

令和2年4月24日

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 事務サービスグループ 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4月23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。

※上記の掲載番号10のファンドにおきましては、2020年6月30日に繰上償還の賛否に関する書面決議を行う
予定です。2020年4月13日開示の『「One ETF 国内金先物」の繰上償還(信託終了)および重大な約款変更
に係る書面決議基準日設定のお知らせ』をご参照ください。

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 1369)
問合せ先 事務サービスグループ 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4月23日現在)

13,872,674 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年4月23日現在)

271,889,626,502 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年4月23日現在)

19,599 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4月23日現在)

0.01 %

(参考) 乖離率の計算式

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

5. 交換にかかる交換口数(別紙参照)

6. 設定にかかる株式のポートフォリオ(別紙参照)

日経平均株価(日経225)とは

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

指数の著作権等

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

One ETF 日経225

日付	日経平均株価(日経225)		One ETF 日経225				
	指数終値	日次騰落率	一口あたりの 純資産額	日次騰落率	乖離率	上場受益権口数	純資産総額
2020/3/27	19,389.43	3.88%	19,379	3.88%	-0.00%	13,955,219	270,439,704,855
2020/3/30	19,084.97	-1.57%	19,249	-0.67%	0.90%	13,955,219	268,622,847,807
2020/3/31	18,917.01	-0.88%	19,085	-0.85%	0.03%	13,955,219	266,329,815,276
2020/4/1	18,065.41	-4.50%	18,221	-4.53%	-0.03%	13,955,219	254,275,039,526
2020/4/2	17,818.72	-1.37%	17,977	-1.34%	0.03%	13,900,173	249,884,146,313
2020/4/3	17,820.19	0.01%	17,975	-0.01%	-0.02%	13,900,173	249,857,212,764
2020/4/6	18,576.30	4.24%	18,740	4.26%	0.01%	13,845,131	259,458,251,879
2020/4/7	18,950.18	2.01%	19,121	2.03%	0.02%	13,845,131	264,730,652,095
2020/4/8	19,353.24	2.13%	19,516	2.07%	-0.06%	13,845,131	270,198,339,176
2020/4/9	19,345.77	-0.04%	19,519	0.02%	0.05%	13,900,188	271,312,710,567
2020/4/10	19,498.50	0.79%	19,666	0.75%	-0.04%	13,900,188	273,365,649,294
2020/4/13	19,043.40	-2.33%	19,211	-2.31%	0.02%	13,900,188	267,034,824,656
2020/4/14	19,638.81	3.13%	19,810	3.12%	-0.01%	13,927,697	275,912,547,025
2020/4/15	19,550.09	-0.45%	19,722	-0.44%	0.01%	13,927,697	274,679,340,978
2020/4/16	19,290.20	-1.33%	19,458	-1.34%	-0.01%	13,927,697	271,006,540,484
2020/4/17	19,897.26	3.15%	20,068	3.13%	-0.01%	13,927,697	279,496,334,875
2020/4/20	19,669.12	-1.15%	19,840	-1.14%	0.01%	13,927,697	276,329,649,354
2020/4/21	19,280.78	-1.97%	19,450	-1.97%	0.01%	13,817,637	268,749,240,711
2020/4/22	19,137.95	-0.74%	19,303	-0.76%	-0.01%	13,872,674	267,779,862,854
2020/4/23	19,429.44	1.52%	19,599	1.53%	0.01%	13,872,674	271,889,626,502

交換にかかる交換口数

交換申込日(令和2年4月28日)、交換受付日(令和2年4月28日)分の
交換口数は以下の通りです。

交換口数 55,400 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4月28日)、設定受付日(令和2年4月28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、最小交換口数のポートに相当する口数の設定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	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	太平洋金属	200
88	5631	日本製鋼所	400
89	5703	日本軽金属ホールディングス	2,000
90	5706	三井金属鉱業	200
91	5707	東邦亜鉛	200
92	5711	三菱マテリアル	200
93	5713	住友金属鉱山	1,000
94	5714	DOWAホールディングス	400
95	5801	古河電気工業	200
96	5802	住友電気工業	2,000
97	5803	フジクラ	2,000
98	5901	東洋製罐グループホールディングス	2,000
99	6098	リクルートホールディングス	6,000
100	6103	オークマ	400
101	6113	アマダ	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

会社名
代表者名
(コード番号
問合せ先
TEL

アセットマネジメントOne株式会社
取締役社長 菅野 暁
1473)
事務サービスグループ 鈴木 俊直
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4月23日現在）

119,766,489

口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年4月23日現在）

173,989,405,018

円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年4月23日現在）

1,452.74

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4月23日現在）

0.01

%

（参考）乖離率の計算式

上場ETFの
一口あたりの純資産額

前営業日の上場ETFの
一口あたりの純資産額

-

TOPIXの終値

前営業日の
TOPIXの終値

×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
2020/3/27	1,459.49	4.30%	1,468.71	4.31%	0.01%	130,587,919	191,796,203,181
2020/3/30	1,435.54	-1.64%	1,462.05	-0.45%	1.19%	130,587,919	190,926,295,095
2020/3/31	1,403.04	-2.26%	1,429.44	-2.23%	0.03%	130,587,919	186,667,647,647
2020/4/1	1,351.08	-3.70%	1,375.92	-3.74%	-0.04%	130,587,919	179,677,893,452
2020/4/2	1,329.87	-1.57%	1,354.63	-1.55%	0.02%	132,854,019	179,968,502,878
2020/4/3	1,325.13	-0.36%	1,349.78	-0.36%	-0.00%	133,838,519	180,652,964,061
2020/4/6	1,376.30	3.86%	1,402.05	3.87%	0.01%	114,342,189	160,313,983,280
2020/4/7	1,403.21	1.96%	1,430.06	2.00%	0.04%	114,342,189	163,515,888,399
2020/4/8	1,425.47	1.59%	1,451.38	1.49%	-0.10%	114,342,189	165,953,676,623
2020/4/9	1,416.98	-0.60%	1,443.84	-0.52%	0.08%	114,342,189	165,092,229,297
2020/4/10	1,430.04	0.92%	1,456.56	0.88%	-0.04%	114,342,189	166,545,859,197
2020/4/13	1,405.91	-1.69%	1,432.38	-1.66%	0.03%	114,837,189	164,490,794,798
2020/4/14	1,433.51	1.96%	1,460.43	1.96%	-0.00%	115,822,589	169,150,884,411
2020/4/15	1,434.07	0.04%	1,461.10	0.05%	0.01%	116,808,089	170,668,450,574
2020/4/16	1,422.24	-0.82%	1,448.77	-0.84%	-0.02%	116,808,089	169,228,602,781
2020/4/17	1,442.54	1.43%	1,469.28	1.42%	-0.01%	116,808,089	171,623,569,123
2020/4/20	1,432.41	-0.70%	1,459.23	-0.68%	0.02%	117,599,289	171,604,831,153
2020/4/21	1,415.89	-1.15%	1,442.47	-1.15%	0.00%	117,599,289	169,633,862,540
2020/4/22	1,406.90	-0.63%	1,433.09	-0.65%	-0.02%	119,766,489	171,636,127,876
2020/4/23	1,425.98	1.36%	1,452.74	1.37%	0.01%	119,766,489	173,989,405,018

交換にかかる交換口数

交換申込日(令和2年4月28日)、交換受付日(令和2年4月28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4月28日)、設定受付日(令和2年4月28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 1474)
問合せ先 事務サービスグループ 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4月23日現在)

10,392,716 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年4月23日現在)

135,063,128,982 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年4月23日現在)

12,996 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4月23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
2020/3/27	13,058.23	4.25%	13,118	4.27%	0.02%	10,165,795	133,351,821,777
2020/3/30	12,862.51	-1.50%	13,073	-0.34%	1.16%	10,165,795	132,894,050,613
2020/3/31	12,573.18	-2.25%	12,784	-2.21%	0.04%	10,165,795	129,954,497,672
2020/4/1	12,104.76	-3.73%	12,302	-3.77%	-0.04%	10,195,324	125,419,969,927
2020/4/2	11,930.83	-1.44%	12,131	-1.39%	0.05%	10,195,324	123,683,889,698
2020/4/3	11,909.84	-0.18%	12,107	-0.20%	-0.02%	10,224,865	123,788,252,459
2020/4/6	12,354.96	3.74%	12,562	3.76%	0.02%	10,224,865	128,440,776,554
2020/4/7	12,599.59	1.98%	12,815	2.01%	0.03%	10,244,621	131,279,925,561
2020/4/8	12,810.48	1.67%	13,016	1.57%	-0.11%	10,264,385	133,603,923,674
2020/4/9	12,731.24	-0.62%	12,946	-0.54%	0.08%	10,264,385	132,882,253,629
2020/4/10	12,834.80	0.81%	13,046	0.77%	-0.04%	10,284,165	134,165,712,508
2020/4/13	12,611.65	-1.74%	12,822	-1.72%	0.02%	10,284,165	131,863,670,583
2020/4/14	12,871.20	2.06%	13,086	2.06%	0.00%	10,284,165	134,576,644,710
2020/4/15	12,915.51	0.34%	13,132	0.35%	0.01%	10,303,927	135,309,501,600
2020/4/16	12,757.23	-1.23%	12,968	-1.25%	-0.02%	10,343,431	134,133,018,809
2020/4/17	12,959.81	1.59%	13,173	1.58%	-0.01%	10,343,431	136,252,377,582
2020/4/20	12,851.34	-0.84%	13,064	-0.83%	0.01%	10,343,431	135,128,164,974
2020/4/21	12,699.47	-1.18%	12,911	-1.17%	0.01%	10,343,431	133,545,286,208
2020/4/22	12,625.15	-0.59%	12,833	-0.60%	-0.02%	10,392,716	133,371,102,412
2020/4/23	12,782.45	1.25%	12,996	1.27%	0.02%	10,392,716	135,063,128,982

交換にかかる交換口数

交換申込日(令和2年4月28日)、交換受付日(令和2年4月28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4月28日)、設定受付日(令和2年4月28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	事務サービスグループ 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4月23日現在）

29,143,539 口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年4月23日現在）

41,357,320,172 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年4月23日現在）

1,419.09 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4月23日現在）

0.03 %

（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
2020/3/27	1,429.77	4.44%	1,427.36	4.45%	0.01%	29,143,539	41,598,279,824
2020/3/30	1,416.54	-0.92%	1,429.36	0.14%	1.06%	29,143,539	41,656,584,419
2020/3/31	1,384.97	-2.23%	1,398.04	-2.19%	0.04%	29,143,539	40,743,936,552
2020/4/1	1,332.87	-3.76%	1,344.86	-3.80%	-0.04%	29,143,539	39,194,041,620
2020/4/2	1,315.15	-1.33%	1,327.27	-1.31%	0.02%	29,143,539	38,681,341,648
2020/4/3	1,315.64	0.04%	1,327.59	0.02%	-0.01%	29,143,539	38,690,643,873
2020/4/6	1,365.96	3.82%	1,378.49	3.83%	0.01%	29,143,539	40,174,069,023
2020/4/7	1,386.93	1.53%	1,400.37	1.59%	0.05%	29,143,539	40,811,596,330
2020/4/8	1,414.66	2.00%	1,426.86	1.89%	-0.11%	29,143,539	41,583,806,801
2020/4/9	1,401.19	-0.95%	1,414.49	-0.87%	0.09%	29,143,539	41,223,127,582
2020/4/10	1,408.37	0.51%	1,421.34	0.48%	-0.03%	29,143,539	41,422,793,014
2020/4/13	1,387.93	-1.45%	1,401.00	-1.43%	0.02%	29,143,539	40,830,026,049
2020/4/14	1,415.26	1.97%	1,428.49	1.96%	-0.01%	29,143,539	41,631,133,922
2020/4/15	1,423.33	0.57%	1,436.52	0.56%	-0.01%	29,143,539	41,865,233,518
2020/4/16	1,409.33	-0.98%	1,422.18	-1.00%	-0.01%	29,143,539	41,447,264,360
2020/4/17	1,427.97	1.32%	1,440.84	1.31%	-0.01%	29,143,539	41,991,273,222
2020/4/20	1,410.98	-1.19%	1,424.18	-1.16%	0.03%	29,143,539	41,505,662,908
2020/4/21	1,397.67	-0.94%	1,410.72	-0.95%	-0.00%	29,143,539	41,113,409,482
2020/4/22	1,393.51	-0.30%	1,406.17	-0.32%	-0.03%	29,143,539	40,980,858,296
2020/4/23	1,405.94	0.89%	1,419.09	0.92%	0.03%	29,143,539	41,357,320,172

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(「SPDJI」)、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SPDJI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SPDJIおよび委託会社に付与されています。当ファンドは、SPDJI、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)の商標または標章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4月28日)、交換受付日(令和2年4月28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4月28日)、設定受付日(令和2年4月28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	2,800	
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	3291	飯田グループホールディングス	900	
55	3382	セブン&アイ・ホールディングス	3,800	
56	3391	ツルハホールディングス	200	
57	3397	トリドールホールディングス	200	
58	3401	帝人	600	
59	3402	東レ	5,900	
60	3543	コメダホールディングス	200	
61	3563	スシローグローバルホールディングス	300	
62	3632	グリー	700	
63	3659	ネクソン	2,100	
64	3673	ブロードリーフ	400	
65	3694	オプティム	100	
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	7,200	
77	4506	大日本住友製薬	600	
78	4519	中外製薬	1,000	
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	1,700	
96	4902	コニカミノルタ	2,300	
97	4911	資生堂	2,300	
98	4912	ライオン	1,100	
99	4922	ユーセー	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	900	
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	8,500	
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	8053	住友商事	4,400	
150	8058	三菱商事	5,900	
151	8129	東邦ホールディングス	200	
152	8227	しまむら	100	
153	8233	高島屋	600	
154	8267	イオン	2,700	
155	8283	PALTAC	100	
156	8308	りそなホールディングス	7,300	
157	8572	アコム	1,400	
158	8715	アニコム ホールディングス	100	
159	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	
160	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	800	
161	8766	東京海上ホールディングス	4,300	
162	8804	東京建物	700	
163	8876	リログループ	400	
164	9009	京成電鉄	600	
165	9041	近鉄グループホールディングス	600	
166	9064	ヤマトホールディングス	1,000	
167	9065	山九	200	
168	9076	セイノーホールディングス	500	
169	9086	日立物流	100	
170	9143	SGホールディングス	800	

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	9202	ANAホールディングス	1,700	
172	9432	日本電信電話	11,800	
173	9435	光通信	100	
174	9437	NTTドコモ	5,300	
175	9501	東京電力ホールディングス	4,900	
176	9503	関西電力	3,300	
177	9531	東京瓦斯	1,400	
178	9532	大阪瓦斯	1,500	
179	9601	松竹	100	
180	9602	東宝	500	
181	9603	エイチ・アイ・エス	100	※
182	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	2,300	
183	9627	アインホールディングス	100	※
184	9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	300	
185	9716	乃村工藝社	500	
186	9744	メイテック	100	
187	9749	富士ソフト	100	
188	9766	コナミホールディングス	300	
189	9783	ベネッセホールディングス	200	
190	9830	トラスコ中山	100	
191	9831	ヤマダ電機	2,400	
192	9832	オートバックスセブン	200	
193	9983	ファーストリテイリング	100	
194	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	事務サービスグループ 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4月23日現在）

662,195 口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年4月23日現在）

7,568,986,753 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年4月23日現在）

11,430 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4月23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
2020/3/27	11,405.11	4.15%	11,398	4.17%	0.01%	662,195	7,547,965,098
2020/3/30	11,093.53	-2.73%	11,225	-1.52%	1.21%	662,195	7,432,929,111
2020/3/31	10,969.59	-1.12%	11,100	-1.11%	0.00%	662,195	7,350,623,515
2020/4/1	10,534.63	-3.97%	10,655	-4.01%	-0.04%	662,195	7,055,987,149
2020/4/2	10,257.68	-2.63%	10,384	-2.54%	0.09%	662,195	6,875,912,579
2020/4/3	9,988.36	-2.63%	10,120	-2.54%	0.08%	662,195	6,701,162,153
2020/4/6	10,362.68	3.75%	10,500	3.75%	0.01%	662,195	6,952,912,221
2020/4/7	10,744.72	3.69%	10,885	3.67%	-0.02%	662,195	7,208,073,056
2020/4/8	10,914.62	1.58%	11,043	1.45%	-0.13%	662,195	7,312,787,136
2020/4/9	11,010.18	0.88%	11,145	0.92%	0.05%	662,195	7,380,079,270
2020/4/10	11,125.31	1.05%	11,255	0.99%	-0.06%	662,195	7,452,759,973
2020/4/13	10,992.54	-1.19%	11,122	-1.18%	0.01%	662,195	7,365,132,977
2020/4/14	11,163.56	1.56%	11,296	1.56%	0.01%	662,195	7,480,059,919
2020/4/15	11,013.38	-1.35%	11,151	-1.28%	0.06%	662,195	7,384,021,732
2020/4/16	11,215.37	1.83%	11,341	1.70%	-0.13%	662,195	7,510,022,651
2020/4/17	11,296.98	0.73%	11,424	0.73%	0.00%	662,195	7,565,161,462
2020/4/20	11,409.14	0.99%	11,533	0.95%	-0.04%	662,195	7,637,322,977
2020/4/21	11,221.91	-1.64%	11,346	-1.62%	0.02%	662,195	7,513,482,735
2020/4/22	11,070.97	-1.35%	11,195	-1.33%	0.01%	662,195	7,412,990,061
2020/4/23	11,305.38	2.12%	11,430	2.10%	-0.02%	662,195	7,568,986,753

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4月28日)、交換受付日(令和2年4月28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4月28日)、設定受付日(令和2年4月28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	事務サービスグループ 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4月23日現在）

1,153,652 口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年4月23日現在）

17,010,189,379 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年4月23日現在）

14,745 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4月23日現在）

0.00 %

（参考）乖離率の計算式

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

5. 交換にかかる交換口数（別紙参照）

6. 設定にかかる株式のポートフォリオ（別紙参照）

One ETF 高配当日本株

日付	S&P/JPX 配当貴族指数		One ETF 高配当日本株				
	指数終値	日次騰落率	一口あたりの 純資産額	日次騰落率	乖離率	上場受益権口数	純資産総額
2020/3/27	153.61	4.44%	15,465	4.44%	0.01%	1,115,302	17,248,106,980
2020/3/30	150.23	-2.20%	15,413	-0.34%	1.86%	1,115,302	17,190,248,714
2020/3/31	145.80	-2.95%	14,971	-2.87%	0.08%	1,115,302	16,696,972,564
2020/4/1	140.41	-3.70%	14,409	-3.75%	-0.06%	1,153,652	16,623,041,520
2020/4/2	137.78	-1.87%	14,146	-1.83%	0.05%	1,153,652	16,319,143,253
2020/4/3	137.30	-0.35%	14,095	-0.36%	-0.01%	1,153,652	16,261,151,210
2020/4/6	142.51	3.80%	14,632	3.81%	0.01%	1,153,652	16,880,655,276
2020/4/7	144.78	1.59%	14,874	1.65%	0.06%	1,153,652	17,159,861,924
2020/4/8	146.09	0.91%	14,709	-1.11%	-2.02%	1,153,652	16,968,657,376
2020/4/9	145.29	-0.55%	14,643	-0.45%	0.10%	1,153,652	16,892,356,988
2020/4/10	147.69	1.65%	14,873	1.57%	-0.08%	1,153,652	17,157,770,802
2020/4/13	144.99	-1.83%	14,607	-1.79%	0.04%	1,153,652	16,851,162,587
2020/4/14	146.35	0.94%	14,748	0.97%	0.03%	1,153,652	17,014,164,264
2020/4/15	145.36	-0.68%	14,653	-0.64%	0.04%	1,153,652	16,904,745,604
2020/4/16	144.36	-0.68%	14,549	-0.71%	-0.03%	1,153,652	16,784,012,760
2020/4/17	145.59	0.85%	14,672	0.85%	-0.00%	1,153,652	16,926,702,235
2020/4/20	145.32	-0.18%	14,646	-0.18%	0.01%	1,153,652	16,896,866,497
2020/4/21	144.64	-0.47%	14,575	-0.48%	-0.02%	1,153,652	16,814,249,437
2020/4/22	143.79	-0.59%	14,486	-0.61%	-0.02%	1,153,652	16,711,766,364
2020/4/23	146.35	1.78%	14,745	1.79%	0.00%	1,153,652	17,010,189,379

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「SPDJI」）、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SPDJI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SPDJI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、SPDJI、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4月28日)、交換受付日(令和2年4月28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4月28日)、設定受付日(令和2年4月28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、3,000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	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

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	1498)
問合せ先	事務サービスグループ 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4月23日現在）

831,883 口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年4月23日現在）

9,037,697,761 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年4月23日現在）

10,864.00 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4月23日現在）

0.02 %

（参考）乖離率の計算式

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

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
2020/3/27	110.52	4.23%	11,090.00	4.23%	0.00%	1,031,332	11,437,337,961
2020/3/30	108.61	-1.73%	11,036.00	-0.49%	1.24%	1,031,332	11,381,647,433
2020/3/31	106.06	-2.35%	10,781.00	-2.31%	0.04%	1,031,332	11,118,299,585
2020/4/1	101.90	-3.92%	10,355.00	-3.95%	-0.03%	1,031,332	10,678,953,854
2020/4/2	100.58	-1.30%	10,222.00	-1.28%	0.01%	1,031,332	10,542,353,356
2020/4/3	100.43	-0.15%	10,205.00	-0.17%	-0.02%	929,308	9,483,505,762
2020/4/6	104.59	4.14%	10,628.00	4.15%	0.00%	929,308	9,876,469,664
2020/4/7	106.42	1.75%	10,819.00	1.80%	0.05%	929,308	10,053,755,224
2020/4/8	107.89	1.39%	10,959.00	1.29%	-0.09%	925,325	10,140,651,140
2020/4/9	107.12	-0.72%	10,889.00	-0.64%	0.08%	933,225	10,161,868,946
2020/4/10	107.89	0.72%	10,964.00	0.69%	-0.03%	933,225	10,231,735,106
2020/4/13	105.93	-1.82%	10,768.00	-1.79%	0.03%	933,225	10,048,923,180
2020/4/14	108.16	2.11%	10,994.00	2.10%	-0.01%	933,225	10,260,043,783
2020/4/15	108.37	0.19%	11,016.00	0.20%	0.01%	933,225	10,280,113,352
2020/4/16	106.72	-1.53%	10,848.00	-1.53%	0.00%	933,225	10,123,230,256
2020/4/17	108.63	1.80%	11,040.00	1.77%	-0.03%	933,225	10,302,588,646
2020/4/20	107.62	-0.94%	10,940.00	-0.91%	0.03%	933,225	10,209,028,411
2020/4/21	106.14	-1.37%	10,791.00	-1.36%	0.01%	831,883	8,976,611,654
2020/4/22	105.46	-0.64%	10,720.00	-0.66%	-0.02%	831,883	8,917,803,918
2020/4/23	106.86	1.33%	10,864.00	1.34%	0.02%	831,883	9,037,697,761

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、市場参加者がスチュワード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4月28日)、交換受付日(令和2年4月28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4月28日)、設定受付日(令和2年4月28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、4,000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	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	キリンホールディングス	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	400
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	500
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	4912	ライオン	100
41	5020	JXTGホールディングス	500
42	5108	ブリヂストン	100
43	5401	日本製鉄	200
44	5802	住友電気工業	200
45	5803	フジクラ	100
46	5938	LIXILグループ	100
47	6098	リクルートホールディングス	300
48	6301	小松製作所	200
49	6326	クボタ	300
50	6367	ダイキン工業	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	6471	日本精工	100
52	6472	NTN	100
53	6502	東芝	100
54	6503	三菱電機	500
55	6594	日本電産	100
56	6752	パナソニック	400
57	6758	ソニー	200
58	6841	横河電機	100
59	6902	デンソー	100
60	6981	村田製作所	100
61	7011	三菱重工業	100
62	7201	日産自動車	400
63	7203	トヨタ自動車	500
64	7205	日野自動車	100
65	7261	マツダ	100
66	7269	スズキ	100
67	7272	ヤマハ発動機	100
68	7731	ニコン	100
69	7733	オリンパス	200
70	7751	キヤノン	200
71	7752	リコー	100
72	7762	シチズン時計	100
73	7911	凸版印刷	100
74	7912	大日本印刷	100
75	8001	伊藤忠商事	300
76	8002	丸紅	400
77	8031	三井物産	400
78	8053	住友商事	300
79	8058	三菱商事	300
80	8113	ユニ・チャーム	100
81	8252	丸井グループ	100
82	8267	イオン	300
83	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,500
84	8308	りそなホールディングス	400
85	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	100
86	8316	三井住友フィナンシャルグループ	300
87	8411	みずほフィナンシャルグループ	5,100
88	8572	アコム	100
89	8593	三菱UFJリース	100
90	8601	大和証券グループ本社	300
91	8604	野村ホールディングス	600
92	8630	SOMPOホールディングス	100
93	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	100
94	8750	第一生命ホールディングス	200
95	8766	東京海上ホールディングス	100
96	8795	T&Dホールディングス	100
97	8801	三井不動産	200
98	8802	三菱地所	200
99	9021	西日本旅客鉄道	100
100	9432	日本電信電話	300
101	9433	KDDI	400
102	9437	NTTドコモ	300
103	9531	東京瓦斯	200
104	9532	大阪瓦斯	200
105	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	100

以上

会社名	アセットマネジメントOne株式会社
代表者名	取締役社長 菅野 暁
(コード番号	2553)
問合わせ先	事務サービスグループ 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4月23日現在)

510,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(令和2年4月23日現在)

539,478,656 円

3. 上場ETFの1口あたりの純資産額
(令和2年4月23日現在)

1,058 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4月23日現在)

0.10 %

(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。

会社名
代表者名
(コード番号
問合せ先
TEL

アセットマネジメントOne株式会社
取締役社長 菅野 暁
2556)
事務サービスグループ 鈴木 俊直
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4月23日現在）

19,343,943

口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年4月23日現在）

30,739,240,414

円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年4月23日現在）

1,589.09

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4月23日現在）

-0.00

%

（参考）乖離率の計算式

上場ETFの
一口あたりの純資産額

前営業日の上場ETFの
一口あたりの純資産額

-

東証REIT指数の終値

前営業日の
東証REIT指数の終値

×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
2020/3/27	1,541.74	-2.54%	1,561.02	-2.54%	-0.00%	16,554,019	25,841,217,537
2020/3/30	1,571.28	1.92%	1,594.69	2.16%	0.24%	16,554,019	26,398,511,757
2020/3/31	1,595.19	1.52%	1,618.88	1.52%	-0.00%	16,554,019	26,798,941,515
2020/4/1	1,498.06	-6.09%	1,520.44	-6.08%	0.01%	17,445,719	26,525,113,612
2020/4/2	1,466.21	-2.13%	1,488.10	-2.13%	-0.00%	18,336,119	27,285,990,616
2020/4/3	1,436.37	-2.04%	1,457.81	-2.04%	-0.00%	19,642,519	28,635,040,500
2020/4/6	1,419.26	-1.19%	1,440.41	-1.19%	-0.00%	19,642,519	28,293,275,129
2020/4/7	1,541.13	8.59%	1,564.05	8.58%	-0.00%	19,642,519	30,721,857,634
2020/4/8	1,559.49	1.19%	1,569.88	0.37%	-0.82%	19,642,519	30,836,421,393
2020/4/9	1,548.47	-0.71%	1,558.79	-0.71%	0.00%	19,941,119	31,084,029,587
2020/4/10	1,547.47	-0.06%	1,557.77	-0.07%	-0.00%	19,941,119	31,063,607,041
2020/4/13	1,548.71	0.08%	1,558.99	0.08%	-0.00%	19,941,119	31,087,959,662
2020/4/14	1,551.10	0.15%	1,561.39	0.15%	-0.00%	19,941,119	31,135,827,061
2020/4/15	1,539.32	-0.76%	1,549.53	-0.76%	-0.00%	19,343,943	29,974,098,778
2020/4/16	1,551.74	0.81%	1,562.03	0.81%	-0.00%	19,343,943	30,215,870,840
2020/4/17	1,576.15	1.57%	1,586.64	1.58%	0.00%	19,343,943	30,691,885,933
2020/4/20	1,591.56	0.98%	1,602.12	0.98%	-0.00%	19,343,943	30,991,377,375
2020/4/21	1,541.36	-3.15%	1,551.60	-3.15%	0.00%	19,343,943	30,014,049,750
2020/4/22	1,529.93	-0.74%	1,540.08	-0.74%	-0.00%	19,343,943	29,791,312,506
2020/4/23	1,578.64	3.18%	1,589.09	3.18%	-0.00%	19,343,943	30,739,240,414

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4月28日)、交換受付日(令和2年4月28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4月28日)、設定受付日(令和2年4月28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	事務サービスグループ 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4月23日現在)

14,260 口

2. 上場ETFの純資産総額
(令和2年4月23日現在)

77,792,317 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(令和2年4月23日現在)

5,455 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4月23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。