

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31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( $\beta$ 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 真帆  
( 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31日現在)

114,540,113 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

2,244,053,968,778 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

19,592 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31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)

[ 2017/04/03 申込分 ]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
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
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	4578	大塚ホールディングス	2,000
64	4689	ヤフー	800
65	4704	トレンドマイクロ	2,000
66	4755	楽天	2,000
67	4901	富士フイルムホールディングス	2,000
68	4902	コニカミノルタ	2,000
69	4911	資生堂	2,000
70	5002	昭和シェル石油	2,000
71	5020	JXホールディングス	2,000
72	5101	横浜ゴム	1,000
73	5108	ブリヂストン	2,000
74	5201	旭硝子	2,000
75	5202	日本板硝子	200
76	5214	日本電気硝子	3,000
77	5232	住友大阪セメント	2,000
78	5233	太平洋セメント	2,000
79	5301	東海カーボン	2,000
80	5332	TOTO	1,000
81	5333	日本碍子	2,000
82	5401	新日鐵住金	200
83	5406	神戸製鋼所	200
84	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	200
85	5413	日新製鋼	200
86	5541	大平洋金属	2,000
87	5631	日本製鋼所	400
88	5703	日本軽金属ホールディングス	2,000
89	5706	三井金属鉱業	2,000
90	5707	東邦亜鉛	2,000
91	5711	三菱マテリアル	200
92	5713	住友金属鉱山	2,000
93	5714	DOWAホールディングス	2,000
94	5715	古河機械金属	2,000
95	5801	古河電気工業	200
96	5802	住友電気工業	2,000
97	5803	フジクラ	2,000
98	5901	東洋製罐グループホールディングス	2,000
99	6103	オークマ	2,000
100	6113	アマダホールディングス	2,000
101	6301	小松製作所	2,000
102	6302	住友重機械工業	2,000
103	6305	日立建機	2,000
104	6326	クボタ	2,000
105	6361	荏原製作所	400
106	6366	千代田化工建設	2,000
107	6367	ダイキン工業	2,000
108	6471	日本精工	2,000
109	6472	NTN	2,000
110	6473	ジェイテクト	2,000
111	6479	ミネベアミツミ	2,000

112	6501	日立製作所	2,000
113	6502	東芝	2,000
114	6503	三菱電機	2,000
115	6504	富士電機	2,000
116	6506	安川電機	2,000
117	6508	明電舎	2,000
118	6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	2,000
119	6701	日本電気	2,000
120	6702	富士通	2,000
121	6703	沖電気工業	200
122	6752	パナソニック	2,000
123	6758	ソニー	2,000
124	6762	TDK	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
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	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

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31日現在)

1,360,294,753 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

2,109,416,686,310 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

1,550.71 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31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)

[ 2017/04/03 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31日現在)

164,157 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

202,743,736 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

1,235.06 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31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)

[ 2017/04/03 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	2484	夢の街創造委員会	100
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	200
9	2782	セリア	100
10	2928	RIZAPグループ	100
11	3679	じげん	100
12	3782	ディー・ディー・エス	100
13	3857	ラック	100
14	3911	Aiming	100
15	4293	セブテーニ・ホールディングス	300
16	4563	アンジェス MG	200
17	4564	オンコセラピー・サイエンス	400
18	4565	そーせいグループ	100
19	4571	ナノキャリア	100
20	4576	デ・ウエスタン・セラピテクス研究所	100
21	4582	シンバイオ製薬	100
22	4583	カイオム・バイオサイエンス	100
23	4592	サンバイオ	100
24	4594	グリーンペプタイド	100
25	4813	ACCESS	100
26	4842	USEN	300
27	4849	エン・ジャパン	100
28	4978	リプロセル	200
29	6079	エナリス	100
30	6145	日特エンジニアリング	100
31	6324	ハーモニック・ドライブ・システムズ	100
32	6425	ユニバーサルエンターテインメント	100
33	6736	サン電子	100
34	6890	フェローテック	100
35	7716	ナカニシ	100
36	7774	ジャパン・ティッシュ・エンジニアリング	100
37	7777	スリー・ディー・マトリックス	100
38	7779	CYBERDYNE	200
39	8739	スパークス・グループ	300
40	8789	フィンテック グローバル	500
41	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 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31日現在)

472,220 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

2,479,958,460 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

5,252 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31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 中田 真帆  
 ( 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31日現在)

75,824,576 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

135,688,007,951 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

1,789.50 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31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)

[ 2017/04/03 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	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	11
8	3281	GLP投資法人 投資証券	46
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	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	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	3478	森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	5
34	8951	日本ビルファンド投資法人 投資証券	25
35	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	23
36	8953	日本リテールファンド投資法人 投資証券	48
37	8954	オリックス不動産投資法人 投資証券	48
38	8955	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	16
39	8956	プレミア投資法人 投資証券	23
40	8957	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	17
41	8958	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	3
42	8960	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	55
43	8961	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	20
44	8963	インヴェンシブル投資法人 投資証券	60
45	8964	フロンティア不動産投資法人 投資証券	9
46	8966	平和不動産リート投資法人 投資証券	16
47	8967	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	16
48	8968	福岡リート投資法人 投資証券	12
49	8972	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	7
50	8973	積水ハウス・SI レジデンシャル投資法人 投資証券	19
51	8975	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	22

52	8976	大和証券オフィス投資法人 投資証券	7
53	8977	阪急リート投資法人 投資証券	10
54	8979	スターツプロシード投資法人 投資証券	4
55	8984	大和ハウスリート投資法人 投資証券	27
56	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	67
57	8986	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	28
58	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31日現在)

41,356 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

197,353,591 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

4,772.07 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31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)

[ 2017/04/03 申込分 ]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	3402	東レ	8,900
2	3407	旭化成	7,000
3	4004	昭和電工	700
4	4091	大陽日酸	800
5	4188	三菱ケミカルホールディングス	7,700
6	5019	出光興産	600
7	5233	太平洋セメント	7,000
8	5333	日本碍子	1,600
9	5631	日本製鋼所	400
10	5714	DOWAホールディングス	1,000
11	5801	古河電気工業	400
12	5802	住友電気工業	4,400
13	6361	荏原製作所	600
14	6370	栗田工業	700
15	6501	日立製作所	27,000
16	6502	東芝	22,000
17	6503	三菱電機	11,500
18	6645	オムロン	1,100
19	6741	日本信号	400
20	6752	パナソニック	12,400
21	6753	シャープ	8,000
22	6758	ソニー	7,300
23	6861	キーエンス	500
24	6902	デンソー	2,900
25	6923	スタンレー電気	900
26	6954	ファナック	1,100
27	6971	京セラ	1,800
28	6988	日東電工	900
29	7011	三菱重工業	17,000
30	7012	川崎重工業	8,000
31	7203	トヨタ自動車	4,400
32	7211	三菱自動車工業	3,700
33	7267	本田技研工業	8,000
34	7912	大日本印刷	4,000
35	9513	電源開発	1,000



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31日現在)

190,800 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

9,589,392,162 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

50,259 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31日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

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

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 真帆  
( 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31日現在)

5,200,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

11,111,515,587 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

2,136.83 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31日現在)

△ 0.13%

(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31日現在)

4,600,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

6,307,998,995 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

1,371.30 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3月31日現在)

△ 0.37%

(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 真帆  
( 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31日現在)

11,642,921 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

20,005,006,756 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

1,718.21 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31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)

[ 2017/04/03 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	400
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31日現在)

2,600,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

7,408,355,669 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

2,849.37 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31日現在)

0.03%

(参考) 乖離率の計算式

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

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31日現在)

300,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

362,145,886 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

1,207.15 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31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31日現在)

800,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

1,079,365,462 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

1,349.21 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31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31日現在)

2,100,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

3,842,229,139 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

1,829.63 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31日現在)

△ 0.16%

(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 真帆  
( 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31日現在)

3,000,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

4,915,401,028 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

1,638.47 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31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4月3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31日現在)

168,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

8,726,580,219 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

51,944 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31日現在)

△ 0.72%

(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31日現在)

9,475,580 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

14,563,774,566 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

1,537.0 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31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 真帆  
( 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31日現在)

4,481,369 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

5,787,704,708 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

1,291.5 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31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 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31日現在)

85,287,725 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

105,983,396,010 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

1,242.7 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31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31日現在)

185,647 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

2,519,640,083 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

13,572 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31日現在)

0.05%

(参考) 乖離率の計算式

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



#### ※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4月3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31日現在)

6,299,188 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

9,573,753,344 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

1,519.84 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31日現在)

0.02%

(参考) 乖離率の計算式

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

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)

[ 2017/04/03 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	400
58	5002	昭和シェル石油	900
59	5020	JXホールディングス	4,000
60	5108	ブリヂストン	200
61	5110	住友ゴム工業	400
62	5201	旭硝子	1,000
63	5214	日本電気硝子	1,000
64	5232	住友大阪セメント	2,000
65	5703	日本軽金属ホールディングス	400
66	5802	住友電気工業	100
67	5929	三和ホールディングス	300
68	5938	LIXILグループ	300
69	6113	アマダホールディングス	700
70	6136	オーエスジー	300
71	6146	ディスコ	100
72	6301	小松製作所	300
73	6361	荏原製作所	300
74	6370	栗田工業	400
75	6460	セガサミーホールディングス	500
76	6701	日本電気	2,000
77	6724	セイコーエプソン	200
78	6754	アンリツ	300
79	7201	日産自動車	400
80	7202	いすゞ自動車	100
81	7203	トヨタ自動車	100
82	7259	アイシン精機	200
83	7606	ユナイテッドアローズ	100
84	7751	キヤノン	300
85	7752	リコー	600
86	7762	シチズン時計	500
87	7911	凸版印刷	1,000
88	7912	大日本印刷	1,000
89	7951	ヤマハ	300
90	7988	ニフコ	100
91	8001	伊藤忠商事	400
92	8002	丸紅	400
93	8015	豊田通商	200
94	8031	三井物産	600
95	8035	東京エレクトロン	100
96	8053	住友商事	700
97	8058	三菱商事	200
98	8086	ニプロ	600
99	8252	丸井グループ	300
100	8267	イオン	600
101	8282	ケーズホールディングス	500
102	8848	レオパレス21	900
103	9021	西日本旅客鉄道	100
104	9062	日本通運	2,000
105	9201	日本航空	300
106	9202	ANAホールディングス	3,000
107	9432	日本電信電話	200
108	9433	KDDI	300
109	9435	光通信	100
110	9437	NTTドコモ	400
111	9502	中部電力	700

112	9504	中国電力	800
113	9505	北陸電力	800
114	9506	東北電力	700
115	9507	四国電力	400
116	9513	電源開発	300
117	9531	東京瓦斯	2,000
118	9532	大阪瓦斯	2,000
119	9697	カプコン	200
120	9719	SCSK	200
121	9735	セコム	100
122	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31日現在)

2,236,060 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

3,091,803,777 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

1,382.7 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31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 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31日現在)

50,800 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

1,053,081,993 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

20,730 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31日現在)

0.06%

(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4月3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 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31日現在)

908,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

16,875,292,386 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

18,585 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31日現在)

0.06%

(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( $\beta$ 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31日現在)

100,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年3月31日現在)

1,005,277,605 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年3月31日現在)

10,053 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31日現在)

0.13%

(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>