,565,504,450

交換にかかる交換口数

交換申込日(令和2年1月16日)、交換受付日(令和2年1月16日)分の
交換口数は以下の通りです。

交換口数 10 万口以上 10 万口単位

設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(令和2年1月16日)、設定受付日(令和2年1月16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ポートフォリオです。

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
1	1332	日本水産	1,100
2	1333	マルハニチロ	200
3	1605	国際石油開発帝石	4,500
4	1719	安藤・間	700
5	1720	東急建設	300
6	1721	コムシスホールディングス	400
7	1801	大成建設	900
8	1802	大林組	2,600
9	1803	清水建設	2,600
10	1808	長谷工コーポレーション	1,000
11	1812	鹿島建設	2,000
12	1820	西松建設	200
13	1821	三井住友建設	600
14	1824	前田建設工業	600
15	1860	戸田建設	1,100
16	1861	熊谷組	100
17	1878	大東建託	300
18	1881	NIPPO	200
19	1893	五洋建設	1,000
20	1911	住友林業	700
21	1925	大和ハウス工業	2,500
22	1928	積水ハウス	2,800
23	1951	協和エクシオ	400
24	1959	九電工	200
25	2121	ミクシィ	200
26	2124	ジェイエイシーリクルートメント	100
27	2127	日本M&Aセンター	600
28	2146	UTグループ	100
29	2175	エス・エム・エス	200
30	2181	パーソルホールディングス	800
31	2201	森永製菓	200
32	2206	江崎グリコ	200
33	2229	カルビー	400
34	2267	ヤクルト本社	600
35	2269	明治ホールディングス	500
36	2282	日本ハム	300
37	2327	日鉄ソリューションズ	100
38	2331	総合警備保障	300
39	2337	いちご	1,000
40	2371	カカクコム	600
41	2379	ディップ	100
42	2412	ベネフィット・ワン	300
43	2413	エムスリー	1,700
44	2427	アウトソーシング	400
45	2432	ディー・エヌ・エー	400
46	2433	博報堂DYホールディングス	1,100
47	2502	アサヒグループホールディングス	1,700
48	2503	キリンホールディングス	3,500
49	2587	サントリー食品インターナショナル	600
50	2651	ローソン	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
51	2670	エービーシー・マート	100
52	2702	日本マクドナルドホールディングス	300
53	2768	双日	4,500
54	2782	セリア	200
55	2784	アルフレッサ ホールディングス	900
56	2801	キッコーマン	600
57	2802	味の素	1,800
58	2809	キューピー	500
59	2815	アリアケジャパン	100
60	2871	ニチレイ	400
61	2875	東洋水産	400
62	2897	日清食品ホールディングス	400
63	2914	日本たばこ産業	4,800
64	3003	ヒューリック	1,700
65	3038	神戸物産	300
66	3048	ビックカメラ	500
67	3064	MonotaRO	600
68	3086	J. フロント リテイリング	1,000
69	3088	マツモトキヨシホールディングス	300
70	3092	ZOZO	600
71	3107	ダイワボウホールディングス	100
72	3116	トヨタ紡織	200
73	3141	ウエルシアホールディングス	200
74	3148	クリエイトSDホールディングス	100
75	3167	TOKAIホールディングス	400
76	3197	すかいらーくホールディングス	900
77	3231	野村不動産ホールディングス	500
78	3254	プレサンスコーポレーション	100
79	3288	オープンハウス	200
80	3289	東急不動産ホールディングス	2,200
81	3291	飯田グループホールディングス	700
82	3360	シップヘルスケアホールディングス	100
83	3382	セブン&アイ・ホールディングス	3,200
84	3391	ツルハホールディングス	200
85	3401	帝人	700
86	3402	東レ	5,800
87	3405	クラレ	1,300
88	3407	旭化成	5,300
89	3436	SUMCO	1,000
90	3543	コメダホールディングス	200
91	3549	クスリのアオキホールディングス	100
92	3626	TIS	300
93	3659	ネクソン	2,300
94	3668	コロプラ	300
95	3738	ティーガイア	100
96	3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	200
97	3769	GMOペイメントゲートウェイ	100
98	3861	王子ホールディングス	3,400
99	4004	昭和電工	600
100	4005	住友化学	5,900
101	4021	日産化学	400
102	4042	東ソー	1,200
103	4043	トクヤマ	200
104	4061	デンカ	300
105	4063	信越化学工業	1,400
106	4088	エア・ウォーター	700
107	4091	大陽日酸	800
108	4151	協和キリン	800
109	4182	三菱瓦斯化学	800
110	4183	三井化学	700

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	4185	JSR	700
112	4188	三菱ケミカルホールディングス	5,400
113	4202	ダイセル	1,100
114	4204	積水化学工業	1,700
115	4206	アイカ工業	200
116	4208	宇部興産	400
117	4217	日立化成	400
118	4246	ダイキョーニシカワ	200
119	4307	野村総合研究所	1,300
120	4324	電通グループ	800
121	4403	日油	300
122	4452	花王	2,000
123	4502	武田薬品工業	5,200
124	4503	アステラス製薬	7,200
125	4506	大日本住友製薬	600
126	4507	塩野義製薬	1,000
127	4516	日本新薬	200
128	4519	中外製薬	900
129	4521	科研製薬	100
130	4523	エーザイ	1,000
131	4528	小野薬品工業	1,900
132	4530	久光製薬	200
133	4536	参天製薬	1,500
134	4543	テルモ	2,300
135	4555	沢井製薬	200
136	4568	第一三共	2,300
137	4578	大塚ホールディングス	1,600
138	4587	ペプチドリーム	400
139	4612	日本ペイントホールディングス	700
140	4613	関西ペイント	900
141	4631	DIC	300
142	4661	オリエンタルランド	800
143	4666	パーク24	400
144	4681	リゾートトラスト	400
145	4684	オービック	300
146	4689	Zホールディングス	11,100
147	4704	トレンドマイクロ	400
148	4716	日本オラクル	200
149	4732	ユー・エス・エス	900
150	4739	伊藤忠テクノソリューションズ	400
151	4751	サイバーエージェント	500
152	4755	楽天	3,700
153	4768	大塚商会	400
154	4819	デジタルガレージ	100
155	4849	エン・ジャパン	100
156	4902	ユニカミノルタ	1,800
157	4911	資生堂	1,600
158	4912	ライオン	1,100
159	4922	コーセー	200
160	4927	ポーラ・オルビスホールディングス	400
161	4967	小林製薬	200
162	5019	出光興産	900
163	5020	JXTGホールディングス	12,300
164	5021	コスモエネルギーホールディングス	200
165	5101	横浜ゴム	500
166	5108	ブリヂストン	2,500
167	5110	住友ゴム工業	700
168	5201	AGC	800
169	5233	太平洋セメント	500
170	5301	東海カーボン	900

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	5332	TOTO	600
172	5333	日本碍子	1,000
173	5334	日本特殊陶業	600
174	5393	ニチアス	200
175	5401	日本製鉄	3,600
176	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	2,200
177	5486	日立金属	900
178	5703	日本軽金属ホールディングス	2,100
179	5713	住友金属鉱山	1,000
180	5714	DOWAホールディングス	200
181	5801	古河電気工業	300
182	5802	住友電気工業	3,000
183	5929	三和ホールディングス	800
184	5947	リンナイ	200
185	5975	東プレ	200
186	6028	テクノプロ・ホールディングス	200
187	6098	リクルートホールディングス	5,600
188	6113	アマダホールディングス	1,000
189	6136	オーエスジー	400
190	6141	DMG森精機	500
191	6146	ディスコ	100
192	6201	豊田自動織機	700
193	6268	ナブテスコ	500
194	6269	三井海洋開発	100
195	6273	SMC	300
196	6301	小松製作所	3,700
197	6302	住友重機械工業	500
198	6305	日立建機	300
199	6324	ハーモニック・ドライブ・システムズ	200
200	6326	クボタ	4,400
201	6367	ダイキン工業	1,000
202	6383	ダイフク	400
203	6432	竹内製作所	100
204	6448	ブラザー工業	1,000
205	6463	TPR	100
206	6471	日本精工	1,500
207	6473	ジェイテクト	800
208	6479	ミネベアミツミ	1,500
209	6481	THK	500
210	6501	日立製作所	3,900
211	6503	三菱電機	8,200
212	6504	富士電機	500
213	6506	安川電機	900
214	6586	マキタ	1,100
215	6588	東芝テック	100
216	6594	日本電産	1,000
217	6641	日新電機	200
218	6645	オムロン	700
219	6701	日本電気	1,000
220	6702	富士通	800
221	6723	ルネサスエレクトロニクス	3,900
222	6724	セイコーエプソン	1,000
223	6728	アルバック	200
224	6750	エレコム	100
225	6752	パナソニック	9,400
226	6755	富士通ゼネラル	200
227	6758	ソニー	3,500
228	6762	TDK	400
229	6770	アルプスアルパイン	700
230	6806	ヒロセ電機	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
231	6841	横河電機	800
232	6845	アズビル	500
233	6849	日本光電工業	300
234	6856	堀場製作所	200
235	6857	アドバンテスト	600
236	6861	キーエンス	600
237	6869	シスメックス	600
238	6902	デンソー	1,800
239	6920	レーザーテック	300
240	6923	スタンレー電気	600
241	6952	カシオ計算機	700
242	6954	ファナック	800
243	6965	浜松ホトニクス	600
244	6971	京セラ	1,200
245	6976	太陽誘電	400
246	6981	村田製作所	2,400
247	6988	日東電工	600
248	7011	三菱重工業	1,400
249	7012	川崎重工業	600
250	7013	IHI	600
251	7148	FPG	200
252	7164	全国保証	200
253	7167	めぶきフィナンシャルグループ	4,200
254	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	4,800
255	7202	いすゞ自動車	2,400
256	7203	トヨタ自動車	3,100
257	7205	日野自動車	1,000
258	7259	アイシン精機	700
259	7261	マツダ	2,400
260	7267	本田技研工業	6,500
261	7269	スズキ	1,600
262	7270	SUBARU	2,500
263	7272	ヤマハ発動機	1,100
264	7276	小糸製作所	500
265	7282	豊田合成	300
266	7309	シマノ	300
267	7313	テイ・エス テック	200
268	7419	ノジマ	100
269	7453	良品計画	1,100
270	7458	第一興商	200
271	7459	メディパルホールディングス	900
272	7532	パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	1,900
273	7550	ゼンショーホールディングス	400
274	7564	ワークマン	100
275	7575	日本ライフライン	200
276	7606	ユナイテッドアローズ	100
277	7649	スギホールディングス	200
278	7701	島津製作所	1,000
279	7729	東京精密	100
280	7731	ニコン	1,300
281	7733	オリンパス	4,500
282	7735	SCREENホールディングス	100
283	7741	HOYA	1,600
284	7747	朝日インテック	900
285	7751	キヤノン	4,400
286	7832	バンダイナムコホールディングス	800
287	7846	パイロットコーポレーション	100
288	7867	タカラトミー	400
289	7951	ヤマハ	500
290	7956	ピジョン	500

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
291	7974	任天堂	500
292	7988	ニフコ	300
293	8001	伊藤忠商事	5,700
294	8002	丸紅	8,400
295	8015	豊田通商	900
296	8020	兼松	300
297	8028	ファミリーマート	600
298	8031	三井物産	7,100
299	8035	東京エレクトロン	500
300	8036	日立ハイテクノロジーズ	300
301	8053	住友商事	5,100
302	8056	日本ユニシス	300
303	8058	三菱商事	5,700
304	8088	岩谷産業	200
305	8111	ゴールドウイン	100
306	8113	ユニ・チャーム	1,600
307	8227	しまむら	100
308	8252	丸井グループ	700
309	8267	イオン	3,100
310	8273	イズミ	200
311	8279	ヤオコー	100
312	8282	ケーズホールディングス	800
313	8283	PALTAC	100
314	8303	新生銀行	600
315	8304	あおぞら銀行	500
316	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	41,100
317	8308	りそなホールディングス	8,900
318	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	1,500
319	8316	三井住友フィナンシャルグループ	5,400
320	8331	千葉銀行	2,800
321	8410	セブン銀行	2,700
322	8411	みずほフィナンシャルグループ	110,000
323	8424	芙蓉総合リース	100
324	8439	東京センチュリー	200
325	8473	SBIホールディングス	900
326	8570	イオンフィナンシャルサービス	500
327	8585	オリエン트コーポレーション	2,200
328	8591	オリックス	5,100
329	8593	三菱UFJリース	2,100
330	8601	大和証券グループ本社	6,500
331	8604	野村ホールディングス	14,200
332	8628	松井証券	500
333	8630	SOMPOホールディングス	1,500
334	8697	日本取引所グループ	2,300
335	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2,100
336	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	700
337	8750	第一生命ホールディングス	4,600
338	8766	東京海上ホールディングス	2,900
339	8795	T&Dホールディングス	2,400
340	8801	三井不動産	4,000
341	8802	三菱地所	5,700
342	8804	東京建物	900
343	8830	住友不動産	1,800
344	8850	スターツコーポレーション	100
345	8876	リログループ	400
346	8905	イオンモール	400
347	9001	東武鉄道	900
348	9003	相鉄ホールディングス	400
349	9005	東急	2,100
350	9007	小田急電鉄	1,200

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
351	9008	京王電鉄	400
352	9009	京成電鉄	600
353	9020	東日本旅客鉄道	1,400
354	9021	西日本旅客鉄道	700
355	9022	東海旅客鉄道	700
356	9024	西武ホールディングス	1,100
357	9041	近鉄グループホールディングス	800
358	9042	阪急阪神ホールディングス	1,000
359	9045	京阪ホールディングス	500
360	9048	名古屋鉄道	900
361	9062	日本通運	300
362	9064	ヤマトホールディングス	1,400
363	9065	山九	200
364	9086	日立物流	100
365	9201	日本航空	1,400
366	9202	ANAホールディングス	1,400
367	9404	日本テレビホールディングス	700
368	9432	日本電信電話	8,200
369	9433	KDDI	6,000
370	9435	光通信	100
371	9437	NTTドコモ	5,900
372	9502	中部電力	2,500
373	9503	関西電力	3,100
374	9506	東北電力	2,100
375	9508	九州電力	1,700
376	9513	電源開発	700
377	9531	東京瓦斯	1,600
378	9532	大阪瓦斯	1,600
379	9602	東宝	500
380	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	2,100
381	9627	アインホールディングス	100
382	9678	カナモト	100
383	9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	300
384	9697	カプコン	400
385	9706	日本空港ビルデング	300
386	9719	SCSK	200
387	9735	セコム	800
388	9744	メイテック	100
389	9766	コナミホールディングス	300
390	9810	日鉄物産	100
391	9843	ニトリホールディングス	300
392	9962	ミスミグループ本社	1,000
393	9983	ファーストリテイリング	100
394	9984	ソフトバンクグループ	3,900
395	9989	サンドラッグ	300

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2年1月9日現在)

30,036,571 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年1月9日現在)

48,899,780,309 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年1月9日現在)

1,628.01 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2年1月9日現在)

0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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
2019/12/9	1,623.06	0.45%	1,634.53	0.44%	-0.01%	29,937,771	48,934,334,376
2019/12/10	1,622.96	-0.01%	1,634.42	-0.01%	-0.00%	29,937,771	48,930,756,823
2019/12/11	1,618.41	-0.28%	1,629.72	-0.29%	-0.01%	29,937,771	48,790,101,039
2019/12/12	1,616.14	-0.14%	1,627.49	-0.14%	0.00%	29,937,771	48,723,311,595
2019/12/13	1,639.79	1.46%	1,651.41	1.47%	0.01%	29,937,771	49,439,574,013
2019/12/16	1,637.25	-0.15%	1,648.76	-0.16%	-0.01%	29,937,771	49,360,216,057
2019/12/17	1,646.48	0.56%	1,658.05	0.56%	-0.00%	29,937,771	49,638,176,604
2019/12/18	1,637.26	-0.56%	1,648.68	-0.57%	-0.01%	29,937,771	49,357,752,021
2019/12/19	1,631.50	-0.35%	1,643.06	-0.34%	0.01%	29,937,771	49,189,666,043
2019/12/20	1,626.76	-0.29%	1,638.22	-0.29%	-0.00%	29,937,771	49,044,532,279
2019/12/23	1,627.44	0.04%	1,638.85	0.04%	-0.00%	29,937,771	49,063,373,917
2019/12/24	1,625.53	-0.12%	1,636.91	-0.12%	-0.00%	30,036,571	49,167,289,974
2019/12/25	1,621.11	-0.27%	1,632.39	-0.28%	-0.00%	30,036,571	49,031,385,708
2019/12/26	1,629.07	0.49%	1,640.44	0.49%	0.00%	30,036,571	49,273,056,267
2019/12/27	1,627.49	-0.10%	1,641.81	0.08%	0.18%	30,036,571	49,314,296,451
2019/12/30	1,616.90	-0.65%	1,631.07	-0.65%	-0.00%	30,036,571	48,991,843,561
2020/1/6	1,595.18	-1.34%	1,608.93	-1.36%	-0.01%	30,036,571	48,326,590,683
2020/1/7	1,622.79	1.73%	1,636.80	1.73%	0.00%	30,036,571	49,163,767,961
2020/1/8	1,602.67	-1.24%	1,600.35	-2.23%	-0.99%	30,036,571	48,069,159,773
2020/1/9	1,630.35	1.73%	1,628.01	1.73%	0.00%	30,036,571	48,899,780,309

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も負いません。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2年1月16日)、交換受付日(令和2年1月16日)分の
交換口数は以下の通りです。

交換口数 50 万口以上 50 万口単位

設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(令和2年1月16日)、設定受付日(令和2年1月16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、50万口に相当する設定ポートフォリオです。

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
1	1414	ショーボンドホールディングス	200
2	1417	ミライト・ホールディングス	300
3	1719	安藤・間	600
4	1801	大成建設	1,100
5	1803	清水建設	2,700
6	1812	鹿島建設	2,400
7	1820	西松建設	200
8	1821	三井住友建設	500
9	1824	前田建設工業	500
10	1833	奥村組	100
11	1861	熊谷組	200
12	1878	大東建託	300
13	1925	大和ハウス工業	2,100
14	1928	積水ハウス	2,100
15	1942	関電工	300
16	1944	きんでん	700
17	2127	日本M&Aセンター	400
18	2201	森永製菓	200
19	2264	森永乳業	200
20	2269	明治ホールディングス	500
21	2282	日本ハム	300
22	2317	システナ	400
23	2331	総合警備保障	200
24	2371	カカクコム	500
25	2413	エムスリー	1,400
26	2433	博報堂DYホールディングス	1,400
27	2453	ジャパンベストレスキューシステム	100
28	2471	エスプール	100
29	2502	アサヒグループホールディングス	2,000
30	2531	宝ホールディングス	500
31	2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	600
32	2593	伊藤園	200
33	2670	エービーシー・マート	100
34	2730	エディオン	300
35	2768	双日	5,500
36	2784	アルフレッサ ホールディングス	900
37	2801	キッコーマン	500
38	2802	味の素	1,700
39	2811	カゴメ	200
40	2871	ニチレイ	500
41	2875	東洋水産	300
42	2897	日清食品ホールディングス	300
43	2914	日本たばこ産業	5,100
44	3003	ヒューリック	1,400
45	3038	神戸物産	200
46	3048	ビックカメラ	400
47	3053	ペッパーフードサービス	100
48	3088	マツモトキヨシホールディングス	300
49	3092	ZOZO	700
50	3098	ココカラファイン	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	3099	三越伊勢丹ホールディングス	1,400
52	3141	ウエルシアホールディングス	200
53	3186	ネクステージ	100
54	3250	エー・ディー・ワークス	1,800
55	3291	飯田グループホールディングス	900
56	3382	セブン&アイ・ホールディングス	3,800
57	3391	ツルハホールディングス	200
58	3397	トリドールホールディングス	100
59	3401	帝人	600
60	3402	東レ	5,800
61	3543	コメダホールディングス	200
62	3563	スシローグローバルホールディングス	100
63	3632	グリーン	700
64	3659	ネクソン	2,100
65	3673	ブロードリーフ	400
66	3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	200
67	4021	日産化学	300
68	4063	信越化学工業	1,000
69	4091	大陽日酸	500
70	4189	KHネオケム	100
71	4204	積水化学工業	1,600
72	4206	アイカ工業	300
73	4307	野村総合研究所	1,200
74	4324	電通グループ	800
75	4452	花王	1,900
76	4502	武田薬品工業	7,100
77	4506	大日本住友製薬	600
78	4519	中外製薬	900
79	4521	科研製薬	100
80	4523	エーザイ	1,000
81	4528	小野薬品工業	1,900
82	4536	参天製薬	1,300
83	4544	みらかホールディングス	200
84	4568	第一三共	2,300
85	4613	関西ペイント	700
86	4661	オリエンタルランド	700
87	4666	パーク24	300
88	4676	フジ・メディア・ホールディングス	700
89	4680	ラウンドワン	200
90	4684	オービック	300
91	4714	リソー教育	400
92	4716	日本オラクル	200
93	4755	楽天	3,100
94	4768	大塚商会	500
95	4901	富士フイルムホールディングス	1,600
96	4902	ユニカミノルタ	2,300
97	4911	資生堂	2,300
98	4912	ライオン	1,100
99	4922	コーセー	100
100	4967	小林製薬	200
101	4974	タカラバイオ	200
102	5108	ブリヂストン	2,400
103	5233	太平洋セメント	400
104	5332	TOTO	600
105	5423	東京製鐵	300
106	5444	大和工業	100
107	5711	三菱マテリアル	400
108	5857	アサヒホールディングス	100
109	5929	三和ホールディングス	600
110	5938	LIXILグループ	1,100

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	6028	テクノプロ・ホールディングス	200
112	6098	リクルートホールディングス	5,100
113	6367	ダイキン工業	1,000
114	6370	栗田工業	400
115	6586	マキタ	800
116	6701	日本電気	1,400
117	6724	セイコーエプソン	900
118	6810	マクセルホールディングス	200
119	6845	アズビル	400
120	6861	キーエンス	900
121	6869	シスメックス	700
122	6952	カシオ計算機	700
123	6971	京セラ	1,100
124	7011	三菱重工業	1,100
125	7164	全国保証	300
126	7181	かんぽ生命保険	300
127	7182	ゆうちょ銀行	1,700
128	7198	アルヒ	100
129	7201	日産自動車	8,400
130	7203	トヨタ自動車	5,100
131	7267	本田技研工業	7,400
132	7453	良品計画	900
133	7459	メディバルホールディングス	600
134	7518	ネットワンシステムズ	300
135	7581	サイゼリヤ	100
136	7606	ユナイテッドアローズ	100
137	7649	スギホールディングス	200
138	7731	ニコン	1,200
139	7733	オリンパス	3,400
140	7741	HOYA	1,300
141	7911	凸版印刷	1,100
142	7936	アシックス	500
143	7951	ヤマハ	400
144	7956	ピジョン	400
145	7974	任天堂	500
146	8001	伊藤忠商事	8,400
147	8031	三井物産	8,300
148	8035	東京エレクトロン	600
149	8036	日立ハイテクノロジーズ	200
150	8053	住友商事	4,400
151	8058	三菱商事	5,900
152	8129	東邦ホールディングス	200
153	8227	しまむら	100
154	8233	高島屋	600
155	8267	イオン	2,700
156	8283	PALTAC	100
157	8308	りそなホールディングス	7,300
158	8572	アコム	1,400
159	8715	アニコム ホールディングス	100
160	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	3,200
161	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	800
162	8766	東京海上ホールディングス	4,300
163	8804	東京建物	700
164	8876	リログループ	400
165	9009	京成電鉄	600
166	9041	近鉄グループホールディングス	600
167	9064	ヤマトホールディングス	1,000
168	9065	山九	200
169	9076	セイノーホールディングス	500
170	9086	日立物流	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
171	9143	SGホールディングス	800
172	9202	ANAホールディングス	1,700
173	9432	日本電信電話	11,700
174	9435	光通信	100
175	9437	NTTドコモ	5,300
176	9501	東京電力ホールディングス	4,900
177	9503	関西電力	3,300
178	9531	東京瓦斯	1,400
179	9532	大阪瓦斯	1,500
180	9601	松竹	100
181	9602	東宝	500
182	9603	エイチ・アイ・エス	100
183	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	2,300
184	9627	アインホールディングス	100
185	9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	300
186	9716	乃村工藝社	500
187	9744	メイテック	100
188	9749	富士ソフト	100
189	9766	コナミホールディングス	200
190	9783	ベネッセホールディングス	200
191	9830	トラスコ中山	100
192	9831	ヤマダ電機	2,400
193	9832	オートバックスセブン	200
194	9983	ファーストリテイリング	100
195	9987	スズケン	300

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2年1月9日現在)

662,195 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年1月9日現在)

9,748,113,516 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年1月9日現在)

14,721 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2年1月9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
2019/12/9	14,936.65	0.32%	14,972	0.31%	-0.00%	666,167	9,973,815,236
2019/12/10	14,976.21	0.26%	15,010	0.25%	-0.01%	666,167	9,999,244,260
2019/12/11	14,884.39	-0.61%	14,918	-0.61%	0.00%	666,167	9,938,000,382
2019/12/12	14,785.72	-0.66%	14,822	-0.64%	0.02%	666,167	9,873,889,347
2019/12/13	14,872.70	0.59%	14,914	0.62%	0.03%	666,167	9,934,976,534
2019/12/16	14,862.86	-0.07%	14,902	-0.08%	-0.01%	666,167	9,927,313,304
2019/12/17	14,954.20	0.61%	14,993	0.61%	-0.00%	666,167	9,988,006,939
2019/12/18	14,858.00	-0.64%	14,896	-0.65%	-0.00%	666,167	9,923,368,054
2019/12/19	14,856.96	-0.01%	14,896	0.00%	0.01%	666,167	9,923,062,344
2019/12/20	14,890.79	0.23%	14,926	0.20%	-0.03%	662,195	9,884,219,340
2019/12/23	14,838.43	-0.35%	14,875	-0.34%	0.01%	662,195	9,850,068,008
2019/12/24	14,882.88	0.30%	14,917	0.28%	-0.02%	662,195	9,878,249,987
2019/12/25	14,816.55	-0.45%	14,851	-0.44%	0.00%	662,195	9,834,085,826
2019/12/26	14,900.74	0.57%	14,935	0.57%	-0.00%	662,195	9,889,884,890
2019/12/27	14,952.56	0.35%	15,012	0.52%	0.17%	662,195	9,941,106,640
2019/12/30	14,825.34	-0.85%	14,885	-0.85%	0.00%	662,195	9,856,632,635
2020/1/6	14,587.06	-1.61%	14,644	-1.62%	-0.01%	662,195	9,697,020,058
2020/1/7	14,835.65	1.70%	14,893	1.70%	-0.00%	662,195	9,862,318,695
2020/1/8	14,566.24	-1.82%	14,520	-2.50%	-0.69%	662,195	9,615,110,327
2020/1/9	14,766.32	1.37%	14,721	1.38%	0.01%	662,195	9,748,113,516

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2年1月16日)、交換受付日(令和2年1月16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2年1月16日)、設定受付日(令和2年1月16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	飛島建設	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	ビーネックスグループ	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	200
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	6080	M&Aキャピタルパートナーズ	100
105	6089	ウィルグループ	100
106	6101	ツガミ	300
107	6183	ベルシステム24ホールディングス	200
108	6191	エアトリ	100
109	6196	ストライク	100
110	6197	ソラスト	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
111	6258	平田機工	100
112	6266	タツモ	100
113	6323	ローツェ	100
114	6340	澁谷工業	100
115	6364	北越工業	100
116	6379	レイズネクスト	200
117	6406	フジテック	500
118	6409	キトー	100
119	6420	フクシマガリレイ	100
120	6432	竹内製作所	200
121	6440	JUKI	200
122	6463	TPR	200
123	6464	ツバキ・ナカシマ	300
124	6486	イーグル工業	200
125	6630	ヤーマン	200
126	6641	日新電機	300
127	6670	MCJ	400
128	6787	メイコー	100
129	6817	スミダコーポレーション	100
130	6877	OBARA GROUP	100
131	7148	FPG	400
132	7172	ジャパンインベストメントアドバイザー	100
133	7177	GMOフィナンシャルホールディングス	300
134	7220	武蔵精密工業	300
135	7244	市光工業	200
136	7256	河西工業	200
137	7419	ノジマ	300
138	7593	VTホールディングス	600
139	7606	ユナイテッドアローズ	100
140	7611	ハイデイ日高	200
141	7613	シークス	200
142	7679	薬王堂ホールディングス	100
143	7717	ブイ・テクノロジー	100
144	7718	スター精密	200
145	7839	SHOEI	100
146	7844	マーベラス	200
147	7943	ニチハ	200
148	8020	兼松	500
149	8051	山善	600
150	8074	ユアサ商事	100
151	8096	兼松エレクトロニクス	100
152	8133	伊藤忠エネクス	300
153	8255	アクシアル リテイリング	200
154	8739	スパークス・グループ	700
155	8771	イー・ギャランティ	200
156	8841	テーオーシー	300
157	8890	レーサム	100
158	8892	日本エスコン	300
159	8897	タカラレーベン	700
160	8909	シノケングループ	200
161	8920	東祥	100
162	8923	トーセイ	200
163	8934	サンフロンティア不動産	200
164	8935	エフ・ジェー・ネクスト	100
165	9037	ハマキョウレックス	100
166	9058	トランコム	100
167	9069	センコーグループホールディングス	800
168	9267	Genky DrugStores	100
169	9422	コネクシオ	100
170	9514	エフオン	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
171	9517	イーレックス	200
172	9678	カナモト	200
173	9682	DTS	300
174	9699	西尾レントオール	100
175	9743	丹青社	300
176	9790	福井コンピュータホールディングス	100
177	9928	ミロク情報サービス	100
178	9974	ベルク	100

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 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2年1月9日現在)

763,982 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年1月9日現在)

14,274,656,559 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年1月9日現在)

18,685 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2年1月9日現在)

0.02 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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
2019/12/9	186.35	0.90%	18,723	0.89%	-0.02%	772,924	14,471,397,516
2019/12/10	185.83	-0.28%	18,671	-0.28%	0.00%	772,924	14,431,414,177
2019/12/11	185.54	-0.16%	18,640	-0.17%	-0.01%	772,924	14,407,064,837
2019/12/12	184.94	-0.32%	18,582	-0.31%	0.01%	772,924	14,362,108,585
2019/12/13	187.70	1.49%	18,859	1.49%	0.00%	772,924	14,576,866,959
2019/12/16	187.46	-0.13%	18,834	-0.13%	-0.01%	772,924	14,557,342,288
2019/12/17	189.10	0.88%	18,998	0.87%	-0.01%	772,924	14,683,671,108
2019/12/18	188.50	-0.32%	18,935	-0.33%	-0.01%	772,924	14,635,283,542
2019/12/19	188.05	-0.24%	18,892	-0.23%	0.01%	772,924	14,601,765,295
2019/12/20	188.16	0.05%	18,899	0.04%	-0.02%	769,942	14,551,217,496
2019/12/23	187.72	-0.23%	18,856	-0.23%	0.01%	769,942	14,517,704,916
2019/12/24	187.27	-0.24%	18,811	-0.24%	-0.00%	769,942	14,483,380,264
2019/12/25	186.17	-0.59%	18,701	-0.58%	0.00%	769,942	14,398,755,824
2019/12/26	187.22	0.57%	18,807	0.57%	0.00%	769,942	14,480,011,513
2019/12/27	188.11	0.47%	18,915	0.57%	0.10%	769,942	14,563,626,239
2019/12/30	186.89	-0.65%	18,792	-0.65%	-0.00%	763,982	14,356,673,271
2020/1/6	184.61	-1.22%	18,559	-1.24%	-0.02%	763,982	14,178,695,542
2020/1/7	186.80	1.19%	18,782	1.20%	0.02%	763,982	14,348,942,542
2020/1/8	183.66	-1.68%	18,467	-1.68%	0.01%	763,982	14,108,549,969
2020/1/9	185.79	1.16%	18,685	1.18%	0.02%	763,982	14,274,656,559

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2年1月16日)、交換受付日(令和2年1月16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2年1月16日)、設定受付日(令和2年1月16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	400
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2年1月9日現在)

895,922 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年1月9日現在)

11,736,704,162 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年1月9日現在)

13,100.00 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2年1月9日現在)

-0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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
2019/12/9	130.00	0.38%	13,166.00	0.38%	0.00%	888,061	11,692,110,465
2019/12/10	129.86	-0.10%	13,153.00	-0.10%	0.00%	888,061	11,680,269,409
2019/12/11	129.60	-0.21%	13,124.00	-0.22%	-0.01%	888,061	11,655,301,947
2019/12/12	129.55	-0.03%	13,120.00	-0.03%	0.00%	888,061	11,651,633,504
2019/12/13	131.95	1.85%	13,363.00	1.85%	-0.00%	888,061	11,867,174,900
2019/12/16	131.59	-0.27%	13,326.00	-0.28%	-0.00%	888,061	11,834,659,641
2019/12/17	132.25	0.50%	13,393.00	0.50%	0.00%	888,061	11,894,039,420
2019/12/18	131.55	-0.53%	13,322.00	-0.53%	-0.00%	888,061	11,830,492,706
2019/12/19	131.37	-0.14%	13,304.00	-0.14%	0.00%	888,061	11,814,815,830
2019/12/20	130.85	-0.40%	13,251.00	-0.40%	-0.00%	884,102	11,715,278,340
2019/12/23	130.81	-0.03%	13,247.00	-0.03%	-0.00%	884,102	11,711,997,291
2019/12/24	130.64	-0.13%	13,230.00	-0.13%	0.01%	884,102	11,696,367,832
2019/12/25	130.27	-0.28%	13,192.00	-0.29%	-0.00%	884,102	11,662,873,231
2019/12/26	130.93	0.51%	13,259.00	0.51%	0.00%	895,922	11,878,881,588
2019/12/27	130.85	-0.06%	13,273.00	0.11%	0.17%	895,922	11,891,202,746
2019/12/30	129.91	-0.72%	13,177.00	-0.72%	-0.00%	895,922	11,805,669,203
2020/1/6	128.20	-1.31%	13,003.00	-1.32%	-0.01%	895,922	11,649,637,723
2020/1/7	130.13	1.50%	13,199.00	1.51%	0.01%	895,922	11,825,138,474
2020/1/8	128.53	-1.23%	12,890.00	-2.34%	-1.11%	895,922	11,548,515,085
2020/1/9	130.62	1.63%	13,100.00	1.63%	-0.00%	895,922	11,736,704,162

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)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2年1月16日)、交換受付日(令和2年1月16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2年1月16日)、設定受付日(令和2年1月16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	1802	大林組	200
3	1803	清水建設	100
4	1812	鹿島建設	100
5	1925	大和ハウス工業	100
6	1928	積水ハウス	100
7	2002	日清製粉グループ本社	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	電通グループ	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	7762	シチズン時計	100
72	7911	凸版印刷	100
73	7912	大日本印刷	100
74	8001	伊藤忠商事	300
75	8002	丸紅	400
76	8031	三井物産	400
77	8053	住友商事	300
78	8058	三菱商事	300
79	8113	ユニ・チャーム	100
80	8252	丸井グループ	100
81	8267	イオン	300
82	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,400
83	8308	りそなホールディングス	400
84	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	100
85	8316	三井住友フィナンシャルグループ	200
86	8411	みずほフィナンシャルグループ	4,900
87	8572	アコム	100
88	8593	三菱UFJリース	100
89	8601	大和証券グループ本社	300
90	8604	野村ホールディングス	600
91	8630	SOMPOホールディングス	100
92	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	100
93	8750	第一生命ホールディングス	200
94	8766	東京海上ホールディングス	100
95	8795	T&Dホールディングス	100
96	8801	三井不動産	200
97	8802	三菱地所	200
98	9021	西日本旅客鉄道	100
99	9432	日本電信電話	300
100	9433	KDDI	400
101	9437	NTTドコモ	300
102	9531	東京瓦斯	200
103	9532	大阪瓦斯	200
104	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	100

以上

[掲載番号：8]
各位

令和2年1月10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2年1月9日現在)

510,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(令和2年1月9日現在)

562,733,803 円

3. 上場ETFの1口あたりの純資産額
(令和2年1月9日現在)

1,103 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2年1月9日現在)

-0.07 %

(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2年1月9日現在)

11,855,502 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年1月9日現在)

25,364,843,498 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年1月9日現在)

2,139.50 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2年1月9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
2019/12/9	2,176.54	-0.32%	2,194.01	-0.32%	-0.00%	12,097,602	26,542,235,244
2019/12/10	2,175.07	-0.07%	2,192.51	-0.07%	-0.00%	12,097,602	26,524,075,092
2019/12/11	2,159.12	-0.73%	2,176.42	-0.73%	-0.00%	12,097,602	26,329,476,612
2019/12/12	2,157.66	-0.07%	2,174.93	-0.07%	-0.00%	12,751,602	27,733,890,488
2019/12/13	2,127.11	-1.42%	2,144.13	-1.42%	-0.00%	12,751,602	27,341,085,012
2019/12/16	2,111.36	-0.74%	2,128.25	-0.74%	-0.00%	12,751,602	27,138,633,106
2019/12/17	2,111.58	0.01%	2,128.47	0.01%	-0.00%	13,049,202	27,774,842,644
2019/12/18	2,108.31	-0.15%	2,125.16	-0.16%	-0.00%	13,049,202	27,731,705,463
2019/12/19	2,120.01	0.55%	2,136.94	0.55%	-0.00%	13,049,202	27,885,400,130
2019/12/20	2,109.75	-0.48%	2,126.59	-0.48%	-0.00%	11,855,502	25,211,814,427
2019/12/23	2,117.84	0.38%	2,134.71	0.38%	-0.00%	11,855,502	25,308,096,560
2019/12/24	2,126.53	0.41%	2,143.45	0.41%	-0.00%	11,855,502	25,411,707,079
2019/12/25	2,142.99	0.77%	2,160.03	0.77%	-0.00%	11,855,502	25,608,239,318
2019/12/26	2,160.01	0.79%	2,177.15	0.79%	-0.00%	11,855,502	25,811,164,794
2019/12/27	2,148.57	-0.53%	2,174.87	-0.10%	0.42%	11,855,502	25,784,178,180
2019/12/30	2,145.49	-0.14%	2,171.82	-0.14%	0.00%	11,855,502	25,748,064,292
2020/1/6	2,150.98	0.26%	2,177.31	0.25%	-0.00%	11,855,502	25,813,126,336
2020/1/7	2,142.11	-0.41%	2,168.30	-0.41%	-0.00%	11,855,502	25,706,298,747
2020/1/8	2,118.07	-1.12%	2,127.76	-1.87%	-0.75%	11,855,502	25,225,702,752
2020/1/9	2,129.77	0.55%	2,139.50	0.55%	-0.00%	11,855,502	25,364,843,498

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2年1月16日)、交換受付日(令和2年1月16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2年1月16日)、設定受付日(令和2年1月16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	15
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	15
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	4
23	3455	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	2
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	38
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	10

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2年1月9日現在)

14,260 口

2. 上場ETFの純資産総額
(令和2年1月9日現在)

71,408,801 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(令和2年1月9日現在)

5,008 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2年1月9日現在)

0.01 %

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。