

平成28年12月9日

各 位

会社名 アセットマネジメントOne株式会社
(管理会社コード 13694)
代表者名 取締役社長 西 惠正
問合せ先 投資信託ディスクロージャー部 三木谷 正直
TEL 03-6774-5100

上場ETF(管理会社:アセットマネジメントOne)に関する日々の開示事項 (2/2)

アセットマネジメントOne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12月8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 アセットマネジメントOne株式会社
代表者名 取締役社長 西 恵正
(コード番号 1369)
問合せ先 投資信託ディスクロージャー部 三木谷 正直
TEL 03-6774-5100

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12月8日現在)

12,870,377 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年12月8日現在)

243,450,492,890 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年12月8日現在)

18,916 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12月8日現在)

0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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 |
| 2016/11/10 | 17,344.42 | 6.72% | 17,485 | 6.72% | -0.00% | 10,386,811 | 181,613,609,886 |
| 2016/11/11 | 17,374.79 | 0.18% | 17,517 | 0.18% | 0.01% | 10,438,516 | 182,846,638,856 |
| 2016/11/14 | 17,672.62 | 1.71% | 17,816 | 1.71% | -0.01% | 10,025,068 | 178,605,544,262 |
| 2016/11/15 | 17,668.15 | -0.03% | 17,811 | -0.03% | -0.00% | 10,076,773 | 179,479,345,371 |
| 2016/11/16 | 17,862.21 | 1.10% | 18,007 | 1.10% | 0.00% | 10,076,773 | 181,454,884,835 |
| 2016/11/17 | 17,862.63 | 0.00% | 18,008 | 0.01% | 0.00% | 10,076,773 | 181,457,957,189 |
| 2016/11/18 | 17,967.41 | 0.59% | 18,113 | 0.58% | -0.00% | 9,404,907 | 170,349,196,523 |
| 2016/11/21 | 18,106.02 | 0.77% | 18,252 | 0.77% | -0.00% | 9,508,319 | 173,546,794,711 |
| 2016/11/22 | 18,162.94 | 0.31% | 18,310 | 0.32% | 0.00% | 6,096,383 | 111,625,726,148 |
| 2016/11/24 | 18,333.41 | 0.94% | 18,482 | 0.94% | 0.00% | 7,027,093 | 129,874,729,748 |
| 2016/11/25 | 18,381.22 | 0.26% | 18,529 | 0.25% | -0.01% | 7,027,093 | 130,206,812,170 |
| 2016/11/28 | 18,356.89 | -0.13% | 18,504 | -0.13% | -0.00% | 7,233,995 | 133,857,082,232 |
| 2016/11/29 | 18,307.04 | -0.27% | 18,454 | -0.27% | 0.00% | 7,233,995 | 133,494,219,905 |
| 2016/11/30 | 18,308.48 | 0.01% | 18,457 | 0.02% | 0.01% | 8,733,556 | 161,192,533,289 |
| 2016/12/1 | 18,513.12 | 1.12% | 18,660 | 1.10% | -0.02% | 10,129,591 | 189,019,960,854 |
| 2016/12/2 | 18,426.08 | -0.47% | 18,573 | -0.47% | 0.00% | 10,129,591 | 188,132,656,948 |
| 2016/12/5 | 18,274.99 | -0.82% | 18,421 | -0.82% | 0.00% | 10,750,231 | 198,031,906,638 |
| 2016/12/6 | 18,360.54 | 0.47% | 18,508 | 0.47% | 0.00% | 12,611,827 | 233,418,556,195 |
| 2016/12/7 | 18,496.69 | 0.74% | 18,645 | 0.74% | -0.00% | 12,611,827 | 235,142,576,200 |
| 2016/12/8 | 18,765.47 | 1.45% | 18,916 | 1.45% | 0.00% | 12,870,377 | 243,450,492,890 |

交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年12月14日)、交換受付日(平成28年12月14日)分の
交換口数は以下の通りです。

交換口数 51,900 口の整数倍

設定にかかるポートフォリオ

設定申込日(平成28年12月14日)、設定受付日(平成28年12月14日)分の
設定ポートフォリオは以下の通りです。

| No. | 銘柄コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----|-------|-----------------|-------|
| 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 | 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 |

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 | 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 |
| 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 |

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 | 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 | 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 |

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 | 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 |
| 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 |

以上

各位

会社名 アセットマネジメントOne株式会社
代表者名 取締役社長 西 恵正
(コード番号 1473)
問合せ先 投資信託ディスクロージャー部 三木谷 正直
TEL 03-6774-5100

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12月8日現在)

39,372,823 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年12月8日現在)

59,966,074,782 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年12月8日現在)

1,523.03 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12月8日現在)

0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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**東京証券取引所が有しています。
- 株**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 |
| 2016/11/10 | 1,376.35 | 5.78% | 1,385.89 | 5.79% | 0.01% | 37,213,144 | 51,573,504,294 |
| 2016/11/11 | 1,378.28 | 0.14% | 1,387.89 | 0.14% | 0.00% | 37,213,144 | 51,647,736,136 |
| 2016/11/14 | 1,400.00 | 1.58% | 1,409.64 | 1.57% | -0.01% | 40,199,844 | 56,667,265,372 |
| 2016/11/15 | 1,402.98 | 0.21% | 1,412.64 | 0.21% | -0.00% | 40,199,844 | 56,788,018,895 |
| 2016/11/16 | 1,421.65 | 1.33% | 1,431.44 | 1.33% | 0.00% | 40,199,844 | 57,543,558,065 |
| 2016/11/17 | 1,423.08 | 0.10% | 1,432.90 | 0.10% | 0.00% | 40,199,844 | 57,602,279,561 |
| 2016/11/18 | 1,428.46 | 0.38% | 1,438.29 | 0.38% | -0.00% | 40,199,844 | 57,819,160,569 |
| 2016/11/21 | 1,442.93 | 1.01% | 1,452.83 | 1.01% | -0.00% | 40,199,844 | 58,403,530,961 |
| 2016/11/22 | 1,447.50 | 0.32% | 1,457.48 | 0.32% | 0.00% | 40,199,844 | 58,590,632,309 |
| 2016/11/24 | 1,459.96 | 0.86% | 1,470.05 | 0.86% | 0.00% | 40,199,844 | 59,095,818,418 |
| 2016/11/25 | 1,464.53 | 0.31% | 1,474.58 | 0.31% | -0.00% | 40,199,844 | 59,277,729,863 |
| 2016/11/28 | 1,469.58 | 0.34% | 1,479.67 | 0.35% | 0.00% | 40,199,844 | 59,482,497,937 |
| 2016/11/29 | 1,468.57 | -0.07% | 1,478.57 | -0.07% | -0.01% | 22,408,923 | 33,133,233,373 |
| 2016/11/30 | 1,469.43 | 0.06% | 1,479.71 | 0.08% | 0.02% | 22,408,923 | 33,158,818,525 |
| 2016/12/1 | 1,483.27 | 0.94% | 1,493.43 | 0.93% | -0.01% | 22,408,923 | 33,466,245,303 |
| 2016/12/2 | 1,477.98 | -0.36% | 1,487.86 | -0.37% | -0.02% | 22,408,923 | 33,341,297,640 |
| 2016/12/5 | 1,466.96 | -0.75% | 1,476.92 | -0.74% | 0.01% | 22,408,923 | 33,096,232,685 |
| 2016/12/6 | 1,477.20 | 0.70% | 1,487.34 | 0.71% | 0.01% | 39,372,823 | 58,560,635,771 |
| 2016/12/7 | 1,490.62 | 0.91% | 1,500.78 | 0.90% | -0.00% | 39,372,823 | 59,090,130,268 |
| 2016/12/8 | 1,512.69 | 1.48% | 1,523.03 | 1.48% | 0.00% | 39,372,823 | 59,966,074,782 |

交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年12月14日)、交換受付日(平成28年12月14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12月14日)、設定受付日(平成28年12月14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 アセットマネジメントOne株式会社
 代表者名 取締役社長 西 恵正
 (コード番号 1474)
 問合せ先 投資信託ディスクロージャー部 三木谷 正直
 TEL 03-6774-5100

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12月8日現在)

3,904,564 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年12月8日現在)

53,257,106,820 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年12月8日現在)

13,640 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12月8日現在)

0.01 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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 |
| 2016/11/10 | 12,351.63 | 5.91% | 12,440 | 5.92% | 0.01% | 3,801,629 | 47,290,846,107 |
| 2016/11/11 | 12,383.44 | 0.26% | 12,472 | 0.26% | -0.00% | 3,801,629 | 47,415,434,447 |
| 2016/11/14 | 12,583.05 | 1.61% | 12,672 | 1.60% | -0.01% | 3,801,629 | 48,174,754,439 |
| 2016/11/15 | 12,615.04 | 0.25% | 12,704 | 0.25% | -0.00% | 3,801,629 | 48,296,856,808 |
| 2016/11/16 | 12,777.92 | 1.29% | 12,868 | 1.29% | -0.00% | 3,801,629 | 48,920,831,597 |
| 2016/11/17 | 12,786.58 | 0.07% | 12,877 | 0.07% | 0.00% | 4,000,635 | 51,515,932,483 |
| 2016/11/18 | 12,819.33 | 0.26% | 12,910 | 0.26% | 0.00% | 4,000,635 | 51,649,465,592 |
| 2016/11/21 | 12,945.20 | 0.98% | 13,036 | 0.98% | -0.01% | 4,000,635 | 52,153,552,856 |
| 2016/11/22 | 12,983.20 | 0.29% | 13,075 | 0.30% | 0.01% | 4,000,635 | 52,308,207,682 |
| 2016/11/24 | 13,105.50 | 0.94% | 13,198 | 0.94% | -0.00% | 4,000,635 | 52,800,999,233 |
| 2016/11/25 | 13,146.29 | 0.31% | 13,238 | 0.30% | -0.01% | 4,000,635 | 52,962,369,145 |
| 2016/11/28 | 13,187.85 | 0.32% | 13,280 | 0.32% | 0.00% | 4,000,635 | 53,128,205,130 |
| 2016/11/29 | 13,179.86 | -0.06% | 13,272 | -0.06% | 0.00% | 4,000,635 | 53,095,104,470 |
| 2016/11/30 | 13,182.36 | 0.02% | 13,276 | 0.03% | 0.01% | 4,000,635 | 53,110,594,258 |
| 2016/12/1 | 13,311.39 | 0.98% | 13,405 | 0.97% | -0.01% | 4,100,088 | 54,960,036,345 |
| 2016/12/2 | 13,258.60 | -0.40% | 13,350 | -0.41% | -0.01% | 3,904,564 | 52,126,475,986 |
| 2016/12/5 | 13,156.93 | -0.77% | 13,248 | -0.76% | 0.00% | 3,904,564 | 51,728,534,375 |
| 2016/12/6 | 13,238.63 | 0.62% | 13,331 | 0.63% | 0.01% | 3,904,564 | 52,053,333,902 |
| 2016/12/7 | 13,344.30 | 0.80% | 13,437 | 0.80% | -0.00% | 3,904,564 | 52,466,895,510 |
| 2016/12/8 | 13,545.11 | 1.50% | 13,640 | 1.51% | 0.01% | 3,904,564 | 53,257,106,820 |

交換にかかる交換口数

交換申込日(平成28年12月14日)、交換受付日(平成28年12月14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12月14日)、設定受付日(平成28年12月14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 | 4,900 |
| 3 | 1719 | 安藤・間 | 700 |
| 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 | テンブホールディングス | 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 | ディップ | 100 |
| 33 | 2413 | エムスリー | 800 |
| 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 | 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 |

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 | 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 | グリーン | 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 |
| 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 |

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 | 2,600 |
| 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 |
| 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 |

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 | 4,200 |
| 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 | 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 |
| 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 |

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 | 6,700 |
| 237 | 7269 | スズキ | 1,600 |
| 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 | 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 | キヤノン | 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 | ピジョン | 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 |

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 | 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 | 35,600 |
| 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 |
| 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 | 111,000 |
| 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 | オリエントコーポレーション | 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 | 1,600 |

設定にかかるポートフォリオ

| No. | 銘柄コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----|-------|----------------|--------|
| 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 | 700 |
| 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 | 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 | 2,400 |
| 391 | 9989 | サンドラッグ | 200 |

以上

会社名 アセットマネジメントOne株式会社
代表者名 取締役社長 西 恵正
(コード番号 1484)
問合せ先 投資信託ディスクロージャー部 三木谷 正直
TEL 03-6774-5100

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12月8日現在)

50,250,640 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年12月8日現在)

68,246,825,363 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年12月8日現在)

1,358.13 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12月8日現在)

0.01 %

(参考) 乖離率の計算式

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

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 |
| 2016/11/10 | 1,247.13 | 4.90% | 1,260.67 | 4.93% | 0.03% | 50,893,676 | 64,160,023,931 |
| 2016/11/11 | 1,242.99 | -0.33% | 1,256.70 | -0.31% | 0.02% | 50,893,676 | 63,958,133,874 |
| 2016/11/14 | 1,257.44 | 1.16% | 1,271.28 | 1.16% | -0.00% | 50,893,676 | 64,699,924,419 |
| 2016/11/15 | 1,260.95 | 0.28% | 1,274.81 | 0.28% | -0.00% | 50,893,676 | 64,879,793,442 |
| 2016/11/16 | 1,275.20 | 1.13% | 1,289.27 | 1.13% | 0.00% | 50,893,676 | 65,615,809,160 |
| 2016/11/17 | 1,279.16 | 0.31% | 1,293.23 | 0.31% | -0.00% | 50,394,971 | 65,172,317,217 |
| 2016/11/18 | 1,280.56 | 0.11% | 1,294.70 | 0.11% | 0.00% | 50,394,971 | 65,246,342,119 |
| 2016/11/21 | 1,293.76 | 1.03% | 1,307.99 | 1.03% | -0.00% | 50,394,971 | 65,916,307,678 |
| 2016/11/22 | 1,297.74 | 0.31% | 1,312.08 | 0.31% | 0.00% | 50,394,971 | 66,122,328,256 |
| 2016/11/24 | 1,307.41 | 0.75% | 1,321.91 | 0.75% | 0.00% | 51,690,871 | 68,330,469,559 |
| 2016/11/25 | 1,314.10 | 0.51% | 1,328.54 | 0.50% | -0.01% | 51,690,871 | 68,673,376,317 |
| 2016/11/28 | 1,319.00 | 0.37% | 1,333.46 | 0.37% | -0.00% | 51,690,871 | 68,927,594,352 |
| 2016/11/29 | 1,320.69 | 0.13% | 1,335.06 | 0.12% | -0.01% | 51,690,871 | 69,010,367,617 |
| 2016/11/30 | 1,322.71 | 0.15% | 1,337.22 | 0.16% | 0.01% | 51,690,871 | 69,122,111,220 |
| 2016/12/1 | 1,333.42 | 0.81% | 1,347.97 | 0.80% | -0.01% | 51,690,871 | 69,677,633,621 |
| 2016/12/2 | 1,323.91 | -0.71% | 1,338.32 | -0.72% | -0.00% | 50,250,640 | 67,251,674,590 |
| 2016/12/5 | 1,314.07 | -0.74% | 1,328.45 | -0.74% | 0.01% | 50,250,640 | 66,755,362,012 |
| 2016/12/6 | 1,319.08 | 0.38% | 1,333.72 | 0.40% | 0.02% | 50,250,640 | 67,020,066,466 |
| 2016/12/7 | 1,326.56 | 0.57% | 1,341.31 | 0.57% | 0.00% | 50,250,640 | 67,401,867,327 |
| 2016/12/8 | 1,343.09 | 1.25% | 1,358.13 | 1.25% | 0.01% | 50,250,640 | 68,246,825,363 |

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12月14日)、交換受付日(平成28年12月14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12月14日)、設定受付日(平成28年12月14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 | 2,900 |
| 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 | 1,000 |
| 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 | 1,100 |
| 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 | 3401 | 帝人 | 800 |
| 58 | 3402 | 東レ | 6,000 |
| 59 | 3549 | クスリのアオキホールディングス | 100 |
| 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 | 2,800 |
| 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 | 6013 | タクマ | 400 |
| 107 | 6028 | テクノプロ・ホールディングス | 200 |
| 108 | 6098 | リクルートホールディングス | 1,800 |
| 109 | 6136 | オーエスジー | 400 |
| 110 | 6268 | ナブテスコ | 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 |
|-----|-------|----------------|---------|
| 111 | 6301 | 小松製作所 | 4,100 |
| 112 | 6361 | 荏原製作所 | 400 |
| 113 | 6366 | 千代田化工建設 | 1,000 |
| 114 | 6370 | 栗田工業 | 600 |
| 115 | 6383 | ダイフク | 400 |
| 116 | 6457 | グローリー | 300 |
| 117 | 6465 | ホシザキ | 200 |
| 118 | 6504 | 富士電機 | 3,000 |
| 119 | 6594 | 日本電産 | 900 |
| 120 | 6619 | ダブル・スコープ | 100 |
| 121 | 6632 | JVCケンウッド | 600 |
| 122 | 6701 | 日本電気 | 12,000 |
| 123 | 6702 | 富士通 | 8,000 |
| 124 | 6727 | ワコム | 600 |
| 125 | 6841 | 横河電機 | 800 |
| 126 | 6856 | 堀場製作所 | 200 |
| 127 | 6869 | シスメックス | 700 |
| 128 | 6952 | カシオ計算機 | 1,000 |
| 129 | 6954 | ファナック | 900 |
| 130 | 6971 | 京セラ | 1,200 |
| 131 | 6988 | 日東電工 | 600 |
| 132 | 7164 | 全国保証 | 200 |
| 133 | 7201 | 日産自動車 | 14,000 |
| 134 | 7203 | トヨタ自動車 | 5,100 |
| 135 | 7267 | 本田技研工業 | 8,400 |
| 136 | 7459 | メディパルホールディングス | 1,300 |
| 137 | 7518 | ネットワンシステムズ | 300 |
| 138 | 7545 | 西松屋チェーン | 200 |
| 139 | 7552 | ハピネット | 100 |
| 140 | 7599 | IDOM | 200 |
| 141 | 7616 | コロワイド | 300 |
| 142 | 7649 | スギホールディングス | 200 |
| 143 | 7729 | 東京精密 | 200 |
| 144 | 7731 | ニコン | 1,600 |
| 145 | 7733 | オリンパス | 1,200 |
| 146 | 7735 | SCREENホールディングス | 200 |
| 147 | 7751 | キヤノン | 4,400 |
| 148 | 7752 | リコー | 3,000 |
| 149 | 7911 | 凸版印刷 | 2,000 |
| 150 | 7912 | 大日本印刷 | 2,000 |
| 151 | 7936 | アシックス | 1,200 |
| 152 | 7966 | リンテック | 200 |
| 153 | 8001 | 伊藤忠商事 | 7,200 |
| 154 | 8002 | 丸紅 | 9,300 |
| 155 | 8015 | 豊田通商 | 900 |
| 156 | 8031 | 三井物産 | 6,600 |
| 157 | 8035 | 東京エレクトロン | 800 |
| 158 | 8078 | 阪和興業 | 1,000 |
| 159 | 8088 | 岩谷産業 | 1,000 |
| 160 | 8129 | 東邦ホールディングス | 300 |
| 161 | 8136 | サンリオ | 300 |
| 162 | 8227 | しまむら | 100 |
| 163 | 8267 | イオン | 4,000 |
| 164 | 8304 | あおぞら銀行 | 6,000 |
| 165 | 8308 | りそなホールディングス | 9,600 |
| 166 | 8382 | 中国銀行 | 500 |
| 167 | 8411 | みずほフィナンシャルグループ | 123,000 |
| 168 | 8628 | 松井証券 | 400 |
| 169 | 8732 | マネーパートナーズグループ | 100 |
| 170 | 8802 | 三菱地所 | 6,000 |

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 | 8840 | 大京 | 2,000 |
| 172 | 8905 | イオンモール | 500 |
| 173 | 9076 | セイノーホールディングス | 600 |
| 174 | 9202 | ANAホールディングス | 17,000 |
| 175 | 9364 | 上組 | 1,000 |
| 176 | 9375 | 近鉄エクスプレス | 200 |
| 177 | 9404 | 日本テレビホールディングス | 800 |
| 178 | 9432 | 日本電信電話 | 5,800 |
| 179 | 9435 | 光通信 | 100 |
| 180 | 9437 | NTTドコモ | 6,100 |
| 181 | 9531 | 東京瓦斯 | 8,000 |
| 182 | 9603 | エイチ・アイ・エス | 200 |
| 183 | 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ | 500 |
| 184 | 9616 | 共立メンテナンス | 100 |
| 185 | 9627 | アインホールディングス | 100 |
| 186 | 9678 | カナモト | 100 |
| 187 | 9744 | メイテック | 100 |
| 188 | 9747 | アサツー ディ・ケイ | 100 |
| 189 | 9861 | 吉野家ホールディングス | 300 |
| 190 | 9962 | ミスミグループ本社 | 800 |
| 191 | 9983 | ファーストリテイリング | 100 |
| 192 | 9987 | スズケン | 500 |

以上