

平成 27 年 2 月 16 日

各 位

管理会社名 チャイナ・アセット・マネジメント（香港）・リミテッド
代表者名 最高経営責任者 張霄岭
(銘柄コード 1575)
問合せ先 アンダーソン・毛利・友常法律事務所
担当者 弁護士 平川 修
(TEL 03-6888-1000)

平成 26 年 12 月期（平成 26 年 1 月 1 日～平成 26 年 12 月 31 日）信託財産状況報告書

チャイナ・アセット・マネジメント（香港）・リミテッドを発行者として上場する下記の **ETF** 銘柄について、
信託財産状況報告書（以下、「本報告書」といいます）を開示（※注）致します。

銘柄	銘柄コード	上場取引所
ChinaAMC CSI 300 Index ETF-JDR	1575	東

※注

本報告書は、信託業法第 27 条第 1 項の規定に基づき、受託者たる三菱 UFJ 信託銀行株式会社が作成し、
東京証券取引所の有価証券上場規程に定める上場外国指標連動証券信託受益証券の管理会社が開示致します。

以 上

ChinaAMC CSI 300 Index ETF-JDR 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 2 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「ChinaAMC CSI 300 Index ETF-JDR」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
平成 26 年 12 月 31 日現在	
平成 26 年 1 月 1 日～平成 26 年 12 月 31 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	ChinaAMC CSI 300 Index ETF-JDR
銘柄コード	1575
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村證券株式会社
受託者	三菱UFJ信託銀行株式会社、日本マスタートラスト信託銀行株式会社
信託財産	本信託財産は、CSI 300 インデックス（以下、「本指標」といいます。）に連動する ETF（以下、「受託有価証券」といいます。）およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	年一回の分配を行う予定です。

■信託財産を構成する資産の内容

1、外国投資信託受益証券

資産の種類	外国投資信託受益証券
資産の名称	ChinaAMC CSI 300 Index ETF
純資産総額	198,703,586 円（平成 26 年 12 月 31 日時点）（注 1）
一証券あたりの純資産額	662 円（平成 26 年 12 月 31 日時点）
価額の算出方法および外国投資信託受益証券に係る権利を有する者への報告の頻度および方法	当該外国投資信託受益証券の価額は、保有資産等の前日の終値に基づいて算出され、純資産残高（RMB のみ）および一口あたり総資産残高（RMB、HKD）が運用者のウェブサイト（ http://www.chinaamc ）

	com.hk/portal/HKen/etf_fund.jsp) で毎日公表されています。
ファンド資産の運用者、保管者およびその他重要な業務を行う者の名称、住所および役割（注2）	・ Manager（運用者） China Asset Management（Hong Kong） Limited 37/F, Bank of China Tower, 1 Garden Road, Central, Hong Kong ・ Trustee（受託者） Cititrust Limited 50/F, Citibank Tower, Citibank Plaza, 3 Garden Road, Central, Hong Kong ・ Adviser（投資助言者） China Asset Management Co., Ltd. 3/F Tower B, Tongtai Building, No. 33 Finance Street Xicheng District, Beijing, People's Republic of China ・ Custodian（保管者） Citibank, N.A. 50/F, Citibank Tower, Citibank Plaza, 3 Garden Road Central, Hong Kong ・ PRC Custodian（保管者） Citibank（China） Co., Limited Citigroup Tower, No. 33, Hua Yuan Shi Qiao Road Lu Jia Zui Finance and Trade Area, Shanghai, People's Republic of China ・ Service Agent or Conversion Agent（サービス・エージェント／転換代理人） HK Conversion Agency Services Limited 2/F, Infinitus Plaza, 199 Des Voeux Road, Central, Hong Kong ・ Registrar（上場代理人） Computershare Hong Kong Investor Services Limited 46/F, Hopewell Centre, 183 Queen's Road East, Wanchai Hong Kong ・ Legal Adviser to the Manager（リーガル・アドバイザー） Simmons & Simmons 13/F, One Pacific Place, 88 Queensway, Hong Kong ・ Auditors（外部監査人） Ernst & Young 22/F, Citic Tower, 1 Tim Mei Avenue, Central, Hong Kong
受託者と上記関係者との間の資本関係および人的関係	該当事項はありません。

ファンド資産に関する外部監査 を行う者の氏名・名称（注2）	Ernst & Young
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注1：計算期間末日（平成26年12月31日）時点における総額（簿価）を記載しております。

注2：「ファンド資産」とは、外国投資信託受益証券に係る権利を有する者から出資または拠出を受けた資産をいいます。

2、金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円（平成26年12月31日現在）

※ 上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
198,703,586円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況（自平成26年1月1日至平成26年12月31日）

1、信託の設定、解約

（千円未満切捨て）

設定		解約	
口数（単位：口）	金額（単位：千円）	口数（単位：口）	金額（単位：千円）
-	-	1,900,000	720,100

2、利害関係人等との取引状況

信託財産から受領した外貨建て分配金は、三菱UFJ信託銀行との外国為替取引により円転し、受益者へ分配するまでの間、現金を日本マスタートラスト信託銀行株式会社の銀行勘定に預入しました。また、一口あたりの分配金額の計算上生じた1円未満の端数に相当する金銭の総額および銀行勘定預入利息については、信託契約に基づき、信託報酬として受託者が受領しております。

3、信託業務の委託の状況

信託業務（信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。）の第三者への委託は行っておりません。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末（平成26年12月31日）現在
（単位：千円）

資産の部		
固定資産		
投資有価証券		198,703
固定資産合計		198,703
資産合計		198,703
負債の部		
負債合計		—

元本等の部	
元本	
受益権	114,600
元本合計	114,600
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	84,103
評価・換算差額等合計	84,103
元本等合計	198,703
負債・元本等合計	198,703

< 損益計算書（※１） >

当計算期間（自 平成 26 年 1 月 1 日 至 平成 26 年 12 月 31 日）

（単位：千円）

経常収益	1,480
経常費用	1,480
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

※１ 本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第 19 条第 2 項に定める「収支計算書」を兼ねております。

■外貨建て分配金の円転取引について

信託財産から受領した外貨建て分配金は、三菱 UFJ 信託銀行との外国為替取引により円転致しました。

金額（単位：人民元）	約定日	為替レート	金額（単位：円）
90,000	平成 26 年 7 月 28 日	16.10	1,449,000

■信託財産の銀行勘定への運用について

円転した分配金を受益者へ分配するまでの間、現金を日本マスタートラスト信託銀行株式会社の銀行勘定にて運用致しました。

金額（単位：円）	期間	利息額（単位：円）
1,449,000	平成 26 年 7 月 30 日～平成 26 年 8 月 19 日	15

■収益の分配の状況について

平成 26 年 7 月 21 日を分配金の支払いに係る基準日とし、一口あたり 4 円の分配金を平成 26 年 8 月 29 日より支払いました。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
平成 26 年 1 月 31 日	379
平成 26 年 2 月 28 日	367
平成 26 年 3 月 31 日	359
平成 26 年 4 月 30 日	357
平成 26 年 5 月 30 日	355
平成 26 年 6 月 30 日	360
平成 26 年 7 月 31 日	397
平成 26 年 8 月 29 日	400
平成 26 年 9 月 30 日	440
平成 26 年 10 月 31 日	453
平成 26 年 11 月 28 日	540
平成 26 年 12 月 31 日	662