

令和2年5月11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5月8日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(10銘柄)

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

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

※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5月8日現在)

13,927,705 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年5月8日現在)

283,470,865,907 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年5月8日現在)

20,353 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5月8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<br>純資産額 | 日次騰落率  | 乖離率    | 上場受益権口数    | 純資産総額           |
| 2020/4/7  | 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 |
| 2020/4/24 | 19,262.00     | -0.86% | 19,428         | -0.87% | -0.01% | 13,872,674 | 269,524,305,502 |
| 2020/4/27 | 19,783.22     | 2.71%  | 19,955         | 2.71%  | 0.01%  | 13,927,704 | 277,931,146,929 |
| 2020/4/28 | 19,771.19     | -0.06% | 19,945         | -0.05% | 0.01%  | 13,927,704 | 277,785,718,093 |
| 2020/4/30 | 20,193.69     | 2.14%  | 20,367         | 2.12%  | -0.02% | 13,927,704 | 283,667,397,307 |
| 2020/5/1  | 19,619.35     | -2.84% | 19,790         | -2.83% | 0.01%  | 13,927,704 | 275,629,565,609 |
| 2020/5/7  | 19,674.77     | 0.28%  | 19,846         | 0.28%  | 0.00%  | 13,927,705 | 276,404,034,965 |
| 2020/5/8  | 20,179.09     | 2.56%  | 20,353         | 2.55%  | -0.01% | 13,927,705 | 283,470,865,907 |

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(令和2年5月13日)、交換受付日(令和2年5月13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5月13日)、設定受付日(令和2年5月13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           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       事務サービスグループ 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5月8日現在）

121,738,185           口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年5月8日現在）

180,818,928,417       円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年5月8日現在）

1,485.31           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5月8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<br>純資産額 | 日次騰落率  | 乖離率    | 上場受益権口数     | 純資産総額           |
| 2020/4/7  | 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 |
| 2020/4/24 | 1,421.29      | -0.33% | 1,447.78       | -0.34% | -0.01% | 119,766,489 | 173,394,936,853 |
| 2020/4/27 | 1,447.25      | 1.83%  | 1,474.28       | 1.83%  | 0.00%  | 119,766,489 | 176,569,431,321 |
| 2020/4/28 | 1,449.15      | 0.13%  | 1,476.43       | 0.15%  | 0.01%  | 119,766,489 | 176,826,584,482 |
| 2020/4/30 | 1,464.03      | 1.03%  | 1,491.01       | 0.99%  | -0.04% | 119,766,489 | 178,573,550,152 |
| 2020/5/1  | 1,431.26      | -2.24% | 1,457.70       | -2.23% | 0.00%  | 119,766,489 | 174,583,052,016 |
| 2020/5/7  | 1,426.73      | -0.32% | 1,453.19       | -0.31% | 0.01%  | 118,780,585 | 172,610,524,275 |
| 2020/5/8  | 1,458.28      | 2.21%  | 1,485.31       | 2.21%  | -0.00% | 121,738,185 | 180,818,928,417 |

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(令和2年5月13日)、交換受付日(令和2年5月13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5月13日)、設定受付日(令和2年5月13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5月8日現在)

10,442,211 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年5月8日現在)

138,685,625,669 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年5月8日現在)

13,281 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5月8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<br>純資産額   | 日次騰落率  | 乖離率    | 上場受益権口数    | 純資産総額           |
| 2020/4/7  | 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 |
| 2020/4/24 | 12,736.53                 | -0.36% | 12,946           | -0.38% | -0.03% | 10,392,716 | 134,547,451,490 |
| 2020/4/27 | 12,978.72                 | 1.90%  | 13,194           | 1.92%  | 0.01%  | 10,392,716 | 137,118,337,083 |
| 2020/4/28 | 12,981.65                 | 0.02%  | 13,199           | 0.04%  | 0.02%  | 10,392,716 | 137,175,695,844 |
| 2020/4/30 | 13,127.34                 | 1.12%  | 13,341           | 1.08%  | -0.05% | 10,392,716 | 138,650,447,281 |
| 2020/5/1  | 12,817.42                 | -2.36% | 13,026           | -2.36% | -0.00% | 10,442,211 | 136,016,691,382 |
| 2020/5/7  | 12,779.18                 | -0.30% | 12,988           | -0.29% | 0.01%  | 10,442,211 | 135,623,416,595 |
| 2020/5/8  | 13,067.11                 | 2.25%  | 13,281           | 2.26%  | 0.00%  | 10,442,211 | 138,685,625,669 |

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(令和2年5月13日)、交換受付日(令和2年5月13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5月13日)、設定受付日(令和2年5月13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5月8日現在）

29,143,539 口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年5月8日現在）

41,825,605,930 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年5月8日現在）

1,435.16 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5月8日現在）

0.02 %

（参考）乖離率の計算式

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

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<br>純資産額            | 日次騰落率  | 乖離率    | 上場受益権口数    | 純資産総額          |
| 2020/4/7  | 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 |
| 2020/4/24 | 1,404.49          | -0.10% | 1,417.36                  | -0.12% | -0.02% | 29,143,539 | 41,306,982,510 |
| 2020/4/27 | 1,425.03          | 1.46%  | 1,438.25                  | 1.47%  | 0.01%  | 29,143,539 | 41,915,650,944 |
| 2020/4/28 | 1,422.45          | -0.18% | 1,436.00                  | -0.16% | 0.02%  | 29,143,539 | 41,850,229,424 |
| 2020/4/30 | 1,427.32          | 0.34%  | 1,440.51                  | 0.31%  | -0.03% | 29,143,539 | 41,981,632,128 |
| 2020/5/1  | 1,398.10          | -2.05% | 1,411.09                  | -2.04% | 0.00%  | 29,143,539 | 41,124,213,339 |
| 2020/5/7  | 1,397.84          | -0.02% | 1,410.78                  | -0.02% | -0.00% | 29,143,539 | 41,115,183,409 |
| 2020/5/8  | 1,421.71          | 1.71%  | 1,435.16                  | 1.73%  | 0.02%  | 29,143,539 | 41,825,605,930 |

## 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5月13日)、交換受付日(令和2年5月13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5月13日)、設定受付日(令和2年5月13日)分の  
設定ポートフォリオは以下の通りです。

設定申込不可日のため受け付けておりません。

以 上

|        |                   |
|--------|-------------------|
| 会社名    | アセットマネジメントOne株式会社 |
| 代表者名   | 取締役社長 菅野 暁        |
| (コード番号 | 1493)             |
| 問合せ先   | 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5月8日現在）

662,195 口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年5月8日現在）

8,014,972,569 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年5月8日現在）

12,104 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5月8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<br>(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<br>純資産額   | 日次騰落率  | 乖離率    | 上場受益権口数 | 純資産総額         |
| 2020/4/7  | 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 |
| 2020/4/24 | 11,246.79                 | -0.52% | 11,370           | -0.52% | -0.01% | 662,195 | 7,529,042,977 |
| 2020/4/27 | 11,428.30                 | 1.61%  | 11,554           | 1.62%  | 0.00%  | 662,195 | 7,650,937,639 |
| 2020/4/28 | 11,575.14                 | 1.28%  | 11,701           | 1.27%  | -0.01% | 662,195 | 7,748,369,710 |
| 2020/4/30 | 11,785.15                 | 1.81%  | 11,906           | 1.75%  | -0.06% | 662,195 | 7,884,039,812 |
| 2020/5/1  | 11,607.60                 | -1.51% | 11,726           | -1.51% | -0.01% | 662,195 | 7,764,648,985 |
| 2020/5/7  | 11,689.31                 | 0.70%  | 11,804           | 0.67%  | -0.04% | 662,195 | 7,816,754,579 |
| 2020/5/8  | 11,989.49                 | 2.57%  | 12,104           | 2.54%  | -0.03% | 662,195 | 8,014,972,569 |

## 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5月13日)、交換受付日(令和2年5月13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5月13日)、設定受付日(令和2年5月13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   | 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             | 200   |
| 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            | 1,500 |
| 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  | ペ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  | 3276  | 日本管理センター              | 100 |
| 53  | 3284  | フージャースホールディングス        | 300 |
| 54  | 3299  | ムゲンエステート              | 100 |
| 55  | 3341  | 日本調剤                  | 100 |
| 56  | 3387  | クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 800 |
| 57  | 3397  | トリドールホールディングス         | 400 |
| 58  | 3415  | TOKYO BASE            | 100 |
| 59  | 3433  | トーカロ                  | 400 |
| 60  | 3452  | ビーロット                 | 100 |
| 61  | 3457  | ハウストゥ                 | 100 |
| 62  | 3543  | コメダホールディングス           | 300 |
| 63  | 3656  | KLab                  | 300 |
| 64  | 3662  | エイチーム                 | 100 |
| 65  | 3665  | エニグモ                  | 100 |
| 66  | 3668  | コロプラ                  | 500 |
| 67  | 3676  | デジタルハーツホールディングス       | 100 |
| 68  | 3677  | システム情報                | 100 |
| 69  | 3679  | じげん                   | 400 |
| 70  | 3687  | フィックスターズ              | 200 |
| 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  | 4022  | ラサ工業                  | 100 |
| 78  | 4047  | 関東電化工業                | 300 |
| 79  | 4082  | 第一稀元素化学工業             | 200 |
| 80  | 4246  | ダイキョーニシカワ             | 300 |
| 81  | 4290  | プレスステージ・インターナショナル     | 500 |
| 82  | 4318  | クイック                  | 100 |
| 83  | 4368  | 扶桑化学工業                | 100 |
| 84  | 4641  | アルプス技研                | 100 |
| 85  | 4674  | クレスコ                  | 100 |
| 86  | 4714  | リソー教育                 | 700 |
| 87  | 4722  | フューチャー                | 200 |
| 88  | 4745  | 東京個別指導学院              | 100 |
| 89  | 4792  | 山田コンサルティンググループ        | 100 |
| 90  | 4839  | WOWOW                 | 100 |
| 91  | 4845  | スカラ                   | 100 |
| 92  | 4848  | フルキャストホールディングス        | 100 |
| 93  | 4975  | JCU                   | 200 |
| 94  | 5017  | 富士石油                  | 400 |
| 95  | 5122  | オカモト                  | 100 |
| 96  | 5184  | ニチリン                  | 100 |
| 97  | 5358  | イソライト工業               | 100 |
| 98  | 5423  | 東京製鐵                  | 700 |
| 99  | 5702  | 大紀アルミニウム工業所           | 200 |
| 100 | 5857  | アサヒホールディングス           | 300 |
| 101 | 5949  | ユニプレス                 | 300 |
| 102 | 5975  | 東プレ                   | 300 |
| 103 | 6013  | タクマ                   | 500 |
| 104 | 6035  | アイ・アールジャパンホールディングス    | 100 |
| 105 | 6046  | リンクバル                 | 100 |
| 106 | 6050  | イー・ガーディアン             | 100 |
| 107 | 6071  | IBJ                   | 100 |
| 108 | 6080  | M&Aキャピタルパートナーズ        | 100 |
| 109 | 6089  | ウィルグループ               | 100 |
| 110 | 6101  | ツガミ                   | 300 |

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 | 6183  | ベルシステム24ホールディングス   | 200 |
| 112 | 6191  | エアトリ               | 100 |
| 113 | 6196  | ストライク              | 100 |
| 114 | 6197  | ソラスト               | 400 |
| 115 | 6258  | 平田機工               | 100 |
| 116 | 6266  | タツモ                | 100 |
| 117 | 6323  | ローツェ               | 100 |
| 118 | 6340  | 澁谷工業               | 100 |
| 119 | 6364  | 北越工業               | 200 |
| 120 | 6379  | レイズネクスト            | 300 |
| 121 | 6406  | フジテック              | 500 |
| 122 | 6409  | キトー                | 100 |
| 123 | 6420  | フクシマガリレイ           | 100 |
| 124 | 6432  | 竹内製作所              | 300 |
| 125 | 6440  | JUKI               | 200 |
| 126 | 6463  | TPR                | 200 |
| 127 | 6464  | ツバキ・ナカシマ           | 300 |
| 128 | 6486  | イーグル工業             | 200 |
| 129 | 6630  | ヤーマン               | 200 |
| 130 | 6641  | 日新電機               | 400 |
| 131 | 6670  | MCJ                | 400 |
| 132 | 6787  | メイコー               | 100 |
| 133 | 6817  | スミダコーポレーション        | 100 |
| 134 | 6877  | OBARA GROUP        | 100 |
| 135 | 7148  | FPG                | 500 |
| 136 | 7172  | ジャパンインベストメントアドバイザー | 100 |
| 137 | 7177  | GMOフィナンシャルホールディングス | 300 |
| 138 | 7220  | 武蔵精密工業             | 300 |
| 139 | 7244  | 市光工業               | 200 |
| 140 | 7256  | 河西工業               | 200 |
| 141 | 7419  | ノジマ                | 300 |
| 142 | 7593  | VTホールディングス         | 600 |
| 143 | 7606  | ユナイテッドアローズ         | 200 |
| 144 | 7611  | ハイデイ日高             | 200 |
| 145 | 7613  | シークス               | 200 |
| 146 | 7679  | 薬王堂ホールディングス        | 100 |
| 147 | 7717  | ブイ・テクノロジー          | 100 |
| 148 | 7718  | スター精密              | 200 |
| 149 | 7839  | SHOEI              | 200 |
| 150 | 7844  | マーベラス              | 200 |
| 151 | 7943  | ニチハ                | 200 |
| 152 | 8020  | 兼松                 | 500 |
| 153 | 8051  | 山善                 | 600 |
| 154 | 8074  | ユアサ商事              | 100 |
| 155 | 8096  | 兼松エレクトロニクス         | 100 |
| 156 | 8133  | 伊藤忠エネクス            | 300 |
| 157 | 8255  | アクシアル リテイリング       | 200 |
| 158 | 8739  | スパークス・グループ         | 700 |
| 159 | 8771  | イー・ギャランティ          | 200 |
| 160 | 8841  | テーオーシー             | 300 |
| 161 | 8890  | レーサム               | 100 |
| 162 | 8892  | 日本エスコン             | 300 |
| 163 | 8897  | タカラレーベン            | 700 |
| 164 | 8909  | シノケングループ           | 200 |
| 165 | 8920  | 東祥                 | 100 |
| 166 | 8923  | トーセイ               | 200 |
| 167 | 8934  | サンフロンティア不動産        | 200 |
| 168 | 8935  | エフ・ジェー・ネクスト        | 100 |
| 169 | 9037  | ハマキョウレックス          | 100 |
| 170 | 9058  | トランコム              | 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 | 9069  | センコーグループホールディングス | 800 |
| 172 | 9267  | Genky DrugStores | 100 |
| 173 | 9422  | コネクシオ            | 100 |
| 174 | 9514  | エフオン             | 100 |
| 175 | 9517  | イーレックス           | 200 |
| 176 | 9678  | カナモト             | 200 |
| 177 | 9682  | DTS              | 300 |
| 178 | 9699  | 西尾レントオール         | 100 |
| 179 | 9743  | 丹青社              | 300 |
| 180 | 9790  | 福井コンピュータホールディングス | 100 |
| 181 | 9928  | ミロク情報サービス        | 100 |
| 182 | 9974  | ベルク              | 100 |

以上

|        |                   |
|--------|-------------------|
| 会社名    | アセットマネジメントOne株式会社 |
| 代表者名   | 取締役社長 菅野 暁        |
| (コード番号 | 1494)             |
| 問合せ先   | 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5月8日現在）

1,153,652 口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年5月8日現在）

17,267,776,331 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年5月8日現在）

14,968 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5月8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<br>純資産額 | 日次騰落率  | 乖離率    | 上場受益権口数   | 純資産総額          |
| 2020/4/7  | 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 |
| 2020/4/24 | 146.00         | -0.24% | 14,706         | -0.26% | -0.02% | 1,153,652 | 16,965,637,284 |
| 2020/4/27 | 148.35         | 1.61%  | 14,944         | 1.62%  | 0.01%  | 1,153,652 | 17,240,242,208 |
| 2020/4/28 | 148.53         | 0.12%  | 14,965         | 0.14%  | 0.02%  | 1,153,652 | 17,264,675,339 |
| 2020/4/30 | 150.30         | 1.19%  | 15,137         | 1.15%  | -0.04% | 1,153,652 | 17,462,683,009 |
| 2020/5/1  | 147.12         | -2.12% | 14,818         | -2.11% | 0.01%  | 1,153,652 | 17,094,294,095 |
| 2020/5/7  | 145.54         | -1.07% | 14,664         | -1.04% | 0.03%  | 1,153,652 | 16,917,225,099 |
| 2020/5/8  | 148.57         | 2.08%  | 14,968         | 2.07%  | -0.01% | 1,153,652 | 17,267,776,331 |

## 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5月13日)、交換受付日(令和2年5月13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5月13日)、設定受付日(令和2年5月13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。

| 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   | 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5月8日現在）

831,883 口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年5月8日現在）

9,215,675,437 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年5月8日現在）

11,078.00 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5月8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<br>純資産額 | 日次騰落率  | 乖離率    | 上場受益権口数 | 純資産総額          |
| 2020/4/7  | 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  |
| 2020/4/24 | 106.36                   | -0.47% | 10,812.00      | -0.48% | -0.01% | 831,883 | 8,994,582,445  |
| 2020/4/27 | 108.41                   | 1.93%  | 11,021.00      | 1.93%  | 0.01%  | 831,883 | 9,167,830,843  |
| 2020/4/28 | 108.30                   | -0.10% | 11,012.00      | -0.08% | 0.02%  | 831,883 | 9,160,602,992  |
| 2020/4/30 | 109.75                   | 1.34%  | 11,153.00      | 1.28%  | -0.06% | 831,883 | 9,277,858,472  |
| 2020/5/1  | 106.97                   | -2.53% | 10,873.00      | -2.51% | 0.02%  | 831,883 | 9,045,177,243  |
| 2020/5/7  | 106.51                   | -0.44% | 10,827.00      | -0.42% | 0.01%  | 831,883 | 9,006,807,731  |
| 2020/5/8  | 109.00                   | 2.33%  | 11,078.00      | 2.32%  | -0.02% | 831,883 | 9,215,675,437  |

## 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](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5月13日)、交換受付日(令和2年5月13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5月13日)、設定受付日(令和2年5月13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  | 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              | 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                       | 300   |
| 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5月8日現在)

510,000 口

2. 上場ETFの純資産総額  
(令和2年5月8日現在)

537,049,624 円

3. 上場ETFの1口あたりの純資産額  
(令和2年5月8日現在)

1,053 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5月8日現在)

-0.04 %

(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。

|        |                   |
|--------|-------------------|
| 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   | 事務サービスグループ 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5月8日現在）

19,343,943 口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年5月8日現在）

32,321,632,968 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年5月8日現在）

1,670.89 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5月8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<br>純資産額   | 日次騰落率  | 乖離率    | 上場受益権口数    | 純資産総額          |
| 2020/4/7  | 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 |
| 2020/4/24 | 1,551.04 | -1.75% | 1,561.31         | -1.75% | 0.00%  | 19,343,943 | 30,201,926,366 |
| 2020/4/27 | 1,586.58 | 2.29%  | 1,597.05         | 2.29%  | -0.00% | 19,343,943 | 30,893,261,368 |
| 2020/4/28 | 1,563.99 | -1.42% | 1,578.41         | -1.17% | 0.26%  | 19,343,943 | 30,532,757,345 |
| 2020/4/30 | 1,576.43 | 0.80%  | 1,590.96         | 0.80%  | -0.00% | 19,343,943 | 30,775,419,662 |
| 2020/5/1  | 1,564.67 | -0.75% | 1,579.07         | -0.75% | -0.00% | 19,343,943 | 30,545,479,708 |
| 2020/5/7  | 1,573.51 | 0.56%  | 1,587.95         | 0.56%  | -0.00% | 19,343,943 | 30,717,135,353 |
| 2020/5/8  | 1,655.72 | 5.22%  | 1,670.89         | 5.22%  | -0.00% | 19,343,943 | 32,321,632,968 |

## 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5月13日)、交換受付日(令和2年5月13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5月13日)、設定受付日(令和2年5月13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、6万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   | 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   | 2979  | SOSILA物流リート投資法人 投資証券         | 3  |
| 4   | 3226  | 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券      | 4  |
| 5   | 3227  | MCUBS MidCity投資法人 投資証券       | 15 |
| 6   | 3234  | 森ヒルズリート投資法人 投資証券             | 13 |
| 7   | 3249  | 産業ファンド投資法人 投資証券              | 15 |
| 8   | 3269  | アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券         | 11 |
| 9   | 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 | 8  |
| 10  | 3279  | アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券      | 6  |
| 11  | 3281  | GLP投資法人 投資証券                 | 29 |
| 12  | 3282  | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券      | 5  |
| 13  | 3283  | 日本プロロジスリート投資法人 投資証券          | 17 |
| 14  | 3287  | 星野リゾート・リート投資法人 投資証券          | 2  |
| 15  | 3290  | Oneリート投資法人 投資証券              | 2  |
| 16  | 3292  | イオンリート投資法人 投資証券              | 12 |
| 17  | 3295  | ヒューリックリート投資法人 投資証券           | 10 |
| 18  | 3296  | 日本リート投資法人 投資証券               | 4  |
| 19  | 3298  | インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券   | 74 |
| 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       | 37 |
| 26  | 3463  | いちごホテルリート投資法人 投資証券           | 2  |
| 27  | 3466  | ラサールロジポート投資法人 投資証券           | 11 |
| 28  | 3468  | スターアジア不動産投資法人 投資証券           | 4  |
| 29  | 3470  | マリモ地方創生リート投資法人 投資証券          | 1  |
| 30  | 3471  | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券     | 3  |
| 31  | 3472  | 大江戸温泉リート投資法人 投資証券            | 2  |
| 32  | 3473  | さくら総合リート投資法人 投資証券            | 2  |
| 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         | 8  |
| 45  | 8956  | プレミア投資法人 投資証券                | 10 |
| 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  | 37 |
| 62  | 8986  | 大和証券リビング投資法人 投資証券      | 14 |
| 63  | 8987  | ジャパンエクセレント投資法人 投資証券    | 11 |

以上

各 位

|        |                   |
|--------|-------------------|
| 会社名    | アセットマネジメントOne株式会社 |
| 代表者名   | 取締役社長 菅野 暁        |
| (コード番号 | 1683)             |
| 問合せ先   | 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5月8日現在)

14,260 口

---

2. 上場ETFの純資産総額  
(令和2年5月8日現在)

76,539,873 円

---

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額  
(令和2年5月8日現在)

5,367 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5月8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。