

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24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24日現在)

11,260,369 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年1月24日現在)

268,048,319,032 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年1月24日現在)

23,805 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24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
2019/12/23	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
2020/1/10	23,850.57	0.47%	23,829	0.46%	-0.00%	9,370,922	223,304,159,200
2020/1/14	24,025.17	0.73%	24,004	0.73%	0.00%	9,370,922	224,937,539,304
2020/1/15	23,916.58	-0.45%	23,895	-0.45%	-0.00%	8,981,939	214,626,848,139
2020/1/16	23,933.13	0.07%	23,912	0.07%	0.00%	11,093,382	265,263,642,746
2020/1/17	24,041.26	0.45%	24,020	0.45%	-0.00%	11,065,589	265,790,796,481
2020/1/20	24,083.51	0.18%	24,062	0.17%	-0.00%	11,010,067	264,919,007,626
2020/1/21	23,864.56	-0.91%	23,843	-0.91%	-0.00%	10,898,974	259,859,190,364
2020/1/22	24,031.35	0.70%	24,009	0.70%	-0.00%	11,232,400	269,678,389,825
2020/1/23	23,795.44	-0.98%	23,773	-0.98%	-0.00%	11,482,465	272,970,546,806
2020/1/24	23,827.18	0.13%	23,805	0.13%	0.00%	11,260,369	268,048,319,032

交換にかかる交換口数

交換申込日(令和2年1月30日)、交換受付日(令和2年1月30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30日)、設定受付日(令和2年1月30日)分の
設定ポートフォリオは以下の通りです。

(注)備考欄に※のある銘柄については、金銭による設定(取得)のお申込みを受け付けます。(有価証券による設定(取得)のお申込みは受け付けません。)

No.	銘柄コード	銘柄名	株数	備考
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	1000	

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数	備考
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	備考
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	備考
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24日現在)

117,316,809 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年1月24日現在)

204,179,080,581 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年1月24日現在)

1,740.41 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24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
2019/12/23	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
2020/1/10	1,735.16	0.35%	1,745.18	0.35%	-0.00%	118,292,822	206,441,965,486
2020/1/14	1,740.53	0.31%	1,750.61	0.31%	0.00%	118,292,822	207,084,735,615
2020/1/15	1,731.06	-0.54%	1,741.09	-0.54%	0.00%	118,292,822	205,958,133,258
2020/1/16	1,728.72	-0.14%	1,738.73	-0.14%	-0.00%	118,292,822	205,679,266,308
2020/1/17	1,735.44	0.39%	1,745.49	0.39%	0.00%	118,292,822	206,478,808,600
2020/1/20	1,744.16	0.50%	1,754.26	0.50%	-0.00%	118,292,822	207,516,923,122
2020/1/21	1,734.97	-0.53%	1,745.00	-0.53%	-0.00%	116,320,509	202,978,941,752
2020/1/22	1,744.13	0.53%	1,754.21	0.53%	-0.00%	117,316,809	205,798,143,454
2020/1/23	1,730.50	-0.78%	1,740.43	-0.79%	-0.00%	117,316,809	204,181,173,398
2020/1/24	1,730.44	-0.00%	1,740.41	-0.00%	0.00%	117,316,809	204,179,080,581

交換にかかる交換口数

交換申込日(令和2年1月30日)、交換受付日(令和2年1月30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30日)、設定受付日(令和2年1月30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24日現在)

9,827,830 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年1月24日現在)

152,964,440,943 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年1月24日現在)

15,564 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24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
2019/12/23	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
2020/1/10	15,518.71	0.41%	15,587	0.41%	-0.00%	9,698,614	151,170,080,176
2020/1/14	15,583.91	0.42%	15,653	0.42%	0.00%	9,698,614	151,808,395,635
2020/1/15	15,493.98	-0.58%	15,562	-0.58%	-0.00%	9,728,299	151,391,879,816
2020/1/16	15,480.75	-0.09%	15,548	-0.09%	-0.00%	9,728,299	151,259,788,882
2020/1/17	15,543.62	0.41%	15,612	0.41%	0.01%	9,728,299	151,877,001,862
2020/1/20	15,619.10	0.49%	15,688	0.49%	0.00%	9,728,299	152,613,176,312
2020/1/21	15,517.25	-0.65%	15,585	-0.66%	-0.00%	9,728,299	151,614,404,620
2020/1/22	15,608.92	0.59%	15,677	0.59%	-0.00%	9,827,830	154,072,717,190
2020/1/23	15,483.29	-0.80%	15,550	-0.81%	-0.01%	9,827,830	152,823,705,278
2020/1/24	15,497.20	0.09%	15,564	0.09%	0.00%	9,827,830	152,964,440,943

交換にかかる交換口数

交換申込日(令和2年1月30日)、交換受付日(令和2年1月30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30日)、設定受付日(令和2年1月30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2年1月24日現在)

30,036,571 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年1月24日現在)

49,156,879,812 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年1月24日現在)

1,636.57 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24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
2019/12/23	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
2020/1/10	1,635.41	0.31%	1,632.99	0.31%	-0.00%	30,036,571	49,049,382,061
2020/1/14	1,641.31	0.36%	1,638.87	0.36%	-0.00%	30,036,571	49,226,106,937
2020/1/15	1,633.40	-0.48%	1,630.97	-0.48%	-0.00%	30,036,571	48,988,618,537
2020/1/16	1,634.41	0.06%	1,631.91	0.06%	-0.00%	30,036,571	49,017,040,026
2020/1/17	1,637.95	0.22%	1,635.49	0.22%	0.00%	30,036,571	49,124,364,674
2020/1/20	1,645.56	0.46%	1,643.08	0.46%	-0.00%	30,036,571	49,352,408,608
2020/1/21	1,635.68	-0.60%	1,633.21	-0.60%	-0.00%	30,036,571	49,055,907,518
2020/1/22	1,647.49	0.72%	1,644.94	0.72%	-0.00%	30,036,571	49,408,290,249
2020/1/23	1,637.35	-0.62%	1,634.68	-0.62%	-0.01%	30,036,571	49,100,061,626
2020/1/24	1,639.23	0.12%	1,636.57	0.12%	0.00%	30,036,571	49,156,879,812

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2年1月30日)、交換受付日(令和2年1月30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30日)、設定受付日(令和2年1月30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。

(注)備考欄に※のある銘柄については、金銭による設定(取得)のお申込みを受け付けます。(有価証券による設定(取得)のお申込みは受け付けません。)

No.	銘柄コード	銘柄名	株数	備考
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	備考
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	備考
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	備考
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24日現在)

662,195 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年1月24日現在)

9,710,995,395 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年1月24日現在)

14,665 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24日現在)

0.02 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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
2019/12/23	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
2020/1/10	14,756.22	-0.07%	14,711	-0.07%	0.00%	662,195	9,741,605,718
2020/1/14	14,737.90	-0.12%	14,694	-0.12%	0.01%	662,195	9,730,415,878
2020/1/15	14,730.89	-0.05%	14,685	-0.06%	-0.01%	662,195	9,724,577,455
2020/1/16	14,697.80	-0.22%	14,653	-0.22%	0.01%	662,195	9,702,817,683
2020/1/17	14,712.20	0.10%	14,668	0.10%	0.00%	662,195	9,712,883,653
2020/1/20	14,809.48	0.66%	14,764	0.65%	-0.01%	662,195	9,776,453,765
2020/1/21	14,817.85	0.06%	14,770	0.04%	-0.02%	662,195	9,780,304,339
2020/1/22	14,889.22	0.48%	14,841	0.48%	-0.00%	662,195	9,827,396,177
2020/1/23	14,793.90	-0.64%	14,744	-0.65%	-0.01%	662,195	9,763,432,720
2020/1/24	14,712.10	-0.55%	14,665	-0.54%	0.02%	662,195	9,710,995,395

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30日)、交換受付日(令和2年1月30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30日)、設定受付日(令和2年1月30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 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24日現在)

763,982 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年1月24日現在)

14,122,102,166 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年1月24日現在)

18,485 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24日現在)

0.01 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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
2019/12/23	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
2020/1/10	185.59	-0.10%	18,666	-0.10%	0.00%	763,982	14,260,247,600
2020/1/14	184.96	-0.34%	18,606	-0.32%	0.02%	763,982	14,214,559,334
2020/1/15	184.23	-0.40%	18,531	-0.40%	-0.00%	763,982	14,157,219,735
2020/1/16	184.54	0.17%	18,561	0.16%	-0.01%	763,982	14,180,097,980
2020/1/17	185.11	0.31%	18,618	0.31%	-0.00%	763,982	14,224,112,070
2020/1/20	186.07	0.52%	18,714	0.52%	-0.00%	763,982	14,297,395,370
2020/1/21	185.33	-0.39%	18,639	-0.40%	-0.01%	763,982	14,240,072,317
2020/1/22	186.06	0.39%	18,713	0.40%	0.01%	763,982	14,296,152,479
2020/1/23	184.36	-0.91%	18,541	-0.92%	-0.01%	763,982	14,164,947,308
2020/1/24	183.78	-0.32%	18,485	-0.30%	0.01%	763,982	14,122,102,166

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30日)、交換受付日(令和2年1月30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30日)、設定受付日(令和2年1月30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24日現在)

895,922 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年1月24日現在)

11,824,705,925 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年1月24日現在)

13,198.00 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24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
2019/12/23	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
2020/1/10	131.08	0.35%	13,146.00	0.35%	-0.00%	895,922	11,777,736,829
2020/1/14	131.79	0.54%	13,216.00	0.53%	-0.01%	895,922	11,840,842,161
2020/1/15	131.15	-0.49%	13,152.00	-0.48%	0.00%	895,922	11,782,982,963
2020/1/16	131.25	0.08%	13,162.00	0.08%	-0.00%	895,922	11,791,716,531
2020/1/17	131.85	0.46%	13,221.00	0.45%	-0.01%	895,922	11,845,264,561
2020/1/20	132.40	0.42%	13,277.00	0.42%	0.00%	895,922	11,895,291,658
2020/1/21	131.60	-0.60%	13,197.00	-0.60%	0.00%	895,922	11,823,673,697
2020/1/22	132.37	0.58%	13,274.00	0.58%	-0.00%	895,922	11,892,541,647
2020/1/23	131.41	-0.73%	13,177.00	-0.73%	-0.00%	895,922	11,805,612,549
2020/1/24	131.62	0.16%	13,198.00	0.16%	-0.00%	895,922	11,824,705,925

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30日)、交換受付日(令和2年1月30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30日)、設定受付日(令和2年1月30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。

(注)備考欄に※のある銘柄については、金銭による設定(取得)のお申込みを受け付けます。(有価証券による設定(取得)のお申込みは受け付けません。)

No.	銘柄コード	銘柄名	株数	備考
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	コニカミノルタ	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27日

会社名 アセットマネジメントOne株式会社
代表者名 取締役社長 菅野 暁
(コード番号 2553)
問い合わせ先 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24日現在)

510,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(令和2年1月24日現在)

557,921,491 円

3. 上場ETFの1口あたりの純資産額
(令和2年1月24日現在)

1,094 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24日現在)

-0.13 %

(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24日現在)

11,498,557 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年1月24日現在)

25,342,410,792 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年1月24日現在)

2,203.96 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24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
2019/12/23	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
2020/1/10	2,133.12	0.16%	2,142.85	0.16%	-0.00%	10,959,822	23,485,268,774
2020/1/14	2,136.46	0.16%	2,146.17	0.15%	-0.00%	10,661,257	22,880,819,678
2020/1/15	2,129.99	-0.30%	2,139.64	-0.30%	-0.00%	10,721,057	22,939,159,202
2020/1/16	2,144.51	0.68%	2,154.19	0.68%	-0.00%	10,721,057	23,095,236,861
2020/1/17	2,157.72	0.62%	2,167.45	0.62%	-0.00%	10,721,057	23,237,405,508
2020/1/20	2,169.56	0.55%	2,179.36	0.55%	0.00%	10,721,057	23,365,046,484
2020/1/21	2,163.21	-0.29%	2,172.96	-0.29%	-0.00%	10,900,457	23,686,240,481
2020/1/22	2,181.43	0.84%	2,191.25	0.84%	-0.00%	10,900,457	23,885,662,365
2020/1/23	2,185.35	0.18%	2,195.17	0.18%	-0.00%	11,498,557	25,241,310,615
2020/1/24	2,194.11	0.40%	2,203.96	0.40%	-0.00%	11,498,557	25,342,410,792

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30日)、交換受付日(令和2年1月30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30日)、設定受付日(令和2年1月30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 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24日現在)

14,260 口

2. 上場ETFの純資産総額
(令和2年1月24日現在)

71,904,132 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(令和2年1月24日現在)

5,042 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24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。