

平成27年9月25日

各 位

会社名 DIAMアセットマネジメント株式会社
(管理会社コード 13694)
代表者名 代表取締役社長 西 惠正
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

上場ETF(管理会社:DIAMアセットマネジメント)に関する日々の開示事項

DIAM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24日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(3銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	DIAM ETF 日経225	1369	東
2	DIAM ETF トピックス	1473	東
3	DIAM ETF JPX日経400	1474	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

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9月24日現在)

5,707,792 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月24日現在)

100,322,534,092 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月24日現在)

17,576 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9月24日現在)

-0.01 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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。

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
2015/8/25	17,806.70	-3.96%	17,803	-3.96%	-0.00%	5,351,065	95,267,329,144
2015/8/26	18,376.83	3.20%	18,375	3.21%	0.01%	5,605,850	103,008,763,388
2015/8/27	18,574.44	1.08%	18,582	1.13%	0.05%	5,605,850	104,166,562,191
2015/8/28	19,136.32	3.03%	19,144	3.02%	-0.00%	5,605,850	107,319,036,361
2015/8/31	18,890.48	-1.28%	18,897	-1.29%	-0.01%	5,554,924	104,971,429,671
2015/9/1	18,165.69	-3.84%	18,172	-3.84%	0.00%	5,554,924	100,943,492,808
2015/9/2	18,095.40	-0.39%	18,104	-0.37%	0.01%	5,554,924	100,563,668,002
2015/9/3	18,182.39	0.48%	18,189	0.47%	-0.01%	5,554,924	101,040,671,932
2015/9/4	17,792.16	-2.15%	17,798	-2.15%	-0.00%	5,554,924	98,867,565,936
2015/9/7	17,860.47	0.38%	17,867	0.39%	0.00%	5,554,924	99,247,828,228
2015/9/8	17,427.08	-2.43%	17,433	-2.43%	-0.00%	5,554,924	96,839,684,092
2015/9/9	18,770.51	7.71%	18,776	7.70%	-0.01%	5,554,924	104,298,908,358
2015/9/10	18,299.62	-2.51%	18,305	-2.51%	0.00%	5,656,788	103,547,741,322
2015/9/11	18,264.22	-0.19%	18,270	-0.19%	0.00%	5,605,938	102,420,781,829
2015/9/14	17,965.70	-1.63%	17,971	-1.64%	-0.00%	5,402,218	97,081,462,675
2015/9/15	18,026.48	0.34%	18,031	0.33%	-0.00%	5,402,218	97,409,265,604
2015/9/16	18,171.60	0.81%	18,178	0.82%	0.01%	5,402,218	98,201,119,066
2015/9/17	18,432.27	1.43%	18,438	1.43%	-0.00%	5,707,792	105,241,217,016
2015/9/18	18,070.21	-1.96%	18,076	-1.96%	0.00%	5,707,792	103,173,699,586
2015/9/24	17,571.83	-2.76%	17,576	-2.77%	-0.01%	5,707,792	100,322,534,092

交換にかかる交換口数

交換申込日(平成27年9月30日)、交換受付日(平成27年9月30日)分の交換口数は以下の通りです。

交換申込不可日のため受け付けておりません。

設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(平成27年9月30日)、設定受付日(平成27年9月30日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

設定申込不可日のため受け付けておりません。

以上

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 1473)
 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 トピックス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24日現在)

28,890,760 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月24日現在)

41,229,555,407 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月24日現在)

1,427.08 円

4. 上場ETF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9月24日現在)

-0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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)

東証株価指数(TOPIX)について

- ・TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「**㈱東京証券取引所**」という。)の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は**㈱東京証券取引所**が有しています。
- ・**㈱東京証券取引所**は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。
- ・**㈱東京証券取引所**は、TOPIXの指数値及びTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ・**㈱東京証券取引所**は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、**㈱東京証券取引所**は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
- ・当ファンドは、**㈱東京証券取引所**により提供、保証又は販売されるものではありません。
- ・**㈱東京証券取引所**は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ・**㈱東京証券取引所**は、当社又は本件商品の購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ・以上の項目に限らず、**㈱東京証券取引所**は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

DIAM ETF トピックス

日付	東証株価指数(TOPIX)		DIAM ETF トピックス				
	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
2015/9/7	1,445.65	0.08%	1,445.80	0.08%	0.01%	13,942,460	20,158,067,570
2015/9/8	1,416.71	-2.00%	1,416.91	-2.00%	0.00%	20,917,560	29,638,321,380
2015/9/9	1,507.37	6.40%	1,507.59	6.40%	0.00%	21,916,260	33,040,834,224
2015/9/10	1,479.52	-1.85%	1,479.74	-1.85%	0.00%	21,916,260	32,430,433,853
2015/9/11	1,480.23	0.05%	1,480.43	0.05%	-0.00%	28,890,760	42,770,702,494
2015/9/14	1,462.41	-1.20%	1,462.58	-1.21%	-0.00%	28,890,760	42,255,180,619
2015/9/15	1,462.24	-0.01%	1,462.40	-0.01%	-0.00%	28,890,760	42,249,849,529
2015/9/16	1,472.60	0.71%	1,472.78	0.71%	0.00%	28,890,760	42,549,645,656
2015/9/17	1,491.91	1.31%	1,492.08	1.31%	-0.00%	28,890,760	43,107,402,081
2015/9/18	1,462.38	-1.98%	1,462.52	-1.98%	-0.00%	28,890,760	42,253,389,265
2015/9/24	1,426.97	-2.42%	1,427.08	-2.42%	-0.00%	28,890,760	41,229,555,407

交換にかかる交換口数

交換申込日(平成27年9月30日)、交換受付日(平成27年9月30日)分の
交換口数は以下の通りです。

交換申込不可日のため受け付けておりません。

設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(平成27年9月30日)、設定受付日(平成27年9月30日)分の
設定ポートフォリオは以下の通りです。

設定申込不可日のため受け付けておりません。

以上

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 1474)
 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 JPX日経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24日現在)

3,287,649 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年9月24日現在)

42,089,040,141 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年9月24日現在)

12,802 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 (JPX日経400)の終値の変動率に係る乖離率 (平成27年9月24日現在)

-0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{JPX日経400の終値}}{\text{前営業日のJPX日経400の終値}} \right] \times 100(\%)$$

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)

JPX日経インデックス400 (JPX日経400)について

・「JPX日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所 (以下、総称して「JPXグループ」という。)並びに株式会社日本経済新聞社 (以下、「日経」という。)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、「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」自体及び「JPX日経インデックス400」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。
 ・「JPX日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て「JPXグループ」及び「日経」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、「JPXグループ」及び「日経」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。
 ・「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」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。
 ・「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」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。

DIAM ETF JPX日経400

日付	JPX日経インデックス400 (JPX日経400)		DIAM ETF JPX日経400				
	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
2015/9/7	12,977.78	0.07%	12,980	0.08%	0.01%	1,393,869	18,092,886,337
2015/9/8	12,702.69	-2.12%	12,705	-2.12%	0.00%	1,393,869	17,708,696,643
2015/9/9	13,548.21	6.66%	13,551	6.66%	0.00%	1,592,765	21,582,971,350
2015/9/10	13,282.27	-1.96%	13,285	-1.96%	-0.00%	1,692,221	22,480,532,601
2015/9/11	13,282.73	0.00%	13,285	0.00%	-0.00%	2,889,885	38,392,157,578
2015/9/14	13,114.33	-1.27%	13,116	-1.27%	-0.00%	2,889,885	37,904,425,105
2015/9/15	13,109.25	-0.04%	13,111	-0.04%	0.00%	2,889,885	37,889,724,003
2015/9/16	13,218.10	0.83%	13,220	0.83%	0.00%	2,889,885	38,204,524,138
2015/9/17	13,396.44	1.35%	13,398	1.35%	-0.00%	3,287,649	44,049,094,555
2015/9/18	13,120.22	-2.06%	13,122	-2.06%	0.00%	3,287,649	43,140,888,700
2015/9/24	12,800.75	-2.43%	12,802	-2.44%	-0.00%	3,287,649	42,089,040,141

交換にかかる交換口数

交換申込日(平成27年9月30日)、交換受付日(平成27年9月30日)分の交換口数は以下の通りです。

交換申込不可日のため受け付けておりません。

設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(平成27年9月30日)、設定受付日(平成27年9月30日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

設定申込不可日のため受け付けておりません。

以上