

平成28年8月24日

各 位

会社名 DIAMアセットマネジメント株式会社  
(管理会社コード 13694)  
代表者名 代表取締役社長 西 惠正  
問合せ先 投信ディスクロージャーグループ 上野 圭子  
TEL 03-3287-3110

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

DIAMアセットマネジメント株式会社を管理会社として上場するETF銘柄について、以下のとおり平成28年8月23日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(4銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	<a href="#">DIAM ETF 日経225</a>	1369	東
2	<a href="#">DIAM ETF トピックス</a>	1473	東
3	<a href="#">DIAM ETF JPX日経400</a>	1474	東
4	<a href="#">DIAM ETF JPX/S&amp;P 設備・人材投資指数</a>	1484	東

※各銘柄の状況につきましては、次ページ以降をご参照ください。なお、各銘柄名をクリックしていただくと、各銘柄の状況が表示されます。

以 上

各位

会社名 DIAMアセットマネジメント株式会社  
代表者名 代表取締役社長 西 恵正  
(コード番号 1369)  
問合せ先 投信ディスクロージャーグループ 上野 圭子  
TEL 03-3287-3110

## DIAM ETF 日経225に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成28年8月23日現在)

8,203,992 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月23日現在)

135,483,667,209 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月23日現在)

16,514 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と日経平均株価(日経225)の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月23日現在)

-0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[ \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経225の終値}}{\text{前営業日の日経225の終値}} \right] \times 100(\%)$$

5. 交換にかかる交換口数(別紙参照)

6. 設定にかかる株式のポートフォリオ(別紙参照)

### 日経平均株価(日経225)とは

「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体及び「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

### 指数の著作権等

「日経」及び「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属しています。当ファンドは、委託会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他、「日経平均株価」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

## DIAM ETF 日経225

日付	日経平均株価(日経225)		DIAM ETF 日経225				
	指数終値	日次騰落率	一口あたりの 純資産額	日次騰落率	乖離率	上場受益権口数	純資産総額
2016/7/26	16,383.04	-1.43%	16,400	-1.43%	-0.00%	6,976,666	114,418,656,912
2016/7/27	16,664.82	1.72%	16,684	1.73%	0.01%	6,976,666	116,398,789,755
2016/7/28	16,476.84	-1.13%	16,495	-1.13%	-0.00%	6,976,666	115,079,815,804
2016/7/29	16,569.27	0.56%	16,588	0.56%	0.00%	6,976,666	115,727,936,316
2016/8/1	16,635.77	0.40%	16,654	0.40%	-0.00%	6,976,666	116,190,675,928
2016/8/2	16,391.45	-1.47%	16,410	-1.47%	0.00%	6,976,666	114,483,717,234
2016/8/3	16,083.11	-1.88%	16,101	-1.88%	-0.00%	6,976,666	112,328,003,721
2016/8/4	16,254.89	1.07%	16,272	1.06%	-0.01%	6,976,666	113,525,875,940
2016/8/5	16,254.45	-0.00%	16,272	0.00%	0.00%	6,976,666	113,523,582,310
2016/8/8	16,650.57	2.44%	16,668	2.43%	-0.00%	7,385,762	123,107,403,815
2016/8/9	16,764.97	0.69%	16,783	0.69%	0.00%	7,385,762	123,952,923,129
2016/8/10	16,735.12	-0.18%	16,753	-0.18%	-0.00%	7,385,762	123,736,508,198
2016/8/12	16,919.92	1.10%	16,938	1.10%	0.00%	7,385,762	125,098,883,305
2016/8/15	16,869.56	-0.30%	16,887	-0.30%	-0.00%	7,692,590	129,906,245,562
2016/8/16	16,596.51	-1.62%	16,614	-1.62%	0.00%	7,897,158	131,201,860,824
2016/8/17	16,745.64	0.90%	16,763	0.90%	-0.00%	7,897,158	132,379,935,055
2016/8/18	16,486.01	-1.55%	16,503	-1.55%	-0.00%	8,203,992	135,391,325,949
2016/8/19	16,545.82	0.36%	16,563	0.36%	0.00%	8,203,992	135,878,754,073
2016/8/22	16,598.19	0.32%	16,615	0.31%	-0.00%	8,203,992	136,305,289,994
2016/8/23	16,497.36	-0.61%	16,514	-0.61%	-0.00%	8,203,992	135,483,667,209

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年8月29日)、交換受付日(平成28年8月29日)分の  
交換口数は以下の通りです。

交換申込不可日のため受け付けておりません。

## 設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(平成28年8月29日)、設定受付日(平成28年8月29日)分の  
設定ポートフォリオは以下の通りです。

設定申込不可日のため受け付けておりません。

以上

各位

会社名 DIAMアセットマネジメント株式会社  
 代表者名 代表取締役社長 西 恵正  
 (コード番号 1473)  
 問合せ先 投信ディスクロージャーグループ 上野 圭子  
 TEL 03-3287-3110

## DIAM ETF トピックスに関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成28年8月23日現在)

37,179,043 口

---

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月23日現在)

48,165,315,037 円

---

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月23日現在)

1,295.50 円

---

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と東証株価指数 (TOPIX) の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月23日現在)

0.00 %

---

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[ \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{TOPIXの終値}}{\text{前営業日のTOPIXの終値}} \right] \times 100(\%)$$

5. 交換にかかる交換口数(別紙参照)  
 6. 設定にかかる株式のポートフォリオ(別紙参照)

### 東証株価指数(TOPIX)について

- ・TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「**株東**東京証券取引所」という。)の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は**株東**東京証券取引所が有しています。
- ・**株東**東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。
- ・**株東**東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ・**株東**東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、**株東**東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
- ・当ファンドは、**株東**東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。
- ・**株東**東京証券取引所は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ・**株東**東京証券取引所は、当社又は本件商品の購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ・以上の項目に限らず、**株東**東京証券取引所は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

## DIAM ETF トピックス

日付	東証株価指数 (TOPIX)		DIAM ETF トピックス				
	指数終値	日次騰落率	一口あたりの 純資産額	日次騰落率	乖離率	上場受益権口数	純資産総額
2016/7/26	1,306.94	-1.39%	1,304.88	-1.39%	-0.00%	35,182,943	45,909,486,445
2016/7/27	1,321.67	1.13%	1,319.71	1.14%	0.01%	35,182,943	46,431,357,417
2016/7/28	1,307.00	-1.11%	1,304.97	-1.12%	-0.01%	35,182,943	45,912,819,277
2016/7/29	1,322.74	1.20%	1,320.78	1.21%	0.01%	35,182,943	46,468,972,768
2016/8/1	1,321.83	-0.07%	1,319.78	-0.08%	-0.01%	35,182,943	46,433,735,111
2016/8/2	1,300.20	-1.64%	1,298.17	-1.64%	-0.00%	36,181,143	46,969,363,966
2016/8/3	1,271.98	-2.17%	1,270.00	-2.17%	0.00%	36,181,143	45,950,135,396
2016/8/4	1,282.99	0.87%	1,280.99	0.87%	-0.00%	36,181,143	46,347,791,776
2016/8/5	1,279.90	-0.24%	1,277.90	-0.24%	-0.00%	37,179,043	47,511,156,567
2016/8/8	1,305.53	2.00%	1,303.47	2.00%	-0.00%	37,179,043	48,461,809,442
2016/8/9	1,317.49	0.92%	1,315.42	0.92%	0.00%	37,179,043	48,906,173,855
2016/8/10	1,314.83	-0.20%	1,312.80	-0.20%	0.00%	37,179,043	48,808,817,268
2016/8/12	1,323.22	0.64%	1,321.12	0.63%	-0.00%	37,179,043	49,117,967,976
2016/8/15	1,316.63	-0.50%	1,314.54	-0.50%	-0.00%	37,179,043	48,873,287,375
2016/8/16	1,298.47	-1.38%	1,296.40	-1.38%	-0.00%	37,179,043	48,198,765,613
2016/8/17	1,311.13	0.97%	1,309.06	0.98%	0.00%	37,179,043	48,669,441,136
2016/8/18	1,290.79	-1.55%	1,288.77	-1.55%	0.00%	37,179,043	47,915,112,701
2016/8/19	1,295.67	0.38%	1,293.60	0.37%	-0.00%	37,179,043	48,094,782,854
2016/8/22	1,303.68	0.62%	1,301.58	0.62%	-0.00%	37,179,043	48,391,440,531
2016/8/23	1,297.56	-0.47%	1,295.50	-0.47%	0.00%	37,179,043	48,165,315,037

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年8月29日)、交換受付日(平成28年8月29日)分の  
交換口数は以下の通りです。

交換口数	200 万口以上 200 万口単位
------	-------------------

## 設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(平成28年8月29日)、設定受付日(平成28年8月29日)分の  
設定ポートフォリオは以下の通りです。

設定申込不可日のため受け付けておりません。

以上

各位

会社名 DIAMアセットマネジメント株式会社  
 代表者名 代表取締役社長 西 恵正  
 (コード番号 1474)  
 問合せ先 投信ディスクロージャーグループ 上野 圭子  
 TEL 03-3287-3110

## DIAM ETF JPX日経400に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成28年8月23日現在)

3,304,814      口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月23日現在)

38,497,359,587      円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月23日現在)

11,649      円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とJPX日経インデックス400 (JPX日経400)の終値の変動率に係る乖離率 (平成28年8月23日現在)

0.01      %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[ \frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{JPX日経400の終値}}{\text{前営業日のJPX日経400の終値}} \right] \times 100(\%)$$

5. 交換にかかる交換口数 (別紙参照)

6. 設定にかかる株式のポートフォリオ (別紙参照)

### JPX日経インデックス400 (JPX日経400) について

- ・「JPX日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所 (以下、総称して「JPXグループ」という。)並びに株式会社日本経済新聞社 (以下、「日経」という。)によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」自体及び「JPX日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。
- ・「JPX日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て「JPXグループ」及び「日経」に帰属しています。
- ・当ファンドは、委託会社の責任のもとで運用されるものであり、「JPXグループ」及び「日経」は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。
- ・「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。
- ・「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。



## DIAM ETF JPX日経400

日付	JPX日経インデックス400 (JPX日経400)		DIAM ETF JPX日経400				
	指数終値	日次騰落率	一口あたりの 純資産額	日次騰落率	乖離率	上場受益権口数	純資産総額
2016/7/26	11,750.11	-1.43%	11,735	-1.44%	-0.00%	3,304,814	38,780,790,457
2016/7/27	11,887.23	1.17%	11,873	1.18%	0.01%	3,304,814	39,238,124,902
2016/7/28	11,753.36	-1.13%	11,738	-1.14%	-0.01%	3,304,814	38,792,275,178
2016/7/29	11,879.95	1.08%	11,866	1.09%	0.01%	3,304,814	39,213,843,018
2016/8/1	11,885.15	0.04%	11,870	0.03%	-0.01%	3,304,814	39,227,735,436
2016/8/2	11,689.47	-1.65%	11,674	-1.65%	-0.00%	3,304,814	38,581,354,659
2016/8/3	11,435.75	-2.17%	11,421	-2.17%	0.00%	3,304,814	37,743,994,593
2016/8/4	11,541.05	0.92%	11,526	0.92%	-0.00%	3,304,814	38,091,331,992
2016/8/5	11,511.57	-0.26%	11,496	-0.26%	-0.00%	3,304,814	37,993,732,853
2016/8/8	11,752.51	2.09%	11,737	2.10%	0.00%	3,304,814	38,788,777,473
2016/8/9	11,858.66	0.90%	11,843	0.90%	-0.00%	3,304,814	39,139,002,762
2016/8/10	11,833.82	-0.21%	11,819	-0.20%	0.01%	3,304,814	39,058,323,435
2016/8/12	11,912.07	0.66%	11,896	0.65%	-0.01%	3,304,814	39,314,763,062
2016/8/15	11,853.67	-0.49%	11,838	-0.49%	0.00%	3,304,814	39,121,063,199
2016/8/16	11,684.54	-1.43%	11,669	-1.43%	-0.00%	3,304,814	38,562,254,128
2016/8/17	11,808.53	1.06%	11,793	1.06%	0.00%	3,304,814	38,972,570,184
2016/8/18	11,614.45	-1.64%	11,599	-1.65%	-0.00%	3,304,814	38,331,978,528
2016/8/19	11,653.93	0.34%	11,638	0.34%	-0.00%	3,304,814	38,460,805,800
2016/8/22	11,715.58	0.53%	11,699	0.52%	-0.00%	3,304,814	38,663,885,032
2016/8/23	11,664.85	-0.43%	11,649	-0.43%	0.01%	3,304,814	38,497,359,587

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年8月29日)、交換受付日(平成28年8月29日)分の  
交換口数は以下の通りです。

交換口数	10 万口以上 10 万口単位
------	-----------------

## 設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(平成28年8月29日)、設定受付日(平成28年8月29日)分の  
設定ポートフォリオは以下の通りです。

設定申込不可日のため受け付けておりません。

以上

会社名 DIAMアセットマネジメント株式会社  
代表者名 代表取締役社長 西 恵正  
(コード番号 1484)  
問合せ先 投信ディスクロージャーグループ 上野 圭子  
TEL 03-3287-3110

## DIAM ETF JPX/S&P 設備・人材投資指数に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成28年8月23日現在)

48,262,700 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年8月23日現在)

57,803,263,676 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年8月23日現在)

1,197.68 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23日現在)

-0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

5. 交換にかかる交換口数(別紙参照)

6. 設定にかかる株式のポートフォリオ(別紙参照)

DIAM ETF JPX/S&P 設備・人材投資指数

日付	JPX/S&P 設備・人材投資指数		DIAM ETF JPX/S&P 設備・人材投資指数				
	指数終値	日次騰落率	一口あたりの 純資産額	日次騰落率	乖離率	上場受益権口数	純資産総額
2016/7/26	1,209.98	-1.14%	1,211.96	-1.14%	-0.00%	40,085,800	48,582,435,734
2016/7/27	1,220.72	0.89%	1,222.93	0.91%	0.02%	40,085,800	49,022,112,083
2016/7/28	1,208.78	-0.98%	1,210.94	-0.98%	-0.00%	42,080,200	50,956,752,557
2016/7/29	1,220.27	0.95%	1,222.45	0.95%	0.00%	42,080,200	51,440,903,917
2016/8/1	1,223.09	0.23%	1,225.31	0.23%	0.00%	44,074,200	54,004,570,630
2016/8/2	1,205.77	-1.42%	1,207.95	-1.42%	-0.00%	44,074,200	53,239,216,806
2016/8/3	1,181.67	-2.00%	1,183.79	-2.00%	-0.00%	44,074,200	52,174,503,455
2016/8/4	1,182.85	0.10%	1,184.99	0.10%	0.00%	45,570,000	54,000,105,638
2016/8/5	1,180.10	-0.23%	1,182.23	-0.23%	-0.00%	45,570,000	53,874,118,023
2016/8/8	1,198.83	1.59%	1,200.98	1.59%	-0.00%	45,570,000	54,728,526,509
2016/8/9	1,211.33	1.04%	1,213.49	1.04%	-0.00%	45,570,000	55,298,800,674
2016/8/10	1,211.93	0.05%	1,214.08	0.05%	-0.00%	46,567,200	56,536,259,101
2016/8/12	1,220.87	0.74%	1,223.00	0.73%	-0.00%	46,567,200	56,951,847,049
2016/8/15	1,217.57	-0.27%	1,219.68	-0.27%	-0.00%	46,567,200	56,796,885,425
2016/8/16	1,201.99	-1.28%	1,204.05	-1.28%	-0.00%	48,063,300	57,870,761,863
2016/8/17	1,209.18	0.60%	1,211.31	0.60%	0.00%	48,063,300	58,219,600,117
2016/8/18	1,187.54	-1.79%	1,189.62	-1.79%	-0.00%	48,262,700	57,414,498,297
2016/8/19	1,188.72	0.10%	1,190.80	0.10%	-0.00%	48,262,700	57,471,349,543
2016/8/22	1,195.64	0.58%	1,197.71	0.58%	-0.00%	48,262,700	57,804,869,795
2016/8/23	1,195.62	-0.00%	1,197.68	-0.00%	-0.00%	48,262,700	57,803,263,676

**JPX/S&P 設備・人材投資指数とは**

JPX/S&P 設備・人材投資指数とは、東証株価指数(TOPIX)の構成銘柄の中から流動性、信用力及び市場評価の安定性によりスクリーニングされたユニバースのうち、「設備投資の成長性」「設備投資の効率性」「人材投資の充実度」の3要素からスコアリング評価をして200銘柄を選定し算出される株価指数です。本指数は株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所(JPXグループ)とS&P ダウ・ジョーンズ・インデックスが「設備投資・人材投資」に積極的に取り組む企業を対象とする指数として共同開発し、2005年9月16日を基準値1000として算出・公表するものです。

**指数の著作権等**

JPX/S&P 設備・人材投資指数はS&P ダウ・ジョーンズ・インデックスまたはその関連会社(「SPDJ」)、株式会社日本取引所グループ(「JPX」)および株式会社東京証券取引所(「東証」)の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが委託会社にそれぞれ付与されています。JPX®はJPXの登録商標であり、これを利用するライセンスがSPDJおよび委託会社に付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P、それぞれの関連会社、JPXまたは東証によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、JPX/S&P 設備・人材投資指数に関するデータの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。JPX/S&P設備・人材投資指数はユニバースに東証株価指数(TOPIX)を使用しています。東証株価指数(TOPIX)は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)の商標または標章に関するすべての権利は東証が有しています。

## 交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年8月29日)、交換受付日(平成28年8月29日)分の  
交換口数は以下の通りです。

交換口数	50 万口以上 50 万口単位
------	-----------------

## 設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(平成28年8月29日)、設定受付日(平成28年8月29日)分の  
設定ポートフォリオは以下の通りです。

設定申込不可日のため受け付けておりません。

以上