平成27年3月18日

各　　位

会社名　　日興アセットマネジメント株式会社
（管理会社コード：13084　）
代表者名　代表取締役　村上 雅彦
問合せ先　事務企画管理部　　中田 眞帆
（TEL　03 － 6447 － 6235 ）

上場ETF（管理会社：日興アセットマネジメント）に関する日々の開示事項

日興アセットマネジメント株式会社を管理会社として上場するETF銘柄について、以下のとおり平成27年3月17日現在の状況をご報告します。

上場 ETF 銘柄（25銘柄）

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	上場インデックスファンド225	1330	東
2	上場インデックスファンドTOPIX	1308	東
3	上場インデックスファンドS＆P日本新興株100	1314	東
4	上場インデックスファンドTOPIX100日本大型株	1316	東
5	上場インデックスファンドTOPIX　Mid400日本中型株	1317	東
6	上場インデックスファンドTOPIX　Small日本小型株	1318	東
7	上場インデックスファンド中国A株（パンダ）CSI300	1322	東
8	上場インデックスファンドJリート（東証REIT指数）隔月分配型	1345	東
9	上場インデックスファンドFTSE日本グリーンチップ35	1347	東
10	上場インデックスファンド海外債券（Citi WGBI）毎月分配型	1677	東
11	上場インデックスファンド海外先進国株式 （MSCI-KOKUSAI）	1680	東
12	上場インデックスファンド海外新興国株式 （MSCIエマージング）	1681	東
13	上場インデックスファンド日本高配当（東証配当フォーカス100）	1698	東
14	上場インデックスファンド日本株式（MSCIジャパン）	1544	東
15	上場インデックスファンド米国株式（S&P500）	1547	東
16	上場インデックスファンド中国H株（ハンセン中国企業株）	1548	東
17	上場インデックスファンドCNX Nifty先物（インド株式）	1549	東
18	上場インデックスファンド世界株式（MSCI ACWI）除く日本	1554	東
19	上場インデックスファンド豪州リート（S＆P/ASX200 A-REIT）	1555	東
20	上場インデックスファンド日経中国関連株50	1556	東
21	上場インデックスファンド新興国債券（バークレイズLocal EM国債）	1566	東
22	上場インデックスファンド日経225（ミニ）	1578	東
23	上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financials	1586	東
24	上場インデックスファンドJPX日経インデックス400	1592	東
25	上場インデックスファンド日経レバレッジ指数	1358	東

＊ 各銘柄の状況につきましては、次ページ以降をご参照ください。なお、各銘柄名をクリックしていただくと、各銘柄の状況が表示されます。

以　上

〔掲載番号:1〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1330　)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03　－　6447　－　6235　)

上場インデックスファンド225に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

67,449,801　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

1,345,389,962,879　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

19,947　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と日経225株価指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

0.00%

(参考)　乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経225株価指数の終値}}{\text{前営業日の日経225株価指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

〔掲載番号:1〕

上場インデックスファンド225　PCF（ユニット株式）

[2015/03/17　は設定交換申込不可日のため開示を行ないません]

設定のお申込みに関しましては、お申し込み不可日であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される日については、受益証券の取得のお申込みを受付ける場合があります。

〔掲載番号:2〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1308　)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03 － 6447 － 6235)

上場インデックスファンドTOPIXに関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成27年3月17日現在)

693,459,208　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

1,101,969,633,146　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

1,589.09　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と東証株価指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.00%

(参考)　乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{東証株価指数の終値}}{\text{前営業日の東証株価指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

〔掲載番号:2〕

上場インデックスファンドTOPIX　PCF（ユニット株式）

[2015/03/17　は設定交換申込不可日のため開示を行ないません]

設定のお申込みに関しましては、お申し込み不可日であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される日については、受益証券の取得のお申込みを受付ける場合があります。

〔掲載番号:3〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1314)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03 － 6447 － 6235)

上場インデックスファンドS&P日本新興株100に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

668,607　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

702,703,311　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

1,051.00　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とS&P日本新興株100指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{S\&P日本新興株100指数の終値}}{\text{前営業日のS\&P日本新興株100指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

〔掲載番号:3〕

上場インデックスファンドS&P日本新興株100　PCF(ユニット株式)

[2015/03/17　申込分]

NO.	銘柄ｺｰﾄﾞ	銘柄名	株数(株)
1	1407	ウエストホールディングス	100
2	1429	日本アクア	200
3	2121	ミクシィ	200
4	2146	UTホールディングス	200
5	2158	UBIC	100
6	2160	ジーエヌアイグループ	1,000
7	2191	テラ	100
8	2337	いちごグループホールディングス	1,000
9	2362	夢真ホールディングス	200
10	2370	メディネット	500
11	2400	メッセージ	100
12	2438	アスカネット	100
13	2489	アドウェイズ	200
14	2492	インフォマート	300
15	2497	ユナイテッド	100
16	2702	日本マクドナルドホールディングス	400
17	2767	フィールズ	100
18	2782	セリア	100
19	3244	サムティ	100
20	3665	エニグモ	100
21	3679	じげん	100
22	3727	アプリックスIPホールディングス	100
23	3751	日本アジアグループ	200
24	3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	2,700
25	3773	アドバンスト・メディア	100
26	3782	ディー・ディー・エス	200
27	3843	フリービット	100
28	3857	ラック	100
29	3858	ユビキタス	100
30	4281	デジタル・アドバタイジング・コンソーシア	100
31	4293	セプテーニ・ホールディングス	100
32	4298	プロトコーポレーション	100
33	4348	インフォコム	100
34	4563	アンジェス　MG	400
35	4564	オンコセラピー・サイエンス	800
36	4565	そーせいグループ	100
37	4571	ナノキャリア	200
38	4576	デ・ウエスタン・セラピテクス研究所	100
39	4582	シンバイオ製薬	200
40	4583	カイオム・バイオサイエンス	100
41	4585	UMNファーマ	100
42	4813	ACCESS	200
43	4819	デジタルガレージ	200
44	4842	USEN	600
45	4849	エン・ジャパン	100
46	4974	タカラバイオ	300
47	4978	リプロセル	300
48	5989	エイチワン	100
49	6072	地盤ネットホールディングス	100
50	6077	N・フィールド	100
51	6079	エナリス	100

52	6145	日特エンジニアリング	100
53	6432	竹内製作所	100
54	6677	エスケーエレクトロニクス	100
55	6736	サン電子	100
56	6787	メイコー	100
57	6871	日本マイクロニクス	100
58	6890	フェローテック	200
59	6908	イリソ電子工業	100
60	6960	フクダ電子	100
61	7157	ライフネット生命保険	200
62	7458	第一興商	300
63	7593	VTホールディングス	600
64	7707	プレシジョン・システム・サイエンス	100
65	7716	ナカニシ	200
66	7774	ジャパン・ティッシュ・エンジニアリング	100
67	7776	セルシード	100
68	7777	スリー・ディー・マトリックス	100
69	7779	CYBERDYNE	200
70	8699	澤田ホールディングス	200
71	8708	藍澤證券	300
72	8739	スパークス・グループ	600
73	8890	レーサム	100
74	8909	シノケングループ	100
75	8914	エリアリンク	600
76	8922	日本アセットマーケティング	800
77	9419	ワイヤレスゲート	100
78	9424	日本通信	800
79	9436	沖縄セルラー電話	100
80	9438	エムティーアイ	100
81	9514	ファーストエスコ	100

〔掲載番号:4〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1316　)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03 － 6447 － 6235)

上場インデックスファンドTOPIX100日本大型株に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

577,462　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

599,623,648　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

1,038.38　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とTOPIX 100 株価指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額 + 一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{TOPIX 100 株価指数の終値}}{\text{前営業日のTOPIX 100 株価指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

〔掲載番号:4〕

上場インデックスファンドTOPIX100日本大型株　PCF(ユニット株式)

[2015/03/17　は設定交換申込不可日のため開示を行ないません]

設定のお申込みに関しましては、お申し込み不可日であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される日については、受益証券の取得のお申込みを受付ける場合があります。

〔掲載番号:5〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1317　)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03　－　6447　－　6235　)

上場インデックスファンドTOPIX　Mid400日本中型株に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

336,815　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

592,480,147　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

1,759.07　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とTOPIX Mid400 株価指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額 + 一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{TOPIX Mid400 株価指数の終値}}{\text{前営業日のTOPIX Mid400 株価指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

〔掲載番号:5〕

上場インデックスファンドTOPIX Mid400日本中型株　PCF(ユニット株式)

［ 2015/03/17　は設定交換申込不可日のため開示を行ないません ］

設定のお申込みに関しましては、お申し込み不可日であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される日については、受益証券の取得のお申込みを受付ける場合があります。

〔掲載番号:6〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1318　)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03　－　6447　－　6235　)

上場インデックスファンドTOPIX　Small日本小型株に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

337,276　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

597,901,468　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

1,772.74　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とTOPIX Small 株価指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{TOPIX Small 株価指数の終値}}{\text{前営業日のTOPIX Small 株価指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

〔掲載番号:6〕

上場インデックスファンドTOPIX Small日本小型株　PCF(ユニット株式)

[2015/03/17　は設定交換申込不可日のため開示を行ないません]

設定のお申込みに関しましては、お申し込み不可日であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される日については、受益証券の取得のお申込みを受付ける場合があります。

〔掲載番号:7〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1322　)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03　－　6447　－　6235　)

上場インデックスファンド中国A株(パンダ)CSI300に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成27年3月17日現在)

1,022,220　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

6,771,262,282　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

6,624　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と円換算したCSI300指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.02%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したCSI300指数の終値}}{\text{前営業日の円換算したCSI300指数の終値}} \right) \times 100$$

〔掲載番号:8〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1345　)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03 － 6447 － 6235)

上場インデックスファンドJリート(東証REIT指数)隔月分配型に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

45,618,863　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

83,629,876,889　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

1,833.23　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と東証REIT指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{東証REIT指数の終値}}{\text{前営業日の東証REIT指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

〔掲載番号:8〕

上場インデックスファンドJリート　PCF（ユニット投資口）

[2015/03/17　申込分]

NO.	銘柄ｺｰﾄﾞ	銘柄名	投資口数
1	3226	日本アコモデーションファンド投資法人　投資証券	9
2	3227	MIDリート投資法人　投資証券	3
3	3234	森ヒルズリート投資法人　投資証券	30
4	3240	野村不動産レジデンシャル投資法人　投資証券	3
5	3249	産業ファンド投資法人　投資証券	7
6	3263	大和ハウスリート投資法人　投資証券	6
7	3269	アドバンス・レジデンス投資法人　投資証券	25
8	3278	ケネディクス・レジデンシャル投資法人　投資証券	7
9	3279	アクティビア・プロパティーズ投資法人　投資証券	5
10	3281	GLP投資法人　投資証券	46
11	3282	コンフォリア・レジデンシャル投資法人　投資証券	9
12	3283	日本プロロジスリート投資法人　投資証券	33
13	3285	野村不動産マスターファンド投資法人　投資証券	32
14	3287	星野リゾート・リート投資法人　投資証券	1
15	3290	SIA不動産投資法人　投資証券	1
16	3292	イオンリート投資法人　投資証券	21
17	3295	ヒューリックリート投資法人　投資証券	15
18	3296	日本リート投資法人　投資証券	6
19	3298	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人　投資証券	8
20	3308	日本ヘルスケア投資法人　投資証券	1
21	3309	積水ハウス・リート投資法人　投資証券	12
22	3451	トーセイ・リート投資法人　投資証券	2
23	8951	日本ビルファンド投資法人　投資証券	27
24	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人　投資証券	24
25	8953	日本リテールファンド投資法人　投資証券	46
26	8954	オリックス不動産投資法人　投資証券	43
27	8955	日本プライムリアルティ投資法人　投資証券	16
28	8956	プレミア投資法人　投資証券	5
29	8957	東急リアル・エステート投資法人　投資証券	19
30	8958	グローバル・ワン不動産投資法人　投資証券	4
31	8959	野村不動産オフィスファンド投資法人　投資証券	7
32	8960	ユナイテッド・アーバン投資法人　投資証券	50
33	8961	森トラスト総合リート投資法人　投資証券	25
34	8963	インヴィンシブル投資法人　投資証券	50
35	8964	フロンティア不動産投資法人　投資証券	9
36	8966	平和不動産リート投資法人　投資証券	18
37	8967	日本ロジスティクスファンド投資法人　投資証券	16
38	8968	福岡リート投資法人　投資証券	13
39	8972	ケネディクス・オフィス投資法人　投資証券	8
40	8973	積水ハウス・SI レジデンシャル投資法人　投資証券	19
41	8975	いちご不動産投資法人　投資証券	21
42	8976	大和証券オフィス投資法人　投資証券	8
43	8977	阪急リート投資法人　投資証券	11
44	8979	スターツプロシード投資法人　投資証券	3
45	8982	トップリート投資法人　投資証券	3
46	8984	大和ハウス・レジデンシャル投資法人　投資証券	14
47	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人　投資証券	57
48	8986	日本賃貸住宅投資法人　投資証券	28
49	8987	ジャパンエクセレント投資法人　投資証券	23

〔掲載番号:9〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1347　)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03　－　6447　－　6235　)

上場インデックスファンドFTSE日本グリーンチップ35に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

275,886　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

1,502,680,473　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

5,446.74　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とFTSE日本グリーンチップ35指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{FTSE日本グリーンチップ35指数の終値}}{\text{前営業日のFTSE日本グリーンチップ35指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

〔掲載番号:9〕

上場インデックスファンドFTSE日本グリーンチップ35　PCF(ユニット株式)

[2015/03/17　申込分]

NO.	銘柄ｺｰﾄﾞ	銘柄名	株数(株)
1	3402	東レ	9,000
2	3407	旭化成	8,000
3	4004	昭和電工	9,000
4	4091	大陽日酸	1,000
5	4188	三菱ケミカルホールディングス	7,800
6	5012	東燃ゼネラル石油	2,000
7	5019	出光興産	600
8	5233	太平洋セメント	7,000
9	5333	日本碍子	2,000
10	5631	日本製鋼所	2,000
11	5714	DOWAホールディングス	1,000
12	5801	古河電気工業	4,000
13	5802	住友電気工業	4,400
14	6361	荏原製作所	3,000
15	6370	栗田工業	700
16	6501	日立製作所	27,000
17	6502	東芝	24,000
18	6503	三菱電機	11,000
19	6645	オムロン	1,300
20	6741	日本信号	400
21	6752	パナソニック	12,200
22	6753	シャープ	9,000
23	6758	ソニー	6,600
24	6902	デンソー	2,700
25	6923	スタンレー電気	900
26	6954	ファナック	1,100
27	6971	京セラ	1,900
28	6988	日東電工	900
29	7011	三菱重工業	18,000
30	7012	川崎重工業	9,000
31	7203	トヨタ自動車	3,800
32	7211	三菱自動車工業	3,600
33	7267	本田技研工業	8,100
34	7912	大日本印刷	4,000
35	9513	電源開発	800

〔掲載番号:10〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1677)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03 － 6447 － 6235)

上場インデックスファンド海外債券(Citi WGBI)毎月分配型に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

117,000　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

6,804,289,074　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

58,156　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.02%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{WGBI指数の終値}}{\text{前営業日のWGBI指数の終値}} \right) \times 100$$

〔掲載番号:11〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1680　)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03　－　6447　－　6235　)

上場インデックスファンド海外先進国株式 (MSCI-KOKUSAI)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

4,900,000　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

10,560,128,145　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

2,155.13　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
円換算したMSCI-KOKUSAIインデックスの終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額 + 一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したMSCI-KOKUSAIインデックスの終値}}{\text{前営業日の 円換算したMSCI-KOKUSAIインデックスの終値}} \right) \times 100$$

〔掲載番号:12〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1681　)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03 － 6447 － 6235)

上場インデックスファンド海外新興国株式 (MSCIエマージング)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成27年3月17日現在)

4,800,000　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

6,930,101,793　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

1,443.77　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
円換算したMSCI-エマージング・マーケットインデックスの終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

0.17%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したMSCI-エマージング・マーケットインデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したMSCI-エマージング・マーケットインデックスの終値}} \right) \times 100$$

〔掲載番号:13〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1698)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03 － 6447 － 6235)

上場インデックスファンド日本高配当(東証配当フォーカス100)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成27年3月17日現在)

2,690,151　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

4,522,919,807　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

1,681.29　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と東証配当フォーカス100指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{東証配当フォーカス100指数の終値}}{\text{前営業日の東証配当フォーカス100指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

〔掲載番号:13〕

上場インデックスファンド日本高配当(東証配当フォーカス100) PCF(ユニット株式)

[2015/03/17 申込分]

NO.	銘柄ｺｰﾄﾞ	銘柄名	株数(株)
1	1878	大東建託	100
2	1925	大和ハウス工業	900
3	2503	キリンホールディングス	5,200
4	2579	コカ・コーラウエスト	400
5	2580	コカ・コーライーストジャパン	400
6	2914	日本たばこ産業	7,000
7	3191	ジョイフル本田	100
8	3405	クラレ	2,000
9	3632	グリー	700
10	3861	王子ホールディングス	1,000
11	4004	昭和電工	8,000
12	4045	東亞合成	1,000
13	4151	協和発酵キリン	1,000
14	4452	花王	3,200
15	4502	武田薬品工業	900
16	4508	田辺三菱製薬	300
17	4519	中外製薬	1,100
18	4523	エーザイ	300
19	4551	鳥居薬品	100
20	4568	第一三共	900
21	4578	大塚ホールディングス	2,400
22	4631	DIC	5,000
23	4676	フジ・メディア・ホールディングス	300
24	4704	トレンドマイクロ	600
25	4768	大塚商会	300
26	4912	ライオン	1,000
27	4919	ミルボン	100
28	4927	ポーラ・オルビスホールディングス	100
29	4985	アース製薬	100
30	5002	昭和シェル石油	1,200
31	5012	東燃ゼネラル石油	2,000
32	5020	JXホールディングス	3,200
33	5101	横浜ゴム	1,000
34	5105	東洋ゴム工業	500
35	5108	ブリヂストン	3,400
36	5110	住友ゴム工業	900
37	5201	旭硝子	6,000
38	5214	日本電気硝子	2,000
39	5301	東海カーボン	1,000
40	5406	神戸製鋼所	5,000
41	5563	新日本電工	700
42	5713	住友金属鉱山	1,000
43	5938	LIXILグループ	400
44	5943	ノーリツ	200
45	5959	岡部	300
46	6113	アマダ	400
47	6269	三井海洋開発	100
48	6301	小松製作所	1,400
49	6460	セガサミーホールディングス	300
50	6592	マブチモーター	300
51	6856	堀場製作所	200
52	7201	日産自動車	3,700

53	7203	トヨタ自動車	3,600
54	7205	日野自動車	400
55	7259	アイシン精機	200
56	7262	ダイハツ工業	300
57	7267	本田技研工業	2,300
58	7272	ヤマハ発動機	1,600
59	7739	キヤノン電子	100
60	7740	タムロン	100
61	7751	キヤノン	6,500
62	7752	リコー	800
63	7911	凸版印刷	1,000
64	7912	大日本印刷	1,000
65	7984	コクヨ	600
66	8001	伊藤忠商事	2,300
67	8002	丸紅	2,500
68	8031	三井物産	2,300
69	8053	住友商事	1,600
70	8058	三菱商事	2,000
71	8060	キヤノンマーケティングジャパン	300
72	8304	あおぞら銀行	2,000
73	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	21,100
74	8308	りそなホールディングス	3,100
75	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	6,000
76	8316	三井住友フィナンシャルグループ	2,100
77	8411	みずほフィナンシャルグループ	37,000
78	8473	SBIホールディングス	300
79	8570	イオンフィナンシャルサービス	200
80	8591	オリックス	1,900
81	8601	大和証券グループ本社	3,000
82	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	300
83	8951	日本ビルファンド投資法人　投資証券	11
84	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人　投資証券	3
85	8955	日本プライムリアルティ投資法人　投資証券	7
86	8958	グローバル・ワン不動産投資法人　投資証券	1
87	8961	森トラスト総合リート投資法人　投資証券	3
88	8964	フロンティア不動産投資法人　投資証券	4
89	8973	積水ハウス・SI　レジデンシャル投資法人　投資	2
90	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人　投資証券	22
91	8986	日本賃貸住宅投資法人　投資証券	3
92	8987	ジャパンエクセレント投資法人　投資証券	10
93	9021	西日本旅客鉄道	200
94	9432	日本電信電話	900
95	9433	KDDI	800
96	9437	NTTドコモ	1,900
97	9449	GMOインターネット	400
98	9504	中国電力	400
99	9747	アサツー　ディ・ケイ	200
100	9830	トラスコ中山	100

〔掲載番号:14〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1544)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03 － 6447 － 6235)

上場インデックスファンド日本株式(MSCIジャパン)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

640,624　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

626,771,846　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

978.38　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
円換算したMSCIジャパンインデックスの終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したMSCIジャパンインデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したMSCIジャパンインデックスの終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

〔掲載番号:14〕

上場インデックスファンド日本株式(MSCIジャパン) PCF(ユニット株式)

[2015/03/17 は設定交換申込不可日のため開示を行ないません]

設定のお申込みに関しましては、お申し込み不可日であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される日については、受益証券の取得のお申込みを受付ける場合があります。

この情報は、MSCI Japan Indexが基準および構成要素として用いられている「上場インデックスファンド日本株式(MSCI Japan)」の設定および解約についてのみ使用することができます。この情報は、閲覧者自身の使用に限り使用することができ、いかなる形でも再計算、複製または流布することはできず、いかなる金融商品または指数の作成を含め、その他一切に使用することはできません。この情報のいかなる使用もMSCIとの別個のライセンス契約を必要とします。この情報は、いかなる種類の投資判断を行う(または避ける)推奨、または投資助言を構成するよう意図されておらず、そのようなものとして依拠することはできません。過去のデータおよび分析は、将来の実績、分析、予測または予想を示すもの、またはそれを保証するものとして見られるべきではありません。この情報は「現状のまま」で提供されており、それを使用する者は、そのいかなる使用、またはその使用を許可することに伴う一切のリスクを負います。提供される情報は、MSCIインデックスのすべての構成要素を表すものとは限りません。MSCI、その関連会社その他この情報の編集、計算または作成に関与または関係した第三者は、当該情報またはその使用から得られる結果に関して、明示的か黙示的かを問わず何ら保証または表明するものではありません。MSCI、その関連会社その他いずれのMSCI関係者も、ここに、この情報に関するすべての保証(独創性、正確性、完全性、適時性、非侵害、商品性および特定目的適合性を含みますがこれに限定されません。)を明示的に否認します。上記事項を制限することなく、直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、結果的損害その他あらゆる損害(逸失利益を含みますがこれに限定されません。)につき、仮にその可能性について通知されていた場合、またはその他の方法で予期していた場合であろうと、MSCI、その関連会社その他この情報の編集、計算または作成に関与または関係した第三者は、いかなる場合においても、かかる損害について責任を負いません。

〔掲載番号:15〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1547　)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(　TEL　　03　－　6447　－　6235　)

上場インデックスファンド米国株式(S&P500)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成27年3月17日現在)

2,800,000　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

7,609,405,555　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

2,717.64　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と円換算したS&P500指数の終値の変動率に係る乖離率
(平成27年3月17日現在)

△ 0.06%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したS\&P500指数の終値}}{\text{前営業日の円換算したS\&P500指数の終値}} \right) \times 100$$

〔掲載番号:16〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1548)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03 － 6447 － 6235)

上場インデックスファンド中国H株(ハンセン中国企業株)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

300,000　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

428,085,671　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

1,426.95　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
円換算したハンセン中国企業株指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額 + 一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したハンセン中国企業株指数の終値}}{\text{前営業日の円換算したハンセン中国企業株指数の終値}} \right) \times 100$$

〔掲載番号:17〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1549)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03 － 6447 － 6235)

上場インデックスファンドCNX Nifty先物(インド株式)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

600,000　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

933,712,516　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

1,556.19　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
円換算したCNX　Nifty指数先物の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したCNX　Nifty指数先物の終値}}{\text{前営業日の円換算したCNX　Nifty指数先物の終値}} \right) \times 100$$

〔掲載番号:18〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上 雅彦
(コード番号　　1554)
問合せ先　事務企画管理部　　中田 眞帆
(TEL　 03 － 6447 － 6235)

上場インデックスファンド世界株式 (MSCI ACWI) 除く日本に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

1,800,000 口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

3,337,538,581 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

1,854.19 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
円換算したMSCI ACWI ex Japanインデックスの終値の変動率に係る乖離率
(平成27年3月17日現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額 + 一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したMSCI ACWI ex Japanインデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したMSCI ACWI ex Japanインデックスの終値}} \right) \times 100$$

〔掲載番号:19〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1555)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03 － 6447 － 6235)

上場インデックスファンド豪州リート(S&P/ASX200 A-REIT)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

2,300,000　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

3,784,364,568　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

1,645.38　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
円換算したS&P/ASX200 A-REIT指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したS\&P/ASX200 A-REIT指数の終値}}{\text{前営業日の円換算したS\&P/ASX200 A-REIT指数の終値}} \right) \times 100$$

〔掲載番号:20〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1556)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03 － 6447 － 6235)

上場インデックスファンド日経中国関連株50に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

257,190　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

407,612,112　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

1,584.87　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と日経中国関連株50指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経中国関連株50指数の終値}}{\text{前営業日の日経中国関連株50指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

〔掲載番号:20〕

上場インデックスファンド日経中国関連株50　PCF(ユニット株式)

[2015/03/17　申込分]

NO.	銘柄ｺｰﾄﾞ	銘柄名	株数(株)
1	2502	アサヒグループホールディングス	1,100
2	2802	味の素	1,000
3	3382	セブン＆アイ・ホールディングス	2,200
4	3402	東レ	4,000
5	3407	旭化成	3,000
6	4005	住友化学	4,000
7	4063	信越化学工業	1,100
8	4183	三井化学	2,000
9	4188	三菱ケミカルホールディングス	3,200
10	4452	花王	1,300
11	4911	資生堂	1,000
12	5020	JXホールディングス	6,000
13	5108	ブリヂストン	1,700
14	5401	新日鐵住金	20,000
15	5406	神戸製鋼所	9,000
16	5411	ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	1,400
17	5713	住友金属鉱山	2,000
18	5802	住友電気工業	1,900
19	6301	小松製作所	2,500
20	6305	日立建機	300
21	6326	クボタ	3,000
22	6367	ダイキン工業	700
23	6471	日本精工	1,000
24	6501	日立製作所	14,000
25	6502	東芝	10,000
26	6503	三菱電機	6,000
27	6752	パナソニック	6,600
28	6753	シャープ	4,000
29	6758	ソニー	3,300
30	6762	TDK	300
31	6902	デンソー	1,300
32	6954	ファナック	500
33	6971	京セラ	900
34	6981	村田製作所	600
35	6988	日東電工	400
36	7011	三菱重工業	9,000
37	7201	日産自動車	5,800
38	7203	トヨタ自動車	4,000
39	7267	本田技研工業	4,600
40	7731	ニコン	900
41	7751	キヤノン	3,300
42	8001	伊藤忠商事	4,100
43	8002	丸紅	4,200
44	8031	三井物産	4,400
45	8053	住友商事	3,100
46	8058	三菱商事	3,400
47	8113	ユニ・チャーム	1,000
48	8267	イオン	2,100
49	9104	商船三井	3,000
50	9983	ファーストリテイリング	100

〔掲載番号:21〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1566)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03 － 6447 － 6235)

上場インデックスファンド新興国債券(バークレイズLocal EM国債)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成27年3月17日現在)

78,000　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

4,736,279,831　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

60,722　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と円換算したバークレイズ自国通貨建て新興市場国債・10%国キャップ・インデックスの終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.06%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額 + 一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したバークレイズ自国通貨建て新興市場国債・10%国キャップ・インデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したバークレイズ自国通貨建て新興市場国債・10%国キャップ・インデックスの終値}} \right) \times 100$$

〔掲載番号:22〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1578　)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03　－　6447　－　6235　)

上場インデックスファンド日経225(ミニ)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

3,372,310　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

5,314,319,343　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

1,575.9　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と日経225株価指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経225株価指数の終値}}{\text{前営業日の日経225株価指数の終値}} \right) \times 100$$

〔掲載番号:23〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1586　)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03　－　6447　－　6235　)

上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financialsに関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

3,160,000　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

4,163,431,801　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

1,317.5　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とTOPIX Ex-Financialsの終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{TOPIX Ex-Financialsの終値}}{\text{前営業日のTOPIX Ex-Financialsの終値}} \right) \times 100$$

〔掲載番号:24〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1592　)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03　－　6447　－　6235　)

上場インデックスファンドJPX日経インデックス400に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

35,571,464　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

46,135,237,805　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

1,297.0　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とJPX日経インデックス 400の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{JPX日経インデックス 400の終値}}{\text{前営業日のJPX日経インデックス 400の終値}} \right) \times 100$$

〔掲載番号:25〕

平成27年3月18日

各　　位

管理会社名　日興アセットマネジメント株式会社
代表者名　　代表取締役　村上　雅彦
(コード番号　　1358)
問合せ先　事務企画管理部　　中田　眞帆
(TEL　 03 － 6447 － 6235)

上場インデックスファンド日経レバレッジ指数に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成27年3月17日現在)

54,211　口

2. 上場ETFの純資産総額　　(平成27年3月17日現在)

830,782,830　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　　(平成27年3月17日現在)

15,325　円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と日経平均レバレッジ・インデックスの終値の変動率に係る乖離率

(平成27年3月17日現在)

△ 0.27%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額 + 一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経平均レバレッジ・インデックスの終値}}{\text{前営業日の日経平均レバレッジ・インデックスの終値}} \right) \times 100$$

※日経平均レバレッジ・インデックスに内在する性質に関する注意点

・日経平均レバレッジ・インデックスは、前営業日に対する当該営業日の騰落率が、同期間の日経平均株価の騰落率の2倍となるよう計算されます。しかしながら、2営業日以上離れた期間における日経平均レバレッジ・インデックスの騰落率は、複利効果により、一般に日経平均株価の2倍とはならず、計算上、差が生じます。

・2営業日以上離れた期間における日経平均レバレッジ・インデックスの騰落率と日経平均株価の騰落率の2倍との差は、当該期間中の日経平均株価の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。ただし一般に、一定のレンジ内で日経平均株価の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、日経平均レバレッジ・インデックスの指数値は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差が大きくなる傾向があります。

※日経平均レバレッジ・インデックスと基準価額の主なカイ離要因

当ファンドは、基準価額の変動率を日経平均レバレッジ・インデックスの変動率に一致させることをめざしますが、次のような要因があるため、同指数と一致した推移をすることをお約束できるものではありません。

・株価指数先物取引の値動きと日経平均株価の値動きが一致しないこと。また、投資対象とする上場インデックスファンド225などの上場投資信託証券の値動きと日経平均株価の値動きが一致しないこと。

・日々の追加設定・解約などに対応した株価指数先物取引や投資対象とする上場インデックスファンド225などの上場投資信託証券の約定価格と評価価格（終値）に差が生じること。

・日経平均株価の採用銘柄の変更や資本異動などによってポートフォリオの調整が行なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、信託報酬、売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。

・組入銘柄の配当金や有価証券の貸付による品貸料が発生すること。

※金融商品取引所で取引される市場価格と基準価額のカイ離

・当ファンドは東京証券取引所に上場され公に取引されますが、市場価格は、主に当ファンドの需要、当ファンドの運用成果および投資者が代替的な投資と比較して当ファンドが全般的にどの程度魅力的であるか、などの評価に左右されます。したがって、当ファンドの市場価格が、基準価額を下回って取引されるかまたは上回って取引されるかは予測することはできません。