

令和2年6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6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6月23日現在)

13,047,203 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年6月23日現在)

296,632,689,929 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年6月23日現在)

22,735 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6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
2020/5/27	21,419.23	0.70%	21,600	0.70%	0.01%	14,092,931	304,407,658,036
2020/5/28	21,916.31	2.32%	22,103	2.33%	0.01%	14,092,931	311,500,735,955
2020/5/29	21,877.89	-0.18%	22,060	-0.19%	-0.02%	14,092,931	310,886,582,234
2020/6/1	22,062.39	0.84%	22,247	0.85%	0.00%	14,092,931	313,532,363,391
2020/6/2	22,325.61	1.19%	22,513	1.20%	0.00%	13,212,141	297,439,200,986
2020/6/3	22,613.76	1.29%	22,804	1.29%	0.00%	12,992,069	296,270,345,032
2020/6/4	22,695.74	0.36%	22,885	0.36%	-0.01%	12,992,069	297,329,842,182
2020/6/5	22,863.73	0.74%	23,054	0.74%	-0.00%	13,019,592	300,148,990,641
2020/6/8	23,178.10	1.37%	23,370	1.37%	-0.00%	13,019,592	304,272,510,854
2020/6/9	23,091.03	-0.38%	23,283	-0.37%	0.00%	13,157,212	306,333,720,094
2020/6/10	23,124.95	0.15%	23,314	0.13%	-0.01%	13,157,212	306,748,944,663
2020/6/11	22,472.91	-2.82%	22,657	-2.82%	0.00%	12,992,101	294,359,193,704
2020/6/12	22,305.48	-0.75%	22,488	-0.75%	-0.00%	12,992,101	292,163,625,842
2020/6/15	21,530.95	-3.47%	21,706	-3.48%	-0.01%	12,992,101	282,009,582,023
2020/6/16	22,582.21	4.88%	22,765	4.88%	-0.00%	12,992,101	295,768,228,254
2020/6/17	22,455.76	-0.56%	22,643	-0.54%	0.02%	12,992,101	294,183,082,938
2020/6/18	22,355.46	-0.45%	22,538	-0.46%	-0.02%	12,909,538	290,950,114,856
2020/6/19	22,478.79	0.55%	22,665	0.56%	0.01%	13,074,751	296,343,652,137
2020/6/22	22,437.27	-0.18%	22,620	-0.20%	-0.01%	13,102,275	296,378,216,632
2020/6/23	22,549.05	0.50%	22,735	0.51%	0.01%	13,047,203	296,632,689,929

交換にかかる交換口数

交換申込日(令和2年6月26日)、交換受付日(令和2年6月26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6月26日)、設定受付日(令和2年6月26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
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6月23日現在）

145,402,030

口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年6月23日現在）

235,014,547,299

円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年6月23日現在）

1,616.31

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6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
2020/5/27	1,549.47	0.96%	1,578.00	0.96%	0.00%	122,918,555	193,965,981,196
2020/5/28	1,577.34	1.80%	1,606.63	1.81%	0.02%	122,918,555	197,484,535,060
2020/5/29	1,563.67	-0.87%	1,592.33	-0.89%	-0.02%	122,918,555	195,726,736,633
2020/6/1	1,568.75	0.32%	1,597.74	0.34%	0.01%	125,284,355	200,171,493,747
2020/6/2	1,587.68	1.21%	1,616.91	1.20%	-0.01%	123,321,162	199,398,625,978
2020/6/3	1,599.08	0.72%	1,628.62	0.72%	0.01%	128,646,562	209,516,440,034
2020/6/4	1,603.82	0.30%	1,633.43	0.30%	-0.00%	128,646,562	210,135,795,749
2020/6/5	1,612.48	0.54%	1,642.20	0.54%	-0.00%	132,590,762	217,740,919,784
2020/6/8	1,630.72	1.13%	1,660.73	1.13%	-0.00%	132,590,762	220,197,439,532
2020/6/9	1,628.43	-0.14%	1,658.37	-0.14%	-0.00%	132,590,762	219,884,552,788
2020/6/10	1,624.71	-0.23%	1,654.41	-0.24%	-0.01%	132,590,762	219,359,853,513
2020/6/11	1,588.92	-2.20%	1,618.08	-2.20%	0.01%	142,447,062	230,490,473,256
2020/6/12	1,570.68	-1.15%	1,599.32	-1.16%	-0.01%	142,447,062	227,818,944,840
2020/6/15	1,530.78	-2.54%	1,558.73	-2.54%	0.00%	142,447,062	222,036,300,397
2020/6/16	1,593.45	4.09%	1,622.50	4.09%	-0.00%	140,473,630	227,919,039,613
2020/6/17	1,587.09	-0.40%	1,616.40	-0.38%	0.02%	142,444,830	230,248,017,911
2020/6/18	1,583.09	-0.25%	1,611.96	-0.27%	-0.02%	142,444,830	229,614,924,638
2020/6/19	1,582.80	-0.02%	1,612.00	0.00%	0.02%	143,431,430	231,211,468,438
2020/6/22	1,579.09	-0.23%	1,607.98	-0.25%	-0.01%	145,402,030	233,803,378,762
2020/6/23	1,587.14	0.51%	1,616.31	0.52%	0.01%	145,402,030	235,014,547,299

交換にかかる交換口数

交換申込日(令和2年6月26日)、交換受付日(令和2年6月26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6月26日)、設定受付日(令和2年6月26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6月23日現在)

10,886,667 口

2. 上場ETFの純資産総額 (令和2年6月23日現在)

158,100,162,531 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (令和2年6月23日現在)

14,522 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6月23日現在)

0.01 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{JPX日経400の終値}}{\text{前営業日のJPX日経400の終値}} \right] \times 100(\%)$$

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
2020/5/27	13,933.23	0.91%	14,158	0.91%	-0.00%	10,678,901	151,195,571,437
2020/5/28	14,195.52	1.88%	14,427	1.90%	0.02%	10,678,901	154,065,090,980
2020/5/29	14,078.89	-0.82%	14,305	-0.85%	-0.02%	10,678,901	152,763,006,981
2020/6/1	14,132.45	0.38%	14,362	0.40%	0.02%	10,708,535	153,792,025,923
2020/6/2	14,301.63	1.20%	14,532	1.18%	-0.01%	10,757,910	156,334,249,810
2020/6/3	14,411.53	0.77%	14,644	0.77%	0.00%	10,757,910	157,540,051,868
2020/6/4	14,454.87	0.30%	14,689	0.31%	0.01%	10,757,910	158,020,430,300
2020/6/5	14,534.54	0.55%	14,769	0.54%	-0.01%	10,757,910	158,884,603,140
2020/6/8	14,694.12	1.10%	14,930	1.09%	-0.01%	10,757,910	160,617,702,766
2020/6/9	14,676.32	-0.12%	14,913	-0.11%	0.01%	10,757,910	160,429,278,257
2020/6/10	14,636.97	-0.27%	14,870	-0.29%	-0.02%	10,767,816	160,116,970,102
2020/6/11	14,320.50	-2.16%	14,549	-2.16%	0.00%	10,777,718	156,805,188,098
2020/6/12	14,172.29	-1.03%	14,397	-1.04%	-0.01%	10,777,718	155,169,025,308
2020/6/15	13,801.09	-2.62%	14,020	-2.62%	0.00%	10,787,621	151,246,345,551
2020/6/16	14,367.07	4.10%	14,595	4.10%	0.00%	10,807,421	157,737,694,835
2020/6/17	14,302.51	-0.45%	14,534	-0.42%	0.03%	10,817,325	157,214,940,353
2020/6/18	14,261.28	-0.29%	14,487	-0.32%	-0.04%	10,827,225	156,856,925,804
2020/6/19	14,263.59	0.02%	14,493	0.04%	0.03%	10,856,943	157,352,267,366
2020/6/22	14,227.29	-0.25%	14,453	-0.28%	-0.02%	10,856,943	156,919,139,019
2020/6/23	14,293.21	0.46%	14,522	0.48%	0.01%	10,886,667	158,100,162,531

交換にかかる交換口数

交換申込日(令和2年6月26日)、交換受付日(令和2年6月26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6月26日)、設定受付日(令和2年6月26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6月23日現在）

27,170,135 口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年6月23日現在）

42,522,089,913 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年6月23日現在）

1,565.03 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6月23日現在）

0.02 %

（参考）乖離率の計算式

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

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
2020/5/27	1,512.33	0.79%	1,526.63	0.80%	0.01%	29,143,539	44,491,305,223
2020/5/28	1,538.66	1.74%	1,553.46	1.76%	0.02%	29,143,539	45,273,198,017
2020/5/29	1,531.00	-0.50%	1,545.21	-0.53%	-0.03%	29,143,539	45,032,952,093
2020/6/1	1,533.57	0.17%	1,548.08	0.19%	0.02%	29,143,539	45,116,645,294
2020/6/2	1,547.32	0.90%	1,561.99	0.90%	0.00%	29,143,539	45,521,864,014
2020/6/3	1,558.64	0.73%	1,573.50	0.74%	0.01%	29,143,539	45,857,219,632
2020/6/4	1,565.17	0.42%	1,580.01	0.41%	-0.01%	29,143,539	46,047,084,753
2020/6/5	1,569.52	0.28%	1,584.47	0.28%	0.00%	29,143,539	46,176,990,295
2020/6/8	1,580.98	0.73%	1,596.15	0.74%	0.01%	29,143,539	46,517,362,243
2020/6/9	1,582.33	0.09%	1,597.37	0.08%	-0.01%	29,143,539	46,552,986,553
2020/6/10	1,579.88	-0.15%	1,594.69	-0.17%	-0.01%	29,143,539	46,474,808,289
2020/6/11	1,551.74	-1.78%	1,566.22	-1.79%	-0.00%	27,170,135	42,554,289,108
2020/6/12	1,536.68	-0.97%	1,550.72	-0.99%	-0.02%	27,170,135	42,133,399,835
2020/6/15	1,498.28	-2.50%	1,511.98	-2.50%	0.00%	27,170,135	41,080,600,805
2020/6/16	1,556.69	3.90%	1,570.95	3.90%	0.00%	27,170,135	42,682,930,359
2020/6/17	1,548.78	-0.51%	1,563.46	-0.48%	0.03%	27,170,135	42,479,502,843
2020/6/18	1,546.45	-0.15%	1,560.61	-0.18%	-0.03%	27,170,135	42,401,918,260
2020/6/19	1,549.45	0.19%	1,563.94	0.21%	0.02%	27,170,135	42,492,473,401
2020/6/22	1,546.50	-0.19%	1,560.63	-0.21%	-0.02%	27,170,135	42,402,611,101
2020/6/23	1,550.59	0.26%	1,565.03	0.28%	0.02%	27,170,135	42,522,089,913

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6月26日)、交換受付日(令和2年6月26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6月26日)、設定受付日(令和2年6月26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6月23日現在）

610,762 口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年6月23日現在）

8,119,127,865 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年6月23日現在）

13,293 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6月23日現在)

0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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
2020/5/27	13,124.92	0.70%	13,233	0.71%	0.00%	662,195	8,763,072,438
2020/5/28	13,146.15	0.16%	13,265	0.24%	0.08%	662,195	8,783,696,181
2020/5/29	13,134.27	-0.09%	13,247	-0.14%	-0.05%	662,195	8,771,898,671
2020/6/1	13,204.36	0.53%	13,317	0.53%	-0.01%	662,195	8,818,510,187
2020/6/2	13,390.81	1.41%	13,503	1.40%	-0.02%	662,195	8,941,683,013
2020/6/3	13,380.69	-0.08%	13,496	-0.05%	0.02%	662,195	8,937,218,461
2020/6/4	13,369.55	-0.08%	13,486	-0.07%	0.01%	662,195	8,930,598,724
2020/6/5	13,367.31	-0.02%	13,486	0.00%	0.02%	662,195	8,930,325,833
2020/6/8	13,504.56	1.03%	13,624	1.02%	-0.00%	662,195	9,021,596,089
2020/6/9	13,510.53	0.04%	13,629	0.04%	-0.01%	662,195	9,024,742,013
2020/6/10	13,517.20	0.05%	13,634	0.04%	-0.01%	662,195	9,028,422,645
2020/6/11	13,166.63	-2.59%	13,284	-2.57%	0.03%	622,666	8,271,404,665
2020/6/12	12,961.84	-1.56%	13,077	-1.56%	-0.00%	622,666	8,142,646,397
2020/6/15	12,586.17	-2.90%	12,700	-2.88%	0.02%	622,666	7,907,733,884
2020/6/16	13,120.07	4.24%	13,237	4.23%	-0.01%	622,666	8,242,172,638
2020/6/17	13,089.20	-0.24%	13,209	-0.21%	0.02%	622,666	8,224,953,948
2020/6/18	13,102.21	0.10%	13,216	0.05%	-0.05%	622,666	8,229,405,728
2020/6/19	13,095.10	-0.05%	13,213	-0.02%	0.03%	610,762	8,069,991,474
2020/6/22	13,107.43	0.09%	13,221	0.06%	-0.03%	610,762	8,074,846,525
2020/6/23	13,178.18	0.54%	13,293	0.54%	0.00%	610,762	8,119,127,865

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6月26日)、交換受付日(令和2年6月26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6月26日)、設定受付日(令和2年6月26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
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
1494)
事務サービスグループ 鈴木 俊直
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6月23日現在）

965,835

口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年6月23日現在）

15,416,085,265

円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年6月23日現在）

15,961

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6月23日現在)

0.02

%

(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

-

S&P/JPX 配当貴族指数の終値

前営業日の
S&P/JPX 配当貴族指数の終値

×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 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
2020/5/27	157.82	1.97%	15,894	1.94%	-0.04%	1,088,042	17,292,829,337
2020/5/28	159.57	1.11%	16,076	1.15%	0.04%	1,088,042	17,490,876,973
2020/5/29	158.09	-0.92%	15,923	-0.95%	-0.03%	1,088,042	17,324,476,232
2020/6/1	158.08	-0.01%	15,927	0.03%	0.03%	1,088,042	17,328,845,066
2020/6/2	159.85	1.12%	16,103	1.11%	-0.01%	1,088,042	17,520,967,487
2020/6/3	161.16	0.82%	16,236	0.83%	0.00%	1,088,042	17,665,618,395
2020/6/4	161.23	0.04%	16,244	0.05%	0.01%	1,088,042	17,674,642,284
2020/6/5	162.44	0.75%	16,364	0.74%	-0.01%	1,088,042	17,804,749,831
2020/6/8	165.44	1.85%	16,661	1.81%	-0.03%	1,088,042	18,127,405,814
2020/6/9	164.65	-0.48%	16,583	-0.47%	0.01%	1,088,042	18,042,732,979
2020/6/10	163.55	-0.67%	16,477	-0.64%	0.03%	1,088,042	17,928,091,969
2020/6/11	159.02	-2.77%	16,027	-2.73%	0.04%	998,576	16,004,605,941
2020/6/12	157.13	-1.19%	15,834	-1.20%	-0.02%	998,576	15,811,556,899
2020/6/15	153.75	-2.15%	15,491	-2.17%	-0.01%	968,762	15,007,058,043
2020/6/16	159.27	3.59%	16,049	3.60%	0.01%	965,835	15,500,941,873
2020/6/17	158.53	-0.47%	15,982	-0.42%	0.05%	965,835	15,435,591,181
2020/6/18	158.03	-0.31%	15,925	-0.36%	-0.04%	965,835	15,381,130,753
2020/6/19	157.78	-0.16%	15,907	-0.11%	0.04%	965,835	15,363,910,509
2020/6/22	157.72	-0.04%	15,895	-0.08%	-0.04%	965,835	15,351,781,082
2020/6/23	158.35	0.40%	15,961	0.42%	0.02%	965,835	15,416,085,265

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6月26日)、交換受付日(令和2年6月26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6月26日)、設定受付日(令和2年6月26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	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6月23日現在）

627,303 口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年6月23日現在）

7,552,045,539 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年6月23日現在）

12,039.00 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6月23日現在）

0.01 %

（参考）乖離率の計算式

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

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
2020/5/27	115.54	1.20%	11,741.00	1.20%	-0.00%	831,883	9,767,109,158
2020/5/28	118.15	2.26%	12,005.00	2.25%	-0.01%	831,883	9,986,990,961
2020/5/29	116.91	-1.05%	11,877.00	-1.07%	-0.02%	831,883	9,879,981,507
2020/6/1	117.20	0.25%	11,908.00	0.26%	0.01%	831,883	9,906,333,624
2020/6/2	118.49	1.10%	12,038.00	1.09%	-0.01%	831,883	10,014,600,827
2020/6/3	119.60	0.94%	12,151.00	0.94%	0.00%	831,883	10,108,012,365
2020/6/4	119.89	0.24%	12,180.00	0.24%	-0.01%	831,883	10,132,732,193
2020/6/5	120.72	0.69%	12,263.00	0.68%	-0.01%	757,232	9,285,900,226
2020/6/8	122.57	1.53%	12,449.00	1.52%	-0.02%	757,232	9,426,725,366
2020/6/9	122.30	-0.22%	12,422.00	-0.22%	0.00%	757,232	9,406,043,702
2020/6/10	121.81	-0.40%	12,371.00	-0.41%	-0.01%	757,232	9,367,849,054
2020/6/11	118.80	-2.48%	12,067.00	-2.46%	0.02%	670,728	8,093,795,465
2020/6/12	117.60	-1.01%	11,943.00	-1.03%	-0.02%	670,728	8,010,581,674
2020/6/15	114.46	-2.67%	11,625.00	-2.66%	0.01%	670,728	7,797,425,487
2020/6/16	119.42	4.33%	12,127.00	4.32%	-0.02%	631,256	7,655,451,318
2020/6/17	118.59	-0.69%	12,049.00	-0.64%	0.05%	631,256	7,605,947,488
2020/6/18	118.02	-0.48%	11,988.00	-0.51%	-0.02%	627,303	7,519,802,605
2020/6/19	117.99	-0.03%	11,988.00	0.00%	0.03%	627,303	7,520,261,892
2020/6/22	117.87	-0.10%	11,973.00	-0.13%	-0.02%	627,303	7,510,546,000
2020/6/23	118.51	0.55%	12,039.00	0.55%	0.01%	627,303	7,552,045,539

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6月26日)、交換受付日(令和2年6月26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6月26日)、設定受付日(令和2年6月26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	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6月23日現在)

510,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(令和2年6月23日現在)

578,909,275 円

3. 上場ETFの1口あたりの純資産額
(令和2年6月23日現在)

1,135 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6月23日現在)

-0.06 %

(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	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6月23日現在）

19,403,643 口

2. 上場ETFの純資産総額（令和2年6月23日現在）

33,224,845,988 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（令和2年6月23日現在）

1,712.30 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6月23日現在）

-0.00 %

（参考）乖離率の計算式

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

5. 交換にかかる交換口数（別紙参照）

6. 設定にかかる株式のポートフォリオ（別紙参照）

One ETF 東証REIT指数

日付	東証REIT指数		One ETF 東証REIT指数				
	指数終値	日次騰落率	一口あたりの 純資産額	日次騰落率	乖離率	上場受益権口数	純資産総額
2020/5/27	1,677.21	0.75%	1,692.46	0.75%	-0.00%	19,343,943	32,738,829,327
2020/5/28	1,671.67	-0.33%	1,692.03	-0.03%	0.30%	19,343,943	32,730,532,083
2020/5/29	1,701.03	1.76%	1,721.74	1.76%	-0.00%	19,343,943	33,305,169,844
2020/6/1	1,671.93	-1.71%	1,692.26	-1.71%	-0.00%	19,343,943	32,735,043,159
2020/6/2	1,701.81	1.79%	1,722.49	1.79%	-0.00%	19,343,943	33,319,821,830
2020/6/3	1,734.95	1.95%	1,756.01	1.95%	-0.00%	19,343,943	33,968,237,171
2020/6/4	1,703.06	-1.84%	1,723.72	-1.84%	-0.00%	19,046,927	32,831,651,464
2020/6/5	1,719.57	0.97%	1,740.43	0.97%	-0.00%	19,046,927	33,149,844,525
2020/6/8	1,753.41	1.97%	1,774.65	1.97%	-0.00%	19,046,927	33,801,568,222
2020/6/9	1,758.66	0.30%	1,779.95	0.30%	-0.00%	19,046,927	33,902,586,987
2020/6/10	1,761.42	0.16%	1,782.72	0.16%	-0.00%	19,046,927	33,955,319,298
2020/6/11	1,708.60	-3.00%	1,729.27	-3.00%	0.00%	18,868,643	32,628,892,560
2020/6/12	1,716.68	0.47%	1,737.40	0.47%	-0.00%	18,868,643	32,782,471,850
2020/6/15	1,635.73	-4.72%	1,655.49	-4.71%	0.00%	18,868,643	31,236,780,075
2020/6/16	1,708.58	4.45%	1,729.22	4.45%	-0.00%	18,928,043	32,730,683,703
2020/6/17	1,721.36	0.75%	1,742.19	0.75%	0.00%	18,928,043	32,976,206,787
2020/6/18	1,721.48	0.01%	1,742.30	0.01%	-0.00%	19,344,143	33,703,350,661
2020/6/19	1,684.76	-2.13%	1,705.15	-2.13%	0.00%	19,344,143	32,984,606,441
2020/6/22	1,685.76	0.06%	1,706.12	0.06%	-0.00%	19,403,643	33,104,949,738
2020/6/23	1,691.88	0.36%	1,712.30	0.36%	-0.00%	19,403,643	33,224,845,988

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「**関東東京証券取引所**」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**関東東京証券取引所**が有しています。
- ②**関東東京証券取引所**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**関東東京証券取引所**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**関東東京証券取引所**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、**関東東京証券取引所**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、**関東東京証券取引所**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**関東東京証券取引所**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義務を持ちません。
- ⑦**関東東京証券取引所**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、**関東東京証券取引所**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6月26日)、交換受付日(令和2年6月26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6月26日)、設定受付日(令和2年6月26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6月23日現在)

14,260 口

2. 上場ETFの純資産総額
(令和2年6月23日現在)

78,832,926 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(令和2年6月23日現在)

5,528 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6月23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。