平成29年1月23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　　投資信託ﾃﾞｨｽｸﾛｰｼﾞｬｰ部 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29年1月20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

[掲載番号:1]　　平成29年1月23日

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　惠正
(コード番号　1369)
問合せ先　投資信託ﾃﾞｨｽｸﾛｰｼﾞｬｰ部 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29年1月20日現在)

14,435,702　口

2. 上場ETFの純資産総額　(平成29年1月20日現在)

277,185,151,987　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　(平成29年1月20日現在)

19,201　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29年1月20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
2016/12/20	19,494.53	0.53%	19,650	0.53%	0.00%	10,284,919	202,094,113,745
2016/12/21	19,444.49	-0.26%	19,599	-0.26%	-0.00%	9,767,799	191,436,038,305
2016/12/22	19,427.67	-0.09%	19,581	-0.09%	-0.01%	9,974,656	195,311,983,494
2016/12/26	19,396.64	-0.16%	19,549	-0.16%	-0.00%	9,974,656	194,994,771,636
2016/12/27	19,403.06	0.03%	19,555	0.03%	-0.00%	17,628,920	344,739,846,145
2016/12/28	19,401.72	-0.01%	19,582	0.14%	0.14%	17,628,920	345,213,583,882
2016/12/29	19,145.14	-1.32%	19,322	-1.33%	-0.01%	14,483,103	279,841,600,672
2016/12/30	19,114.37	-0.16%	19,292	-0.16%	0.01%	13,760,318	265,458,020,512
2017/1/4	19,594.16	2.51%	19,776	2.51%	-0.00%	13,760,318	272,122,633,913
2017/1/5	19,520.69	-0.37%	19,701	-0.38%	-0.00%	13,760,318	271,090,594,734
2017/1/6	19,454.33	-0.34%	19,634	-0.34%	-0.00%	13,760,318	270,164,426,879
2017/1/10	19,301.44	-0.79%	19,366	-1.36%	-0.58%	13,760,318	266,485,042,617
2017/1/11	19,364.67	0.33%	19,429	0.33%	-0.00%	13,864,220	269,372,718,527
2017/1/12	19,134.70	-1.19%	19,198	-1.19%	-0.00%	13,916,172	267,168,588,761
2017/1/13	19,287.28	0.80%	19,351	0.80%	-0.00%	14,435,702	279,349,437,571
2017/1/16	19,095.24	-1.00%	19,158	-1.00%	-0.00%	14,435,702	276,563,419,713
2017/1/17	18,813.53	-1.48%	18,874	-1.48%	-0.01%	14,435,702	272,466,476,682
2017/1/18	18,894.37	0.43%	18,956	0.43%	0.00%	14,435,702	273,640,376,392
2017/1/19	19,072.25	0.94%	19,136	0.95%	0.01%	14,435,702	276,238,103,312
2017/1/20	19,137.91	0.34%	19,201	0.34%	-0.00%	14,435,702	277,185,151,987

交換にかかる交換口数

交換申込日（平成29年1月26日）、交換受付日（平成29年1月26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29年1月26日）、設定受付日（平成29年1月26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

[掲載番号：2]　　平成29年1月23日

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　惠正
(コード番号　1473)
問合せ先　投資信託ﾃﾞｨｽｸﾛｰｼﾞｬｰ部 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29年1月20日現在)

48,400,337　口

2. 上場ETFの純資産総額　(平成29年1月20日現在)

74,200,197,647　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　(平成29年1月20日現在)

1,533.05　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29年1月20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
2016/12/20	1,552.36	0.21%	1,562.94	0.22%	0.00%	36,421,937	56,925,436,438
2016/12/21	1,544.94	-0.48%	1,555.42	-0.48%	-0.00%	36,421,937	56,651,266,675
2016/12/22	1,543.82	-0.07%	1,554.20	-0.08%	-0.01%	36,421,937	56,607,085,599
2016/12/26	1,538.14	-0.37%	1,548.47	-0.37%	-0.00%	36,421,937	56,398,383,408
2016/12/27	1,536.22	-0.12%	1,546.59	-0.12%	0.00%	36,421,937	56,329,680,978
2016/12/28	1,536.80	0.04%	1,549.24	0.17%	0.13%	36,421,937	56,426,371,355
2016/12/29	1,518.39	-1.20%	1,530.47	-1.21%	-0.01%	36,421,937	55,742,788,855
2016/12/30	1,518.61	0.01%	1,530.77	0.02%	0.01%	36,421,937	55,753,670,460
2017/1/4	1,554.48	2.36%	1,567.01	2.37%	0.01%	36,421,937	57,073,589,565
2017/1/5	1,555.68	0.08%	1,568.05	0.07%	-0.01%	36,421,937	57,111,536,663
2017/1/6	1,553.32	-0.15%	1,565.64	-0.15%	-0.00%	36,421,937	57,023,754,891
2017/1/10	1,542.31	-0.71%	1,541.92	-1.52%	-0.81%	36,421,937	56,159,725,448
2017/1/11	1,550.40	0.52%	1,549.97	0.52%	-0.00%	47,402,037	73,471,826,703
2017/1/12	1,535.41	-0.97%	1,534.97	-0.97%	-0.00%	48,400,337	74,292,912,392
2017/1/13	1,544.89	0.62%	1,544.44	0.62%	-0.00%	48,400,337	74,751,627,733
2017/1/16	1,530.64	-0.92%	1,530.17	-0.92%	-0.00%	48,400,337	74,060,539,656
2017/1/17	1,509.10	-1.41%	1,508.61	-1.41%	-0.00%	48,400,337	73,017,075,380
2017/1/18	1,513.86	0.32%	1,513.40	0.32%	0.00%	48,400,337	73,248,942,271
2017/1/19	1,528.15	0.94%	1,527.75	0.95%	0.00%	48,400,337	73,943,542,181
2017/1/20	1,533.46	0.35%	1,533.05	0.35%	-0.00%	48,400,337	74,200,197,647

交換にかかる交換口数

交換申込日（平成29年1月26日）、交換受付日（平成29年1月26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29年1月26日）、設定受付日（平成29年1月26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

[掲載番号：3]　　平成29年1月23日

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　惠正
（コード番号　1474）
問合せ先　投資信託ﾃﾞｨｽｸﾛｰｼﾞｬｰ部 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29年1月20日現在）

4,123,920　口

2. 上場ETFの純資産総額　（平成29年1月20日現在）

56,730,209,612　円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額　（平成29年1月20日現在）

13,756　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29年1月20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
2016/12/20	13,912.64	0.25%	14,010	0.26%	0.01%	2,526,698	35,397,925,986
2016/12/21	13,850.89	-0.44%	13,946	-0.46%	-0.01%	2,430,708	33,898,583,336
2016/12/22	13,841.55	-0.07%	13,935	-0.08%	-0.01%	2,333,186	32,513,946,309
2016/12/26	13,785.73	-0.40%	13,878	-0.41%	-0.01%	3,925,106	54,473,107,320
2016/12/27	13,775.68	-0.07%	13,868	-0.07%	0.00%	3,925,106	54,433,992,528
2016/12/28	13,780.50	0.03%	13,894	0.19%	0.15%	3,925,106	54,534,404,922
2016/12/29	13,622.00	-1.15%	13,732	-1.17%	-0.02%	3,925,106	53,898,005,627
2016/12/30	13,614.80	-0.05%	13,725	-0.05%	0.00%	3,925,106	53,873,373,959
2017/1/4	13,938.86	2.38%	14,053	2.39%	0.01%	3,925,106	55,159,331,101
2017/1/5	13,950.40	0.08%	14,062	0.06%	-0.02%	3,925,106	55,196,586,137
2017/1/6	13,928.49	-0.16%	14,040	-0.16%	0.00%	3,925,106	55,108,626,798
2017/1/10	13,816.61	-0.80%	13,827	-1.52%	-0.71%	3,925,106	54,271,399,129
2017/1/11	13,886.42	0.51%	13,896	0.50%	-0.01%	4,024,505	55,925,490,855
2017/1/12	13,743.96	-1.03%	13,753	-1.03%	-0.00%	4,024,505	55,350,907,929
2017/1/13	13,842.86	0.72%	13,852	0.72%	0.00%	4,123,920	57,126,224,780
2017/1/16	13,716.75	-0.91%	13,726	-0.91%	0.00%	4,123,920	56,604,210,117
2017/1/17	13,516.30	-1.46%	13,525	-1.46%	-0.00%	4,123,920	55,776,657,084
2017/1/18	13,563.75	0.35%	13,573	0.35%	0.00%	4,123,920	55,973,001,930
2017/1/19	13,695.53	0.97%	13,705	0.97%	0.00%	4,123,920	56,517,853,454
2017/1/20	13,747.11	0.38%	13,756	0.37%	-0.00%	4,123,920	56,730,209,612

交換にかかる交換口数

交換申込日（平成29年1月26日）、交換受付日（平成29年1月26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29年1月26日）、設定受付日（平成29年1月26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

[掲載番号：4]
各 位

平成29年1月23日

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　惠正
（コード番号　1484）
問合せ先　投資信託ﾃﾞｨｽｸﾛｰｼﾞｬｰ部 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29年1月20日現在）

49,331,263 口

2. 上場ETFの純資産総額 （平成29年1月20日現在）

67,989,909,205 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 （平成29年1月20日現在）

1,378.23 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29年1月20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
2016/12/20	1,388.84	0.33%	1,404.07	0.33%	-0.00%	53,242,840	74,756,881,897
2016/12/21	1,384.61	-0.30%	1,399.69	-0.31%	-0.01%	53,242,840	74,523,564,164
2016/12/22	1,385.13	0.04%	1,400.10	0.03%	-0.01%	51,746,665	72,450,416,435
2016/12/26	1,381.74	-0.24%	1,396.60	-0.25%	-0.01%	51,746,665	72,269,257,151
2016/12/27	1,379.92	-0.13%	1,394.80	-0.13%	0.00%	51,746,665	72,175,998,608
2016/12/28	1,378.39	-0.11%	1,396.58	0.13%	0.24%	51,746,665	72,268,135,004
2016/12/29	1,363.69	-1.07%	1,381.45	-1.08%	-0.02%	51,249,015	70,798,128,447
2016/12/30	1,364.03	0.02%	1,381.85	0.03%	0.00%	51,249,015	70,818,320,116
2017/1/4	1,393.36	2.15%	1,411.68	2.16%	0.01%	51,249,015	72,347,300,036
2017/1/5	1,395.10	0.12%	1,413.27	0.11%	-0.01%	51,249,015	72,428,914,157
2017/1/6	1,392.69	-0.17%	1,410.80	-0.17%	-0.00%	51,249,015	72,302,220,417
2017/1/10	1,383.15	-0.68%	1,387.67	-1.64%	-0.95%	51,249,015	71,116,790,341
2017/1/11	1,387.89	0.34%	1,392.42	0.34%	0.00%	49,331,263	68,689,672,054
2017/1/12	1,373.41	-1.04%	1,377.89	-1.04%	-0.00%	49,331,263	67,973,168,455
2017/1/13	1,385.55	0.88%	1,390.02	0.88%	-0.00%	49,331,263	68,571,640,015
2017/1/16	1,375.49	-0.73%	1,379.84	-0.73%	-0.01%	49,331,263	68,069,476,900
2017/1/17	1,354.86	-1.50%	1,359.14	-1.50%	-0.00%	49,331,263	67,048,262,878
2017/1/18	1,357.26	0.18%	1,361.60	0.18%	0.00%	49,331,263	67,169,265,558
2017/1/19	1,370.87	1.00%	1,375.29	1.01%	0.00%	49,331,263	67,844,581,485
2017/1/20	1,373.79	0.21%	1,378.23	0.21%	0.00%	49,331,263	67,989,909,205

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（「SPDJI」）、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SPDJI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SPDJIおよび委託会社に付与されています。当ファンドは、SPDJI、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29年1月26日）、交換受付日（平成29年1月26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29年1月26日）、設定受付日（平成29年1月26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