

平成27年7月10日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
(管理会社コード:13054)
代表者名 代表取締役社長 白 川 真
問合せ先 経営企画部 近藤 龍一郎
(TEL. 03-5555-4946)

上場ETF(管理会社:大和証券投資信託委託)に関する日々の開示事項 1/2

大和証券投資信託委託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7月9日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(13銘柄)

| 掲載番号 | 銘柄名 | 銘柄コード | 上場取引所 |
|------|------------------------------|-------|-------|
| 1 | ダイワ上場投信－日経225 | 1320 | 東 |
| 2 | ダイワ上場投信－トピックス | 1305 | 東 |
| 3 | ダイワ上場投信－トピックス・コア30 | 1310 | 東 |
| 4 | ダイワ上場投信－東証電気機器株価指数 | 1610 | 東 |
| 5 | ダイワ上場投信－東証銀行業株価指数 | 1612 | 東 |
| 6 | ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials | 1585 | 東 |
| 7 | ダイワ上場投信－JPX日経400 | 1599 | 東 |
| 8 | ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス | 1365 | 東 |
| 9 | ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス | 1366 | 東 |
| 10 | ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数 | 1367 | 東 |
| 11 | ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数 | 1368 | 東 |
| 12 | ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス | 1456 | 東 |
| 13 | ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数 | 1457 | 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、各銘柄の保有状況が表示されます。

以上

平成27年7月10日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 白 川 真
(コード番号 1320)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信一日経225』に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信一日経225』の上場受益権口数
(平成27年7月9日 現在)

67,345,090 口

2. 『ダイワ上場投信一日経225』の純資産総額
(平成27年7月9日 現在)

1,377,722,990,183 円

3. 『ダイワ上場投信一日経225』の一口あたりの純資産額
(平成27年7月9日 現在)

20,457.7 円

4. 『ダイワ上場投信一日経225』の一口あたりの純資産額と
『日経平均株価』の終値の変動率に係る乖離率
(平成27年7月9日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成27年7月10日 現在)

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----------------------|-----|----------------------|-------|
| 単位 = 1 バスケット | 1 | 1332 日本水産 | 2,000 |
| 銘柄数 = 225 | 2 | 1333 マルハニチロ | 200 |
| バスケット提示日 = 平成27年7月10日 | 3 | 1605 国際石油開発帝石 | 800 |
| 追加設定日 = 平成27年7月16日 | 4 | 1721 コムシスホールディングス | 2,000 |
| | 5 | 1801 大成建設 | 2,000 |
| | 6 | 1802 大林組 | 2,000 |
| | 7 | 1803 清水建設 | 2,000 |
| | 8 | 1812 鹿島建設 | 2,000 |
| | 9 | 1925 大和ハウス工業 | 2,000 |
| | 10 | 1928 積水ハウス | 2,000 |
| | 11 | 1963 日揮 | 2,000 |
| | 12 | 2002 日清製粉グループ本社 | 2,000 |
| | 13 | 2269 明治ホールディングス | 200 |
| | 14 | 2282 日本ハム | 2,000 |
| | 15 | 2501 サッポロホールディングス | 2,000 |
| | 16 | 2502 アサヒグループホールディングス | 2,000 |
| | 17 | 2503 キリンホールディングス | 2,000 |
| | 18 | 2531 宝ホールディングス | 2,000 |
| | 19 | 2768 双日 | 200 |
| | 20 | 2801 キッコーマン | 2,000 |
| | 21 | 2802 味の素 | 2,000 |
| | 22 | 2871 ニチレイ | 2,000 |
| | 23 | 2914 日本たばこ産業 | 2,000 |
| | 24 | 3086 J. フロント リテイリング | 1,000 |
| | 25 | 3099 三越伊勢丹ホールディングス | 2,000 |
| | 26 | 3101 東洋紡 | 2,000 |
| | 27 | 3103 ユニチカ | 2,000 |
| | 28 | 3105 日清紡ホールディングス | 2,000 |
| | 29 | 3110 日東紡績 | 2,000 |
| | 30 | 3289 東急不動産ホールディングス | 2,000 |
| | 31 | 3382 セブン&アイ・ホールディングス | 2,000 |
| | 32 | 3401 帝人 | 2,000 |
| | 33 | 3402 東レ | 2,000 |
| | 34 | 3405 クラレ | 2,000 |
| | 35 | 3407 旭化成 | 2,000 |
| | 36 | 3436 SUMCO | 200 |
| | 37 | 3861 王子ホールディングス | 2,000 |
| | 38 | 3863 日本製紙 | 200 |
| | 39 | 3865 北越紀州製紙 | 2,000 |
| | 40 | 4004 昭和電工 | 2,000 |
| | 41 | 4005 住友化学 | 2,000 |
| | 42 | 4021 日産化学工業 | 2,000 |
| | 43 | 4041 日本曹達 | 2,000 |
| | 44 | 4042 東ソー | 2,000 |
| | 45 | 4043 トクヤマ | 2,000 |
| | 46 | 4061 電気化学工業 | 2,000 |
| | 47 | 4063 信越化学工業 | 2,000 |
| | 48 | 4151 協和発酵キリン | 2,000 |
| | 49 | 4183 三井化学 | 2,000 |
| | 50 | 4188 三菱ケミカルホールディングス | 1,000 |

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----|------|--------------------|--------|
| 51 | 4208 | 宇部興産 | 2,000 |
| 52 | 4272 | 日本化薬 | 2,000 |
| 53 | 4324 | 電通 | 2,000 |
| 54 | 4452 | 花王 | 2,000 |
| 55 | 4502 | 武田薬品工業 | 2,000 |
| 56 | 4503 | アステラス製薬 | 10,000 |
| 57 | 4506 | 大日本住友製薬 | 2,000 |
| 58 | 4507 | 塩野義製薬 | 2,000 |
| 59 | 4519 | 中外製薬 | 2,000 |
| 60 | 4523 | エーザイ | 2,000 |
| 61 | 4543 | テルモ | 4,000 |
| 62 | 4568 | 第一三共 | 2,000 |
| 63 | 4689 | ヤフー | 800 |
| 64 | 4704 | トレンドマイクロ | 2,000 |
| 65 | 4901 | 富士フイルムホールディングス | 2,000 |
| 66 | 4902 | コニカミノルタ | 2,000 |
| 67 | 4911 | 資生堂 | 2,000 |
| 68 | 5002 | 昭和シェル石油 | 2,000 |
| 69 | 5020 | JXホールディングス | 2,000 |
| 70 | 5101 | 横浜ゴム | 1,000 |
| 71 | 5108 | ブリヂストン | 2,000 |
| 72 | 5201 | 旭硝子 | 2,000 |
| 73 | 5202 | 日本板硝子 | 2,000 |
| 74 | 5214 | 日本電気硝子 | 3,000 |
| 75 | 5232 | 住友大阪セメント | 2,000 |
| 76 | 5233 | 太平洋セメント | 2,000 |
| 77 | 5301 | 東海カーボン | 2,000 |
| 78 | 5332 | TOTO | 2,000 |
| 79 | 5333 | 日本碍子 | 2,000 |
| 80 | 5401 | 新日鐵住金 | 2,000 |
| 81 | 5406 | 神戸製鋼所 | 2,000 |
| 82 | 5411 | ジェイ エフ イー ホールディングス | 200 |
| 83 | 5413 | 日新製鋼 | 200 |
| 84 | 5541 | 太平洋金属 | 2,000 |
| 85 | 5631 | 日本製鋼所 | 2,000 |
| 86 | 5703 | 日本軽金属ホールディングス | 2,000 |
| 87 | 5706 | 三井金属鉱業 | 2,000 |
| 88 | 5707 | 東邦亜鉛 | 2,000 |
| 89 | 5711 | 三菱マテリアル | 2,000 |
| 90 | 5713 | 住友金属鉱山 | 2,000 |
| 91 | 5714 | DOWAホールディングス | 2,000 |
| 92 | 5715 | 古河機械金属 | 2,000 |
| 93 | 5801 | 古河電気工業 | 2,000 |
| 94 | 5802 | 住友電気工業 | 2,000 |
| 95 | 5803 | フジクラ | 2,000 |
| 96 | 5901 | 東洋製罐グループホールディングス | 2,000 |
| 97 | 6103 | オクマ | 2,000 |
| 98 | 6113 | アマダホールディングス | 2,000 |
| 99 | 6301 | 小松製作所 | 2,000 |
| 100 | 6302 | 住友重機械工業 | 2,000 |

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----|------|-------------------|-------|
| 101 | 6305 | 日立建機 | 2,000 |
| 102 | 6326 | クボタ | 2,000 |
| 103 | 6361 | 荏原製作所 | 2,000 |
| 104 | 6366 | 千代田化工建設 | 2,000 |
| 105 | 6367 | ダイキン工業 | 2,000 |
| 106 | 6471 | 日本精工 | 2,000 |
| 107 | 6472 | NTN | 2,000 |
| 108 | 6473 | ジェイテクト | 2,000 |
| 109 | 6479 | ミネベア | 2,000 |
| 110 | 6501 | 日立製作所 | 2,000 |
| 111 | 6502 | 東芝 | 2,000 |
| 112 | 6503 | 三菱電機 | 2,000 |
| 113 | 6504 | 富士電機 | 2,000 |
| 114 | 6506 | 安川電機 | 2,000 |
| 115 | 6508 | 明電舎 | 2,000 |
| 116 | 6674 | ジーエス・ユアサ コーポレーション | 2,000 |
| 117 | 6701 | 日本電気 | 2,000 |
| 118 | 6702 | 富士通 | 2,000 |
| 119 | 6703 | 沖電気工業 | 2,000 |
| 120 | 6752 | パナソニック | 2,000 |
| 121 | 6753 | シャープ | 2,000 |
| 122 | 6758 | ソニー | 2,000 |
| 123 | 6762 | TDK | 2,000 |
| 124 | 6767 | ミツミ電機 | 2,000 |
| 125 | 6770 | アルプス電気 | 2,000 |
| 126 | 6773 | パイオニア | 2,000 |
| 127 | 6841 | 横河電機 | 2,000 |
| 128 | 6857 | アドバンテスト | 4,000 |
| 129 | 6902 | デンソー | 2,000 |
| 130 | 6952 | カンオ計算機 | 2,000 |
| 131 | 6954 | ファナック | 2,000 |
| 132 | 6971 | 京セラ | 4,000 |
| 133 | 6976 | 太陽誘電 | 2,000 |
| 134 | 6988 | 日東電工 | 2,000 |
| 135 | 7003 | 三井造船 | 2,000 |
| 136 | 7004 | 日立造船 | 400 |
| 137 | 7011 | 三菱重工業 | 2,000 |
| 138 | 7012 | 川崎重工業 | 2,000 |
| 139 | 7013 | IHI | 2,000 |
| 140 | 7201 | 日産自動車 | 2,000 |
| 141 | 7202 | いすゞ自動車 | 1,000 |
| 142 | 7203 | トヨタ自動車 | 2,000 |
| 143 | 7205 | 日野自動車 | 2,000 |
| 144 | 7211 | 三菱自動車工業 | 200 |
| 145 | 7261 | マツダ | 400 |
| 146 | 7267 | 本田技研工業 | 4,000 |
| 147 | 7269 | スズキ | 2,000 |
| 148 | 7270 | 富士重工業 | 2,000 |
| 149 | 7731 | ニコン | 2,000 |
| 150 | 7733 | オリンパス | 2,000 |

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----|------|---------------------------|-------|
| 151 | 7735 | SCREENホールディングス | 2,000 |
| 152 | 7751 | キャノン | 3,000 |
| 153 | 7752 | リコー | 2,000 |
| 154 | 7762 | シチズンホールディングス | 2,000 |
| 155 | 7911 | 凸版印刷 | 2,000 |
| 156 | 7912 | 大日本印刷 | 2,000 |
| 157 | 7951 | ヤマハ | 2,000 |
| 158 | 8001 | 伊藤忠商事 | 2,000 |
| 159 | 8002 | 丸紅 | 2,000 |
| 160 | 8015 | 豊田通商 | 2,000 |
| 161 | 8031 | 三井物産 | 2,000 |
| 162 | 8035 | 東京エレクトロン | 2,000 |
| 163 | 8053 | 住友商事 | 2,000 |
| 164 | 8058 | 三菱商事 | 2,000 |
| 165 | 8233 | 高島屋 | 2,000 |
| 166 | 8252 | 丸井グループ | 2,000 |
| 167 | 8253 | クレディセゾン | 2,000 |
| 168 | 8267 | イオン | 2,000 |
| 169 | 8270 | ユニーグループ・ホールディングス | 2,000 |
| 170 | 8303 | 新生銀行 | 2,000 |
| 171 | 8304 | あおぞら銀行 | 2,000 |
| 172 | 8306 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 2,000 |
| 173 | 8308 | りそなホールディングス | 200 |
| 174 | 8309 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 2,000 |
| 175 | 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ | 200 |
| 176 | 8331 | 千葉銀行 | 2,000 |
| 177 | 8332 | 横浜銀行 | 2,000 |
| 178 | 8354 | ふくおかフィナンシャルグループ | 2,000 |
| 179 | 8355 | 静岡銀行 | 2,000 |
| 180 | 8411 | みずほフィナンシャルグループ | 2,000 |
| 181 | 8601 | 大和証券グループ本社 | 2,000 |
| 182 | 8604 | 野村ホールディングス | 2,000 |
| 183 | 8628 | 松井証券 | 2,000 |
| 184 | 8630 | 損保ジャパン日本興亜ホールディングス | 500 |
| 185 | 8725 | MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 600 |
| 186 | 8729 | ソニーフィナンシャルホールディングス | 400 |
| 187 | 8750 | 第一生命保険 | 200 |
| 188 | 8766 | 東京海上ホールディングス | 1,000 |
| 189 | 8795 | T&Dホールディングス | 400 |
| 190 | 8801 | 三井不動産 | 2,000 |
| 191 | 8802 | 三菱地所 | 2,000 |
| 192 | 8803 | 平和不動産 | 400 |
| 193 | 8804 | 東京建物 | 1,000 |
| 194 | 8830 | 住友不動産 | 2,000 |
| 195 | 9001 | 東武鉄道 | 2,000 |
| 196 | 9005 | 東京急行電鉄 | 2,000 |
| 197 | 9007 | 小田急電鉄 | 2,000 |
| 198 | 9008 | 京王電鉄 | 2,000 |
| 199 | 9009 | 京成電鉄 | 2,000 |
| 200 | 9020 | 東日本旅客鉄道 | 200 |

[掲載番号:1]

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----|------|------------------|--------|
| 201 | 9021 | 西日本旅客鉄道 | 200 |
| 202 | 9022 | 東海旅客鉄道 | 200 |
| 203 | 9062 | 日本通運 | 2,000 |
| 204 | 9064 | ヤマトホールディングス | 2,000 |
| 205 | 9101 | 日本郵船 | 2,000 |
| 206 | 9104 | 商船三井 | 2,000 |
| 207 | 9107 | 川崎汽船 | 2,000 |
| 208 | 9202 | ANAホールディングス | 2,000 |
| 209 | 9301 | 三菱倉庫 | 2,000 |
| 210 | 9412 | スカパーJSATホールディングス | 200 |
| 211 | 9432 | 日本電信電話 | 400 |
| 212 | 9433 | KDDI | 12,000 |
| 213 | 9437 | NTTドコモ | 200 |
| 214 | 9501 | 東京電力 | 200 |
| 215 | 9502 | 中部電力 | 200 |
| 216 | 9503 | 関西電力 | 200 |
| 217 | 9531 | 東京瓦斯 | 2,000 |
| 218 | 9532 | 大阪瓦斯 | 2,000 |
| 219 | 9602 | 東宝 | 200 |
| 220 | 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ | 2,000 |
| 221 | 9681 | 東京ドーム | 2,000 |
| 222 | 9735 | セコム | 2,000 |
| 223 | 9766 | コナミ | 2,000 |
| 224 | 9983 | ファーストリテイリング | 2,000 |
| 225 | 9984 | ソフトバンクグループ | 6,000 |

平成27年7月10日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 白 川 真
(コード番号 1305)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信―トピックス』に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信―トピックス』の上場受益権口数

(平成27年7月9日 現在)

783,769,974 口

2. 『ダイワ上場投信―トピックス』の純資産総額

(平成27年7月9日 現在)

1,295,905,926,480 円

3. 『ダイワ上場投信―トピックス』の一口あたりの純資産額

(平成27年7月9日 現在)

1,653.43 円

4. 『ダイワ上場投信―トピックス』の一口あたりの純資産額と
『東証株価指数(TOPIX)』の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年7月9日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成27年7月10日 現在)

[掲載番号:2]

ダイワ上場投信ートピックス(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成27年7月10日
追加設定日 = 平成27年7月16日

平成27年7月10日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 白 川 真
(コード番号 1310)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の上場受益権口数
(平成27年7月9日 現在)

2,602,584 口

2. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の純資産総額
(平成27年7月9日 現在)

2,062,297,598 円

3. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の一口あたりの純資産額
(平成27年7月9日 現在)

792.404 円

4. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の一口あたりの純資産額と
『TOPIX Core30 指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成27年7月9日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成27年7月10日 現在)

ダイワ上場投信ートピックス・コア30(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----------------------|-----|------------------------|---------|
| 単位 = 1 バスケット | 1 | 2914 日本たばこ産業 | 9,000 |
| 銘柄数 = 30 | 2 | 3382 セブン&アイ・ホールディングス | 6,000 |
| バスケット提示日 = 平成27年7月10日 | 3 | 4063 信越化学工業 | 2,700 |
| 追加設定日 = 平成27年7月16日 | 4 | 4502 武田薬品工業 | 5,700 |
| | 5 | 4503 アステラス製薬 | 17,000 |
| | 6 | 5401 新日鐵住金 | 64,000 |
| | 7 | 6301 小松製作所 | 7,500 |
| | 8 | 6501 日立製作所 | 35,000 |
| | 9 | 6752 パナソニック | 17,700 |
| | 10 | 6758 ソニー | 9,500 |
| | 11 | 6902 デンソー | 3,600 |
| | 12 | 6954 ファナック | 1,500 |
| | 13 | 7201 日産自動車 | 20,400 |
| | 14 | 7203 トヨタ自動車 | 20,100 |
| | 15 | 7267 本田技研工業 | 13,100 |
| | 16 | 7751 キヤノン | 8,400 |
| | 17 | 8031 三井物産 | 12,200 |
| | 18 | 8058 三菱商事 | 11,000 |
| | 19 | 8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 115,100 |
| | 20 | 8316 三井住友フィナンシャルグループ | 10,900 |
| | 21 | 8411 みずほフィナンシャルグループ | 200,200 |
| | 22 | 8604 野村ホールディングス | 29,300 |
| | 23 | 8766 東京海上ホールディングス | 5,800 |
| | 24 | 8801 三井不動産 | 8,000 |
| | 25 | 8802 三菱地所 | 11,000 |
| | 26 | 9020 東日本旅客鉄道 | 2,700 |
| | 27 | 9432 日本電信電話 | 11,200 |
| | 28 | 9433 KDDI | 14,600 |
| | 29 | 9437 NTTドコモ | 11,100 |
| | 30 | 9984 ソフトバンクグループ | 7,600 |

平成27年7月10日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 白 川 真
(コード番号 1610)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の上場受益権口数

(平成27年7月9日 現在)

1,023,700 口

2. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の純資産総額

(平成27年7月9日 現在)

2,191,836,632 円

3. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の一口あたりの純資産額

(平成27年7月9日 現在)

2,141.093 円

4. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の一口あたりの純資産額と
『東証電気機器株価指数』の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年7月9日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成27年7月10日 現在)

ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----------------------|-----|------------------------|---------|
| 単位 = 1 バスケット | 1 | 4062 イビデン | 4,700 |
| 銘柄数 = 158 | 2 | 4902 コニカミノルタ | 17,200 |
| バスケット提示日 = 平成27年7月10日 | 3 | 6448 ブラザー工業 | 9,300 |
| 追加設定日 = 平成27年7月16日 | 4 | 6479 ミネベア | 11,000 |
| | 5 | 6501 日立製作所 | 173,000 |
| | 6 | 6502 東芝 | 152,000 |
| | 7 | 6503 三菱電機 | 72,000 |
| | 8 | 6504 富士電機 | 20,000 |
| | 9 | 6505 東洋電機製造 | 1,000 |
| | 10 | 6506 安川電機 | 8,800 |
| | 11 | 6507 シンフォニア テクノロジー | 5,000 |
| | 12 | 6508 明電舎 | 7,000 |
| | 13 | 6513 オリジン電気 | 1,000 |
| | 14 | 6516 山洋電気 | 2,000 |
| | 15 | 6517 デンヨー | 600 |
| | 16 | 6588 東芝テック | 5,000 |
| | 17 | 6590 芝浦メカトロニクス | 1,000 |
| | 18 | 6592 マブチモーター | 2,100 |
| | 19 | 6594 日本電産 | 7,900 |
| | 20 | 6617 東光高岳 | 400 |
| | 21 | 6620 宮越ホールディングス | 200 |
| | 22 | 6622 ダイヘン | 4,000 |
| | 23 | 6624 田淵電機 | 800 |
| | 24 | 6630 ヤーマン | 100 |
| | 25 | 6632 JVCケンウッド | 5,300 |
| | 26 | 6638 ミマキエンジニアリング | 400 |
| | 27 | 6640 第一精工 | 300 |
| | 28 | 6641 日新電機 | 1,700 |
| | 29 | 6644 大崎電気工業 | 1,000 |
| | 30 | 6645 オムロン | 7,800 |
| | 31 | 6651 日東工業 | 1,200 |
| | 32 | 6652 IDEC | 900 |
| | 33 | 6654 不二電機工業 | 100 |
| | 34 | 6674 ジーエス・ユアサ コーポレーション | 14,000 |
| | 35 | 6675 サクサホールディングス | 2,000 |
| | 36 | 6676 メルコホールディングス | 400 |
| | 37 | 6678 テクノメディカ | 200 |
| | 38 | 6701 日本電気 | 93,000 |
| | 39 | 6702 富士通 | 69,000 |
| | 40 | 6703 沖電気工業 | 25,000 |
| | 41 | 6704 岩崎通信機 | 3,000 |
| | 42 | 6706 電気興業 | 2,000 |
| | 43 | 6707 サンケン電気 | 4,000 |
| | 44 | 6715 ナカヨ | 1,000 |
| | 45 | 6718 アイホン | 400 |
| | 46 | 6723 ルネサスエレクトロニクス | 3,700 |
| | 47 | 6724 セイコーエプソン | 9,800 |
| | 48 | 6727 ワコム | 5,700 |
| | 49 | 6728 アルバック | 1,200 |
| | 50 | 6730 アクセル | 300 |

ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----|------|----------------|--------|
| 51 | 6737 | EIZO | 700 |
| 52 | 6740 | ジャパンディスプレイ | 14,800 |
| 53 | 6741 | 日本信号 | 2,000 |
| 54 | 6742 | 京三製作所 | 2,000 |
| 55 | 6744 | 能美防災 | 1,000 |
| 56 | 6745 | ホーチキ | 500 |
| 57 | 6750 | エレコム | 300 |
| 58 | 6751 | 日本無線 | 2,000 |
| 59 | 6752 | パナソニック | 87,800 |
| 60 | 6753 | シャープ | 61,000 |
| 61 | 6754 | アンリツ | 4,300 |
| 62 | 6755 | 富士通ゼネラル | 2,000 |
| 63 | 6756 | 日立国際電気 | 2,000 |
| 64 | 6758 | ソニー | 47,100 |
| 65 | 6762 | TDK | 4,400 |
| 66 | 6763 | 帝国通信工業 | 2,000 |
| 67 | 6767 | ミツミ電機 | 2,500 |
| 68 | 6768 | タムラ製作所 | 3,000 |
| 69 | 6770 | アルプス電気 | 5,700 |
| 70 | 6771 | 池上通信機 | 2,000 |
| 71 | 6773 | パイオニア | 10,800 |
| 72 | 6779 | 日本電波工業 | 700 |
| 73 | 6785 | 鈴木 | 200 |
| 74 | 6788 | 日本トリム | 200 |
| 75 | 6789 | ローランド ディー. ジー. | 300 |
| 76 | 6794 | フォスター電機 | 800 |
| 77 | 6796 | クラリオン | 4,000 |
| 78 | 6798 | SMK | 2,000 |
| 79 | 6800 | ヨコオ | 600 |
| 80 | 6801 | 東光 | 2,000 |
| 81 | 6803 | ティアック | 4,000 |
| 82 | 6804 | ホシデン | 2,200 |
| 83 | 6806 | ヒロセ電機 | 1,200 |
| 84 | 6807 | 日本航空電子工業 | 2,000 |
| 85 | 6809 | TOA | 800 |
| 86 | 6810 | 日立マクセル | 1,400 |
| 87 | 6814 | 古野電気 | 900 |
| 88 | 6815 | ユニデンホールディングス | 2,000 |
| 89 | 6816 | アルパイン | 1,700 |
| 90 | 6817 | スミダコーポレーション | 600 |
| 91 | 6820 | アイコム | 400 |
| 92 | 6823 | リオン | 300 |
| 93 | 6839 | 船井電機 | 700 |
| 94 | 6841 | 横河電機 | 7,200 |
| 95 | 6844 | 新電元工業 | 3,000 |
| 96 | 6845 | アズビル | 2,400 |
| 97 | 6848 | 東亜ディーケーケー | 300 |
| 98 | 6849 | 日本光電工業 | 3,100 |
| 99 | 6850 | チノー | 300 |
| 100 | 6853 | 共和電業 | 900 |

ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----|------|------------------|--------|
| 101 | 6855 | 日本電子材料 | 300 |
| 102 | 6856 | 堀場製作所 | 1,300 |
| 103 | 6857 | アドバンテスト | 4,900 |
| 104 | 6858 | 小野測器 | 300 |
| 105 | 6859 | エスベック | 800 |
| 106 | 6860 | パナソニック デバイスSUNX | 600 |
| 107 | 6861 | キーエンス | 1,600 |
| 108 | 6866 | 日置電機 | 400 |
| 109 | 6869 | シスメックス | 5,600 |
| 110 | 6875 | メガチップス | 800 |
| 111 | 6877 | OBARA GROUP | 500 |
| 112 | 6901 | 澤藤電機 | 1,000 |
| 113 | 6905 | コーセル | 1,000 |
| 114 | 6911 | 新日本無線 | 1,000 |
| 115 | 6914 | オブテックス | 500 |
| 116 | 6915 | 千代田インテグレ | 400 |
| 117 | 6920 | レーザーテック | 700 |
| 118 | 6923 | スタンレー電気 | 5,200 |
| 119 | 6924 | 岩崎電気 | 2,000 |
| 120 | 6925 | ウシオ電機 | 4,400 |
| 121 | 6926 | 岡谷電機産業 | 400 |
| 122 | 6927 | ヘリオス テクノ ホールディング | 700 |
| 123 | 6929 | 日本セラミック | 400 |
| 124 | 6932 | 遠藤照明 | 300 |
| 125 | 6935 | 日本デジタル研究所 | 600 |
| 126 | 6937 | 古河電池 | 1,000 |
| 127 | 6938 | 双信電機 | 300 |
| 128 | 6941 | 山一電機 | 800 |
| 129 | 6947 | 図研 | 500 |
| 130 | 6951 | 日本電子 | 3,000 |
| 131 | 6952 | カシオ計算機 | 7,200 |
| 132 | 6954 | ファナック | 7,500 |
| 133 | 6958 | 日本シイエムケイ | 1,800 |
| 134 | 6961 | エンプラス | 300 |
| 135 | 6962 | 大真空 | 1,000 |
| 136 | 6963 | ローム | 3,600 |
| 137 | 6965 | 浜松ホトニクス | 5,600 |
| 138 | 6966 | 三井ハイテック | 1,000 |
| 139 | 6967 | 新光電気工業 | 2,700 |
| 140 | 6971 | 京セラ | 11,800 |
| 141 | 6976 | 太陽誘電 | 3,800 |
| 142 | 6981 | 村田製作所 | 7,600 |
| 143 | 6985 | ユーシン | 1,000 |
| 144 | 6986 | 双葉電子工業 | 1,200 |
| 145 | 6989 | 北陸電気工業 | 3,000 |
| 146 | 6996 | ニチコン | 2,300 |
| 147 | 6997 | 日本ケミコン | 6,000 |
| 148 | 6999 | KOA | 1,000 |
| 149 | 7244 | 市光工業 | 2,000 |
| 150 | 7276 | 小糸製作所 | 4,300 |

[掲載番号:4]

ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----|------|----------------|--------|
| 151 | 7280 | ミツバ | 1,300 |
| 152 | 7718 | スター精密 | 1,400 |
| 153 | 7735 | SCREENホールディングス | 7,000 |
| 154 | 7739 | キヤノン電子 | 700 |
| 155 | 7751 | キヤノン | 41,800 |
| 156 | 7752 | リコー | 21,700 |
| 157 | 7999 | MUTOHホールディングス | 1,000 |
| 158 | 8035 | 東京エレクトロン | 6,100 |

平成27年7月10日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 白 川 真
(コード番号 1612)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の上場受益権口数
(平成27年7月9日 現在)

4,674,352 口

2. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の純資産総額
(平成27年7月9日 現在)

1,011,596,500 円

3. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の一口あたりの純資産額
(平成27年7月9日 現在)

216.414 円

4. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の一口あたりの純資産額と
『東証銀行業株価指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成27年7月9日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成27年7月10日 現在)

ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----------------------|-----|------------------------|---------|
| 単位 = 1 バスケット | 1 | 7161 じもとホールディングス | 1,700 |
| 銘柄数 = 85 | 2 | 7167 足利ホールディングス | 1,500 |
| バスケット提示日 = 平成27年7月10日 | 3 | 7173 東京TYフィナンシャルグループ | 300 |
| 追加設定日 = 平成27年7月16日 | 4 | 8303 新生銀行 | 22,000 |
| | 5 | 8304 あおぞら銀行 | 16,000 |
| | 6 | 8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 187,600 |
| | 7 | 8308 りそなホールディングス | 27,400 |
| | 8 | 8309 三井住友トラスト・ホールディングス | 52,000 |
| | 9 | 8316 三井住友フィナンシャルグループ | 17,700 |
| | 10 | 8324 第四銀行 | 3,000 |
| | 11 | 8325 北越銀行 | 3,000 |
| | 12 | 8327 西日本シティ銀行 | 8,000 |
| | 13 | 8331 千葉銀行 | 9,000 |
| | 14 | 8332 横浜銀行 | 16,000 |
| | 15 | 8333 常陽銀行 | 8,000 |
| | 16 | 8334 群馬銀行 | 6,000 |
| | 17 | 8336 武蔵野銀行 | 400 |
| | 18 | 8337 千葉興業銀行 | 500 |
| | 19 | 8338 筑波銀行 | 1,000 |
| | 20 | 8341 七十七銀行 | 4,000 |
| | 21 | 8342 青森銀行 | 2,000 |
| | 22 | 8343 秋田銀行 | 2,000 |
| | 23 | 8344 山形銀行 | 1,000 |
| | 24 | 8345 岩手銀行 | 200 |
| | 25 | 8346 東邦銀行 | 2,000 |
| | 26 | 8349 東北銀行 | 1,000 |
| | 27 | 8350 みちのく銀行 | 1,000 |
| | 28 | 8354 ふくおかフィナンシャルグループ | 9,000 |
| | 29 | 8355 静岡銀行 | 7,000 |
| | 30 | 8356 十六銀行 | 3,000 |
| | 31 | 8358 スルガ銀行 | 2,500 |
| | 32 | 8359 八十二銀行 | 4,000 |
| | 33 | 8360 山梨中央銀行 | 1,000 |
| | 34 | 8361 大垣共立銀行 | 3,000 |
| | 35 | 8362 福井銀行 | 2,000 |
| | 36 | 8363 北國銀行 | 3,000 |
| | 37 | 8364 清水銀行 | 100 |
| | 38 | 8366 滋賀銀行 | 2,000 |
| | 39 | 8367 南都銀行 | 2,000 |
| | 40 | 8368 百五銀行 | 2,000 |
| | 41 | 8369 京都銀行 | 4,000 |
| | 42 | 8370 紀陽銀行 | 900 |
| | 43 | 8374 三重銀行 | 1,000 |
| | 44 | 8377 ほくほくフィナンシャルグループ | 16,000 |
| | 45 | 8379 広島銀行 | 7,000 |
| | 46 | 8381 山陰合同銀行 | 1,000 |
| | 47 | 8382 中国銀行 | 1,700 |
| | 48 | 8383 鳥取銀行 | 1,000 |
| | 49 | 8385 伊予銀行 | 2,500 |
| | 50 | 8386 百十四銀行 | 3,000 |

ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|----|------|----------------|---------|
| 51 | 8387 | 四国銀行 | 2,000 |
| 52 | 8388 | 阿波銀行 | 2,000 |
| 53 | 8390 | 鹿児島銀行 | 2,000 |
| 54 | 8392 | 大分銀行 | 1,000 |
| 55 | 8393 | 宮崎銀行 | 2,000 |
| 56 | 8394 | 肥後銀行 | 2,000 |
| 57 | 8395 | 佐賀銀行 | 1,000 |
| 58 | 8396 | 十八銀行 | 1,000 |
| 59 | 8397 | 沖縄銀行 | 200 |
| 60 | 8399 | 琉球銀行 | 500 |
| 61 | 8410 | セブン銀行 | 7,900 |
| 62 | 8411 | みずほフィナンシャルグループ | 326,300 |
| 63 | 8416 | 高知銀行 | 1,000 |
| 64 | 8418 | 山口フィナンシャルグループ | 2,000 |
| 65 | 8521 | 長野銀行 | 1,000 |
| 66 | 8522 | 名古屋銀行 | 2,000 |
| 67 | 8524 | 北洋銀行 | 3,500 |
| 68 | 8527 | 愛知銀行 | 100 |
| 69 | 8529 | 第三銀行 | 1,000 |
| 70 | 8530 | 中京銀行 | 1,000 |
| 71 | 8536 | 東日本銀行 | 1,000 |
| 72 | 8537 | 大光銀行 | 1,000 |
| 73 | 8541 | 愛媛銀行 | 1,000 |
| 74 | 8542 | トマト銀行 | 1,000 |
| 75 | 8543 | みなと銀行 | 2,000 |
| 76 | 8544 | 京葉銀行 | 2,000 |
| 77 | 8545 | 関西アーバン銀行 | 300 |
| 78 | 8550 | 栃木銀行 | 1,000 |
| 79 | 8551 | 北日本銀行 | 100 |
| 80 | 8558 | 東和銀行 | 3,000 |
| 81 | 8562 | 福島銀行 | 3,000 |
| 82 | 8563 | 大東銀行 | 1,000 |
| 83 | 8600 | トモニホールディングス | 1,800 |
| 84 | 8713 | フィデアホールディングス | 1,400 |
| 85 | 8714 | 池田泉州ホールディングス | 2,200 |

平成27年7月10日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 白 川 真
(コード番号 1585)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の上場受益権口数
(平成27年7月9日 現在)

13,950,564 口

2. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の純資産総額
(平成27年7月9日 現在)

18,556,417,707 円

3. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の一口あたりの純資産額
(平成27年7月9日 現在)

1,330.155 円

4. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』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7月9日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成27年7月10日 現在)

[掲載番号:6]

ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials (設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成27年7月10日
追加設定日 = 平成27年7月16日

平成27年7月10日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 白 川 真
(コード番号 1599)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の上場受益権口数
(平成27年7月9日 現在)

3,160,890 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の純資産総額
(平成27年7月9日 現在)

45,766,870,446 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の一口あたりの純資産額
(平成27年7月9日 現在)

14,479.109 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』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7月9日 現在)

0.01 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成27年7月10日 現在)

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----------------------|-----|-----------------------|-------|
| 単位 = 1 バスケット | 1 | 1605 国際石油開発帝石 | 5,000 |
| 銘柄数 = 387 | 2 | 1719 安藤・間 | 600 |
| バスケット提示日 = 平成27年7月10日 | 3 | 1721 コムシスホールディングス | 400 |
| 追加設定日 = 平成27年7月16日 | 4 | 1722 ミサワホーム | 100 |
| | 5 | 1801 大成建設 | 5,000 |
| | 6 | 1808 長谷工コーポレーション | 1,200 |
| | 7 | 1812 鹿島建設 | 4,000 |
| | 8 | 1878 大東建託 | 400 |
| | 9 | 1911 住友林業 | 700 |
| | 10 | 1925 大和ハウス工業 | 2,800 |
| | 11 | 1928 積水ハウス | 3,000 |
| | 12 | 1951 協和エクシオ | 400 |
| | 13 | 1963 日揮 | 1,000 |
| | 14 | 1983 東芝プラントシステム | 200 |
| | 15 | 2002 日清製粉グループ本社 | 1,000 |
| | 16 | 2131 アコーディア・ゴルフ | 300 |
| | 17 | 2181 テンプホールディングス | 200 |
| | 18 | 2229 カルビー | 400 |
| | 19 | 2267 ヤクルト本社 | 500 |
| | 20 | 2269 明治ホールディングス | 300 |
| | 21 | 2282 日本ハム | 1,000 |
| | 22 | 2371 カカクコム | 600 |
| | 23 | 2413 エムスリー | 800 |
| | 24 | 2432 ディー・エヌ・エー | 400 |
| | 25 | 2433 博報堂DYホールディングス | 1,200 |
| | 26 | 2502 アサヒグループホールディングス | 1,900 |
| | 27 | 2503 キリンホールディングス | 3,900 |
| | 28 | 2593 伊藤園 | 300 |
| | 29 | 2651 ローソン | 300 |
| | 30 | 2670 エービーシー・マート | 100 |
| | 31 | 2681 ゲオホールディングス | 200 |
| | 32 | 2702 日本マクドナルドホールディングス | 400 |
| | 33 | 2768 双日 | 5,600 |
| | 34 | 2782 セリア | 100 |
| | 35 | 2784 アルフレッサ ホールディングス | 1,000 |
| | 36 | 2801 キッコーマン | 1,000 |
| | 37 | 2802 味の素 | 2,000 |
| | 38 | 2809 キューピー | 500 |
| | 39 | 2871 ニチレイ | 1,000 |
| | 40 | 2875 東洋水産 | 500 |
| | 41 | 2897 日清食品ホールディングス | 400 |
| | 42 | 2914 日本たばこ産業 | 4,600 |
| | 43 | 3003 ヒューリック | 1,600 |
| | 44 | 3064 MonotaRO | 200 |
| | 45 | 3086 J. フロント リテイリング | 1,100 |
| | 46 | 3088 マツモトキヨシホールディングス | 200 |
| | 47 | 3092 スタートトゥデイ | 300 |
| | 48 | 3099 三越伊勢丹ホールディングス | 1,700 |
| | 49 | 3116 トヨタ紡織 | 300 |
| | 50 | 3141 ウエルシアホールディングス | 100 |

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|--|-----|---------------------------|--------|
| | 51 | 3231 野村不動産ホールディングス | 500 |
| | 52 | 3289 東急不動産ホールディングス | 2,200 |
| | 53 | 3291 飯田グループホールディングス | 500 |
| | 54 | 3360 シップヘルスケアホールディングス | 200 |
| | 55 | 3382 セブン&アイ・ホールディングス | 3,500 |
| | 56 | 3391 ツルハホールディングス | 200 |
| | 57 | 3402 東レ | 7,000 |
| | 58 | 3405 クラレ | 1,500 |
| | 59 | 3407 旭化成 | 6,000 |
| | 60 | 3632 グリー | 500 |
| | 61 | 3738 ティーガイア | 100 |
| | 62 | 3765 ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 2,100 |
| | 63 | 3774 インターネットイニシアティブ | 100 |
| | 64 | 3861 王子ホールディングス | 4,000 |
| | 65 | 4004 昭和電工 | 6,000 |
| | 66 | 4021 日産化学工業 | 600 |
| | 67 | 4042 東ソー | 2,000 |
| | 68 | 4045 東亜合成 | 600 |
| | 69 | 4061 電気化学工業 | 2,000 |
| | 70 | 4063 信越化学工業 | 1,600 |
| | 71 | 4088 エア・ウォーター | 1,000 |
| | 72 | 4091 太陽日酸 | 1,100 |
| | 73 | 4095 日本パーカライジング | 400 |
| | 74 | 4114 日本触媒 | 1,000 |
| | 75 | 4151 協和発酵キリン | 1,000 |
| | 76 | 4185 JSR | 900 |
| | 77 | 4188 三菱ケミカルホールディングス | 5,600 |
| | 78 | 4202 ダイセル | 1,300 |
| | 79 | 4204 積水化学工業 | 2,000 |
| | 80 | 4205 日本ゼオン | 1,000 |
| | 81 | 4206 アイカ工業 | 300 |
| | 82 | 4208 宇部興産 | 4,000 |
| | 83 | 4217 日立化成 | 400 |
| | 84 | 4272 日本化薬 | 1,000 |
| | 85 | 4307 野村総合研究所 | 500 |
| | 86 | 4324 電通 | 1,000 |
| | 87 | 4452 花王 | 2,400 |
| | 88 | 4502 武田薬品工業 | 3,300 |
| | 89 | 4503 アステラス製薬 | 10,000 |
| | 90 | 4507 塩野義製薬 | 1,400 |
| | 91 | 4508 田辺三菱製薬 | 1,000 |
| | 92 | 4519 中外製薬 | 900 |
| | 93 | 4523 エーザイ | 1,200 |
| | 94 | 4527 ロート製薬 | 400 |
| | 95 | 4528 小野薬品工業 | 400 |
| | 96 | 4530 久光製薬 | 300 |
| | 97 | 4534 持田製薬 | 100 |
| | 98 | 4536 参天製薬 | 1,600 |
| | 99 | 4540 ツムラ | 300 |
| | 100 | 4543 テルモ | 1,300 |

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----|------|--------------------|--------|
| 101 | 4544 | みらかホールディングス | 200 |
| 102 | 4555 | 沢井製薬 | 100 |
| 103 | 4568 | 第一三共 | 3,000 |
| 104 | 4569 | キョーリン製薬ホールディングス | 200 |
| 105 | 4578 | 大塚ホールディングス | 1,800 |
| 106 | 4581 | 大正製薬ホールディングス | 200 |
| 107 | 4612 | 日本ペイントホールディングス | 800 |
| 108 | 4613 | 関西ペイント | 1,000 |
| 109 | 4631 | DIC | 4,000 |
| 110 | 4634 | 東洋インキSCホールディングス | 1,000 |
| 111 | 4661 | オリエンタルランド | 1,000 |
| 112 | 4666 | パーク24 | 400 |
| 113 | 4676 | フジ・メディア・ホールディングス | 900 |
| 114 | 4681 | リゾートトラスト | 300 |
| 115 | 4684 | オービック | 300 |
| 116 | 4689 | ヤフー | 6,000 |
| 117 | 4704 | トレンドマイクロ | 400 |
| 118 | 4708 | もしもしホットライン | 200 |
| 119 | 4716 | 日本オラクル | 100 |
| 120 | 4732 | ユー・エス・エス | 1,100 |
| 121 | 4739 | 伊藤忠テクノソリューションズ | 200 |
| 122 | 4751 | サイバーエージェント | 200 |
| 123 | 4755 | 楽天 | 4,200 |
| 124 | 4768 | 大塚商会 | 200 |
| 125 | 4842 | USEN | 400 |
| 126 | 4901 | 富士フイルムホールディングス | 2,000 |
| 127 | 4902 | コニカミノルタ | 2,000 |
| 128 | 4911 | 資生堂 | 1,600 |
| 129 | 4924 | ドクターシーラボ | 100 |
| 130 | 4967 | 小林製薬 | 100 |
| 131 | 5002 | 昭和シェル石油 | 800 |
| 132 | 5012 | 東燃ゼネラル石油 | 1,000 |
| 133 | 5019 | 出光興産 | 400 |
| 134 | 5020 | JXホールディングス | 9,900 |
| 135 | 5101 | 横浜ゴム | 500 |
| 136 | 5105 | 東洋ゴム工業 | 400 |
| 137 | 5108 | ブリヂストン | 2,800 |
| 138 | 5110 | 住友ゴム工業 | 700 |
| 139 | 5201 | 旭硝子 | 4,000 |
| 140 | 5214 | 日本電気硝子 | 2,000 |
| 141 | 5233 | 太平洋セメント | 6,000 |
| 142 | 5332 | TOTO | 1,000 |
| 143 | 5334 | 日本特殊陶業 | 800 |
| 144 | 5401 | 新日鐵住金 | 38,000 |
| 145 | 5411 | ジェイ エフ イー ホールディングス | 2,300 |
| 146 | 5471 | 大同特殊鋼 | 1,000 |
| 147 | 5486 | 日立金属 | 900 |
| 148 | 5631 | 日本製鋼所 | 1,000 |
| 149 | 5706 | 三井金属鉱業 | 2,000 |
| 150 | 5711 | 三菱マテリアル | 6,000 |

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----|------|-------------------|--------|
| 151 | 5713 | 住友金属鉱山 | 2,000 |
| 152 | 5714 | DOWAホールディングス | 1,000 |
| 153 | 5802 | 住友電気工業 | 3,400 |
| 154 | 5857 | アサヒホールディングス | 100 |
| 155 | 5938 | LIXILグループ | 1,300 |
| 156 | 5947 | リンナイ | 200 |
| 157 | 5949 | ユニプレス | 200 |
| 158 | 5970 | ジーテクト | 100 |
| 159 | 5991 | 日本発条 | 800 |
| 160 | 6136 | オーエスジー | 400 |
| 161 | 6146 | ディスコ | 100 |
| 162 | 6201 | 豊田自動織機 | 800 |
| 163 | 6268 | ナブテスコ | 500 |
| 164 | 6273 | SMC | 300 |
| 165 | 6301 | 小松製作所 | 4,400 |
| 166 | 6302 | 住友重機械工業 | 2,000 |
| 167 | 6305 | 日立建機 | 400 |
| 168 | 6326 | クボタ | 4,000 |
| 169 | 6361 | 荏原製作所 | 2,000 |
| 170 | 6366 | 千代田化工建設 | 1,000 |
| 171 | 6367 | ダイキン工業 | 1,200 |
| 172 | 6370 | 栗田工業 | 500 |
| 173 | 6412 | 平和 | 200 |
| 174 | 6417 | SANKYO | 200 |
| 175 | 6425 | ユニバーサルエンターテインメント | 100 |
| 176 | 6448 | ブラザー工業 | 1,100 |
| 177 | 6460 | セガサミーホールディングス | 900 |
| 178 | 6463 | TPR | 100 |
| 179 | 6465 | ホンザキ電機 | 200 |
| 180 | 6471 | 日本精工 | 1,700 |
| 181 | 6473 | ジェイテクト | 900 |
| 182 | 6474 | 不二越 | 1,000 |
| 183 | 6479 | ミネベア | 1,000 |
| 184 | 6481 | THK | 600 |
| 185 | 6501 | 日立製作所 | 20,000 |
| 186 | 6502 | 東芝 | 18,000 |
| 187 | 6503 | 三菱電機 | 9,000 |
| 188 | 6504 | 富士電機 | 2,000 |
| 189 | 6506 | 安川電機 | 1,000 |
| 190 | 6586 | マキタ | 600 |
| 191 | 6594 | 日本電産 | 900 |
| 192 | 6645 | オムロン | 900 |
| 193 | 6674 | ジーエス・ユアサ コーポレーション | 2,000 |
| 194 | 6702 | 富士通 | 8,000 |
| 195 | 6703 | 沖電気工業 | 3,000 |
| 196 | 6724 | セイコーエプソン | 1,200 |
| 197 | 6727 | ワコム | 700 |
| 198 | 6752 | パナソニック | 10,400 |
| 199 | 6754 | アンリツ | 500 |
| 200 | 6762 | TDK | 500 |

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----|------|-----------------|--------|
| 201 | 6806 | ヒロセ電機 | 100 |
| 202 | 6841 | 横河電機 | 900 |
| 203 | 6849 | 日本光電工業 | 400 |
| 204 | 6856 | 堀場製作所 | 200 |
| 205 | 6861 | キーエンス | 200 |
| 206 | 6869 | シスメックス | 700 |
| 207 | 6902 | デンソー | 2,100 |
| 208 | 6923 | スタンレー電気 | 600 |
| 209 | 6952 | カシオ計算機 | 900 |
| 210 | 6954 | ファナック | 900 |
| 211 | 6965 | 浜松ホトニクス | 700 |
| 212 | 6971 | 京セラ | 1,400 |
| 213 | 6981 | 村田製作所 | 900 |
| 214 | 6988 | 日東電工 | 700 |
| 215 | 7003 | 三井造船 | 3,000 |
| 216 | 7011 | 三菱重工業 | 14,000 |
| 217 | 7012 | 川崎重工業 | 6,000 |
| 218 | 7013 | IHI | 6,000 |
| 219 | 7014 | 名村造船所 | 200 |
| 220 | 7201 | 日産自動車 | 11,900 |
| 221 | 7202 | いすゞ自動車 | 2,700 |
| 222 | 7203 | トヨタ自動車 | 2,700 |
| 223 | 7205 | 日野自動車 | 1,200 |
| 224 | 7211 | 三菱自動車工業 | 3,100 |
| 225 | 7240 | NOK | 400 |
| 226 | 7242 | カヤバ工業 | 1,000 |
| 227 | 7245 | 大同メタル工業 | 100 |
| 228 | 7248 | カルソニックカンセイ | 1,000 |
| 229 | 7259 | アイシン精機 | 800 |
| 230 | 7261 | マツダ | 2,500 |
| 231 | 7262 | ダイハツ工業 | 1,000 |
| 232 | 7267 | 本田技研工業 | 4,800 |
| 233 | 7269 | スズキ | 1,800 |
| 234 | 7270 | 富士重工業 | 2,900 |
| 235 | 7272 | ヤマハ発動機 | 1,300 |
| 236 | 7276 | 小糸製作所 | 500 |
| 237 | 7278 | エクセディ | 100 |
| 238 | 7280 | ミツバ | 200 |
| 239 | 7282 | 豊田合成 | 300 |
| 240 | 7296 | エフ・シー・シー | 100 |
| 241 | 7309 | シマノ | 400 |
| 242 | 7313 | テイ・エス テック | 200 |
| 243 | 7451 | 三菱食品 | 100 |
| 244 | 7453 | 良品計画 | 100 |
| 245 | 7458 | 第一興商 | 200 |
| 246 | 7459 | メディopalホールディングス | 800 |
| 247 | 7532 | ドンキホーテホールディングス | 500 |
| 248 | 7593 | VTホールディングス | 300 |
| 249 | 7606 | ユナイテッドアローズ | 100 |
| 250 | 7649 | スギホールディングス | 200 |

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----|------|----------------------|--------|
| 251 | 7731 | ニコン | 1,600 |
| 252 | 7741 | HOYA | 2,000 |
| 253 | 7751 | キヤノン | 4,900 |
| 254 | 7752 | リコー | 2,600 |
| 255 | 7832 | バンダイナムコホールディングス | 900 |
| 256 | 7860 | エイベックス・グループ・ホールディングス | 200 |
| 257 | 7936 | アシックス | 800 |
| 258 | 7947 | エフピコ | 100 |
| 259 | 7956 | ピジョン | 500 |
| 260 | 7988 | ニフコ | 200 |
| 261 | 8001 | 伊藤忠商事 | 7,000 |
| 262 | 8002 | 丸紅 | 7,300 |
| 263 | 8015 | 豊田通商 | 900 |
| 264 | 8020 | 兼松 | 2,000 |
| 265 | 8028 | ファミリーマート | 300 |
| 266 | 8031 | 三井物産 | 7,100 |
| 267 | 8036 | 日立ハイテクノロジーズ | 300 |
| 268 | 8051 | 山善 | 300 |
| 269 | 8053 | 住友商事 | 5,000 |
| 270 | 8058 | 三菱商事 | 6,400 |
| 271 | 8088 | 岩谷産業 | 1,000 |
| 272 | 8113 | ユニ・チャーム | 1,800 |
| 273 | 8129 | 東邦ホールディングス | 300 |
| 274 | 8136 | サンリオ | 200 |
| 275 | 8214 | AOKIホールディングス | 200 |
| 276 | 8218 | コメリ | 100 |
| 277 | 8227 | しまむら | 100 |
| 278 | 8233 | 高島屋 | 1,000 |
| 279 | 8253 | クレディセゾン | 700 |
| 280 | 8267 | イオン | 3,400 |
| 281 | 8270 | ユニーグループ・ホールディングス | 800 |
| 282 | 8273 | イズミ | 200 |
| 283 | 8282 | ケーズホールディングス | 200 |
| 284 | 8303 | 新生銀行 | 8,000 |
| 285 | 8304 | あおぞら銀行 | 6,000 |
| 286 | 8306 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 28,800 |
| 287 | 8308 | りそなホールディングス | 9,800 |
| 288 | 8309 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 19,000 |
| 289 | 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ | 4,000 |
| 290 | 8327 | 西日本シティ銀行 | 3,000 |
| 291 | 8331 | 千葉銀行 | 3,000 |
| 292 | 8332 | 横浜銀行 | 6,000 |
| 293 | 8333 | 常陽銀行 | 3,000 |
| 294 | 8334 | 群馬銀行 | 2,000 |
| 295 | 8354 | ふくおかフィナンシャルグループ | 3,000 |
| 296 | 8355 | 静岡銀行 | 2,000 |
| 297 | 8356 | 十六銀行 | 1,000 |
| 298 | 8358 | スルガ銀行 | 900 |
| 299 | 8359 | 八十二銀行 | 2,000 |
| 300 | 8377 | ほくほくフィナンシャルグループ | 6,000 |

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|--|-----|---------------------------|--------|
| | 301 | 8379 広島銀行 | 2,000 |
| | 302 | 8382 中国銀行 | 800 |
| | 303 | 8385 伊予銀行 | 1,200 |
| | 304 | 8410 セブン銀行 | 2,800 |
| | 305 | 8411 みずほフィナンシャルグループ | 87,100 |
| | 306 | 8418 山口フィナンシャルグループ | 1,000 |
| | 307 | 8424 芙蓉総合リース | 100 |
| | 308 | 8425 興銀リース | 200 |
| | 309 | 8439 東京センチュリーリース | 200 |
| | 310 | 8508 Jトラスト | 300 |
| | 311 | 8515 アイフル | 1,400 |
| | 312 | 8524 北洋銀行 | 1,300 |
| | 313 | 8544 京葉銀行 | 1,000 |
| | 314 | 8566 リコーリース | 100 |
| | 315 | 8570 イオンフィナンシャルサービス | 600 |
| | 316 | 8572 アコム | 1,700 |
| | 317 | 8586 日立キャピタル | 200 |
| | 318 | 8591 オリックス | 5,900 |
| | 319 | 8593 三菱UFJリース | 2,100 |
| | 320 | 8601 大和証券グループ本社 | 8,000 |
| | 321 | 8604 野村ホールディングス | 17,200 |
| | 322 | 8609 岡三証券グループ | 1,000 |
| | 323 | 8616 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 1,000 |
| | 324 | 8628 松井証券 | 400 |
| | 325 | 8697 日本取引所グループ | 1,200 |
| | 326 | 8729 ソニーフィナンシャルホールディングス | 800 |
| | 327 | 8750 第一生命保険 | 5,400 |
| | 328 | 8766 東京海上ホールディングス | 3,400 |
| | 329 | 8795 T&Dホールディングス | 3,100 |
| | 330 | 8801 三井不動産 | 4,000 |
| | 331 | 8802 三菱地所 | 6,000 |
| | 332 | 8830 住友不動産 | 2,000 |
| | 333 | 8840 大京 | 1,000 |
| | 334 | 8848 レオパレス21 | 900 |
| | 335 | 8870 住友不動産販売 | 100 |
| | 336 | 8897 タカラレーベン | 400 |
| | 337 | 8905 イオンモール | 500 |
| | 338 | 8933 エス・ティ・ティ都市開発 | 500 |
| | 339 | 9001 東武鉄道 | 5,000 |
| | 340 | 9003 相鉄ホールディングス | 2,000 |
| | 341 | 9005 東京急行電鉄 | 5,000 |
| | 342 | 9007 小田急電鉄 | 3,000 |
| | 343 | 9008 京王電鉄 | 2,000 |
| | 344 | 9009 京成電鉄 | 1,000 |
| | 345 | 9020 東日本旅客鉄道 | 1,600 |
| | 346 | 9021 西日本旅客鉄道 | 800 |
| | 347 | 9022 東海旅客鉄道 | 800 |
| | 348 | 9031 西日本鉄道 | 1,000 |
| | 349 | 9041 近鉄グループホールディングス | 9,000 |
| | 350 | 9042 阪急阪神ホールディングス | 6,000 |

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----|------|---------------|--------|
| 351 | 9045 | 京阪電気鉄道 | 3,000 |
| 352 | 9048 | 名古屋鉄道 | 4,000 |
| 353 | 9062 | 日本通運 | 3,000 |
| 354 | 9064 | ヤマトホールディングス | 1,500 |
| 355 | 9065 | 山九 | 1,000 |
| 356 | 9086 | 日立物流 | 200 |
| 357 | 9202 | ANAホールディングス | 17,000 |
| 358 | 9364 | 上組 | 1,000 |
| 359 | 9375 | 近鉄エクスプレス | 100 |
| 360 | 9404 | 日本テレビホールディングス | 800 |
| 361 | 9432 | 日本電信電話 | 5,300 |
| 362 | 9433 | KDDI | 8,500 |
| 363 | 9435 | 光通信 | 100 |
| 364 | 9437 | NTTドコモ | 6,500 |
| 365 | 9449 | GMOインターネット | 300 |
| 366 | 9513 | 電源開発 | 600 |
| 367 | 9531 | 東京瓦斯 | 10,000 |
| 368 | 9532 | 大阪瓦斯 | 9,000 |
| 369 | 9602 | 東宝 | 600 |
| 370 | 9603 | エイチ・アイ・エス | 100 |
| 371 | 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ | 500 |
| 372 | 9627 | アインファーマシーズ | 100 |
| 373 | 9719 | SCSK | 200 |
| 374 | 9735 | セコム | 900 |
| 375 | 9766 | コナミ | 300 |
| 376 | 9783 | ベネッセホールディングス | 300 |
| 377 | 9787 | イオンデイライト | 100 |
| 378 | 9810 | 日鉄住金物産 | 1,000 |
| 379 | 9831 | ヤマダ電機 | 3,300 |
| 380 | 9843 | ニトリホールディングス | 400 |
| 381 | 9936 | 王将フードサービス | 100 |
| 382 | 9948 | アークス | 200 |
| 383 | 9956 | バロー | 200 |
| 384 | 9962 | ミスミグループ本社 | 900 |
| 385 | 9983 | ファーストリテイリング | 200 |
| 386 | 9984 | ソフトバンクグループ | 2,400 |
| 387 | 9989 | サンドラッグ | 200 |

平成27年7月10日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 白 川 真
(コード番号 1365)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の上場受益権口数
(平成27年7月9日 現在)

1,290,000 口

2. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の純資産総額
(平成27年7月9日 現在)

16,640,392,521 円

3. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成27年7月9日 現在)

12,899.53 円

4. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』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7月9日 現在)

0.83 %

●「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

対象指標とする「日経平均レバレッジ・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「2倍」の値動きになる指数で、「日経平均株価」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な正相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「日経平均株価」の変動率の「2倍」とはならず、計算上、差が生じます。こ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。一般に、「日経平均株価」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「日経平均レバレッジ・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率と日経平均レバレッジ・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、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と一致させることをお約束できるものではありません。

平成27年7月10日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 白 川 真
(コード番号 1366)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成27年7月9日 現在)

820,000 口

2. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の純資産総額
(平成27年7月9日 現在)

5,916,663,362 円

3. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成27年7月9日 現在)

7,215.44 円

4. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『日経平均ダブルインバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成27年7月9日 現在)

-0.84 %

●「日経平均ダブルインバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「日経平均ダブルインバース・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「-2倍」(マイナス2倍)の値動きになる指数で、「日経平均株価」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上の計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「日経平均株価」の変動率の「-2倍」とはならず、計算上、差が生じます。こ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。一般に、「日経平均株価」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「日経平均ダブルインバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率と日経平均ダブルインバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率を日経平均ダブルインバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成27年7月10日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 白 川 真
(コード番号 1367)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の上場受益権口数
(平成27年7月9日 現在)

360,000 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の純資産総額
(平成27年7月9日 現在)

4,573,973,243 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の一口あたりの純資産額
(平成27年7月9日 現在)

12,705.48 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成27年7月9日 現在)

1.40 %

●「TOPIXレバレッジ(2倍)指数」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「TOPIXレバレッジ(2倍)指数」は原指標の「TOPIX」の変動率の「2倍」の値動きになる指数で、「TOPIX」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な正相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「TOPIX」の変動率の「2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「TOPIX」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。一般に、「TOPIX」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「TOPIXレバレッジ(2倍)指数」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とTOPIXレバレッジ(2倍)指数の変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、TOPIXの値動きとTOPIX先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をTOPIXレバレッジ(2倍)指数の変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成27年7月10日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 白 川 真
(コード番号 1368)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の上場受益権口数
(平成27年7月9日 現在)

230,000 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の純資産総額
(平成27年7月9日 現在)

1,700,686,643 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の一口あたりの純資産額
(平成27年7月9日 現在)

7,394.29 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成27年7月9日 現在)

-1.40 %

●「TOPIXダブルインバース(-2倍)指数」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「TOPIXダブルインバース(-2倍)指数」は原指標の「TOPIX」の変動率の「-2倍」(マイナス2倍)の値動きになる指数で、「TOPIX」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「TOPIX」の変動率の「-2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「TOPIX」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。一般に、「TOPIX」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「TOPIXダブルインバース(-2倍)指数」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とTOPIXダブルインバース(-2倍)指数の変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、TOPIXの値動きとTOPIX先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をTOPIXダブルインバース(-2倍)指数の変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成27年7月10日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 白 川 真
(コード番号 1456)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成27年7月9日 現在)

260,000 口

2. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の純資産総額
(平成27年7月9日 現在)

2,601,397,987 円

3. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成27年7月9日 現在)

10,005.38 円

4. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『日経平均インバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成27年7月9日 現在)

-0.42 %

●「日経平均インバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「日経平均インバース・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「-1倍」(マイナス1倍)の値動きになる指数で、「日経平均株価」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-1倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「日経平均株価」の変動率の「-1倍」とはならず、計算上、差が生じます。こ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。一般に、「日経平均株価」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。

【「日経平均インバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率と日経平均インバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率を日経平均インバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成27年7月10日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 白 川 真
(コード番号 1457)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の上場受益権口数
(平成27年7月9日 現在)

260,000 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の純資産総額
(平成27年7月9日 現在)

2,645,547,853 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の一口あたりの純資産額
(平成27年7月9日 現在)

10,175.18 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIXインバース(-1倍)指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成27年7月9日 現在)

-0.70 %

●「TOPIXインバース(-1倍)指数」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「TOPIXインバース(-1倍)指数」は原指標の「TOPIX」の変動率の「-1倍」(マイナス1倍)の値動きになる指数で、「TOPIX」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-1倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「TOPIX」の変動率の「-1倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「TOPIX」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。一般に、「TOPIX」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。

【「TOPIXインバース(-1倍)指数」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とTOPIXインバース(-1倍)指数の変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、TOPIXの値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をTOPIXインバース(-1倍)指数の変動率と一致させることをお約束できるものではありません。