

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 中田 眞帆
 (TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在の状況をご報告します。

上場 ETF 銘柄 (25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
25	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(β ヘッジ)	1490	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。

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 中田 眞帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

109,990,573 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

2,219,584,721,331 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

20,180 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3月14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)

[2017/03/15 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 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

1,268,352,120 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

2,029,751,250,036 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

1,600.31 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3月14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)

[2017/03/15 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 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

164,157 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

200,971,797 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

1,224.27 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3月14日現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

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

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)

[2017/03/15 申込分]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	2121	ミクシィ	200
2	2146	UTグループ	100
3	2158	FRONTEO	100
4	2362	夢真ホールディングス	100
5	2370	メディネット	300
6	2489	アドウェイズ	100
7	2702	日本マクドナルドホールディングス	200
8	2782	セリア	100
9	2928	RIZAPグループ	100
10	3679	じげん	100
11	3782	ディー・ディー・エス	100
12	3857	ラック	100
13	3911	Aiming	100
14	4293	セブテーニ・ホールディングス	300
15	4563	アンジェス MG	200
16	4564	オンコセラピー・サイエンス	400
17	4565	そーせいグループ	100
18	4571	ナノキャリア	100
19	4576	デ・ウエスタン・セラピテクス研究所	100
20	4582	シンバイオ製薬	100
21	4583	カイオム・バイオサイエンス	100
22	4592	サンバイオ	100
23	4594	グリーンペプタイド	100
24	4813	ACCESS	100
25	4842	USEN	300
26	4849	エン・ジャパン	100
27	4978	リプロセル	200
28	6079	エナリス	100
29	6145	日特エンジニアリング	100
30	6324	ハーモニック・ドライブ・システムズ	100
31	6425	ユニバーサルエンターテインメント	100
32	6736	サン電子	100
33	6890	フェローテック	100
34	7716	ナカニシ	100
35	7774	ジャパン・ティッシュ・エンジニアリング	100
36	7777	スリー・ディー・マトリックス	100
37	7779	CYBERDYNE	200
38	8739	スパークス・グループ	300
39	8789	フィンテック グローバル	500
40	8922	日本アセットマーケティング	400

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 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

472,220 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

2,545,198,068 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

5,390 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3月14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 中田 眞帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

74,377,076 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

133,430,475,010 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

1,793.97 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3月14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)

[2017/03/15 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	29
4	3249	産業ファンド投資法人 投資証券	7
5	3269	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	23
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	11
8	3281	GLP投資法人 投資証券	47
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	31
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	3
13	3292	イオンリート投資法人 投資証券	25
14	3295	ヒューリックリート投資法人 投資証券	17
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	15
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	3
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	72
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	5
28	3470	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	1
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	3476	投資法人みらい 投資証券	3
33	8951	日本ビルファンド投資法人 投資証券	24
34	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	23
35	8953	日本リテールファンド投資法人 投資証券	47
36	8954	オリックス不動産投資法人 投資証券	47
37	8955	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	16
38	8956	プレミア投資法人 投資証券	23
39	8957	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	17
40	8958	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	3
41	8960	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	53
42	8961	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	21
43	8963	インヴェンシブル投資法人 投資証券	62
44	8964	フロンティア不動産投資法人 投資証券	8
45	8966	平和不動産リート投資法人 投資証券	17
46	8967	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	15
47	8968	福岡リート投資法人 投資証券	13
48	8972	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	7
49	8973	積水ハウス・SI レジデンシャル投資法人 投資証券	19
50	8975	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	24
51	8976	大和証券オフィス投資法人 投資証券	7

52	8977	阪急リート投資法人 投資証券	10
53	8979	スターツプロシード投資法人 投資証券	4
54	8984	大和ハウスリート投資法人 投資証券	25
55	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	66
56	8986	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	28
57	8987	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	22

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 中田 眞帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

41,356 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

201,164,254 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

4,864.21 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3月14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)

[2017/03/15 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	8,100
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	1,600
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	4,600
14	6361	荏原製作所	600
15	6370	栗田工業	700
16	6501	日立製作所	28,000
17	6502	東芝	23,000
18	6503	三菱電機	12,100
19	6645	オムロン	1,200
20	6741	日本信号	400
21	6752	パナソニック	13,100
22	6753	シャープ	9,000
23	6758	ソニー	7,700
24	6902	デンソー	3,000
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	900
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	3,800
33	7267	本田技研工業	8,600
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 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

188,800 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

9,569,508,706 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

50,686 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3月14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 中田 眞帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

5,200,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

11,316,692,125 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

2,176.29 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3月14日現在)

△ 0.07%

(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 中田 眞帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

4,600,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

6,294,563,784 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

1,368.38 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3月14日現在)

0.14%

(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 中田 眞帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

10,399,321 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

18,448,956,719 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

1,774.05 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3月14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)

[2017/03/15 申込分]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	1414	ショーボンドホールディングス	100
2	1878	大東建託	100
3	1925	大和ハウス工業	800
4	2428	ウェルネット	100
5	2461	ファンコミュニケーションズ	200
6	2503	麒麟ホールディングス	4,700
7	2914	日本たばこ産業	6,100
8	3003	ヒューリック	2,000
9	3197	すかいらーく	400
10	3405	クラレ	1,600
11	3453	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	4
12	3673	ブロードリーフ	200
13	4004	昭和電工	600
14	4005	住友化学	2,000
15	4045	東亜合成	600
16	4151	協和発酵キリン	1,200
17	4185	JSR	200
18	4324	電通	1,100
19	4452	花王	2,500
20	4502	武田薬品工業	900
21	4519	中外製薬	1,000
22	4568	第一三共	700
23	4578	大塚ホールディングス	2,000
24	4631	DIC	400
25	4704	トレンドマイクロ	500
26	4732	ユー・エス・エス	300
27	4768	大塚商会	200
28	4812	電通国際情報サービス	100
29	4902	コニカミノルタ	500
30	4927	ポーラ・オルビスホールディングス	100
31	4985	アース製薬	100
32	5002	昭和シェル石油	900
33	5020	JXホールディングス	2,400
34	5101	横浜ゴム	600
35	5105	東洋ゴム工業	600
36	5108	ブリヂストン	3,500
37	5110	住友ゴム工業	1,000
38	5201	旭硝子	5,000
39	5214	日本電気硝子	2,000
40	5959	岡部	200
41	6028	テクノプロ・ホールディングス	200
42	6113	アマダホールディングス	300
43	6141	DMG森精機	500
44	6178	日本郵政	600
45	6268	ナブテスコ	500
46	6326	クボタ	4,400
47	6464	ツバキ・ナカシマ	100
48	6471	日本精工	400
49	6592	マブチモーター	300
50	6915	千代田インテグレ	100
51	7167	めぶきフィナンシャルグループ	1,100

52	7182	ゆうちょ銀行	600
53	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,400
54	7201	日産自動車	2,700
55	7203	トヨタ自動車	2,800
56	7267	本田技研工業	2,000
57	7270	富士重工業	700
58	7272	ヤマハ発動機	1,400
59	7739	キヤノン電子	100
60	7740	タムロン	100
61	7751	キヤノン	5,000
62	7752	リコー	600
63	7912	大日本印刷	1,000
64	8001	伊藤忠商事	1,600
65	8002	丸紅	2,100
66	8031	三井物産	1,900
67	8035	東京エレクトロン	100
68	8053	住友商事	1,300
69	8060	キヤノンマーケティングジャパン	300
70	8304	あおぞら銀行	1,000
71	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	16,400
72	8308	りそなホールディングス	2,600
73	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	500
74	8316	三井住友フィナンシャルグループ	1,700
75	8411	みずほフィナンシャルグループ	29,600
76	8591	オリックス	1,700
77	8601	大和証券グループ本社	2,000
78	8604	野村ホールディングス	4,300
79	8697	日本取引所グループ	700
80	8725	MS&ADインシュアランスグループホール	600
81	8766	東京海上ホールディングス	900
82	8804	東京建物	1,100
83	8951	日本ビルファンド投資法人 投資証券	12
84	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	14
85	8961	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	14
86	8963	インヴィンシブル投資法人 投資証券	30
87	8964	フロンティア不動産投資法人 投資証券	4
88	8973	積水ハウス・SI レジデンシャル投資法人 投資	12
89	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	31
90	8986	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	16
91	8987	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	11
92	9201	日本航空	400
93	9432	日本電信電話	1,700
94	9433	KDDI	2,100
95	9437	NTTドコモ	1,600
96	9504	中国電力	300
97	9513	電源開発	200
98	9747	アサツー ディ・ケイ	200
99	9830	トラスコ中山	200
100	9831	ヤマダ電機	700

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 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

2,600,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

7,605,874,054 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

2,925.34 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3月14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 中田 眞帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

300,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

367,613,703 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

1,225.38 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3月14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 中田 眞帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

800,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

1,110,132,006 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

1,387.67 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3月14日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

2,100,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

3,903,970,672 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

1,859.03 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3月14日現在)

△ 0.05%

(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 中田 眞帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

3,000,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

4,705,543,816 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

1,568.51 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3月14日現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

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

平成29年3月15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 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

166,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

8,607,886,497 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

51,855 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3月14日現在)

△ 0.24%

(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 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

9,475,580 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

15,000,780,978 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

1,583.1 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3月14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 中田 眞帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

4,481,369 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

5,937,187,588 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

1,324.9 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3月14日現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

84,601,920 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

108,639,679,579 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

1,284.1 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3月14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 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

185,647 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

2,675,706,897 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

14,413 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3月14日現在)

△ 0.03%

(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速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3月15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 中田 眞帆
 (TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

5,578,788 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

8,682,740,022 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

1,556.38 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3月14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)

[2017/03/15 申込分]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	1719	安藤・間	500
2	1721	コムシスホールディングス	500
3	1801	大成建設	1,000
4	1812	鹿島建設	1,000
5	1820	西松建設	2,000
6	1878	大東建託	100
7	1893	五洋建設	500
8	1925	大和ハウス工業	300
9	1928	積水ハウス	500
10	1959	九電工	300
11	1983	東芝プラントシステム	500
12	2371	カカクコム	600
13	2433	博報堂DYホールディングス	800
14	2503	麒麟ホールディングス	500
15	2607	不二製油グループ本社	400
16	2651	ローソン	100
17	2670	エービーシー・マート	100
18	2685	アダストリア	100
19	2768	双日	500
20	2784	アルフレッサ ホールディングス	500
21	2914	日本たばこ産業	300
22	3088	マツモトキヨシホールディングス	200
23	3101	東洋紡	3,000
24	3116	トヨタ紡織	100
25	3197	すかいらーく	600
26	3231	野村不動産ホールディングス	400
27	3291	飯田グループホールディングス	300
28	3382	セブン&アイ・ホールディングス	200
29	3401	帝人	400
30	3405	クラレ	600
31	3407	旭化成	1,000
32	3861	王子ホールディングス	1,000
33	3863	日本製紙	500
34	3941	レンゴー	1,000
35	4061	デンカ	1,000
36	4062	イビデン	100
37	4114	日本触媒	100
38	4185	JSR	500
39	4204	積水化学工業	500
40	4208	宇部興産	1,000
41	4307	野村総合研究所	300
42	4502	武田薬品工業	200
43	4503	アステラス製薬	600
44	4508	田辺三菱製薬	400
45	4521	科研製薬	100
46	4523	エーザイ	200
47	4541	日医工	100
48	4555	沢井製薬	200
49	4568	第一三共	400
50	4578	大塚ホールディングス	200
51	4666	パーク24	300

52	4681	リゾートトラスト	200
53	4704	トレンドマイクロ	200
54	4732	ユー・エス・エス	500
55	4768	大塚商会	200
56	4902	コニカミノルタ	100
57	4927	ポーラ・オルビスホールディングス	100
58	5002	昭和シェル石油	900
59	5012	東燃ゼネラル石油	1,000
60	5020	JXホールディングス	1,800
61	5108	ブリヂストン	200
62	5110	住友ゴム工業	400
63	5201	旭硝子	1,000
64	5214	日本電気硝子	1,000
65	5232	住友大阪セメント	2,000
66	5703	日本軽金属ホールディングス	400
67	5802	住友電気工業	100
68	5929	三和ホールディングス	400
69	5938	LIXILグループ	300
70	6113	アマダホールディングス	700
71	6136	オーエスジー	300
72	6146	ディスコ	100
73	6301	小松製作所	300
74	6361	荏原製作所	300
75	6370	栗田工業	400
76	6460	セガサミーホールディングス	500
77	6581	日立工機	100
78	6701	日本電気	2,000
79	6724	セイコーエプソン	200
80	6754	アンリツ	300
81	7201	日産自動車	400
82	7202	いすゞ自動車	100
83	7203	トヨタ自動車	100
84	7259	アイシン精機	200
85	7606	ユナイテッドアローズ	100
86	7751	キヤノン	300
87	7752	リコー	600
88	7762	シチズン時計	500
89	7911	凸版印刷	1,000
90	7912	大日本印刷	1,000
91	7951	ヤマハ	300
92	7988	ニフコ	100
93	8001	伊藤忠商事	400
94	8002	丸紅	400
95	8015	豊田通商	200
96	8031	三井物産	600
97	8035	東京エレクトロン	100
98	8053	住友商事	700
99	8058	三菱商事	200
100	8086	ニプロ	600
101	8252	丸井グループ	300
102	8267	イオン	600
103	8282	ケーズホールディングス	500
104	8848	レオパレス21	900
105	9021	西日本旅客鉄道	100
106	9062	日本通運	2,000
107	9201	日本航空	300
108	9202	ANAホールディングス	3,000
109	9432	日本電信電話	200
110	9433	KDDI	300
111	9435	光通信	100

112	9437	NTTドコモ	400
113	9502	中部電力	700
114	9504	中国電力	800
115	9505	北陸電力	800
116	9506	東北電力	700
117	9507	四国電力	400
118	9513	電源開発	300
119	9531	東京瓦斯	2,000
120	9532	大阪瓦斯	2,000
121	9697	カプコン	200
122	9719	SCSK	200
123	9735	セコム	100
124	9831	ヤマダ電機	1,700

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 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

2,236,060 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

3,169,934,664 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

1,417.6 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3月14日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

30,800 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

643,528,500 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

20,894 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3月14日現在)

0.04%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 中田 眞帆
 (TEL 03 - 6447 - 6271)

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3月14日現在)

892,500 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

16,342,587,960 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

18,311 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3月14日現在)

0.08%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 1490)
問合せ先 事務管理部 中田 真帆
(TEL 03 - 6447 - 6271)

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(β ヘッジ)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3月14日現在)

100,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月14日現在)

1,001,368,465 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月14日現在)

10,014 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
MSCIジャパンIMIカスタムロングショート戦略85%+円キャッシュ15%指数の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年3月14日現在)

0.17%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{MSCIジャパンIMIカスタムロングショート戦略85\%+円キャッシュ15\%指数の終値}}{\text{前営業日のMSCIジャパンIMIカスタムロングショート戦略85\%+円キャッシュ15\%指数の終値}} \right) \times 100$$

< 指数の特性 >

ベータヘッジを行なうことにより、指標の変動率が株式市場全体の変動率に対して中立的となることをめざしています。

< 原指数(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)との相違 >

原指数に比べて、株式市場全体の動きに影響されにくく、また、日々の値動きが小さくなる傾向があります。このため、原指数に比べて、利益・損失の額が小さくなる傾向があります。

< 留意すべき投資スタイル >

株式市場全体の下落による損失を軽減させる効果が期待できる反面、株式市場全体の上昇による収益機会も限定されることがあります。したがって、株式市場全体の値動きを捉えることをめざす投資家や、短期的な収益獲得をめざす投資家は、期待する投資成果が得られにくいいため、留意が必要です。

※当ファンドの詳細な内容については、以下の当社HPをご覧ください。

<http://www.nikkoam.com/products/etf/lineup/msci-jbeta>