

各 位

管理会社名 中国南方アセット・マネジメント・リミテッド
代表者名 最高経営責任者 丁晨
(銘柄コード 1576)
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 飛岡 和明
(TEL 03-6775-1000)

2019年6月期（2018年7月1日～2019年6月30日）信託財産状況報告書

中国南方アセット・マネジメント・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
南方 FTSE 中国 A 株 50 ETF	1576	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

南方 FTSE 中国 A 株50 ETF 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 7 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「南方 FTSE 中国 A 株 50 ETF」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。
2019 年 6 月 30 日現在	
2018 年 7 月 1 日～2019 年 6 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	南方 FTSE 中国 A 株 50 ETF
銘柄コード	1576
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、FTSE 中国 A50 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受託有価証券の一口あたりの純資産額は、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	南方 FTSE 中国 A 株 50 ETF (CSOP FTSE China A50 ETF)
純資産総額	237,892,609,726 円 (2019 年 6 月 30 日時点)
一口あたりの純資産額	207 円 (2019 年 6 月 30 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.csopasset.com/en/products/index_etf.php) で毎日公表されています。

<p>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）</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Manager and RQFII Holder（運用者） CSOP Asset Management Limited 2801-2803, Two Exchange Square 8 Connaught Place, Central, Hong Kong • Trustee and Registrar（受託者） HSBC Institutional Trust Services (Asia) Limited 1 Queen's Road, Central, Hong Kong • Adviser（投資助言者） China Southern Asset Management Co. Limited 33rd Floor, Duty-Free Business Building, 6 Fuhua 1st Rd, Futian CBD, Shenzhen, China 518048 • Custodian（保管者） The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited 1 Queen's Road, Central, Hong Kong • PRC Custodian（保管者） HSBC Bank (China) Company Limited 33th Floor, HSBC Building, Shanghai ifc, 8 Century Avenue, Pudong, Shanghai, China 200120 • Listing Agent（上場代理人） Altus Capital Limited 21 Wing Wo Street Central • 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） PricewaterhouseCoopers 21st Floor, Edinburgh Tower 15 Queen's Road, Central, Hong Kong
<p>受託者と上記関係者との間の資本関係および人的関係</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>ファンド資産に関する外部監査を行う者の氏名・名称（注）</p>	<p>PricewaterhouseCoopers</p>
<p>保管機関</p>	<p>受託者の指定するカストディアン</p>

注：「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（注）
価 格	0円（2019年6月30日現在）

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

（2019年6月30日現在）

本信託の純資産総額（単位：円）（注）	口数（単位：口）
32,850,645	53,000

注：受託者の採用する算出方法に基づく本信託の決算期日末日時点の金額であり、東京証券取引所に日々開示された本信託受益証券一口に対応する外国ETFの純資産額に、本信託受益証券の上場受益権口数を乗じたものとは必ずしも一致するものではありません。

■取引の状況（自2018年7月1日至2019年6月30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）
—	—	—	—

2. 自己または利害関係人との取引状況

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。カストディー業務については、ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング・コーポレーション・リミテッド（香港上海銀行）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（2019年6月30日）現在
（単位：千円）

資産の部		
固定資産		
投資有価証券		32,850
固定資産合計		32,850
資産合計		32,850
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		

元本	
受益権	20,055
元本合計	20,055
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	12,794
評価・換算差額等合計	12,794
元本等合計	32,850
負債・元本等合計	32,850

< 損益計算書 (注) >

当計算期間 (自 2018年7月1日 至 2019年6月30日)

(単位: 千円)

経常収益	672
経常費用	36
経常利益	636
当期純利益	636
前期繰越利益	—
当期末処分利益	636
利益処分額	
受益権収益分配金	△636
受益権収益分配金合計	△636
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)
42,930	2019年1月4日	15.30	656,829

■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)
656,829	2019年1月8日~2019年1月9日	0

■収益の分配の状況について

2018年12月17日を分配金の支払いに係る基準日とし、一口あたり12円の分配金を2019年1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)
2018年7月31日	570
2018年8月31日	545
2018年9月28日	583
2018年10月31日	536
2018年11月30日	535
2018年12月28日	466
2019年1月31日	535
2019年2月28日	599
2019年3月29日	622
2019年4月26日	611
2019年5月31日	577
2019年6月28日	620