

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23日現在)

5,198,112 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年7月23日現在)

107,523,023,325 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年7月23日現在)

20,685 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23日現在)

-0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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
2015/6/25	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
2015/7/2	20,522.50	0.95%	20,678	0.94%	-0.01%	5,452,381	112,745,588,888
2015/7/3	20,539.79	0.08%	20,695	0.08%	-0.00%	5,452,381	112,838,318,839
2015/7/6	20,112.12	-2.08%	20,266	-2.07%	0.01%	5,452,381	110,495,471,132
2015/7/7	20,376.59	1.31%	20,531	1.31%	-0.01%	5,452,381	111,943,479,655
2015/7/8	19,737.64	-3.14%	19,740	-3.85%	-0.72%	5,452,381	107,628,625,441
2015/7/9	19,855.50	0.60%	19,858	0.60%	0.00%	5,452,381	108,274,852,759
2015/7/10	19,779.83	-0.38%	19,783	-0.38%	0.00%	5,452,381	107,865,606,502
2015/7/13	20,089.77	1.57%	20,092	1.56%	-0.01%	5,452,381	109,549,689,851
2015/7/14	20,385.33	1.47%	20,388	1.47%	0.00%	5,452,381	111,162,858,257
2015/7/15	20,463.33	0.38%	20,465	0.38%	-0.00%	5,452,381	111,584,439,540
2015/7/16	20,600.12	0.67%	20,602	0.67%	0.00%	5,452,381	112,328,211,880
2015/7/17	20,650.92	0.25%	20,653	0.25%	0.00%	5,452,381	112,606,072,125
2015/7/21	20,841.97	0.93%	20,843	0.92%	-0.01%	5,452,381	113,645,985,348
2015/7/22	20,593.67	-1.19%	20,595	-1.19%	0.00%	5,198,112	107,053,371,087
2015/7/23	20,683.95	0.44%	20,685	0.44%	-0.00%	5,198,112	107,523,023,325

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(平成27年7月29日)、交換受付日(平成27年7月29日)分の  
交換口数は以下の通りです。

交換口数 51,100 口の整数倍

## 設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(平成27年7月29日)、設定受付日(平成27年7月29日)分の  
設定ポートフォリオは以下の通りです。

(注)備考欄に※のある銘柄については、金銭による設定(取得)のお申込みを受け付けません。(有価証券による設定(取得)のお申込みは受け付けません。)

No.	銘柄コード	銘柄名	枚数	備考
1	1332	日本水産	2,000	
2	1333	マルハニチロ	200	
3	1605	国際石油開発帝石	800	
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	

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数	備考
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	大平洋金属	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	オークマ	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	
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	

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数	備考
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	カシオ計算機	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	
151	7735	SCREENホールディングス	2,000	
152	7751	キヤノン	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	

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数	備考
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	
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	

以上