

## 【表紙】

- 【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書
- 【提出先】 関東財務局長
- 【提出日】 令和2年9月30日
- 【発行者名】 チャイナ・アセット・マネジメント（香港）・リミテッド  
(China Asset Management (Hong Kong) Limited)
- 【代表者の役職氏名】 張霄<sup>㊦</sup>  
(Zhang Xiaoling)  
最高経営責任者  
(Chief Executive Officer)
- 【本店の所在の場所】 香港、セントラル、ガーデンロード1、バンク・オブ・チャイ  
ナ・タワー37階  
(37/F, Bank of China Tower, 1 Garden Road, Central, Hong Kong)
- 【代理人の氏名又は名称】 弁護士 飛岡 和明
- 【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区大手町1-1-1 大手町パークビルディング  
アンダーソン・毛利・友常法律事務所
- 【事務連絡者氏名】 弁護士 大出 萌  
同 宇山 由里子  
同 瀧川 亮祐
- 【連絡場所】 東京都千代田区大手町1-1-1 大手町パークビルディング  
アンダーソン・毛利・友常法律事務所
- 【電話番号】 03(6775)1000
- 【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】  
ChinaAMC CSI 300 Index ETF-JDR  
\* 上記記載は、届出の対象とした募集有価証券信託受益証券の名称です。
- 【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券の金額】  
100,000,000,000円を上限とします。  
\* 上記記載は、届出の対象とした募集有価証券信託受益証券の金額です。
- 【縦覧に供する場所】 株式会社東京証券取引所  
(東京都中央区日本橋兜町2番1号)

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出したことにより、令和2年6月30日に提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。 )の関係情報を新たな情報により訂正および追加するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

## 2【訂正内容】

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容(＊)と同一内容に更新または追加されます。

原届出書	半期報告書	訂正の内容
第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況 (1) 投資状況	1 ファンドの運用状況 (1) 投資状況	更新
(3) 運用実績	(2) 運用実績	追加
(4) 販売及び買戻しの実績	2 販売及び買戻しの実績	追加
第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表	3 ファンドの経理状況	追加
第三部 特別情報 第1 管理会社の概況 1 管理会社の概況 (1) 資本金の額	4 管理会社の概況 (1) 資本金の額	更新
2 事業の内容及び営業の概況	(2) 事業の内容及び営業の状況	更新
5 その他 (4) 訴訟事件その他の重要事項	(3) その他	追加

＊ 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。(「5 管理会社の経理の概況」は、訂正内容に該当しないため省略します。)

[次へ](#)

[別段の記載がある場合を除き、下記1～3までの記述は、有価証券信託受益証券に係る受託有価証券を構成する外国投資信託受益証券に係る信託(本香港ETF)に関する情報です。]

## 1 ファンドの運用状況

チャイナ・アセット・マネジメント(香港)・リミテッド(以下「資産運用会社」といいます。)が管理するチャイナAMC ETFシリーズと称するアンブレラ・ユニット・トラストのサブファンドであるChinaAMC CSI 300 Index ETF(以下「本香港ETF」といいます。)の運用状況は、以下のとおりです。

### (1) 投資状況

#### 資産別及び地域別の投資状況

(2020年6月30日現在)

資産の種類	国名	時価合計	投資比率(%)
株式	中国	11,970,935,956.84人民元 (178,606,364,476円)	98.84
現金、未収金及びその他の資産 (負債控除後)		140,507,869.52人民元 (2,096,377,413円)	1.16
合計 (純資産総額)		12,111,443,826.36人民元 (180,702,741,889円)	100.00

- (注1) 投資比率とは、本香港ETFの純資産に対する当該資産の時価の比率をいいます。以下同じです。
- (注2) 半期報告書の中で金額及び比率を表示する場合、四捨五入してあります。したがって、合計欄の数値が総数と一致しない場合があります。また、円貨への換算は、半期報告書の中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算の上、必要な場合には四捨五入してあります。したがって、半期報告書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もあります。
- (注3) 人民元、香港ドル及び米ドルの日本円への換算は、それぞれ、1人民元 = 14.92円(令和2年7月31日15時(東京時間)現在のブルームバーグ公表の米ドル/人民元(CNH)及び米ドル/日本円の仲値から算出する為替相場)、1香港ドル = 13.50円(令和2年7月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場仲値)及び1米ドル = 104.60円(令和2年7月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場仲値)により計算されています。

## (2) 運用実績

## 純資産の推移

2019年8月から2020年7月までの間の各月末及び半期報告書提出日の直近日の純資産総額及び1口当たり純資産額の推移は、以下のとおりです。

	純資産総額		1口当たり純資産額	
	(人民元)	(円)	(人民元)	(円)
2019年8月末日	12,958,810,259.84	193,345,449,077	38.8454	580
2019年9月末日	14,230,606,377.10	212,320,647,146	38.9933	582
2019年10月末日	14,490,352,125.76	216,196,053,716	39.7050	592
2019年11月末日	14,449,119,309.06	215,580,860,091	39.0939	583
2019年12月末日	17,382,025,714.00	259,339,823,653	41.7586	623
2020年1月末日	17,859,733,633.61	266,467,225,813	40.8036	609
2020年2月末日	13,329,990,254.20	198,883,454,593	40.1204	599
2020年3月末日	12,321,668,552.20	183,839,294,799	37.5432	560
2020年4月末日	11,975,058,293.73	178,667,869,742	39.3463	587
2020年5月末日	11,449,674,837.54	170,829,148,576	39.4273	588
2020年6月末日	12,111,443,826.36	180,702,741,889	42.6534	636
2020年7月末日	14,211,193,744.97	212,031,010,675	47.9217	715
2020年8月14日	13,917,124,319.92	207,643,494,853	48.0481	717

## 証券取引所における取引価格の推移

	香港証券取引所取引価格 (1口当たり終値)	
	(人民元)	(円)
2019年8月末日	38.85	580
2019年9月末日	38.99	582
2019年10月末日	39.71	592
2019年11月末日	39.09	583
2019年12月末日	41.76	623
2020年1月末日	40.80	609
2020年2月末日	40.12	599
2020年3月末日	37.54	560
2020年4月末日	39.35	587
2020年5月末日	39.43	588
2020年6月末日	42.65	636
2020年7月末日	47.92	715
2020年8月14日	48.05	717

## 分配の推移

期別	(人民元)	(円)
2019年8月1日から2020年7月末日まで	0.38	6

## 収益率の推移

期別	収益率(%) <sup>(注)</sup>
2019年8月1日から2020年7月末日まで	23.34

(注) 収益率(%) =  $100 \times (a - b) / b$

a = 上記期間の末日の本香港ETFの1口当たり純資産額(当該期間の分配金の合計額を加えた額)

b = 前期間の末日(2019年7月末日)の本香港ETFの1口当たり純資産額(分配落ちの額)

## 2 販売及び買戻しの実績

2019年8月1日から2020年7月末日までの期間における販売口数及び買戻口数並びに当該期間末日現在の発行済口数は、以下のとおりです。

	販売口数 (口)	買戻口数 (口)	発行済口数 (口)
2019年8月1日から 2020年7月末日まで	178,500,000	242,550,000	296,550,000

(注) 日本における販売及び買戻しは行われておりません。

[次へ](#)

### 3 ファンドの経理状況

本香港ETFの日本語の中間財務書類は、国際財務報告基準(IFRS)に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものです(但し、円換算部分を除きます。)。本香港ETFの原文の中間財務書類は、「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」に基づき、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(以下「中間財務諸表等規則」といいます。)第76条第4項但書の規定の適用を受けています。

本香港ETFの原文の中間財務書類は、公認会計士法第1条の3第7項に規定する外国監査法人等の監査を受けていません。

本香港ETFの原文の中間財務書類は、人民元で表示されています。本香港ETFの原文の中間財務書類の日本語訳には、中間財務諸表等規則第79条の規定に基づき、主要な金額について円換算額が併記されています。日本円で表示される金額は、1人民元=14.92円(令和2年7月31日15時(東京時間)現在のブルームバーグ公表の米ドル/人民元(CNH)及び米ドル/日本円の仲値から算出する為替相場)により換算されており、円未満の金額は四捨五入されています。

[次へ](#)

## (1) 資産及び負債の状況

ChinaAMC CSI 300 Index ETF

(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 財政状態計算書

2020年6月30日

	2020年6月30日 (未監査)		2019年12月31日 (監査済み)	
	人民元	日本円	人民元	日本円
<b>資産</b>				
損益を通じて公正価値で測定される金融資産	11,970,935,957	178,606,364,478	17,264,823,312	257,591,163,815
その他の未収金	4	60	28,852	430,472
現金及び現金等価物	157,038,505	2,343,014,495	142,201,975	2,121,653,467
資産合計	<u>12,127,974,466</u>	<u>180,949,379,033</u>	<u>17,407,054,139</u>	<u>259,713,247,754</u>
<b>負債</b>				
未払運用報酬	6,733,267	100,460,344	9,376,356	139,895,232
未払保護預かり、ファンド事務管理及び受託者報酬	6,404,253	95,551,455	4,706,120	70,215,310
参加ディーラーに対する未払金	-	-	7,483,461	111,653,238
その他の未払金及び未払費用	3,393,120	50,625,350	3,462,488	51,660,321
負債合計	<u>16,530,640</u>	<u>246,637,149</u>	<u>25,028,425</u>	<u>373,424,101</u>
受益者に帰属する純資産	<u>12,111,443,826</u>	<u>180,702,741,884</u>	<u>17,382,025,714</u>	<u>259,339,823,653</u>
発行済み受益証券数	<u>283,950,000</u>	<u>283,950,000</u>	<u>416,250,000</u>	<u>416,250,000</u>
1口あたり純資産価値	<u>42.6534</u>	<u>636.3893</u>	<u>41.7586</u>	<u>623.0386</u>

注：サブファンドの当半期報告書は2019年度の年次財務諸表において採用されていたもの同一の会計方針に従い作成されています。

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 包括損益計算書

2020年1月1日から2020年6月30日の期間

	2020年1月1日から 2020年6月30日の期間 (未監査)		2019年1月1日から 2019年6月30日の期間 (未監査)	
	人民元	日本円	人民元	日本円
<b>収益</b>				
受取配当金	123,286,214	1,839,430,313	152,564,027	2,276,255,283
受取利息	260,817	3,891,390	191,040	2,850,317
	<u>123,547,031</u>	<u>1,843,321,703</u>	<u>152,755,067</u>	<u>2,279,105,600</u>
<b>費用</b>				
運用報酬	( 47,600,043)	( 710,192,642)	( 49,946,872)	( 745,207,330)
売買委託報酬	( 19,743,830)	( 294,577,944)	( 5,913,344)	( 88,227,092)
保護預かり、ファンド事務管理及び受託者報酬	( 4,777,112)	( 71,274,511)	( 5,104,326)	( 76,156,544)
監査報酬	( 76,147)	( 1,136,113)	( 62,803)	( 937,021)
インデックス・ライセンス・フィー	( 34,700)	( 517,724)	( 25,765)	( 384,414)
データ・ライセンス・フィー	( 2,720,003)	( 40,582,445)	( 2,854,107)	( 42,583,276)
専門家報酬	( 60,117)	( 896,946)	( 137,500)	( 2,051,500)
支払利息	-	-	( 160)	( 2,387)
その他の営業費用	( 247,672)	( 3,695,266)	( 4,846,255)	( 72,306,125)
	<u>( 75,259,624)</u>	<u>( 1,122,873,591)</u>	<u>( 68,891,132)</u>	<u>( 1,027,855,689)</u>
投資及び為替変動考慮前利益	48,287,407	720,448,112	83,863,935	1,251,249,911
<b>投資(損失)利益及び為替変動</b>				
損益を通じて公正価値で測定される金融資産に係る未実現損失又は利益の正味変動	( 721,628,459)	(10,766,696,608)	2,965,596,462	44,246,699,213
損益を通じて公正価値で測定される金融資産に係る正味実現利益	737,662,094	11,005,918,442	100,804,904	1,504,009,168
投資及び為替変動による正味利益	<u>16,033,635</u>	<u>239,221,834</u>	<u>3,066,401,366</u>	<u>45,750,708,381</u>
税引前利益	64,321,042	959,669,946	3,150,265,301	47,001,958,292
源泉所得税費用	( 12,444,181)	( 185,667,181)	( 15,375,694)	( 229,405,354)
包括利益合計	<u>51,876,861</u>	<u>774,002,765</u>	<u>3,134,889,607</u>	<u>46,772,552,938</u>

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 受益者に帰属する純資産変動計算書

2020年1月1日から2020年6月30日の期間

	2020年1月1日から 2020年6月30日の期間 (未監査)		2019年1月1日から 2019年6月30日の期間 (未監査)	
	人民元	日本円	人民元	日本円
期首残高	17,382,025,714	259,339,823,653	11,816,519,143	176,302,465,614
受益証券の発行	2,538,023,676	37,867,313,246	2,862,124,836	42,702,902,553
受益証券の買戻し	(7,860,482,425)	(117,278,397,780)	(3,220,671,305)	(48,052,415,871)
包括利益合計	<u>51,876,861</u>	<u>774,002,765</u>	<u>3,134,889,607</u>	<u>46,772,552,938</u>
期末残高	<u><u>12,111,443,826</u></u>	<u><u>180,702,741,884</u></u>	<u><u>14,592,862,281</u></u>	<u><u>217,725,505,234</u></u>

	2020年1月1日から 2020年6月30日の期間 (未監査)		2019年1月1日から 2019年6月30日の期間 (未監査)	
	受益証券数		受益証券数	
期首残高	416,250,000		384,750,000	
受益証券の期中発行数	64,200,000		74,550,000	
受益証券の期中買戻数	<u>(196,500,000)</u>		<u>(87,000,000)</u>	
期末残高	<u><u>283,950,000</u></u>		<u><u>372,300,000</u></u>	

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## キャッシュ・フロー計算書

2020年1月1日から2020年6月30日の期間

	2020年1月1日から 2020年6月30日の期間 (未監査)		2019年1月1日から 2019年6月30日の期間 (未監査)	
	人民元	日本円	人民元	日本円
<b>営業活動によるキャッシュ・フロー</b>				
税引前利益	64,321,042	959,669,946	3,150,265,301	47,001,958,292
損益を通じて公正価値で測定される金融 資産の減少(増加)	5,293,887,355	78,984,799,337	(2,725,298,942)	(40,661,460,215)
その他の未収金の減少	28,848	430,412	3,697	55,159
未払運用報酬の(減少)増加	(2,643,089)	(39,434,888)	1,048,749	15,647,335
未払保護預かり、ファンド事務管理及び 受託者報酬の増加	1,698,133	25,336,145	4,224,853	63,034,807
その他の未払金及び未払費用の(減少) 増加	(69,368)	(1,034,971)	310,881	4,638,345
ブローカーに対する未払金の減少	-	-	(22,479,440)	(335,393,245)
営業活動により生じた現金	5,357,222,921	79,929,765,981	408,075,099	6,088,480,478
支払税金	(12,444,181)	(185,667,181)	(15,375,694)	(229,405,354)
営業活動により生じた正味現金	5,344,778,740	79,744,098,800	392,699,405	5,859,075,124
<b>財務活動によるキャッシュ・フロー</b>				
受益証券発行による受取額	2,530,540,215	37,755,660,008	2,862,124,836	42,702,902,553
受益証券の買戻しに係る支払	(7,860,482,425)	(117,278,397,780)	(3,220,671,305)	(48,052,415,871)
財務活動に使用した正味現金	(5,329,942,210)	(79,522,737,772)	(358,546,469)	(5,349,513,318)
現金及び現金等価物の正味増加	14,836,530	221,361,028	34,152,936	509,561,806
現金及び現金等価物期首残高	142,201,975	2,121,653,467	99,894,957	1,490,432,758
現金及び現金等価物期末残高	157,038,505	2,343,014,495	134,047,893	1,999,994,564
現金及び現金等価物の内訳				
銀行預金	157,038,505	2,343,014,495	134,047,893	1,999,994,564
営業活動により生じた正味現金には以下が含まれます。				
受取配当金(源泉税控除後)	110,854,438	1,653,948,215	137,198,178	2,046,996,816
受取利息(源泉税控除後)	248,412	3,706,307	181,195	2,703,429
支払利息	-	-	160	2,387

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオ (未監査)

2020年6月30日現在

	保有数	市場価値 人民元	対純資産 価値比率 (%)
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産</b>			
<b>上場有価証券</b>			
<b>中国</b>			
<b>コミュニケーション・サービス</b>			
China Film Co Ltd	603,579	7,924,992	0.07%
China Satellite Communications Co Ltd	323,482	5,825,911	0.05%
China United Network Communications Ltd	7,523,648	36,414,456	0.30%
Focus Media Information Technology Co Ltd	8,305,055	46,259,156	0.38%
Giant Network Group Co Ltd	490,947	8,542,478	0.07%
Mango Excellent Media Co Ltd	575,491	37,522,013	0.31%
Oriental Pearl Group Co Ltd	1,656,130	15,981,655	0.13%
Perfect World Co Ltd/China	522,558	30,120,243	0.25%
Wanda Film Holding Co Ltd	672,260	10,265,410	0.08%
Wuhu Sanqi Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd	1,024,171	47,931,203	0.40%
Zhejiang Century Huatong Group Co Ltd	2,013,463	30,826,119	0.25%
<b>一般消費財</b>			
BYD Co Ltd	732,890	52,621,502	0.43%
China Grand Automotive Services Group Co Ltd	3,274,390	10,445,304	0.09%
China Shipbuilding Industry Group Power Co Ltd	524,068	8,227,868	0.07%
China Tourism Group Duty Free Corp Ltd	789,030	121,534,291	1.00%
Chongqing Changan Automobile Co Ltd	1,573,042	17,303,462	0.14%
Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	1,133,371	23,653,453	0.20%
Great Wall Motor Co Ltd	982,322	7,583,526	0.06%
Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	3,890,347	220,076,930	1.82%
Guangzhou Automobile Group Co Ltd	750,244	6,752,196	0.06%
Haier Smart Home Co Ltd	3,059,477	54,152,743	0.45%
Hangzhou Robam Appliances Co Ltd	383,540	11,931,929	0.10%
HLA Corp Ltd	1,068,228	6,217,087	0.05%
Huayu Automotive Systems Co Ltd	1,274,329	26,493,300	0.22%
Midea Group Co Ltd	3,960,453	236,795,485	1.96%
Offcn Education Technology Co Ltd	548,407	15,218,294	0.13%
Oppein Home Group Inc	102,183	11,843,010	0.10%
SAIC Motor Corp Ltd	2,833,159	48,135,371	0.40%
Shanghai Yuyuan Tourist Mart Group Co Ltd	1,259,023	11,154,944	0.09%
Shenzhen Overseas Chinese Town Co Ltd	3,314,888	20,088,221	0.17%
Songcheng Performance Development Co Ltd	1,268,201	21,939,877	0.18%

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオ(未監査)(続き)

2020年6月30日現在

	保有数	市場価値 人民元	対純資産 価値比率 (%)
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>			
<b>上場有価証券(続き)</b>			
<b>中国(続き)</b>			
<b>一般消費財(続き)</b>			
Suning.com Co Ltd	3,010,252	26,399,910	0.22%
TCL Technology Group Corp	10,938,453	67,818,409	0.56%
Zhejiang Supor Co Ltd	132,801	9,428,871	0.08%
<b>生活必需品</b>			
Anhui Gujing Distillery Co Ltd	93,302	14,017,692	0.12%
Beijing Shunxin Agriculture Co Ltd	419,600	23,908,808	0.20%
Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd	785,714	97,742,822	0.81%
Guangdong Haid Group Co Ltd	638,487	30,385,596	0.25%
Hebei Yangyuan Zhihui Beverage Co Ltd	409,048	8,794,532	0.07%
Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd	804,759	37,091,342	0.31%
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd	4,903,044	152,631,760	1.26%
Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd	507,200	20,181,488	0.17%
Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd	487,537	51,259,640	0.42%
Jiangxi Zhengbang Technology Co Ltd	1,011,500	17,681,020	0.15%
Kweichow Moutai Co Ltd	406,093	594,065,328	4.90%
Luzhou Laojiao Co Ltd	591,957	53,939,122	0.45%
Muyuan Foodstuff Co Ltd	1,211,495	99,342,590	0.82%
New Hope Liuhe Co Ltd	1,703,938	50,777,352	0.42%
Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd	211,222	30,627,190	0.25%
Tongwei Co Ltd	2,079,536	36,142,336	0.30%
Wens Foodstuffs Group Co Ltd	3,606,379	78,619,062	0.65%
Wuliangye Yibin Co Ltd	1,568,604	268,419,516	2.22%
Yonghui Superstores Co Ltd	3,094,140	29,023,033	0.24%
<b>エネルギー</b>			
China Coal Energy Co Ltd	1,479,670	5,622,746	0.05%
China Oilfield Services Ltd	475,097	6,242,775	0.05%
China Petroleum & Chemical Corp	10,806,627	42,253,912	0.35%
China Shenhua Energy Co Ltd	2,665,881	38,282,051	0.32%
CNOOC Energy Technology & Services Ltd	1,642,900	3,827,957	0.03%
Offshore Oil Engineering Co Ltd	1,786,732	8,129,631	0.07%
PetroChina Co Ltd	7,849,569	32,889,694	0.27%

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオ(未監査)(続き)

2020年6月30日現在

	保有数	市場価値 人民元	対純資産 価値比率 (%)
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>			
<b>上場有価証券(続き)</b>			
<b>中国(続き)</b>			
<b>エネルギー(続き)</b>			
Shaanxi Coal Industry Co Ltd	3,233,181	23,311,235	0.19%
Shanxi Meijin Energy Co Ltd	993,842	6,221,451	0.05%
Yanzhou Coal Mining Co Ltd	717,880	6,288,629	0.05%
<b>金融</b>			
Agricultural Bank of China Ltd	23,220,789	78,486,267	0.65%
Avic Capital Co Ltd	4,349,620	17,224,495	0.14%
Bank of Beijing Co Ltd	11,959,845	58,603,241	0.48%
Bank of Changsha Co Ltd	829,990	6,590,121	0.05%
Bank of Chengdu Co Ltd	1,755,399	13,972,976	0.12%
Bank of China Ltd	17,040,063	59,299,419	0.49%
Bank of Communications Co Ltd	22,208,643	113,930,339	0.94%
Bank of Guiyang Co Ltd	1,821,007	13,038,410	0.11%
Bank of Hangzhou Co Ltd	1,917,250	17,101,870	0.14%
Bank of Jiangsu Co Ltd	7,464,898	42,325,972	0.35%
Bank of Nanjing Co Ltd	4,852,982	35,572,358	0.29%
Bank of Ningbo Co Ltd	2,428,239	63,789,839	0.53%
Bank of Shanghai Co Ltd	8,038,023	66,715,591	0.55%
Bank of Xi'an Co Ltd	1,077,895	5,669,728	0.05%
Caitong Securities Co Ltd	2,030,843	20,816,141	0.17%
Changjiang Securities Co Ltd	3,132,052	21,110,030	0.17%
China CITIC Bank Corp Ltd	2,473,482	12,738,432	0.11%
China Construction Bank Corp	5,428,389	34,253,135	0.28%
China Everbright Bank Co Ltd	12,868,542	46,069,380	0.38%
China Galaxy Securities Co Ltd	1,038,729	11,914,222	0.10%
China Great Wall Securities Co Ltd	752,610	9,272,155	0.08%
China Life Insurance Co Ltd	1,346,369	36,634,700	0.30%
China Merchants Bank Co Ltd	8,337,278	281,133,014	2.32%
China Merchants Securities Co Ltd	2,311,244	50,731,806	0.42%
China Minsheng Banking Corp Ltd	17,198,712	97,516,697	0.81%
China Pacific Insurance Group Co Ltd	2,540,480	69,228,080	0.57%
China Zheshang Bank Co Ltd	1,760,000	6,934,400	0.06%
Chinalin Securities Co Ltd	218,144	3,012,569	0.02%

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

投資ポートフォリオ(未監査)(続き)

2020年6月30日現在

	保有数	市場価値 人民元	対純資産 価値比率 (%)
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>			
<b>上場有価証券(続き)</b>			
<b>中国(続き)</b>			
<b>金融(続き)</b>			
Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd	929,300	4,386,296	0.04%
CITIC Securities Co Ltd	6,885,640	166,012,780	1.37%
CSC Financial Co Ltd	412,814	16,256,615	0.13%
Dongxing Securities Co Ltd	1,114,740	12,150,666	0.10%
East Money Information Co Ltd	5,210,927	105,260,725	0.87%
Everbright Securities Co Ltd	1,578,730	25,354,404	0.21%
Founder Securities Co Ltd	3,327,303	23,557,305	0.19%
GF Securities Co Ltd	2,392,493	33,782,001	0.28%
Guosen Securities Co Ltd	1,991,963	22,509,182	0.19%
Guotai Junan Securities Co Ltd	3,645,060	62,913,736	0.52%
Guoyuan Securities Co Ltd	1,628,711	13,681,172	0.11%
Haitong Securities Co Ltd	6,537,526	82,242,077	0.68%
Hi think RoyalFlush Information Network Co Ltd	173,849	23,135,825	0.19%
Hongta Securities Co Ltd	323,240	6,270,856	0.05%
Huatai Securities Co Ltd	4,757,663	89,444,064	0.74%
Huaxia Bank Co Ltd	4,978,555	30,468,757	0.25%
Hubei Biocause Pharmaceutical Co Ltd	1,593,922	8,304,334	0.07%
Industrial & Commercial Bank of China Ltd	28,334,268	141,104,655	1.17%
Industrial Bank Co Ltd	10,075,050	158,984,289	1.31%
Industrial Securities Co Ltd	3,789,061	25,955,068	0.21%
Minmetals Capital Co Ltd	1,818,093	12,835,737	0.11%
New China Life Insurance Co Ltd	674,519	29,867,701	0.25%
Orient Securities Co Ltd/China	2,893,617	27,460,425	0.23%
People's Insurance Co Group of China Ltd/The	1,721,500	11,086,460	0.09%
Ping An Bank Co Ltd	7,839,660	100,347,648	0.83%
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	8,755,981	625,177,043	5.16%
Postal Savings Bank of China Co Ltd	2,166,700	9,901,819	0.08%
Qingdao Rural Commercial Bank Corp	2,241,628	9,930,412	0.08%
SDIC Capital Co Ltd	1,366,596	17,396,767	0.14%
Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd	9,490,126	100,405,533	0.83%
Shenwan Hongyuan Group Co Ltd	7,283,004	36,779,170	0.30%
Sinolink Securities Co Ltd	1,955,450	22,311,684	0.18%
SooChow Securities Co Ltd	2,509,238	20,475,382	0.17%

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオ(未監査)(続き)

2020年6月30日現在

	保有数	市場価値 人民元	対純資産 価値比率 (%)
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>			
<b>上場有価証券(続き)</b>			
<b>中国(続き)</b>			
<b>金融(続き)</b>			
Southwest Securities Co Ltd	2,278,289	10,457,347	0.09%
Tianfeng Securities Co Ltd	2,694,040	16,325,882	0.13%
Western Securities Co Ltd	1,415,481	11,550,325	0.10%
Zheshang Securities Co Ltd	1,077,900	10,681,989	0.09%
<b>ヘルスケア</b>			
Aier Eye Hospital Group Co Ltd	1,627,804	70,728,084	0.58%
Autobio Diagnostics Co Ltd	104,665	17,001,783	0.14%
Beijing Tongrentang Co Ltd	443,173	12,018,852	0.10%
Changchun High & New Technology Industry Group Inc	228,868	99,626,240	0.82%
Chengdu Kanghong Pharmaceutical Group Co Ltd	212,228	10,526,509	0.09%
Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd	517,474	51,825,021	0.43%
Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd	454,319	14,688,133	0.12%
Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd	423,914	43,188,358	0.36%
Huadong Medicine Co Ltd	707,388	17,896,916	0.15%
Hualan Biological Engineering Inc	884,896	44,342,139	0.37%
Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd	3,002,677	277,147,087	2.29%
Jointown Pharmaceutical Group Co Ltd	606,995	11,302,247	0.09%
Lepu Medical Technology Beijing Co Ltd	1,007,875	36,807,595	0.30%
Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co Ltd	2,218,102	31,962,850	0.26%
Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	975,181	33,009,877	0.27%
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd	932,689	17,142,824	0.14%
Shanghai RAAS Blood Products Co Ltd	1,634,838	13,830,729	0.11%
Shenzhen Kangtai Biological Products Co Ltd	271,500	44,026,440	0.36%
Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd	814,482	17,104,122	0.14%
Tonghua Dongbao Pharmaceutical Co Ltd	1,150,859	20,059,472	0.17%
Walvax Biotechnology Co Ltd	1,242,899	65,078,192	0.54%
WuXi AppTec Co Ltd	837,514	80,903,852	0.67%
Yunnan Baiyao Group Co Ltd	412,910	38,735,087	0.32%
Zhangzhou Pientzehuang Pharmaceutical Co Ltd	243,704	41,490,606	0.34%
Zhejiang NHU Co Ltd	1,041,865	30,318,272	0.25%

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオ(未監査)(続き)

2020年6月30日現在

	保有数	市場価値 人民元	対純資産 価値比率 (%)
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>			
<b>上場有価証券(続き)</b>			
<b>中国(続き)</b>			
<b>工業</b>			
AECC Aviation Power Co Ltd	727,480	17,081,230	0.14%
Air China Ltd	2,415,796	15,968,412	0.13%
AVIC Aircraft Co Ltd	1,119,006	19,851,166	0.16%
AVIC Shenyang Aircraft Co Ltd	339,714	11,149,413	0.09%
AVICOPTER PLC	238,113	9,779,301	0.08%
Beijing New Building Materials PLC	683,026	14,568,945	0.12%
Beijing-Shanghai High Speed Railway Co Ltd	2,381,700	14,837,991	0.12%
China Avionics Systems Co Ltd	426,561	5,681,793	0.05%
China Communications Construction Co Ltd	2,848,570	20,908,504	0.17%
China Eastern Airlines Corp Ltd	3,622,010	15,284,882	0.13%
China Gezhouba Group Co Ltd	2,232,826	13,285,315	0.11%
China National Chemical Engineering Co Ltd	1,993,367	10,923,651	0.09%
China Railway Construction Corp Ltd	3,722,619	31,195,547	0.26%
China Railway Group Ltd	6,580,440	33,033,809	0.27%
China Shipbuilding Industry Co Ltd	7,372,490	29,489,960	0.24%
China Southern Airlines Co Ltd	3,472,620	17,953,445	0.15%
China Spacesat Co Ltd	478,179	14,742,259	0.12%
China State Construction Engineering Corp Ltd	16,963,697	80,916,835	0.67%
COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd	3,915,083	13,585,338	0.11%
CRRC Corp Ltd	9,835,440	54,783,401	0.45%
Daqing Railway Co Ltd	4,806,997	33,841,259	0.28%
Eve Energy Co Ltd	743,791	35,590,399	0.29%
Fangda Carbon New Material Co Ltd	1,845,965	11,592,660	0.10%
Guangzhou Baiyun International Airport Co Ltd	836,146	12,742,865	0.11%
Hainan Airlines Holding Co Ltd	9,296,430	13,944,645	0.12%
Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd	690,192	24,812,402	0.20%
Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd	213,800	17,146,760	0.14%
Jiangsu Zhongtian Technology Co Ltd	1,983,056	22,705,991	0.19%
Metalurgical Corp of China Ltd	5,771,370	14,486,139	0.12%
NARI Technology Co Ltd	1,868,042	37,827,850	0.31%
Ningbo Zhoushan Port Co Ltd	3,193,838	11,402,002	0.09%
Power Construction Corp of China Ltd	6,182,787	21,392,443	0.18%
Qingdao Port International Co Ltd	566,600	3,218,288	0.03%

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオ(未監査)(続き)

2020年6月30日現在

	保有数	市場価値 人民元	対純資産 価値比率 (%)
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>			
<b>上場有価証券(続き)</b>			
<b>中国(続き)</b>			
<b>工業(続き)</b>			
Sany Heavy Industry Co Ltd	4,772,804	89,537,803	0.74%
SF Holding Co Ltd	1,070,560	58,559,632	0.48%
Shanghai Construction Group Co Ltd	3,591,745	11,026,657	0.09%
Shanghai Electric Group Co Ltd	2,956,917	14,902,862	0.12%
Shanghai International Airport Co Ltd	778,744	56,124,080	0.46%
Shanghai International Port Group Co Ltd	2,809,829	11,801,282	0.10%
Shanghai M&G Stationery Inc	300,142	16,387,753	0.14%
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	843,317	32,037,613	0.26%
Spring Airlines Co Ltd	296,634	10,453,382	0.09%
STO Express Co Ltd	495,196	8,126,166	0.07%
TBEA Co Ltd	2,998,700	20,301,199	0.17%
Weichai Power Co Ltd	3,874,284	53,155,176	0.44%
XCMG Construction Machinery Co Ltd	3,799,289	22,453,798	0.19%
Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd	2,232,035	22,253,389	0.18%
YTO Express Group Co Ltd	1,022,902	14,893,453	0.12%
Yunda Holding Co Ltd	937,356	22,918,354	0.19%
Zhejiang Chint Electrics Co Ltd	869,189	22,903,130	0.19%
Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd	1,451,892	31,796,435	0.26%
Zhengzhou Yutong Bus Co Ltd	1,073,946	13,102,141	0.11%
Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd	4,190,285	26,943,533	0.22%
<b>インフォメーション・テクノロジー</b>			
360 Security Technology Inc	819,910	15,012,552	0.12%
Aisino Corp	903,468	14,672,320	0.12%
Avary Holding Shenzhen Co Ltd	205,458	10,285,227	0.08%
AVIC Jonhon Optronic Technology Co Ltd	444,709	18,237,516	0.15%
Beijing Shiji Information Technology Co Ltd	258,683	10,096,397	0.08%
BOE Technology Group Co Ltd	21,898,761	102,267,214	0.84%
Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd	842,595	23,339,881	0.19%
China Greatwall Technology Group Co Ltd	1,420,381	18,749,029	0.15%
Dawning Information Industry Co Ltd	841,674	32,320,282	0.27%
Fiberhome Telecommunication Technologies Co Ltd	567,896	16,417,873	0.14%
Foxconn Industrial Internet Co Ltd	1,606,087	24,332,218	0.20%

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオ(未監査)(続き)

2020年6月30日現在

	保有数	市場価値 人民元	対純資産 価値比率 (%)
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>			
<b>上場有価証券(続き)</b>			
<b>中国(続き)</b>			
<b>インフォメーション・テクノロジー(続き)</b>			
Gigadevice Semiconductor Beijing Inc	266,085	62,772,112	0.52%
Glodon Co Ltd	731,067	50,955,370	0.42%
GoerTek Inc	1,836,332	53,914,708	0.45%
Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co Ltd	211,918	21,090,079	0.17%
Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd	3,021,433	91,700,492	0.76%
Hengtong Optic-electric Co Ltd	1,104,943	18,132,115	0.15%
Hundsun Technologies Inc	675,366	72,736,918	0.60%
Iflytek Co Ltd	1,243,877	46,558,316	0.38%
Inspur Electronic Information Industry Co Ltd	815,123	31,936,519	0.26%
Lens Technology Co Ltd	1,063,318	29,815,437	0.25%
LONGi Green Energy Technology Co Ltd	2,134,103	86,922,015	0.72%
Luxshare Precision Industry Co Ltd	3,386,504	173,896,980	1.44%
NAURA Technology Group Co Ltd	200,043	34,189,349	0.28%
OFILM Group Co Ltd	1,524,728	28,039,748	0.23%
Sanan Optoelectronics Co Ltd	1,977,683	49,442,075	0.41%
Shengyi Technology Co Ltd	919,969	26,927,493	0.22%
Shennan Circuits Co Ltd	115,369	19,326,615	0.16%
Shenzhen Goodix Technology Co Ltd	147,591	32,898,034	0.27%
Shenzhen Sunway Communication Co Ltd	626,200	33,201,124	0.27%
Tianjin Zhonghuan Semiconductor Co Ltd	1,575,698	35,390,177	0.29%
Unisplendour Corp Ltd	825,352	35,473,629	0.29%
Universal Scientific Industrial Shanghai Co Ltd	529,034	11,554,103	0.10%
Will Semiconductor Ltd	139,802	28,233,014	0.23%
Wingtech Technology Co Ltd	363,500	45,782,825	0.38%
WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd	975,800	24,375,484	0.20%
Yealink Network Technology Corp Ltd	217,900	14,873,854	0.12%
Yonyou Network Technology Co Ltd	1,312,973	57,902,109	0.48%
Zhejiang Dahua Technology Co Ltd	1,456,771	27,984,571	0.23%
ZTE Corp	2,180,713	87,512,013	0.72%
<b>素材</b>			
Aluminum Corp of China Ltd	5,286,245	14,590,036	0.12%
Anhui Conch Cement Co Ltd	1,939,623	102,625,453	0.85%

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオ(未監査)(続き)

2020年6月30日現在

	保有数	市場価値 人民元	対純資産 価値比率 (%)
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>			
<b>上場有価証券(続き)</b>			
<b>中国(続き)</b>			
<b>素材(続き)</b>			
Baiyin Nonferrous Group Co Ltd	1,197,500	3,053,625	0.03%
Baoshan Iron & Steel Co Ltd	7,200,787	32,835,589	0.27%
BBMG Corp	2,696,066	8,249,962	0.07%
Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd	888,426	36,096,748	0.30%
Bluestar Adisseo Co	238,261	2,911,549	0.02%
China Jushi Co Ltd	1,698,471	15,541,010	0.13%
China Molybdenum Co Ltd	5,708,460	20,950,048	0.17%
China Northern Rare Earth Group High-Tech Co Ltd	1,761,808	16,420,051	0.14%
Citic Pacific Special Steel Group Co Ltd	281,939	4,818,338	0.04%
Ganfeng Lithium Co Ltd	618,062	33,109,581	0.27%
Hengli Petrochemical Co Ltd	1,706,954	23,897,356	0.20%
Hengyi Petrochemical Co Ltd	1,487,987	13,585,321	0.11%
Hesteel Co Ltd	3,433,128	7,003,581	0.06%
Hoshine Silicon Industry Co Ltd	113,925	3,114,709	0.03%
Inner Mongolia BaoTou Steel Union Co Ltd	18,419,673	19,893,247	0.16%
Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co Ltd	2,728,576	6,930,583	0.06%
Jiangxi Copper Co Ltd	838,482	11,285,968	0.09%
Lomon Billions Group Co Ltd	821,016	15,188,796	0.13%
Ningxia Baofeng Energy Group Co Ltd	652,400	5,493,208	0.05%
Rongsheng Petro Chemical Co Ltd	1,525,519	18,763,884	0.15%
Shandong Gold Mining Co Ltd	1,054,125	38,602,057	0.32%
Shandong Nanshan Aluminum Co Ltd	5,795,527	11,764,920	0.10%
Tianqi Lithium Corp	716,467	16,442,918	0.14%
Wanhua Chemical Group Co Ltd	1,269,129	63,443,759	0.52%
Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd	553,523	21,509,904	0.18%
Zhejiang Longsheng Group Co Ltd	2,103,728	26,906,681	0.22%
Zhongjin Gold Corp Ltd	1,501,131	13,720,337	0.11%
Zijin Mining Group Co Ltd	11,113,085	48,897,574	0.40%
<b>不動産</b>			
China Fortune Land Development Co Ltd	974,222	22,270,715	0.18%
China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd	2,562,217	42,122,847	0.35%

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオ(未監査)(続き)

2020年6月30日現在

	保有数	市場価値 人民元	対純資産 価値比率 (%)
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>			
<b>上場有価証券(続き)</b>			
<b>中国(続き)</b>			
<b>不動産(続き)</b>			
China Vanke Co Ltd	5,502,011	143,822,568	1.19%
Gemdale Corp	1,821,131	24,949,495	0.21%
Greenland Holdings Corp Ltd	2,950,400	18,233,472	0.15%
Jiangsu Zhongnan Construction Group Co Ltd	1,499,395	13,344,616	0.11%
Jinke Properties Group Co Ltd	1,726,353	14,087,040	0.12%
Poly Developments and Holdings Group Co Ltd	5,787,280	85,535,998	0.71%
Red Star Macaline Group Corp Ltd	325,600	3,448,104	0.03%
RiseSun Real Estate Development Co Ltd	1,406,091	11,389,337	0.09%
Seazen Holdings Co Ltd	729,732	22,796,828	0.19%
Shanghai Lingang Holdings Corp Ltd	483,975	10,390,943	0.09%
Xinhu Zhongbao Co Ltd	3,475,804	10,357,896	0.09%
Yango Group Co Ltd	1,323,791	8,392,835	0.07%
Youngor Group Co Ltd	2,241,332	13,358,339	0.11%
<b>公益事業</b>			
CGN Power Co Ltd	4,772,900	14,127,784	0.12%
China National Nuclear Power Co Ltd	5,032,831	20,584,279	0.17%
China Yangtze Power Co Ltd	7,116,520	134,786,889	1.11%
GD Power Development Co Ltd	9,530,652	17,631,706	0.15%
Huadian Power International Corp Ltd	2,633,864	9,007,815	0.07%
Huaneng Lancang River Hydropower Inc	1,451,300	5,500,427	0.05%
Huaneng Power International Inc	3,556,003	15,006,333	0.12%
SDIC Power Holdings Co Ltd	2,190,530	17,217,566	0.14%
Sichuan Chuantou Energy Co Ltd	1,067,106	9,892,073	0.08%
<b>投資合計(公正価値)</b>		<b>11,970,935,957</b>	<b>98.86%</b>
<b>投資合計(取得原価)</b>		<b>10,264,508,672</b>	

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオの変動(未監査)

2020年1月1日から2020年6月30日までの期間

投資	2020年 1月1日 現在保有残高	取得	コーポレート ・アクション	売却	2020年 6月30日 現在保有残高
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産</b>					
<b>上場有価証券</b>					
360 Security Technology Inc	511,710	576,600	-	268,400	819,910
AECC Aviation Power Co Ltd	1,125,580	171,200	-	569,300	727,480
Agricultural Bank of China Ltd	47,965,037	7,162,252	-	31,906,500	23,220,789
Aier Eye Hospital Group Co Ltd	1,559,983	519,638	323,383	775,200	1,627,804
Air China Ltd	3,751,496	572,900	-	1,908,600	2,415,796
Aisino Corp	1,398,468	214,000	-	709,000	903,468
Aluminum Corp of China Ltd	8,183,445	1,258,000	-	4,155,200	5,286,245
Angang Steel Co Ltd	3,022,504	414,300	-	3,436,804	-
Anhui Conch Cement Co Ltd	2,503,529	628,294	-	1,192,200	1,939,623
Anhui Gujing Distillery Co Ltd	154,220	88,282	-	149,200	93,302
Anxin Trust Co Ltd	2,743,163	188,100	-	2,931,263	-
Autobio Diagnostics Co Ltd	-	107,865	-	3,200	104,665
Avary Holding Shenzhen Co Ltd	315,158	42,800	-	152,500	205,458
AVIC Aircraft Co Ltd	1,728,206	256,800	-	866,000	1,119,006
Avic Capital Co Ltd	6,745,220	1,031,500	-	3,427,100	4,349,620
AVIC Jonhon Optronic Technology Co Ltd	661,189	85,520	-	302,000	444,709
AVIC Shenyang Aircraft Co Ltd	528,314	85,600	-	274,200	339,714
AVICOPTER PLC	362,113	42,800	-	166,800	238,113
BAIC BluePark New Energy Technology Co Ltd	1,738,975	242,669	-	1,981,644	-
Baiyin Nonferrous Group Co Ltd	1,860,900	269,900	-	933,300	1,197,500
Bank of Beijing Co Ltd	18,531,469	2,826,676	-	9,398,300	11,959,845
Bank of Changsha Co Ltd	1,289,837	199,653	-	659,500	829,990
Bank of Chengdu Co Ltd	2,258,299	548,300	-	1,051,200	1,755,399
Bank of China Ltd	26,388,763	4,036,400	-	13,385,100	17,040,063
Bank of Communications Co Ltd	34,397,343	5,262,300	-	17,451,000	22,208,643
Bank of Guiyang Co Ltd	3,214,631	490,476	-	1,884,100	1,821,007
Bank of Hangzhou Co Ltd	2,564,050	673,400	-	1,320,200	1,917,250
Bank of Jiangsu Co Ltd	11,560,570	1,769,028	-	5,864,700	7,464,898
Bank of Nanjing Co Ltd	7,440,326	1,168,656	-	3,756,000	4,852,982
Bank of Ningbo Co Ltd	3,530,233	608,206	-	1,710,200	2,428,239
Bank of Shanghai Co Ltd	8,894,427	3,387,096	-	4,243,500	8,038,023
Bank of Xi'an Co Ltd	610,727	741,968	-	274,800	1,077,895
Baoshan Iron & Steel Co Ltd	11,159,053	1,707,034	-	5,665,300	7,200,787

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオの変動(未監査)(続き)

2020年1月1日から2020年6月30日までの期間

投資(続き)	2020年 1月1日 現在保有残高	取得	コーポレート ・アクション	売却	2020年 6月30日 現在保有残高
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>					
<b>上場有価証券(続き)</b>					
BBMG Corp	4,176,000	648,166	-	2,128,100	2,696,066
Beijing New Building Materials PLC	1,061,562	177,164	-	555,700	683,026
Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd	1,117,142	304,084	-	532,800	888,426
Beijing Originwater Technology Co Ltd	2,380,404	330,596	-	2,711,000	-
Beijing Shiji Information Technology Co Ltd	391,892	42,800	-	176,009	258,683
Beijing Shunxin Agriculture Co Ltd	-	426,000	-	6,400	419,600
Beijing Tongrentang Co Ltd	677,973	119,500	-	354,300	443,173
Beijing-Shanghai High Speed Railway Co Ltd	-	2,423,300	-	41,600	2,381,700
Bluestar Adisseo Co	362,400	54,161	-	178,300	238,261
BOE Technology Group Co Ltd	29,670,761	6,351,500	-	14,123,500	21,898,761
Bohai Leasing Co Ltd	2,318,447	321,300	-	2,639,747	-
BYD Co Ltd	1,133,234	171,156	-	571,500	732,890
Caitong Securities Co Ltd	3,141,843	475,400	-	1,586,400	2,030,843
CGN Power Co Ltd	-	4,849,700	-	76,800	4,772,900
Changchun High & New Technology Industry Group Inc	183,113	77,421	115,634	147,300	228,868
Changjiang Securities Co Ltd	4,842,974	739,478	-	2,450,400	3,132,052
Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd	1,315,589	219,206	-	692,200	842,595
Chengdu Kanghong Pharmaceutical Group Co Ltd	325,000	42,728	-	155,500	212,228
China Avionics Systems Co Ltd	656,161	98,500	-	328,100	426,561
China CITIC Bank Corp Ltd	3,841,182	586,000	-	1,953,700	2,473,482
China Coal Energy Co Ltd	2,307,670	348,100	-	1,176,100	1,479,670
China Communications Construction Co Ltd	2,941,370	1,317,200	-	1,410,000	2,848,570
China Construction Bank Corp	8,416,089	1,283,800	-	4,271,500	5,428,389
China Eastern Airlines Corp Ltd	5,606,510	858,900	-	2,843,400	3,622,010
China Everbright Bank Co Ltd	19,944,142	3,038,700	-	10,114,300	12,868,542
China Film Co Ltd	933,489	142,190	-	472,100	603,579
China Fortune Land Development Co Ltd	1,510,563	216,059	-	752,400	974,222
China Galaxy Securities Co Ltd	1,618,229	253,100	-	832,600	1,038,729

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオの変動(未監査)(続き)

2020年1月1日から2020年6月30日までの期間

投資(続き)	2020年 1月1日 現在保有残高	取得	コーポレート ・アクション	売却	2020年 6月30日 現在保有残高
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>					
<b>上場有価証券(続き)</b>					
China Gezhouba Group Co Ltd	3,470,626	522,400	-	1,760,200	2,232,826
China Grand Automotive Services Group Co Ltd	4,087,190	1,123,100	-	1,935,900	3,274,390
China Great Wall Securities Co Ltd	417,100	496,010	-	160,500	752,610
China Greatwall Technology Group Co Ltd	-	1,445,981	-	25,600	1,420,381
China Jushi Co Ltd	2,640,592	401,579	-	1,343,700	1,698,471
China Life Insurance Co Ltd	2,087,629	340,340	-	1,081,600	1,346,369
China Merchants Bank Co Ltd	12,906,181	1,960,697	-	6,529,600	8,337,278
China Merchants Securities Co Ltd	3,582,663	552,581	-	1,824,000	2,311,244
China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd	3,954,316	599,001	-	1,991,100	2,562,217
China Minsheng Banking Corp Ltd	31,079,299	4,684,713	-	18,565,300	17,198,712
China Molybdenum Co Ltd	8,840,960	1,350,300	-	4,482,800	5,708,460
China National Chemical Engineering Co Ltd	3,083,894	468,373	-	1,558,900	1,993,367
China National Nuclear Power Co Ltd	7,787,731	1,188,300	-	3,943,200	5,032,831
China Northern Rare Earth Group High-Tech Co Ltd	2,733,008	424,200	-	1,395,400	1,761,808
China Oilfield Services Ltd	748,397	131,900	-	405,200	475,097
China Pacific Insurance Group Co Ltd	3,933,064	595,216	-	1,987,800	2,540,480
China Petroleum & Chemical Corp	16,766,047	2,557,480	-	8,516,900	10,806,627
China Railway Construction Corp Ltd	5,767,819	882,000	-	2,927,200	3,722,619
China Railway Group Ltd	10,201,040	1,547,100	-	5,167,700	6,580,440
China Satellite Communications Co Ltd	502,782	95,000	-	274,300	323,482
China Shenhua Energy Co Ltd	4,132,407	638,174	-	2,104,700	2,665,881
China Shipbuilding Industry Co Ltd	11,460,175	1,748,115	-	5,835,800	7,372,490
China Shipbuilding Industry Group Power Co Ltd	847,668	128,400	-	452,000	524,068
China Southern Airlines Co Ltd	5,378,364	817,056	-	2,722,800	3,472,620
China Spacesat Co Ltd	747,379	140,800	-	410,000	478,179
China State Construction Engineering Corp Ltd	26,282,737	4,013,060	-	13,332,100	16,963,697
China Tourism Group Duty Free Corp Ltd	1,214,930	171,200	-	597,100	789,030

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオの変動(未監査)(続き)

2020年1月1日から2020年6月30日までの期間

投資(続き)	2020年 1月1日 現在保有残高	取得	コーポレート ・アクション	売却	2020年 6月30日 現在保有残高
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>					
<b>上場有価証券(続き)</b>					
China United Network Communications Ltd	11,658,864	1,784,400	-	5,919,616	7,523,648
China Vanke Co Ltd	7,295,387	1,667,824	-	3,461,200	5,502,011
China Yangtze Power Co Ltd	11,013,166	1,684,254	-	5,580,900	7,116,520
China Zheshang Bank Co Ltd	-	1,788,800	-	28,800	1,760,000
China In Securities Co Ltd	333,444	42,800	-	158,100	218,144
Chongqing Changan Automobile Co Ltd	2,444,231	377,711	-	1,248,900	1,573,042
Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd	-	945,300	-	16,000	929,300
Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd	597,494	196,580	-	276,600	517,474
Citic Pacific Special Steel Group Co Ltd	-	288,339	-	6,400	281,939
CITIC Securities Co Ltd	9,849,489	2,154,551	-	5,118,400	6,885,640
CNOOC Energy Technology & Services Ltd	2,512,000	407,400	-	1,276,500	1,642,900
COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd	4,850,483	1,343,400	-	2,278,800	3,915,083
CRRC Corp Ltd	12,180,327	3,439,513	-	5,784,400	9,835,440
CSC Financial Co Ltd	556,978	117,836	-	262,000	412,814
Daqin Railway Co Ltd	7,449,797	1,142,000	-	3,784,800	4,806,997
Dawning Information Industry Co Ltd	792,405	231,588	221,381	403,700	841,674
Dong-E-E-Jiao Co Ltd	571,873	77,961	-	649,834	-
Dongxing Securities Co Ltd	1,723,000	256,740	-	865,000	1,114,740
East Money Information Co Ltd	6,723,173	1,038,700	945,754	3,496,700	5,210,927
Eve Energy Co Ltd	-	756,591	-	12,800	743,791
Everbright Securities Co Ltd	2,449,930	381,400	-	1,252,600	1,578,730
Fangda Carbon New Material Co Ltd	2,040,818	311,400	563,447	1,069,700	1,845,965
Fiberhome Telecommunication Technologies Co Ltd	876,196	128,400	-	436,700	567,896
Focus Media Information Technology Co Ltd	12,858,955	1,966,800	-	6,520,700	8,305,055
Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd	1,021,656	190,256	144,502	570,700	785,714
Founder Securities Co Ltd	5,154,003	784,900	-	2,611,600	3,327,303
Foxconn Industrial Internet Co Ltd	2,233,987	420,100	-	1,048,000	1,606,087
Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	1,749,871	256,800	-	873,300	1,133,371

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオの変動(未監査)(続き)

2020年1月1日から2020年6月30日までの期間

投資(続き)	2020年 1月1日 現在保有残高	取得	コーポレート ・アクション	売却	2020年 6月30日 現在保有残高
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>					
<b>上場有価証券(続き)</b>					
Ganfeng Lithium Co Ltd	951,941	128,321	-	462,200	618,062
GD Power Development Co Ltd	14,762,452	2,272,400	-	7,504,200	9,530,652
Gemdale Corp	2,823,631	424,300	-	1,426,800	1,821,131
GF Securities Co Ltd	3,702,203	556,390	-	1,866,100	2,392,493
Giant Network Group Co Ltd	766,017	137,530	-	412,600	490,947
Gigadevice Semiconductor Beijing Inc	243,842	84,575	68,668	131,000	266,085
Glodon Co Ltd	845,996	285,171	-	400,100	731,067
GoerTek Inc	2,837,980	427,852	-	1,429,500	1,836,332
Great Wall Motor Co Ltd	1,512,822	246,900	-	777,400	982,322
Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	6,032,141	944,606	-	3,086,400	3,890,347
Greenland Holdings Corp Ltd	4,562,100	697,300	-	2,309,000	2,950,400
Guangdong Haid Group Co Ltd	998,924	173,763	-	534,200	638,487
Guangzhou Automobile Group Co Ltd	1,159,224	171,120	-	580,100	750,244
Guangzhou Baiyun International Airport Co Ltd	1,302,646	205,000	-	671,500	836,146
Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd	713,929	113,390	-	373,000	454,319
Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co Ltd	103,475	263,843	-	155,400	211,918
Guosen Securities Co Ltd	3,079,363	470,800	-	1,558,200	1,991,963
Guotai Junan Securities Co Ltd	5,640,619	852,141	-	2,847,700	3,645,060
Guoyuan Securities Co Ltd	2,526,011	381,500	-	1,278,800	1,628,711
Haier Smart Home Co Ltd	4,622,285	709,992	-	2,272,800	3,059,477
Hainan Airlines Holding Co Ltd	14,412,330	2,174,400	-	7,290,300	9,296,430
Haitong Securities Co Ltd	10,134,983	1,537,043	-	5,134,500	6,537,526
Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd	4,683,415	723,518	-	2,385,500	3,021,433
Hangzhou Robam Appliances Co Ltd	591,139	85,501	-	293,100	383,540
Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd	646,926	85,288	-	308,300	423,914
Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd	1,072,082	175,210	-	557,100	690,192
Hebei Yangyuan Zhihui Beverage Co Ltd	530,264	85,560	73,524	280,300	409,048
Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd	1,253,071	190,188	-	638,500	804,759

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオの変動(未監査)(続き)

2020年1月1日から2020年6月30日までの期間

投資(続き)	2020年 1月1日 現在保有残高	取得	コーポレート ・アクション	売却	2020年 6月30日 現在保有残高
--------	-------------------------	----	------------------	----	--------------------------

損益を通じて公正価値で測定される金融  
資産(続き)

## 上場有価証券(続き)

Hengli Petrochemical Co Ltd	2,638,713	389,641	-	1,321,400	1,706,954
Hengtong Optic-electric Co Ltd	1,668,343	256,800	-	820,200	1,104,943
Hengyi Petrochemical Co Ltd	1,421,660	440,123	300,604	674,400	1,487,987
Hesteel Co Ltd	5,315,028	804,900	-	2,686,800	3,433,128
Hi think RoyalFlush Information Network Co Ltd	269,360	43,789	-	139,300	173,849
HLA Corp Ltd	1,662,928	253,000	-	847,700	1,068,228
Hongta Securities Co Ltd	502,340	95,100	-	274,200	323,240
Hoshine Silicon Industry Co Ltd	183,932	60,993	-	131,000	113,925
Huadian Power International Corp Ltd	4,086,264	610,300	-	2,062,700	2,633,864
Huadong Medicine Co Ltd	1,096,668	171,120	-	560,400	707,388
Hualan Biological Engineering Inc	1,058,296	181,237	229,863	584,500	884,896
Huaneng Lancang River Hydropower Inc	2,263,900	337,900	-	1,150,500	1,451,300
Huaneng Power International Inc	5,512,703	830,600	-	2,787,300	3,556,003
Huatai Securities Co Ltd	5,526,155	1,882,208	-	2,650,700	4,757,663
Huaxia Bank Co Ltd	7,696,084	1,181,471	-	3,899,000	4,978,555
Huayu Automotive Systems Co Ltd	1,971,429	299,600	-	996,700	1,274,329
Hubei Biocause Pharmaceutical Co Ltd	2,476,226	376,496	-	1,258,800	1,593,922
Hubei Jumpcan Pharmaceutical Co Ltd	417,299	84,000	-	501,299	-
Hundsun Technologies Inc	806,709	134,500	164,957	430,800	675,366
Iflytek Co Ltd	1,928,264	299,413	-	983,800	1,243,877
Industrial & Commercial Bank of China Ltd	27,005,668	14,321,200	-	12,992,600	28,334,268
Industrial Bank Co Ltd	18,213,072	2,740,778	-	10,878,800	10,075,050
Industrial Securities Co Ltd	5,867,661	895,000	-	2,973,600	3,789,061
Inner Mongolia BaoTou Steel Union Co Ltd	28,508,873	4,345,400	-	14,434,600	18,419,673
Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co Ltd	4,242,676	655,900	-	2,170,000	2,728,576
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd	7,630,818	1,151,526	-	3,879,300	4,903,044
Inspur Electronic Information Industry Co Ltd	-	827,923	-	12,800	815,123
Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd	-	217,000	-	3,200	213,800
Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd	3,877,085	606,343	543,149	2,023,900	3,002,677
Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd	-	516,800	-	9,600	507,200

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオの変動(未監査)(続き)

2020年1月1日から2020年6月30日までの期間

投資(続き)	2020年 1月1日 現在保有残高	取得	コーポレート ・アクション	売却	2020年 6月30日 現在保有残高
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>					
<b>上場有価証券(続き)</b>					
Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd	760,693	144,144	-	417,300	487,537
Jiangsu Zhongnan Construction Group Co Ltd	2,315,895	354,000	-	1,170,500	1,499,395
Jiangsu Zhongtian Technology Co Ltd	3,069,956	470,800	-	1,557,700	1,983,056
Jiangxi Copper Co Ltd	1,305,707	192,175	-	659,400	838,482
Jiangxi Zhengbang Technology Co Ltd	-	1,027,500	-	16,000	1,011,500
Jinke Properties Group Co Ltd	2,682,153	415,200	-	1,371,000	1,726,353
Jointown Pharmaceutical Group Co Ltd	715,075	264,620	-	372,700	606,995
Kweichow Moutai Co Ltd	623,315	95,178	-	312,400	406,093
Lens Technology Co Ltd	976,203	889,715	-	802,600	1,063,318
Lepu Medical Technology Beijing Co Ltd	1,342,232	320,643	-	655,000	1,007,875
Lomon Billions Group Co Ltd	1,267,916	213,600	-	660,500	821,016
LONGi Green Energy Technology Co Ltd	3,308,090	509,713	-	1,683,700	2,134,103
Luxshare Precision Industry Co Ltd	4,023,470	614,773	765,661	2,017,400	3,386,504
Luzhou Laojiao Co Ltd	910,549	128,108	-	446,700	591,957
Mango Excellent Media Co Ltd	660,009	205,282	-	289,800	575,491
Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co Ltd	3,429,658	513,444	-	1,725,000	2,218,102
Metalurgical Corp of China Ltd	8,918,170	1,353,700	-	4,500,500	5,771,370
Midea Group Co Ltd	6,084,846	960,607	-	3,085,000	3,960,453
Minmetals Capital Co Ltd	615,760	1,494,933	-	292,600	1,818,093
Muyuan Foodstuff Co Ltd	1,084,801	180,685	516,909	570,900	1,211,495
NARI Technology Co Ltd	2,883,442	432,500	-	1,447,900	1,868,042
NAURA Technology Group Co Ltd	-	203,243	-	3,200	200,043
New China Life Insurance Co Ltd	1,049,519	179,000	-	554,000	674,519
New Hope Liuhe Co Ltd	2,635,747	387,991	-	1,319,800	1,703,938
Ningbo Zhoushan Port Co Ltd	4,952,038	744,000	-	2,502,200	3,193,838
Ningxia Baofeng Energy Group Co Ltd	1,013,300	156,500	-	517,400	652,400
Offcn Education Technology Co Ltd	844,707	128,400	-	424,700	548,407
Offshore Oil Engineering Co Ltd	2,769,832	419,400	-	1,402,500	1,786,732
OFILM Group Co Ltd	2,382,228	359,100	-	1,216,600	1,524,728
Oppein Home Group Inc	166,990	82,493	-	147,300	102,183
Orient Securities Co Ltd/China	4,479,467	681,050	-	2,266,900	2,893,617

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオの変動(未監査)(続き)

2020年1月1日から2020年6月30日までの期間

投資(続き)	2020年 1月1日 現在保有残高	取得	コーポレート ・アクション	売却	2020年 6月30日 現在保有残高
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>					
<b>上場有価証券(続き)</b>					
Oriental Pearl Group Co Ltd	2,571,547	385,883	-	1,301,300	1,656,130
Pangang Group Vanadium Titanium & Resources Co Ltd	5,372,100	775,700	-	6,147,800	-
People's Insurance Co Group of China Ltd/The	1,337,600	1,013,600	-	629,700	1,721,500
Perfect World Co Ltd/China	641,561	167,997	-	287,000	522,558
PetroChina Co Ltd	12,145,731	1,866,138	-	6,162,300	7,849,569
Ping An Bank Co Ltd	12,151,363	1,855,197	-	6,166,900	7,839,660
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	13,568,035	2,090,346	-	6,902,400	8,755,981
Poly Developments and Holdings Group Co Ltd	8,958,546	1,365,634	-	4,536,900	5,787,280
Postal Savings Bank of China Co Ltd	-	2,205,100	-	38,400	2,166,700
Power Construction Corp of China Ltd	9,570,887	1,469,100	-	4,857,200	6,182,787
Qingdao Port International Co Ltd	603,600	228,200	-	265,200	566,600
Qingdao Rural Commercial Bank Corp	767,100	1,826,728	-	352,200	2,241,628
Red Star MacAlline Group Corp Ltd	508,100	85,600	-	268,100	325,600
RiseSun Real Estate Development Co Ltd	2,181,091	332,800	-	1,107,800	1,406,091
Rongsheng Petro Chemical Co Ltd	2,353,459	356,660	-	1,184,600	1,525,519
SAIC Motor Corp Ltd	4,392,759	681,000	-	2,240,600	2,833,159
Sanan Optoelectronics Co Ltd	3,063,283	467,000	-	1,552,600	1,977,683
Sany Heavy Industry Co Ltd	7,386,281	1,118,323	-	3,731,800	4,772,804
SDIC Capital Co Ltd	2,114,996	331,900	-	1,080,300	1,366,596
SDIC Power Holdings Co Ltd	4,243,130	632,700	-	2,685,300	2,190,530
Seazen Holdings Co Ltd	1,128,732	171,200	-	570,200	729,732
SF Holding Co Ltd	1,104,662	496,298	-	530,400	1,070,560
Shaanxi Coal Industry Co Ltd	5,008,804	766,577	-	2,542,200	3,233,181
Shandong Gold Mining Co Ltd	1,308,725	400,400	-	655,000	1,054,125
Shandong Nanshan Aluminum Co Ltd	9,002,860	1,369,967	-	4,577,300	5,795,527
Shanghai Construction Group Co Ltd	5,563,745	832,500	-	2,804,500	3,591,745
Shanghai Electric Group Co Ltd	4,570,917	691,900	-	2,305,900	2,956,917
Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	1,250,781	317,900	-	593,500	975,181
Shanghai International Airport Co Ltd	1,199,072	170,972	-	591,300	778,744

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオの変動(未監査)(続き)

2020年1月1日から2020年6月30日までの期間

投資(続き)	2020年 1月1日 現在保有残高	取得	コーポレート ・アクション	売却	2020年 6月30日 現在保有残高
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>					
<b>上場有価証券(続き)</b>					
Shanghai International Port Group Co Ltd	5,798,729	852,200	-	3,841,100	2,809,829
Shanghai Lingang Holdings Corp Ltd	501,590	247,585	-	265,200	483,975
Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co Ltd	1,102,621	155,852	-	1,258,473	-
Shanghai M&G Stationery Inc	465,728	101,114	-	266,700	300,142
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd	1,440,389	213,500	-	721,200	932,689
Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd	14,704,217	2,242,609	-	7,456,700	9,490,126
Shanghai RAAS Blood Products Co Ltd	2,489,918	385,120	-	1,240,200	1,634,838
Shanghai Yuyuan Tourist Mart Group Co Ltd	1,937,320	299,403	-	977,700	1,259,023
Shanxi Meijin Energy Co Ltd	1,531,700	235,742	-	773,600	993,842
Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd	323,542	42,780	-	155,100	211,222
Shengyi Technology Co Ltd	1,416,569	214,000	-	710,600	919,969
Shennan Circuits Co Ltd	137,760	94,658	34,351	151,400	115,369
Shenwan Hongyuan Group Co Ltd	11,282,004	1,726,200	-	5,725,200	7,283,004
Shenzhen Goodix Technology Co Ltd	179,296	115,795	-	147,500	147,591
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	1,308,434	224,183	-	689,300	843,317
Shenzhen Kangtai Biological Products Co Ltd	-	274,700	-	3,200	271,500
Shenzhen Overseas Chinese Town Co Ltd	5,136,888	777,500	-	2,599,500	3,314,888
Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co Ltd	526,246	77,958	-	604,204	-
Shenzhen Sunway Communication Co Ltd	960,900	151,600	-	486,300	626,200
Siasun Robot & Automation Co Ltd	1,369,066	195,000	-	1,564,066	-
Sichuan Chuantou Energy Co Ltd	2,207,206	331,000	-	1,471,100	1,067,106
Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd	1,083,893	254,589	-	524,000	814,482
Sinolink Securities Co Ltd	3,031,350	467,000	-	1,542,900	1,955,450
Songcheng Performance Development Co Ltd	1,091,512	182,560	604,729	610,600	1,268,201
Soochow Securities Co Ltd	3,008,837	481,300	671,201	1,652,100	2,509,238
Southwest Securities Co Ltd	3,527,989	527,700	-	1,777,400	2,278,289

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオの変動(未監査)(続き)

2020年1月1日から2020年6月30日までの期間

投資(続き)	2020年 1月1日 現在保有残高	取得	コーポレート ・アクション	売却	2020年 6月30日 現在保有残高
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>					
<b>上場有価証券(続き)</b>					
Spring Airlines Co Ltd	466,496	99,038	-	268,900	296,634
STO Express Co Ltd	375,296	273,300	-	153,400	495,196
Suning.com Co Ltd	4,667,252	708,300	-	2,365,300	3,010,252
Suzhou Gold Mantis Construction Decoration Co Ltd	2,014,204	273,000	-	2,287,204	-
Tasly Pharmaceutical Group Co Ltd	1,134,444	156,000	-	1,290,444	-
TBEA Co Ltd	4,657,191	711,409	-	2,369,900	2,998,700
TCL Technology Group Corp	16,928,953	2,579,900	-	8,570,400	10,938,453
Tianfeng Securities Co Ltd	656,700	2,246,700	147,240	356,600	2,694,040
Tianjin Zhonghuan Semiconductor Co Ltd	-	1,601,298	-	25,600	1,575,698
Tianqi Lithium Corp	1,115,187	171,080	-	569,800	716,467
Tonghua Dongbao Pharmaceutical Co Ltd	1,773,846	256,713	-	879,700	1,150,859
Tongling Nonferrous Metals Group Co Ltd	7,901,687	1,079,304	-	8,980,991	-
Tongwei Co Ltd	2,435,936	1,029,500	-	1,385,900	2,079,536
Transfar Zhilian Co Ltd	1,617,800	222,200	-	1,840,000	-
Tsinghua Tongfang Co Ltd	2,975,442	407,500	-	3,382,942	-
Tungshu Optoelectronic Technology Co Ltd	5,477,088	766,200	-	6,243,288	-
Unisplendour Corp Ltd	1,026,585	322,767	-	524,000	825,352
Universal Scientific Industrial Shanghai Co Ltd	-	538,634	-	9,600	529,034
Walvax Biotechnology Co Ltd	1,546,752	444,047	-	747,900	1,242,899
Wanda Film Holding Co Ltd	1,046,263	171,097	-	545,100	672,260
Wangsu Science & Technology Co Ltd	2,439,977	344,300	-	2,784,277	-
Wanhua Chemical Group Co Ltd	1,963,918	299,511	-	994,300	1,269,129
Weichai Power Co Ltd	5,995,384	925,800	-	3,046,900	3,874,284
Wens Foodstuffs Group Co Ltd	4,660,861	734,965	636,353	2,425,800	3,606,379
Western Securities Co Ltd	2,194,457	341,924	-	1,120,900	1,415,481
Will Semiconductor Ltd	219,898	57,104	-	137,200	139,802
Wingtech Technology Co Ltd	-	369,900	-	6,400	363,500
Wuhu Sanqi Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd	1,327,463	351,708	-	655,000	1,024,171
Wuliangye Yibin Co Ltd	2,435,298	390,406	-	1,257,100	1,568,604

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオの変動(未監査)(続き)

2020年1月1日から2020年6月30日までの期間

投資(続き)	2020年 1月1日 現在保有残高	取得	コーポレート ・アクション	売却	2020年 6月30日 現在保有残高
<b>損益を通じて公正価値で測定される金融資産(続き)</b>					
<b>上場有価証券(続き)</b>					
WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd	-	991,800	-	16,000	975,800
WuXi AppTec Co Ltd	910,038	132,172	253,004	457,700	837,514
XCMG Construction Machinery Co Ltd	5,886,239	906,750	-	2,993,700	3,799,289
Xiamen C & D Inc	1,766,729	239,300	-	2,006,029	-
Xinhu Zhongbao Co Ltd	5,379,304	810,500	-	2,714,000	3,475,804
Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd	3,448,788	519,647	-	1,736,400	2,232,035
YanAn Bicon Pharmaceutical Listed Co	772,228	117,000	-	889,228	-
Yango Group Co Ltd	2,023,440	309,051	-	1,008,700	1,323,791
Yanzhou Coal Mining Co Ltd	1,111,780	171,200	-	565,100	717,880
Yealink Network Technology Corp Ltd	-	221,100	-	3,200	217,900
Yonghui Superstores Co Ltd	4,788,840	723,800	-	2,418,500	3,094,140
Yonyou Network Technology Co Ltd	1,574,787	272,208	329,578	863,600	1,312,973
Youngor Group Co Ltd	4,398,332	661,000	-	2,818,000	2,241,332
YTO Express Group Co Ltd	700,800	732,202	-	410,100	1,022,902
Yunda Holding Co Ltd	833,816	332,975	172,365	401,800	937,356
Yunnan Baiyao Group Co Ltd	633,371	85,439	-	305,900	412,910
Zhangzhou Pientzhuang Pharmaceutical Co Ltd	370,116	42,788	-	169,200	243,704
Zhejiang Century Huatong Group Co Ltd	2,985,303	469,000	-	1,440,840	2,013,463
Zhejiang Chint Electrics Co Ltd	1,348,715	213,774	-	693,300	869,189
Zhejiang Dahua Technology Co Ltd	2,256,890	342,281	-	1,142,400	1,456,771
Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd	811,822	163,601	-	421,900	553,523
Zhejiang Longsheng Group Co Ltd	3,264,385	509,743	-	1,670,400	2,103,728
Zhejiang NHU Co Ltd	1,618,213	252,952	-	829,300	1,041,865
Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd	1,727,510	264,318	358,364	898,300	1,451,892
Zhejiang Supor Co Ltd	210,984	58,517	-	136,700	132,801
Zhejiang Zheneng Electric Power Co Ltd	5,121,597	698,400	-	5,819,997	-
Zhengzhou Yutong Bus Co Ltd	1,663,446	256,800	-	846,300	1,073,946
Zheshang Securities Co Ltd	1,669,200	256,800	-	848,100	1,077,900
Zhongjin Gold Corp Ltd	2,163,580	356,151	-	1,018,600	1,501,131
Zijin Mining Group Co Ltd	17,205,635	2,629,550	-	8,722,100	11,113,085

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 投資ポートフォリオの変動(未監査)(続き)

2020年1月1日から2020年6月30日までの期間

投資(続き)	2020年 1月1日 現在保有残高	取得	コーポレート ・アクション	売却	2020年 6月30日 現在保有残高
--------	-------------------------	----	------------------	----	--------------------------

損益を通じて公正価値で測定される金融  
資産(続き)

## 上場有価証券(続き)

Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd	6,488,235	989,050	-	3,287,000	4,190,285
ZTE Corp	2,984,666	661,147	-	1,465,100	2,180,713

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## パフォーマンス記録(未監査)

2020年1月1日から2020年6月30日までの期間

## 1. 純資産価値(サブファンドの信託証書に基づき計算)

	受益者に帰属 する純資産 人民元	1口当たり 純資産価値 人民元
2020年6月30日現在(未監査)	12,111,443,826	42.6534
2019年12月31日現在(監査済み)	17,382,025,714	41.7586
2018年12月31日現在(監査済み)	11,816,519,143	30.7122
2017年12月31日現在(監査済み)	11,093,007,702	41.1309

2. 1口当たり最高発行価格及び最低償還価格<sup>1</sup>

	最高発行価格 人民元	最低償還価格 人民元
以下の日付に終了した期間/年度		
2020年6月30日(未監査)	42.8389	35.9722
2019年12月31日(監査済み)	41.7586	30.2426
2018年12月31日(監査済み)	44.7342	30.5351
2017年12月31日(監査済み)	43.1972	33.9102
2016年12月31日(監査済み)	36.5111	29.1665
2015年12月31日(監査済み)	53.7690	30.5877
2014年12月31日(監査済み)	35.3314	21.0387
2013年12月31日(監査済み)	27.1919	21.6261
2012年12月31日 <sup>2</sup> (監査済み)	24.9664	21.1203

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## パフォーマンス記録(未監査)(続き)

2020年1月1日から2020年6月30日までの期間

3. スキーム・パフォーマンスと実際のインデックス・パフォーマンスとの比較<sup>1</sup>

下表は、以下の期間/年度における、サブファンドのパフォーマンス(時価評価)とインデックスのパフォーマンスを比較したものです。

	インデックス (2012年7月16日 以降)	サブファンドの 人民元カウンター (2012年7月17日 以降)	サブファンドの 香港ドル カウンター (2012年10月26日 以降)
以下の日付に終了した期間/年度			
2020年6月30日(未監査)	105.62%	77.42%	63.66%
2019年12月31日(監査済み)	100.16%	71.69%	64.83%
2018年12月31日(監査済み)	43.81%	27.89%	25.22%
2017年12月31日(監査済み)	88.27%	70.04%	75.49%
2016年12月31日(監査済み)	37.94%	39.88%	33.75%
2015年12月31日(監査済み)	55.48%	57.44%	59.33%
2014年12月31日(監査済み)	47.25%	41.94%	52.57%
2013年12月31日(監査済み)	-2.90%	-4.96%	4.44%
2012年12月31日 <sup>2</sup> (監査済み)	5.13%	4.13%	11.72%

<sup>1</sup>過去のパフォーマンスの数値は、サブファンドの将来のパフォーマンスを示唆するものではありません。

<sup>2</sup>サブファンドの会計期間は2012年7月11日(設定日)から2012年12月31日でした。

ChinaAMC CSI 300 Index ETF  
(ChinaAMC ETF Seriesのサブファンド)

## 分配金に関する開示(未監査)

2020年1月1日から2020年6月30日までの期間

	分配金 人民元	受益証券1口 当たり分配金 人民元
管理会社により宣言された分配金		
2020年7月27日(2020年7月31日に支払済み)	112,062,000	0.38
2019年7月25日(2019年7月31日に支払済み)	142,330,500	0.39

管理会社は、単独の裁量により、各期間において、管理会社の決定する時期に受益者に収益を分配すること、又はいずれの期間においても分配を行わない旨を決定することができます。受益者への分配金は、サブファンドの純利益から支払われます。

[次へ](#)

## ( 2 ) 投資有価証券明細表等

本香港ETFの投資有価証券明細表等については、「( 1 ) 資産及び負債の状況」の項目に記載した本香港ETFの未監査の投資ポートフォリオをご参照ください。

[次へ](#)

## 4 管理会社の概況

## (1) 資本金の額

(2020年7月31日現在)

資本金の額	200,000,000香港ドル (約2,700百万円)
発行済株式総数(個)	200,000,000

(注) 新会社条例(第622章)(2014年3月3日施行)により、授權資本の概念は廃止され、香港企業の株式は、すべて無額面株式となりました。したがって、発行する株式の総数は記載しておりません。

## (2) 事業の内容及び営業の状況

本香港ETFにおいて、資産運用会社の主たる目的は、資産運用業務を提供することです。

資産運用会社は、2020年7月31日現在、以下の41本の投資信託の運用を行っており、その管理投資信託財産額の概算は約5,674億円です。

(2020年7月31日現在)

設立国	種類別	ファンドの本数	純資産額の合計 (単位:米ドル)
ケイマン諸島	株式投資信託	5	97,389,948.77
	債券投資信託	4	1,631,833,856.25
	小計	9	1,729,223,805.02
香港	指数連動型上場投資信託(ETF)	13	2,186,099,524.65
	株式投資信託	3	35,009,772.43
	債券投資信託	5	438,553,083.99
	小計	21	2,659,662,381.07
ルクセンブルク	株式投資信託	3	155,580,684.07
	債券投資信託	8	879,980,876.36
	小計	11	1,035,561,560.43
合計		41	5,424,447,746.52 (約5,674億円)

## (3) その他

半期報告書提出日前6ヶ月以内において訴訟事件その他本香港ETF及び/又は資産運用会社に重要な影響を与えた又は与えることが予想される事実はありません。