

平成27年12月11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12月10日現在の状況をご報告します。

上場 ETF 銘柄 (21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
21	上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティ	1399	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12月10日現在)

79,811,527 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

1,562,081,873,503 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

19,572 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12月10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)

[2015/12/11 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	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	麒麟ホールディングス	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
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
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
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	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

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12月10日現在)

824,403,500 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

1,288,786,787,601 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

1,563.30 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12月10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)

[2015/12/11 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12月10日現在)

628,552 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

695,227,868 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

1,106.08 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12月10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)

[2015/12/11 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	2121	ミクシィ	300
3	2146	UTグループ	200
4	2157	コシダカホールディングス	100
5	2158	UBIC	100
6	2160	ジーエヌアイグループ	1,000
7	2191	テラ	100
8	2337	いちごグループホールディングス	1,100
9	2362	夢真ホールディングス	200
10	2370	メディネット	500
11	2400	メッセージ	100
12	2438	アスカネット	100
13	2489	アドウェイズ	200
14	2492	インフォマート	300
15	2497	ユナイテッド	100
16	2702	日本マクドナルドホールディングス	400
17	2782	セリア	100
18	2928	健康コーポレーション	100
19	3244	サムティ	100
20	3665	エニグモ	100
21	3679	じげん	100
22	3727	アプリックスIPホールディングス	100
23	3773	アドバンスト・メディア	100
24	3782	ディー・ディー・エス	200
25	3843	フリービット	100
26	3857	ラック	100
27	3858	ユビキタス	100
28	4080	田中化学研究所	100
29	4281	デジタル・アドバタイジング・コンソーシア	100
30	4293	セプテーニ・ホールディングス	100
31	4348	インフォコム	100
32	4368	扶桑化学工業	100
33	4563	アンジェス MG	400
34	4564	オンコセラピー・サイエンス	800
35	4565	そーせいグループ	100
36	4571	ナノキャリア	200
37	4576	デ・ウエスタン・セラピテクス研究所	100
38	4583	カイオム・バイオサイエンス	100
39	4585	UMNファーマ	100
40	4587	ペプチドリーム	200
41	4777	ガーラ	100
42	4813	ACCESS	200
43	4819	デジタルガレージ	200
44	4842	USEN	500
45	4849	エン・ジャパン	100
46	4974	タカラバイオ	300
47	4978	リプロセル	300
48	6047	Gunosy	100
49	6145	日特エンジニアリング	100
50	6324	ハーモニック・ドライブ・システムズ	200
51	6425	ユニバーサルエンターテインメント	100

52	6619	ダブル・スコープ	100
53	6677	エスケーエレクトロニクス	100
54	6736	サン電子	100
55	6871	日本マイクロニクス	200
56	6890	フェローテック	200
57	6908	イリソ電子工業	100
58	6960	フクダ電子	100
59	7157	ライフネット生命保険	200
60	7177	GMOクリックホールディングス	100
61	7298	八千代工業	100
62	7419	ノジマ	200
63	7458	第一興商	300
64	7575	日本ライフライン	100
65	7618	ピーシーデポコーポレーション	100
66	7716	ナカニシ	200
67	7722	国際計測器	100
68	7774	ジャパン・ティッシュ・エンジニアリング	100
69	7777	スリー・ディー・マトリックス	100
70	7779	CYBERDYNE	400
71	7829	サマンサタバサジャパンリミテッド	100
72	7918	ヴィア・ホールディングス	100
73	8186	大塚家具	100
74	8739	スパークス・グループ	600
75	8789	フィンテック グローバル	800
76	8890	レーサム	100
77	8909	シノケングループ	100
78	8914	エリアリンク	600
79	8922	日本アセットマーケティング	800
80	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 眞帆
(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12月10日現在)

572,220 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

3,652,506,901 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

6,383 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12月10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 真帆
(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12月10日現在)

52,066,731 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

90,539,404,514 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

1,738.91 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12月10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)

[2015/12/11 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	9
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	31
4	3249	産業ファンド投資法人 投資証券	7
5	3263	大和ハウスリート投資法人 投資証券	7
6	3269	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	26
7	3278	ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	7
8	3279	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	11
9	3281	GLP投資法人 投資証券	51
10	3282	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	9
11	3283	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	34
12	3287	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	2
13	3290	SIA不動産投資法人 投資証券	1
14	3292	イオンリート投資法人 投資証券	21
15	3295	ヒューリックリート投資法人 投資証券	15
16	3296	日本リート投資法人 投資証券	8
17	3298	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	10
18	3308	日本ヘルスケア投資法人 投資証券	1
19	3309	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	15
20	3451	トーセイ・リート投資法人 投資証券	3
21	3453	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	7
22	3455	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	2
23	3459	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	3
24	3460	ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	1
25	3462	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	73
26	8951	日本ビルファンド投資法人 投資証券	28
27	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	26
28	8953	日本リテールファンド投資法人 投資証券	50
29	8954	オリックス不動産投資法人 投資証券	46
30	8955	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	17
31	8956	プレミア投資法人 投資証券	26
32	8957	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	19
33	8958	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	4
34	8960	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	54
35	8961	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	26
36	8963	インヴィンシブル投資法人 投資証券	62
37	8964	フロンティア不動産投資法人 投資証券	10
38	8966	平和不動産リート投資法人 投資証券	18
39	8967	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	17
40	8968	福岡リート投資法人 投資証券	14
41	8972	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	8
42	8973	積水ハウス・SI レジデンシャル投資法人 投資証券	20
43	8975	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	28
44	8976	大和証券オフィス投資法人 投資証券	10
45	8977	阪急リート投資法人 投資証券	11
46	8979	スターツプロシード投資法人 投資証券	3
47	8982	トップリート投資法人 投資証券	3
48	8984	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券	14
49	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	62
50	8986	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	32
51	8987	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	25

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12月10日現在)

77,477 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

372,385,849 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

4,806.41 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12月10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)

[2015/12/11 申込分]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	3402	東レ	9,000
2	3407	旭化成	8,000
3	4004	昭和電工	9,000
4	4091	大陽日酸	900
5	4188	三菱ケミカルホールディングス	7,900
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	7,000
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	1,000
12	5801	古河電気工業	4,000
13	5802	住友電気工業	4,600
14	6361	荏原製作所	3,000
15	6370	栗田工業	700
16	6501	日立製作所	28,000
17	6502	東芝	23,000
18	6503	三菱電機	12,000
19	6645	オムロン	1,200
20	6741	日本信号	400
21	6752	パナソニック	12,800
22	6753	シャープ	10,000
23	6758	ソニー	7,500
24	6902	デンソー	3,000
25	6923	スタンレー電気	900
26	6954	ファナック	1,200
27	6971	京セラ	1,900
28	6988	日東電工	900
29	7011	三菱重工業	19,000
30	7012	川崎重工業	9,000
31	7203	トヨタ自動車	3,900
32	7211	三菱自動車工業	3,700
33	7267	本田技研工業	7,400
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12月10日現在)

124,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

7,101,478,665 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

57,270 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12月10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12月10日現在)

5,100,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

10,717,346,670 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

2,101.44 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12月10日現在)

0.11%

(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12月10日現在)

4,700,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

5,737,187,621 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

1,220.68 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12月10日現在)

△ 0.06%

(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12月10日現在)

3,767,151 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

6,358,834,109 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

1,687.97 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12月10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)

[2015/12/11 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	4,000
6	2579	コカ・コーラウエスト	400
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	1,700
10	2914	日本たばこ産業	5,600
11	3076	あい ホールディングス	200
12	3405	クラレ	1,800
13	4004	昭和電工	7,000
14	4045	東亜合成	700
15	4151	協和発酵キリン	1,000
16	4185	JSR	300
17	4324	電通	1,100
18	4452	花王	2,500
19	4502	武田薬品工業	900
20	4508	田辺三菱製薬	200
21	4568	第一三共	700
22	4578	大塚ホールディングス	1,800
23	4631	DIC	4,000
24	4704	トレンドマイクロ	500
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	900
30	5012	東燃ゼネラル石油	1,000
31	5020	JXホールディングス	2,800
32	5101	横浜ゴム	600
33	5105	東洋ゴム工業	500
34	5108	ブリヂストン	3,300
35	5110	住友ゴム工業	900
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	1,200
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	400
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	1,300
50	6310	井関農機	1,000
51	6326	クボタ	5,000

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	3,500
59	7203	トヨタ自動車	3,200
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	2,100
63	7272	ヤマハ発動機	1,400
64	7751	キヤノン	5,700
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	2,100
69	8002	丸紅	2,100
70	8031	三井物産	2,000
71	8053	住友商事	1,400
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	2,000
74	8308	りそなホールディングス	2,700
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	1,700
77	8411	みずほフィナンシャルグループ	32,300
78	8591	オリックス	1,800
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	4,600
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	13
83	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	15
84	8955	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	8
85	8958	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	3
86	8961	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	16
87	8964	フロンティア不動産投資法人 投資証券	5
88	8973	積水ハウス・SI レジデンシャル投資法人 投資	13
89	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	31
90	8986	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	20
91	8987	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	12
92	9101	日本郵船	2,000
93	9201	日本航空	400
94	9432	日本電信電話	1,600
95	9433	KDDI	2,100
96	9437	NTTドコモ	1,700
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12月10日現在)

2,800,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

7,586,834,222 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

2,709.58 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12月10日現在)

△ 0.03%

(参考) 乖離率の計算式

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

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12月10日現在)

500,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

590,452,646 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

1,180.91 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12月10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12月10日現在)

700,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

916,224,217 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

1,308.89 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12月10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12月10日現在)

2,200,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

3,915,000,464 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

1,779.55 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12月10日現在)

0.10%

(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12月10日現在)

2,700,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

4,164,554,834 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

1,542.43 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12月10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12月11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12月10日現在)

104,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

5,733,319,512 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

55,128 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12月10日現在)

△ 0.05%

(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12月10日現在)

11,232,360 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

17,375,250,166 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

1,546.9 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12月10日現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

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

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12月10日現在)

2,379,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

3,091,754,589 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

1,299.6 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12月10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 眞帆
(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12月10日現在)

43,815,134 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

55,559,313,586 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

1,268.0 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12月10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12月10日現在)

191,647 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

2,742,042,146 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

14,308 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12月10日現在)

△ 0.10%

(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。

平成27年12月11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 1399)
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MSCI日本株高配当低ボラティリティ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12月10日現在)

409,500 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成27年12月10日現在)

584,059,545 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成27年12月10日現在)

1,426.27 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とMSCIジャパンIMIカスタム高流動性高利回り
低ボラティリティ指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成27年12月10日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{MSCIジャパンIMIカスタム高流動性高利回り低ボラティリティ指数の終値}}{\text{前営業日のMSCIジャパンIMIカスタム高流動性高利回り低ボラティリティ指数の終値}} \right) \times 100$$

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:21]

上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティ PCF (ユニット株式)

[2015/12/11 申込分]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	1820	西松建設	2,000
2	1878	大東建託	100
3	1925	大和ハウス工業	300
4	1928	積水ハウス	500
5	2503	麒麟ホールディングス	600
6	2579	コカ・コーラウエスト	400
7	2580	コカ・コーライーストジャパン	600
8	2651	ローソン	100
9	2670	エービーシー・マート	100
10	2768	双日	200
11	2914	日本たばこ産業	200
12	3105	日清紡ホールディングス	400
13	3231	野村不動産ホールディングス	400
14	3291	飯田グループホールディングス	200
15	3405	クラレ	600
16	3407	旭化成	1,000
17	3861	王子ホールディングス	2,000
18	3863	日本製紙	500
19	4004	昭和電工	4,000
20	4061	デンカ	2,000
21	4062	イビデン	300
22	4182	三菱瓦斯化学	1,000
23	4185	JSR	500
24	4188	三菱ケミカルホールディングス	1,100
25	4204	積水化学工業	700
26	4208	宇部興産	4,000
27	4217	日立化成	300
28	4272	日本化薬	1,000
29	4307	野村総合研究所	200
30	4502	武田薬品工業	200
31	4503	アステラス製薬	600
32	4508	田辺三菱製薬	500
33	4521	科研製薬	100
34	4523	エーザイ	100
35	4544	みらかホールディングス	200
36	4568	第一三共	400
37	4578	大塚ホールディングス	200
38	4631	DIC	2,000
39	4666	パーク24	400
40	4689	ヤフー	2,000
41	4704	トレンドマイクロ	200
42	4732	ユー・エス・エス	500
43	4739	伊藤忠テクノソリューションズ	400
44	4902	コニカミノルタ	400
45	4927	ポーラ・オルビスホールディングス	100
46	5002	昭和シェル石油	900
47	5012	東燃ゼネラル石油	1,000
48	5019	出光興産	500
49	5020	JXホールディングス	2,000
50	5101	横浜ゴム	400
51	5105	東洋ゴム工業	200

52	5108	ブリヂストン	200
53	5110	住友ゴム工業	500
54	5201	旭硝子	1,000
55	5214	日本電気硝子	1,000
56	5711	三菱マテリアル	1,000
57	5714	DOWAホールディングス	1,000
58	5802	住友電気工業	600
59	5929	三和ホールディングス	700
60	5938	LIXILグループ	200
61	6113	アマダホールディングス	100
62	6136	オーエスジー	200
63	6201	豊田自動織機	100
64	6268	ナブテスコ	400
65	6301	小松製作所	400
66	6361	荏原製作所	1,000
67	6370	栗田工業	400
68	6417	SANKYO	200
69	6460	セガサミーホールディングス	400
70	6473	ジェイテクト	100
71	6501	日立製作所	1,000
72	6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,000
73	6703	沖電気工業	3,000
74	6902	デンソー	200
75	6971	京セラ	100
76	6995	東海理化電機製作所	400
77	7003	三井造船	3,000
78	7011	三菱重工業	1,000
79	7201	日産自動車	800
80	7203	トヨタ自動車	100
81	7205	日野自動車	100
82	7240	NOK	100
83	7259	アイシン精機	100
84	7262	ダイハツ工業	600
85	7267	本田技研工業	200
86	7282	豊田合成	300
87	7751	キヤノン	300
88	7752	リコー	800
89	7762	シチズンホールディングス	1,100
90	7912	大日本印刷	1,000
91	7988	ニフコ	100
92	8001	伊藤忠商事	300
93	8002	丸紅	800
94	8015	豊田通商	100
95	8028	ファミリーマート	200
96	8031	三井物産	600
97	8036	日立ハイテクノロジーズ	300
98	8053	住友商事	700
99	8058	三菱商事	200
100	8086	ニプロ	700
101	8136	サンリオ	300
102	8219	青山商事	200
103	8270	ユニーグループ・ホールディングス	1,400
104	8282	ケーズホールディングス	200
105	9062	日本通運	2,000
106	9101	日本郵船	3,000
107	9107	川崎汽船	3,000
108	9201	日本航空	200
109	9432	日本電信電話	200
110	9433	KDDI	300
111	9435	光通信	100

112	9437	NTTドコモ	400
113	9504	中国電力	600
114	9513	電源開発	200
115	9531	東京瓦斯	2,000
116	9532	大阪瓦斯	2,000
117	9783	ベネッセホールディングス	300