

平成28年2月23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22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22日現在)

5,758,104 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年2月22日現在)

92,852,431,998 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年2月22日現在)

16,126 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22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
2016/1/25	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
2016/2/4	17,044.99	-0.85%	17,062	-0.85%	0.00%	6,521,659	111,271,285,923
2016/2/5	16,819.59	-1.32%	16,835	-1.33%	-0.01%	6,623,527	111,508,051,042
2016/2/8	17,004.30	1.10%	17,020	1.10%	0.00%	6,623,527	112,735,622,717
2016/2/9	16,085.44	-5.40%	16,101	-5.40%	0.00%	6,776,338	109,103,577,359
2016/2/10	15,713.39	-2.31%	15,728	-2.32%	-0.00%	6,776,338	106,579,290,296
2016/2/12	14,952.61	-4.84%	14,966	-4.84%	-0.00%	6,827,275	102,175,206,642
2016/2/15	16,022.58	7.16%	16,037	7.16%	0.00%	6,878,214	110,305,057,079
2016/2/16	16,054.43	0.20%	16,069	0.20%	0.00%	5,859,854	94,164,792,861
2016/2/17	15,836.36	-1.36%	15,850	-1.36%	-0.00%	5,758,104	91,268,079,368
2016/2/18	16,196.80	2.28%	16,213	2.29%	0.01%	5,758,104	93,354,732,301
2016/2/19	15,967.17	-1.42%	15,982	-1.42%	-0.01%	5,758,104	92,027,613,897
2016/2/22	16,111.05	0.90%	16,126	0.90%	-0.00%	5,758,104	92,852,431,998

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年2月26日)、交換受付日(平成28年2月26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26日)、設定受付日(平成28年2月26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28年2月22日現在)

26,137,788 口

---

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年2月22日現在)

33,974,560,011 円

---

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年2月22日現在)

1,299.83 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22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
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
2016/2/4	1,388.81	-1.24%	1,388.75	-1.24%	0.00%	32,028,552	44,479,542,628
2016/2/5	1,368.97	-1.43%	1,368.80	-1.44%	-0.01%	32,028,552	43,840,748,507
2016/2/8	1,380.41	0.84%	1,380.28	0.84%	0.00%	32,028,552	44,208,220,115
2016/2/9	1,304.33	-5.51%	1,304.23	-5.51%	0.00%	32,028,552	41,772,676,363
2016/2/10	1,264.96	-3.02%	1,264.88	-3.02%	0.00%	32,028,552	40,512,368,824
2016/2/12	1,196.28	-5.43%	1,196.13	-5.44%	-0.01%	32,028,552	38,310,268,687
2016/2/15	1,292.23	8.02%	1,292.11	8.02%	0.00%	32,028,552	41,384,275,466
2016/2/16	1,297.01	0.37%	1,296.83	0.37%	-0.00%	26,137,788	33,896,182,449
2016/2/17	1,282.40	-1.13%	1,282.17	-1.13%	-0.00%	26,137,788	33,513,043,103
2016/2/18	1,311.20	2.25%	1,311.08	2.25%	0.01%	26,137,788	34,268,814,775
2016/2/19	1,291.82	-1.48%	1,291.72	-1.48%	0.00%	26,137,788	33,762,689,143
2016/2/22	1,300.00	0.63%	1,299.83	0.63%	-0.01%	26,137,788	33,974,560,011

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年2月26日)、交換受付日(平成28年2月26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26日)、設定受付日(平成28年2月26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22日現在）

2,505,639 口

2. 上場ETFの純資産総額（平成28年2月22日現在）

29,470,858,405 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（平成28年2月22日現在）

11,762 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22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
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
2016/2/4	12,532.60	-1.23%	12,523	-1.23%	0.00%	3,094,321	38,748,709,337
2016/2/5	12,358.86	-1.39%	12,348	-1.40%	-0.01%	3,094,321	38,209,189,016
2016/2/8	12,458.11	0.80%	12,448	0.81%	0.01%	3,094,321	38,516,908,761
2016/2/9	11,771.53	-5.51%	11,762	-5.51%	0.00%	3,094,321	36,394,786,633
2016/2/10	11,416.56	-3.02%	11,407	-3.02%	-0.00%	3,094,321	35,297,076,136
2016/2/12	10,780.40	-5.57%	10,771	-5.58%	-0.00%	3,094,321	33,329,068,080
2016/2/15	11,675.35	8.30%	11,665	8.30%	-0.00%	3,094,321	36,094,870,449
2016/2/16	11,721.81	0.40%	11,711	0.39%	-0.00%	2,505,639	29,344,159,438
2016/2/17	11,586.63	-1.15%	11,576	-1.15%	0.00%	2,505,639	29,004,921,769
2016/2/18	11,850.64	2.28%	11,841	2.29%	0.01%	2,505,639	29,668,975,744
2016/2/19	11,688.54	-1.37%	11,679	-1.37%	-0.00%	2,505,639	29,262,441,608
2016/2/22	11,772.51	0.72%	11,762	0.71%	-0.01%	2,505,639	29,470,858,405

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年2月26日)、交換受付日(平成28年2月26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26日)、設定受付日(平成28年2月26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