

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 代表取締役社長 柴田 拓美
 問合せ先 事務企画管理部 中田 眞帆
 (TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在の状況をご報告します。

上場 ETF 銘柄 (20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中国A株(パンダ)CSI300	1322	東
5	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
6	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
7	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
8	上場インデックスファンド海外先進国株式 (MSCI-KOKUSAI)	1680	東
9	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
10	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
11	上場インデックスファンド米国株式 (S&P500)	1547	東
12	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
13	上場インデックスファンドCNX Nifty先物(インド株式)	1549	東
14	上場インデックスファンド世界株式 (MSCI ACWI) 除く日本	1554	東
15	上場インデックスファンド豪州リート(S&P/ASX200 A-REIT)	1555	東
16	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
17	上場インデックスファンド日経225(ミニ)	1578	東
18	上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financials	1586	東
19	上場インデックスファンドJPX日経インデックス400	1592	東
20	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

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1330)
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

80,001,950 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

1,563,728,373,969 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

19,546 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8月28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)

[2015/08/31 は設定交換申込不可日のため開示を行いません]

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。

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1308)
問合せ先 事務企画管理部 中田 眞帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

805,376,037 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

1,257,363,559,123 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

1,561.21 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8月28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)

[2015/08/31 は設定交換申込不可日のため開示を行いません]

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。

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1314)
問合せ先 事務企画管理部 中田 眞帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

609,352 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

631,750,550 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

1,036.76 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8月28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)

[2015/08/31 は設定交換申込不可日のため開示を行いません]

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。

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1322)
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

872,220 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

4,823,161,673 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

5,530 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8月28日現在)

0.35%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 代表取締役社長 柴田 拓美
 (コード番号 1345)
 問合せ先 事務企画管理部 中田 眞帆
 (TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンドリート(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8月28日現在)

56,617,660 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

94,122,327,287 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

1,662.42 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8月28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:5]

上場インデックスファンドJリート PCF(ユニット投資口)

[2015/08/31 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。

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1347)
問合せ先 事務企画管理部 中田 眞帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

77,477 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

373,575,034 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

4,821.75 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8月28日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

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

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:6]

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)

[2015/08/31 は設定交換申込不可日のため開示を行いません]

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。

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1677)
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

119,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

6,878,207,676 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

57,800 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8月28日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1680)
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

4,900,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

10,139,614,343 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

2,069.31 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8月28日現在)

0.37%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1681)
問合せ先 事務企画管理部 中田 眞帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

4,700,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

5,839,209,991 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

1,242.39 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8月28日現在)

△ 0.19%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1698)
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

3,767,151 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

6,283,507,347 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

1,667.97 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8月28日現在)

△ 0.03%

(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:10]

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)

[2015/08/31 申込分]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	1414	ショーボンドホールディングス	100
2	1878	大東建託	100
3	1925	大和ハウス工業	700
4	2501	サッポロホールディングス	2,000
5	2503	麒麟ホールディングス	3,600
6	2579	コカ・コーラウエスト	300
7	2580	コカ・コーライーストジャパン	300
8	2587	サントリー食品インターナショナル	600
9	2768	双日	1,500
10	2914	日本たばこ産業	5,100
11	3076	あい ホールディングス	200
12	3405	クラレ	1,700
13	4004	昭和電工	7,000
14	4045	東亜合成	600
15	4151	協和発酵キリン	1,000
16	4185	JSR	200
17	4324	電通	1,000
18	4452	花王	2,300
19	4502	武田薬品工業	800
20	4508	田辺三菱製薬	200
21	4568	第一三共	600
22	4578	大塚ホールディングス	1,600
23	4631	DIC	4,000
24	4704	トレンドマイクロ	400
25	4768	大塚商会	200
26	4902	コニカミノルタ	500
27	4927	ポーラ・オルビスホールディングス	100
28	4985	アース製薬	100
29	5002	昭和シェル石油	800
30	5012	東燃ゼネラル石油	1,000
31	5020	JXホールディングス	2,600
32	5101	横浜ゴム	500
33	5105	東洋ゴム工業	400
34	5108	ブリヂストン	3,000
35	5110	住友ゴム工業	800
36	5201	旭硝子	5,000
37	5214	日本電気硝子	2,000
38	5301	東海カーボン	1,000
39	5401	新日鐵住金	11,000
40	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	700
41	5711	三菱マテリアル	2,000
42	5713	住友金属鉱山	1,000
43	5938	LIXILグループ	300
44	5943	ノーリツ	200
45	5959	岡部	200
46	6113	アマダホールディングス	400
47	6141	DMG森精機	800
48	6268	ナブテスコ	700
49	6301	小松製作所	1,200
50	6310	井関農機	1,000
51	6326	クボタ	4,000

52	6376	日機装	300
53	6440	JUKI	200
54	6592	マブチモーター	300
55	6724	セイコーエプソン	300
56	6856	堀場製作所	200
57	6954	ファナック	300
58	7201	日産自動車	3,200
59	7203	トヨタ自動車	2,900
60	7205	日野自動車	300
61	7262	ダイハツ工業	300
62	7267	本田技研工業	1,900
63	7272	ヤマハ発動機	1,300
64	7751	キヤノン	5,200
65	7752	リコー	700
66	7912	大日本印刷	1,000
67	7984	コクヨ	400
68	8001	伊藤忠商事	1,900
69	8002	丸紅	1,900
70	8031	三井物産	1,900
71	8053	住友商事	1,300
72	8060	キヤノンマーケティングジャパン	300
73	8304	あおぞら銀行	1,000
74	8308	りそなホールディングス	2,400
75	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	5,000
76	8316	三井住友フィナンシャルグループ	1,600
77	8411	みずほフィナンシャルグループ	29,600
78	8591	オリックス	1,700
79	8601	大和証券グループ本社	2,000
80	8604	野村ホールディングス	4,200
81	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	200
82	8951	日本ビルファンド投資法人 投資証券	12
83	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	14
84	8955	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	7
85	8958	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2
86	8961	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	15
87	8964	フロンティア不動産投資法人 投資証券	4
88	8973	積水ハウス・SI レジデンシャル投資法人 投資	12
89	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	28
90	8986	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	19
91	8987	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	11
92	9101	日本郵船	2,000
93	9201	日本航空	400
94	9432	日本電信電話	1,500
95	9433	KDDI	2,000
96	9437	NTTドコモ	1,500
97	9504	中国電力	300
98	9505	北陸電力	200
99	9747	アサツー ディ・ケイ	200
100	9830	トラスコ中山	100

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1547)
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

2,700,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

7,069,893,433 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

2,618.48 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8月28日現在)

0.21%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1548)
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

500,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

607,785,990 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

1,215.57 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8月28日現在)

△ 0.08%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1549)
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

800,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

1,107,638,806 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

1,384.55 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8月28日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1554)
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

2,100,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

3,693,249,933 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

1,758.69 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8月28日現在)

0.31%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1555)
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

2,400,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

3,565,603,002 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

1,485.67 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8月28日現在)

0.03%

(参考) 乖離率の計算式

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

平成27年8月31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 代表取締役社長 柴田 拓美
 (コード番号 1566)
 問合せ先 事務企画管理部 中田 眞帆
 (TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

94,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

5,318,751,395 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

56,582 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8月28日現在)

0.02%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1578)
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

9,435,310 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

14,576,611,598 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

1,544.9 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8月28日現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1586)
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

3,859,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

4,971,506,376 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

1,288.3 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8月28日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1592)
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

46,313,964 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

58,656,337,914 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

1,266.5 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8月28日現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1358)
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6483)

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8月28日現在)

184,647 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年8月28日現在)

2,700,967,389 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年8月28日現在)

14,628 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8月28日現在)

0.38%

(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減衰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。