

平成28年6月10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6月9日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(4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
4	<a href="#">DIAM ETF JPX/S&amp;P 設備・人材投資指数</a>	1484	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6月9日現在)

6,977,186 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年6月9日現在)

117,315,119,794 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年6月9日現在)

16,814 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6月9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、委託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
2016/5/13	16,412.21	-1.41%	16,557	-1.41%	-0.00%	7,077,715	117,184,483,422
2016/5/16	16,466.40	0.33%	16,614	0.34%	0.01%	7,077,715	117,585,832,609
2016/5/17	16,652.80	1.13%	16,801	1.13%	-0.01%	7,482,023	125,708,524,179
2016/5/18	16,644.69	-0.05%	16,792	-0.05%	-0.00%	7,482,023	125,636,024,506
2016/5/19	16,646.66	0.01%	16,794	0.01%	0.00%	7,482,023	125,655,079,910
2016/5/20	16,736.35	0.54%	16,885	0.54%	0.00%	7,431,480	125,478,984,497
2016/5/23	16,654.60	-0.49%	16,802	-0.49%	-0.00%	7,431,480	124,865,313,346
2016/5/24	16,498.76	-0.94%	16,645	-0.93%	0.00%	7,431,480	123,694,825,338
2016/5/25	16,757.35	1.57%	16,906	1.57%	0.00%	7,431,480	125,635,881,416
2016/5/26	16,772.46	0.09%	16,921	0.09%	-0.00%	7,431,480	125,748,867,458
2016/5/27	16,834.84	0.37%	16,983	0.37%	-0.01%	7,431,480	126,212,399,437
2016/5/30	17,068.02	1.39%	17,219	1.39%	0.00%	7,431,480	127,961,309,448
2016/5/31	17,234.98	0.98%	17,387	0.98%	-0.00%	7,128,222	123,937,561,821
2016/6/1	16,955.73	-1.62%	17,105	-1.62%	-0.00%	7,128,222	121,930,799,816
2016/6/2	16,562.55	-2.32%	16,709	-2.32%	0.00%	6,774,950	113,201,972,341
2016/6/3	16,642.23	0.48%	16,789	0.48%	-0.00%	6,724,461	112,897,107,106
2016/6/6	16,580.03	-0.37%	16,725	-0.38%	-0.01%	6,977,186	116,696,641,005
2016/6/7	16,675.45	0.58%	16,822	0.58%	0.00%	6,977,186	117,373,684,284
2016/6/8	16,830.92	0.93%	16,979	0.93%	0.00%	6,977,186	118,464,420,294
2016/6/9	16,668.41	-0.97%	16,814	-0.97%	-0.01%	6,977,186	117,315,119,794

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年6月15日)、交換受付日(平成28年6月15日)分の  
交換口数は以下の通りです。

交換口数 50,700 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6月15日)、設定受付日(平成28年6月15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	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,000
142	7201	日産自動車	2,000
143	7202	いすゞ自動車	1,000
144	7203	トヨタ自動車	2,000
145	7205	日野自動車	2,000
146	7211	三菱自動車工業	200
147	7261	マツダ	400
148	7267	本田技研工業	4,000
149	7269	スズキ	2,000
150	7270	富士重工業	2,000
151	7731	ニコン	2,000
152	7733	オリンパス	2,000
153	7735	SCREENホールディングス	2,000
154	7751	キヤノン	3,000
155	7752	リコー	2,000
156	7762	シチズンホールディングス	2,000
157	7911	凸版印刷	2,000
158	7912	大日本印刷	2,000
159	7951	ヤマハ	2,000
160	8001	伊藤忠商事	2,000
161	8002	丸紅	2,000
162	8015	豊田通商	2,000
163	8031	三井物産	2,000
164	8035	東京エレクトロン	2,000
165	8053	住友商事	2,000
166	8058	三菱商事	2,000
167	8233	高島屋	2,000
168	8252	丸井グループ	2,000
169	8253	クレディセゾン	2,000
170	8267	イオン	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	8270	ユニーグループ・ホールディングス	2,000
172	8303	新生銀行	2,000
173	8304	あおぞら銀行	2,000
174	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,000
175	8308	りそなホールディングス	200
176	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	2,000
177	8316	三井住友フィナンシャルグループ	200
178	8331	千葉銀行	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	東京電力ホールディングス	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6月9日現在)

38,123,591 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年6月9日現在)

51,478,772,795 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年6月9日現在)

1,350.31 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6月9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
2016/5/13	1,320.19	-1.28%	1,332.75	-1.29%	-0.01%	37,125,191	49,478,435,501
2016/5/16	1,321.65	0.11%	1,334.52	0.13%	0.02%	37,125,191	49,544,340,913
2016/5/17	1,335.85	1.07%	1,348.86	1.07%	0.00%	37,125,191	50,076,638,307
2016/5/18	1,338.38	0.19%	1,351.26	0.18%	-0.01%	37,125,191	50,165,927,843
2016/5/19	1,336.56	-0.14%	1,349.45	-0.13%	0.00%	37,125,191	50,098,721,872
2016/5/20	1,343.40	0.51%	1,356.38	0.51%	0.00%	37,125,191	50,355,755,251
2016/5/23	1,338.68	-0.35%	1,351.65	-0.35%	0.00%	37,125,191	50,180,260,620
2016/5/24	1,326.50	-0.91%	1,339.34	-0.91%	-0.00%	37,125,191	49,723,289,952
2016/5/25	1,342.88	1.23%	1,355.93	1.24%	0.00%	37,125,191	50,339,218,426
2016/5/26	1,342.87	0.00%	1,355.92	0.00%	0.00%	37,125,191	50,338,792,230
2016/5/27	1,349.93	0.53%	1,363.04	0.53%	-0.00%	37,125,191	50,603,294,882
2016/5/30	1,366.01	1.19%	1,379.28	1.19%	0.00%	37,125,191	51,205,899,620
2016/5/31	1,379.80	1.01%	1,393.13	1.00%	-0.01%	37,125,191	51,720,139,749
2016/6/1	1,362.07	-1.28%	1,375.30	-1.28%	0.01%	37,125,191	51,058,255,294
2016/6/2	1,331.81	-2.22%	1,344.80	-2.22%	0.00%	37,125,191	49,926,103,208
2016/6/3	1,337.23	0.41%	1,350.25	0.41%	-0.00%	37,125,191	50,128,200,732
2016/6/6	1,332.43	-0.36%	1,345.33	-0.36%	-0.01%	37,125,191	49,945,733,451
2016/6/7	1,340.77	0.63%	1,353.83	0.63%	0.01%	37,125,191	50,261,316,792
2016/6/8	1,350.97	0.76%	1,364.09	0.76%	-0.00%	37,125,191	50,642,069,775
2016/6/9	1,337.41	-1.00%	1,350.31	-1.01%	-0.01%	38,123,591	51,478,772,795

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年6月15日)、交換受付日(平成28年6月15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6月15日)、設定受付日(平成28年6月15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6月9日現在)

3,701,156 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年6月9日現在)

44,931,878,687 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年6月9日現在)

12,140 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6月9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、委託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
2016/5/13	11,928.21	-1.32%	12,023	-1.34%	-0.02%	3,699,761	44,483,448,576
2016/5/16	11,961.84	0.28%	12,060	0.31%	0.03%	3,699,761	44,618,163,746
2016/5/17	12,086.52	1.04%	12,185	1.04%	-0.01%	3,699,761	45,082,965,713
2016/5/18	12,104.18	0.15%	12,202	0.14%	-0.01%	3,699,761	45,142,865,873
2016/5/19	12,086.37	-0.15%	12,184	-0.15%	-0.00%	3,699,761	45,077,305,936
2016/5/20	12,136.17	0.41%	12,234	0.41%	-0.00%	3,699,761	45,264,406,418
2016/5/23	12,090.65	-0.38%	12,189	-0.37%	0.01%	3,799,316	46,308,376,837
2016/5/24	11,974.59	-0.96%	12,071	-0.97%	-0.01%	3,799,316	45,863,210,962
2016/5/25	12,118.43	1.20%	12,217	1.21%	0.01%	3,799,316	46,416,337,165
2016/5/26	12,114.06	-0.04%	12,212	-0.04%	-0.00%	3,799,316	46,397,867,337
2016/5/27	12,180.00	0.54%	12,279	0.55%	0.00%	3,799,316	46,650,484,036
2016/5/30	12,329.06	1.22%	12,429	1.22%	-0.00%	3,799,316	47,221,490,444
2016/5/31	12,453.26	1.01%	12,554	1.01%	-0.00%	3,799,316	47,695,497,099
2016/6/1	12,283.58	-1.36%	12,383	-1.36%	0.00%	3,799,316	47,045,922,766
2016/6/2	12,004.95	-2.27%	12,102	-2.27%	-0.00%	3,799,316	45,978,506,308
2016/6/3	12,047.90	0.36%	12,145	0.36%	-0.00%	3,799,316	46,144,331,060
2016/6/6	12,005.62	-0.35%	12,102	-0.35%	-0.00%	3,799,316	45,978,296,446
2016/6/7	12,083.08	0.65%	12,180	0.64%	-0.00%	3,799,316	46,277,308,698
2016/6/8	12,174.51	0.76%	12,273	0.76%	0.01%	3,701,156	45,422,726,435
2016/6/9	12,043.82	-1.07%	12,140	-1.08%	-0.01%	3,701,156	44,931,878,687

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年6月15日)、交換受付日(平成28年6月15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6月15日)、設定受付日(平成28年6月15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

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 1484)  
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/S&P 設備・人材投資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28年6月9日現在)

15,652,100 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年6月9日現在)

19,337,729,555 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年6月9日現在)

1235.47 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とJPX/S&P 設備・人材投資指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年6月9日現在)

- %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[ \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{JPX/S\&P 設備・人材投資指数の終値}}{\text{前営業日のJPX/S\&P 設備・人材投資指数の終値}} \right] \times 100(\%)$$

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)

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年6月15日)、交換受付日(平成28年6月15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6月15日)、設定受付日(平成28年6月15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、50万口に相当する設定ポートフォリオです。

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
1	1333	マルハニチロ	300
2	1414	ショーボンドホールディングス	100
3	1417	ミライト・ホールディングス	400
4	1605	国際石油開発帝石	5,800
5	1719	安藤・間	700
6	1721	コムシスホールディングス	400
7	1801	大成建設	7,000
8	1802	大林組	2,700
9	1805	飛島建設	1,000
10	1812	鹿島建設	6,000
11	1813	不動テトラ	1,000
12	1824	前田建設工業	1,000
13	1861	熊谷組	1,000
14	1878	大東建託	600
15	1888	若築建設	1,000
16	1890	東洋建設	400
17	1911	住友林業	1,000
18	1925	大和ハウス工業	2,900
19	1926	ライト工業	200
20	1928	積水ハウス	3,900
21	1944	きんでん	600
22	1963	日揮	1,000
23	1983	東芝プラントシステム	200
24	2127	日本M&Aセンター	200
25	2181	テンプホールディングス	900
26	2229	カルビー	400
27	2269	明治ホールディングス	600
28	2281	プリマハム	1,000
29	2282	日本ハム	1,000
30	2371	カカクコム	600
31	2413	エムスリー	1,200
32	2433	博報堂DYホールディングス	1,500
33	2502	アサヒグループホールディングス	2,400
34	2503	キリンホールディングス	3,700
35	2531	宝ホールディングス	700
36	2580	コカ・コーライーストジャパン	400
37	2587	サントリー食品インターナショナル	600
38	2607	不二製油グループ本社	300
39	2670	エービーシー・マート	100
40	2685	アダストリア	100
41	2784	アルフレッサ ホールディングス	1,300
42	2802	味の素	2,500
43	2809	キューピー	400
44	2871	ニチレイ	1,000
45	3046	ジェイアイエヌ	100
46	3048	ビックカメラ	700
47	3076	あい ホールディングス	200
48	3087	ドトール・日レスホールディングス	200
49	3088	マツモトキヨシホールディングス	200
50	3099	三越伊勢丹ホールディングス	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
51	3105	日清紡ホールディングス	500
52	3231	野村不動産ホールディングス	600
53	3360	シップヘルスケアホールディングス	200
54	3382	セブン&アイ・ホールディングス	3,800
55	3391	ツルハホールディングス	200
56	3402	東レ	8,000
57	3407	旭化成	5,000
58	3591	ワコールホールディングス	1,000
59	3668	コロプラ	200
60	3863	日本製紙	400
61	4004	昭和電工	6,000
62	4185	JSR	900
63	4204	積水化学工業	2,300
64	4217	日立化成	400
65	4452	花王	2,900
66	4502	武田薬品工業	3,900
67	4503	アステラス製薬	11,700
68	4516	日本新薬	200
69	4519	中外製薬	1,100
70	4536	参天製薬	2,100
71	4543	テルモ	1,100
72	4544	みらかホールディングス	200
73	4555	沢井製薬	200
74	4568	第一三共	3,200
75	4661	オリエンタルランド	900
76	4681	リゾートトラスト	400
77	4684	オービック	400
78	4716	日本オラクル	100
79	4768	大塚商会	400
80	4901	富士フイルムホールディングス	2,200
81	4902	コニカミノルタ	2,100
82	4921	ファンケル	200
83	4924	シーズ・ホールディングス	100
84	4967	小林製薬	100
85	5002	昭和シェル石油	1,300
86	5012	東燃ゼネラル石油	2,000
87	5101	横浜ゴム	600
88	5108	ブリヂストン	3,200
89	5201	旭硝子	4,000
90	5233	太平洋セメント	5,000
91	5332	TOTO	800
92	5334	日本特殊陶業	1,100
93	5440	共英製鋼	100
94	5715	古河機械金属	2,000
95	5741	UACJ	1,000
96	5929	三和ホールディングス	800
97	5938	LIXILグループ	1,400
98	5947	リンナイ	200
99	6098	リクルートホールディングス	1,500
100	6140	旭ダイヤモンド工業	300
101	6146	ディスコ	100
102	6291	日本エアーテック	100
103	6301	小松製作所	4,500
104	6361	荏原製作所	2,000
105	6366	千代田化工建設	1,000
106	6370	栗田工業	600
107	6395	タダノ	400
108	6406	フジテック	300
109	6412	平和	200
110	6457	グローリー	300



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	6465	ホシザキ電機	200
112	6592	マブチモーター	200
113	6624	田淵電機	100
114	6701	日本電気	11,000
115	6702	富士通	11,000
116	6727	ワコム	600
117	6762	TDK	500
118	6810	日立マクセル	200
119	6841	横河電機	900
120	6845	アズビル	300
121	6869	シスメックス	700
122	6877	OBARA GROUP	100
123	6902	デンソー	2,200
124	6952	カシオ計算機	800
125	6971	京セラ	1,400
126	7011	三菱重工業	15,000
127	7164	全国保証	200
128	7201	日産自動車	13,200
129	7203	トヨタ自動車	5,300
130	7262	ダイハツ工業	1,100
131	7453	良品計画	100
132	7459	メディバルホールディングス	900
133	7532	ドンキホーテホールディングス	500
134	7606	ユナイテッドアローズ	100
135	7701	島津製作所	1,000
136	7731	ニコン	1,400
137	7735	SCREENホールディングス	1,000
138	7752	リコー	2,800
139	7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	100
140	7911	凸版印刷	3,000
141	7912	大日本印刷	2,000
142	7936	アシックス	1,400
143	7956	ピジョン	400
144	8001	伊藤忠商事	8,100
145	8002	丸紅	11,900
146	8015	豊田通商	1,100
147	8016	オンワードホールディングス	1,000
148	8028	ファミリーマート	300
149	8031	三井物産	6,600
150	8035	東京エレクトロン	800
151	8053	住友商事	5,100
152	8088	岩谷産業	1,000
153	8219	青山商事	200
154	8227	しまむら	100
155	8233	高島屋	2,000
156	8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	500
157	8267	イオン	4,100
158	8282	ケーズホールディングス	400
159	8304	あおぞら銀行	6,000
160	8308	りそなホールディングス	10,700
161	8355	静岡銀行	2,000
162	8382	中国銀行	600
163	8411	みずほフィナンシャルグループ	146,300
164	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	1,200
165	8732	マネーパートナーズグループ	100
166	8905	イオンモール	600
167	9001	東武鉄道	6,000
168	9062	日本通運	3,000
169	9076	セイノーホールディングス	700
170	9086	日立物流	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	9201	日本航空	1,600
172	9202	ANAホールディングス	20,000
173	9375	近鉄エクスプレス	200
174	9404	日本テレビホールディングス	1,100
175	9412	スカパーJSATホールディングス	800
176	9432	日本電信電話	5,700
177	9435	光通信	100
178	9505	北陸電力	1,000
179	9603	エイチ・アイ・エス	200
180	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	600
181	9616	共立メンテナンス	100
182	9678	カナモト	200
183	9699	西尾レントオール	100
184	9719	SCSK	200
185	9744	メイテック	100
186	9783	ベネッセホールディングス	300
187	9843	ニトリホールディングス	300
188	9962	ミスミグループ本社	1,000
189	9983	ファーストリテイリング	200
190	9984	ソフトバンクグループ	4,500
191	9987	スズケン	500
192	9989	サンドラッグ	200

以上