

各位

令和元年9月2日

会社名                    アセットマネジメントOne株式会社  
(管理会社コード    13694)  
代表者名                取締役社長    菅野   暁  
問合わせ先              業務プロセス管理部   鈴木   俊直  
TEL   03-6774-5065

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

アセットマネジメントOne株式会社を管理会社として上場するETF銘柄について、以下のとおり令和元年8月30日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(1銘柄)

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

以上

各位

令和元年9月2日

会社名 アセットマネジメントOne株式会社  
代表者名 取締役社長 菅野 暁  
(コード番号 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8月30日現在)

510,000 口

2.上場ETFの純資産総額  
(令和元年8月30日現在)

483,549,549 円

3.上場ETFの1口あたりの純資産額  
(令和元年8月30日現在)

948 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8月30日現在)

0.16 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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数化したものです。

指数の著作権等

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