

【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4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】 甘添
(Gan Tian)
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・友常法律事務所外国法共同事業
- 【事務連絡者氏名】 弁護士 瀧川 亮祐
同 河田 健太郎
- 【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・友常法律事務所外国法共同事業
- 【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4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

(2022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	13,658,480,920.00人民元 (269,072,074,124円)	92.30
現金、未収金及びその他の資産 (負債控除後)		1,139,768,252.00人民元 (22,453,434,564円)	7.70
合計 (純資産総額)		14,798,249,172.00人民元 (291,525,508,688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=19.70円(令和4年7月29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=17.15円(令和4年7月29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=134.61円(令和4年7月29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

2021年8月から2022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)
2021年8月末日	14,340,716,946.66	282,512,123,849	49.1541	968
2021年9月末日	14,728,641,278.89	290,154,233,194	49.7421	980
2021年10月末日	15,134,815,890.87	298,155,873,050	50.1734	988
2021年11月末日	14,890,439,261.16	293,341,653,445	49.3633	972
2021年12月末日	16,564,849,087.78	326,327,527,029	50.3797	992
2022年1月末日	15,770,120,127.28	310,671,366,507	46.5195	916
2022年2月末日	15,785,050,245.85	310,965,489,843	46.6668	919
2022年3月末日	11,685,586,391.86	230,206,051,920	42.9696	847
2022年4月末日	11,548,710,913.41	227,509,604,994	40.8876	805
2022年5月末日	11,364,058,553.40	223,871,953,502	41.6953	821
2022年6月末日	14,798,249,172.00	291,525,508,688	45.9502	905
2022年7月末日	13,249,924,066.21	261,023,504,104	42.6317	840
2022年8月12日	13,121,526,209.40	258,494,066,325	42.8808	845

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)
2021年8月末日	49.15	968
2021年9月末日	49.74	980
2021年10月末日	50.17	988
2021年11月末日	49.36	972
2021年12月末日	50.38	992
2022年1月末日	46.52	916
2022年2月末日	46.67	919
2022年3月末日	42.97	847
2022年4月末日	40.89	806
2022年5月末日	41.70	821
2022年6月末日	45.95	905
2022年7月末日	42.63	840
2022年8月12日	42.88	845

分配の推移

期別	(人民元)	(円)
2021年8月1日から2022年7月末日まで	0.37	7

収益率の推移

期別	収益率(%) ^(注)
2021年8月1日から2022年7月末日まで	-12.46

(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(2021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

2021年8月1日から2022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)
2021年8月1日から 2022年7月末日まで	114,150,000	113,850,000	310,800,000

(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=19.70円(令和4年7月29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。

(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
2022年6月30日

	2022年6月30日 (未監査)		2021年12月31日 (監査済み)	
	人民元	日本円	人民元	日本円
資産				
損益を通じて公正価値で				
測定される金融資産	13,658,480,920	269,072,074,124	16,485,209,161	324,758,620,472
未収利息	1,058,231	20,847,151	-	-
現金及び現金等価物	1,278,848,234	25,193,310,210	119,277,152	2,349,759,894
資産合計	<u>14,938,387,385</u>	<u>294,286,231,485</u>	<u>16,604,486,313</u>	<u>327,108,380,366</u>
負債				
スワップ契約に係る未払				
利息	851,652	16,777,544	-	-
証拠金勘定未払金	27,755,214	546,777,716	-	-
未払運用報酬	7,442,121	146,609,784	9,323,934	183,681,500
未払保護預かり、ファン ド事務管理及び受託者 報酬	1,725,574	33,993,808	6,131,486	120,790,274
参加ディーラーに対する 未払金	94,954,039	1,870,594,568	21,843,147	430,309,996
その他の未払金及び未払 費用	1,659,708	32,696,248	2,338,659	46,071,582
前受買付代金	5,749,905	113,273,129	-	-
負債合計	<u>140,138,213</u>	<u>2,760,722,797</u>	<u>39,637,226</u>	<u>780,853,352</u>
純資産				
受益者に帰属する純資産	<u>14,798,249,172</u>	<u>291,525,508,688</u>	<u>16,564,849,087</u>	<u>326,327,527,014</u>
負債及び純資産合計	<u>14,938,387,385</u>	<u>294,286,231,485</u>	<u>16,604,486,313</u>	<u>327,108,380,366</u>
発行済み受益証券数	<u>322,050,000</u>	<u>337,050,000</u>	<u>328,800,000</u>	<u>328,800,000</u>
1口あたり純資産価値	<u>45.9502</u>	<u>864.9325</u>	<u>50.3797</u>	<u>992.4803</u>

注：サブファンドの当半期報告書は2021年度の年次財務諸表において採用されていたものと同じ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

2022年1月1日から2022年6月30日の期間

	2022年1月1日から 2022年6月30日の期間 (未監査)		2021年1月1日から 2021年6月30日の期間 (未監査)	
	人民元	日本円	人民元	日本円
収益				
受取配当金	116,813,906	2,301,233,948	132,541,057	2,611,058,823
受取利息	1,770,642	34,881,647	95,830	1,887,851
その他の収益	491,297	9,678,551	-	-
	<u>119,075,845</u>	<u>2,345,794,146</u>	<u>132,636,887</u>	<u>2,612,946,674</u>
費用				
運用報酬	(46,896,335)	(923,857,800)	(58,046,657)	(1,143,519,143)
売買委託報酬及び取引手数料	(12,809,425)	(252,345,673)	(10,754,247)	(211,858,666)
保護預かり、ファンド事務管 理及び受託者報酬	(5,727,827)	(112,838,192)	(6,319,620)	(124,496,514)
監査報酬	(77,385)	(1,524,485)	(68,094)	(1,341,452)
インデックス・ライセンス・ フィー	(31,595)	(622,422)	(32,421)	(638,694)
データ・ライセンス・フィー	(2,678,191)	(52,760,362)	(3,316,541)	(65,335,857)
専門家報酬	(367,539)	(7,240,518)	(160,761)	(3,166,992)
スワップ契約に係る支払利息	(3,500,025)	(68,950,493)	-	-
その他の営業費用	(644,529)	(12,697,220)	(207,275)	(4,083,317)
	<u>(72,732,851)</u>	<u>(1,432,837,165)</u>	<u>(78,905,616)</u>	<u>(1,554,440,635)</u>
投資利益考慮前(損失)利益	46,342,994	912,956,981	53,731,271	1,058,506,039
投資(損失)利益				
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 現損失の正味変動	(1,258,782,109)	(24,798,007,547)	(526,710,234)	(10,376,191,610)
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(損失)利益	(363,112,081)	(7,153,307,996)	594,062,716	11,703,035,505
正味為替利益	3,809,805	75,053,159	-	-
正味投資(損失)利益	<u>(1,618,084,385)</u>	<u>(31,876,262,384)</u>	<u>67,352,482</u>	<u>1,326,843,895</u>
税引前(損失)利益	(1,571,741,391)	(30,963,305,403)	121,083,753	2,385,349,934
源泉所得税費用	(11,707,119)	(230,630,244)	(13,333,343)	(262,666,857)
包括利益合計	<u>(1,583,448,510)</u>	<u>(31,193,935,647)</u>	<u>107,750,410</u>	<u>2,122,683,077</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

2022年1月1日から2022年6月30日の期間

	2022年1月1日から 2022年6月30日の期間 (未監査)		2021年1月1日から 2021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	16,564,849,087	326,327,527,014	15,733,343,678	309,946,870,457
受益証券の発行	3,343,656,733	65,870,037,640	3,827,664,844	75,404,997,427
受益証券の買戻し	(3,526,808,138)	(69,478,120,319)	(1,687,251,805)	(33,238,860,559)
包括利益合計	<u>(1,583,448,510)</u>	<u>(31,193,935,647)</u>	<u>107,750,410</u>	<u>2,122,683,077</u>
期末残高	<u><u>14,798,249,172</u></u>	<u><u>291,525,508,688</u></u>	<u><u>17,981,507,127</u></u>	<u><u>354,235,690,402</u></u>

	2022年1月1日から 2022年6月30日の期間 (未監査) 受益証券数		2021年1月1日から 2021年6月30日の期間 (未監査) 受益証券数	
	期首残高	328,800,000		296,400,000
受益証券の期中発行数	76,350,000		71,850,000	
受益証券の期中買戻数	<u>(83,100,000)</u>		<u>(31,200,000)</u>	
期末残高	<u><u>322,050,000</u></u>		<u><u>337,050,000</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

2022年1月1日から2022年6月30日の期間

	2022年1月1日から 2022年6月30日の期間 (未監査)		2021年1月1日から 2021年6月30日の期間 (未監査)	
	人民元	日本円	人民元	日本円
営業活動によるキャッシュ・フロー				
税引前(損失)利益	(1,571,741,391)	(30,963,305,403)	121,083,753	2,385,349,934
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)	2,826,728,241	55,686,546,348	(2,243,815,469)	(44,203,164,739)
未収利息の増加	(1,058,231)	(20,847,151)	-	-
その他の未収金の増加	-	-	(100,841)	(1,986,568)
スワップ契約に係る未払利息の増加	851,652	16,777,544	-	-
証拠金勘定未払金の増加	27,755,214	546,777,716	-	-
未払運用報酬の(減少)増加	(1,881,813)	(37,071,716)	1,388,215	27,347,836
未払保護預かり、ファンド事務管理及び受託者報酬の(減少)増加	(4,405,912)	(86,796,466)	689,911	13,591,247
その他の未払金及び未払費用の減少	(678,951)	(13,375,334)	(787,532)	(15,514,380)
営業活動により生じた(に使用した)現金	1,275,568,809	25,128,705,538	(2,121,541,963)	(41,794,376,670)
支払税金	(11,707,119)	(230,630,244)	(13,333,343)	(262,666,857)
営業活動により生じた(に使用した)正味現金	1,263,861,690	24,898,075,294	(2,134,875,306)	(42,057,043,527)
財務活動によるキャッシュ・フロー				
受益証券発行による受取額	3,422,517,530	67,423,595,341	3,827,694,772	75,405,587,008
受益証券の買戻しに係る支払	(3,526,808,138)	(69,478,120,319)	(1,687,251,805)	(33,238,860,559)
財務活動(に使用した)より生じた正味現金	(104,290,608)	(2,054,524,978)	2,140,442,967	42,166,726,449
現金及び現金等価物の正味増加	1,159,571,082	22,843,550,316	5,567,661	109,682,922
現金及び現金等価物期首残高	119,277,152	2,349,759,894	116,641,605	2,297,839,619
現金及び現金等価物期末残高	1,278,848,234	25,193,310,210	122,209,266	2,407,522,541
現金及び現金等価物の内訳				
銀行預金	1,278,848,234	25,193,310,210	122,209,266	2,407,522,541
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)	105,106,787	2,070,603,704	119,208,632	2,348,410,050
受取利息(源泉税控除後)	712,411	14,034,497	94,912	1,869,766

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)

2022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 (%)
損益を通じて公正価値で測定される金融資産			
上場有価証券			
中国			
コミュニケーション・サービス			
37 Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd	851,086	18,069,292	0.12
China Mobile Ltd	289,900	17,538,546	0.12
China Satellite Communications Co Ltd	274,429	3,103,849	0.02
China Telecom Corp Ltd	3,488,100	13,010,773	0.09
China United Network Communications Ltd	11,919,759	41,242,740	0.28
Focus Media Information Technology Co Ltd	6,482,502	43,629,272	0.29
Mango Excellent Media Co Ltd	473,206	15,786,688	0.11
Zhejiang Century Huatong Group Co Ltd	2,857,835	13,775,021	0.09
一般消費財			
Beijing Roborock Technology Co Ltd	26,142	16,125,653	0.11
BYD Co Ltd	585,769	195,356,169	1.32
Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co Ltd	95,129	16,255,503	0.11
China Tourism Group Duty Free Corp Ltd	630,352	146,817,691	1.00
Chongqing Changan Automobile Co Ltd	3,189,919	55,261,169	0.37
Ecovacs Robotics Co Ltd	149,500	18,223,306	0.12
FAW Jiefang Group Co Ltd	599,700	5,601,605	0.04
Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	1,028,762	43,011,918	0.29
Great Wall Motor Co Ltd	794,221	29,419,078	0.20
Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	3,057,786	103,105,940	0.69
Guangzhou Automobile Group Co Ltd	1,420,938	21,655,026	0.15
Haier Smart Home Co Ltd	2,434,286	66,843,378	0.45
Huali Industrial Group Co Ltd	63,900	4,669,866	0.03
Huayu Automotive Systems Co Ltd	1,013,908	23,319,940	0.16
Huizhou Desay Sv Automotive Co Ltd	181,152	26,812,474	0.18
Midea Group Co Ltd	3,162,466	190,974,829	1.30
Offcn Education Technology Co Ltd	1,190,446	6,893,126	0.05
Oppein Home Group Inc	120,283	18,124,572	0.12
SAIC Motor Corp Ltd	3,002,154	53,470,678	0.36
Shandong Linglong Tyre Co Ltd	384,400	9,752,241	0.07
Shanghai Yuyuan Tourist Mart Group Co Ltd	1,002,263	9,461,197	0.06
Shenzhen Overseas Chinese Town Co Ltd	2,636,474	17,108,552	0.12
TCL Technology Group Corp	8,993,184	43,078,615	0.29
Zhejiang Supor Co Ltd	106,647	6,008,455	0.04

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)
2022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 (%)
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)			
中国(続き)			
生活必需品			
Anhui Gujing Distillery Co Ltd	108,111	26,987,751	0.18
Chongqing Brewery Co Ltd	157,358	23,069,253	0.16
DaShenLin Pharmaceutical Group Co Ltd	1,620	50,706	0.00
Eastroc Beverage Group Co Ltd	32,800	5,602,868	0.04
Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd	895,977	80,957,698	0.55
Guangdong Haid Group Co Ltd	542,101	32,528,816	0.22
Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd	1,117,287	32,735,934	0.22
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd	3,307,473	128,822,370	0.87
Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd	403,617	20,584,101	0.14
Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd	389,511	71,341,740	0.48
Kweichow Moutai Co Ltd	405,970	830,211,477	5.61
Luzhou Laojiao Co Ltd	473,803	116,812,446	0.79
Muyuan Foods Co Ltd	1,717,359	94,919,206	0.64
New Hope Liuhe Co Ltd	1,445,667	22,118,609	0.15
Shanghai Bairun Investment Holding Group Co Ltd	345,216	10,369,222	0.07
Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd	317,713	103,200,309	0.70
Tongwei Co Ltd	1,742,532	104,309,142	0.70
Tsingtao Brewery Co Ltd	225,345	23,419,367	0.16
Wens Foodstuffs Group Co Ltd	3,283,460	69,904,728	0.47
Wuliangye Yibin Co Ltd	1,253,403	253,085,148	1.71
Yihai Kerry Arawana Holdings Co Ltd	385,900	20,848,330	0.14
Yunnan Botanee Bio-Technology Group Co Ltd	58,484	12,722,864	0.09
エネルギー			
China Coal Energy Co Ltd	1,167,300	12,116,970	0.08
China Oilfield Services Ltd	383,514	5,349,881	0.04
China Petroleum & Chemical Corp	8,579,027	35,003,652	0.24
China Shenhua Energy Co Ltd	2,129,543	70,913,460	0.48
PetroChina Co Ltd	6,231,969	33,029,404	0.22
Shaanxi Coal Industry Co Ltd	2,487,618	52,684,341	0.36
Yankuang Energy Group Co Ltd	590,400	23,308,938	0.16
金融			
Agricultural Bank of China Ltd	20,494,889	61,895,555	0.42
Bank of Beijing Co Ltd	9,484,418	43,060,169	0.29
Bank of Chengdu Co Ltd	1,396,666	23,156,492	0.16
Bank of China Ltd	13,518,263	44,069,537	0.30
Bank of Communications Co Ltd	17,748,183	88,387,671	0.60

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)
2022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 (%)
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)			
中国(続き)			
金融(続き)			
Bank of Hangzhou Co Ltd	1,898,268	28,436,831	0.19
Bank of Jiangsu Co Ltd	7,582,707	53,986,936	0.36
Bank of Nanjing Co Ltd	3,306,606	34,450,991	0.23
Bank of Ningbo Co Ltd	2,557,566	91,588,013	0.62
Bank of Shanghai Co Ltd	6,384,309	41,817,838	0.28
China CITIC Bank Corp Ltd	1,977,182	9,391,803	0.06
China Construction Bank Corp	4,312,740	26,135,200	0.18
China Everbright Bank Co Ltd	10,607,302	31,928,499	0.22
China Galaxy Securities Co Ltd	827,277	7,999,808	0.05
China International Capital Corp Ltd	379,208	16,871,549	0.11
China Life Insurance Co Ltd	1,065,305	33,110,818	0.22
China Merchants Bank Co Ltd	7,992,131	337,259,361	2.28
China Merchants Securities Co Ltd	2,387,371	34,403,310	0.23
China Minsheng Banking Corp Ltd	15,924,873	59,241,298	0.40
China Pacific Insurance Group Co Ltd	2,203,364	51,845,838	0.35
China Zheshang Bank Co Ltd	5,350,900	17,765,508	0.12
CITIC Securities Co Ltd	6,256,820	135,524,137	0.92
CSC Financial Co Ltd	832,930	24,080,952	0.16
East Money Information Co Ltd	6,828,722	173,448,256	1.18
Everbright Securities Co Ltd	1,252,052	19,733,162	0.13
Founder Securities Co Ltd	2,631,904	17,660,560	0.12
GF Securities Co Ltd	1,895,117	35,438,659	0.24
Guosen Securities Co Ltd	1,851,555	17,719,951	0.12
Guotai Junan Securities Co Ltd	2,893,435	43,981,224	0.30
Haitong Securities Co Ltd	6,196,052	60,784,512	0.41
Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd	140,349	13,495,213	0.09
Hongta Securities Co Ltd	606,872	5,541,001	0.04
Huatai Securities Co Ltd	3,801,084	53,975,978	0.36
Huaxia Bank Co Ltd	3,949,155	20,574,907	0.14
Industrial & Commercial Bank of China Ltd	22,636,918	107,978,139	0.73
Industrial Bank Co Ltd	9,391,552	186,891,222	1.27
Industrial Securities Co Ltd	3,427,351	24,163,618	0.16
New China Life Insurance Co Ltd	543,395	17,492,123	0.12
Orient Securities Co Ltd/China	3,350,263	34,206,922	0.23
People's Insurance Co Group of China Ltd/The	2,047,589	10,361,075	0.07
Ping An Bank Co Ltd	6,267,326	93,881,087	0.63
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	6,998,308	326,764,687	2.21
Postal Savings Bank of China Co Ltd	6,985,222	37,649,457	0.25
SDIC Capital Co Ltd	1,645,417	10,465,233	0.07

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)
2022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 (%)
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)			
中国(続き)			
金融(続き)			
Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd	7,582,346	60,735,750	0.41
Shanghai Rural Commercial Bank Co Ltd	619,000	3,881,156	0.03
Shenwan Hongyuan Group Co Ltd	5,796,864	24,869,073	0.17
Zheshang Securities Co Ltd	1,243,867	14,155,967	0.10
Zhongtai Securities Co Ltd	1,782,100	13,633,682	0.09
ヘルスケア			
Aier Eye Hospital Group Co Ltd	1,748,773	78,289,913	0.53
Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd	97,556	28,193,576	0.19
Beijing Tiantan Biological Products Corp Ltd	437,691	10,627,655	0.07
Beijing Tongrentang Co Ltd	437,208	23,119,589	0.16
Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co Ltd	115,961	18,010,422	0.12
Bloomage Biotechnology Corp Ltd	65,721	9,344,858	0.06
Changchun High & New Technology Industry Group Inc	207,656	48,473,920	0.33
Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd	514,227	57,088,002	0.38
Gan & Lee Pharmaceuticals Co Ltd	150,660	7,227,183	0.05
Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd	447,154	14,125,634	0.10
Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd	182,215	15,041,960	0.10
Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd	340,450	38,966,970	0.26
Huadong Medicine Co Ltd	567,619	25,633,541	0.17
Hualan Biological Engineering Inc	693,770	15,818,243	0.11
Imeik Technology Development Co Ltd	59,627	35,772,976	0.24
Jafron Biomedical Co Ltd	310,047	15,779,191	0.11
Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd	2,885,069	107,008,280	0.72
Lepu Medical Technology Beijing Co Ltd	812,359	15,085,274	0.10
Ovctek China Inc	332,628	19,024,586	0.13
Pharmaron Beijing Co Ltd	321,768	30,641,100	0.21
Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	779,740	34,374,060	0.23
Shanghai RAAS Blood Products Co Ltd	2,586,588	15,339,107	0.10
Shenzhen Kangtai Biological Products Co Ltd	429,517	19,406,873	0.13
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	314,955	98,642,405	0.66
Topchoice Medical Corp	146,509	25,558,734	0.17
Walvax Biotechnology Co Ltd	1,028,339	49,761,578	0.34
WuXi AppTec Co Ltd	1,322,860	137,562,553	0.93
Yunnan Baiyao Group Co Ltd	463,112	27,967,354	0.19
Zhangzhou Pientzhuang Pharmaceutical Co Ltd	195,004	69,564,156	0.47
Zhejiang NHU Co Ltd	1,195,158	27,262,251	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)

2022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 (%)
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)			
中国(続き)			
工業			
AECC Aviation Power Co Ltd	852,150	38,779,034	0.26
Air China Ltd	1,912,800	22,207,068	0.15
AVIC Shenyang Aircraft Co Ltd	504,567	30,501,130	0.21
AVIC Xi'an Aircraft Industry Group Co Ltd	881,839	26,710,546	0.18
Beijing New Building Materials PLC	647,364	22,411,312	0.15
Beijing-Shanghai High Speed Railway Co Ltd	12,685,350	63,682,405	0.43
China Communications Construction Co Ltd	2,262,798	20,997,410	0.14
China CSSC Holdings Ltd	1,141,700	21,670,128	0.15
China Eastern Airlines Corp Ltd	3,515,012	19,297,648	0.13
China Energy Engineering Corp Ltd	8,338,000	19,761,204	0.13
China National Chemical Engineering Co Ltd	2,350,468	22,118,789	0.15
China Railway Construction Corp Ltd	2,947,521	23,285,145	0.16
China Railway Group Ltd	6,591,240	40,469,210	0.27
China Shipbuilding Industry Co Ltd	7,308,390	27,114,624	0.18
China Southern Airlines Co Ltd	3,244,457	23,718,053	0.16
China State Construction Engineering Corp Ltd	13,546,817	72,067,797	0.49
Contemporary Amperex Technology Co Ltd	901,471	481,392,113	3.26
COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd	4,069,294	56,562,721	0.38
CRRC Corp Ltd	7,808,474	40,604,896	0.27
Daqin Railway Co Ltd	3,827,760	25,225,124	0.17
Eve Energy Co Ltd	734,273	71,594,195	0.48
Ginlong Technologies Co Ltd	98,650	21,015,132	0.14
Gongniu Group Co Ltd	54,378	8,315,921	0.06
Gotion High-tech Co Ltd	638,800	29,129,172	0.20
Guangdong Kinlong Hardware Products Co Ltd	86,128	11,168,376	0.08
Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd	548,228	18,162,924	0.12
Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd	343,275	21,184,884	0.14
Metallurgical Corp of China Ltd	4,578,833	16,025,514	0.11
NARI Technology Co Ltd	2,152,780	58,125,513	0.39
Ningbo Ronbay New Energy Technology Co Ltd	175,988	22,781,250	0.15
Power Construction Corp of China Ltd	4,895,961	38,529,153	0.26
Sany Heavy Industry Co Ltd	3,819,486	72,797,600	0.49
SF Holding Co Ltd	1,264,553	70,579,148	0.48
Shanghai International Airport Co Ltd	618,473	35,067,780	0.24
Shanghai International Port Group Co Ltd	2,092,129	12,197,154	0.08
Shanghai M&G Stationery Inc	234,643	13,158,420	0.09
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	1,190,050	78,386,904	0.53
Spring Airlines Co Ltd	232,234	13,551,352	0.09

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)

2022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 (%)
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)			
中国(続き)			
工業(続き)			
Sungrow Power Supply Co Ltd	670,362	65,856,077	0.44
Sunwoda Electronic Co Ltd	777,900	24,581,813	0.17
Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd	48,600	23,850,249	0.16
TBEA Co Ltd	2,437,179	66,743,666	0.45
Weichai Power Co Ltd	3,485,738	43,467,923	0.29
Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	704,926	44,537,725	0.30
Wuxi Shangji Automation Co Ltd	125,520	19,579,865	0.13
XCMG Construction Machinery Co Ltd	3,515,269	18,947,470	0.13
Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd	1,778,805	26,326,704	0.18
Yunda Holding Co Ltd	924,508	15,772,561	0.11
Zhejiang Chint Electrics Co Ltd	682,525	24,420,225	0.17
Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd	1,161,490	31,916,475	0.22
Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd	3,181,951	19,600,765	0.13
インフォメーション・テクノロジー			
360 Security Technology Inc	1,836,913	15,650,739	0.11
Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China	238,200	27,810,272	0.19
Anker Innovations Technology Co Ltd	107,100	7,102,589	0.05
Avary Holding Shenzhen Co Ltd	443,383	13,394,623	0.09
AVIC Jonhon Optron Technology Co Ltd	515,654	32,652,519	0.22
Beijing Kingsoft Office Software Inc	121,280	23,908,504	0.16
BOE Technology Group Co Ltd	24,228,235	95,462,963	0.64
Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd	742,903	22,359,452	0.15
China Greatwall Technology Group Co Ltd	1,241,786	13,436,344	0.09
China Resources Microelectronics Ltd	346,620	20,475,365	0.14
Dawning Information Industry Co Ltd	758,984	22,023,054	0.15
Flat Glass Group Co Ltd	335,788	12,792,393	0.09
Foxconn Industrial Internet Co Ltd	2,545,602	25,049,393	0.17
Gigadevice Semiconductor Beijing Inc	430,815	61,263,392	0.41
Glodon Co Ltd	612,057	33,320,251	0.22
GoerTek Inc	1,542,963	51,842,623	0.35
Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co Ltd	213,102	16,050,675	0.11
Hangzhou First Applied Material Co Ltd	349,224	22,879,871	0.15
Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd	3,048,304	110,351,407	0.74
Hangzhou Silan Microelectronics Co Ltd	553,100	28,758,311	0.19
Hundsun Technologies Inc	758,272	33,015,204	0.22
Iflytek Co Ltd	1,197,909	49,382,285	0.33
Ingenic Semiconductor Co Ltd	126,200	13,408,949	0.09

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)
2022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 (%)
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)			
中国(続き)			
インフォメーション・テクノロジー(続き)			
Inspur Electronic Information Industry Co Ltd	649,552	17,199,268	0.12
JA Solar Technology Co Ltd	603,148	47,588,267	0.32
JCET Group Co Ltd	906,311	24,470,927	0.17
Lens Technology Co Ltd	1,272,773	14,089,775	0.10
Lingyi iTech Guangdong Co	1,801,361	9,043,189	0.06
LONGi Green Energy Technology Co Ltd	3,916,524	260,924,651	1.77
Luxshare Precision Industry Co Ltd	3,200,883	108,152,045	0.73
Maxscend Microelectronics Co Ltd	209,251	28,248,809	0.19
Montage Technology Co Ltd	290,842	17,620,010	0.12
National Silicon Industry Group Co Ltd	690,015	15,856,857	0.11
NAURA Technology Group Co Ltd	171,102	47,415,139	0.32
Qi An Xin Technology Group Inc	178,400	9,954,933	0.07
Sangfor Technologies Inc	164,900	17,114,120	0.12
Semiconductor Manufacturing International Corp	1,243,430	56,167,270	0.38
SG Micro Corp	162,100	29,506,101	0.20
Shanghai Baosight Software Co Ltd	291,108	15,893,142	0.11
Shengyi Technology Co Ltd	751,722	12,771,892	0.09
Shennan Circuits Co Ltd	134,108	12,567,664	0.09
Shenzhen Goodix Technology Co Ltd	153,391	9,499,012	0.06
Shenzhen Transsion Holdings Co Ltd	159,663	14,246,597	0.10
StarPower Semiconductor Ltd	48,068	18,548,496	0.12
TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd	1,461,197	86,046,786	0.58
Thunder Software Technology Co Ltd	216,909	28,305,245	0.19
Trina Solar Co Ltd	698,139	45,554,825	0.31
Unigroup Guoxin Microelectronics Co Ltd	272,600	51,718,586	0.35
Unisplendour Corp Ltd	908,106	17,616,997	0.12
Will Semiconductor Co Ltd Shanghai	341,467	59,080,805	0.40
Wingtech Technology Co Ltd	481,726	40,994,668	0.28
Wuhan Guide Infrared Co Ltd	841,404	10,829,242	0.07
Yealink Network Technology Corp Ltd	228,947	17,435,405	0.12
Yonyou Network Technology Co Ltd	1,094,785	23,767,340	0.16
Zhejiang Dahua Technology Co Ltd	1,157,022	18,998,939	0.13
Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd	412,864	27,904,243	0.19
ZTE Corp	2,045,039	52,212,745	0.35
素材			
Aluminum Corp of China Ltd	5,044,445	23,961,476	0.16
Anhui Conch Cement Co Ltd	1,548,313	54,624,963	0.37

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)
2022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 (%)
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)			
中国(続き)			
素材(続き)			
Baoshan Iron & Steel Co Ltd	5,720,149	34,435,827	0.23
Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd	1,300,927	66,953,950	0.45
Cathay Biotech Inc	83,859	9,377,666	0.06
China Jushi Co Ltd	1,549,629	26,979,054	0.18
China Northern Rare Earth Group High-Tech Co Ltd	1,403,908	49,359,003	0.33
Citic Pacific Special Steel Group Co Ltd	644,812	12,993,295	0.09
CMOC Group Ltd	4,534,460	25,983,121	0.18
CNGR Advanced Material Co Ltd	120,300	14,903,669	0.10
Ganfeng Lithium Co Ltd	517,951	77,016,878	0.52
Guangzhou Tinci Materials Technology Co Ltd	869,526	53,966,663	0.36
Hengli Petrochemical Co Ltd	1,360,558	30,258,003	0.20
Hengyi Petrochemical Co Ltd	1,415,289	14,874,480	0.10
Hoshine Silicon Industry Co Ltd	140,500	16,571,853	0.11
Huaфон Chemical Co Ltd	959,500	8,098,462	0.06
Inner Mongolia BaoTou Steel Union Co Ltd	14,634,193	34,391,822	0.23
Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co Ltd	2,161,241	10,546,098	0.07
Jiangsu Eastern Shenghong Co Ltd	1,139,803	19,272,567	0.13
Jiangxi Copper Co Ltd	661,076	11,787,205	0.08
LB Group Co Ltd	921,621	18,479,354	0.13
Ningxia Baofeng Energy Group Co Ltd	1,415,397	20,736,094	0.14
Qinghai Salt Lake Industry Co Ltd	2,808,800	84,155,092	0.57
Rongsheng Petrochemical Co Ltd	1,940,711	29,865,946	0.20
Satellite Chemical Co Ltd	777,896	20,108,619	0.14
Shandong Gold Mining Co Ltd	1,163,043	21,586,248	0.15
Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd	958,472	27,986,751	0.19
Shandong Nanshan Aluminum Co Ltd	4,597,141	16,963,971	0.11
Shanghai Putailai New Energy Technology Co Ltd	448,425	37,850,688	0.26
Tianqi Lithium Corp	666,712	83,207,305	0.56
Wanhua Chemical Group Co Ltd	1,014,650	98,409,859	0.66
Xinjiang Tianshan Cement Co Ltd	391,700	4,818,012	0.03
Yunnan Energy New Material Co Ltd	347,522	87,032,993	0.59
Zangge Mining Co Ltd	294,000	9,684,723	0.07
Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd	820,729	78,483,419	0.53
Zhejiang Longsheng Group Co Ltd	1,668,401	16,984,335	0.11
Zhongjin Gold Corp Ltd	1,865,731	13,787,916	0.09
Zijin Mining Group Co Ltd	9,312,566	86,886,075	0.59

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)
2022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 (%)
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)			
中国(続き)			
不動産			
China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd	2,037,302	27,357,965	0.18
China Vanke Co Ltd	4,396,481	90,113,978	0.61
Gemdale Corp	1,729,397	23,240,509	0.16
Greenland Holdings Corp Ltd	2,465,109	9,761,472	0.07
Poly Developments and Holdings Group Co Ltd	4,638,147	80,978,654	0.55
Seazen Holdings Co Ltd	585,132	14,878,704	0.10
公益事業			
CGN Power Co Ltd	7,578,700	21,220,713	0.14
China Longyuan Power Group Corp Ltd	108,600	2,362,881	0.02
China National Nuclear Power Co Ltd	6,042,231	41,450,870	0.28
China Three Gorges Renewables Group Co Ltd	5,517,300	34,705,048	0.23
China Yangtze Power Co Ltd	7,342,685	169,761,860	1.15
GD Power Development Co Ltd	5,725,452	22,388,088	0.15
Huaneng Lancang River Hydropower Inc	1,161,600	8,119,973	0.06
Huaneng Power International Inc	2,815,198	19,820,010	0.13
SDIC Power Holdings Co Ltd	1,907,670	20,030,838	0.14

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)

2022年6月30日現在

	ポジション	原資産	カウンター パーティー	契約	市場価値 人民元	対純資産 価値比率 (%)
<u>損益を通じて公正価値 で測定される金融資産 (続き)</u>						
<u>トータルリターン スワップ契約</u>						
Total Return Swap (JPM)	Long	CSI 300 Index	JP Morgan Broking Hong Kong Ltd	98,000	54,576,200	0.37
Total Return Swap (CGML)	Long	CSI 300 Index	Citigroup Global Markets Limited	100,000	53,527,702	0.36
投資合計(公正価値)					<u>13,658,480,920</u>	<u>92.30</u>
投資合計(取得原価)					<u>12,827,762,233</u>	

[次へ](#)

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)
2022年1月1日から2022年6月30日までの期間

投資	2022年	コーポレート ・アクション	売却	2022年
	1月1日 現在保有残高			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				
上場有価証券				
360 Security Technology Inc	2,116,613	469,200	-	1,836,913
37 Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd	992,329	206,457	-	851,086
Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China	185,520	115,880	-	238,200
AECC Aviation Power Co Ltd	989,345	207,805	-	852,150
Agricultural Bank of China Ltd	26,044,289	5,596,700	-	20,494,889
Aier Eye Hospital Group Co Ltd	2,002,773	454,500	-	1,748,773
Air China Ltd	2,215,400	488,300	-	1,912,800
Aluminum Corp of China Ltd	5,826,445	1,300,300	-	5,044,445
Anhui Conch Cement Co Ltd	1,778,413	403,600	-	1,548,313
Anhui Gujing Distillery Co Ltd	94,711	76,800	-	108,111
Anker Innovations Technology Co Ltd	123,600	54,900	-	107,100
Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd	112,156	56,800	-	97,556
Autobio Diagnostics Co Ltd	177,644	30,400	-	-
Avary Holding Shenzhen Co Ltd	510,283	101,800	-	443,383
AVIC Jonhon Optronic Technology Co Ltd	410,596	119,060	129,998	515,654
AVIC Shenyang Aircraft Co Ltd	436,599	212,568	-	504,567
AVIC Xi'an Aircraft Industry Group Co Ltd	1,032,839	232,800	-	881,839
Bank of Beijing Co Ltd	10,977,245	2,436,973	-	9,484,418
Bank of Chengdu Co Ltd	1,608,966	356,300	-	1,396,666
Bank of China Ltd	15,627,063	3,489,900	-	13,518,263
Bank of Communications Co Ltd	20,385,483	4,661,000	-	17,748,183
Bank of Hangzhou Co Ltd	2,199,300	487,268	-	1,898,268
Bank of Jiangsu Co Ltd	8,767,207	1,943,300	-	7,582,707
Bank of Nanjing Co Ltd	3,713,726	843,480	-	3,306,606
Bank of Ningbo Co Ltd	2,942,561	661,405	-	2,557,566
Bank of Shanghai Co Ltd	7,370,838	1,661,171	-	6,384,309
Baoshan Iron & Steel Co Ltd	6,606,449	1,480,200	-	5,720,149
Beijing Kingsoft Office Software Inc	139,243	55,001	-	121,280
Beijing New Building Materials PLC	744,364	152,700	-	647,364
Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd	1,311,069	423,958	-	1,300,927

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)
2022年1月1日から2022年6月30日までの期間

投資(続き)	2022年	取得	コーポレート ・アクション	売却	2022年
	1月1日 現在保有残高				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)					
Beijing Roborock Technology Co Ltd	25,371	70,032	-	69,261	26,142
Beijing Tiantan Biological Products Corp Ltd	503,591	101,800	-	167,700	437,691
Beijing Tongrentang Co Ltd	502,990	101,718	-	167,500	437,208
Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co Ltd	93,980	59,805	28,376	66,200	115,961
Beijing-Shanghai High Speed Railway Co Ltd	14,566,550	3,330,000	-	5,211,200	12,685,350
Betta Pharmaceuticals Co Ltd	187,620	29,132	-	216,752	-
BGI Genomics Co Ltd	187,111	29,200	-	216,311	-
Bloomage Biotechnology Corp Ltd	83,130	58,791	-	76,200	65,721
BOC International China Co Ltd	1,035,920	132,900	-	1,168,820	-
BOE Technology Group Co Ltd	22,261,435	9,306,400	-	7,339,600	24,228,235
BYD Co Ltd	672,979	152,690	-	239,900	585,769
Caitong Securities Co Ltd	1,855,036	300,340	419,020	2,574,396	-
Cathay Biotech Inc	-	93,496	-	9,637	83,859
CGN Power Co Ltd	8,765,400	1,948,900	-	3,135,600	7,578,700
Changchun High & New Technology Industry Group Inc	239,908	50,848	-	83,100	207,656
Changjiang Securities Co Ltd	2,870,395	379,509	-	3,249,904	-
Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co Ltd	109,350	57,179	-	71,400	95,129
Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd	883,874	199,229	-	340,200	742,903
China CITIC Bank Corp Ltd	2,267,282	533,400	-	823,500	1,977,182
China Coal Energy Co Ltd	1,358,900	291,600	-	483,200	1,167,300
China Communications Construction Co Ltd	2,615,498	589,100	-	941,800	2,262,798
China Construction Bank Corp	4,977,200	1,113,740	-	1,778,200	4,312,740
China CSSC Holdings Ltd	1,326,400	289,400	-	474,100	1,141,700
China Eastern Airlines Corp Ltd	4,059,712	912,300	-	1,457,000	3,515,012
China Energy Engineering Corp Ltd	9,611,300	2,167,800	-	3,441,100	8,338,000
China Everbright Bank Co Ltd	12,267,502	2,730,300	-	4,390,500	10,607,302
China Galaxy Securities Co Ltd	949,977	205,600	-	328,300	827,277

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)
2022年1月1日から2022年6月30日までの期間

投資(続き)	2022年		コーポレート ・アクション	2022年	
	1月1日 現在保有残高	取得		売却	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)					
China Greatwall Technology Group Co Ltd	1,308,786	325,800	-	392,800	1,241,786
China International Capital Corp Ltd	236,908	217,600	-	75,300	379,208
China Jushi Co Ltd	1,779,772	403,757	-	633,900	1,549,629
China Life Insurance Co Ltd	1,239,028	283,677	-	457,400	1,065,305
China Longyuan Power Group Corp Ltd	-	108,600	-	-	108,600
China Merchants Bank Co Ltd	9,194,252	2,109,679	-	3,311,800	7,992,131
China Merchants Securities Co Ltd	2,750,926	616,245	-	979,800	2,387,371
China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd	2,351,602	534,500	-	848,800	2,037,302
China Minsheng Banking Corp Ltd	18,423,273	4,101,100	-	6,599,500	15,924,873
China Mobile Ltd	-	289,900	-	-	289,900
China National Chemical Engineering Co Ltd	-	2,350,468	-	-	2,350,468
China National Nuclear Power Co Ltd	5,191,131	2,460,500	-	1,609,400	6,042,231
China Northern Rare Earth Group High-Tech Co Ltd	1,616,708	356,300	-	569,100	1,403,908
China Oilfield Services Ltd	439,214	101,800	-	157,500	383,514
China Pacific Insurance Group Co Ltd	2,537,364	571,900	-	905,900	2,203,364
China Petroleum & Chemical Corp	9,916,527	2,213,100	-	3,550,600	8,579,027
China Railway Construction Corp Ltd	3,404,421	748,400	-	1,205,300	2,947,521
China Railway Group Ltd	7,546,640	1,696,700	-	2,652,100	6,591,240
China Railway Signal & Communication Corp Ltd	1,923,459	243,179	-	2,166,638	-
China Resources Microelectronics Ltd	197,505	213,615	-	64,500	346,620
China Satellite Communications Co Ltd	335,629	66,600	-	127,800	274,429
China Shenhua Energy Co Ltd	2,444,233	556,310	-	871,000	2,129,543
China Shipbuilding Industry Co Ltd	8,452,390	1,888,200	-	3,032,200	7,308,390
China Southern Airlines Co Ltd	3,758,515	831,142	-	1,345,200	3,244,457
China State Construction Engineering Corp Ltd	15,551,417	3,556,600	-	5,561,200	13,546,817
China Telecom Corp Ltd	3,460,000	1,173,200	-	1,145,100	3,488,100
China Three Gorges Renewables Group Co Ltd	6,359,600	1,432,700	-	2,275,000	5,517,300

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)
2022年1月1日から2022年6月30日までの期間

投資(続き)	2022年		コーポレート ・アクション	2022年	
	1月1日 現在保有残高	取得		売却	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)					
China Tourism Group Duty Free Corp Ltd	723,255	157,197	-	250,100	630,352
China United Network Communications Ltd	13,788,608	3,068,251	-	4,937,100	11,919,759
China Vanke Co Ltd	5,049,971	1,158,410	-	1,811,900	4,396,481
China Yangtze Power Co Ltd	8,436,185	1,921,400	-	3,014,900	7,342,685
China Zheshang Bank Co Ltd	6,206,300	1,366,100	-	2,221,500	5,350,900
Chongqing Brewery Co Ltd	180,858	50,900	-	74,400	157,358
Chongqing Changan Automobile Co Ltd	2,829,978	656,191	718,250	1,014,500	3,189,919
Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd	596,063	142,364	-	224,200	514,227
Citic Pacific Special Steel Group Co Ltd	758,012	160,800	-	274,000	644,812
CITIC Securities Co Ltd	6,323,796	1,572,850	975,974	2,615,800	6,256,820
CMOC Group Ltd	5,235,260	1,175,400	-	1,876,200	4,534,460
CNGR Advanced Material Co Ltd	-	126,700	-	6,400	120,300
Contemporary Amperex Technology Co Ltd	1,040,366	244,205	-	383,100	901,471
COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd	4,691,951	1,047,543	-	1,670,200	4,069,294
CRRC Corp Ltd	9,022,374	2,010,300	-	3,224,200	7,808,474
CSC Financial Co Ltd	956,775	203,555	-	327,400	832,930
Daqin Railway Co Ltd	4,485,460	996,700	-	1,654,400	3,827,760
DaShenLin Pharmaceutical Group Co Ltd	233,439	29,200	1,720	262,739	1,620
Dawning Information Industry Co Ltd	869,142	203,542	-	313,700	758,984
East Money Information Co Ltd	6,135,321	1,742,277	960,924	2,009,800	6,828,722
Eastroc Beverage Group Co Ltd	48,100	63,800	-	79,100	32,800
Ecovacs Robotics Co Ltd	171,400	52,800	-	74,700	149,500
Eve Energy Co Ltd	843,685	200,288	-	309,700	734,273
Everbright Securities Co Ltd	1,456,052	326,900	-	530,900	1,252,052
FAW Jiefang Group Co Ltd	687,500	152,700	-	240,500	599,700
Flat Glass Group Co Ltd	382,688	101,800	-	148,700	335,788
Focus Media Information Technology Co Ltd	7,506,502	1,669,100	-	2,693,100	6,482,502
Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd	936,838	226,435	73,204	340,500	895,977
Founder Securities Co Ltd	3,051,699	675,905	-	1,095,700	2,631,904

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)
2022年1月1日から2022年6月30日までの期間

投資(続き)	2022年		コーポレート ・アクション	2022年	
	1月1日 現在保有残高	取得		売却	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)					
Foxconn Industrial Internet Co Ltd	2,950,502	655,300	-	1,060,200	2,545,602
Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	1,044,978	337,684	-	353,900	1,028,762
Gan & Lee Pharmaceuticals Co Ltd	127,760	79,500	-	56,600	150,660
Ganfeng Lithium Co Ltd	599,229	143,522	-	224,800	517,951
GD Power Development Co Ltd	6,619,052	1,495,700	-	2,389,300	5,725,452
Gemdale Corp	1,668,097	609,200	-	547,900	1,729,397
GF Securities Co Ltd	2,195,677	487,240	-	787,800	1,895,117
Gigadevice Semiconductor Beijing Inc	397,715	161,600	-	128,500	430,815
Ginlong Technologies Co Ltd	-	106,950	-	8,300	98,650
Glodon Co Ltd	701,226	152,631	-	241,800	612,057
GoerTek Inc	1,772,638	403,025	-	632,700	1,542,963
Gongniu Group Co Ltd	62,700	66,278	-	74,600	54,378
Gotion High-tech Co Ltd	-	638,800	-	-	638,800
Great Wall Motor Co Ltd	907,740	203,581	-	317,100	794,221
Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	3,510,486	807,400	-	1,260,100	3,057,786
Greenland Holdings Corp Ltd	2,836,909	643,900	-	1,015,700	2,465,109
Guangdong Haid Group Co Ltd	619,580	152,521	-	230,000	542,101
Guangdong Kinlong Hardware Products Co Ltd	99,120	54,208	-	67,200	86,128
Guangzhou Automobile Group Co Ltd	1,622,573	357,265	-	558,900	1,420,938
Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd	514,754	101,800	-	169,400	447,154
Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd	208,215	50,900	-	76,900	182,215
Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co Ltd	245,002	50,900	-	82,800	213,102
Guangzhou Tinci Materials Technology Co Ltd	425,183	267,160	334,083	156,900	869,526
Guosen Securities Co Ltd	2,143,355	477,900	-	769,700	1,851,555
Guotai Junan Securities Co Ltd	3,341,535	741,800	-	1,189,900	2,893,435
Haier Smart Home Co Ltd	2,811,917	639,869	-	1,017,500	2,434,286
Haitong Securities Co Ltd	7,164,652	1,601,100	-	2,569,700	6,196,052
Hangzhou First Applied Material Co Ltd	280,789	83,720	89,515	104,800	349,224

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)
2022年1月1日から2022年6月30日までの期間

投資(続き)	2022年		コーポレート ・アクション	2022年	
	1月1日 現在保有残高	取得		売却	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)					
Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd	3,467,113	806,591	-	1,225,400	3,048,304
Hangzhou Silan Microelectronics Co Ltd	-	553,100	-	-	553,100
Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd	391,050	101,800	-	152,400	340,450
Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd	635,420	152,608	-	239,800	548,228
Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd	1,287,783	297,504	-	468,000	1,117,287
Hengli Petrochemical Co Ltd	1,564,158	352,100	-	555,700	1,360,558
Hengyi Petrochemical Co Ltd	1,624,089	364,400	-	573,200	1,415,289
Hi think RoyalFlush Information Network Co Ltd	161,449	50,900	-	72,000	140,349
Hongta Securities Co Ltd	696,472	152,700	-	242,300	606,872
Hoshine Silicon Industry Co Ltd	122,500	74,300	-	56,300	140,500
Huadong Medicine Co Ltd	649,819	152,700	-	234,900	567,619
Huafon Chemical Co Ltd	1,036,000	272,700	-	349,200	959,500
Hualan Biological Engineering Inc	817,570	181,900	-	305,700	693,770
Huali Industrial Group Co Ltd	-	75,300	-	11,400	63,900
Huaneng Lancang River Hydropower Inc	1,333,900	303,000	-	475,300	1,161,600
Huaneng Power International Inc	3,266,098	726,000	-	1,176,900	2,815,198
Huatai Securities Co Ltd	3,817,684	1,235,000	-	1,251,600	3,801,084
Huaxia Bank Co Ltd	4,564,755	1,011,000	-	1,626,600	3,949,155
Huayu Automotive Systems Co Ltd	1,163,528	254,480	-	404,100	1,013,908
Huizhou Desay Sv Automotive Co Ltd	-	181,152	-	-	181,152
Humanwell Healthcare Group Co Ltd	721,265	87,600	-	808,865	-
Hundsun Technologies Inc	868,306	203,466	-	313,500	758,272
Iflytek Co Ltd	1,361,424	305,385	-	468,900	1,197,909
Imeik Technology Development Co Ltd	68,700	65,127	-	74,200	59,627
Industrial & Commercial Bank of China Ltd	25,998,568	5,951,550	-	9,313,200	22,636,918
Industrial Bank Co Ltd	10,799,931	2,470,221	-	3,878,600	9,391,552
Industrial Securities Co Ltd	3,972,551	876,000	-	1,421,200	3,427,351
Ingenic Semiconductor Co Ltd	-	132,300	-	6,100	126,200

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)
2022年1月1日から2022年6月30日までの期間

投資(続き)	2022年		コーポレート ・アクション	2022年	
	1月1日 現在保有残高	取得		売却	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)					
Inner Mongolia BaoTou Steel Union Co Ltd	16,898,693	3,769,500	-	6,034,000	14,634,193
Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co Ltd	2,500,676	559,065	-	898,500	2,161,241
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd	3,800,872	863,101	-	1,356,500	3,307,473
Inspur Electronic Information Industry Co Ltd	747,752	155,000	-	253,200	649,552
Intco Medical Technology Co Ltd	279,950	29,131	1,720	310,801	-
JA Solar Technology Co Ltd	471,500	126,229	155,819	150,400	603,148
Jafron Biomedical Co Ltd	365,228	90,819	-	146,000	310,047
JCET Group Co Ltd	920,411	283,100	-	297,200	906,311
Jiangsu Eastern Shenghong Co Ltd	1,077,803	407,100	-	345,100	1,139,803
Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd	391,675	101,800	-	150,200	343,275
Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd	3,324,440	758,229	-	1,197,600	2,885,069
Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd	463,217	101,800	-	161,400	403,617
Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd	446,568	101,743	-	158,800	389,511
Jiangxi Copper Co Ltd	768,619	163,057	-	270,600	661,076
Jiangxi Zhengbang Technology Co Ltd	1,178,864	159,500	-	1,338,364	-
Jonjee Hi-Tech Industrial And Commercial Holding Co Ltd	415,787	58,400	-	474,187	-
Juwei Food Co Ltd	268,960	29,200	-	298,160	-
Kingfa Sci & Tech Co Ltd	1,334,900	175,200	-	1,510,100	-
Kweichow Moutai Co Ltd	465,724	103,446	-	163,200	405,970
LB Group Co Ltd	882,921	329,600	-	290,900	921,621
Lens Technology Co Ltd	1,480,873	322,700	-	530,800	1,272,773
Lepu Medical Technology Beijing Co Ltd	932,259	203,600	-	323,500	812,359
Lingyi iTech Guangdong Co	2,093,961	456,600	-	749,200	1,801,361
LONGi Green Energy Technology Co Ltd	3,219,324	924,858	968,042	1,195,700	3,916,524
Luxshare Precision Industry Co Ltd	3,666,199	839,784	-	1,305,100	3,200,883
Luzhou Laojiao Co Ltd	540,903	109,600	-	176,700	473,803
Mango Excellent Media Co Ltd	558,806	125,200	-	210,800	473,206
Maxscend Microelectronics Co Ltd	174,697	50,860	78,094	94,400	209,251

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)
2022年1月1日から2022年6月30日までの期間

投資(続き)	2022年		コーポレート ・アクション	2022年	
	1月1日 現在保有残高	取得		売却	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)					
Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co Ltd	2,028,090	263,868	-	2,291,958	-
Metallurgical Corp of China Ltd	5,287,670	1,163,163	-	1,872,000	4,578,833
Midea Group Co Ltd	3,618,324	817,042	-	1,272,900	3,162,466
Montage Technology Co Ltd	338,797	74,703	-	122,658	290,842
Muyuan Foods Co Ltd	1,953,938	451,721	-	688,300	1,717,359
Nanjing Securities Co Ltd	1,650,418	206,800	-	1,857,218	-
NARI Technology Co Ltd	2,057,083	463,200	350,297	717,800	2,152,780
National Silicon Industry Group Co Ltd	559,660	297,655	-	167,300	690,015
NAURA Technology Group Co Ltd	195,902	50,900	-	75,700	171,102
New China Life Insurance Co Ltd	622,116	151,879	-	230,600	543,395
New Hope Liuhe Co Ltd	1,677,365	368,902	-	600,600	1,445,667
Ningbo Ronbay New Energy Technology Co Ltd	-	175,988	-	-	175,988
Ningxia Baofeng Energy Group Co Ltd	1,632,232	358,865	-	575,700	1,415,397
Offcn Education Technology Co Ltd	1,374,944	315,702	-	500,200	1,190,446
Oppein Home Group Inc	138,083	55,600	-	73,400	120,283
Orient Securities Co Ltd/China	3,096,535	843,959	643,169	1,233,400	3,350,263
Ovctek China Inc	383,528	97,500	-	148,400	332,628
People's Insurance Co Group of China Ltd/The	2,114,089	630,100	-	696,600	2,047,589
Perfect World Co Ltd/China	864,794	116,800	-	981,594	-
PetroChina Co Ltd	7,206,869	1,603,000	-	2,577,900	6,231,969
Pharmaron Beijing Co Ltd	197,900	103,818	94,750	74,700	321,768
Ping An Bank Co Ltd	7,202,316	1,655,110	-	2,590,100	6,267,326
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	8,043,298	1,834,610	-	2,879,600	6,998,308
Poly Developments and Holdings Group Co Ltd	5,323,232	1,213,915	-	1,899,000	4,638,147
Postal Savings Bank of China Co Ltd	8,062,422	1,804,200	-	2,881,400	6,985,222
Power Construction Corp of China Ltd	5,677,787	1,255,674	-	2,037,500	4,895,961
Qi An Xin Technology Group Inc	203,800	50,900	-	76,300	178,400
Qinghai Salt Lake Industry Co Ltd	-	2,808,800	-	-	2,808,800
Rongsheng Petrochemical Co Ltd	2,248,760	487,951	-	796,000	1,940,711

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)
2022年1月1日から2022年6月30日までの期間

投資(続き)	2022年	取得	コーポレート ・アクション	売却	2022年
	1月1日 現在保有残高				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)					
SAIC Motor Corp Ltd	3,470,759	783,495	-	1,252,100	3,002,154
Sangfor Technologies Inc	-	164,900	-	-	164,900
Sany Heavy Industry Co Ltd	4,408,615	988,771	-	1,577,900	3,819,486
Satellite Chemical Co Ltd	-	777,896	-	-	777,896
SDIC Capital Co Ltd	1,897,917	431,000	-	683,500	1,645,417
SDIC Power Holdings Co Ltd	2,215,062	487,208	-	794,600	1,907,670
Seazen Holdings Co Ltd	669,832	152,700	-	237,400	585,132
Semiconductor Manufacturing International Corp	1,445,441	326,743	-	528,754	1,243,430
SF Holding Co Ltd	1,462,553	344,300	-	542,300	1,264,553
SG Micro Corp	-	117,150	56,050	11,100	162,100
Shaanxi Coal Industry Co Ltd	2,875,109	639,909	-	1,027,400	2,487,618
Shandong Gold Mining Co Ltd	1,338,727	300,216	-	475,900	1,163,043
Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd	1,096,798	251,174	-	389,500	958,472
Shandong Linglong Tyre Co Ltd	503,200	101,800	-	220,600	384,400
Shandong Nanshan Aluminum Co Ltd	-	4,597,141	-	-	4,597,141
Shanghai Bairun Investment Holding Group Co Ltd	273,240	72,520	86,256	86,800	345,216
Shanghai Baosight Software Co Ltd	249,508	119,100	-	77,500	291,108
Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	893,789	203,551	-	317,600	779,740
Shanghai International Airport Co Ltd	709,973	152,700	-	244,200	618,473
Shanghai International Port Group Co Ltd	2,584,429	554,900	-	1,047,200	2,092,129
Shanghai Lingang Holdings Corp Ltd	706,030	87,600	-	793,630	-
Shanghai M&G Stationery Inc	270,743	50,900	-	87,000	234,643
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd	857,717	116,800	-	974,517	-
Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd	8,703,178	1,983,568	-	3,104,400	7,582,346
Shanghai Putailai New Energy Technology Co Ltd	256,709	89,467	199,949	97,700	448,425
Shanghai RAAS Blood Products Co Ltd	2,992,738	666,850	-	1,073,000	2,586,588

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)
2022年1月1日から2022年6月30日までの期間

投資(続き)	2022年		コーポレート ・アクション	2022年	
	1月1日 現在保有残高	取得		売却	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)					
Shanghai Rural Commercial Bank Co Ltd	-	619,000	-	-	619,000
Shanghai Yuyuan Tourist Mart Group Co Ltd	1,149,563	254,500	-	401,800	1,002,263
Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd	364,673	101,740	-	148,700	317,713
Shengyi Technology Co Ltd	858,622	203,600	-	310,500	751,722
Shennan Circuits Co Ltd	147,408	51,800	-	65,100	134,108
Shenwan Hongyuan Group Co Ltd	8,362,564	1,718,000	-	4,283,700	5,796,864
Shenzhen Goodix Technology Co Ltd	171,591	50,900	-	69,100	153,391
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	1,363,850	305,400	-	479,200	1,190,050
Shenzhen Kangtai Biological Products Co Ltd	303,705	83,209	139,203	96,600	429,517
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	363,400	94,755	-	143,200	314,955
Shenzhen Overseas Chinese Town Co Ltd	3,043,374	680,700	-	1,087,600	2,636,474
Shenzhen Transsion Holdings Co Ltd	181,315	51,472	-	73,124	159,663
Sinolink Securities Co Ltd	1,791,760	233,600	-	2,025,360	-
Songcheng Performance Development Co Ltd	1,169,197	146,000	-	1,315,197	-
Spring Airlines Co Ltd	267,634	50,900	-	86,300	232,234
StarPower Semiconductor Ltd	-	60,868	-	12,800	48,068
Sungrow Power Supply Co Ltd	769,962	167,000	-	266,600	670,362
Suning.com Co Ltd	2,770,352	371,200	-	3,141,552	-
Sunwoda Electronic Co Ltd	-	777,900	-	-	777,900
Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd	-	61,300	-	12,700	48,600
TBEA Co Ltd	-	2,437,179	-	-	2,437,179
TCL Technology Group Corp	10,418,694	2,310,990	-	3,736,500	8,993,184
TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd	1,684,698	395,499	-	619,000	1,461,197
Thunder Software Technology Co Ltd	-	216,909	-	-	216,909
Tianfeng Securities Co Ltd	3,221,040	423,910	-	3,644,950	-
Tianqi Lithium Corp	768,112	173,000	-	274,400	666,712
Tongwei Co Ltd	2,001,444	454,088	-	713,000	1,742,532
Topchoice Medical Corp	168,219	50,890	-	72,600	146,509

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)
2022年1月1日から2022年6月30日までの期間

投資(続き)	2022年	取得	コーポレート ・アクション	売却	2022年
	1月1日 現在保有残高				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)					
Trina Solar Co Ltd	617,354	277,385	-	196,600	698,139
Tsingtao Brewery Co Ltd	262,245	50,900	-	87,800	225,345
Unigroup Guoxin Microelectronics Co Ltd	312,800	57,800	-	98,000	272,600
Unisplendour Corp Ltd	1,063,906	232,800	-	388,600	908,106
Universal Scientific Industrial Shanghai Co Ltd	487,440	58,400	-	545,840	-
Walvax Biotechnology Co Ltd	1,161,339	254,500	-	387,500	1,028,339
Wanhua Chemical Group Co Ltd	1,164,038	259,012	-	408,400	1,014,650
Weichai Power Co Ltd	3,521,938	1,125,900	-	1,162,100	3,485,738
Wens Foodstuffs Group Co Ltd	3,298,205	1,074,155	-	1,088,900	3,283,460
Will Semiconductor Co Ltd Shanghai	388,835	102,932	-	150,300	341,467
Wingtech Technology Co Ltd	557,802	134,124	-	210,200	481,726
Winner Medical Co Ltd	67,900	40,580	-	108,480	-
Wuhan Guide Infrared Co Ltd	693,203	186,820	214,481	253,100	841,404
Wuliangye Yibin Co Ltd	1,444,327	341,976	-	532,900	1,253,403
WuXi AppTec Co Ltd	1,522,575	348,985	-	548,700	1,322,860
Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	818,166	193,060	-	306,300	704,926
Wuxi Shangji Automation Co Ltd	-	131,320	-	5,800	125,520
XCMG Construction Machinery Co Ltd	4,076,369	903,300	-	1,464,400	3,515,269
Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd	2,042,905	458,300	-	722,400	1,778,805
Xinjiang Tianshan Cement Co Ltd	-	391,700	-	-	391,700
Yankuang Energy Group Co Ltd	-	590,400	-	-	590,400
Yealink Network Technology Corp Ltd	263,770	50,877	-	85,700	228,947
Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd	262,785	29,193	-	291,978	-
Yihai Kerry Arawana Holdings Co Ltd	319,200	160,500	-	93,800	385,900
Yonghui Superstores Co Ltd	2,695,140	355,600	-	3,050,740	-
Yonyou Network Technology Co Ltd	1,214,441	278,544	-	398,200	1,094,785
Yunda Holding Co Ltd	862,808	349,200	-	287,500	924,508
Yunnan Baiyao Group Co Ltd	381,252	108,860	119,500	146,500	463,112
Yunnan Botanee Bio-Technology Group Co Ltd	-	70,284	-	11,800	58,484
Yunnan Energy New Material Co Ltd	398,867	101,755	-	153,100	347,522

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)
2022年1月1日から2022年6月30日までの期間

投資(続き)	2022年		コーポレート ・アクション	2022年	
	1月1日 現在保有残高	取得		売却	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)					
Zangge Mining Co Ltd	-	294,000	-	-	294,000
Zhangzhou Pientzehuang Pharmaceutical Co Ltd	223,404	50,900	-	79,300	195,004
Zhejiang Century Huatong Group Co Ltd	3,315,335	727,000	-	1,184,500	2,857,835
Zhejiang Chint Electrics Co Ltd	804,125	181,900	-	303,500	682,525
Zhejiang Dahua Technology Co Ltd	1,332,071	300,251	-	475,300	1,157,022
Zhejiang Dingli Machinery Co Ltd	183,380	29,200	-	212,580	-
Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd	723,723	188,320	170,286	261,600	820,729
Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd	473,800	101,764	-	162,700	412,864
Zhejiang Longsheng Group Co Ltd	1,931,001	434,600	-	697,200	1,668,401
Zhejiang NHU Co Ltd	1,143,598	287,309	176,751	412,500	1,195,158
Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd	1,330,890	305,400	-	474,800	1,161,490
Zhejiang Supor Co Ltd	122,997	54,950	-	71,300	106,647
Zheshang Securities Co Ltd	1,146,500	470,567	-	373,200	1,243,867
Zhongjin Gold Corp Ltd	2,150,331	484,100	-	768,700	1,865,731
Zhongtai Securities Co Ltd	2,060,700	446,400	-	725,000	1,782,100
Zijin Mining Group Co Ltd	10,697,166	2,452,100	-	3,836,700	9,312,566
Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd	3,686,841	821,210	-	1,326,100	3,181,951
ZTE Corp	2,362,839	538,200	-	856,000	2,045,039
トータルリターンスワップ契約					
Total Return Swap (JPM)	-	98,000	-	-	98,000
Total Return Swap (CGML)	-	100,000	-	-	100,000

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)

2022年1月1日から2022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
2022年6月30日現在(未監査)	14,798,249,172	45.9502
2021年12月31日現在(監査済み)	16,564,849,087	50.3797
2020年12月31日現在(監査済み)	15,733,343,678	53.0815
2019年12月31日現在(監査済み)	17,382,025,714	41.7586

2. 1口当たり最高発行価格及び最低償還価格¹

	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		
2022年6月30日(未監査)	50.1430	38.5126
2021年12月31日(監査済み)	59.0817	48.4918
2020年12月31日(監査済み)	53.0815	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 ² (監査済み)	24.9664	21.1203

¹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。

²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)パフォーマンス記録(未監査)(続き)
2022年1月1日から2022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¹

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。

以下の日付に終了した期間/年度	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 ター (2012年7月 17日以降)	サブファンドの 香港ドルカウ ター (2012年10月 26日以降)
2022年6月30日(未監査)	130.06%	105.69%	107.86%
2021年12月31日(監査済み)	149.33%	125.30%	136.97%
2020年12月31日(監査済み)	160.00%	134.19%	140.13%
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 ² (監査済み)	5.13%	4.13%	11.72%

¹ 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。

² 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)

2022年1月1日から2022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		
2022年7月25日(2022年7月29日に支払済み)	115,884,000	0.37
2021年7月26日(2021年7月30日に支払済み)	96,255,000	0.30

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

(2022年7月29日現在)

資本金の額	600,000,000香港ドル (約10,290百万円)
発行済株式総数(個)	600,000,000

(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、2022年7月29日現在、以下の56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6,249億円です。

(2022年7月29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	8	75,888,316.75
	債券投資信託	5	889,562,282.83
	小計	13	965,450,599.58
香港	指数連動型上場投資信託 (ETF)	20	2,981,644,422.80
	株式投資信託	3	33,386,677.25
	債券投資信託	7	526,518,383.51
	バランス・ファンド	1	-
	小計	31	3,541,549,483.56
ルクセンブルク	株式投資信託	4	92,291,432.11
	債券投資信託	8	42,904,397.62
	小計	12	135,195,829.73
合計		56	4,642,195,912.87 (約6,249億円)

(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。