

平成27年9月14日

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9月11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9月11日現在)

81,099,314 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

1,512,774,715,457 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

18,653 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9月11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)

[ 2015/09/14 申込分 ]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
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
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
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
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	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

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9月11日現在)

813,309,037 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

1,212,691,874,603 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

1,491.06 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9月11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)

[ 2015/09/14 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9月11日現在)

609,352 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

614,263,122 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

1,008.06 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9月11日現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

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

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)

[ 2015/09/14 申込分 ]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	1407	ウエストホールディングス	100
2	1429	日本アクア	200
3	2121	ミクシィ	300
4	2146	UTグループ	200
5	2157	コシダカホールディングス	100
6	2158	UBIC	200
7	2160	ジーエヌアイグループ	1,000
8	2191	テラ	100
9	2337	いちごグループホールディングス	1,100
10	2362	夢真ホールディングス	200
11	2370	メディネット	600
12	2400	メッセージ	100
13	2438	アスカネット	100
14	2489	アドウェイズ	200
15	2492	インフォマート	300
16	2497	ユナイテッド	100
17	2702	日本マクドナルドホールディングス	500
18	2782	セリア	200
19	3244	サムティ	100
20	3664	モブキャスト	100
21	3665	エニグモ	100
22	3679	じげん	100
23	3727	アプリックスIPホールディングス	100
24	3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,100
25	3773	アドバンスト・メディア	100
26	3782	ディー・ディー・エス	200
27	3843	フリービット	100
28	3857	ラック	100
29	3858	ユビキタス	100
30	4281	デジタル・アドバタイジング・コンソーシア	200
31	4293	セブテーニ・ホールディングス	100
32	4298	プロトコーポレーション	100
33	4348	インフォコム	100
34	4563	アンジェス MG	400
35	4564	オンコセラピー・サイエンス	900
36	4565	そーせいグループ	100
37	4571	ナノキャリア	300
38	4576	デ・ウエスタン・セラピテクス研究所	100
39	4582	シンバイオ製薬	200
40	4583	カイオム・バイオサイエンス	100
41	4585	UMNファーマ	100
42	4587	ペプチドリーム	200
43	4813	ACCESS	200
44	4819	デジタルガレージ	300
45	4842	USEN	600
46	4849	エン・ジャパン	100
47	4974	タカラバイオ	400
48	4978	リプロセル	300
49	5989	エイチワン	100
50	6072	地盤ネットホールディングス	100
51	6079	エナリス	100

52	6145	日特エンジニアリング	100
53	6312	フロイント産業	100
54	6425	ユニバーサルエンターテインメント	100
55	6677	エスケエレクトロニクス	100
56	6736	サン電子	100
57	6787	メイコー	200
58	6871	日本マイクロニクス	100
59	6890	フェローテック	200
60	6908	イリソ電子工業	100
61	6960	フクダ電子	100
62	7157	ライフネット生命保険	200
63	7458	第一興商	300
64	7707	プレジジョン・システム・サイエンス	100
65	7716	ナカニシ	200
66	7774	ジャパン・ティッシュ・エンジニアリング	100
67	7776	セルシード	100
68	7777	スリー・ディー・マトリックス	100
69	7779	CYBERDYNE	400
70	8699	澤田ホールディングス	200
71	8739	スパークス・グループ	700
72	8890	レーサム	100
73	8909	シノケングループ	100
74	8914	エリアリンク	700
75	8922	日本アセットマーケティング	900
76	9419	ワイヤレスゲート	100
77	9436	沖縄セルラー電話	100
78	9514	ファーストエスコ	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 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9月11日現在)

872,220 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

5,084,616,339 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

5,830 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9月11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9月11日現在)

56,869,060 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

89,897,617,087 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

1,580.78 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9月11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)

[ 2015/09/14 申込分 ]

NO.	銘柄コード	銘柄名	投資口数
1	3226	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	10
2	3227	MCUBS MidCity投資法人 投資証券	5
3	3234	森ヒルズリート投資法人 投資証券	33
4	3240	野村不動産レジデンシャル投資法人 投資証券	3
5	3249	産業ファンド投資法人 投資証券	8
6	3263	大和ハウスリート投資法人 投資証券	7
7	3269	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	28
8	3278	ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	7
9	3279	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	6
10	3281	GLP投資法人 投資証券	55
11	3282	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	10
12	3283	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	37
13	3285	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	35
14	3287	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	1
15	3290	SIA不動産投資法人 投資証券	1
16	3292	イオンリート投資法人 投資証券	23
17	3295	ヒューリックリート投資法人 投資証券	16
18	3296	日本リート投資法人 投資証券	8
19	3298	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	11
20	3308	日本ヘルスケア投資法人 投資証券	1
21	3309	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	17
22	3451	トーセイ・リート投資法人 投資証券	2
23	3453	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	5
24	3455	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	2
25	3459	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	3
26	3460	ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	2
27	8951	日本ビルファンド投資法人 投資証券	30
28	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	28
29	8953	日本リテールファンド投資法人 投資証券	54
30	8954	オリックス不動産投資法人 投資証券	49
31	8955	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	19
32	8956	プレミア投資法人 投資証券	6
33	8957	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	21
34	8958	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	4
35	8959	野村不動産オフィスファンド投資法人 投資証券	8
36	8960	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	56
37	8961	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	28
38	8963	インヴェンシブル投資法人 投資証券	67
39	8964	フロンティア不動産投資法人 投資証券	11
40	8966	平和不動産リート投資法人 投資証券	20
41	8967	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	18
42	8968	福岡リート投資法人 投資証券	16
43	8972	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	9
44	8973	積水ハウス・SI レジデンシャル投資法人 投資証券	21
45	8975	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	30
46	8976	大和証券オフィス投資法人 投資証券	10
47	8977	阪急リート投資法人 投資証券	12
48	8979	スターツプロシード投資法人 投資証券	3
49	8982	トップリート投資法人 投資証券	4
50	8984	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券	16
51	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	67

52	8986	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	35
53	8987	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	27

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 真帆  
( 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9月11日現在)

77,477 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

355,359,588 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

4,586.65 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9月11日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

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

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)

[ 2015/09/14 申込分 ]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	3402	東レ	10,000
2	3407	旭化成	9,000
3	4004	昭和電工	10,000
4	4091	大陽日酸	1,200
5	4188	三菱ケミカルホールディングス	8,400
6	5012	東燃ゼネラル石油	2,000
7	5019	出光興産	600
8	5233	太平洋セメント	8,000
9	5333	日本碍子	2,000
10	5631	日本製鋼所	2,000
11	5714	DOWAホールディングス	2,000
12	5801	古河電気工業	4,000
13	5802	住友電気工業	4,900
14	6361	荏原製作所	3,000
15	6370	栗田工業	700
16	6501	日立製作所	30,000
17	6502	東芝	24,000
18	6503	三菱電機	13,000
19	6645	オムロン	1,300
20	6741	日本信号	400
21	6752	パナソニック	13,600
22	6753	シャープ	10,000
23	6758	ソニー	8,000
24	6902	デンソー	3,100
25	6923	スタンレー電気	1,000
26	6954	ファナック	1,300
27	6971	京セラ	2,100
28	6988	日東電工	1,100
29	7011	三菱重工業	21,000
30	7012	川崎重工業	10,000
31	7203	トヨタ自動車	4,300
32	7211	三菱自動車工業	4,000
33	7267	本田技研工業	8,900
34	7912	大日本印刷	4,000
35	9513	電源開発	1,100

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 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9月11日現在)

120,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

6,915,508,991 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

57,629 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9月11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9月11日現在)

4,900,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

9,939,238,950 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

2,028.42 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9月11日現在)

△ 0.09%

(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9月11日現在)

4,700,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

5,783,391,195 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

1,230.51 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9月11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 眞帆  
( 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9月11日現在)

3,767,151 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

6,053,725,643 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

1,606.98 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9月11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)

[ 2015/09/14 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 眞帆  
( 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9月11日現在)

2,800,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

7,166,461,029 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

2,559.45 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9月11日現在)

△ 0.17%

(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 眞帆  
( 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9月11日現在)

500,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

601,519,016 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

1,203.04 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9月11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9月11日現在)

800,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

1,080,375,678 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

1,350.47 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9月11日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

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

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9月11日現在)

2,200,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

3,796,639,929 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

1,725.75 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9月11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9月11日現在)

2,500,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

3,565,991,825 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

1,426.40 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9月11日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

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

平成27年9月14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9月11日現在)

96,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

5,263,255,100 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

54,826 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9月11日現在)

0.90%

(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9月11日現在)

9,418,310 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

13,885,007,866 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

1,474.3 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9月11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 眞帆  
( 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9月11日現在)

3,859,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

4,751,241,160 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

1,231.2 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9月11日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

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

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9月11日現在)

46,503,964 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

56,099,703,415 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

1,206.3 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9月11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9月11日現在)

237,647 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月11日現在)

3,132,789,228 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月11日現在)

13,183 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9月11日現在)

0.33%

(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。