

平成28年8月15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12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12日現在)

97,043,736 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

1,675,965,345,779 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

17,270 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12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)

[2016/08/15 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12日現在)

973,660,759 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

1,296,102,475,275 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

1,331.16 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12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)

[2016/08/15 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12日現在)

217,977 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

240,707,761 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

1,104.28 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12日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

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

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)

[2016/08/15 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 真帆
(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12日現在)

472,220 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

2,224,778,850 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

4,711 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12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 真帆
(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12日現在)

63,249,095 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

117,662,958,929 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

1,860.31 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12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)

[2016/08/15 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12日現在)

77,477 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

306,580,051 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

3,957.05 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12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)

[2016/08/15 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12日現在)

139,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

6,917,335,647 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

49,765 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12日現在)

△ 0.02%

(参考) 乖離率の計算式

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

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12日現在)

6,000,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

11,038,483,827 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

1,839.75 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12日現在)

△ 0.15%

(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12日現在)

4,800,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

5,597,119,776 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

1,166.07 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12日現在)

△ 0.67%

(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12日現在)

8,115,752 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

12,039,412,509 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

1,483.46 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12日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

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

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)

[2016/08/15 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 | キリンホールディングス | 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 眞帆
(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12日現在)

2,900,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

7,046,628,583 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

2,429.87 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12日現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

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

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12日現在)

400,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

403,087,664 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

1,007.72 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12日現在)

△ 0.02%

(参考) 乖離率の計算式

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

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12日現在)

800,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

960,515,587 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

1,200.64 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12日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

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

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12日現在)

2,200,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

3,458,441,880 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

1,572.02 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12日現在)

△ 0.21%

(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12日現在)

2,700,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

4,315,573,243 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

1,598.36 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12日現在)

0.13%

(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15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12日現在)

134,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

6,756,457,390 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

50,421 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12日現在)

△ 0.41%

(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12日現在)

12,936,360 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

17,667,526,754 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

1,365.7 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12日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 眞帆
(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12日現在)

4,701,369 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

5,321,306,228 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

1,131.9 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12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12日現在)

67,777,134 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

73,353,929,971 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

1,082.3 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12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12日現在)

324,647 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

3,488,737,461 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

10,746 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12日現在)

△ 0.21%

(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衰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カイ離要因

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カイ離

・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15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12日現在)

2,987,532 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

3,740,675,379 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

1,252.10 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12日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

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

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)

[2016/08/15 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12日現在)

3,224,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月12日現在)

3,970,026,853 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月12日現在)

1,231.4 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12日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

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