

平成27年11月5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11月4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11月4日現在)

5,707,929 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年11月4日現在)

108,759,176,836 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年11月4日現在)

19,054 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11月4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 |
| 2015/10/6 | 18,186.10 | 1.00% | 18,310 | 1.00% | -0.00% | 5,809,153 | 106,364,179,885 |
| 2015/10/7 | 18,322.98 | 0.75% | 18,449 | 0.76% | 0.01% | 5,809,153 | 107,170,423,569 |
| 2015/10/8 | 18,141.17 | -0.99% | 18,264 | -1.00% | -0.01% | 5,809,153 | 106,097,986,033 |
| 2015/10/9 | 18,438.67 | 1.64% | 18,564 | 1.64% | 0.00% | 5,809,153 | 107,839,135,679 |
| 2015/10/13 | 18,234.74 | -1.11% | 18,358 | -1.11% | -0.00% | 5,809,153 | 106,644,010,353 |
| 2015/10/14 | 17,891.00 | -1.89% | 18,013 | -1.88% | 0.01% | 5,809,153 | 104,639,517,868 |
| 2015/10/15 | 18,096.90 | 1.15% | 18,219 | 1.14% | -0.01% | 6,011,709 | 109,529,694,453 |
| 2015/10/16 | 18,291.80 | 1.08% | 18,415 | 1.08% | -0.00% | 6,011,709 | 110,708,183,484 |
| 2015/10/19 | 18,131.23 | -0.88% | 18,253 | -0.88% | -0.00% | 6,011,709 | 109,734,725,715 |
| 2015/10/20 | 18,207.15 | 0.42% | 18,330 | 0.42% | 0.00% | 6,011,709 | 110,193,912,255 |
| 2015/10/21 | 18,554.28 | 1.91% | 18,679 | 1.90% | -0.00% | 6,011,709 | 112,292,614,196 |
| 2015/10/22 | 18,435.87 | -0.64% | 18,560 | -0.64% | 0.00% | 6,011,709 | 111,577,880,485 |
| 2015/10/23 | 18,825.30 | 2.11% | 18,951 | 2.11% | -0.01% | 6,011,709 | 113,930,350,240 |
| 2015/10/26 | 18,947.12 | 0.65% | 19,074 | 0.65% | 0.00% | 6,011,709 | 114,667,253,320 |
| 2015/10/27 | 18,777.04 | -0.90% | 18,904 | -0.89% | 0.01% | 6,011,709 | 113,643,454,026 |
| 2015/10/28 | 18,903.02 | 0.67% | 19,031 | 0.67% | 0.00% | 6,011,709 | 114,407,572,920 |
| 2015/10/29 | 18,935.71 | 0.17% | 19,063 | 0.17% | -0.00% | 6,011,709 | 114,600,677,788 |
| 2015/10/30 | 19,083.10 | 0.78% | 19,212 | 0.78% | 0.00% | 5,758,489 | 110,631,075,608 |
| 2015/11/2 | 18,683.24 | -2.10% | 18,810 | -2.09% | 0.00% | 5,758,489 | 108,318,639,193 |
| 2015/11/4 | 18,926.91 | 1.30% | 19,054 | 1.30% | -0.01% | 5,707,929 | 108,759,176,836 |

交換にかかる交換口数

交換申込日(平成27年11月10日)、交換受付日(平成27年11月10日)分の
交換口数は以下の通りです。

交換口数 50,800 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11月10日)、設定受付日(平成27年11月10日)分の
設定ポートフォリオは以下の通りです。

| No. | 銘柄コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----|-------|-----------------|-------|
| 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 | 1808 | 長谷工コーポレーション | 400 |
| 9 | 1812 | 鹿島建設 | 2,000 |
| 10 | 1925 | 大和ハウス工業 | 2,000 |
| 11 | 1928 | 積水ハウス | 2,000 |
| 12 | 1963 | 日揮 | 2,000 |
| 13 | 2002 | 日清製粉グループ本社 | 2,000 |
| 14 | 2269 | 明治ホールディングス | 400 |
| 15 | 2282 | 日本ハム | 2,000 |
| 16 | 2432 | ディー・エヌ・エー | 600 |
| 17 | 2501 | サッポロホールディングス | 2,000 |
| 18 | 2502 | アサヒグループホールディングス | 2,000 |
| 19 | 2503 | キリンホールディングス | 2,000 |
| 20 | 2531 | 宝ホールディングス | 2,000 |
| 21 | 2768 | 双日 | 200 |
| 22 | 2801 | キッコーマン | 2,000 |
| 23 | 2802 | 味の素 | 2,000 |
| 24 | 2871 | ニチレイ | 2,000 |
| 25 | 2914 | 日本たばこ産業 | 2,000 |
| 26 | 3086 | J. フロント リテイリング | 1,000 |
| 27 | 3099 | 三越伊勢丹ホールディングス | 2,000 |
| 28 | 3101 | 東洋紡 | 2,000 |
| 29 | 3103 | ユニチカ | 2,000 |
| 30 | 3105 | 日清紡ホールディングス | 2,000 |
| 31 | 3289 | 東急不動産ホールディングス | 2,000 |
| 32 | 3382 | セブン&アイ・ホールディングス | 2,000 |
| 33 | 3401 | 帝人 | 2,000 |
| 34 | 3402 | 東レ | 2,000 |
| 35 | 3405 | クラレ | 2,000 |
| 36 | 3407 | 旭化成 | 2,000 |
| 37 | 3436 | SUMCO | 200 |
| 38 | 3861 | 王子ホールディングス | 2,000 |
| 39 | 3863 | 日本製紙 | 200 |
| 40 | 3865 | 北越紀州製紙 | 2,000 |
| 41 | 4004 | 昭和電工 | 2,000 |
| 42 | 4005 | 住友化学 | 2,000 |
| 43 | 4021 | 日産化学工業 | 2,000 |
| 44 | 4041 | 日本曹達 | 2,000 |
| 45 | 4042 | 東ソー | 2,000 |
| 46 | 4043 | トクヤマ | 2,000 |
| 47 | 4061 | デンカ | 2,000 |
| 48 | 4063 | 信越化学工業 | 2,000 |
| 49 | 4151 | 協和発酵キリン | 2,000 |
| 50 | 4183 | 三井化学 | 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 |
|-----|-------|--------------------|--------|
| 51 | 4188 | 三菱ケミカルホールディングス | 1,000 |
| 52 | 4208 | 宇部興産 | 2,000 |
| 53 | 4272 | 日本化薬 | 2,000 |
| 54 | 4324 | 電通 | 2,000 |
| 55 | 4452 | 花王 | 2,000 |
| 56 | 4502 | 武田薬品工業 | 2,000 |
| 57 | 4503 | アステラス製薬 | 10,000 |
| 58 | 4506 | 大日本住友製薬 | 2,000 |
| 59 | 4507 | 塩野義製薬 | 2,000 |
| 60 | 4519 | 中外製薬 | 2,000 |
| 61 | 4523 | エーザイ | 2,000 |
| 62 | 4543 | テルモ | 4,000 |
| 63 | 4568 | 第一三共 | 2,000 |
| 64 | 4689 | ヤフー | 800 |
| 65 | 4704 | トレンドマイクロ | 2,000 |
| 66 | 4901 | 富士フイルムホールディングス | 2,000 |
| 67 | 4902 | コニカミノルタ | 2,000 |
| 68 | 4911 | 資生堂 | 2,000 |
| 69 | 5002 | 昭和シェル石油 | 2,000 |
| 70 | 5020 | JXホールディングス | 2,000 |
| 71 | 5101 | 横浜ゴム | 1,000 |
| 72 | 5108 | ブリヂストン | 2,000 |
| 73 | 5201 | 旭硝子 | 2,000 |
| 74 | 5202 | 日本板硝子 | 2,000 |
| 75 | 5214 | 日本電気硝子 | 3,000 |
| 76 | 5232 | 住友大阪セメント | 2,000 |
| 77 | 5233 | 太平洋セメント | 2,000 |
| 78 | 5301 | 東海カーボン | 2,000 |
| 79 | 5332 | TOTO | 1,000 |
| 80 | 5333 | 日本碍子 | 2,000 |
| 81 | 5401 | 新日鐵住金 | 200 |
| 82 | 5406 | 神戸製鋼所 | 2,000 |
| 83 | 5411 | ジェイ エフ イー ホールディングス | 200 |
| 84 | 5413 | 日新製鋼 | 200 |
| 85 | 5541 | 大平洋金属 | 2,000 |
| 86 | 5631 | 日本製鋼所 | 2,000 |
| 87 | 5703 | 日本軽金属ホールディングス | 2,000 |
| 88 | 5706 | 三井金属鉱業 | 2,000 |
| 89 | 5707 | 東邦亜鉛 | 2,000 |
| 90 | 5711 | 三菱マテリアル | 2,000 |
| 91 | 5713 | 住友金属鉱山 | 2,000 |
| 92 | 5714 | DOWAホールディングス | 2,000 |
| 93 | 5715 | 古河機械金属 | 2,000 |
| 94 | 5801 | 古河電気工業 | 2,000 |
| 95 | 5802 | 住友電気工業 | 2,000 |
| 96 | 5803 | フジクラ | 2,000 |
| 97 | 5901 | 東洋製罐グループホールディングス | 2,000 |
| 98 | 6103 | オークマ | 2,000 |
| 99 | 6113 | アマダホールディングス | 2,000 |
| 100 | 6301 | 小松製作所 | 2,000 |
| 101 | 6302 | 住友重機械工業 | 2,000 |
| 102 | 6305 | 日立建機 | 2,000 |
| 103 | 6326 | クボタ | 2,000 |
| 104 | 6361 | 荏原製作所 | 2,000 |
| 105 | 6366 | 千代田化工建設 | 2,000 |
| 106 | 6367 | ダイキン工業 | 2,000 |
| 107 | 6471 | 日本精工 | 2,000 |
| 108 | 6472 | NTN | 2,000 |
| 109 | 6473 | ジェイテクト | 2,000 |
| 110 | 6479 | ミネベア | 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 |
|-----|-------|-------------------|-------|
| 111 | 6501 | 日立製作所 | 2,000 |
| 112 | 6502 | 東芝 | 2,000 |
| 113 | 6503 | 三菱電機 | 2,000 |
| 114 | 6504 | 富士電機 | 2,000 |
| 115 | 6506 | 安川電機 | 2,000 |
| 116 | 6508 | 明電舎 | 2,000 |
| 117 | 6674 | ジーエス・ユアサ コーポレーション | 2,000 |
| 118 | 6701 | 日本電気 | 2,000 |
| 119 | 6702 | 富士通 | 2,000 |
| 120 | 6703 | 沖電気工業 | 2,000 |
| 121 | 6752 | パナソニック | 2,000 |
| 122 | 6753 | シャープ | 2,000 |
| 123 | 6758 | ソニー | 2,000 |
| 124 | 6762 | TDK | 2,000 |
| 125 | 6767 | ミツミ電機 | 2,000 |
| 126 | 6770 | アルプス電気 | 2,000 |
| 127 | 6773 | パイオニア | 2,000 |
| 128 | 6841 | 横河電機 | 2,000 |
| 129 | 6857 | アドバンテスト | 4,000 |
| 130 | 6902 | デンソー | 2,000 |
| 131 | 6952 | カシオ計算機 | 2,000 |
| 132 | 6954 | ファナック | 2,000 |
| 133 | 6971 | 京セラ | 4,000 |
| 134 | 6976 | 太陽誘電 | 2,000 |
| 135 | 6988 | 日東電工 | 2,000 |
| 136 | 7003 | 三井造船 | 2,000 |
| 137 | 7004 | 日立造船 | 400 |
| 138 | 7011 | 三菱重工業 | 2,000 |
| 139 | 7012 | 川崎重工業 | 2,000 |
| 140 | 7013 | IHI | 2,000 |
| 141 | 7201 | 日産自動車 | 2,000 |
| 142 | 7202 | いすゞ自動車 | 1,000 |
| 143 | 7203 | トヨタ自動車 | 2,000 |
| 144 | 7205 | 日野自動車 | 2,000 |
| 145 | 7211 | 三菱自動車工業 | 200 |
| 146 | 7261 | マツダ | 400 |
| 147 | 7267 | 本田技研工業 | 4,000 |
| 148 | 7269 | スズキ | 2,000 |
| 149 | 7270 | 富士重工業 | 2,000 |
| 150 | 7731 | ニコン | 2,000 |
| 151 | 7733 | オリンパス | 2,000 |
| 152 | 7735 | SCREENホールディングス | 2,000 |
| 153 | 7751 | キヤノン | 3,000 |
| 154 | 7752 | リコー | 2,000 |
| 155 | 7762 | シチズンホールディングス | 2,000 |
| 156 | 7911 | 凸版印刷 | 2,000 |
| 157 | 7912 | 大日本印刷 | 2,000 |
| 158 | 7951 | ヤマハ | 2,000 |
| 159 | 8001 | 伊藤忠商事 | 2,000 |
| 160 | 8002 | 丸紅 | 2,000 |
| 161 | 8015 | 豊田通商 | 2,000 |
| 162 | 8031 | 三井物産 | 2,000 |
| 163 | 8035 | 東京エレクトロン | 2,000 |
| 164 | 8053 | 住友商事 | 2,000 |
| 165 | 8058 | 三菱商事 | 2,000 |
| 166 | 8233 | 高島屋 | 2,000 |
| 167 | 8252 | 丸井グループ | 2,000 |
| 168 | 8253 | クレディセゾン | 2,000 |
| 169 | 8267 | イオン | 2,000 |
| 170 | 8270 | ユニーグループ・ホールディングス | 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 |
|-----|-------|---------------------------|--------|
| 171 | 8303 | 新生銀行 | 2,000 |
| 172 | 8304 | あおぞら銀行 | 2,000 |
| 173 | 8306 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 2,000 |
| 174 | 8308 | りそなホールディングス | 200 |
| 175 | 8309 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 2,000 |
| 176 | 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ | 200 |
| 177 | 8331 | 千葉銀行 | 2,000 |
| 178 | 8332 | 横浜銀行 | 2,000 |
| 179 | 8354 | ふくおかフィナンシャルグループ | 2,000 |
| 180 | 8355 | 静岡銀行 | 2,000 |
| 181 | 8411 | みずほフィナンシャルグループ | 2,000 |
| 182 | 8601 | 大和証券グループ本社 | 2,000 |
| 183 | 8604 | 野村ホールディングス | 2,000 |
| 184 | 8628 | 松井証券 | 2,000 |
| 185 | 8630 | 損保ジャパン日本興亜ホールディングス | 500 |
| 186 | 8725 | MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 600 |
| 187 | 8729 | ソニーフィナンシャルホールディングス | 400 |
| 188 | 8750 | 第一生命保険 | 200 |
| 189 | 8766 | 東京海上ホールディングス | 1,000 |
| 190 | 8795 | T&Dホールディングス | 400 |
| 191 | 8801 | 三井不動産 | 2,000 |
| 192 | 8802 | 三菱地所 | 2,000 |
| 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 | コナミホールディングス | 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

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11月4日現在)

35,858,160 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年11月4日現在)

55,655,834,266 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年11月4日現在)

1,552.11 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11月4日現在)

-0.01 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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「**株東**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**株東**東京証券取引所が有しています。
- ・**株東**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。
- ・**株東**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。
- ・**株東**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、**株東**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、**株東**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。
- ・**株東**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。
- ・**株東**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、**株東**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 |
| 2015/10/6 | 1,475.84 | 0.81% | 1,487.11 | 0.81% | -0.00% | 28,890,760 | 42,963,632,638 |
| 2015/10/7 | 1,493.17 | 1.17% | 1,504.59 | 1.18% | 0.00% | 28,890,760 | 43,468,818,170 |
| 2015/10/8 | 1,481.40 | -0.79% | 1,492.72 | -0.79% | -0.00% | 28,890,760 | 43,125,674,661 |
| 2015/10/9 | 1,515.13 | 2.28% | 1,526.65 | 2.27% | -0.00% | 28,890,760 | 44,106,187,704 |
| 2015/10/13 | 1,503.13 | -0.79% | 1,514.51 | -0.80% | -0.00% | 32,869,960 | 49,781,983,868 |
| 2015/10/14 | 1,470.83 | -2.15% | 1,482.01 | -2.15% | 0.00% | 32,869,960 | 48,713,749,716 |
| 2015/10/15 | 1,490.72 | 1.35% | 1,502.01 | 1.35% | -0.00% | 35,858,160 | 53,859,196,798 |
| 2015/10/16 | 1,505.84 | 1.01% | 1,517.21 | 1.01% | -0.00% | 35,858,160 | 54,404,358,516 |
| 2015/10/19 | 1,494.75 | -0.74% | 1,506.04 | -0.74% | 0.00% | 35,858,160 | 54,004,001,385 |
| 2015/10/20 | 1,499.28 | 0.30% | 1,510.60 | 0.30% | -0.00% | 35,858,160 | 54,167,454,733 |
| 2015/10/21 | 1,526.81 | 1.84% | 1,538.31 | 1.83% | -0.00% | 35,858,160 | 55,160,945,362 |
| 2015/10/22 | 1,518.22 | -0.56% | 1,529.68 | -0.56% | 0.00% | 35,858,160 | 54,851,334,286 |
| 2015/10/23 | 1,547.84 | 1.95% | 1,559.48 | 1.95% | -0.00% | 35,858,160 | 55,920,246,379 |
| 2015/10/26 | 1,558.99 | 0.72% | 1,570.72 | 0.72% | 0.00% | 35,858,160 | 56,323,212,789 |
| 2015/10/27 | 1,543.11 | -1.02% | 1,554.76 | -1.02% | 0.00% | 35,858,160 | 55,750,776,797 |
| 2015/10/28 | 1,547.19 | 0.26% | 1,558.90 | 0.27% | 0.00% | 35,858,160 | 55,899,176,194 |
| 2015/10/29 | 1,547.11 | -0.01% | 1,558.85 | 0.00% | 0.00% | 35,858,160 | 55,897,339,699 |
| 2015/10/30 | 1,558.20 | 0.72% | 1,570.04 | 0.72% | 0.00% | 35,858,160 | 56,298,601,307 |
| 2015/11/2 | 1,526.97 | -2.00% | 1,538.63 | -2.00% | 0.00% | 35,858,160 | 55,172,607,929 |
| 2015/11/4 | 1,540.43 | 0.88% | 1,552.11 | 0.88% | -0.01% | 35,858,160 | 55,655,834,266 |

交換にかかる交換口数

交換申込日(平成27年11月10日)、交換受付日(平成27年11月10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11月10日)、設定受付日(平成27年11月10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11月4日現在)

3,287,649 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年11月4日現在)

45,839,898,363 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年11月4日現在)

13,943 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11月4日現在)

-0.01 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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 |
| 2015/10/6 | 13,221.78 | 0.84% | 13,324 | 0.84% | 0.00% | 3,287,649 | 43,803,080,878 |
| 2015/10/7 | 13,378.22 | 1.18% | 13,481 | 1.18% | -0.00% | 3,287,649 | 44,322,226,187 |
| 2015/10/8 | 13,269.57 | -0.81% | 13,372 | -0.81% | 0.00% | 3,287,649 | 43,962,079,694 |
| 2015/10/9 | 13,589.07 | 2.41% | 13,693 | 2.40% | -0.01% | 3,287,649 | 45,018,418,701 |
| 2015/10/13 | 13,470.86 | -0.87% | 13,574 | -0.87% | 0.00% | 3,287,649 | 44,626,311,066 |
| 2015/10/14 | 13,174.03 | -2.20% | 13,275 | -2.20% | 0.00% | 3,287,649 | 43,644,086,589 |
| 2015/10/15 | 13,349.87 | 1.33% | 13,452 | 1.33% | -0.00% | 3,287,649 | 44,224,059,035 |
| 2015/10/16 | 13,494.06 | 1.08% | 13,597 | 1.08% | -0.00% | 3,287,649 | 44,700,560,841 |
| 2015/10/19 | 13,374.59 | -0.89% | 13,476 | -0.89% | -0.00% | 3,287,649 | 44,305,456,282 |
| 2015/10/20 | 13,428.88 | 0.41% | 13,531 | 0.41% | 0.00% | 3,287,649 | 44,483,854,733 |
| 2015/10/21 | 13,675.72 | 1.84% | 13,779 | 1.83% | -0.01% | 3,287,649 | 45,301,097,255 |
| 2015/10/22 | 13,590.55 | -0.62% | 13,694 | -0.62% | 0.01% | 3,287,649 | 45,019,611,407 |
| 2015/10/23 | 13,878.26 | 2.12% | 13,983 | 2.11% | -0.01% | 3,287,649 | 45,971,211,632 |
| 2015/10/26 | 13,979.88 | 0.73% | 14,085 | 0.73% | -0.00% | 3,287,649 | 46,307,927,153 |
| 2015/10/27 | 13,838.07 | -1.01% | 13,943 | -1.01% | 0.01% | 3,287,649 | 45,839,921,102 |
| 2015/10/28 | 13,874.09 | 0.26% | 13,979 | 0.26% | -0.00% | 3,287,649 | 45,959,325,557 |
| 2015/10/29 | 13,888.86 | 0.11% | 13,994 | 0.11% | 0.00% | 3,287,649 | 46,008,351,835 |
| 2015/10/30 | 14,000.71 | 0.81% | 14,107 | 0.81% | 0.00% | 3,287,649 | 46,379,523,540 |
| 2015/11/2 | 13,702.71 | -2.13% | 13,808 | -2.12% | 0.01% | 3,287,649 | 45,394,240,208 |
| 2015/11/4 | 13,838.52 | 0.99% | 13,943 | 0.98% | -0.01% | 3,287,649 | 45,839,898,363 |

交換にかかる交換口数

交換申込日(平成27年11月10日)、交換受付日(平成27年11月10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11月10日)、設定受付日(平成27年11月10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