

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
(管理会社コード:13054)
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

上場ETF(管理会社:大和証券投資信託委託)に関する日々の開示事項 1/2

大和証券投資信託委託株式会社を管理会社として上場するETF銘柄について、以下のとおり平成28年11月18日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(18銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	ダイワ上場投信－日経225	1320	東
2	ダイワ上場投信－トピックス	1305	東
3	ダイワ上場投信－トピックス・コア30	1310	東
4	ダイワ上場投信－東証電気機器株価指数	1610	東
5	ダイワ上場投信－東証銀行業株価指数	1612	東
6	ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials	1585	東
7	ダイワ上場投信－JPX日経400	1599	東
8	ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス	1365	東
9	ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス	1366	東
10	ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数	1367	東
11	ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数	1368	東
12	ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス	1456	東
13	ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数	1457	東
14	ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス	1464	東
15	ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス	1465	東
16	ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス	1466	東
17	ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数	1479	東
18	ダイワ上場投信－東証REIT指数	1488	東

*各銘柄の状況につきましては、次ページ以降をご参照ください。

なお、各銘柄名をクリックしていただくと、各銘柄の保有状況が表示されます。

以上

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1320)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信一日経225』に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信一日経225』の上場受益権口数

(平成28年11月18日 現在)

98,139,282 口

2. 『ダイワ上場投信一日経225』の純資産総額

(平成28年11月18日 現在)

1,807,175,479,368 円

3. 『ダイワ上場投信一日経225』の一口あたりの純資産額

(平成28年11月18日 現在)

18,414.4 円

4. 『ダイワ上場投信一日経225』の一口あたりの純資産額と
『日経平均株価』の終値の変動率に係る乖離率

(平成28年11月18日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年11月21日 現在)

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バスケット	1	1332 日本水産	2,000
銘柄数 = 225	2	1333 マルハニチロ	200
バスケット提示日 = 平成28年11月21日	3	1605 国際石油開発帝石	800
追加設定日 = 平成28年11月28日	4	1721 コムシスホールディングス	2,000
	5	1801 大成建設	2,000
	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	1,000
	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	400
	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	4042 東ソー	2,000
	45	4043 トクヤマ	2,000
	46	4061 デンカ	2,000
	47	4063 信越化学工業	2,000
	48	4151 協和発酵キリン	2,000
	49	4183 三井化学	2,000
	50	4188 三菱ケミカルホールディングス	1,000

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
51	4208	宇部興産	2,000
52	4272	日本化薬	2,000
53	4324	電通	2,000
54	4452	花王	2,000
55	4502	武田薬品工業	2,000
56	4503	アステラス製薬	10,000
57	4506	大日本住友製薬	2,000
58	4507	塩野義製薬	2,000
59	4519	中外製薬	2,000
60	4523	エーザイ	2,000
61	4543	テルモ	4,000
62	4568	第一三共	2,000
63	4689	ヤフー	800
64	4704	トレンドマイクロ	2,000
65	4755	楽天	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	200
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	200
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	400
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	200
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	200
95	5802	住友電気工業	2,000
96	5803	フジクラ	2,000
97	5901	東洋製罐グループホールディングス	2,000
98	6103	オークマ	2,000
99	6113	アマダホールディングス	2,000
100	6301	小松製作所	2,000

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
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	400
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	200
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	カンオ計算機	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

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
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	400
154	7751	キヤノン	3,000
155	7752	リコー	2,000
156	7762	シチズン時計	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	8028	ユニー・ファミリーマートホールディングス	2,000
164	8031	三井物産	2,000
165	8035	東京エレクトロン	2,000
166	8053	住友商事	2,000
167	8058	三菱商事	2,000
168	8233	高島屋	2,000
169	8252	丸井グループ	2,000
170	8253	クレディセゾン	2,000
171	8267	イオン	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	200
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	SOMPOホールディングス	500
186	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	600
187	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	400
188	8750	第一生命ホールディングス	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	1,000
198	9008	京王電鉄	2,000
199	9009	京成電鉄	1,000
200	9020	東日本旅客鉄道	200

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
201	9021	西日本旅客鉄道	200
202	9022	東海旅客鉄道	200
203	9062	日本通運	2,000
204	9064	ヤマトホールディングス	2,000
205	9101	日本郵船	2,000
206	9104	商船三井	2,000
207	9107	川崎汽船	2,000
208	9202	ANAホールディングス	2,000
209	9301	三菱倉庫	2,000
210	9412	スカパーJSATホールディングス	200
211	9432	日本電信電話	400
212	9433	KDDI	12,000
213	9437	NTTドコモ	200
214	9501	東京電力ホールディングス	200
215	9502	中部電力	200
216	9503	関西電力	200
217	9531	東京瓦斯	2,000
218	9532	大阪瓦斯	2,000
219	9602	東宝	200
220	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	2,000
221	9681	東京ドーム	1,000
222	9735	セコム	2,000
223	9766	コナミホールディングス	2,000
224	9983	ファーストリテイリング	2,000
225	9984	ソフトバンクグループ	6,000

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1305)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信ートピックス』に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信ートピックス』の上場受益権口数

(平成28年11月18日 現在)

1,114,843,675 口

2. 『ダイワ上場投信ートピックス』の純資産総額

(平成28年11月18日 現在)

1,654,266,977,317 円

3. 『ダイワ上場投信ートピックス』の一口あたりの純資産額

(平成28年11月18日 現在)

1,483.86 円

4. 『ダイワ上場投信ートピックス』の一口あたりの純資産額と
『東証株価指数(TOPIX)』の終値の変動率に係る乖離率

(平成28年11月18日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年11月21日 現在)

[掲載番号:2]

ダイワ上場投信ートピックス(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成28年11月21日
追加設定日 = 平成28年11月28日

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1310)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の上場受益権口数
(平成28年11月18日 現在)

2,602,584 口

2. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の純資産総額
(平成28年11月18日 現在)

1,723,150,114 円

3. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の一口あたりの純資産額
(平成28年11月18日 現在)

662.092 円

4. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の一口あたりの純資産額と
『TOPIX Core30 指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年11月18日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年11月21日 現在)

ダイワ上場投信―トピックス・コア30(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バスケット	1	2914 日本たばこ産業	9,000
銘柄数 = 30	2	3382 セブン&アイ・ホールディングス	6,000
バスケット提示日 = 平成28年11月21日	3	4063 信越化学工業	2,700
追加設定日 = 平成28年11月28日	4	4502 武田薬品工業	5,700
	5	4503 アステラス製薬	15,600
	6	6501 日立製作所	35,000
	7	6752 パナソニック	16,600
	8	6758 ソニー	10,300
	9	6861 キーエンス	300
	10	6902 デンソー	3,600
	11	6954 ファナック	1,500
	12	6981 村田製作所	1,500
	13	7201 日産自動車	17,400
	14	7203 トヨタ自動車	18,100
	15	7267 本田技研工業	13,100
	16	7751 キヤノン	7,800
	17	8031 三井物産	13,000
	18	8058 三菱商事	10,800
	19	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	108,800
	20	8316 三井住友フィナンシャルグループ	11,500
	21	8411 みずほフィナンシャルグループ	195,000
	22	8766 東京海上ホールディングス	5,800
	23	8801 三井不動産	8,000
	24	8802 三菱地所	11,000
	25	9020 東日本旅客鉄道	2,800
	26	9022 東海旅客鉄道	1,200
	27	9432 日本電信電話	11,500
	28	9433 KDDI	14,200
	29	9437 NTTドコモ	10,700
	30	9984 ソフトバンクグループ	7,100

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1610)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の上場受益権口数

(平成28年11月18日 現在)

1,023,700 口

2. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の純資産総額

(平成28年11月18日 現在)

1,941,905,214 円

3. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の一口あたりの純資産額

(平成28年11月18日 現在)

1,896.948 円

4. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の一口あたりの純資産額と
『東証電気機器株価指数』の終値の変動率に係る乖離率

(平成28年11月18日 現在)

-0.01 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年11月21日 現在)

ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バスケット	1	3105 日清紡ホールディングス	4,000
銘柄数 = 161	2	4062 イビデン	5,000
バスケット提示日 = 平成28年11月21日	3	4902 コニカミノルタ	16,700
追加設定日 = 平成28年11月28日	4	6448 ブラザー工業	9,200
	5	6479 ミネベア	11,500
	6	6501 日立製作所	171,000
	7	6502 東芝	160,000
	8	6503 三菱電機	76,200
	9	6504 富士電機	22,000
	10	6505 東洋電機製造	1,000
	11	6506 安川電機	8,300
	12	6507 シンフォニア テクノロジー	5,000
	13	6508 明電舎	7,000
	14	6513 オリジン電気	1,000
	15	6516 山洋電気	2,000
	16	6517 デンヨー	700
	17	6588 東芝テック	4,000
	18	6590 芝浦メカトロニクス	1,000
	19	6592 マブチモーター	2,000
	20	6594 日本電産	9,300
	21	6615 ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100
	22	6617 東光高岳	400
	23	6619 ダブル・スコープ	700
	24	6620 宮越ホールディングス	200
	25	6622 ダイヘン	4,000
	26	6624 田淵電機	1,100
	27	6630 ヤーマン	100
	28	6632 JVCケンウッド	5,200
	29	6638 ミマキエンジニアリング	600
	30	6640 第一精工	300
	31	6641 日新電機	1,400
	32	6644 大崎電気工業	1,000
	33	6645 オムロン	7,600
	34	6651 日東工業	1,000
	35	6652 IDEC	900
	36	6654 不二電機工業	100
	37	6674 ジーエス・ユアサ コーポレーション	14,000
	38	6675 サクサホールディングス	2,000
	39	6676 メルコホールディングス	400
	40	6678 テクノメディカ	200
	41	6701 日本電気	98,000
	42	6702 富士通	69,000
	43	6703 沖電気工業	3,100
	44	6704 岩崎通信機	3,000
	45	6706 電気興業	2,000
	46	6707 サンケン電気	4,000
	47	6715 ナカヨ	1,000
	48	6718 アイホン	400
	49	6723 ルネサスエレクトロニクス	3,700
	50	6724 セイコーエプソン	10,600

ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
51	6727	ワコム	5,500
52	6728	アルバック	1,300
53	6730	アクセル	300
54	6737	EIZO	700
55	6740	ジャパンディスプレイ	13,300
56	6741	日本信号	2,000
57	6742	京三製作所	2,000
58	6744	能美防災	800
59	6745	ホーチキ	500
60	6750	エレコム	600
61	6751	日本無線	400
62	6752	パナソニック	81,600
63	6754	アンリツ	5,200
64	6755	富士通ゼネラル	2,000
65	6756	日立国際電気	1,900
66	6758	ソニー	50,400
67	6762	TDK	4,000
68	6763	帝国通信工業	2,000
69	6767	ミツミ電機	2,500
70	6768	タムラ製作所	3,000
71	6770	アルプス電気	6,600
72	6771	池上通信機	2,000
73	6773	パイオニア	10,700
74	6779	日本電波工業	700
75	6785	鈴木	300
76	6788	日本トリム	200
77	6789	ローランド ディー. ジー.	400
78	6794	フォスター電機	800
79	6796	クラリオン	4,000
80	6798	SMK	2,000
81	6800	ヨコオ	500
82	6803	ティアック	5,000
83	6804	ホシデン	2,200
84	6806	ヒロセ電機	1,200
85	6807	日本航空電子工業	2,000
86	6809	TOA	800
87	6810	日立マクセル	1,100
88	6814	古野電気	900
89	6815	ユニデンホールディングス	2,000
90	6816	アルパイン	1,700
91	6817	スミダコーポレーション	600
92	6820	アイコム	400
93	6823	リオン	300
94	6826	本多通信工業	200
95	6839	船井電機	800
96	6841	横河電機	7,700
97	6844	新電元工業	3,000
98	6845	アズビル	2,200
99	6848	東亜ディーケーケー	400
100	6849	日本光電工業	3,000

ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
101	6850	チノー	300
102	6853	共和電業	800
103	6855	日本電子材料	300
104	6856	堀場製作所	1,400
105	6857	アドバンテスト	4,900
106	6858	小野測器	300
107	6859	エスペック	600
108	6860	パナソニック デバイスSUNX	600
109	6861	キーエンス	1,600
110	6866	日置電機	400
111	6869	シスメックス	5,500
112	6871	日本マイクロニクス	1,300
113	6875	メガチップス	700
114	6877	OBARA GROUP	400
115	6905	コーセル	1,000
116	6908	イリソ電子工業	200
117	6911	新日本無線	600
118	6914	オプテックス	500
119	6915	千代田インテグレ	400
120	6916	アイ・オー・データ機器	200
121	6920	レーザーテック	800
122	6923	スタンレー電気	5,100
123	6924	岩崎電気	3,000
124	6925	ウシオ電機	4,300
125	6926	岡谷電機産業	400
126	6927	ヘリオス テクノ ホールディング	700
127	6929	日本セラミック	600
128	6932	遠藤照明	400
129	6935	日本デジタル研究所	700
130	6937	古河電池	1,000
131	6938	双信電機	300
132	6941	山一電機	700
133	6947	図研	500
134	6951	日本電子	3,000
135	6952	カシオ計算機	6,000
136	6954	ファナック	7,200
137	6958	日本シイエムケイ	1,500
138	6961	エンプラス	300
139	6962	大真空	300
140	6963	ローム	3,500
141	6965	浜松ホトニクス	5,600
142	6966	三井ハイテック	900
143	6967	新光電気工業	2,700
144	6971	京セラ	11,700
145	6976	太陽誘電	3,500
146	6981	村田製作所	7,500
147	6985	ユーシン	900
148	6986	双葉電子工業	1,200
149	6989	北陸電気工業	3,000
150	6996	ニチコン	2,200

[掲載番号:4]

ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
151	6997	日本ケミコン	6,000
152	6999	KOA	1,000
153	7244	市光工業	1,000
154	7276	小糸製作所	4,300
155	7280	ミツバ	1,300
156	7735	SCREENホールディングス	1,500
157	7739	キヤノン電子	700
158	7751	キヤノン	38,500
159	7752	リコー	21,500
160	7999	MUTOHホールディングス	1,000
161	8035	東京エレクトロン	4,800

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1612)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の上場受益権口数

(平成28年11月18日 現在)

4,673,862 口

2. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の純資産総額

(平成28年11月18日 現在)

780,116,048 円

3. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の一口あたりの純資産額

(平成28年11月18日 現在)

166.910 円

4. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の一口あたりの純資産額と
『東証銀行業株価指数』の終値の変動率に係る乖離率

(平成28年11月18日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年11月21日 現在)

ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バスケット	1	7161 じもとホールディングス	1,700
銘柄数 = 84	2	7167 めぶきフィナンシャルグループ	11,200
バスケット提示日 = 平成28年11月21日	3	7173 東京TYフィナンシャルグループ	300
追加設定日 = 平成28年11月28日	4	7180 九州フィナンシャルグループ	3,800
	5	7182 ゆうちょ銀行	6,600
	6	7184 富山第一銀行	600
	7	7186 コンコルディア・フィナンシャルグループ	15,200
	8	7189 西日本フィナンシャルホールディングス	1,600
	9	8303 新生銀行	22,000
	10	8304 あおぞら銀行	15,000
	11	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	176,400
	12	8308 りそなホールディングス	27,200
	13	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	4,900
	14	8316 三井住友フィナンシャルグループ	18,600
	15	8324 第四銀行	3,000
	16	8325 北越銀行	300
	17	8331 千葉銀行	9,000
	18	8334 群馬銀行	5,200
	19	8336 武蔵野銀行	400
	20	8337 千葉興業銀行	600
	21	8338 筑波銀行	1,000
	22	8341 七十七銀行	4,000
	23	8342 青森銀行	2,000
	24	8343 秋田銀行	2,000
	25	8344 山形銀行	1,000
	26	8345 岩手銀行	200
	27	8346 東邦銀行	2,000
	28	8349 東北銀行	1,000
	29	8350 みちのく銀行	1,000
	30	8354 ふくおかフィナンシャルグループ	9,000
	31	8355 静岡銀行	6,000
	32	8356 十六銀行	3,000
	33	8358 スルガ銀行	2,400
	34	8359 八十二銀行	4,500
	35	8360 山梨中央銀行	1,000
	36	8361 大垣共立銀行	3,000
	37	8362 福井銀行	2,000
	38	8363 北國銀行	2,000
	39	8364 清水銀行	100
	40	8366 滋賀銀行	2,000
	41	8367 南都銀行	200
	42	8368 百五銀行	2,000
	43	8369 京都銀行	4,000
	44	8370 紀陽銀行	900
	45	8374 三重銀行	100
	46	8377 ほくほくフィナンシャルグループ	1,500
	47	8379 広島銀行	7,000
	48	8381 山陰合同銀行	1,400
	49	8382 中国銀行	1,700
	50	8383 鳥取銀行	100

ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
51	8385	伊予銀行	2,500
52	8386	百十四銀行	3,000
53	8387	四国銀行	2,000
54	8388	阿波銀行	2,000
55	8392	大分銀行	1,000
56	8393	宮崎銀行	2,000
57	8395	佐賀銀行	1,000
58	8396	十八銀行	1,000
59	8397	沖縄銀行	200
60	8399	琉球銀行	500
61	8410	セブン銀行	8,700
62	8411	みずほフィナンシャルグループ	316,100
63	8416	高知銀行	1,000
64	8418	山口フィナンシャルグループ	2,000
65	8521	長野銀行	100
66	8522	名古屋銀行	200
67	8524	北洋銀行	3,800
68	8527	愛知銀行	100
69	8529	第三銀行	100
70	8530	中京銀行	100
71	8537	大光銀行	1,000
72	8541	愛媛銀行	300
73	8542	トマト銀行	100
74	8543	みなと銀行	200
75	8544	京葉銀行	2,000
76	8545	関西アーバン銀行	300
77	8550	栃木銀行	1,300
78	8551	北日本銀行	100
79	8558	東和銀行	4,000
80	8562	福島銀行	3,000
81	8563	大東銀行	1,000
82	8600	トモニホールディングス	1,900
83	8713	フィデアホールディングス	2,300
84	8714	池田泉州ホールディングス	2,500

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1585)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の上場受益権口数
(平成28年11月18日 現在)

4,480,149 口

2. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の純資産総額
(平成28年11月18日 現在)

5,478,258,887 円

3. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の一口あたりの純資産額
(平成28年11月18日 現在)

1,222.785 円

4. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の一口あたりの純資産額と
『TOPIX Ex-Financials』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年11月18日 現在)

-0.02 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年11月21日 現在)

[掲載番号:6]

ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials (設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成28年11月21日
追加設定日 = 平成28年11月28日

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1599)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の上場受益権口数
(平成28年11月18日 現在)

7,906,327 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の純資産総額
(平成28年11月18日 現在)

102,957,088,047 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の一口あたりの純資産額
(平成28年11月18日 現在)

13,022.114 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の一口あたりの純資産額と
『JPX日経インデックス400』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年11月18日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年11月21日 現在)

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バスケット	1	1332 日本水産	1,200
銘柄数 = 391	2	1605 国際石油開発帝石	4,900
バスケット提示日 = 平成28年11月21日	3	1719 安藤・間	700
追加設定日 = 平成28年11月28日	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	3,600
	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	2,800
	16	1928 積水ハウス	2,900
	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	700
	23	2193 クックパッド	200
	24	2206 江崎グリコ	200
	25	2229 カルビー	400
	26	2267 ヤクルト本社	500
	27	2269 明治ホールディングス	600
	28	2282 日本ハム	1,000
	29	2331 総合警備保障	300
	30	2337 いちご	800
	31	2371 カカクコム	600
	32	2379 デイップ	100
	33	2413 エムスリー	800
	34	2432 デイー・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	1,800
	38	2503 キリンホールディングス	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	4,900
	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

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
	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	800
	58	3141 ウェ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	3402 東レ	6,000
	68	3405 クラレ	1,500
	69	3407 旭化成	5,000
	70	3549 クスリのアオキホールディングス	100
	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	1,700
	76	3861 王子ホールディングス	3,000
	77	3880 大王製紙	300
	78	4005 住友化学	6,000
	79	4021 日産化学工業	500
	80	4042 東ソー	3,000
	81	4061 デンカ	2,000
	82	4063 信越化学工業	1,600
	83	4088 エア・ウォーター	700
	84	4091 太陽日酸	700
	85	4095 日本パーカライジング	400
	86	4151 協和発酵キリン	1,000
	87	4182 三菱瓦斯化学	800
	88	4185 JSR	900
	89	4188 三菱ケミカルホールディングス	5,800
	90	4202 ダイセル	1,200
	91	4204 積水化学工業	2,000
	92	4205 日本ゼオン	1,000
	93	4206 アイカ工業	300
	94	4208 宇部興産	4,000
	95	4217 日立化成	500
	96	4272 日本化薬	1,000
	97	4307 野村総合研究所	600
	98	4324 電通	1,000
	99	4403 日油	1,000
	100	4452 花王	2,200

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
101	4502	武田薬品工業	3,300
102	4503	アステラス製薬	8,900
103	4507	塩野義製薬	1,200
104	4508	田辺三菱製薬	1,000
105	4519	中外製薬	900
106	4521	科研製薬	200
107	4523	エーザイ	1,100
108	4528	小野薬品工業	2,000
109	4530	久光製薬	200
110	4536	参天製薬	1,600
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	2,600
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	1,900
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	900
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	300
124	4684	オービック	300
125	4689	ヤフー	5,900
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	1,100
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	1,700
135	4902	コニカミノルタ	1,900
136	4911	資生堂	1,700
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	200
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	800
150	5401	新日鐵住金	3,900

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
151	5406	神戸製鋼所	1,500
152	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	2,400
153	5486	日立金属	900
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	3,300
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	100
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	800
166	6268	ナブテスコ	500
167	6273	SMC	300
168	6301	小松製作所	4,000
169	6302	住友重機械工業	3,000
170	6305	日立建機	400
171	6326	クボタ	4,200
172	6361	荏原製作所	400
173	6367	ダイキン工業	1,100
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	ホンザキ	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	600
186	6486	イーグル工業	100
187	6501	日立製作所	20,000
188	6503	三菱電機	8,900
189	6504	富士電機	3,000
190	6506	安川電機	1,000
191	6586	マキタ	500
192	6594	日本電産	1,100
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	9,500

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
	201	6756 日立国際電気	200
	202	6762 TDK	500
	203	6770 アルプス電気	800
	204	6806 ヒロセ電機	100
	205	6841 横河電機	900
	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	2,100
	211	6923 スタンレー電気	600
	212	6952 カシオ計算機	700
	213	6954 ファナック	800
	214	6965 浜松ホトニクス	600
	215	6971 京セラ	1,400
	216	6981 村田製作所	900
	217	6988 日東電工	600
	218	7011 三菱重工業	14,000
	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	1,800
	226	7186 コンコルディア・フィナンシャルグループ	5,400
	227	7201 日産自動車	10,000
	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
	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	6,700
	237	7269 スズキ	1,700
	238	7270 富士重工業	2,600
	239	7272 ヤマハ発動機	1,200
	240	7276 小糸製作所	500
	241	7280 ミツバ	200
	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 メディパ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

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
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	200
253	7701	島津製作所	1,000
254	7731	ニコン	1,500
255	7732	トプコン	400
256	7733	オリンパス	1,300
257	7735	SCREENホールディングス	200
258	7741	HOYA	1,700
259	7747	朝日インテック	200
260	7751	キャノン	4,500
261	7752	リコー	2,500
262	7832	バンダイナムコホールディングス	900
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	ビジョン	500
267	7988	ニフコ	200
268	8001	伊藤忠商事	6,000
269	8002	丸紅	8,100
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	300
273	8031	三井物産	7,400
274	8035	東京エレクトロン	600
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	5,200
278	8058	三菱商事	6,200
279	8078	阪和興業	1,000
280	8088	岩谷産業	1,000
281	8113	ユニ・チャーム	1,800
282	8129	東邦ホールディングス	300
283	8136	サンリオ	300
284	8174	日本瓦斯	200
285	8227	しまむら	100
286	8233	高島屋	1,000
287	8267	イオン	3,400
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	400
291	8303	新生銀行	8,000
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	35,700
294	8308	りそなホールディングス	9,600
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	5,900
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	3,000
300	8355	静岡銀行	2,000

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
301	8358	スルガ銀行	800
302	8359	八十二銀行	2,100
303	8377	ほくほくフィナンシャルグループ	500
304	8379	広島銀行	2,000
305	8382	中国銀行	800
306	8410	セブン銀行	3,100
307	8411	みずほフィナンシャルグループ	111,100
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	200
312	8473	SBIホールディングス	900
313	8524	北洋銀行	1,300
314	8570	イオンフィナンシャルサービス	500
315	8585	オリエン트コーポレーション	1,800
316	8586	日立キャピタル	200
317	8591	オリックス	5,800
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	16,800
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	500
325	8630	SOMPOホールディングス	1,700
326	8697	日本取引所グループ	2,600
327	8703	カブドットコム証券	600
328	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2,500
329	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	800
330	8750	第一生命ホールディングス	5,000
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	3,000
333	8801	三井不動産	4,000
334	8802	三菱地所	6,000
335	8804	東京建物	1,000
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	エス・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	1,600

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
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	1,500
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	800
366	9432	日本電信電話	3,700
367	9433	KDDI	5,500
368	9435	光通信	100
369	9437	NTTドコモ	6,100
370	9449	GMOインターネット	300
371	9502	中部電力	2,700
372	9506	東北電力	2,100
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	500
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	イオンデイライト	100
385	9810	日鉄住金物産	100
386	9843	ニトリホールディングス	400
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	2,600
391	9989	サンドラッグ	200

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1365)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の上場受益権口数
(平成28年11月18日 現在)

2,795,000 口

2. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の純資産総額
(平成28年11月18日 現在)

27,325,996,191 円

3. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成28年11月18日 現在)

9,776.74 円

4. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『日経平均レバレッジ・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年11月18日 現在)

-0.17 %

●「日経平均レバレッジ・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「日経平均レバレッジ・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「2倍」の値動きになる指数で、「日経平均株価」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な正相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「日経平均株価」の変動率の「2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「日経平均株価」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「日経平均株価」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「日経平均レバレッジ・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率と日経平均レバレッジ・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率を日経平均レバレッジ・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1366)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成28年11月18日 現在)

1,918,000 口

2. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の純資産総額
(平成28年11月18日 現在)

11,399,495,886 円

3. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成28年11月18日 現在)

5,943.43 円

4. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『日経平均ダブルインバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年11月18日 現在)

0.16 %

●「日経平均ダブルインバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「日経平均ダブルインバース・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「-2倍」(マイナス2倍)の値動きになる指数で、「日経平均株価」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上の計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「日経平均株価」の変動率の「-2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「日経平均株価」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「日経平均株価」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「日経平均ダブルインバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率と日経平均ダブルインバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率を日経平均ダブルインバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1367)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の上場受益権口数
(平成28年11月18日 現在)

270,000 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の純資産総額
(平成28年11月18日 現在)

2,624,508,791 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の一口あたりの純資産額
(平成28年11月18日 現在)

9,720.40 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年11月18日 現在)

-0.06 %

●「TOPIXレバレッジ(2倍)指数」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「TOPIXレバレッジ(2倍)指数」は原指標の「TOPIX」の変動率の「2倍」の値動きになる指数で、「TOPIX」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な正相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「TOPIX」の変動率の「2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「TOPIX」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「TOPIX」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「TOPIXレバレッジ(2倍)指数」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とTOPIXレバレッジ(2倍)指数の変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、TOPIXの値動きとTOPIX先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をTOPIXレバレッジ(2倍)指数の変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1368)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の上場受益権口数
(平成28年11月18日 現在)

200,000 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の純資産総額
(平成28年11月18日 現在)

1,235,027,114 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の一口あたりの純資産額
(平成28年11月18日 現在)

6,175.14 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年11月18日 現在)

0.05 %

●「TOPIXダブルインバース(-2倍)指数」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「TOPIXダブルインバース(-2倍)指数」は原指標の「TOPIX」の変動率の「-2倍」(マイナス2倍)の値動きになる指数で、「TOPIX」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「TOPIX」の変動率の「-2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「TOPIX」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「TOPIX」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「TOPIXダブルインバース(-2倍)指数」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とTOPIXダブルインバース(-2倍)指数の変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、TOPIXの値動きとTOPIX先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をTOPIXダブルインバース(-2倍)指数の変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1456)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成28年11月18日 現在)

1,748,000 口

2. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の純資産総額
(平成28年11月18日 現在)

16,690,162,804 円

3. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成28年11月18日 現在)

9,548.15 円

4. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『日経平均インバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年11月18日 現在)

0.08 %

●「日経平均インバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「日経平均インバース・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「-1倍」(マイナス1倍)の値動きになる指数で、「日経平均株価」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-1倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「日経平均株価」の変動率の「-1倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「日経平均株価」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「日経平均株価」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。

【「日経平均インバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率と日経平均インバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率を日経平均インバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1457)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の上場受益権口数
(平成28年11月18日 現在)

230,000 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の純資産総額
(平成28年11月18日 現在)

2,243,845,405 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の一口あたりの純資産額
(平成28年11月18日 現在)

9,755.85 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIXインバース(-1倍)指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年11月18日 現在)

0.02 %

●「TOPIXインバース(-1倍)指数」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「TOPIXインバース(-1倍)指数」は原指標の「TOPIX」の変動率の「-1倍」(マイナス1倍)の値動きになる指数で、「TOPIX」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-1倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「TOPIX」の変動率の「-1倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「TOPIX」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「TOPIX」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。

【「TOPIXインバース(-1倍)指数」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とTOPIXインバース(-1倍)指数の変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、TOPIXの値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をTOPIXインバース(-1倍)指数の変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1464)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の上場受益権口数
(平成28年11月18日 現在)

200,000 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の純資産総額
(平成28年11月18日 現在)

1,541,297,801 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成28年11月18日 現在)

7,706.49 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『JPX日経400レバレッジ・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年11月18日 現在)

0.42 %

●「JPX日経400レバレッジ・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「JPX日経400レバレッジ・インデックス」は原指標の「JPX日経インデックス400」の変動率の「2倍」の値動きになる指数で、「JPX日経インデックス400」の1日の変化率（前日終値と当日終値とを比較して算出）を「2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な正相関ではないため、複数日以上の計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「JPX日経インデックス400」の変動率の「2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「JPX日経インデックス400」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「JPX日経インデックス400」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「JPX日経400レバレッジ・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とJPX日経400レバレッジ・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をJPX日経400レバレッジ・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1465)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成28年11月18日 現在)

690,000 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』の純資産総額
(平成28年11月18日 現在)

6,589,178,172 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成28年11月18日 現在)

9,549.53 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『JPX日経400インバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年11月18日 現在)

-0.22 %

●「JPX日経400インバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「JPX日経400インバース・インデックス」は原指標の「JPX日経インデックス400」の変動率の「-1倍」(マイナス1倍)の値動きになる指数で、「JPX日経インデックス400」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-1倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上の計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「JPX日経インデックス400」の変動率の「-1倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「JPX日経インデックス400」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「JPX日経インデックス400」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。

【「JPX日経400インバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とJPX日経400インバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をJPX日経400インバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1466)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成28年11月18日 現在)

67,900 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の純資産総額
(平成28年11月18日 現在)

563,845,329 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成28年11月18日 現在)

8,304.05 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年11月18日 現在)

-0.42 %

●「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点
対象指標とする「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」は原指標の「JPX日経インデックス400」の変動率の「-2倍」(マイナス2倍)の値動きになる指数で、「JPX日経インデックス400」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上
の計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「JPX日経インデックス400」の変動率の「-2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「JPX日経インデックス400」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「JPX日経インデックス400」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逡減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逡減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】
ファンドの基準価額の変動率とJPX日経400ダブルインバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をJPX日経400ダブルインバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1479)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』の上場受益権口数
(平成28年11月18日 現在)

4,100,889 口

2. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』の純資産総額
(平成28年11月18日 現在)

69,744,052,023 円

3. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』の一口あたりの純資産額
(平成28年11月18日 現在)

17,007.06 円

4. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』の一口あたりの純資産額と
『MSCI日本株人材設備投資指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成28年11月18日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年11月21日 現在)

ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バスケット	1	1801 大成建設	5,000
銘柄数 = 147	2	1878 大東建託	900
バスケット提示日 = 平成28年11月21日	3	1925 大和ハウス工業	4,100
追加設定日 = 平成28年11月28日	4	2002 日清製粉グループ本社	700
	5	2212 山崎製パン	500
	6	2229 カルビー	1,000
	7	2331 総合警備保障	400
	8	2371 カカクコム	1,500
	9	2413 エムスリー	2,100
	10	2502 アサヒグループホールディングス	2,900
	11	2503 キリンホールディングス	1,700
	12	2587 サントリー食品インターナショナル	800
	13	2651 ローソン	500
	14	2702 日本マクドナルドホールディングス	300
	15	2801 キッコーマン	1,000
	16	2802 味の素	4,000
	17	2875 東洋水産	700
	18	2897 日清食品ホールディングス	300
	19	3003 ヒューリック	1,100
	20	3231 野村不動産ホールディングス	600
	21	3289 東急不動産ホールディングス	1,000
	22	3401 帝人	600
	23	3402 東レ	8,000
	24	3405 クラレ	1,300
	25	3407 旭化成	9,000
	26	4005 住友化学	3,000
	27	4063 信越化学工業	1,000
	28	4091 太陽日酸	400
	29	4118 カネカ	1,000
	30	4151 協和発酵キリン	1,600
	31	4182 三菱瓦斯化学	600
	32	4183 三井化学	2,000
	33	4185 JSR	1,000
	34	4188 三菱ケミカルホールディングス	5,700
	35	4204 積水化学工業	1,700
	36	4217 日立化成	1,000
	37	4307 野村総合研究所	800
	38	4324 電通	800
	39	4452 花王	4,300
	40	4502 武田薬品工業	3,200
	41	4503 アステラス製薬	26,300
	42	4507 塩野義製薬	2,200
	43	4508 田辺三菱製薬	1,100
	44	4519 中外製薬	1,700
	45	4523 エーザイ	1,700
	46	4528 小野薬品工業	1,600
	47	4543 テルモ	1,500
	48	4578 大塚ホールディングス	1,700
	49	4689 ヤフー	15,300
	50	4755 楽天	3,000

ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
51	4901	富士フイルムホールディングス	1,800
52	4902	コニカミノルタ	2,300
53	4911	資生堂	1,700
54	5002	昭和シェル石油	300
55	5101	横浜ゴム	500
56	5108	ブリヂストン	7,300
57	5233	太平洋セメント	6,000
58	5332	TOTO	600
59	5333	日本碍子	600
60	5334	日本特殊陶業	1,000
61	5406	神戸製鋼所	700
62	5713	住友金属鉱山	1,000
63	5802	住友電気工業	2,700
64	5901	東洋製罐グループホールディングス	300
65	5938	LIXILグループ	1,000
66	6098	リクルートホールディングス	2,500
67	6301	小松製作所	4,800
68	6305	日立建機	400
69	6326	クボタ	7,500
70	6367	ダイキン工業	2,000
71	6370	栗田工業	300
72	6448	ブラザー工業	900
73	6460	セガサミーホールディングス	700
74	6473	ジェイテクト	1,100
75	6479	ミネベア	900
76	6481	THK	700
77	6501	日立製作所	28,000
78	6594	日本電産	1,100
79	6645	オムロン	1,600
80	6701	日本電気	10,000
81	6702	富士通	6,000
82	6752	パナソニック	7,500
83	6841	横河電機	1,200
84	6861	キーエンス	500
85	6869	シスメックス	1,600
86	6902	デンソー	2,400
87	6952	カシオ計算機	1,900
88	6963	ローム	200
89	6971	京セラ	1,700
90	6981	村田製作所	1,400
91	6988	日東電工	1,400
92	7011	三菱重工業	15,000
93	7013	IHI	5,000
94	7201	日産自動車	11,100
95	7203	トヨタ自動車	8,800
96	7205	日野自動車	2,100
97	7261	マツダ	2,800
98	7282	豊田合成	300
99	7309	シマノ	600
100	7731	ニコン	1,200

ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
	101	7733 オリンパス	600
	102	7751 キヤノン	7,000
	103	7911 凸版印刷	1,000
	104	7912 大日本印刷	1,000
	105	7936 アシックス	600
	106	7974 任天堂	200
	107	8015 豊田通商	600
	108	8035 東京エレクトロン	800
	109	8036 日立ハイテクノロジーズ	500
	110	8113 ユニ・チャーム	2,900
	111	8252 丸井グループ	700
	112	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	36,200
	113	8308 りそなホールディングス	11,200
	114	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	600
	115	8316 三井住友フィナンシャルグループ	3,400
	116	8358 スルガ銀行	1,000
	117	8410 セブン銀行	5,300
	118	8411 みずほフィナンシャルグループ	84,800
	119	8570 イオンフィナンシャルサービス	400
	120	8591 オリックス	7,800
	121	8593 三菱UFJリース	1,200
	122	8601 大和証券グループ本社	5,000
	123	8604 野村ホールディングス	8,800
	124	8697 日本取引所グループ	9,700
	125	8729 ソニーフィナンシャルホールディングス	1,100
	126	8795 T&Dホールディングス	2,600
	127	8801 三井不動産	5,000
	128	8802 三菱地所	4,000
	129	8905 イオンモール	700
	130	9005 東京急行電鉄	6,000
	131	9021 西日本旅客鉄道	900
	132	9045 京阪ホールディングス	2,000
	133	9101 日本郵船	3,000
	134	9202 ANAホールディングス	4,000
	135	9432 日本電信電話	3,100
	136	9433 KDDI	16,300
	137	9437 NTTドコモ	10,100
	138	9502 中部電力	2,600
	139	9506 東北電力	800
	140	9531 東京瓦斯	13,000
	141	9532 大阪瓦斯	13,000
	142	9533 東邦瓦斯	2,000
	143	9602 東宝	500
	144	9613 エヌ・ティ・ティ・データ	600
	145	9735 セコム	1,400
	146	9783 ベネッセホールディングス	200
	147	9984 ソフトバンクグループ	3,900

平成28年11月21日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1488)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－東証REIT指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の上場受益権口数

(平成28年11月18日 現在)

2,531,520 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の純資産総額

(平成28年11月18日 現在)

4,403,731,612 円

3. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の一口あたりの純資産額

(平成28年11月18日 現在)

1,739.560 円

4. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』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11月18日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成28年11月21日 現在)

[掲載番号:18]

ダイワ上場投信－東証REIT指数(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成28年11月21日
追加設定日 = 平成28年11月28日