

平成27年8月6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8月5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8月6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8月5日 現在)

70,598,592 口

2. 『ダイワ上場投信一日経225』の純資産総額
(平成27年8月5日 現在)

1,481,204,348,266 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8月5日 現在)

20,980.6 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8月5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8月6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8月6日	3	1605 国際石油開発帝石	800
追加設定日 = 平成27年8月12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

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

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8月6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8月5日 現在)

801,697,292 口

2. 『ダイワ上場投信―トピックス』の純資産総額

(平成27年8月5日 現在)

1,377,124,388,897 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8月5日 現在)

1,717.76 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8月5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8月6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8月6日
追加設定日 = 平成27年8月12日

平成27年8月6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8月5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8月5日 現在)

2,110,620,507 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8月5日 現在)

810.971 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8月5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8月6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	9,600
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8月6日	3	4063 信越化学工業	2,700
追加設定日 = 平成27年8月12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	65,000
	7	6301 小松製作所	7,400
	8	6501 日立製作所	35,000
	9	6752 パナソニック	17,700
	10	6758 ソニー	10,200
	11	6902 デンソー	3,600
	12	6954 ファナック	1,500
	13	7201 日産自動車	20,300
	14	7203 トヨタ自動車	20,000
	15	7267 本田技研工業	13,000
	16	7751 キヤノン	7,800
	17	8031 三井物産	12,100
	18	8058 三菱商事	11,000
	19	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	114,700
	20	8316 三井住友フィナンシャルグループ	10,800
	21	8411 みずほフィナンシャルグループ	200,500
	22	8604 野村ホールディングス	29,200
	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	14,500
	29	9437 NTTドコモ	11,000
	30	9984 ソフトバンクグループ	7,600

平成27年8月6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8月5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8月5日 現在)

2,099,975,872 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8月5日 現在)

2,051.359 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8月5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8月6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	16,700
バスケット提示日 = 平成27年8月6日	3	6448 ブラザー工業	9,200
追加設定日 = 平成27年8月12日	4	6479 ミネベア	11,000
	5	6501 日立製作所	171,000
	6	6502 東芝	150,000
	7	6503 三菱電機	71,000
	8	6504 富士電機	20,000
	9	6505 東洋電機製造	1,000
	10	6506 安川電機	8,700
	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	2,000
	19	6594 日本電産	7,800
	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	5,200
	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	7,700
	31	6651 日東工業	1,100
	32	6652 IDEC	800
	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	92,000
	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	9,700
	48	6727 ワコム	5,600
	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	14,600
53	6741	日本信号	2,000
54	6742	京三製作所	2,000
55	6744	能美防災	900
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	87,200
60	6753	シャープ	60,000
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	50,000
65	6762	TDK	4,300
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	10,700
72	6779	日本電波工業	600
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	1,000
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	800
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	7,100
95	6844	新電元工業	3,000
96	6845	アズビル	2,300
97	6848	東亜ディーケーケー	300
98	6849	日本光電工業	3,000
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	エスペック	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	5,500
110	6875	メガチップス	700
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	5,100
119	6924	岩崎電気	2,000
120	6925	ウシオ電機	4,300
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	7,100
132	6954	ファナック	7,400
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	3,500
137	6965	浜松ホトニクス	5,600
138	6966	三井ハイテック	900
139	6967	新光電気工業	2,700
140	6971	京セラ	11,700
141	6976	太陽誘電	3,700
142	6981	村田製作所	7,500
143	6985	ユーシン	900
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	2,200
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	38,300
156	7752	リコー	21,400
157	7999	MUTOHホールディングス	1,000
158	8035	東京エレクトロン	6,000

平成27年8月6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8月5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8月5日 現在)

1,054,767,579 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8月5日 現在)

225.650 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8月5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8月6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8月6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8月12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	187,400
	7	8308 りそなホールディングス	27,300
	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	600
	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	327,600
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	1,600
85	8714	池田泉州ホールディングス	2,200

平成27年8月6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8月5日 現在)

15,918,924 口

2. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の純資産総額
(平成27年8月5日 現在)

22,051,770,055 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8月5日 現在)

1,385.255 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8月5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8月6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8月6日
追加設定日 = 平成27年8月12日

平成27年8月6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8月5日 現在)

3,458,005 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の純資産総額
(平成27年8月5日 現在)

52,279,996,001 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8月5日 現在)

15,118.543 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8月5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8月6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8月6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8月12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	1,800
	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	4,900
	43	3003 ヒューリック	1,700
	44	3064 MonotaRO	100
	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	シブ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	1,400
59	3407	旭化成	6,000
60	3632	グリーン	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	2,000
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	1,900
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	4,100
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	900
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	3,000
138	5110	住友ゴム工業	800
139	5201	旭硝子	5,000
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	8,000
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	1,200
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	300
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	4,600
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	4,900
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	3,300
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	28,700
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	87,500
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	17,100
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8月6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8月5日 現在)

1,340,000 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8月5日 現在)

18,559,976,867 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8月5日 現在)

13,850.73 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8月5日 現在)

0.55 %

●「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8月6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8月5日 現在)

750,000 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8月5日 現在)

5,008,195,660 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8月5日 現在)

6,677.59 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8月5日 現在)

-0.55 %

●「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8月6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8月5日 現在)

340,000 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8月5日 現在)

4,771,693,334 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8月5日 現在)

14,034.39 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8月5日 現在)

0.61 %

●「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8月6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8月5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8月5日 現在)

1,529,351,741 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8月5日 現在)

6,649.36 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8月5日 現在)

-0.61 %

●「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8月6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8月5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8月5日 現在)

2,503,513,904 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8月5日 現在)

9,628.90 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8月5日 現在)

-0.28 %

●「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8月6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8月5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8月5日 現在)

2,509,455,339 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8月5日 現在)

9,651.75 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8月5日 現在)

-0.30 %

●「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。