

2024年10月7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 杉原 規之
問合せ先 商品開発グループ長 積木 利浩
(TEL. 03-6774-6312)

「One ETF 南方 中国A株 CSI500」の
基準価額と市場価格の重要な乖離に関するお知らせ (続報)

平素は当社ETFをご愛顧賜り、誠にありがとうございます。

当社で運用を行っている「One ETF 南方 中国A株 CSI500」(銘柄コード：2553)について、基準価額と東京証券取引所における市場価格(終値)との間の重要な乖離が継続発生していることをお知らせいたします。

記

1. 対象投資信託

One ETF 南方 中国A株 CSI500 (以下、「当ETF」といいます。)

2. 乖離の状況とその要因

当ETFにおいては、東京証券取引所における市場価格(終値)が、基準価額(一口あたりの純資産額)を大きく上回る水準となり重要な乖離が発生しましたが、下表のとおり、10月4日においてもその状況が継続しております。

	基準価額 (一口あたり)	市場価格 (終値)	乖離率*
10月1日	1,686円	3,599円	69.9%
10月2日	1,684円	6,399円	77.9%
10月3日	1,721円	10,400円	60.3%
10月4日	1,716円	22,400円	115.7%

*日次騰落率の差分

一般的に、市場価格は、取引所における売買を通じて基準価額に収れんしていく傾向がありますが、当 E T F に関しては需給の影響によって市場価格と基準価額との間に乖離が発生しているものと考えられます。

また、中国の金融商品取引所の上場銘柄は、祝日のため現地 10 月 1 日以降の取引が停止（10 月 1 日～7 日）となっていることから、基準価額については現地 9 月 30 日の時価（人民元ベース）を基に算出しております。そのため現状の基準価額には 10 月 1 日以降の評価を反映した時価が算出されておらず、中国の金融商品取引所の取引が再開した場合には、基準価額が大きく変動する可能性があります。

3. 投資判断上ご留意いただきたい点

当 E T F は、約款上の設定および解約の申込不可日に該当しているため、2024 年 9 月 6 日～10 月 11 日の期間は設定および解約の申込みの受付を停止しております。

設定および解約の申込みの受付停止により、当 E T F の基準価額と東京証券取引所の市場価格がさらに乖離する可能性があります。当 E T F を売買する際には、基準価額と市場価格の乖離に十分ご注意ください。

投資家の皆さまにおかれましては、以上ご留意の上ご投資いただきますよう何卒よろしくお願い申し上げます。

以上