

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
(管理会社コード:13054)
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

上場ETF(管理会社:大和証券投資信託委託)に関する日々の開示事項 1/2

大和証券投資信託委託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16日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(17銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	ダイワ上場投信－日経225	1320	東
2	ダイワ上場投信－トピックス	1305	東
3	ダイワ上場投信－トピックス・コア30	1310	東
4	ダイワ上場投信－東証電気機器株価指数	1610	東
5	ダイワ上場投信－東証銀行業株価指数	1612	東
6	ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials	1585	東
7	ダイワ上場投信－JPX日経400	1599	東
8	ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス	1365	東
9	ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス	1366	東
10	ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数	1367	東
11	ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数	1368	東
12	ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス	1456	東
13	ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数	1457	東
14	ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス	1464	東
15	ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス	1465	東
16	ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス	1466	東
17	ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数	1479	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、各銘柄の保有状況が表示されます。

以上

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1320)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信一日経225』に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信一日経225』の上場受益権口数
(平成28年6月16日 現在)

84,654,934 口

2. 『ダイワ上場投信一日経225』の純資産総額
(平成28年6月16日 現在)

1,350,972,220,238 円

3. 『ダイワ上場投信一日経225』の一口あたりの純資産額
(平成28年6月16日 現在)

15,958.6 円

4. 『ダイワ上場投信一日経225』の一口あたりの純資産額と
『日経平均株価』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年6月16日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年6月17日 現在)

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バスケット	1	1332 日本水産	2,000
銘柄数 = 225	2	1333 マルハニチロ	200
バスケット提示日 = 平成28年6月17日	3	1605 国際石油開発帝石	800
追加設定日 = 平成28年6月23日	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

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

	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

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
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	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

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
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
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

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
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

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1305)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信ートピックス』に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信ートピックス』の上場受益権口数

(平成28年6月16日 現在)

917,495,121 口

2. 『ダイワ上場投信ートピックス』の純資産総額

(平成28年6月16日 現在)

1,196,279,065,861 円

3. 『ダイワ上場投信ートピックス』の一口あたりの純資産額

(平成28年6月16日 現在)

1,303.85 円

4. 『ダイワ上場投信ートピックス』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16日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年6月17日 現在)

[掲載番号:2]

ダイワ上場投信ートピックス(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成28年6月17日
追加設定日 = 平成28年6月23日

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1310)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の上場受益権口数
(平成28年6月16日 現在)

2,602,584 口

2. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の純資産総額
(平成28年6月16日 現在)

1,514,110,951 円

3. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の一口あたりの純資産額
(平成28年6月16日 現在)

581.772 円

4. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の一口あたりの純資産額と
『TOPIX Core30 指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年6月16日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年6月17日 現在)

ダイワ上場投信ートピックス・コア30(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バスケット	1	2914 日本たばこ産業	9,700
銘柄数 = 30	2	3382 セブン&アイ・ホールディングス	6,000
バスケット提示日 = 平成28年6月17日	3	4063 信越化学工業	2,700
追加設定日 = 平成28年6月23日	4	4502 武田薬品工業	6,100
	5	4503 アステラス製薬	17,100
	6	6501 日立製作所	37,000
	7	6752 パナソニック	16,700
	8	6758 ソニー	10,300
	9	6902 デンソー	3,600
	10	6954 ファナック	1,500
	11	6981 村田製作所	1,500
	12	7201 日産自動車	20,400
	13	7203 トヨタ自動車	18,200
	14	7267 本田技研工業	13,100
	15	7751 キヤノン	7,900
	16	8031 三井物産	13,000
	17	8058 三菱商事	10,800
	18	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	115,700
	19	8316 三井住友フィナンシャルグループ	11,500
	20	8411 みずほフィナンシャルグループ	204,400
	21	8604 野村ホールディングス	27,700
	22	8766 東京海上ホールディングス	5,800
	23	8801 三井不動産	8,000
	24	8802 三菱地所	11,000
	25	9020 東日本旅客鉄道	2,700
	26	9022 東海旅客鉄道	1,300
	27	9432 日本電信電話	11,100
	28	9433 KDDI	14,600
	29	9437 NTTドコモ	10,800
	30	9984 ソフトバンクグループ	8,200

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1610)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の上場受益権口数
(平成28年6月16日 現在)

1,023,700 口

2. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の純資産総額
(平成28年6月16日 現在)

1,608,452,280 円

3. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の一口あたりの純資産額
(平成28年6月16日 現在)

1,571.214 円

4. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の一口あたりの純資産額と
『東証電気機器株価指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年6月16日 現在)

0.02 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年6月17日 現在)

[掲載番号:4]

ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成28年6月17日
追加設定日 = 平成28年6月23日

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1612)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の上場受益権口数
(平成28年6月16日 現在)

4,673,862 口

2. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の純資産総額
(平成28年6月16日 現在)

608,924,199 円

3. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の一口あたりの純資産額
(平成28年6月16日 現在)

130.283 円

4. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の一口あたりの純資産額と
『東証銀行業株価指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年6月16日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年6月17日 現在)

ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バスケット	1	7161 じもとホールディングス	1,700
銘柄数 = 85	2	7167 足利ホールディングス	1,700
バスケット提示日 = 平成28年6月17日	3	7173 東京TYフィナンシャルグループ	300
追加設定日 = 平成28年6月23日	4	7180 九州フィナンシャルグループ	3,600
	5	7182 ゆうちょ銀行	6,000
	6	7184 富山第一銀行	600
	7	7186 コンコルディア・フィナンシャルグループ	16,300
	8	8303 新生銀行	20,000
	9	8304 あおぞら銀行	15,000
	10	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	187,400
	11	8308 りそなホールディングス	27,300
	12	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	49,000
	13	8316 三井住友フィナンシャルグループ	18,700
	14	8324 第四銀行	3,000
	15	8325 北越銀行	3,000
	16	8327 西日本シティ銀行	8,000
	17	8331 千葉銀行	9,000
	18	8333 常陽銀行	8,000
	19	8334 群馬銀行	5,000
	20	8336 武蔵野銀行	400
	21	8337 千葉興業銀行	600
	22	8338 筑波銀行	1,000
	23	8341 七十七銀行	4,000
	24	8342 青森銀行	2,000
	25	8343 秋田銀行	2,000
	26	8344 山形銀行	1,000
	27	8345 岩手銀行	200
	28	8346 東邦銀行	2,000
	29	8349 東北銀行	1,000
	30	8350 みちのく銀行	1,000
	31	8354 ふくおかフィナンシャルグループ	10,000
	32	8355 静岡銀行	7,000
	33	8356 十六銀行	3,000
	34	8358 スルガ銀行	2,200
	35	8359 八十二銀行	4,200
	36	8360 山梨中央銀行	1,000
	37	8361 大垣共立銀行	3,000
	38	8362 福井銀行	2,000
	39	8363 北國銀行	2,000
	40	8364 清水銀行	100
	41	8366 滋賀銀行	2,000
	42	8367 南都銀行	2,000
	43	8368 百五銀行	2,000
	44	8369 京都銀行	4,000
	45	8370 紀陽銀行	900
	46	8374 三重銀行	1,000
	47	8377 ほくほくフィナンシャルグループ	16,000
	48	8379 広島銀行	7,000
	49	8381 山陰合同銀行	1,400
	50	8382 中国銀行	1,700

ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
51	8383	鳥取銀行	1,000
52	8385	伊予銀行	2,500
53	8386	百十四銀行	3,000
54	8387	四国銀行	2,000
55	8388	阿波銀行	2,000
56	8392	大分銀行	1,000
57	8393	宮崎銀行	2,000
58	8395	佐賀銀行	1,000
59	8396	十八銀行	1,000
60	8397	沖縄銀行	200
61	8399	琉球銀行	500
62	8410	セブン銀行	8,800
63	8411	みずほフィナンシャルグループ	331,100
64	8416	高知銀行	1,000
65	8418	山口フィナンシャルグループ	2,000
66	8521	長野銀行	1,000
67	8522	名古屋銀行	2,000
68	8524	北洋銀行	3,500
69	8527	愛知銀行	100
70	8529	第三銀行	1,000
71	8530	中京銀行	1,000
72	8537	大光銀行	1,000
73	8541	愛媛銀行	1,000
74	8542	トマト銀行	1,000
75	8543	みなと銀行	2,000
76	8544	京葉銀行	2,000
77	8545	関西アーバン銀行	300
78	8550	栃木銀行	1,000
79	8551	北日本銀行	100
80	8558	東和銀行	4,000
81	8562	福島銀行	3,000
82	8563	大東銀行	1,000
83	8600	トモニホールディングス	1,800
84	8713	フィデアホールディングス	1,900
85	8714	池田泉州ホールディングス	2,500

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1585)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の上場受益権口数
(平成28年6月16日 現在)

21,816,444 口

2. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の純資産総額
(平成28年6月16日 現在)

23,685,445,897 円

3. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の一口あたりの純資産額
(平成28年6月16日 現在)

1,085.669 円

4. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』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28年6月16日 現在)

0.04 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年6月17日 現在)

[掲載番号:6]

ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials (設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成28年6月17日
追加設定日 = 平成28年6月23日

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1599)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の上場受益権口数
(平成28年6月16日 現在)

6,719,251 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の純資産総額
(平成28年6月16日 現在)

76,337,202,941 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の一口あたりの純資産額
(平成28年6月16日 現在)

11,360.969 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』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28年6月16日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年6月17日 現在)

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バスケット	1	1605 国際石油開発帝石	4,900
銘柄数 = 389	2	1719 安藤・間	600
バスケット提示日 = 平成28年6月17日	3	1721 コムシスホールディングス	400
追加設定日 = 平成28年6月23日	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	3,600
	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 テンプホールディングス	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	600
	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	800
	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 キリンホールディングス	3,800
	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	100
	36	2768 双日	5,200
	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	5,400
	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

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	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	1,600
74	4088	エア・ウォーター	1,000
75	4091	太陽日酸	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	3,500
92	4503	アステラス製薬	9,700
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	2,000
100	4530	久光製薬	300

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
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	1,900
110	4581	大正製薬ホールディングス	200
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	900
117	4681	リゾートトラスト	400
118	4684	オービック	300
119	4689	ヤフー	5,900
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	1,100
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	4,100
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	コニカミノルタ	2,100
130	4911	資生堂	1,700
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

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
151	5714	DOWAホールディングス	1,000
152	5802	住友電気工業	3,500
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	800
162	6268	ナブテスコ	500
163	6273	SMC	300
164	6301	小松製作所	4,300
165	6302	住友重機械工業	3,000
166	6305	日立建機	400
167	6326	クボタ	4,200
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
171	6395	タダノ	400
172	6412	平和	300
173	6425	ユニバーサルエンターテインメント	100
174	6448	ブラザー工業	1,100
175	6460	セガサミーホールディングス	900
176	6463	TPR	100
177	6465	ホンザキ電機	200
178	6471	日本精工	1,700
179	6473	ジェイテクト	900
180	6474	不二越	1,000
181	6479	ミネベア	1,300
182	6481	THK	600
183	6486	イーグル工業	100
184	6501	日立製作所	21,000
185	6503	三菱電機	9,000
186	6504	富士電機	3,000
187	6506	安川電機	1,000
188	6586	マキタ	500
189	6594	日本電産	1,000
190	6645	オムロン	900
191	6701	日本電気	11,000
192	6702	富士通	8,000
193	6703	沖電気工業	4,000
194	6724	セイコーエプソン	1,200
195	6727	ワコム	700
196	6752	パナソニック	9,500
197	6754	アンリツ	500
198	6756	日立国際電気	200
199	6762	TDK	500
200	6770	アルプス電気	700

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
201	6806	ヒロセ電機	100
202	6841	横河電機	800
203	6849	日本光電工業	300
204	6856	堀場製作所	200
205	6861	キーエンス	200
206	6869	シスメックス	600
207	6902	デンソー	2,100
208	6923	スタンレー電気	600
209	6952	カシオ計算機	800
210	6954	ファナック	800
211	6965	浜松ホトニクス	600
212	6971	京セラ	1,400
213	6981	村田製作所	900
214	6988	日東電工	700
215	6995	東海理化電機製作所	200
216	7003	三井造船	3,000
217	7011	三菱重工業	15,000
218	7012	川崎重工業	6,000
219	7013	IHI	6,000
220	7014	名村造船所	200
221	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	5,500
222	7201	日産自動車	11,600
223	7202	いすゞ自動車	2,400
224	7203	トヨタ自動車	2,400
225	7205	日野自動車	1,200
226	7211	三菱自動車工業	3,300
227	7240	NOK	400
228	7248	カルソニックカンセイ	1,000
229	7259	アイシン精機	800
230	7261	マツダ	2,600
231	7262	ダイハツ工業	1,000
232	7267	本田技研工業	5,600
233	7269	スズキ	1,500
234	7270	富士重工業	2,600
235	7272	ヤマハ発動機	1,200
236	7276	小糸製作所	500
237	7278	エクセディ	100
238	7280	ミツバ	100
239	7282	豊田合成	300
240	7309	シマノ	300
241	7313	テイ・エス テック	200
242	7453	良品計画	100
243	7458	第一興商	200
244	7459	メディバルホールディングス	800
245	7532	ドンキホーテホールディングス	500
246	7593	VTホールディングス	400
247	7606	ユナイテッドアローズ	100
248	7649	スギホールディングス	100
249	7731	ニコン	1,600
250	7732	トプコン	300

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
251	7733	オリンパス	1,200
252	7741	HOYA	1,900
253	7751	キヤノン	4,500
254	7752	リコー	2,700
255	7832	バンダイナムコホールディングス	900
256	7846	パイロットコーポレーション	100
257	7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	200
258	7936	アシックス	800
259	7951	ヤマハ	600
260	7956	ピジョン	500
261	7988	ニフコ	200
262	8001	伊藤忠商事	6,400
263	8002	丸紅	8,100
264	8015	豊田通商	900
265	8020	兼松	2,000
266	8028	ファミリーマート	300
267	8031	三井物産	7,400
268	8035	東京エレクトロン	700
269	8036	日立ハイテクノロジーズ	300
270	8050	セイコーホールディングス	1,000
271	8053	住友商事	5,200
272	8058	三菱商事	6,200
273	8088	岩谷産業	1,000
274	8113	ユニ・チャーム	1,800
275	8129	東邦ホールディングス	300
276	8136	サンリオ	300
277	8174	日本瓦斯	100
278	8214	AOKIホールディングス	200
279	8227	しまむら	100
280	8233	高島屋	1,000
281	8253	クレディセゾン	600
282	8267	イオン	3,400
283	8273	イズミ	200
284	8279	ヤオコー	100
285	8282	ケーズホールディングス	300
286	8303	新生銀行	7,000
287	8304	あおぞら銀行	5,000
288	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	25,100
289	8308	りそなホールディングス	9,600
290	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	17,000
291	8316	三井住友フィナンシャルグループ	4,300
292	8327	西日本シティ銀行	3,000
293	8331	千葉銀行	3,000
294	8333	常陽銀行	3,000
295	8334	群馬銀行	2,000
296	8354	ふくおかフィナンシャルグループ	4,000
297	8355	静岡銀行	2,000
298	8356	十六銀行	1,000
299	8358	スルガ銀行	800
300	8359	八十二銀行	2,000

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
301	8377	ほくほくフィナンシャルグループ	6,000
302	8379	広島銀行	2,000
303	8382	中国銀行	800
304	8385	伊予銀行	1,200
305	8410	セブン銀行	3,100
306	8411	みずほフィナンシャルグループ	84,800
307	8418	山口フィナンシャルグループ	1,000
308	8424	芙蓉総合リース	100
309	8425	興銀リース	200
310	8439	東京センチュリーリース	200
311	8473	SBIホールディングス	1,000
312	8524	北洋銀行	1,200
313	8544	京葉銀行	1,000
314	8570	イオンフィナンシャルサービス	500
315	8572	アコム	1,600
316	8586	日立キャピタル	200
317	8591	オリックス	5,800
318	8593	三菱UFJリース	2,100
319	8595	ジャフコ	100
320	8601	大和証券グループ本社	8,000
321	8604	野村ホールディングス	15,800
322	8609	岡三証券グループ	1,000
323	8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	900
324	8628	松井証券	400
325	8630	損保ジャパン日本興亜ホールディングス	1,800
326	8697	日本取引所グループ	2,400
327	8703	カブドットコム証券	700
328	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2,500
329	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	800
330	8750	第一生命保険	5,300
331	8766	東京海上ホールディングス	3,300
332	8795	T&Dホールディングス	3,000
333	8801	三井不動産	4,000
334	8802	三菱地所	6,000
335	8804	東京建物	900
336	8830	住友不動産	2,000
337	8840	大京	2,000
338	8848	レオパレス21	1,000
339	8850	スターツコーポレーション	100
340	8870	住友不動産販売	100
341	8897	タカラレーベン	400
342	8905	イオンモール	500
343	8933	エス・ティ・ティ都市開発	500
344	9001	東武鉄道	4,000
345	9003	相鉄ホールディングス	2,000
346	9005	東京急行電鉄	5,000
347	9007	小田急電鉄	3,000
348	9008	京王電鉄	2,000
349	9009	京成電鉄	1,000
350	9020	東日本旅客鉄道	1,500

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
351	9021	西日本旅客鉄道	800
352	9022	東海旅客鉄道	700
353	9031	西日本鉄道	1,000
354	9041	近鉄グループホールディングス	8,000
355	9042	阪急阪神ホールディングス	6,000
356	9044	南海電気鉄道	2,000
357	9045	京阪ホールディングス	2,000
358	9048	名古屋鉄道	4,000
359	9062	日本通運	3,000
360	9064	ヤマトホールディングス	1,500
361	9065	山九	1,000
362	9101	日本郵船	7,000
363	9202	ANAホールディングス	15,000
364	9375	近鉄エクスプレス	100
365	9404	日本テレビホールディングス	700
366	9432	日本電信電話	4,900
367	9433	KDDI	7,500
368	9435	光通信	100
369	9437	NTTドコモ	6,100
370	9449	GMOインターネット	300
371	9513	電源開発	700
372	9531	東京瓦斯	9,000
373	9532	大阪瓦斯	9,000
374	9602	東宝	600
375	9603	エイチ・アイ・エス	100
376	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	500
377	9627	アインホールディングス	100
378	9678	カナモト	100
379	9719	SCSK	200
380	9735	セコム	900
381	9783	ベネッセホールディングス	300
382	9787	イオンデイライト	100
383	9810	日鉄住金物産	1,000
384	9843	ニトリホールディングス	400
385	9956	パローホールディングス	200
386	9962	ミスミグループ本社	900
387	9983	ファーストリテイリング	100
388	9984	ソフトバンクグループ	3,300
389	9989	サンドラッグ	200

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1365)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の上場受益権口数
(平成28年6月16日 現在)

4,515,000 口

2. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の純資産総額
(平成28年6月16日 現在)

32,862,255,698 円

3. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成28年6月16日 現在)

7,278.46 円

4. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』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28年6月16日 現在)

-0.57 %

●「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

対象指標とする「日経平均レバレッジ・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「2倍」の値動きになる指数で、「日経平均株価」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な正相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「日経平均株価」の変動率の「2倍」とはならず、計算上、差が生じます。こ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。一般に、「日経平均株価」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「日経平均レバレッジ・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率と日経平均レバレッジ・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、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と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1366)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成28年6月16日 現在)

630,000 口

2. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の純資産総額
(平成28年6月16日 現在)

5,673,050,501 円

3. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成28年6月16日 現在)

9,004.84 円

4. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『日経平均ダブルインバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年6月16日 現在)

0.53 %

●「日経平均ダブルインバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「日経平均ダブルインバース・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「-2倍」(マイナス2倍)の値動きになる指数で、「日経平均株価」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上の計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「日経平均株価」の変動率の「-2倍」とはならず、計算上、差が生じます。こ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。一般に、「日経平均株価」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「日経平均ダブルインバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率と日経平均ダブルインバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率を日経平均ダブルインバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1367)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の上場受益権口数
(平成28年6月16日 現在)

340,000 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の純資産総額
(平成28年6月16日 現在)

2,500,077,632 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の一口あたりの純資産額
(平成28年6月16日 現在)

7,353.17 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年6月16日 現在)

-0.71 %

●「TOPIXレバレッジ(2倍)指数」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「TOPIXレバレッジ(2倍)指数」は原指標の「TOPIX」の変動率の「2倍」の値動きになる指数で、「TOPIX」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な正相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「TOPIX」の変動率の「2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「TOPIX」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。一般に、「TOPIX」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「TOPIXレバレッジ(2倍)指数」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とTOPIXレバレッジ(2倍)指数の変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、TOPIXの値動きとTOPIX先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をTOPIXレバレッジ(2倍)指数の変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1368)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の上場受益権口数
(平成28年6月16日 現在)

220,000 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の純資産総額
(平成28年6月16日 現在)

2,007,087,937 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の一口あたりの純資産額
(平成28年6月16日 現在)

9,123.13 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年6月16日 現在)

0.72 %

●「TOPIXダブルインバース(-2倍)指数」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「TOPIXダブルインバース(-2倍)指数」は原指標の「TOPIX」の変動率の「-2倍」(マイナス2倍)の値動きになる指数で、「TOPIX」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「TOPIX」の変動率の「-2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「TOPIX」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。一般に、「TOPIX」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「TOPIXダブルインバース(-2倍)指数」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とTOPIXダブルインバース(-2倍)指数の変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、TOPIXの値動きとTOPIX先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をTOPIXダブルインバース(-2倍)指数の変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1456)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成28年6月16日 現在)

2,437,000 口

2. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の純資産総額
(平成28年6月16日 現在)

28,305,702,545 円

3. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成28年6月16日 現在)

11,614.98 円

4. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『日経平均インバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年6月16日 現在)

0.26 %

●「日経平均インバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「日経平均インバース・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「-1倍」(マイナス1倍)の値動きになる指数で、「日経平均株価」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-1倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「日経平均株価」の変動率の「-1倍」とはならず、計算上、差が生じます。こ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。一般に、「日経平均株価」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。

【「日経平均インバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率と日経平均インバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率を日経平均インバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1457)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の上場受益権口数
(平成28年6月16日 現在)

530,000 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の純資産総額
(平成28年6月16日 現在)

6,212,562,294 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の一口あたりの純資産額
(平成28年6月16日 現在)

11,721.82 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIXインバース(-1倍)指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年6月16日 現在)

0.35 %

●「TOPIXインバース(-1倍)指数」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「TOPIXインバース(-1倍)指数」は原指標の「TOPIX」の変動率の「-1倍」(マイナス1倍)の値動きになる指数で、「TOPIX」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-1倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「TOPIX」の変動率の「-1倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「TOPIX」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。一般に、「TOPIX」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。

【「TOPIXインバース(-1倍)指数」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とTOPIXインバース(-1倍)指数の変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、TOPIXの値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をTOPIXインバース(-1倍)指数の変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1464)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の上場受益権口数
(平成28年6月16日 現在)

210,000 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の純資産総額
(平成28年6月16日 現在)

1,231,257,857 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成28年6月16日 現在)

5,863.13 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『JPX日経400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28年6月16日 現在)

-0.68 %

●「JPX日経400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

対象指標とする「JPX日経400レバレッジ・インデックス」は原指標の「JPX日経インデックス400」の変動率の「2倍」の値動きになる指数で、「JPX日経インデックス400」の1日の変化率（前日終値と当日終値とを比較して算出）を「2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な正相関ではないため、複数日以上 of 計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「JPX日経インデックス400」の変動率の「2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「JPX日経インデックス400」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。一般に、「JPX日経インデックス400」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「JPX日経400レバレッジ・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とJPX日経400レバレッジ・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をJPX日経400レバレッジ・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1465)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成28年6月16日 現在)

470,000 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』の純資産総額
(平成28年6月16日 現在)

5,396,212,233 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成28年6月16日 現在)

11,481.30 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『JPX日経400インバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年6月16日 現在)

0.35 %

●「JPX日経400インバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「JPX日経400インバース・インデックス」は原指標の「JPX日経インデックス400」の変動率の「-1倍」(マイナス1倍)の値動きになる指数で、「JPX日経インデックス400」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-1倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「JPX日経インデックス400」の変動率の「-1倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「JPX日経インデックス400」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。一般に、「JPX日経インデックス400」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。

【「JPX日経400インバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とJPX日経400インバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をJPX日経400インバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1466)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成28年6月16日 現在)

77,900 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の純資産総額
(平成28年6月16日 現在)

952,406,510 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成28年6月16日 現在)

12,226.01 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年6月16日 現在)

0.72 %

●「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点
対象指標とする「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」は原指標の「JPX日経インデックス400」の変動率の「-2倍」(マイナス2倍)の値動きになる指数で、「JPX日経インデックス400」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上
の計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「JPX日経インデックス400」の変動率の「-2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「JPX日経インデックス400」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。一般に、「JPX日経インデックス400」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逡減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逡減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】
ファンドの基準価額の変動率とJPX日経400ダブルインバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をJPX日経400ダブルインバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年6月17日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1479)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』の上場受益権口数
(平成28年6月16日 現在)

2,087,209 口

2. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』の純資産総額
(平成28年6月16日 現在)

31,073,680,372 円

3. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』の一口あたりの純資産額
(平成28年6月16日 現在)

14,887.67 円

4. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』の一口あたりの純資産額と
『MSCI日本株人材設備投資指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年6月16日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年6月17日 現在)

ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バasket	1	1801 大成建設	5,000
銘柄数 = 148	2	1878 大東建託	800
Basket提示日 = 平成28年6月17日	3	1925 大和ハウス工業	3,900
追加設定日 = 平成28年6月23日	4	2002 日清製粉グループ本社	600
	5	2229 カルビー	900
	6	2331 総合警備保障	400
	7	2371 カカクコム	1,500
	8	2413 エムスリー	2,000
	9	2502 アサヒグループホールディングス	2,800
	10	2503 キリンホールディングス	1,700
	11	2587 サントリー食品インターナショナル	800
	12	2651 ローソン	500
	13	2702 日本マクドナルドホールディングス	200
	14	2801 キッコーマン	1,000
	15	2802 味の素	3,900
	16	2875 東洋水産	600
	17	2897 日清食品ホールディングス	300
	18	3003 ヒューリック	1,000
	19	3231 野村不動産ホールディングス	600
	20	3289 東急不動産ホールディングス	1,000
	21	3401 帝人	3,000
	22	3402 東レ	8,000
	23	3405 クラレ	1,300
	24	3407 旭化成	9,000
	25	4005 住友化学	3,000
	26	4063 信越化学工業	1,000
	27	4091 大陽日酸	400
	28	4118 カネカ	1,000
	29	4151 協和発酵キリン	1,600
	30	4182 三菱瓦斯化学	1,000
	31	4183 三井化学	2,000
	32	4185 JSR	900
	33	4188 三菱ケミカルホールディングス	5,500
	34	4204 積水化学工業	1,700
	35	4217 日立化成	1,000
	36	4307 野村総合研究所	800
	37	4324 電通	700
	38	4452 花王	4,200
	39	4502 武田薬品工業	3,100
	40	4503 アステラス製薬	25,300
	41	4507 塩野義製薬	2,100
	42	4508 田辺三菱製薬	1,100
	43	4519 中外製薬	1,600
	44	4523 エーザイ	1,700
	45	4528 小野薬品工業	1,600
	46	4543 テルモ	1,500
	47	4578 大塚ホールディングス	1,600
	48	4689 ヤフー	14,700
	49	4755 楽天	2,900
	50	4901 富士フイルムホールディングス	1,700

ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
51	4902	コニカミノルタ	2,200
52	4911	資生堂	1,600
53	5002	昭和シェル石油	300
54	5101	横浜ゴム	500
55	5108	ブリヂストン	7,000
56	5201	旭硝子	4,000
57	5233	太平洋セメント	6,000
58	5332	TOTO	600
59	5333	日本碍子	1,000
60	5334	日本特殊陶業	900
61	5406	神戸製鋼所	7,000
62	5713	住友金属鉱山	1,000
63	5802	住友電気工業	2,600
64	5901	東洋製罐グループホールディングス	300
65	5938	LIXILグループ	1,000
66	6098	リクルートホールディングス	1,800
67	6301	小松製作所	4,600
68	6305	日立建機	400
69	6326	クボタ	7,200
70	6367	ダイキン工業	1,900
71	6370	栗田工業	300
72	6448	ブラザー工業	800
73	6460	セガサミーホールディングス	700
74	6473	ジェイテクト	1,000
75	6479	ミネベア	900
76	6481	THK	600
77	6501	日立製作所	27,000
78	6594	日本電産	1,100
79	6645	オムロン	1,500
80	6701	日本電気	10,000
81	6702	富士通	6,000
82	6752	パナソニック	7,200
83	6841	横河電機	1,200
84	6861	キーエンス	400
85	6869	シスメックス	1,600
86	6902	デンソー	2,300
87	6952	カシオ計算機	1,800
88	6963	ローム	200
89	6971	京セラ	1,600
90	6981	村田製作所	1,400
91	6988	日東電工	1,400
92	7011	三菱重工業	14,000
93	7013	IHI	4,000
94	7201	日産自動車	10,700
95	7203	トヨタ自動車	8,400
96	7205	日野自動車	2,000
97	7261	マツダ	2,700
98	7267	本田技研工業	8,100
99	7282	豊田合成	300
100	7309	シマノ	600

ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
101	7731	ニコン	1,100
102	7733	オリンパス	600
103	7751	キヤノン	6,700
104	7911	凸版印刷	1,000
105	7912	大日本印刷	1,000
106	7936	アシックス	600
107	7974	任天堂	200
108	8015	豊田通商	600
109	8035	東京エレクトロン	800
110	8036	日立ハイテクノロジーズ	500
111	8113	ユニ・チャーム	2,800
112	8252	丸井グループ	700
113	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	34,800
114	8308	りそなホールディングス	10,800
115	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	6,000
116	8316	三井住友フィナンシャルグループ	3,200
117	8358	スルガ銀行	1,000
118	8410	セブン銀行	5,100
119	8411	みずほフィナンシャルグループ	81,000
120	8570	イオンフィナンシャルサービス	300
121	8591	オリックス	7,500
122	8593	三菱UFJリース	1,200
123	8601	大和証券グループ本社	5,000
124	8604	野村ホールディングス	8,500
125	8697	日本取引所グループ	9,300
126	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	1,000
127	8795	T&Dホールディングス	2,500
128	8801	三井不動産	4,000
129	8802	三菱地所	4,000
130	8905	イオンモール	600
131	9005	東京急行電鉄	5,000
132	9021	西日本旅客鉄道	900
133	9045	京阪ホールディングス	2,000
134	9101	日本郵船	3,000
135	9202	ANAホールディングス	4,000
136	9432	日本電信電話	3,000
137	9433	KDDI	16,100
138	9437	NTTドコモ	10,000
139	9502	中部電力	2,500
140	9506	東北電力	800
141	9531	東京瓦斯	13,000
142	9532	大阪瓦斯	13,000
143	9533	東邦瓦斯	2,000
144	9602	東宝	500
145	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	600
146	9735	セコム	1,300
147	9783	ベネッセホールディングス	200
148	9984	ソフトバンクグループ	3,800