

平成28年9月27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 03-6774-5049

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9月26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	DIAM ETF 日経225	1369	東
2	DIAM ETF トピックス	1473	東
3	DIAM ETF JPX日経400	1474	東
4	DIAM ETF JPX/S&P 設備・人材投資指数	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 03-6774-5049

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9月26日現在)

9,866,541 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年9月26日現在)

163,439,387,162 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年9月26日現在)

16,565 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9月26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
2016/8/26	16,360.71	-1.18%	16,373	-1.20%	-0.02%	8,203,992	134,320,931,229
2016/8/29	16,737.49	2.30%	16,761	2.37%	0.07%	8,203,992	137,503,952,939
2016/8/30	16,725.36	-0.07%	16,749	-0.07%	0.00%	8,203,992	137,404,603,116
2016/8/31	16,887.40	0.97%	16,911	0.97%	-0.00%	8,203,992	138,734,252,613
2016/9/1	16,926.84	0.23%	16,950	0.23%	-0.00%	8,203,992	139,057,882,058
2016/9/2	16,925.68	-0.01%	16,949	-0.01%	0.00%	8,203,992	139,047,525,456
2016/9/5	17,037.63	0.66%	17,060	0.65%	-0.01%	8,203,992	139,963,842,176
2016/9/6	17,081.98	0.26%	17,105	0.26%	0.00%	8,203,992	140,327,574,778
2016/9/7	17,012.44	-0.41%	17,035	-0.41%	-0.00%	8,619,560	146,833,868,714
2016/9/8	16,958.77	-0.32%	16,981	-0.32%	-0.00%	8,671,508	147,252,574,801
2016/9/9	16,965.76	0.04%	16,988	0.04%	0.00%	9,035,144	153,491,360,583
2016/9/12	16,672.92	-1.73%	16,695	-1.72%	0.00%	8,983,253	149,972,111,899
2016/9/13	16,729.04	0.34%	16,751	0.34%	-0.00%	8,983,253	150,476,183,304
2016/9/14	16,614.24	-0.69%	16,636	-0.69%	-0.00%	9,087,149	151,170,855,366
2016/9/15	16,405.01	-1.26%	16,426	-1.26%	-0.00%	9,087,149	149,269,162,948
2016/9/16	16,519.29	0.70%	16,541	0.70%	0.00%	9,970,299	164,914,222,312
2016/9/20	16,492.15	-0.16%	16,513	-0.17%	-0.00%	9,970,299	164,639,636,221
2016/9/21	16,807.62	1.91%	16,829	1.91%	0.00%	9,970,299	167,792,566,108
2016/9/23	16,754.02	-0.32%	16,775	-0.32%	-0.00%	9,866,541	165,509,981,074
2016/9/26	16,544.56	-1.25%	16,565	-1.25%	-0.00%	9,866,541	163,439,387,162

交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年9月30日)、交換受付日(平成28年9月30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9月30日)、設定受付日(平成28年9月30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 03-6774-5049

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9月26日現在)

36,215,044 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年9月26日現在)

48,309,184,663 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年9月26日現在)

1,333.95 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9月26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「**㈱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**㈱東京証券取引所**が有しています。
- ・**㈱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。
- ・**㈱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。
- ・**㈱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、**㈱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、**㈱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。
- ・**㈱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。
- ・**㈱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、**㈱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
2016/8/26	1,287.90	-1.26%	1,285.87	-1.25%	0.00%	37,179,043	47,807,540,955
2016/8/29	1,313.24	1.97%	1,311.52	1.99%	0.03%	37,179,043	48,760,966,877
2016/8/30	1,312.81	-0.03%	1,311.08	-0.03%	-0.00%	37,179,043	48,744,752,237
2016/8/31	1,329.54	1.27%	1,327.78	1.27%	-0.00%	37,179,043	49,365,766,680
2016/9/1	1,337.38	0.59%	1,335.60	0.59%	-0.00%	37,179,043	49,656,250,633
2016/9/2	1,340.76	0.25%	1,338.98	0.25%	0.00%	37,179,043	49,781,898,453
2016/9/5	1,343.85	0.23%	1,342.03	0.23%	-0.00%	37,179,043	49,895,370,636
2016/9/6	1,352.58	0.65%	1,350.74	0.65%	-0.00%	37,179,043	50,219,200,857
2016/9/7	1,349.53	-0.23%	1,347.68	-0.23%	-0.00%	37,179,043	50,105,448,251
2016/9/8	1,345.95	-0.27%	1,344.10	-0.27%	-0.00%	37,179,043	49,972,234,893
2016/9/9	1,343.86	-0.16%	1,342.04	-0.15%	0.00%	37,179,043	49,895,816,124
2016/9/12	1,323.10	-1.54%	1,321.26	-1.55%	-0.00%	37,179,043	49,123,327,409
2016/9/13	1,322.99	-0.01%	1,321.17	-0.01%	0.00%	37,179,043	49,119,944,763
2016/9/14	1,314.74	-0.62%	1,312.93	-0.62%	-0.00%	37,179,043	48,813,603,837
2016/9/15	1,301.11	-1.04%	1,299.30	-1.04%	-0.00%	37,179,043	48,306,862,228
2016/9/16	1,311.50	0.80%	1,309.66	0.80%	-0.00%	38,177,843	50,000,182,433
2016/9/20	1,316.97	0.42%	1,315.11	0.42%	-0.00%	38,177,843	50,207,886,936
2016/9/21	1,352.67	2.71%	1,350.83	2.72%	0.01%	38,177,843	51,571,803,573
2016/9/23	1,349.56	-0.23%	1,347.62	-0.24%	-0.01%	36,215,044	48,803,964,898
2016/9/26	1,335.84	-1.02%	1,333.95	-1.01%	0.00%	36,215,044	48,309,184,663

交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年9月30日)、交換受付日(平成28年9月30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9月30日)、設定受付日(平成28年9月30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 03-6774-5049

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9月26日現在）

3,503,596 口

2. 上場ETFの純資産総額（平成28年9月26日現在）

41,907,265,967 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額（平成28年9月26日現在）

11,961 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9月26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
2016/8/26	11,573.51	-1.25%	11,558	-1.24%	0.01%	3,304,814	38,195,752,026
2016/8/29	11,810.49	2.05%	11,797	2.07%	0.02%	3,304,814	38,987,816,502
2016/8/30	11,810.53	0.00%	11,797	0.00%	-0.00%	3,304,814	38,987,734,772
2016/8/31	11,967.56	1.33%	11,954	1.33%	0.00%	3,304,814	39,506,280,023
2016/9/1	12,033.47	0.55%	12,020	0.55%	0.00%	3,304,814	39,723,361,139
2016/9/2	12,061.44	0.23%	12,048	0.23%	0.00%	3,304,814	39,816,126,084
2016/9/5	12,087.00	0.21%	12,073	0.21%	-0.00%	3,304,814	39,899,360,454
2016/9/6	12,160.56	0.61%	12,146	0.60%	-0.00%	3,304,814	40,141,115,663
2016/9/7	12,119.24	-0.34%	12,105	-0.34%	0.00%	3,304,814	40,004,838,509
2016/9/8	12,070.28	-0.40%	12,055	-0.41%	-0.01%	3,304,814	39,840,947,912
2016/9/9	12,055.60	-0.12%	12,041	-0.12%	0.01%	3,304,814	39,794,250,003
2016/9/12	11,870.36	-1.54%	11,856	-1.54%	0.00%	3,304,814	39,180,849,216
2016/9/13	11,870.74	0.00%	11,856	0.00%	-0.00%	3,404,205	40,361,011,396
2016/9/14	11,802.24	-0.58%	11,788	-0.57%	0.00%	3,404,205	40,127,545,226
2016/9/15	11,670.87	-1.11%	11,656	-1.12%	-0.01%	3,404,205	39,680,174,164
2016/9/16	11,768.86	0.84%	11,754	0.84%	0.00%	3,404,205	40,013,233,944
2016/9/20	11,812.31	0.37%	11,797	0.37%	-0.00%	3,404,205	40,159,339,674
2016/9/21	12,140.66	2.78%	12,126	2.79%	0.01%	3,404,205	41,279,279,922
2016/9/23	12,105.95	-0.29%	12,090	-0.30%	-0.01%	3,404,205	41,156,556,286
2016/9/26	11,976.89	-1.07%	11,961	-1.07%	-0.00%	3,503,596	41,907,265,967

交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年9月30日)、交換受付日(平成28年9月30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9月30日)、設定受付日(平成28年9月30日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

なお、以下のポートフォリオは、最小設定口数となるポートフォリオです。

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
1	1332	日本水産	1,200
2	1605	国際石油開発帝石	4,800
3	1719	安藤・間	600
4	1720	東急建設	300
5	1721	コムシスホールディングス	400
6	1801	大成建設	5,000
7	1802	大林組	2,800
8	1803	清水建設	3,000
9	1808	長谷工コーポレーション	1,100
10	1812	鹿島建設	4,000
11	1821	三井住友建設	3,500
12	1861	熊谷組	1,000
13	1878	大東建託	300
14	1911	住友林業	600
15	1925	大和ハウス工業	2,700
16	1928	積水ハウス	3,100
17	1951	協和エクシオ	400
18	1959	九電工	200
19	1963	日揮	900
20	2121	ミクシィ	200
21	2127	日本M&Aセンター	300
22	2181	テンプホールディングス	600
23	2193	クックパッド	200
24	2206	江崎グリコ	200
25	2229	カルビー	300
26	2267	ヤクルト本社	500
27	2269	明治ホールディングス	500
28	2282	日本ハム	1,000
29	2331	総合警備保障	300
30	2337	いちご	900
31	2371	カカクコム	600
32	2379	ディップ	100
33	2413	エムスリー	700
34	2432	ディー・エヌ・エー	400
35	2433	博報堂DYホールディングス	1,200
36	2440	ぐるなび	100
37	2502	アサヒグループホールディングス	1,700
38	2503	麒麟ホールディングス	4,000
39	2593	伊藤園	300
40	2651	ローソン	300
41	2670	エービーシー・マート	100
42	2681	ゲオホールディングス	100
43	2768	双日	5,100
44	2782	セリア	100
45	2784	アルフレッサ ホールディングス	1,000
46	2801	キッコーマン	1,000
47	2802	味の素	1,900
48	2809	キューピー	500
49	2871	ニチレイ	500
50	2875	東洋水産	500

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
51	2897	日清食品ホールディングス	400
52	2914	日本たばこ産業	3,900
53	3003	ヒューリック	1,700
54	3064	MonotaRO	300
55	3086	J. フロント リテイリング	1,000
56	3088	マツモトキヨシホールディングス	200
57	3092	スタートトゥデイ	700
58	3141	ウエルシアホールディングス	100
59	3148	クリエイトSDホールディングス	100
60	3231	野村不動産ホールディングス	500
61	3254	プレサンスコーポレーション	100
62	3289	東急不動産ホールディングス	2,000
63	3291	飯田グループホールディングス	700
64	3360	シップヘルスケアホールディングス	200
65	3382	セブン&アイ・ホールディングス	3,400
66	3391	ツルハホールディングス	200
67	3398	クスリのアオキ	100
68	3402	東レ	6,000
69	3405	クラレ	1,400
70	3407	旭化成	5,000
71	3632	グリー	500
72	3659	ネクソン	900
73	3668	コロプラ	200
74	3738	ティーガイア	100
75	3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1,900
76	3861	王子ホールディングス	3,000
77	3880	大王製紙	400
78	4005	住友化学	6,000
79	4021	日産化学工業	500
80	4042	東ソー	2,000
81	4061	デンカ	2,000
82	4063	信越化学工業	1,500
83	4088	エア・ウォーター	1,000
84	4091	太陽日酸	700
85	4095	日本パーカラライジング	400
86	4151	協和発酵キリン	1,000
87	4182	三菱瓦斯化学	700
88	4185	JSR	800
89	4188	三菱ケミカルホールディングス	5,700
90	4202	ダイセル	1,200
91	4204	積水化学工業	1,900
92	4205	日本ゼオン	1,000
93	4206	アイカ工業	300
94	4208	宇部興産	5,000
95	4217	日立化成	400
96	4272	日本化薬	1,000
97	4307	野村総合研究所	500
98	4324	電通	1,000
99	4403	日油	1,000
100	4452	花王	2,200
101	4502	武田薬品工業	3,400
102	4503	アステラス製薬	9,300
103	4507	塩野義製薬	1,300
104	4508	田辺三菱製薬	1,000
105	4519	中外製薬	900
106	4521	科研製薬	100
107	4523	エーザイ	1,100
108	4528	小野薬品工業	1,900
109	4530	久光製薬	300
110	4536	参天製薬	1,600

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
111	4540	ツムラ	300
112	4543	テルモ	1,300
113	4555	沢井製薬	100
114	4568	第一三共	2,900
115	4569	キョーリン製薬ホールディングス	200
116	4578	大塚ホールディングス	1,800
117	4581	大正製薬ホールディングス	200
118	4612	日本ペイントホールディングス	700
119	4613	関西ペイント	1,000
120	4631	DIC	300
121	4661	オリエンタルランド	900
122	4666	パーク24	400
123	4681	リゾートトラスト	400
124	4684	オービック	300
125	4689	ヤフー	5,800
126	4704	トレンドマイクロ	400
127	4716	日本オラクル	100
128	4732	ユー・エス・エス	1,000
129	4739	伊藤忠テクノソリューションズ	200
130	4751	サイバーエージェント	500
131	4755	楽天	4,400
132	4768	大塚商会	200
133	4842	USEN	400
134	4901	富士フイルムホールディングス	2,000
135	4902	コニカミノルタ	2,000
136	4911	資生堂	1,600
137	4922	コーセー	100
138	4924	シーズ・ホールディングス	100
139	4967	小林製薬	300
140	5101	横浜ゴム	500
141	5105	東洋ゴム工業	500
142	5108	ブリヂストン	2,900
143	5110	住友ゴム工業	800
144	5201	旭硝子	4,000
145	5232	住友大阪セメント	2,000
146	5233	太平洋セメント	5,000
147	5332	TOTO	600
148	5333	日本碍子	1,100
149	5334	日本特殊陶業	700
150	5401	新日鐵住金	3,900
151	5406	神戸製鋼所	1,600
152	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	2,300
153	5486	日立金属	1,000
154	5711	三菱マテリアル	500
155	5713	住友金属鉱山	2,000
156	5714	DOWAホールディングス	1,000
157	5802	住友電気工業	3,400
158	5929	三和ホールディングス	900
159	5932	三協立山	100
160	5947	リンナイ	200
161	5991	日本発条	800
162	6136	オーエスジー	400
163	6141	DMG森精機	500
164	6146	ディスコ	100
165	6201	豊田自動織機	700
166	6268	ナブテスコ	400
167	6273	SMC	300
168	6301	小松製作所	4,200
169	6302	住友重機械工業	3,000
170	6305	日立建機	400

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
171	6326	クボタ	4,100
172	6361	荏原製作所	400
173	6367	ダイキン工業	1,200
174	6383	ダイフク	400
175	6395	タダノ	400
176	6412	平和	300
177	6432	竹内製作所	200
178	6448	ブラザー工業	1,100
179	6463	TPR	100
180	6465	ホシザキ	200
181	6471	日本精工	1,700
182	6473	ジェイテクト	900
183	6474	不二越	1,000
184	6479	ミネベア	1,300
185	6481	THK	500
186	6486	イーグル工業	100
187	6501	日立製作所	21,000
188	6503	三菱電機	9,000
189	6504	富士電機	2,000
190	6506	安川電機	1,000
191	6586	マキタ	500
192	6594	日本電産	1,000
193	6645	オムロン	900
194	6701	日本電気	11,000
195	6702	富士通	8,000
196	6703	沖電気工業	400
197	6723	ルネサスエレクトロニクス	400
198	6724	セイコーエプソン	1,200
199	6750	エレコム	100
200	6752	パナソニック	9,400
201	6756	日立国際電気	200
202	6762	TDK	500
203	6770	アルプス電気	700
204	6806	ヒロセ電機	100
205	6841	横河電機	800
206	6849	日本光電工業	300
207	6856	堀場製作所	200
208	6861	キーエンス	200
209	6869	シスメックス	600
210	6902	デンソー	1,800
211	6923	スタンレー電気	600
212	6952	カシオ計算機	800
213	6954	ファナック	800
214	6965	浜松ホトニクス	600
215	6971	京セラ	1,300
216	6981	村田製作所	900
217	6988	日東電工	700
218	7011	三菱重工業	15,000
219	7012	川崎重工業	6,000
220	7013	IHI	6,000
221	7014	名村造船所	200
222	7148	FPG	300
223	7164	全国保証	200
224	7173	東京TYフィナンシャルグループ	100
225	7180	九州フィナンシャルグループ	1,700
226	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	5,600
227	7201	日産自動車	11,200
228	7202	いすゞ自動車	2,400
229	7203	トヨタ自動車	3,400
230	7205	日野自動車	1,200

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
231	7230	日信工業	200
232	7240	NOK	400
233	7248	カルソニックカンセイ	1,000
234	7259	アイシン精機	800
235	7261	マツダ	2,600
236	7267	本田技研工業	6,600
237	7269	スズキ	1,500
238	7270	富士重工業	2,500
239	7272	ヤマハ発動機	1,200
240	7276	小糸製作所	500
241	7280	ミツバ	100
242	7282	豊田合成	300
243	7309	シマノ	300
244	7313	テイ・エス テック	200
245	7419	ノジマ	100
246	7453	良品計画	100
247	7458	第一興商	200
248	7459	メディバルホールディングス	800
249	7532	ドンキホーテホールディングス	500
250	7593	VTホールディングス	400
251	7606	ユナイテッドアローズ	100
252	7649	スギホールディングス	100
253	7701	島津製作所	1,000
254	7731	ニコン	1,500
255	7732	トプコン	300
256	7733	オリンパス	1,200
257	7735	SCREENホールディングス	200
258	7741	HOYA	1,800
259	7747	朝日インテック	200
260	7751	キヤノン	4,400
261	7752	リコー	2,700
262	7832	バンダイナムコホールディングス	800
263	7846	パイロットコーポレーション	100
264	7936	アシックス	800
265	7951	ヤマハ	600
266	7956	ピジョン	500
267	7988	ニフコ	200
268	8001	伊藤忠商事	6,300
269	8002	丸紅	8,000
270	8015	豊田通商	900
271	8020	兼松	2,000
272	8028	ユニー・ファミリーマートホールディングス	200
273	8031	三井物産	7,300
274	8035	東京エレクトロン	700
275	8036	日立ハイテクノロジーズ	300
276	8050	セイコーホールディングス	1,000
277	8053	住友商事	5,100
278	8058	三菱商事	6,100
279	8078	阪和興業	1,000
280	8088	岩谷産業	1,000
281	8113	ユニ・チャーム	1,700
282	8129	東邦ホールディングス	300
283	8136	サンリオ	200
284	8174	日本瓦斯	100
285	8227	しまむら	100
286	8233	高島屋	1,000
287	8267	イオン	3,300
288	8273	イズミ	200
289	8279	ヤオコー	100
290	8282	ケーズホールディングス	300

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
291	8303	新生銀行	7,000
292	8304	あおぞら銀行	5,000
293	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	37,100
294	8308	りそなホールディングス	9,500
295	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	1,700
296	8316	三井住友フィナンシャルグループ	5,800
297	8331	千葉銀行	3,000
298	8334	群馬銀行	1,800
299	8354	ふくおかフィナンシャルグループ	4,000
300	8355	静岡銀行	2,000
301	8358	スルガ銀行	800
302	8359	八十二銀行	2,000
303	8377	ほくほくフィナンシャルグループ	600
304	8379	広島銀行	2,000
305	8382	中国銀行	800
306	8410	セブン銀行	3,000
307	8411	みずほフィナンシャルグループ	115,800
308	8418	山口フィナンシャルグループ	1,000
309	8424	芙蓉総合リース	100
310	8425	興銀リース	200
311	8439	東京センチュリーリース	200
312	8473	SBIホールディングス	1,000
313	8524	北洋銀行	1,200
314	8570	イオンフィナンシャルサービス	600
315	8585	オリエントコーポレーション	3,500
316	8586	日立キャピタル	200
317	8591	オリックス	5,700
318	8593	三菱UFJリース	2,100
319	8595	ジャフコ	100
320	8601	大和証券グループ本社	8,000
321	8604	野村ホールディングス	15,600
322	8609	岡三証券グループ	1,000
323	8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	900
324	8628	松井証券	400
325	8630	損保ジャパン日本興亜ホールディングス	1,800
326	8697	日本取引所グループ	2,400
327	8703	カブドットコム証券	700
328	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2,400
329	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	800
330	8750	第一生命保険	5,200
331	8766	東京海上ホールディングス	3,300
332	8795	T&Dホールディングス	2,900
333	8801	三井不動産	4,000
334	8802	三菱地所	6,000
335	8804	東京建物	900
336	8830	住友不動産	2,000
337	8840	大京	2,000
338	8848	レオパレス21	1,000
339	8850	スターツコーポレーション	100
340	8870	住友不動産販売	100
341	8897	タカラレーベン	400
342	8905	イオンモール	500
343	8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	500
344	9001	東武鉄道	4,000
345	9003	相鉄ホールディングス	2,000
346	9005	東京急行電鉄	5,000
347	9007	小田急電鉄	1,300
348	9008	京王電鉄	2,000
349	9009	京成電鉄	600
350	9020	東日本旅客鉄道	1,500

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
351	9021	西日本旅客鉄道	800
352	9022	東海旅客鉄道	700
353	9031	西日本鉄道	1,000
354	9041	近鉄グループホールディングス	8,000
355	9042	阪急阪神ホールディングス	1,100
356	9044	南海電気鉄道	2,000
357	9045	京阪ホールディングス	2,000
358	9048	名古屋鉄道	4,000
359	9062	日本通運	3,000
360	9064	ヤマトホールディングス	1,500
361	9065	山九	1,000
362	9101	日本郵船	7,000
363	9201	日本航空	1,600
364	9202	ANAホールディングス	15,000
365	9404	日本テレビホールディングス	700
366	9432	日本電信電話	3,500
367	9433	KDDI	5,400
368	9435	光通信	100
369	9437	NTTドコモ	6,000
370	9449	GMOインターネット	300
371	9502	中部電力	2,500
372	9506	東北電力	2,000
373	9513	電源開発	700
374	9531	東京瓦斯	9,000
375	9532	大阪瓦斯	8,000
376	9533	東邦瓦斯	2,000
377	9602	東宝	600
378	9603	エイチ・アイ・エス	100
379	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	500
380	9627	アインホールディングス	100
381	9678	カナモト	100
382	9719	SCSK	200
383	9735	セコム	900
384	9787	イオンディライト	100
385	9810	日鉄住金物産	100
386	9843	ニトリホールディングス	300
387	9956	バローホールディングス	200
388	9962	ミスミグループ本社	900
389	9983	ファーストリテイリング	100
390	9984	ソフトバンクグループ	2,900
391	9989	サンドラッグ	200

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 惠正
(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 03-6774-5049

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9月26日現在)

50,363,920 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年9月26日現在)

61,991,026,279 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年9月26日現在)

1,230.86 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9月26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
2016/8/26	1,188.53	-1.17%	1,190.55	-1.17%	0.00%	49,758,800	59,240,419,018
2016/8/29	1,206.39	1.50%	1,209.08	1.56%	0.05%	49,758,800	60,162,584,614
2016/8/30	1,203.77	-0.22%	1,206.46	-0.22%	0.00%	49,758,800	60,032,022,511
2016/8/31	1,214.32	0.88%	1,217.02	0.88%	-0.00%	49,758,800	60,557,665,040
2016/9/1	1,223.36	0.75%	1,226.08	0.74%	-0.00%	49,758,800	61,008,148,269
2016/9/2	1,227.37	0.33%	1,230.09	0.33%	-0.00%	49,758,800	61,207,706,573
2016/9/5	1,231.67	0.35%	1,234.36	0.35%	-0.00%	51,254,600	63,266,861,984
2016/9/6	1,239.51	0.64%	1,242.21	0.64%	-0.00%	51,254,600	63,669,035,019
2016/9/7	1,237.62	-0.15%	1,240.31	-0.15%	-0.00%	50,257,434	62,334,920,408
2016/9/8	1,235.01	-0.21%	1,237.68	-0.21%	-0.00%	50,257,434	62,202,671,593
2016/9/9	1,233.40	-0.13%	1,236.07	-0.13%	0.00%	50,257,434	62,121,457,210
2016/9/12	1,217.19	-1.31%	1,219.78	-1.32%	-0.00%	51,753,534	63,127,951,303
2016/9/13	1,218.52	0.11%	1,221.11	0.11%	-0.00%	51,753,534	63,196,694,294
2016/9/14	1,210.17	-0.69%	1,212.74	-0.69%	-0.00%	51,753,534	62,763,338,757
2016/9/15	1,199.27	-0.90%	1,201.80	-0.90%	-0.00%	51,753,534	62,197,174,511
2016/9/16	1,205.45	0.52%	1,207.97	0.51%	-0.00%	51,753,534	62,516,782,415
2016/9/20	1,211.14	0.47%	1,213.63	0.47%	-0.00%	51,753,534	62,809,457,443
2016/9/21	1,240.36	2.41%	1,243.04	2.42%	0.01%	50,790,418	63,134,458,444
2016/9/23	1,237.84	-0.20%	1,240.38	-0.21%	-0.01%	51,326,138	63,663,794,862
2016/9/26	1,228.36	-0.77%	1,230.86	-0.77%	-0.00%	50,363,920	61,991,026,279

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9月30日)、交換受付日(平成28年9月30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9月30日)、設定受付日(平成28年9月30日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

なお、以下のポートフォリオは、50万口に相当する設定ポートフォリオです。

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
1	1332	日本水産	1,000
2	1333	マルハニチロ	300
3	1377	サカタのタネ	100
4	1414	ショーボンドホールディングス	100
5	1605	国際石油開発帝石	5,400
6	1719	安藤・間	900
7	1801	大成建設	6,000
8	1802	大林組	2,600
9	1805	飛島建設	1,200
10	1812	鹿島建設	6,000
11	1820	西松建設	1,000
12	1822	大豊建設	1,000
13	1860	戸田建設	2,000
14	1861	熊谷組	2,000
15	1878	大東建託	400
16	1885	東亜建設工業	100
17	1911	住友林業	900
18	1928	積水ハウス	2,800
19	1944	きんでん	900
20	1951	協和エクシオ	400
21	1983	東芝プラントシステム	200
22	2127	日本M&Aセンター	400
23	2175	エス・エム・エス	100
24	2181	テンプホールディングス	900
25	2183	リニカル	100
26	2193	クックパッド	200
27	2229	カルビー	400
28	2264	森永乳業	1,000
29	2282	日本ハム	1,000
30	2327	新日鉄住金ソリューションズ	200
31	2413	エムスリー	800
32	2433	博報堂DYホールディングス	1,800
33	2461	ファンコミュニケーションズ	300
34	2502	アサヒグループホールディングス	1,900
35	2580	コカ・コーライーストジャパン	300
36	2593	伊藤園	400
37	2607	不二製油グループ本社	200
38	2670	エービーシー・マート	100
39	2784	アルフレッサ ホールディングス	1,000
40	2802	味の素	2,400
41	2897	日清食品ホールディングス	400
42	2914	日本たばこ産業	6,000
43	2931	ユーグレナ	400
44	3076	あい ホールディングス	200
45	3088	マツモトキヨシホールディングス	200
46	3098	ココカラファイン	100
47	3099	三越伊勢丹ホールディングス	1,600
48	3110	日東紡績	1,000
49	3141	ウエルシアホールディングス	100
50	3197	すかいらく	200

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
51	3231	野村不動産ホールディングス	600
52	3291	飯田グループホールディングス	1,200
53	3360	シップヘルスケアホールディングス	200
54	3382	セブン&アイ・ホールディングス	4,000
55	3387	クリエイト・レストランツ・ホールディングス	200
56	3391	ツルハホールディングス	200
57	3398	クスリのアオキ	100
58	3401	帝人	800
59	3402	東レ	6,000
60	3591	ワコールホールディングス	1,000
61	3668	コロプラ	400
62	3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1,900
63	3863	日本製紙	400
64	4004	昭和電工	500
65	4044	セントラル硝子	1,000
66	4062	イビデン	500
67	4063	信越化学工業	1,500
68	4091	大陽日酸	600
69	4185	JSR	800
70	4204	積水化学工業	2,300
71	4307	野村総合研究所	500
72	4324	電通	1,000
73	4452	花王	2,700
74	4502	武田薬品工業	3,200
75	4503	アステラス製薬	9,100
76	4506	大日本住友製薬	600
77	4516	日本新薬	200
78	4519	中外製薬	1,000
79	4523	エーザイ	1,000
80	4541	日医工	200
81	4555	沢井製薬	100
82	4568	第一三共	3,300
83	4661	オリエンタルランド	800
84	4676	フジ・メディア・ホールディングス	1,000
85	4684	オービック	400
86	4689	ヤフー	5,800
87	4716	日本オラクル	100
88	4732	ユー・エス・エス	1,000
89	4739	伊藤忠テクノソリューションズ	200
90	4768	大塚商会	200
91	4901	富士フイルムホールディングス	2,200
92	4902	ユニカミノルタ	2,300
93	4911	資生堂	1,800
94	4922	コーセー	100
95	4924	シーズ・ホールディングス	100
96	5002	昭和シェル石油	1,200
97	5101	横浜ゴム	500
98	5108	ブリヂストン	2,800
99	5201	旭硝子	4,000
100	5233	太平洋セメント	5,000
101	5332	TOTO	700
102	5703	日本軽金属ホールディングス	1,800
103	5929	三和ホールディングス	800
104	5938	LIXILグループ	1,300
105	5947	リンナイ	200
106	6028	テクノプロ・ホールディングス	200
107	6098	リクルートホールディングス	1,800
108	6136	オーエスジー	400
109	6268	ナブテスコ	400
110	6301	小松製作所	4,100

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
111	6361	荏原製作所	400
112	6366	千代田化工建設	1,000
113	6370	栗田工業	600
114	6383	ダイフク	400
115	6457	グローリー	300
116	6465	ホシザキ	200
117	6504	富士電機	3,000
118	6594	日本電産	900
119	6619	ダブル・スコープ	100
120	6632	JVCケンウッド	600
121	6701	日本電気	12,000
122	6702	富士通	8,000
123	6727	ワコム	600
124	6841	横河電機	800
125	6856	堀場製作所	200
126	6869	シスメックス	700
127	6952	カシオ計算機	1,000
128	6954	ファナック	900
129	6971	京セラ	1,200
130	6988	日東電工	600
131	7164	全国保証	200
132	7201	日産自動車	14,000
133	7203	トヨタ自動車	5,100
134	7267	本田技研工業	8,300
135	7459	メディパルホールディングス	1,300
136	7518	ネットワンシステムズ	300
137	7545	西松屋チェーン	200
138	7552	ハピネット	100
139	7599	IDOM	200
140	7616	コロワイド	300
141	7649	スギホールディングス	200
142	7729	東京精密	200
143	7731	ニコン	1,600
144	7733	オリンパス	1,200
145	7735	SCREENホールディングス	200
146	7751	キヤノン	4,300
147	7752	リコー	3,000
148	7911	凸版印刷	2,000
149	7912	大日本印刷	2,000
150	7936	アシックス	1,200
151	7966	リンテック	200
152	8001	伊藤忠商事	7,100
153	8002	丸紅	9,300
154	8015	豊田通商	900
155	8031	三井物産	6,600
156	8035	東京エレクトロン	800
157	8078	阪和興業	1,000
158	8088	岩谷産業	1,000
159	8129	東邦ホールディングス	300
160	8136	サンリオ	300
161	8227	しまむら	100
162	8267	イオン	4,000
163	8304	あおぞら銀行	6,000
164	8308	りそなホールディングス	9,500
165	8382	中国銀行	500
166	8411	みずほフィナンシャルグループ	122,700
167	8628	松井証券	400
168	8732	マネーパートナーズグループ	100
169	8802	三菱地所	6,000
170	8840	大京	2,000

設定にかかるポートフォリオ

No.	銘柄コード	銘柄名	株数
171	8905	イオンモール	500
172	9076	セイノーホールディングス	600
173	9202	ANAホールディングス	17,000
174	9364	上組	1,000
175	9375	近鉄エクスプレス	200
176	9404	日本テレビホールディングス	800
177	9432	日本電信電話	5,800
178	9435	光通信	100
179	9437	NTTドコモ	6,100
180	9531	東京瓦斯	8,000
181	9603	エイチ・アイ・エス	200
182	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	500
183	9616	共立メンテナンス	100
184	9627	アインホールディングス	100
185	9678	カナモト	100
186	9744	メイテック	100
187	9747	アサツー ディ・ケイ	100
188	9861	吉野家ホールディングス	300
189	9962	ミスミグループ本社	800
190	9983	ファーストリテイリング	100
191	9987	スズケン	500

以上