

平成28年2月4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28年2月3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	<a href="#">DIAM ETF 日経225</a>	1369	東
2	<a href="#">DIAM ETF トピックス</a>	1473	東
3	<a href="#">DIAM ETF JPX日経400</a>	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28年2月3日現在)

6,521,659 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年2月3日現在)

112,222,639,243 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年2月3日現在)

17,208 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28年2月3日現在)

-0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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
2016/1/6	18,191.32	-0.99%	18,335	-0.99%	0.00%	6,571,614	120,488,983,718
2016/1/7	17,767.34	-2.33%	17,906	-2.34%	-0.01%	6,571,614	117,670,946,903
2016/1/8	17,697.96	-0.39%	17,716	-1.06%	-0.67%	6,571,614	116,425,044,210
2016/1/12	17,218.96	-2.71%	17,236	-2.71%	-0.00%	6,877,212	118,532,912,009
2016/1/13	17,715.63	2.88%	17,734	2.89%	0.00%	6,928,146	122,860,294,206
2016/1/14	17,240.95	-2.68%	17,259	-2.68%	0.00%	7,030,010	121,330,230,783
2016/1/15	17,147.11	-0.54%	17,164	-0.55%	-0.01%	7,080,941	121,539,927,352
2016/1/18	16,955.57	-1.12%	16,972	-1.12%	-0.00%	7,080,941	120,175,224,742
2016/1/19	17,048.37	0.55%	17,065	0.55%	0.00%	7,131,876	121,707,062,627
2016/1/20	16,416.19	-3.71%	16,432	-3.71%	-0.00%	7,131,876	117,187,674,508
2016/1/21	16,017.26	-2.43%	16,033	-2.43%	0.00%	7,131,876	114,343,250,093
2016/1/22	16,958.53	5.88%	16,974	5.87%	-0.01%	7,131,876	121,057,453,721
2016/1/25	17,110.91	0.90%	17,128	0.91%	0.01%	7,131,876	122,151,219,744
2016/1/26	16,708.90	-2.35%	16,724	-2.36%	-0.01%	6,877,616	115,022,541,600
2016/1/27	17,163.92	2.72%	17,181	2.73%	0.01%	6,877,616	118,165,327,260
2016/1/28	17,041.45	-0.71%	17,059	-0.71%	0.00%	6,877,616	117,322,169,373
2016/1/29	17,518.30	2.80%	17,537	2.80%	0.00%	6,521,659	114,368,523,146
2016/2/1	17,865.23	1.98%	17,883	1.97%	-0.01%	6,521,659	116,625,029,225
2016/2/2	17,750.68	-0.64%	17,768	-0.64%	-0.00%	6,521,659	115,877,937,025
2016/2/3	17,191.25	-3.15%	17,208	-3.15%	-0.00%	6,521,659	112,222,639,243

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年2月9日)、交換受付日(平成28年2月9日)分の  
交換口数は以下の通りです。

交換口数 51,100 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28年2月9日)、設定受付日(平成28年2月9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28年2月3日現在)

31,029,152 口

---

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年2月3日現在)

43,631,570,506 円

---

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年2月3日現在)

1,406.15 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28年2月3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
2016/1/6	1,488.84	-1.05%	1,501.70	-1.05%	-0.00%	28,043,052	42,112,126,267
2016/1/7	1,457.94	-2.08%	1,470.45	-2.08%	-0.01%	28,043,052	41,235,907,100
2016/1/8	1,447.32	-0.73%	1,447.21	-1.58%	-0.85%	28,043,052	40,584,243,880
2016/1/12	1,401.95	-3.13%	1,401.75	-3.14%	-0.01%	28,043,052	39,309,234,428
2016/1/13	1,442.09	2.86%	1,441.95	2.87%	0.00%	28,043,052	40,436,734,093
2016/1/14	1,406.55	-2.46%	1,406.50	-2.46%	0.01%	29,040,952	40,846,034,934
2016/1/15	1,402.45	-0.29%	1,402.33	-0.30%	-0.00%	31,029,152	43,513,031,078
2016/1/18	1,387.93	-1.04%	1,387.71	-1.04%	-0.01%	31,029,152	43,059,471,504
2016/1/19	1,390.41	0.18%	1,390.26	0.18%	0.01%	31,029,152	43,138,655,708
2016/1/20	1,338.97	-3.70%	1,338.79	-3.70%	-0.00%	31,029,152	41,541,625,472
2016/1/21	1,301.49	-2.80%	1,301.35	-2.80%	0.00%	31,029,152	40,379,828,995
2016/1/22	1,374.19	5.59%	1,373.94	5.58%	-0.01%	31,029,152	42,632,196,308
2016/1/25	1,392.63	1.34%	1,392.51	1.35%	0.01%	31,029,152	43,208,415,809
2016/1/26	1,360.23	-2.33%	1,360.05	-2.33%	-0.00%	31,029,152	42,201,123,637
2016/1/27	1,400.70	2.98%	1,400.60	2.98%	0.01%	31,029,152	43,459,525,500
2016/1/28	1,392.10	-0.61%	1,392.01	-0.61%	0.00%	31,029,152	43,192,954,582
2016/1/29	1,432.07	2.87%	1,432.06	2.88%	0.01%	31,029,152	44,435,509,043
2016/2/1	1,462.67	2.14%	1,462.54	2.13%	-0.01%	31,029,152	45,381,398,698
2016/2/2	1,452.04	-0.73%	1,451.95	-0.72%	0.00%	31,029,152	45,052,766,434
2016/2/3	1,406.27	-3.15%	1,406.15	-3.15%	-0.00%	31,029,152	43,631,570,506

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年2月9日)、交換受付日(平成28年2月9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28年2月9日)、設定受付日(平成28年2月9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28年2月3日現在)

3,094,321 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年2月3日現在)

39,231,841,750 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年2月3日現在)

12,679 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28年2月3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
2016/1/6	13,412.15	-1.00%	13,527	-1.00%	-0.01%	2,895,405	39,166,716,789
2016/1/7	13,121.96	-2.16%	13,234	-2.17%	-0.00%	2,895,405	38,317,033,601
2016/1/8	13,029.77	-0.70%	13,020	-1.62%	-0.91%	2,895,405	37,699,146,634
2016/1/12	12,624.58	-3.11%	12,615	-3.11%	-0.00%	2,895,405	36,524,754,033
2016/1/13	12,986.76	2.87%	12,977	2.87%	0.00%	2,895,405	37,573,409,950
2016/1/14	12,662.84	-2.49%	12,654	-2.49%	0.01%	2,895,405	36,637,351,759
2016/1/15	12,625.86	-0.29%	12,616	-0.30%	-0.01%	2,895,405	36,528,888,405
2016/1/18	12,498.67	-1.01%	12,488	-1.01%	-0.01%	2,895,405	36,158,666,396
2016/1/19	12,524.07	0.20%	12,514	0.21%	0.00%	2,994,863	37,478,069,528
2016/1/20	12,065.32	-3.66%	12,055	-3.67%	-0.00%	2,994,863	36,104,125,893
2016/1/21	11,732.82	-2.76%	11,723	-2.75%	0.00%	2,994,863	35,109,949,006
2016/1/22	12,391.02	5.61%	12,380	5.60%	-0.01%	2,994,863	37,077,877,892
2016/1/25	12,562.52	1.38%	12,552	1.39%	0.01%	2,994,863	37,592,856,058
2016/1/26	12,273.79	-2.30%	12,263	-2.30%	-0.00%	3,094,321	37,946,343,828
2016/1/27	12,629.20	2.90%	12,619	2.90%	0.01%	3,094,321	39,047,847,207
2016/1/28	12,547.22	-0.65%	12,537	-0.65%	-0.00%	3,094,321	38,794,473,485
2016/1/29	12,917.43	2.95%	12,908	2.96%	0.01%	3,094,321	39,940,020,408
2016/2/1	13,219.49	2.34%	13,209	2.33%	-0.01%	3,094,321	40,871,697,952
2016/2/2	13,117.17	-0.77%	13,107	-0.77%	0.00%	3,094,321	40,555,724,954
2016/2/3	12,689.25	-3.26%	12,679	-3.27%	-0.00%	3,094,321	39,231,841,750

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年2月9日)、交換受付日(平成28年2月9日)分の  
交換口数は以下の通りです。

交換口数 10 万口以上 10 万口単位

## 設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(平成28年2月9日)、設定受付日(平成28年2月9日)分の  
設定ポートフォリオは以下の通りです。

なお、以下のポートフォリオは、最小設定口数となるポートフォリオです。

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
1	1605	国際石油開発帝石	4,800
2	1719	安藤・間	600
3	1721	コムシスホールディングス	400
4	1722	ミサワホーム	100
5	1801	大成建設	5,000
6	1802	大林組	2,800
7	1803	清水建設	3,000
8	1808	長谷工コーポレーション	1,100
9	1812	鹿島建設	4,000
10	1821	三井住友建設	3,500
11	1878	大東建託	300
12	1911	住友林業	600
13	1925	大和ハウス工業	2,700
14	1928	積水ハウス	3,100
15	1951	協和エクシオ	400
16	1963	日揮	1,000
17	2121	ミクシィ	200
18	2127	日本M&Aセンター	100
19	2181	テンブホールディングス	600
20	2193	クックパッド	200
21	2229	カルビー	300
22	2267	ヤクルト本社	500
23	2269	明治ホールディングス	500
24	2282	日本ハム	1,000
25	2331	総合警備保障	300
26	2371	カカクコム	600
27	2413	エムスリー	700
28	2432	ディー・エヌ・エー	400
29	2433	博報堂DYホールディングス	1,200
30	2502	アサヒグループホールディングス	1,700
31	2503	麒麟ホールディングス	3,700
32	2593	伊藤園	300
33	2651	ローソン	300
34	2670	エービーシー・マート	100
35	2681	ゲオホールディングス	200
36	2768	双日	5,100
37	2782	セリア	100
38	2784	アルフレッサ ホールディングス	1,000
39	2801	キッコーマン	1,000
40	2802	味の素	2,000
41	2809	キューピー	500
42	2871	ニチレイ	1,000
43	2875	東洋水産	500
44	2897	日清食品ホールディングス	400
45	2914	日本たばこ産業	5,300
46	3003	ヒューリック	1,700
47	3064	MonotaRO	300
48	3086	J. フロント リテイリング	1,000
49	3088	マツモトキヨシホールディングス	200
50	3092	スタートトゥデイ	200

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	3099	三越伊勢丹ホールディングス	1,600
52	3116	トヨタ紡織	300
53	3141	ウエルシアホールディングス	100
54	3231	野村不動産ホールディングス	500
55	3289	東急不動産ホールディングス	2,000
56	3291	飯田グループホールディングス	800
57	3360	シップヘルスケアホールディングス	200
58	3382	セブン&アイ・ホールディングス	3,400
59	3391	ツルハホールディングス	200
60	3402	東レ	6,000
61	3405	クラレ	1,400
62	3407	旭化成	5,000
63	3632	グリーン	500
64	3659	ネクソン	800
65	3738	ティーガイア	100
66	3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1,900
67	3861	王子ホールディングス	4,000
68	3880	大王製紙	400
69	4005	住友化学	6,000
70	4021	日産化学工業	500
71	4042	東ソー	2,000
72	4061	デンカ	2,000
73	4063	信越化学工業	1,500
74	4088	エア・ウォーター	1,000
75	4091	大陽日酸	700
76	4095	日本パーカライジング	400
77	4151	協和発酵キリン	1,000
78	4185	JSR	800
79	4188	三菱ケミカルホールディングス	5,800
80	4202	ダイセル	1,200
81	4204	積水化学工業	2,000
82	4205	日本ゼオン	1,000
83	4206	アイカ工業	300
84	4208	宇部興産	5,000
85	4217	日立化成	400
86	4272	日本化薬	1,000
87	4307	野村総合研究所	600
88	4324	電通	1,000
89	4403	日油	1,000
90	4452	花王	2,300
91	4502	武田薬品工業	3,400
92	4503	アステラス製薬	9,600
93	4507	塩野義製薬	1,300
94	4508	田辺三菱製薬	1,000
95	4519	中外製薬	900
96	4521	科研製薬	100
97	4523	エーザイ	1,100
98	4527	ロート製薬	400
99	4528	小野薬品工業	400
100	4530	久光製薬	300
101	4534	持田製薬	100
102	4536	参天製薬	1,600
103	4540	ツムラ	300
104	4543	テルモ	1,300
105	4544	みらかホールディングス	200
106	4555	沢井製薬	100
107	4568	第一三共	2,900
108	4569	キョーリン製薬ホールディングス	200
109	4578	大塚ホールディングス	1,800
110	4581	大正製薬ホールディングス	200

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	4612	日本ペイントホールディングス	700
112	4613	関西ペイント	1,000
113	4631	DIC	3,000
114	4661	オリエンタルランド	900
115	4666	パーク24	400
116	4676	フジ・メディア・ホールディングス	800
117	4681	リゾートトラスト	400
118	4684	オービック	300
119	4689	ヤフー	5,800
120	4704	トレンドマイクロ	400
121	4716	日本オラクル	100
122	4732	ユー・エス・エス	1,000
123	4739	伊藤忠テクノソリューションズ	200
124	4751	サイバーエージェント	200
125	4755	楽天	4,000
126	4768	大塚商会	200
127	4842	USEN	400
128	4901	富士フイルムホールディングス	2,000
129	4902	ユニカミノルタ	2,100
130	4911	資生堂	1,600
131	4922	コーセー	100
132	4924	シーズ・ホールディングス	100
133	4967	小林製薬	100
134	5002	昭和シェル石油	900
135	5101	横浜ゴム	500
136	5105	東洋ゴム工業	400
137	5108	ブリヂストン	2,900
138	5110	住友ゴム工業	800
139	5201	旭硝子	5,000
140	5233	太平洋セメント	5,000
141	5332	TOTO	600
142	5333	日本碍子	1,000
143	5334	日本特殊陶業	700
144	5401	新日鐵住金	3,900
145	5406	神戸製鋼所	16,000
146	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	2,400
147	5486	日立金属	1,000
148	5706	三井金属鉱業	2,000
149	5711	三菱マテリアル	5,000
150	5713	住友金属鉱山	2,000
151	5714	DOWAホールディングス	1,000
152	5802	住友電気工業	3,400
153	5857	アサヒホールディングス	100
154	5929	三和ホールディングス	900
155	5932	三協立山	100
156	5947	リンナイ	200
157	5949	ユニプレス	200
158	5991	日本発条	800
159	6136	オーエスジー	400
160	6146	ディスコ	100
161	6201	豊田自動織機	700
162	6268	ナブテスコ	400
163	6273	SMC	300
164	6301	小松製作所	4,200
165	6302	住友重機械工業	3,000
166	6305	日立建機	400
167	6326	クボタ	4,100
168	6361	荏原製作所	2,000
169	6366	千代田化工建設	1,000
170	6367	ダイキン工業	1,200

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	6412	平和	300
172	6425	ユニバーサルエンターテインメント	100
173	6448	ブラザー工業	1,100
174	6460	セガサミーホールディングス	900
175	6463	TPR	100
176	6465	ホシザキ電機	200
177	6471	日本精工	1,700
178	6473	ジェイテクト	900
179	6474	不二越	1,000
180	6479	ミネベア	1,000
181	6481	THK	500
182	6486	イーグル工業	100
183	6501	日立製作所	21,000
184	6503	三菱電機	9,000
185	6504	富士電機	2,000
186	6506	安川電機	1,000
187	6586	マキタ	500
188	6594	日本電産	1,000
189	6645	オムロン	900
190	6701	日本電気	11,000
191	6702	富士通	8,000
192	6703	沖電気工業	4,000
193	6724	セイコーエプソン	1,200
194	6727	ワコム	600
195	6752	パナソニック	9,400
196	6754	アンリツ	500
197	6762	TDK	500
198	6770	アルプス電気	700
199	6806	ヒロセ電機	100
200	6841	横河電機	800
201	6849	日本光電工業	300
202	6856	堀場製作所	200
203	6861	キーエンス	200
204	6869	シスメックス	600
205	6902	デンソー	2,000
206	6923	スタンレー電気	600
207	6952	カシオ計算機	800
208	6954	ファナック	800
209	6965	浜松ホトニクス	600
210	6971	京セラ	1,300
211	6981	村田製作所	900
212	6988	日東電工	700
213	6995	東海理化電機製作所	200
214	7003	三井造船	3,000
215	7011	三菱重工業	15,000
216	7012	川崎重工業	6,000
217	7013	IHI	6,000
218	7014	名村造船所	200
219	7201	日産自動車	11,500
220	7202	いすゞ自動車	2,400
221	7203	トヨタ自動車	2,400
222	7205	日野自動車	1,200
223	7211	三菱自動車工業	3,300
224	7240	NOK	400
225	7248	カルソニックカンセイ	1,000
226	7259	アイシン精機	800
227	7261	マツダ	2,600
228	7262	ダイハツ工業	1,000
229	7267	本田技研工業	5,500
230	7269	スズキ	1,700



設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
231	7270	富士重工業	2,600
232	7272	ヤマハ発動機	1,200
233	7276	小糸製作所	500
234	7278	エクセディ	100
235	7280	ミツバ	100
236	7282	豊田合成	300
237	7309	シマノ	300
238	7313	テイ・エス テック	200
239	7453	良品計画	100
240	7458	第一興商	200
241	7459	メディopalホールディングス	800
242	7532	ドンキホーテホールディングス	500
243	7593	VTホールディングス	400
244	7606	ユナイテッドアローズ	100
245	7649	スギホールディングス	100
246	7731	ニコン	1,500
247	7732	トプコン	300
248	7733	オリンパス	1,200
249	7741	HOYA	1,900
250	7751	キヤノン	4,400
251	7752	リコー	2,700
252	7832	バンダイナムコホールディングス	800
253	7846	パイロットコーポレーション	100
254	7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	100
255	7936	アシックス	800
256	7951	ヤマハ	600
257	7956	ビジョン	500
258	7988	ニフコ	200
259	8001	伊藤忠商事	6,400
260	8002	丸紅	8,000
261	8015	豊田通商	900
262	8020	兼松	2,000
263	8028	ファミリーマート	200
264	8031	三井物産	7,300
265	8035	東京エレクトロン	700
266	8036	日立ハイテクノロジーズ	300
267	8050	セイコーホールディングス	1,000
268	8053	住友商事	5,100
269	8058	三菱商事	6,100
270	8088	岩谷産業	1,000
271	8113	ユニ・チャーム	1,700
272	8129	東邦ホールディングス	300
273	8136	サンリオ	200
274	8174	日本瓦斯	100
275	8214	AOKIホールディングス	200
276	8227	しまむら	100
277	8233	高島屋	1,000
278	8253	クレディセゾン	600
279	8267	イオン	3,300
280	8273	イズミ	200
281	8279	ヤオコー	100
282	8282	ケーズホールディングス	200
283	8303	新生銀行	7,000
284	8304	あおぞら銀行	5,000
285	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	24,900
286	8308	りそなホールディングス	9,500
287	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	17,000
288	8316	三井住友フィナンシャルグループ	4,200
289	8327	西日本シティ銀行	3,000
290	8331	千葉銀行	3,000

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
291	8332	横浜銀行	5,000
292	8333	常陽銀行	3,000
293	8334	群馬銀行	2,000
294	8354	ふくおかフィナンシャルグループ	4,000
295	8355	静岡銀行	2,000
296	8356	十六銀行	1,000
297	8358	スルガ銀行	800
298	8359	八十二銀行	2,000
299	8377	ほくほくフィナンシャルグループ	6,000
300	8379	広島銀行	2,000
301	8382	中国銀行	800
302	8385	伊予銀行	1,200
303	8410	セブン銀行	3,000
304	8411	みずほフィナンシャルグループ	83,300
305	8418	山口フィナンシャルグループ	1,000
306	8424	芙蓉総合リース	100
307	8425	興銀リース	200
308	8439	東京センチュリーリース	200
309	8473	SBIホールディングス	1,000
310	8524	北洋銀行	1,200
311	8544	京葉銀行	1,000
312	8570	イオンフィナンシャルサービス	500
313	8572	アコム	1,600
314	8586	日立キャピタル	200
315	8591	オリックス	5,700
316	8593	三菱UFJリース	2,100
317	8595	ジャフコ	100
318	8601	大和証券グループ本社	8,000
319	8604	野村ホールディングス	15,600
320	8609	岡三証券グループ	1,000
321	8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	900
322	8628	松井証券	400
323	8630	損保ジャパン日本興亜ホールディングス	1,800
324	8697	日本取引所グループ	2,400
325	8703	カブドットコム証券	700
326	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2,400
327	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	800
328	8750	第一生命保険	5,200
329	8766	東京海上ホールディングス	3,300
330	8795	T&Dホールディングス	3,000
331	8801	三井不動産	4,000
332	8802	三菱地所	6,000
333	8804	東京建物	900
334	8830	住友不動産	2,000
335	8840	大京	2,000
336	8848	レオパレス21	1,000
337	8850	スターツコーポレーション	100
338	8870	住友不動産販売	100
339	8897	タカラレーベン	400
340	8905	イオンモール	500
341	8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	500
342	9001	東武鉄道	4,000
343	9003	相鉄ホールディングス	2,000
344	9005	東京急行電鉄	5,000
345	9007	小田急電鉄	3,000
346	9008	京王電鉄	2,000
347	9009	京成電鉄	1,000
348	9020	東日本旅客鉄道	1,500
349	9021	西日本旅客鉄道	800
350	9022	東海旅客鉄道	700

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
351	9031	西日本鉄道	1,000
352	9041	近鉄グループホールディングス	8,000
353	9042	阪急阪神ホールディングス	6,000
354	9044	南海電気鉄道	2,000
355	9045	京阪電気鉄道	2,000
356	9048	名古屋鉄道	4,000
357	9062	日本通運	3,000
358	9064	ヤマトホールディングス	1,500
359	9065	山九	1,000
360	9101	日本郵船	7,000
361	9202	ANAホールディングス	15,000
362	9375	近鉄エクスプレス	100
363	9404	日本テレビホールディングス	700
364	9432	日本電信電話	4,900
365	9433	KDDI	7,400
366	9435	光通信	100
367	9437	NTTドコモ	6,300
368	9449	GMOインターネット	300
369	9513	電源開発	700
370	9531	東京瓦斯	9,000
371	9532	大阪瓦斯	9,000
372	9602	東宝	600
373	9603	エイチ・アイ・エス	100
374	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	500
375	9627	アインホールディングス	100
376	9678	カナモト	100
377	9719	SCSK	200
378	9735	セコム	900
379	9783	ベネッセホールディングス	300
380	9787	イオンデイライト	100
381	9810	日鉄住金物産	1,000
382	9843	ニトリホールディングス	400
383	9956	バローホールディングス	200
384	9962	ミスミグループ本社	900
385	9983	ファーストリテイリング	200
386	9984	ソフトバンクグループ	3,300
387	9989	サンドラッグ	200

以上