

平成29年1月26日

各 位

会社名 日興アセットマネジメント株式会社
(管理会社コード: 13084)
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場ETF (管理会社:日興アセットマネジメント)に関する日々の開示事項

日興アセットマネジメント株式会社を管理会社として上場するETF銘柄について、以下のとおり平成29年1月25日現在の状況をご報告します。

上場 ETF 銘柄 (24銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	上場インデックスファンド225	1330	東
2	上場インデックスファンドTOPIX	1308	東
3	上場インデックスファンドS&P日本新興株100	1314	東
4	上場インデックスファンド中国A株(パンダ)CSI300	1322	東
5	上場インデックスファンドJリート(東証REIT指数)隔月分配型	1345	東
6	上場インデックスファンドFTSE日本グリーンチップ35	1347	東
7	上場インデックスファンド海外債券(Citi WGBI)毎月分配型	1677	東
8	上場インデックスファンド海外先進国株式 (MSCI-KOKUSAI)	1680	東
9	上場インデックスファンド海外新興国株式 (MSCIエマージング)	1681	東
10	上場インデックスファンド日本高配当(東証配当フォーカス100)	1698	東
11	上場インデックスファンド米国株式 (S&P500)	1547	東
12	上場インデックスファンド中国H株(ハンセン中国企業株)	1548	東
13	上場インデックスファンドNifty50先物(インド株式)	1549	東
14	上場インデックスファンド世界株式 (MSCI ACWI) 除く日本	1554	東
15	上場インデックスファンド豪州リート(S&P/ASX200 A-REIT)	1555	東
16	上場インデックスファンド新興国債券	1566	東
17	上場インデックスファンド日経225(ミニ)	1578	東
18	上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financials	1586	東
19	上場インデックスファンドJPX日経インデックス400	1592	東
20	上場インデックスファンド日経レバレッジ指数	1358	東
21	上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティ	1399	東
22	上場インデックスファンド日本経済貢献株	1481	東
23	上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジなし)	1486	東
24	上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジあり)	1487	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いただくと、各銘柄の状況が表示されます。

以 上

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1330)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンド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25日現在)

102,931,697 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

2,017,883,340,220 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

19,604 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と日経225株価指数の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年1月25日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経225株価指数の終値}}{\text{前営業日の日経225株価指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:1]

上場インデックスファンド225 PCF (ユニット株式)

[2017/01/26 は設定交換申込不可日のため開示を行いません]

設定のお申込みに関しましては、お申し込み不可日であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される日については、受益証券の取得のお申込みを受付ける場合があります。

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1308)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンドTOPIX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25日現在)

1,179,402,802 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

1,822,804,384,501 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

1,545.53 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と東証株価指数の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年1月25日現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{東証株価指数の終値}}{\text{前営業日の東証株価指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:2]

上場インデックスファンドTOPIX PCF (ユニット株式)

[2017/01/26 は設定交換申込不可日のため開示を行いません]

設定のお申込みに関しましては、お申し込み不可日であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される日については、受益証券の取得のお申込みを受付ける場合があります。

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1314)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンドS&P日本新興株100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25日現在)

183,858 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

211,941,488 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

1,152.75 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とS&P日本新興株100指数の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年1月25日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{S\&P日本新興株100指数の終値}}{\text{前営業日のS\&P日本新興株100指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:3]

上場インデックスファンドS&P日本新興株100 PCF(ユニット株式)

[2017/01/26 申込分]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	1407	ウエストホールディングス	100
2	2121	ミクシィ	200
3	2146	UTグループ	100
4	2158	FRONTEO	100
5	2362	夢真ホールディングス	200
6	2370	メディネット	300
7	2489	アドウェイズ	100
8	2702	日本マクドナルドホールディングス	300
9	2782	セリア	100
10	2928	RIZAPグループ	100
11	3679	じげん	100
12	3773	アドバンスト・メディア	100
13	3782	ディー・ディー・エス	100
14	3857	ラック	100
15	3911	Aiming	100
16	4293	セブテーニ・ホールディングス	300
17	4563	アンジェス MG	200
18	4564	オンコセラピー・サイエンス	500
19	4565	そーせいグループ	100
20	4571	ナノキャリア	100
21	4576	デ・ウエスタン・セラピテクス研究所	100
22	4582	シンバイオ製薬	100
23	4583	カイオム・バイオサイエンス	100
24	4592	サンバイオ	100
25	4594	グリーンペプタイド	100
26	4813	ACCESS	100
27	4842	USEN	300
28	4849	エン・ジャパン	100
29	4978	リプロセル	200
30	6079	エナリス	100
31	6145	日特エンジニアリング	100
32	6312	フロイント産業	100
33	6324	ハーモニック・ドライブ・システムズ	100
34	6425	ユニバーサルエンターテインメント	100
35	6736	サン電子	100
36	6890	フェローテック	100
37	7636	ハンズマン	100
38	7716	ナカニシ	100
39	7774	ジャパン・ティッシュ・エンジニアリング	100
40	7777	スリー・ディー・マトリックス	100
41	7779	CYBERDYNE	200
42	8739	スパークス・グループ	300
43	8789	フィンテック グローバル	500
44	8922	日本アセットマーケティング	500

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1322)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンド中国A株(パンダ)CSI300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25日現在)

472,220 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

2,476,134,796 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

5,244 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と円換算したCSI300指数の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年1月25日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したCSI300指数の終値}}{\text{前営業日の円換算したCSI300指数の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
 代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
 (コード番号 1345)
 問合せ先 事務管理部 杉 翠
 (TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンドリート(東証REIT指数)隔月分配型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25日現在)

71,784,096 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

132,690,277,063 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

1,848.46 円

4. 上場ETF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29年1月25日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{東証REIT指数の終値}}{\text{前営業日の東証REIT指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:5]

上場インデックスファンドJリート PCF (ユニット投資口)

[2017/01/26 申込分]

NO.	銘柄コード	銘柄名	投資口数
1	3226	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	8
2	3227	MCUBS MidCity投資法人 投資証券	5
3	3234	森ヒルズリート投資法人 投資証券	31
4	3249	産業ファンド投資法人 投資証券	6
5	3269	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	24
6	3278	ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	6
7	3279	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	12
8	3281	GLP投資法人 投資証券	50
9	3282	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	9
10	3283	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	33
11	3287	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	3
12	3290	SIA不動産投資法人 投資証券	2
13	3292	イオンリート投資法人 投資証券	23
14	3295	ヒューリックリート投資法人 投資証券	18
15	3296	日本リート投資法人 投資証券	7
16	3298	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	14
17	3308	日本ヘルスケア投資法人 投資証券	1
18	3309	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	16
19	3451	トーセイ・リート投資法人 投資証券	3
20	3453	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	7
21	3455	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	2
22	3459	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	5
23	3460	ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	1
24	3462	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	73
25	3463	いちごホテルリート投資法人 投資証券	4
26	3466	ラサールロジポート投資法人 投資証券	19
27	3468	スターアジア不動産投資法人 投資証券	6
28	3470	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	2
29	3471	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	4
30	3472	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	3
31	3473	さくら総合リート投資法人 投資証券	6
32	8951	日本ビルファンド投資法人 投資証券	25
33	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	23
34	8953	日本リテールファンド投資法人 投資証券	45
35	8954	オリックス不動産投資法人 投資証券	44
36	8955	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	16
37	8956	プレミア投資法人 投資証券	23
38	8957	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	17
39	8958	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	3
40	8960	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	53
41	8961	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	23
42	8963	インヴィンシブル投資法人 投資証券	64
43	8964	フロンティア不動産投資法人 投資証券	9
44	8966	平和不動産リート投資法人 投資証券	18
45	8967	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	15
46	8968	福岡リート投資法人 投資証券	13
47	8972	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	7
48	8973	積水ハウス・SI レジデンシャル投資法人 投資証券	19
49	8975	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	27
50	8976	大和証券オフィス投資法人 投資証券	9
51	8977	阪急リート投資法人 投資証券	10

52	8979	スターツプロシード投資法人 投資証券	4
53	8984	大和ハウスリート投資法人 投資証券	26
54	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	66
55	8986	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	28
56	8987	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	23

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1347)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンドFTSE日本グリーンチップ35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25日現在)

77,477 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

366,403,770 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

4,729.19 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とFTSE日本グリーンチップ35指数の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年1月25日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{FTSE日本グリーンチップ35指数の終値}}{\text{前営業日のFTSE日本グリーンチップ35指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:6]

上場インデックスファンドFTSE日本グリーンチップ35 PCF(ユニット株式)

[2017/01/26 申込分]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	3402	東レ	9,000
2	3407	旭化成	8,000
3	4004	昭和電工	800
4	4091	大陽日酸	900
5	4188	三菱ケミカルホールディングス	8,200
6	5012	東燃ゼネラル石油	2,000
7	5019	出光興産	600
8	5233	太平洋セメント	8,000
9	5333	日本碍子	1,700
10	5631	日本製鋼所	400
11	5714	DOWAホールディングス	1,000
12	5801	古河電気工業	400
13	5802	住友電気工業	4,700
14	6361	荏原製作所	600
15	6370	栗田工業	700
16	6501	日立製作所	29,000
17	6502	東芝	24,000
18	6503	三菱電機	12,300
19	6645	オムロン	1,200
20	6741	日本信号	400
21	6752	パナソニック	13,200
22	6753	シャープ	9,000
23	6758	ソニー	7,800
24	6902	デンソー	3,100
25	6923	スタンレー電気	900
26	6954	ファナック	1,200
27	6971	京セラ	1,900
28	6988	日東電工	1,000
29	7011	三菱重工業	20,000
30	7012	川崎重工業	9,000
31	7203	トヨタ自動車	4,300
32	7211	三菱自動車工業	3,900
33	7267	本田技研工業	8,700
34	7912	大日本印刷	4,000
35	9513	電源開発	1,100

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1677)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンド海外債券(Citi WGBI)毎月分配型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25日現在)

156,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

7,966,217,632 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

51,065 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年1月25日現在)

△ 0.02%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{WGBI指数の終値}}{\text{前営業日のWGBI指数の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1680)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンド海外先進国株式 (MSCI-KOKUSAI)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25日現在)

5,300,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

11,004,933,824 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

2,076.40 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
円換算したMSCI-KOKUSAIインデックスの終値の変動率に係る乖離率

(平成29年1月25日現在)

△ 0.25%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したMSCI-KOKUSAIインデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したMSCI-KOKUSAIインデックスの終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1681)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンド海外新興国株式 (MSCIエマージング)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25日現在)

4,700,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

6,167,801,249 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

1,312.30 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
円換算したMSCI-エマージング・マーケットインデックスの終値の変動率に係る乖離率

(平成29年1月25日現在)

△ 0.11%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したMSCI-エマージング・マーケットインデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したMSCI-エマージング・マーケットインデックスの終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1698)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンド日本高配当(東証配当フォーカス100)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25日現在)

7,735,621 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

13,118,782,978 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

1,695.89 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と東証配当フォーカス100指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成29年1月25日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{東証配当フォーカス100指数の終値}}{\text{前営業日の東証配当フォーカス100指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:10]

上場インデックスファンド日本高配当(東証配当フォーカス100) PCF(ユニット株式)

[2017/01/26 は設定交換申込不可日のため開示を行いません]

設定のお申込みに関しましては、お申し込み不可日であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される日については、受益証券の取得のお申込みを受付ける場合があります。

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1547)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンド米国株式 (S&P500)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25日現在)

2,600,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

7,210,824,577 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

2,773.39 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と円換算したS&P500指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成29年1月25日現在)

△ 0.10%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したS\&P500指数の終値}}{\text{前営業日の円換算したS\&P500指数の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1548)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンド中国H株(ハンセン中国企業株)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25日現在)

400,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

462,817,223 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

1,157.04 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
円換算したハンセン中国企業株指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成29年1月25日現在)

△ 0.02%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したハンセン中国企業株指数の終値}}{\text{前営業日の円換算したハンセン中国企業株指数の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1549)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンドNifty50先物(インド株式)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25日現在)

800,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

1,023,010,520 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

1,278.76 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
円換算したNifty50指数先物の終値の変動率に係る乖離率

(平成29年1月25日現在)

△ 0.23%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したNifty50指数先物の終値}}{\text{前営業日の円換算したNifty50指数先物の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1554)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンド世界株式 (MSCI ACWI) 除く日本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25日現在)

2,200,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

3,904,984,870 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

1,774.99 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と

円換算したMSCI ACWI ex Japanインデックスの終値の変動率に係る乖離率

(平成29年1月25日現在)

△ 0.23%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したMSCI ACWI ex Japanインデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したMSCI ACWI ex Japanインデックスの終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1555)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンド豪州リート(S&P/ASX200 A-REIT)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25日現在)

3,000,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

4,683,572,727 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

1,561.19 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
円換算したS&P/ASX200 A-REIT指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成29年1月25日現在)

△ 0.02%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したS\&P/ASX200 A-REIT指数の終値}}{\text{前営業日の円換算したS\&P/ASX200 A-REIT指数の終値}} \right) \times 100$$

平成29年1月26日

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1566)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンド新興国債券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25日現在)

158,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

8,062,073,606 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

51,026 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と円換算したブルームバーグ・バークレイズ自国通貨建て新興市場国債・10%国キャップ・インデックスの終値の変動率に係る乖離率

(平成29年1月25日現在)

△ 0.27%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したブルームバーグ・バークレイズ自国通貨建て新興市場国債・10\%国キャップ・インデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したブルームバーグ・バークレイズ自国通貨建て新興市場国債・10\%国キャップ・インデックスの終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1578)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンド日経225(ミニ)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25日現在)

9,512,580 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

14,629,520,822 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

1,537.9 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と日経225株価指数の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年1月25日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経225株価指数の終値}}{\text{前営業日の日経225株価指数の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1586)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financials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25日現在)

4,481,369 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

5,754,054,418 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

1,284.0 円

4. 上場ETF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29年1月25日現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{TOPIX Ex-Financialsの終値}}{\text{前営業日のTOPIX Ex-Financialsの終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1592)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンドJPX日経インデックス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25日現在)

80,677,775 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

100,172,994,800 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

1,241.6 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の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年1月25日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{JPX日経インデックス 400の終値}}{\text{前営業日のJPX日経インデックス 400の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1358)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンド日経レバレッジ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25日現在)

187,647 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

2,561,321,033 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

13,650 円

4. 上場ETF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29年1月25日現在)

△ 0.38%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経平均レバレッジ・インデックスの終値}}{\text{前営業日の日経平均レバレッジ・インデックスの終値}} \right) \times 100$$

※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

・日経平均レバレッジ・インデックスは、前営業日に対する当該営業日の騰落率が、同期間の日経平均株価の騰落率の2倍となるよう計算されます。しかしながら、2営業日以上離れた期間における日経平均レバレッジ・インデックスの騰落率は、複利効果により、一般に日経平均株価の2倍とはならず、計算上、差が生じます。

・2営業日以上離れた期間における日経平均レバレッジ・インデックスの騰落率と日経平均株価の騰落率の2倍との差は、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。ただし一般に、一定のレンジ内で日経平均株価の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、日経平均レバレッジ・インデックスの指数値は減衰する可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差が大きくなる傾向があります。

※日経平均レバレッジ・インデックスと基準価額の主なカイ離要因

当ファンドは、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に一致させることをめざしますが、次のような要因があるため、同指数と一致した推移をすることをお約束できるものではありません。

・株価指数先物取引の値動きと日経平均株価の値動きが一致しないこと。また、投資対象とする上場インデックスファンド225などの上場投資信託証券の値動きと日経平均株価の値動きが一致しないこと。

・日々の追加設定・解約などに対応した株価指数先物取引や投資対象とする上場インデックスファンド225などの上場投資信託証券の約定価格と評価価格(終値)に差が生じること。

・日経平均株価の採用銘柄の変更や資本異動などによってポートフォリオの調整が行なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、信託報酬、売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。

・組入銘柄の配当金や有価証券の貸付による品貸料が発生すること。

※金融商品取引所で取引される市場価格と基準価額のカイ離

・当ファンドは東京証券取引所に上場され公に取引されますが、市場価格は、主に当ファンドの需要、当ファンドの運用成果および投資者が代替的な投資と比較して当ファンドが全般的にどの程度魅力的であるか、などの評価に左右されます。したがって、当ファンドの市場価格が、基準価額を下回って取引されるかまたは上回って取引されるかは予測することはできません。

平成29年1月26日

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1399)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティ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25日現在)

3,352,488 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

5,028,343,895 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

1,499.88 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とMSCIジャパンIMIカスタム高流動性高利回り
低ボラティリティ指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成29年1月25日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{MSCIジャパンIMIカスタム高流動性高利回り低ボラティリティ指数の終値}}{\text{前営業日のMSCIジャパンIMIカスタム高流動性高利回り低ボラティリティ指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:21]

上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティ PCF (ユニット株式)

[2017/01/26 申込分]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	1721	コムシスホールディングス	500
2	1801	大成建設	1,000
3	1878	大東建託	100
4	1911	住友林業	600
5	1925	大和ハウス工業	300
6	1928	積水ハウス	500
7	1959	九電工	300
8	2503	キリンホールディングス	500
9	2651	ローソン	100
10	2670	エービーシー・マート	100
11	2685	アダストリア	100
12	2768	双日	1,200
13	2914	日本たばこ産業	200
14	3105	日清紡ホールディングス	100
15	3231	野村不動産ホールディングス	400
16	3291	飯田グループホールディングス	300
17	3382	セブン&アイ・ホールディングス	200
18	3401	帝人	400
19	3405	クラレ	600
20	3407	旭化成	1,000
21	3861	王子ホールディングス	1,000
22	3863	日本製紙	500
23	4004	昭和電工	500
24	4061	デンカ	1,000
25	4062	イビデン	200
26	4114	日本触媒	100
27	4185	JSR	500
28	4204	積水化学工業	600
29	4208	宇部興産	3,000
30	4217	日立化成	300
31	4307	野村総合研究所	300
32	4502	武田薬品工業	200
33	4503	アステラス製薬	600
34	4508	田辺三菱製薬	400
35	4521	科研製薬	100
36	4523	エーザイ	100
37	4540	ツムラ	300
38	4544	みらかホールディングス	200
39	4555	沢井製薬	100
40	4568	第一三共	400
41	4578	大塚ホールディングス	200
42	4631	DIC	100
43	4681	リゾートトラスト	200
44	4689	ヤフー	2,200
45	4704	トレンドマイクロ	200
46	4739	伊藤忠テクノソリューションズ	300
47	4768	大塚商会	200
48	4902	ユニカミノルタ	100
49	4927	ポーラ・オルビスホールディングス	100
50	5002	昭和シェル石油	900
51	5012	東燃ゼネラル石油	1,000

52	5019	出光興産	400
53	5020	JXホールディングス	2,100
54	5108	ブリヂストン	200
55	5110	住友ゴム工業	400
56	5201	旭硝子	1,000
57	5214	日本電気硝子	1,000
58	5232	住友大阪セメント	2,000
59	5802	住友電気工業	400
60	5938	LIXILグループ	300
61	5991	日本発條	300
62	6113	アマダホールディングス	700
63	6136	オーエスジー	300
64	6146	ディスコ	100
65	6301	小松製作所	400
66	6361	荏原製作所	300
67	6370	栗田工業	400
68	6417	SANKYO	300
69	6460	セガサミーホールディングス	600
70	6481	THK	200
71	6701	日本電気	2,000
72	6724	セイコーエプソン	300
73	6752	パナソニック	300
74	7201	日産自動車	700
75	7202	いすゞ自動車	300
76	7203	トヨタ自動車	100
77	7211	三菱自動車工業	400
78	7259	アイシン精機	200
79	7267	本田技研工業	100
80	7270	富士重工業	100
81	7282	豊田合成	100
82	7606	ユナイテッドアローズ	100
83	7751	キヤノン	300
84	7752	リコー	600
85	7762	シチズン時計	500
86	7911	凸版印刷	1,000
87	7912	大日本印刷	1,000
88	8001	伊藤忠商事	400
89	8002	丸紅	400
90	8015	豊田通商	300
91	8031	三井物産	600
92	8035	東京エレクトロン	100
93	8053	住友商事	700
94	8058	三菱商事	200
95	8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	200
96	8252	丸井グループ	300
97	8267	イオン	600
98	8282	ケーズホールディングス	500
99	8848	レオパレス21	1,300
100	8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	1,000
101	9021	西日本旅客鉄道	100
102	9062	日本通運	2,000
103	9201	日本航空	300
104	9202	ANAホールディングス	3,000
105	9432	日本電信電話	200
106	9433	KDDI	300
107	9435	光通信	100
108	9437	NTTドコモ	400
109	9502	中部電力	600
110	9504	中国電力	800
111	9506	東北電力	700

112	9507	四国電力	400
113	9513	電源開発	300
114	9531	東京瓦斯	2,000
115	9532	大阪瓦斯	2,000
116	9697	カプコン	200
117	9719	SCSK	200
118	9831	ヤマダ電機	1,600

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1481)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンド日本経済貢献株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25日現在)

2,226,060 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

3,064,797,066 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

1,376.8 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25日現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

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

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1486)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジなし)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25日現在)

50,800 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

1,059,852,159 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

20,863 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とS&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て)の
終値の変動率に係る乖離率

(平成29年1月25日現在)

△ 0.15%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{S\&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て)の終値}}{\text{前営業日のS\&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て)の終値}} \right) \times 100$$

平成29年1月26日

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 柴田 拓美
(コード番号 1487)
問合せ先 事務管理部 杉 翠
(TEL 03 - 6447 - 6483)

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジあり)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25日現在)

872,500 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年1月25日現在)

16,139,373,933 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年1月25日現在)

18,498 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とS&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て、円ヘッジ)の
終値の変動率に係る乖離率

(平成29年1月25日現在)

△ 0.15%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{S\&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て、円ヘッジ)の終値}}{\text{前営業日のS\&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て、円ヘッジ)の終値}} \right) \times 100$$