

各位

会社名 DIAMアセットマネジメント株式会社
 代表者名 代表取締役社長 西 恵正
 (コード番号 1369)
 問合せ先 投信ディスクロージャーグループ 上野 圭子
 TEL 03-3287-3110

DIAM ETF 日経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7月1日現在)

5,452,381 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年7月1日現在)

111,689,954,201 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年7月1日現在)

20,485 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と日経平均株価(日経225)の終値の変動率に係る乖離率
(平成27年7月1日現在)

0.01 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経225の終値}}{\text{前営業日の日経225の終値}} \right] \times 100(\%)$$

5. 交換にかかる交換口数(別紙参照)
 6. 設定にかかる株式のポートフォリオ(別紙参照)

日経平均株価(日経225)とは

「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体及び「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

指数の著作権等

「日経」及び「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属しています。当ファンドは、DIAMアセットマネジメント株式会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他、「日経平均株価」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

以上

DIAM ETF 日経225

| 日付 | 日経平均株価(日経225) | | DIAM ETF 日経225 | | | | |
|-----------|---------------|--------|----------------|--------|--------|-----------|-----------------|
| | 指数終値 | 日次騰落率 | 一口あたりの 純資産額 | 日次騰落率 | 乖離率 | 上場受益権口数 | 純資産総額 |
| 2015/6/4 | 20,488.19 | 0.07% | 20,629 | 0.07% | 0.00% | 5,351,182 | 110,387,916,224 |
| 2015/6/5 | 20,460.90 | -0.13% | 20,601 | -0.14% | -0.00% | 5,351,182 | 110,239,176,766 |
| 2015/6/8 | 20,457.19 | -0.02% | 20,597 | -0.02% | -0.00% | 5,401,782 | 111,259,153,513 |
| 2015/6/9 | 20,096.30 | -1.76% | 20,233 | -1.77% | -0.00% | 5,401,782 | 109,292,228,601 |
| 2015/6/10 | 20,046.36 | -0.25% | 20,184 | -0.24% | 0.01% | 5,401,782 | 109,028,932,471 |
| 2015/6/11 | 20,382.97 | 1.68% | 20,523 | 1.68% | 0.00% | 5,452,381 | 111,896,773,496 |
| 2015/6/12 | 20,407.08 | 0.12% | 20,546 | 0.11% | -0.01% | 5,452,381 | 112,022,784,679 |
| 2015/6/15 | 20,387.79 | -0.09% | 20,525 | -0.10% | -0.01% | 5,452,381 | 111,912,434,861 |
| 2015/6/16 | 20,257.94 | -0.64% | 20,395 | -0.63% | 0.00% | 5,452,381 | 111,200,763,629 |
| 2015/6/17 | 20,219.27 | -0.19% | 20,357 | -0.19% | 0.00% | 5,452,381 | 110,992,231,007 |
| 2015/6/18 | 19,990.82 | -1.13% | 20,126 | -1.13% | -0.00% | 5,452,381 | 109,732,986,078 |
| 2015/6/19 | 20,174.24 | 0.92% | 20,311 | 0.92% | 0.00% | 5,452,381 | 110,741,554,266 |
| 2015/6/22 | 20,428.19 | 1.26% | 20,566 | 1.26% | -0.00% | 5,452,381 | 112,135,919,220 |
| 2015/6/23 | 20,809.42 | 1.87% | 20,950 | 1.87% | 0.00% | 5,452,381 | 114,227,485,927 |
| 2015/6/24 | 20,868.03 | 0.28% | 21,008 | 0.28% | -0.00% | 5,452,381 | 114,542,435,507 |
| 2015/6/25 | 20,771.40 | -0.46% | 20,911 | -0.46% | 0.00% | 5,452,381 | 114,014,703,687 |
| 2015/6/26 | 20,706.15 | -0.31% | 20,865 | -0.22% | 0.09% | 5,452,381 | 113,761,435,623 |
| 2015/6/29 | 20,109.95 | -2.88% | 20,263 | -2.89% | -0.01% | 5,452,381 | 110,479,612,848 |
| 2015/6/30 | 20,235.73 | 0.63% | 20,389 | 0.62% | -0.00% | 5,452,381 | 111,169,391,266 |
| 2015/7/1 | 20,329.32 | 0.46% | 20,485 | 0.47% | 0.01% | 5,452,381 | 111,689,954,201 |

交換にかかる交換口数

交換申込日(平成27年7月7日)、交換受付日(平成27年7月7日)分の交換口数は以下の通りです。

交換申込不可日のため受け付けておりません。

設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(平成27年7月7日)、設定受付日(平成27年7月7日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

設定申込不可日のため受け付けておりません。

以上