

## 本邦初、中国 A 株 CSI500 指数への連動をめざす ETF を東証に上場予定

アセットマネジメントOne株式会社（東京都千代田区、取締役社長 菅野暁）は、本邦で初めて、中国 A 株 CSI スモールキャップ 500 指数に連動する投資成果をめざす以下のETFを2019年6月25日に東京証券取引所へ上場します。本ETFの組成に際して、当社は、株式会社日本取引所グループと上海証券取引所の提携プロジェクトである「日中ETFコネクティビティ」へ参画し、中国現地の運用会社であるチャイナ・サザン・アセット・マネジメント社（中国語名称「南方基金管理股份有限公司」）と共同で設定準備を進めました。

銘柄コード	銘柄名	連動対象指数
2553	One ETF 南方 中国 A 株 CSI500	CSI スモールキャップ 500 指数

本ETFは、上海証券取引所に上場しているETFへの投資を通じて、実質的に中国の中小型株式へ投資します。中国は先進国と比較して依然高い成長を続けており、その成長を享受したいというお客様のニーズに対応するため、当社は中国株式へ投資するETFの上場を検討してきました。本邦では既に中国の大型株式へ投資するETFは上場されていますが、中小型株式に投資するETFは現状存在しないため、本邦初の商品となります。

当社はこれからも、ETFラインナップの拡充等様々な投資機会の提供を行うことで、個人投資家の皆さまの資産形成に資する運用サービスのご提供に努めてまいります。

### 【CSI スモールキャップ 500指数について】

CSI スモールキャップ 500指数は、上海証券取引所および深セン証券取引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、上位500銘柄で構成されている中国の中小型株式の代表的な株価指数です。

以上

### 【取引所における売買時のファンド概要】

商品分類	追加型投信／海外／株式／ETF／インデックス型
銘柄コード	2553
上場市場	東京証券取引所
取引所 売買単位	10口単位
上場日	2019年6月25日（予定）
信託期間	無期限（設定日：2019年6月24日（予定））
決算日	毎年7月8日（初回決算日：2020年7月8日）
収益分配	経費控除後の配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）の全額を分配することを原則とします。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

### 【設定・交換時のファンド概要】

※取引所で売買をされる投資者の皆さまには該当いたしません。

申込締切時間	原則としてお申込受付日の前営業日の15時まで ※詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
購入価額	当初申込期間：1口当たり1,000円 継続申込期間：購入申込受付日の翌営業日の基準価額
購入単位	10,000口以上10,000口単位（当初元本1口＝1,000円）
換金価額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した価額
換金単位	10,000口以上10,000口単位

詳しくは、投資信託説明書（交付目論見書）をご覧ください。

### 【投資リスク】

当ファンドは、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金と異なります。※詳しくは投資信託説明書（交付目論見書）をご覧ください。

<基準価額の変動要因>

株価変動リスク	株式の価格は、国内外の政治・経済・社会情勢の変化、発行企業の業績・経営状況の変化、市場の需給関係等の影響を受け変動します。株式市場や当ファンドが実質的に投資する企業の株価が下落した場合には、その影響を受け、基準価額が下落する要因となります。当ファンドが実質的に投資対象とする新興国の中小型株式は、一般に先進国株式や、その新興国の株式市場全体の動きと比較して株価が大きく変動する場合があります。また、基準価額が大きく下落する場合があります。
流動性リスク	有価証券等を売却または取得する際に市場規模や取引量、取引規制等により、その取引価格が影響を受ける場合があります。一般に市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなる場合があります。また、基準価額に影響をおよぼす要因となります。当ファンドが実質的に投資対象とする新興国の中小型株式は、先進国株式や大型株式と比較して、一般に流動性が低い傾向があります。また、当ファンドが主要投資対象とする中国A株ETFは、上海証券取引所に上場されていますが、取引が活発に行われることを保証するものではなく、中国A株ETFの取引は諸要因で停止される可能性があります。また上場基準を満たせなくなった場合は、上場廃止の可能性があります。
為替変動リスク	為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため、為替相場が当該組入資産の通貨に対して円高になった場合には、実質保有外貨建資産が現地通貨ベースで値上がりした場合でも基準価額が下落する可能性があります。
カントリーリスク	投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制、また、取引規制等の要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。海外に投資する場合には、これらの影響を受け、基準価額が下落する要因となる場合があります。当ファンドが実質的に投資を行う株式や通貨の発行者が属する国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準

	備高等の悪化等が株式市場や為替市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制や課徴的な税制、海外への送金規制等の種々の規制の導入や政策の変更等の要因も株式市場や為替市場に著しい影響をおよぼす可能性があります。
信用リスク	有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。当ファンドが実質的に投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、また、こうした状況に陥ると予想される場合、信用格付けが格下げされた場合等には、株式の価格が下落したり、その価値がなくなることがあり、基準価額が下落する要因となります。
組入上場投資信託証券に関するリスク	当ファンドが主要投資対象とする上場投資信託証券（ETF）の関係法人（投資顧問会社などを含む）におけるファンド運営業務、設立国や取引市場などでの規制当局の動向、法制度や税務制度などの変更が、間接的に当ファンドの運営に大きな影響をおよぼす可能性があります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

### 【ファンドの費用等】

当該費用の合計額、その上限額および計算方法は、運用状況および受益者の保有期間等により異なるため、事前に記載することができません。詳しくは、投資信託説明書（交付目論見書）をご覧ください。

取引所における売買時にご負担いただく費用											
売買委託手数料	取扱い第一種金融商品取引業者（証券会社）が独自に定める額 ※詳しくは取扱会社にお問い合わせください。										
信託財産留保額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額										
設定・交換される場合に直接ご負担いただく費用											
購入時手数料	販売会社が定める額 ※詳しくは販売会社にお問い合わせください。										
換金時手数料	販売会社が定める額 ※詳しくは販売会社にお問い合わせください。										
投資者が信託財産で間接的に負担する費用											
運用管理費用（信託報酬）	ファンド	<p>委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、以下により計算される①と②の合計額とします。</p> <p>①ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.2592% *（税抜0.24%）以内の率を乗じて得た額  信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率  ※有価証券届出書提出日（2019年5月23日）現在は、年率0.2592% *（税抜0.24%）になります。配分は以下の通りです。  *消費税率が10%になった場合は、年率0.264%となります。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>支払先</th> <th>内訳（税抜）</th> <th>主な役務</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>委託会社</td> <td>年率 0.20%</td> <td>信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価</td> </tr> <tr> <td>受託会社</td> <td>年率 0.04%</td> <td>運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行、名義登録事務・分配金および償還金支払関係事務等の対価</td> </tr> </tbody> </table> <p>②株式の貸付の指図を行った場合は、その品貸料に54% *（税抜50%）以内の率を乗じた額につき、委託会社と受託会社で折半します。  *消費税率が10%になった場合は、55%となります。  ※信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。</p>	支払先	内訳（税抜）	主な役務	委託会社	年率 0.20%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	受託会社	年率 0.04%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行、名義登録事務・分配金および償還金支払関係事務等の対価
支払先	内訳（税抜）	主な役務									
委託会社	年率 0.20%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価									
受託会社	年率 0.04%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行、名義登録事務・分配金および償還金支払関係事務等の対価									
	投資対象とする上場投資信託	チャイナ・サザン CSI 500 インデックス ETFの純資産総額に対して年率0.60%程度									

	実質的な負担	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.8592%＊（税抜0.84%）（概算）</p> <p>＊消費税率が10%になった場合は、年率0.864%となります。</p> <p>※上記はファンドが投資対象とするチャイナ・サザン CSI 500 インデックス ETFを高位に組入れた状態を想定しています。</p> <p>※株式の貸付を行った場合は、上記②が加算されます。</p>
その他費用・手数料	<p>その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。</p> <p>①信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。</p> <p>②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。</p> <p>③有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外国での資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。</p> <p>④受益権の上場にかかる費用（上場審査料（54万円＊1（税抜50万円））、新規上場料（新規上場時の純資産総額に対して0.0081%＊2（税抜0.0075%））、年間上場料（毎年末の純資産総額に対して0.0081%＊2（税抜0.0075%））、追加上場料（追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して0.0081%＊2（税抜0.0075%）））は、信託財産から支払うことができるものとします。</p> <p>＊1 消費税率が10%になった場合は、55万円となります。</p> <p>＊2 消費税率が10%になった場合は、0.00825%となります。</p> <p>⑤CSI スモールキャップ 500 指数についての商標（これに類する商標を含みます。）の使用料は、信託財産から支払うことができるものとします。</p> <p>⑥上記の費用・手数料等については、投資対象とするチャイナ・サザン CSI 500 インデックス ETFにおいても発生するものもあります。また、上記以外にもその他の費用・手数料等が別途かかる場合があります。</p> <p>※上記の「その他の費用」については、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。</p> <p>※有価証券届出書提出日（2019年5月23日）現在。</p> <p>※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。</p>	

#### 【ご注意事項】

- ・当資料は、アセットマネジメントOne株式会社が作成したものです。
- ・当ファンドを金融商品取引所で売買される場合には、お申込みになる証券会社より交付される契約締結前交付書面または上場有価証券等書面の内容を必ずご確認のうえ、ご自身でご判断ください。
- ・信託の設定の申込みの場合には、投資信託説明書（交付目論見書）を販売会社（指定参加者）よりお渡しいたしますので、内容を必ずご確認のうえ、ご自身でご判断ください。また、投資信託説明書（交付目論見書）は、アセットマネジメントOne株式会社のホームページでご覧になれます。
- ・当ファンドは、株式等の値動きのある有価証券に投資をします。そのため、連動対象である株価指数の変動、市場環境、組入有価証券の発行者に係る信用状況等の変化により基準価額、市場取引価格は変動します。
- ・投資家の皆様の投資元本は保証されているものではなく、市場取引価格または基準価額の下落により、投資元本を割り込み、損失が生じるおそれがあります。
- ・投資信託は預金等や保険契約ではありません。
- ・当資料における内容は作成時点（2019年5月23日）のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

### 【委託会社およびファンドの関係法人】

- ＜委託会社＞ アセットマネジメント One 株式会社  
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第 324 号  
加入協会：一般社団法人投資信託協会/一般社団法人日本投資顧問業協会
- ＜受託会社＞ みずほ信託銀行株式会社
- ＜販売会社＞ 委託会社にお問い合わせください。

### 【アセットマネジメントOneについて】

アセットマネジメントOne株式会社は、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社の資産運用部門、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社（以下、総称して「統合4社」）が統合し、2016年10月1日に発足した資産運用会社です。「投資顧問事業」と「投資信託事業」の双方の事業領域における運用資産残高は約52兆円と国内有数の規模を誇ります。

統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、資産運用のプロフェッショナルとして、グローバル運用リサーチ体制に支えられた伝統的資産のアクティブ運用や金融工学を駆使した最先端の運用戦略等、個人投資家や機関投資家の多様な運用ニーズに対し、最高水準のソリューションの提供をめざします。

HP： <http://www.am-one.co.jp/>

※運用資産残高は2019年3月末時点。

商号等 / アセットマネジメントOne株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第324号

加入協会 / 一般社団法人投資信託協会、一般社団法人日本投資顧問業協会