

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 甘添  
(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  
外国法共同事業  
担当者 弁護士 飛岡 和明  
(TEL 03-6775-1000)

## 2021年12月期(2021年1月1日~2021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  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。
第 9 期	
2021 年 12 月 31 日現在	
2021 年 1 月 1 日～2021 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	299,161 百万円（2021 年 12 月 31 日時点）（注 1）
一証券あたりの純資産額	906 円（2021 年 12 月 31 日時点）（注 1）
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	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

る者への報告の頻度および方法	残高（RMB、HKD）が運用者のウェブサイト（ <a href="http://www.chinaamc.com.hk/en/products/etf/csi300/fund-details.html">http://www.chinaamc.com.hk/en/products/etf/csi300/fund-details.html</a> ）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）	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Manager（運用者） China Asset Management (Hong Kong) Limited 37/F, Bank of China Tower, 1 Garden Road, Central, Hong Kong</li> <li>• Trustee（受託者） Cititrust Limited 50/F, Champion Tower, 3 Garden Road, Central, Hong Kong</li> <li>• Administrator and Custodian（保管者） Citibank, N.A. 50/F, Champion Tower, 3 Garden Road Central, Hong Kong</li> <li>• 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, PRC 200120</li> <li>• Service Agent（サービス・エージェント） HK Conversion Agency Services Limited 1/F One &amp; Two Exchange Square 8 Connaught Place, Central, Hong Kong</li> <li>• Registrar（上場代理人） Computershare Hong Kong Investor Services Limited 46/F, Hopewell Centre, 183 Queen's Road East, Wanchai Hong Kong</li> <li>• Legal Counsel to the Manager（リーガル・カウンセル） Simmons &amp; Simmons 30/F, One Taikoo Place, 979 King's Road, Hong Kong</li> <li>• Auditors（外部監査人） Ernst &amp; Young 22/F, Citic Tower, 1 Tim Mei Avenue, Central, Hong Kong</li> </ul>
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（2021年12月31日）時点における最終の発行体開示情報を円換算して記載しております。

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

(2021年12月31日現在)

資産の種類	金銭 (注)
価 格	0円

注：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

(2021年12月31日現在)

本信託の純資産総額 (単位：円)	口数 (単位：口)
224,164,631	246,000

### ■取引の状況 (自2021年1月1日至2021年12月31日)

#### 1. 信託の設定、解約

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)
180,000	168,820	60,000	44,293

#### 2. 自己または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信託銀行株式会社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。カスタディー業務については、シティバンクエヌエイホンコンに委託しております。

■資産、負債、元本等および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末（2021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		224,164
固定資産合計		224,164
資産合計		224,164
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		181,604
元本合計		181,604
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		42,560
評価・換算差額等合計		42,560
元本等合計		224,164
負債・元本等合計		224,164

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2021年1月1日 至 2021年12月31日）

（単位：千円）

経常収益	1,248
経常費用	264
経常利益	984
当期純利益	984
前期繰越利益	—
当期末処分利益	984
利益処分額	—
受益権収益分配金	△984
受益権収益分配金合計	△984
次期繰越利益	—

注：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信託銀行株式会社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)
73,800	2021年8月3日	16.55	1,221,390

#### ■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)
1,221,390	2021年8月5日～2021年8月6日	0

#### ■収益の分配の状況について

2021年7月27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2021年9月3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)
2021年1月29日	879
2021年2月26日	887
2021年3月31日	864
2021年4月30日	878
2021年5月28日	933
2021年6月30日	912
2021年7月30日	832
2021年8月31日	835
2021年9月30日	860
2021年10月29日	893
2021年11月30日	880
2021年12月30日	906

(注) 各月末時点の発行体開示情報の外貨建1口当りの純資産額を三菱UFJ銀行の対顧客公示相場の仲値(TTM)で円換算した価額を記載しています。