

2024年10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 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

	基準価額 (一口あたり)	市場価格 (終値)	基準価額と市場価格 の乖離率
10月1日	1,686円	3,599円	113.5%
10月2日	1,684円	6,399円	280.0%
10月3日	1,721円	10,400円	504.3%
10月4日	1,716円	22,400円	1,205.4%
10月7日	1,737円	42,400円	2,341.0%
10月8日	1,730円	35,400円	1,946.2%
10月9日	1,795円	19,500円	986.4%
10月10日	1,694円	15,500円	815.0%

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、上記のとおり、10月10日においてもその状況が継続しております。

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～7日までの取引が停止されていたことから、10月8日までの基準価額については現地9月30日の時価（人民元ベース）を基に算出していた一方、市場価格は需給の影響によって大幅に上昇しておりました。

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。中国の金融商品取引所の取引は10月8日から再開し、10月8日以降は当ETFの市場価格が大幅に下落しましたが、10月10日時点の基準価額と市場価格の乖離は依然として高い水準となっております。

3. 投資判断上ご留意いただきたい点

中国の金融商品取引所の取引は10月8日から再開されましたが、当ETF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ETFの基準価額と東京証券取引所の市場価格が大きく乖離する可能性があります。当ETF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