

平成28年7月25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7月22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7月25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7月22日 現在)

**87,286,361 口**

2. 『ダイワ上場投信一日経225』の純資産総額  
(平成28年7月22日 現在)

**1,476,630,156,391 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7月22日 現在)

**16,917.1 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7月22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7月25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	現金拠出
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7月25日	3	1605 国際石油開発帝石	800	
追加設定日 = 平成28年7月29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	
※「○」で表示した銘柄は	6	1802 大林組	2,000	
現金拠出で対応する銘柄です。	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	400	
	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	200	
	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	現金拠出
	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	現金拠出
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	現金拠出
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	

[掲載番号:1]

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	現金拠出
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	1,000	○
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7月25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7月22日 現在)

**955,264,249 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7月22日 現在)

**1,306,275,529,049 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7月22日 現在)

**1,367.45 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7月22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7月25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7月25日  
追加設定日 = 平成28年7月29日

平成28年7月25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7月22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7月22日 現在)

**1,581,253,854 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7月22日 現在)

**607.571 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7月22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7月25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	8,900
銘柄数 = 30	2	3382 セブン&アイ・ホールディングス	5,900
バスケット提示日 = 平成28年7月25日	3	4063 信越化学工業	2,700
追加設定日 = 平成28年7月29日	4	4502 武田薬品工業	6,000
	5	4503 アステラス製薬	16,200
	6	6501 日立製作所	36,000
	7	6752 パナソニック	16,300
	8	6758 ソニー	10,100
	9	6902 デンソー	3,500
	10	6954 ファナック	1,400
	11	6981 村田製作所	1,500
	12	7201 日産自動車	19,500
	13	7203 トヨタ自動車	18,200
	14	7267 本田技研工業	12,800
	15	7751 キヤノン	7,700
	16	8031 三井物産	12,700
	17	8058 三菱商事	10,600
	18	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	113,100
	19	8316 三井住友フィナンシャルグループ	11,300
	20	8411 みずほフィナンシャルグループ	200,500
	21	8604 野村ホールディングス	27,100
	22	8766 東京海上ホールディングス	5,700
	23	8801 三井不動産	7,000
	24	8802 三菱地所	10,000
	25	9020 東日本旅客鉄道	2,600
	26	9022 東海旅客鉄道	1,300
	27	9432 日本電信電話	10,900
	28	9433 KDDI	13,900
	29	9437 NTTドコモ	10,500
	30	9984 ソフトバンクグループ	8,000

平成28年7月25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7月22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7月22日 現在)

1,707,415,191 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7月22日 現在)

1,667.886 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7月22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7月25日 現在)

## 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)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
単位 = 1 バasket	1	3105 日清紡ホールディングス	3,900	
銘柄数 = 162	2	4062 イビデン	4,300	
Basket提示日 = 平成28年7月25日	3	4902 コニカミノルタ	17,600	
追加設定日 = 平成28年7月29日	4	6448 ブラザー工業	9,100	
	5	6479 ミネベア	11,400	
※「○」で表示した銘柄は	6	6501 日立製作所	180,000	
現金拠出で対応する銘柄です。	7	6502 東芝	148,000	
	8	6503 三菱電機	75,000	
	9	6504 富士電機	21,000	
	10	6505 東洋電機製造	1,000	
	11	6506 安川電機	8,800	
	12	6507 シンフォニア テクノロジー	5,000	
	13	6508 明電舎	6,000	
	14	6513 オリジン電気	1,000	
	15	6516 山洋電気	2,000	
	16	6517 デンヨー	700	
	17	6588 東芝テック	5,000	
	18	6590 芝浦メカトロニクス	1,000	
	19	6592 マブチモーター	2,000	
	20	6594 日本電産	8,500	
	21	6615 ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	
	22	6617 東光高岳	400	
	23	6619 ダブル・スコープ	700	
	24	6620 宮越ホールディングス	200	
	25	6622 ダイヘン	4,000	
	26	6624 田淵電機	800	
	27	6630 ヤーマン	100	
	28	6632 JVCケンウッド	5,200	
	29	6638 ミマキエンジニアリング	600	
	30	6640 第一精工	300	
	31	6641 日新電機	1,700	
	32	6644 大崎電気工業	1,000	
	33	6645 オムロン	8,000	
	34	6651 日東工業	1,100	
	35	6652 IDEC	900	
	36	6654 不二電機工業	100	○
	37	6674 ジーエス・ユアサ コーポレーション	14,000	
	38	6675 サクサホールディングス	2,000	
	39	6676 メルコホールディングス	400	
	40	6678 テクノメディカ	200	
	41	6701 日本電気	97,000	
	42	6702 富士通	68,000	
	43	6703 沖電気工業	31,000	
	44	6704 岩崎通信機	3,000	
	45	6706 電気興業	2,000	
	46	6707 サンケン電気	4,000	
	47	6715 ナカヨ	1,000	
	48	6718 アイホン	400	
	49	6723 ルネサスエレクトロニクス	3,600	
	50	6724 セイコーエプソン	10,500	

## 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)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
51	6727	ワコム	5,500	
52	6728	アルバック	1,300	
53	6730	アクセル	300	
54	6737	EIZO	700	
55	6740	ジャパンディスプレイ	13,200	
56	6741	日本信号	1,900	
57	6742	京三製作所	2,000	
58	6744	能美防災	800	
59	6745	ホーチキ	500	
60	6750	エレコム	600	
61	6751	日本無線	2,000	
62	6752	パナソニック	80,500	
63	6754	アンリツ	4,200	
64	6755	富士通ゼネラル	2,000	
65	6756	日立国際電気	1,600	
66	6758	ソニー	49,700	
67	6762	TDK	4,300	
68	6763	帝国通信工業	2,000	
69	6767	ミツミ電機	2,700	
70	6768	タムラ製作所	3,000	
71	6770	アルプス電気	6,100	
72	6771	池上通信機	2,000	
73	6773	パイオニア	11,400	
74	6779	日本電波工業	600	
75	6785	鈴木	300	
76	6788	日本トリム	200	
77	6789	ローランド ディー. ジー.	400	
78	6794	フォスター電機	900	
79	6796	クラリオン	4,000	
80	6798	SMK	2,000	
81	6800	ヨコオ	500	
82	6803	ティアック	5,000	
83	6804	ホシデン	2,100	
84	6806	ヒロセ電機	1,100	
85	6807	日本航空電子工業	2,000	
86	6809	TOA	800	
87	6810	日立マクセル	1,200	
88	6814	古野電気	800	
89	6815	ユニデンホールディングス	2,000	
90	6816	アルパイン	1,700	
91	6817	スミダコーポレーション	600	
92	6820	アイコム	400	
93	6823	リオン	300	
94	6826	本多通信工業	200	
95	6839	船井電機	700	
96	6841	横河電機	7,100	
97	6844	新電元工業	2,000	
98	6845	アズビル	2,300	
99	6848	東亜ディーケーケー	400	
100	6849	日本光電工業	2,900	

## 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)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
	101	6850 チノー	300	
	102	6853 共和電業	800	
	103	6855 日本電子材料	300	
	104	6856 堀場製作所	1,400	
	105	6857 アドバンテスト	4,800	
	106	6858 小野測器	300	
	107	6859 エスペック	700	
	108	6860 パナソニック デバイスSUNX	600	
	109	6861 キーエンス	1,600	
	110	6866 日置電機	400	
	111	6869 シスメックス	5,500	
	112	6871 日本マイクロニクス	1,300	
	113	6875 メガチップス	700	
	114	6877 OBARA GROUP	400	
	115	6905 コーセル	1,000	
	116	6908 イリソ電子工業	200	
	117	6911 新日本無線	500	
	118	6914 オプテックス	500	
	119	6915 千代田インテグレ	400	
	120	6916 アイ・オー・データ機器	200	
	121	6920 レーザーテック	800	
	122	6923 スタンレー電気	5,000	
	123	6924 岩崎電気	2,000	
	124	6925 ウシオ電機	4,300	
	125	6926 岡谷電機産業	400	
	126	6927 ヘリオス テクノ ホールディング	600	
	127	6929 日本セラミック	600	
	128	6932 遠藤照明	400	
	129	6935 日本デジタル研究所	600	
	130	6937 古河電池	1,000	
	131	6938 双信電機	300	
	132	6941 山一電機	600	
	133	6947 図研	500	
	134	6951 日本電子	3,000	
	135	6952 カシオ計算機	7,100	
	136	6954 フェナック	7,100	
	137	6958 日本シイエムケイ	1,500	
	138	6961 エンプラス	400	
	139	6962 大真空	1,000	
	140	6963 ローム	3,400	
	141	6965 浜松ホトニクス	5,500	
	142	6966 三井ハイテック	1,000	○
	143	6967 新光電気工業	2,700	
	144	6971 京セラ	11,600	
	145	6976 太陽誘電	3,400	
	146	6981 村田製作所	7,400	
	147	6985 ユーシン	900	
	148	6986 双葉電子工業	1,200	
	149	6989 北陸電気工業	3,000	
	150	6996 ニチコン	2,200	

[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)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
151	6997	日本ケミコン	6,000	
152	6999	KOA	1,000	
153	7244	市光工業	2,000	
154	7276	小糸製作所	4,200	
155	7280	ミツバ	1,200	
156	7718	スター精密	1,300	
157	7735	SCREENホールディングス	7,000	
158	7739	キヤノン電子	600	
159	7751	キヤノン	37,900	
160	7752	リコー	22,800	
161	7999	MUTOHホールディングス	1,000	
162	8035	東京エレクトロン	5,800	



平成28年7月25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7月22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7月22日 現在)

**615,631,865 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7月22日 現在)

**131.718 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7月22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7月25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	1,600
銘柄数 = 85	2	7167 足利ホールディングス	1,600
バスケット提示日 = 平成28年7月25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7月29日	4	7180 九州フィナンシャルグループ	3,400
	5	7182 ゆうちょ銀行	5,800
	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	15,600
	8	8303 新生銀行	19,000
	9	8304 あおぞら銀行	14,000
	10	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	180,100
	11	8308 りそなホールディングス	26,300
	12	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	47,000
	13	8316 三井住友フィナンシャルグループ	18,000
	14	8324 第四銀行	3,000
	15	8325 北越銀行	2,000
	16	8327 西日本シティ銀行	7,000
	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	900
	23	8341 七十七銀行	4,000
	24	8342 青森銀行	2,000
	25	8343 秋田銀行	1,000
	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	2,100
	35	8359 八十二銀行	4,100
	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	15,000
	48	8379 広島銀行	7,000
	49	8381 山陰合同銀行	1,300
	50	8382 中国銀行	1,600

## 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	2,400
53	8386	百十四銀行	2,000
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	1,000
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	8,400
63	8411	みずほフィナンシャルグループ	319,300
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	3,400
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	1,700
84	8713	フィデアホールディングス	1,800
85	8714	池田泉州ホールディングス	2,400

平成28年7月25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7月22日 現在)

**22,783,754 口**

2. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の純資産総額  
(平成28年7月22日 現在)

**26,232,192,102 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7月22日 現在)

**1,151.355 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7月22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7月25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7月25日  
追加設定日 = 平成28年7月29日

平成28年7月25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7月22日 現在)

**6,919,480 口**

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の純資産総額  
(平成28年7月22日 現在)

**83,090,399,616 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7月22日 現在)

**12,008.186 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7月22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7月25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	現金拠出
単位 = 1 バスケット	1	1605 国際石油開発帝石	4,900	
銘柄数 = 388	2	1719 安藤・間	600	
バスケット提示日 = 平成28年7月25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7月29日	4	1722 ミサワホーム	100	
	5	1801 大成建設	5,000	
※「○」で表示した銘柄は	6	1802 大林組	2,800	
現金拠出で対応する銘柄です。	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	900	
	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	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 キリンホールディングス	4,000	
	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	5,100	
	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	1,900	
	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	5,000	
	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	現金拠出
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	1,500	
62	3407	旭化成	5,000	
63	3632	グリー	500	
64	3659	ネクソン	900	
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	3,000	
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	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	2,200	
91	4502	武田薬品工業	3,400	
92	4503	アステラス製薬	9,400	
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	現金拠出
	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	300	
	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	4,400	
	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	1,600	
	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	300	
	134	5002 昭和シェル石油	800	
	135	5101 横浜ゴム	500	
	136	5105 東洋ゴム工業	500	
	137	5108 ブリヂストン	2,900	
	138	5110 住友ゴム工業	800	
	139	5201 旭硝子	4,000	
	140	5233 太平洋セメント	5,000	
	141	5332 TOTO	600	
	142	5333 日本碍子	1,100	
	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	現金拠出
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	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	4,200	
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	ホシザキ	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	500	
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	2,000	
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	600	
196	6752	パナソニック	9,400	
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	現金拠出
	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	2,000	
	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	11,300	
	223	7202 いすゞ自動車	2,400	
	224	7203 トヨタ自動車	2,700	
	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	7267 本田技研工業	5,600	
	232	7269 スズキ	1,500	
	233	7270 富士重工業	2,600	
	234	7272 ヤマハ発動機	1,200	
	235	7276 小糸製作所	500	
	236	7278 エクセディ	100	
	237	7280 ミツバ	100	
	238	7282 豊田合成	300	
	239	7309 シマノ	300	
	240	7313 ティ・エス テック	200	
	241	7453 良品計画	100	
	242	7458 第一興商	200	
	243	7459 メディパルホールディングス	800	
	244	7532 ドンキホーテホールディングス	500	
	245	7593 VTホールディングス	400	
	246	7606 ユナイテッドアローズ	100	
	247	7649 スギホールディングス	100	
	248	7731 ニコン	1,500	
	249	7732 トプコン	300	
	250	7733 オリンパス	1,200	

## 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	現金拠出
251	7741	HOYA	1,900	
252	7751	キヤノン	4,400	
253	7752	リコー	2,700	
254	7832	バンダイナムコホールディングス	900	
255	7846	パイロットコーポレーション	100	
256	7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	200	
257	7936	アシックス	800	
258	7951	ヤマハ	600	
259	7956	ビジョン	500	○
260	7988	ニフコ	200	
261	8001	伊藤忠商事	6,400	
262	8002	丸紅	8,000	
263	8015	豊田通商	900	
264	8020	兼松	2,000	
265	8028	ファミリーマート	300	
266	8031	三井物産	7,400	
267	8035	東京エレクトロン	700	
268	8036	日立ハイテクノロジーズ	300	
269	8050	セイコーホールディングス	1,000	
270	8053	住友商事	5,100	
271	8058	三菱商事	6,100	
272	8088	岩谷産業	1,000	
273	8113	ユニ・チャーム	1,800	
274	8129	東邦ホールディングス	300	
275	8136	サンリオ	300	
276	8174	日本瓦斯	100	
277	8214	AOKIホールディングス	200	
278	8227	しまむら	100	
279	8233	高島屋	1,000	
280	8253	クレディセゾン	600	
281	8267	イオン	3,400	
282	8273	イズミ	200	
283	8279	ヤオコー	100	
284	8282	ケーズホールディングス	300	
285	8303	新生銀行	7,000	
286	8304	あおぞら銀行	5,000	
287	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	25,000	
288	8308	りそなホールディングス	9,500	
289	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	17,000	
290	8316	三井住友フィナンシャルグループ	4,300	
291	8327	西日本シティ銀行	3,000	
292	8331	千葉銀行	3,000	
293	8333	常陽銀行	3,000	
294	8334	群馬銀行	2,000	
295	8354	ふくおかフィナンシャルグループ	4,000	
296	8355	静岡銀行	2,000	
297	8356	十六銀行	1,000	
298	8358	スルガ銀行	800	
299	8359	八十二銀行	2,000	
300	8377	ほくほくフィナンシャルグループ	6,000	

## 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	現金拠出
	301	8379 広島銀行	2,000	
	302	8382 中国銀行	800	
	303	8385 伊予銀行	1,200	
	304	8410 セブン銀行	3,100	
	305	8411 みずほフィナンシャルグループ	84,600	
	306	8418 山口フィナンシャルグループ	1,000	
	307	8424 芙蓉総合リース	100	
	308	8425 興銀リース	200	
	309	8439 東京センチュリーリース	200	
	310	8473 SBIホールディングス	1,000	
	311	8524 北洋銀行	1,200	
	312	8544 京葉銀行	1,000	
	313	8570 イオンフィナンシャルサービス	500	
	314	8572 アコム	1,600	
	315	8586 日立キャピタル	200	
	316	8591 オリックス	5,800	
	317	8593 三菱UFJリース	2,100	
	318	8595 ジャフコ	100	
	319	8601 大和証券グループ本社	8,000	
	320	8604 野村ホールディングス	15,700	
	321	8609 岡三証券グループ	1,000	
	322	8616 東海東京フィナンシャル・ホールディングス	900	
	323	8628 松井証券	400	
	324	8630 損保ジャパン日本興亜ホールディングス	1,800	
	325	8697 日本取引所グループ	2,400	
	326	8703 カブドットコム証券	700	
	327	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	
	328	8729 ソニーフィナンシャルホールディングス	800	
	329	8750 第一生命保険	5,200	
	330	8766 東京海上ホールディングス	3,300	
	331	8795 T&Dホールディングス	3,000	
	332	8801 三井不動産	4,000	
	333	8802 三菱地所	6,000	
	334	8804 東京建物	900	
	335	8830 住友不動産	2,000	
	336	8840 大京	2,000	
	337	8848 レオパレス21	1,000	
	338	8850 スターツコーポレーション	100	
	339	8870 住友不動産販売	100	
	340	8897 タカラレーベン	400	
	341	8905 イオンモール	500	
	342	8933 エヌ・ティ・ティ都市開発	500	
	343	9001 東武鉄道	4,000	
	344	9003 相鉄ホールディングス	2,000	
	345	9005 東京急行電鉄	5,000	
	346	9007 小田急電鉄	3,000	
	347	9008 京王電鉄	2,000	
	348	9009 京成電鉄	1,000	
	349	9020 東日本旅客鉄道	1,500	
	350	9021 西日本旅客鉄道	800	

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

平成28年7月25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7月22日 現在)

**3,845,000 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7月22日 現在)

**32,312,254,586 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7月22日 現在)

**8,403.71 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7月22日 現在)

**0.03 %**

●「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7月25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7月22日 現在)

920,000 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7月22日 現在)

6,825,805,209 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7月22日 現在)

7,419.35 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7月22日 現在)

-0.03 %

●「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7月25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7月22日 現在)

**360,000 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7月22日 現在)

**3,022,960,079 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7月22日 現在)

**8,397.11 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7月22日 現在)

**-0.02 %**

●「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7月25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7月22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7月22日 現在)

1,680,331,288 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7月22日 現在)

7,637.87 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7月22日 現在)

0.00 %

●「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7月25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7月22日 現在)

1,638,000 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7月22日 現在)

17,360,532,699 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7月22日 現在)

10,598.62 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7月22日 現在)

-0.02 %

●「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7月25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7月22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7月22日 現在)

**5,712,895,044 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7月22日 現在)

**10,779.05 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7月22日 現在)

**0.00 %**

●「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7月25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7月22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7月22日 現在)

**1,391,392,548 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7月22日 現在)

**6,625.68 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7月22日 現在)

**-0.27 %**

●「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7月25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7月22日 現在)

**510,000 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7月22日 現在)

**5,397,439,886 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7月22日 現在)

**10,583.22 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7月22日 現在)

**0.13 %**

●「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7月25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7月22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7月22日 現在)

**805,819,173 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7月22日 現在)

**10,344.28 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7月22日 現在)

**0.25 %**

●「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7月25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7月22日 現在)

**2,382,248 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7月22日 現在)

**38,143,090,301 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7月22日 現在)

**16,011.39 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7月22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7月25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 バスケット	1	1801 大成建設	5,000
銘柄数 = 149	2	1878 大東建託	800
バスケット提示日 = 平成28年7月25日	3	1925 大和ハウス工業	3,900
追加設定日 = 平成28年7月29日	4	2002 日清製粉グループ本社	600
	5	2212 山崎製パン	500
	6	2229 カルビー	900
	7	2331 総合警備保障	400
	8	2371 カカクコム	1,500
	9	2413 エムスリー	2,000
	10	2502 アサヒグループホールディングス	2,800
	11	2503 キリンホールディングス	1,700
	12	2587 サントリー食品インターナショナル	800
	13	2651 ローソン	500
	14	2702 日本マクドナルドホールディングス	200
	15	2801 キッコーマン	1,000
	16	2802 味の素	3,900
	17	2875 東洋水産	600
	18	2897 日清食品ホールディングス	300
	19	3003 ヒューリック	1,000
	20	3231 野村不動産ホールディングス	600
	21	3289 東急不動産ホールディングス	1,000
	22	3401 帝人	3,000
	23	3402 東レ	8,000
	24	3405 クラレ	1,300
	25	3407 旭化成	9,000
	26	4005 住友化学	3,000
	27	4063 信越化学工業	1,000
	28	4091 太陽日酸	400
	29	4118 カネカ	1,000
	30	4151 協和発酵キリン	1,600
	31	4182 三菱瓦斯化学	1,000
	32	4183 三井化学	2,000
	33	4185 JSR	900
	34	4188 三菱ケミカルホールディングス	5,500
	35	4204 積水化学工業	1,700
	36	4217 日立化成	1,000
	37	4307 野村総合研究所	800
	38	4324 電通	700
	39	4452 花王	4,200
	40	4502 武田薬品工業	3,100
	41	4503 アステラス製薬	25,400
	42	4507 塩野義製薬	2,100
	43	4508 田辺三菱製薬	1,100
	44	4519 中外製薬	1,600
	45	4523 エーザイ	1,700
	46	4528 小野薬品工業	1,600
	47	4543 テルモ	1,500
	48	4578 大塚ホールディングス	1,600
	49	4689 ヤフー	14,700
	50	4755 楽天	2,900

## 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	4901	富士フイルムホールディングス	1,700
52	4902	コニカミノルタ	2,200
53	4911	資生堂	1,600
54	5002	昭和シェル石油	300
55	5101	横浜ゴム	500
56	5108	ブリヂストン	7,000
57	5201	旭硝子	4,000
58	5233	太平洋セメント	6,000
59	5332	TOTO	600
60	5333	日本碍子	600
61	5334	日本特殊陶業	900
62	5406	神戸製鋼所	7,000
63	5713	住友金属鉱山	1,000
64	5802	住友電気工業	2,600
65	5901	東洋製罐グループホールディングス	300
66	5938	LIXILグループ	1,000
67	6098	リクルートホールディングス	1,800
68	6301	小松製作所	4,700
69	6305	日立建機	400
70	6326	クボタ	7,200
71	6367	ダイキン工業	1,900
72	6370	栗田工業	300
73	6448	ブラザー工業	800
74	6460	セガサミーホールディングス	700
75	6473	ジェイテクト	1,000
76	6479	ミネベア	900
77	6481	THK	600
78	6501	日立製作所	27,000
79	6594	日本電産	1,100
80	6645	オムロン	1,500
81	6701	日本電気	10,000
82	6702	富士通	6,000
83	6752	パナソニック	7,300
84	6841	横河電機	1,200
85	6861	キーエンス	400
86	6869	シスメックス	1,600
87	6902	デンソー	2,300
88	6952	カンオ計算機	1,800
89	6963	ローム	200
90	6971	京セラ	1,600
91	6981	村田製作所	1,400
92	6988	日東電工	1,400
93	7011	三菱重工業	14,000
94	7013	IHI	4,000
95	7201	日産自動車	10,700
96	7203	トヨタ自動車	8,500
97	7205	日野自動車	2,100
98	7261	マツダ	2,700
99	7267	本田技研工業	8,100
100	7282	豊田合成	300

## 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	7309	シマノ	600
102	7731	ニコン	1,100
103	7733	オリンパス	600
104	7751	キヤノン	6,700
105	7911	凸版印刷	1,000
106	7912	大日本印刷	1,000
107	7936	アシックス	600
108	7974	任天堂	200
109	8015	豊田通商	600
110	8035	東京エレクトロン	800
111	8036	日立ハイテクノロジーズ	500
112	8113	ユニ・チャーム	2,800
113	8252	丸井グループ	700
114	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	34,900
115	8308	りそなホールディングス	10,800
116	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	6,000
117	8316	三井住友フィナンシャルグループ	3,200
118	8358	スルガ銀行	1,000
119	8410	セブン銀行	5,100
120	8411	みずほフィナンシャルグループ	81,200
121	8570	イオンフィナンシャルサービス	300
122	8591	オリックス	7,500
123	8593	三菱UFJリース	1,200
124	8601	大和証券グループ本社	5,000
125	8604	野村ホールディングス	8,500
126	8697	日本取引所グループ	9,300
127	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	1,000
128	8795	T&Dホールディングス	2,500
129	8801	三井不動産	4,000
130	8802	三菱地所	4,000
131	8905	イオンモール	600
132	9005	東京急行電鉄	5,000
133	9021	西日本旅客鉄道	900
134	9045	京阪ホールディングス	2,000
135	9101	日本郵船	3,000
136	9202	ANAホールディングス	4,000
137	9432	日本電信電話	3,000
138	9433	KDDI	16,100
139	9437	NTTドコモ	10,000
140	9502	中部電力	2,500
141	9506	東北電力	800
142	9531	東京瓦斯	13,000
143	9532	大阪瓦斯	13,000
144	9533	東邦瓦斯	2,000
145	9602	東宝	500
146	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	600
147	9735	セコム	1,400
148	9783	ベネッセホールディングス	200
149	9984	ソフトバンクグループ	3,800