

平成28年8月9日

各 位

会社名 日興アセットマネジメント株式会社  
(管理会社コード: 13084 )  
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美  
問合せ先 事務企画管理部 中田 眞帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場ETF (管理会社:日興アセットマネジメント)に関する日々の開示事項

日興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8月8日現在の状況をご報告します。

### 上場 ETF 銘柄 (22銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	上場インデックスファンド225	1330	東
2	上場インデックスファンドTOPIX	1308	東
3	上場インデックスファンドS&P日本新興株100	1314	東
4	上場インデックスファンド中国A株(パンダ)CSI300	1322	東
5	上場インデックスファンドJリート(東証REIT指数)隔月分配型	1345	東
6	上場インデックスファンドFTSE日本グリーンチップ35	1347	東
7	上場インデックスファンド海外債券(Citi WGBI)毎月分配型	1677	東
8	上場インデックスファンド海外先進国株式 (MSCI-KOKUSAI)	1680	東
9	上場インデックスファンド海外新興国株式 (MSCIEマージング)	1681	東
10	上場インデックスファンド日本高配当(東証配当フォーカス100)	1698	東
11	上場インデックスファンド米国株式 (S&P500)	1547	東
12	上場インデックスファンド中国H株(ハンセン中国企業株)	1548	東
13	上場インデックスファンドNifty50先物(インド株式)	1549	東
14	上場インデックスファンド世界株式 (MSCI ACWI) 除く日本	1554	東
15	上場インデックスファンド豪州リート(S&P/ASX200 A-REIT)	1555	東
16	上場インデックスファンド新興国債券(パークレイズLocal EM国債)	1566	東
17	上場インデックスファンド日経225(ミニ)	1578	東
18	上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financials	1586	東
19	上場インデックスファンドJPX日経インデックス400	1592	東
20	上場インデックスファンド日経レバレッジ指数	1358	東
21	上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティ	1399	東
22	上場インデックスファンド日本経済貢献株	1481	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いただくと、各銘柄の状況が表示されます。

以 上

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1330 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場インデックスファンド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8月8日現在)

96,993,584 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

1,648,492,644,080 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

16,996 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と日経225株価指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月8日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経225株価指数の終値}}{\text{前営業日の日経225株価指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:1]

上場インデックスファンド225 PCF (ユニット株式)

[ 2016/08/09 申込分 ]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
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	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
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
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	6758	ソニー	2,000
123	6762	TDK	2,000
124	6767	ミツミ電機	2,000
125	6770	アルプス電気	2,000
126	6773	パイオニア	2,000
127	6841	横河電機	2,000
128	6857	アドバンテスト	4,000
129	6902	デンソー	2,000
130	6952	カシオ計算機	2,000
131	6954	ファナック	2,000
132	6971	京セラ	4,000
133	6976	太陽誘電	2,000
134	6988	日東電工	2,000
135	7003	三井造船	2,000
136	7004	日立造船	400
137	7011	三菱重工業	2,000
138	7012	川崎重工業	2,000
139	7013	IHI	2,000
140	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,000
141	7201	日産自動車	2,000
142	7202	いすゞ自動車	1,000
143	7203	トヨタ自動車	2,000
144	7205	日野自動車	2,000
145	7211	三菱自動車工業	200
146	7261	マツダ	400
147	7267	本田技研工業	4,000
148	7269	スズキ	2,000
149	7270	富士重工業	2,000
150	7272	ヤマハ発動機	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
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	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	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

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1308 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 眞帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場インデックスファンドTOPIX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8月8日現在)

968,655,259 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

1,272,261,847,713 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

1,313.43 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と東証株価指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月8日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{東証株価指数の終値}}{\text{前営業日の東証株価指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:2]

上場インデックスファンドTOPIX PCF (ユニット株式)

[ 2016/08/09 は設定交換申込不可日のため開示を行いません ]

設定のお申込みに関しましては、お申し込み不可日であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される日については、受益証券の取得のお申込みを受付ける場合があります。



各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1314 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 眞帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場インデックスファンドS&P日本新興株100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8月8日現在)

217,977 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

231,226,121 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

1,060.78 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とS&P日本新興株100指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月8日現在)

△ 0.12%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{S\&P日本新興株100指数の終値}}{\text{前営業日のS\&P日本新興株100指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:3]

上場インデックスファンドS&P日本新興株100 PCF(ユニット株式)

[ 2016/08/09 申込分 ]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	1407	ウエストホールディングス	100
2	2121	ミクシィ	200
3	2146	UTグループ	100
4	2158	FRONTEO	100
5	2362	夢真ホールディングス	100
6	2370	メディネット	400
7	2489	アドウェイズ	100
8	2702	日本マクドナルドホールディングス	300
9	2782	セリア	100
10	2928	RIZAPグループ	100
11	3679	じげん	100
12	3773	アドバンスト・メディア	100
13	3782	ディー・ディー・エス	200
14	3843	フリービット	100
15	3857	ラック	100
16	4281	デジタル・アドバタイジング・コンソーシア	100
17	4293	セブテーニ・ホールディングス	100
18	4563	アンジェス MG	300
19	4564	オンコセラピー・サイエンス	500
20	4565	そーせいグループ	100
21	4571	ナノキャリア	200
22	4576	デ・ウエスタン・セラピテクス研究所	100
23	4583	カイオム・バイオサイエンス	100
24	4813	ACCESS	100
25	4842	USEN	300
26	4849	エン・ジャパン	100
27	4978	リプロセル	200
28	6145	日特エンジニアリング	100
29	6324	ハーモニック・ドライブ・システムズ	100
30	6425	ユニバーサルエンターテインメント	100
31	6736	サン電子	100
32	6890	フェローテック	100
33	7157	ライフネット生命保険	100
34	7177	GMOクリックホールディングス	100
35	7419	ノジマ	100
36	7716	ナカニシ	100
37	7774	ジャパン・ティッシュ・エンジニアリング	100
38	7777	スリー・ディー・マトリックス	100
39	7779	CYBERDYNE	300
40	7918	ヴィア・ホールディングス	100
41	8739	スパークス・グループ	400
42	8789	フィンテック グローバル	600
43	8890	レーサム	100
44	8922	日本アセットマーケティング	600

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1322 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 眞帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場インデックスファンド中国A株(パンダ)CSI300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8月8日現在)

472,220 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

2,194,077,970 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

4,646 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と円換算したCSI300指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月8日現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したCSI300指数の終値}}{\text{前営業日の円換算したCSI300指数の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
 (コード番号 1345 )  
 問合せ先 事務企画管理部 中田 眞帆  
 ( TEL 03 - 6447 - 6483 )

### 上場インデックスファンドリート(東証REIT指数)隔月分配型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8月8日現在)

63,249,095 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

116,746,073,139 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

1,845.81 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と東証REIT指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成28年8月8日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{東証REIT指数の終値}}{\text{前営業日の東証REIT指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:5]

上場インデックスファンドJリート PCF (ユニット投資口)

[ 2016/08/09 申込分 ]

NO.	銘柄コード	銘柄名	投資口数
1	3226	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	8
2	3227	MCUBS MidCity投資法人 投資証券	4
3	3234	森ヒルズリート投資法人 投資証券	31
4	3249	産業ファンド投資法人 投資証券	6
5	3263	大和ハウスリート投資法人 投資証券	6
6	3269	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	23
7	3278	ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	6
8	3279	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	10
9	3281	GLP投資法人 投資証券	45
10	3282	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	9
11	3283	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	32
12	3287	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	1
13	3290	SIA不動産投資法人 投資証券	1
14	3292	イオンリート投資法人 投資証券	23
15	3295	ヒューリックリート投資法人 投資証券	17
16	3296	日本リート投資法人 投資証券	7
17	3298	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	14
18	3308	日本ヘルスケア投資法人 投資証券	1
19	3309	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	15
20	3451	トーセイ・リート投資法人 投資証券	3
21	3453	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	7
22	3455	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	2
23	3459	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	5
24	3460	ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	1
25	3462	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	65
26	3463	いちごホテルリート投資法人 投資証券	2
27	3466	ラサールロジポート投資法人 投資証券	19
28	3468	スターアジア不動産投資法人 投資証券	6
29	8951	日本ビルファンド投資法人 投資証券	25
30	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	23
31	8953	日本リテールファンド投資法人 投資証券	45
32	8954	オリックス不動産投資法人 投資証券	42
33	8955	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	15
34	8956	プレミア投資法人 投資証券	23
35	8957	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	17
36	8958	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	3
37	8960	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	51
38	8961	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	23
39	8963	インヴェンシブル投資法人 投資証券	64
40	8964	フロンティア不動産投資法人 投資証券	9
41	8966	平和不動産リート投資法人 投資証券	18
42	8967	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	15
43	8968	福岡リート投資法人 投資証券	13
44	8972	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	7
45	8973	積水ハウス・SI レジデンシャル投資法人 投資証券	18
46	8975	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	27
47	8976	大和証券オフィス投資法人 投資証券	9
48	8977	阪急リート投資法人 投資証券	10
49	8979	スターツプロシード投資法人 投資証券	3
50	8982	トップリート投資法人 投資証券	3
51	8984	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券	13

52	8985	.....	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	65
53	8986	.....	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	28
54	8987	.....	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	23

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1347 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 眞帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場インデックスファンドFTSE日本グリーンチップ35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8月8日現在)

77,477 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

304,206,059 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

3,926.40 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とFTSE日本グリーンチップ35指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月8日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{FTSE日本グリーンチップ35指数の終値}}{\text{前営業日のFTSE日本グリーンチップ35指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:6]

上場インデックスファンドFTSE日本グリーンチップ35 PCF(ユニット株式)

[ 2016/08/09 申込分 ]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	3402	東レ	11,000
2	3407	旭化成	10,000
3	4004	昭和電工	1,000
4	4091	大陽日酸	1,100
5	4188	三菱ケミカルホールディングス	9,900
6	5012	東燃ゼネラル石油	2,000
7	5019	出光興産	800
8	5233	太平洋セメント	9,000
9	5333	日本碍子	2,000
10	5631	日本製鋼所	3,000
11	5714	DOWAホールディングス	2,000
12	5801	古河電気工業	5,000
13	5802	住友電気工業	5,800
14	6361	荏原製作所	3,000
15	6370	栗田工業	900
16	6501	日立製作所	35,000
17	6502	東芝	29,000
18	6503	三菱電機	15,000
19	6645	オムロン	1,500
20	6741	日本信号	500
21	6752	パナソニック	16,000
22	6753	シャープ	11,000
23	6758	ソニー	9,400
24	6902	デンソー	3,800
25	6923	スタンレー電気	1,100
26	6954	ファナック	1,500
27	6971	京セラ	2,300
28	6988	日東電工	1,200
29	7011	三菱重工業	24,000
30	7012	川崎重工業	11,000
31	7203	トヨタ自動車	5,300
32	7211	三菱自動車工業	4,700
33	7267	本田技研工業	10,200
34	7912	大日本印刷	5,000
35	9513	電源開発	1,300



各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1677 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場インデックスファンド海外債券(Citi WGBI)毎月分配型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8月8日現在)

139,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

6,890,644,555 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

49,573 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と  
シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月8日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{WGBI指数の終値}}{\text{前営業日のWGBI指数の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1680 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

### 上場インデックスファンド海外先進国株式 (MSCI-KOKUSAI)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8月8日現在)

6,000,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

10,935,385,602 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

1,822.56 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と  
円換算したMSCI-KOKUSAIインデックスの終値の変動率に係る乖離率

(平成28年8月8日現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したMSCI-KOKUSAIインデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したMSCI-KOKUSAIインデックスの終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1681 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 眞帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

### 上場インデックスファンド海外新興国株式 (MSCIエマージング)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8月8日現在)

4,800,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

5,476,831,251 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

1,141.01 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と  
円換算したMSCI-エマージング・マーケットインデックスの終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月8日現在)

△ 0.14%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したMSCI-エマージング・マーケットインデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したMSCI-エマージング・マーケットインデックスの終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1698 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場インデックスファンド日本高配当(東証配当フォーカス100)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8月8日現在)

8,115,752 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

11,927,995,343 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

1,469.73 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と東証配当フォーカス100指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成28年8月8日現在)

△ 0.03%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{東証配当フォーカス100指数の終値}}{\text{前営業日の東証配当フォーカス100指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:10]

上場インデックスファンド日本高配当(東証配当フォーカス100) PCF (ユニット株式)

[ 2016/08/09 申込分 ]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	1954	日本工営	1,000
2	2174	GCA	100
3	2502	アサヒグループホールディングス	2,200
4	2503	麒麟ホールディングス	5,200
5	2580	コカ・コーライーストジャパン	400
6	2914	日本たばこ産業	7,600
7	3003	ヒューリック	2,100
8	3405	クラレ	1,700
9	3407	旭化成	2,000
10	3453	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1
11	3673	ブロードリーフ	100
12	4004	昭和電工	700
13	4005	住友化学	2,000
14	4045	東亜合成	700
15	4188	三菱ケミカルホールディングス	1,700
16	4324	電通	1,200
17	4452	花王	3,300
18	4502	武田薬品工業	1,300
19	4578	大塚ホールディングス	2,500
20	4612	日本ペイントホールディングス	700
21	4631	DIC	400
22	4704	トレンドマイクロ	500
23	4768	大塚商会	300
24	4902	コニカミノルタ	700
25	4927	ポーラ・オルビスホールディングス	100
26	5002	昭和シェル石油	1,100
27	5012	東燃ゼネラル石油	2,000
28	5020	JXホールディングス	3,800
29	5101	横浜ゴム	600
30	5105	東洋ゴム工業	500
31	5108	ブリヂストン	3,500
32	5110	住友ゴム工業	1,000
33	5201	旭硝子	6,000
34	5214	日本電気硝子	2,000
35	5563	新日本電工	600
36	5938	LIXILグループ	400
37	5959	岡部	200
38	6028	テクノプロ・ホールディングス	200
39	6141	DMG森精機	600
40	6178	日本郵政	900
41	6201	豊田自動織機	200
42	6268	ナブテスコ	500
43	6301	小松製作所	1,300
44	6326	クボタ	4,900
45	6440	JUKI	100
46	6501	日立製作所	7,000
47	6592	マブチモーター	300
48	6724	セイコーエプソン	400
49	6789	ローランド ディー. ジー.	100
50	6856	堀場製作所	200
51	6902	デンソー	700

52	6915	千代田インテグレ	100
53	7011	三菱重工業	5,000
54	7012	川崎重工業	2,000
55	7182	ゆうちょ銀行	800
56	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,000
57	7201	日産自動車	3,900
58	7203	トヨタ自動車	3,400
59	7267	本田技研工業	2,400
60	7270	富士重工業	800
61	7272	ヤマハ発動機	1,200
62	7739	キヤノン電子	100
63	7740	タムロン	100
64	7751	キヤノン	5,800
65	7752	リコー	1,000
66	8001	伊藤忠商事	2,500
67	8002	丸紅	2,900
68	8011	三陽商会	1,000
69	8031	三井物産	2,800
70	8035	東京エレクトロン	200
71	8053	住友商事	1,900
72	8058	三菱商事	2,300
73	8304	あおぞら銀行	2,000
74	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	21,600
75	8308	りそなホールディングス	3,300
76	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	6,000
77	8316	三井住友フィナンシャルグループ	2,200
78	8355	静岡銀行	1,000
79	8411	みずほフィナンシャルグループ	39,300
80	8591	オリックス	1,900
81	8601	大和証券グループ本社	3,000
82	8604	野村ホールディングス	5,000
83	8697	日本取引所グループ	700
84	8725	MS&ADインシュアランスグループホール	800
85	8750	第一生命保険	1,600
86	8766	東京海上ホールディングス	1,100
87	8795	T&Dホールディングス	900
88	8804	東京建物	1,100
89	8951	日本ビルファンド投資法人 投資証券	12
90	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	3
91	8961	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	3
92	8963	インヴィンシブル投資法人 投資証券	26
93	8964	フロンティア不動産投資法人 投資証券	4
94	8973	積水ハウス・SI レジデンシャル投資法人 投資	2
95	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	26
96	8986	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	3
97	8987	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	10
98	9201	日本航空	600
99	9513	電源開発	300
100	9747	アサツー ディ・ケイ	200

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1547 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場インデックスファンド米国株式 (S&P500)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8月8日現在)

2,900,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

7,024,081,700 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

2,422.10 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と円換算したS&P500指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成28年8月8日現在)

△ 0.05%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したS\&P500指数の終値}}{\text{前営業日の円換算したS\&P500指数の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1548 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場インデックスファンド中国H株(ハンセン中国企業株)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8月8日現在)

400,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

390,355,493 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

975.89 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と  
円換算したハンセン中国企業株指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成28年8月8日現在)

△ 0.03%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したハンセン中国企業株指数の終値}}{\text{前営業日の円換算したハンセン中国企業株指数の終値}} \right) \times 100$$



各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1549 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場インデックスファンドNifty50先物(インド株式)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8月8日現在)

800,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

969,258,977 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

1,211.57 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と  
円換算したNifty50指数先物の終値の変動率に係る乖離率

(平成28年8月8日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したNifty50指数先物の終値}}{\text{前営業日の円換算したNifty50指数先物の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1554 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

### 上場インデックスファンド世界株式 (MSCI ACWI) 除く日本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8月8日現在)

2,200,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

3,421,258,317 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

1,555.12 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と

円換算したMSCI ACWI ex Japanインデックスの終値の変動率に係る乖離率

(平成28年8月8日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したMSCI ACWI ex Japanインデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したMSCI ACWI ex Japanインデックスの終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1555 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場インデックスファンド豪州リート(S&P/ASX200 A-REIT)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8月8日現在)

2,700,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

4,310,402,917 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

1,596.45 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と  
円換算したS&P/ASX200 A-REIT指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成28年8月8日現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したS\&P/ASX200 A-REIT指数の終値}}{\text{前営業日の円換算したS\&P/ASX200 A-REIT指数の終値}} \right) \times 100$$

平成28年8月9日

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1566 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 眞帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場インデックスファンド新興国債券(バークレイズLocal EM国債)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8月8日現在)

134,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

6,653,041,853 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

49,650 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と円換算したバークレイズ自国通貨建て新興市場国債・10%国キャップ・インデックスの終値の変動率に係る乖離率

(平成28年8月8日現在)

△ 0.05%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したバークレイズ自国通貨建て新興市場国債・10\%国キャップ・インデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したバークレイズ自国通貨建て新興市場国債・10\%国キャップ・インデックスの終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1578 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場インデックスファンド日経225(ミニ)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8月8日現在)

12,966,360 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

17,427,199,360 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

1,344.0 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と日経225株価指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月8日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経225株価指数の終値}}{\text{前営業日の日経225株価指数の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1586 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financials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8月8日現在)

4,701,369 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

5,236,232,511 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

1,113.8 円

4. 上場ETF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8月8日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{TOPIX Ex-Financialsの終値}}{\text{前営業日のTOPIX Ex-Financialsの終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1592 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 眞帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場インデックスファンドJPX日経インデックス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8月8日現在)

67,277,134 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

71,838,552,593 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

1,067.8 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の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月8日現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{JPX日経インデックス 400の終値}}{\text{前営業日のJPX日経インデックス 400の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1358 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

## 上場インデックスファンド日経レバレッジ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8月8日現在)

345,647 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

3,586,506,289 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

10,376 円

4. 上場ETF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8月8日現在)

0.02%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経平均レバレッジ・インデックスの終値}}{\text{前営業日の日経平均レバレッジ・インデックスの終値}} \right) \times 100$$



#### ※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

・日経平均レバレッジ・インデックスは、前営業日に対する当該営業日の騰落率が、同期間の日経平均株価の騰落率の2倍となるよう計算されます。しかしながら、2営業日以上離れた期間における日経平均レバレッジ・インデックスの騰落率は、複利効果により、一般に日経平均株価の2倍とはならず、計算上、差が生じます。

・2営業日以上離れた期間における日経平均レバレッジ・インデックスの騰落率と日経平均株価の騰落率の2倍との差は、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。ただし一般に、一定のレンジ内で日経平均株価の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、日経平均レバレッジ・インデックスの指数値は減速する可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差が大きくなる傾向があります。

#### ※日経平均レバレッジ・インデックスと基準価額の主な乖離要因

当ファンドは、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に一致させることをめざしますが、次のような要因があるため、同指数と一致した推移をすることをお約束できるものではありません。

・株価指数先物取引の値動きと日経平均株価の値動きが一致しないこと。また、投資対象とする上場インデックスファンド225などの上場投資信託証券の値動きと日経平均株価の値動きが一致しないこと。

・日々の追加設定・解約などに対応した株価指数先物取引や投資対象とする上場インデックスファンド225などの上場投資信託証券の約定価格と評価価格(終値)に差が生じること。

・日経平均株価の採用銘柄の変更や資本異動などによってポートフォリオの調整が行なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、信託報酬、売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。

・組入銘柄の配当金や有価証券の貸付による品貸料が発生すること。

#### ※金融商品取引所で取引される市場価格と基準価額の乖離

・当ファンドは東京証券取引所に上場され公に取引されますが、市場価格は、主に当ファンドの需要、当ファンドの運用成果および投資者が代替的な投資と比較して当ファンドが全般的にどの程度魅力的であるか、などの評価に左右されます。したがって、当ファンドの市場価格が、基準価額を下回って取引されるかまたは上回って取引されるかは予測することはできません。

平成28年8月9日

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
 (コード番号 1399 )  
 問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆  
 ( TEL 03 - 6447 - 6483 )

### 上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティ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8月8日現在)

2,591,232 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

3,205,137,594 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

1,236.92 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とMSCIジャパンIMIカスタム高流動性高利回り低ボラティリティ指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成28年8月8日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{MSCIジャパンIMIカスタム高流動性高利回り低ボラティリティ指数の終値}}{\text{前営業日のMSCIジャパンIMIカスタム高流動性高利回り低ボラティリティ指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:21]

上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティ PCF (ユニット株式)

[ 2016/08/09 申込分 ]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	1820	西松建設	2,000
2	1878	大東建託	100
3	1925	大和ハウス工業	300
4	1928	積水ハウス	500
5	1963	日揮	100
6	2503	麒麟ホールディングス	600
7	2651	ローソン	100
8	2685	アダストリア	300
9	2768	双日	1,300
10	2914	日本たばこ産業	200
11	3086	J. フロント リテイリング	500
12	3197	すかいらーく	800
13	3231	野村不動産ホールディングス	600
14	3405	クラレ	700
15	3407	旭化成	1,000
16	3861	王子ホールディングス	2,000
17	3863	日本製紙	500
18	4004	昭和電工	800
19	4061	デンカ	2,000
20	4062	イビデン	300
21	4114	日本触媒	100
22	4118	カネカ	1,000
23	4182	三菱瓦斯化学	2,000
24	4185	JSR	700
25	4188	三菱ケミカルホールディングス	1,700
26	4204	積水化学工業	700
27	4208	宇部興産	5,000
28	4217	日立化成	300
29	4502	武田薬品工業	200
30	4503	アステラス製薬	700
31	4508	田辺三菱製薬	600
32	4521	科研製薬	100
33	4523	エーザイ	200
34	4544	みらかホールディングス	200
35	4568	第一三共	400
36	4578	大塚ホールディングス	200
37	4631	DIC	300
38	4681	リゾートトラスト	500
39	4704	トレンドマイクロ	300
40	4732	ユー・エス・エス	600
41	4739	伊藤忠テクノソリューションズ	400
42	4902	コニカミノルタ	500
43	4927	ポーラ・オルビスホールディングス	100
44	5002	昭和シェル石油	900
45	5012	東燃ゼネラル石油	1,000
46	5019	出光興産	500
47	5020	JXホールディングス	2,500
48	5101	横浜ゴム	100
49	5105	東洋ゴム工業	100
50	5108	ブリヂストン	300
51	5110	住友ゴム工業	600

52	5201	旭硝子	2,000
53	5214	日本電気硝子	2,000
54	5233	太平洋セメント	3,000
55	5711	三菱マテリアル	1,000
56	5802	住友電気工業	700
57	5938	LIXILグループ	500
58	6113	アマダホールディングス	900
59	6136	オーエスジー	300
60	6146	ディスコ	100
61	6201	豊田自動織機	200
62	6301	小松製作所	500
63	6305	日立建機	100
64	6361	荏原製作所	2,000
65	6417	SANKYO	300
66	6448	ブラザー工業	400
67	6460	セガサミーホールディングス	800
68	6473	ジェイテクト	200
69	6481	THK	200
70	6504	富士電機	1,000
71	6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	2,000
72	6701	日本電気	3,000
73	6724	セイコーエプソン	300
74	6752	パナソニック	300
75	6902	デンソー	200
76	6952	カシオ計算機	600
77	6988	日東電工	100
78	6995	東海理化電機製作所	500
79	7003	三井造船	1,000
80	7011	三菱重工業	1,000
81	7201	日産自動車	1,000
82	7202	いすゞ自動車	300
83	7203	トヨタ自動車	200
84	7205	日野自動車	400
85	7259	アイシン精機	200
86	7267	本田技研工業	300
87	7270	富士重工業	300
88	7606	ユナイテッドアローズ	300
89	7751	キヤノン	300
90	7752	リコー	1,100
91	7762	シチズンホールディングス	1,700
92	7912	大日本印刷	1,000
93	8001	伊藤忠商事	500
94	8002	丸紅	1,000
95	8015	豊田通商	400
96	8031	三井物産	800
97	8035	東京エレクトロン	100
98	8036	日立ハイテクノロジーズ	300
99	8053	住友商事	900
100	8058	三菱商事	300
101	8136	サンリオ	500
102	8270	ユニーグループ・ホールディングス	1,300
103	8282	ケーズホールディングス	600
104	9021	西日本旅客鉄道	200
105	9062	日本通運	2,000
106	9107	川崎汽船	2,000
107	9201	日本航空	300
108	9432	日本電信電話	200
109	9437	NTTドコモ	400
110	9449	GMOインターネット	100
111	9504	中国電力	800

112	9513	電源開発	400
113	9531	東京瓦斯	2,000
114	9532	大阪瓦斯	2,000
115	9719	SCSK	300
116	9783	ベネッセホールディングス	400
117	9831	ヤマダ電機	2,100

各 位

管理会社名 日興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 柴田 拓美  
(コード番号 1481 )  
問合せ先 事務企画管理部 中田 真帆  
( TEL 03 - 6447 - 6483 )

### 上場インデックスファンド日本経済貢献株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8月8日現在)

3,224,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月8日現在)

3,898,527,067 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月8日現在)

1,209.2 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8月8日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

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