

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
(管理会社コード:13054)
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

上場ETF(管理会社:大和証券投資信託委託)に関する日々の開示事項 1/2

大和証券投資信託委託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8月24日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(18銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	ダイワ上場投信－日経225	1320	東
2	ダイワ上場投信－トピックス	1305	東
3	ダイワ上場投信－トピックス・コア30	1310	東
4	ダイワ上場投信－東証電気機器株価指数	1610	東
5	ダイワ上場投信－東証銀行業株価指数	1612	東
6	ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials	1585	東
7	ダイワ上場投信－JPX日経400	1599	東
8	ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス	1365	東
9	ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス	1366	東
10	ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数	1367	東
11	ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数	1368	東
12	ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス	1456	東
13	ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数	1457	東
14	ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス	1464	東
15	ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス	1465	東
16	ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス	1466	東
17	ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数	1479	東
18	ダイワ上場投信－東証REIT指数	1488	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、各銘柄の保有状況が表示されます。

以上

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1320)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信一日経225』に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信一日経225』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

106,792,868 口

2. 『ダイワ上場投信一日経225』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

2,106,701,940,003 円

3. 『ダイワ上場投信一日経225』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

19,727.0 円

4. 『ダイワ上場投信一日経225』の一口あたりの純資産額と
『日経平均株価』の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年8月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成29年8月25日 現在)

[掲載番号:1]

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成29年8月25日
追加設定日 = 平成29年8月31日

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1305)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信ートピックス』に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信ートピックス』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

1,553,981,492 口

2. 『ダイワ上場投信ートピックス』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

2,561,339,261,321 円

3. 『ダイワ上場投信ートピックス』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

1,648.24 円

4. 『ダイワ上場投信ートピックス』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8月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成29年8月25日 現在)

[掲載番号:2]

ダイワ上場投信ートピックス(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成29年8月25日
追加設定日 = 平成29年8月31日

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1310)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

4,089,874 口

2. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

2,900,179,762 円

3. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

709.112 円

4. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の一口あたりの純資産額と
『TOPIX Core30 指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年8月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成29年8月25日 現在)

[掲載番号:3]

ダイワ上場投信ートピックス・コア30(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成29年8月25日
追加設定日 = 平成29年8月31日

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1610)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

1,023,700 口

2. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

2,315,661,960 円

3. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

2,262.051 円

4. 『ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数』の一口あたりの純資産額と
『東証電気機器株価指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年8月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成29年8月25日 現在)

ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
単位 = 1 バasket	1	3105 日清紡ホールディングス	4,000	
銘柄数 = 157	2	4062 イビデン	5,100	
Basket提示日 = 平成29年8月25日	3	4902 コニカミノルタ	17,000	
追加設定日 = 平成29年8月31日	4	6448 ブラザー工業	8,800	
	5	6479 ミネベアミツミ	13,200	
※「○」で表示した銘柄は	6	6501 日立製作所	174,000	
現金拠出で対応する銘柄です。	7	6503 三菱電機	77,200	
	8	6504 富士電機	22,000	
	9	6505 東洋電機製造	300	
	10	6506 安川電機	8,400	
	11	6507 シンフォニア テクノロジー	5,000	
	12	6508 明電舎	7,000	
	13	6513 オリジン電気	1,000	
	14	6516 山洋電気	2,000	
	15	6517 デンヨー	700	
	16	6588 東芝テック	5,000	
	17	6590 芝浦メカトロニクス	1,000	
	18	6592 マブチモーター	2,000	
	19	6594 日本電産	9,400	
	20	6615 ユー・エム・シー・エレクトロニクス	200	
	21	6617 東光高岳	400	
	22	6619 ダブル・スコープ	1,100	
	23	6620 宮越ホールディングス	200	
	24	6622 ダイヘン	4,000	
	25	6624 田淵電機	1,100	
	26	6630 ヤーマン	100	
	27	6632 JVCケンウッド	5,300	
	28	6638 ミマキエンジニアリング	600	
	29	6640 第一精工	300	
	30	6641 日新電機	1,500	
	31	6644 大崎電気工業	1,400	
	32	6645 オムロン	7,700	
	33	6651 日東工業	1,100	
	34	6652 IDEC	800	
	35	6654 不二電機工業	100	
	36	6674 ジーエス・ユアサ コーポレーション	14,000	
	37	6675 サクサホールディングス	2,000	
	38	6676 メルコホールディングス	400	
	39	6678 テクノメディカ	200	
	40	6701 日本電気	100,000	
	41	6702 富士通	70,000	
	42	6703 沖電気工業	3,100	
	43	6704 岩崎通信機	3,000	
	44	6706 電気興業	2,000	
	45	6707 サンケン電気	4,000	
	46	6715 ナカヨ	1,000	
	47	6718 アイホン	400	
	48	6723 ルネサスエレクトロニクス	3,700	
	49	6724 セイコーエプソン	10,800	
	50	6727 ワコム	5,600	

ダイワ上場投信一東証電気機器株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
51	6728	アルバック	1,200	
52	6730	アクセル	300	
53	6737	EIZO	700	
54	6740	ジャパンディスプレイ	13,500	
55	6741	日本信号	2,000	
56	6742	京三製作所	2,000	
57	6744	能美防災	800	
58	6745	ホーチキ	500	
59	6750	エレコム	600	
60	6751	日本無線	400	
61	6752	パナソニック	83,200	
62	6754	アンリツ	5,300	
63	6755	富士通ゼネラル	2,500	
64	6756	日立国際電気	1,900	
65	6758	ソニー	51,200	
66	6762	TDK	4,100	
67	6763	帝国通信工業	2,000	
68	6768	タムラ製作所	3,000	
69	6770	アルプス電気	6,700	
70	6771	池上通信機	2,000	
71	6773	パイオニア	10,900	
72	6779	日本電波工業	700	
73	6785	鈴木	300	
74	6788	日本トリム	200	
75	6789	ローランド ディー. ジー.	400	
76	6794	フォスター電機	800	
77	6796	クラリオン	4,000	
78	6798	SMK	2,000	
79	6800	ヨコオ	500	
80	6803	ティアック	5,000	
81	6804	ホシデン	2,100	
82	6806	ヒロセ電機	1,200	
83	6807	日本航空電子工業	2,000	
84	6809	TOA	900	
85	6810	日立マクセル	1,100	
86	6814	古野電気	900	○
87	6815	ユニデンホールディングス	2,000	
88	6816	アルパイン	1,700	
89	6817	スミダコーポレーション	700	
90	6820	アイコム	400	
91	6823	リオン	300	
92	6826	本多通信工業	300	
93	6839	船井電機	800	
94	6841	横河電機	7,900	
95	6844	新電元工業	3,000	
96	6845	アズビル	2,200	
97	6848	東亜ディーケーケー	400	
98	6849	日本光電工業	3,000	
99	6850	チノー	200	
100	6853	共和電業	800	

ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
	101	6855 日本電子材料	300	
	102	6856 堀場製作所	1,400	
	103	6857 アドバンテスト	4,900	
	104	6858 小野測器	300	
	105	6859 エスペック	600	
	106	6861 キーエンス	3,300	
	107	6866 日置電機	400	
	108	6869 シスメックス	5,600	
	109	6871 日本マイクロニクス	1,300	
	110	6875 メガチップス	700	
	111	6877 OBARA GROUP	400	
	112	6905 コーセル	1,000	
	113	6908 イリソ電子工業	600	○
	114	6911 新日本無線	600	
	115	6914 オプテックスグループ	600	
	116	6915 千代田インテグレ	300	
	117	6916 アイ・オー・データ機器	300	
	118	6920 レーザーテック	1,600	
	119	6923 スタンレー電気	5,200	
	120	6924 岩崎電気	3,000	
	121	6925 ウシオ電機	4,400	
	122	6926 岡谷電機産業	400	
	123	6927 ヘリオス テクノ ホールディング	700	
	124	6929 日本セラミック	700	
	125	6932 遠藤照明	400	
	126	6937 古河電池	1,000	
	127	6938 双信電機	400	
	128	6941 山一電機	700	
	129	6947 図研	500	
	130	6951 日本電子	3,000	
	131	6952 カシオ計算機	5,800	
	132	6954 ファナック	7,300	
	133	6958 日本シイエムケイ	1,600	
	134	6961 エンプラス	300	
	135	6962 大真空	300	
	136	6963 ローム	3,500	
	137	6965 浜松ホトニクス	5,300	
	138	6966 三井ハイテック	1,000	
	139	6967 新光電気工業	2,700	
	140	6971 京セラ	11,900	
	141	6976 太陽誘電	3,500	
	142	6981 村田製作所	7,600	
	143	6985 ユーシン	1,000	
	144	6986 双葉電子工業	1,200	
	145	6989 北陸電気工業	3,000	
	146	6996 ニチコン	2,300	
	147	6997 日本ケミコン	6,000	
	148	6999 KOA	1,000	
	149	7244 市光工業	2,000	
	150	7276 小糸製作所	4,300	

[掲載番号:4]

ダイワ上場投信—東証電気機器株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
151	7280	ミツバ	1,300	
152	7735	SCREENホールディングス	1,500	
153	7739	キヤノン電子	700	
154	7751	キヤノン	39,000	
155	7752	リコー	21,800	
156	7999	MUTOHホールディングス	1,000	
157	8035	東京エレクトロン	4,800	

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1612)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

4,673,862 口

2. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

759,160,033 円

3. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

162.427 円

4. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の一口あたりの純資産額と
『東証銀行業株価指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年8月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成29年8月25日 現在)

ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バスケット	1	7161 じもとホールディングス	1,700
銘柄数 = 84	2	7167 めぶきフィナンシャルグループ	11,100
バスケット提示日 = 平成29年8月25日	3	7173 東京TYフィナンシャルグループ	300
追加設定日 = 平成29年8月31日	4	7180 九州フィナンシャルグループ	3,800
	5	7182 ゆうちょ銀行	6,500
	6	7184 富山第一銀行	600
	7	7186 コンコルディア・フィナンシャルグループ	14,900
	8	7189 西日本フィナンシャルホールディングス	1,600
	9	8303 新生銀行	22,000
	10	8304 あおぞら銀行	15,000
	11	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	172,800
	12	8308 りそなホールディングス	26,900
	13	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	4,800
	14	8316 三井住友フィナンシャルグループ	18,400
	15	8324 第四銀行	3,000
	16	8325 北越銀行	200
	17	8331 千葉銀行	9,000
	18	8334 群馬銀行	5,000
	19	8336 武蔵野銀行	400
	20	8337 千葉興業銀行	600
	21	8338 筑波銀行	1,000
	22	8341 七十七銀行	4,000
	23	8342 青森銀行	2,000
	24	8343 秋田銀行	1,000
	25	8344 山形銀行	1,000
	26	8345 岩手銀行	200
	27	8346 東邦銀行	2,100
	28	8349 東北銀行	1,000
	29	8350 みちのく銀行	1,000
	30	8354 ふくおかフィナンシャルグループ	9,000
	31	8355 静岡銀行	6,000
	32	8356 十六銀行	3,000
	33	8358 スルガ銀行	2,400
	34	8359 八十二銀行	4,400
	35	8360 山梨中央銀行	1,000
	36	8361 大垣共立銀行	4,000
	37	8362 福井銀行	2,000
	38	8363 北國銀行	2,000
	39	8364 清水銀行	100
	40	8366 滋賀銀行	2,000
	41	8367 南都銀行	300
	42	8368 百五銀行	2,000
	43	8369 京都銀行	4,000
	44	8370 紀陽銀行	900
	45	8374 三重銀行	100
	46	8377 ほくほくフィナンシャルグループ	1,500
	47	8379 広島銀行	7,000
	48	8381 山陰合同銀行	1,400
	49	8382 中国銀行	1,600
	50	8383 鳥取銀行	100

ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
51	8385	伊予銀行	3,300
52	8386	百十四銀行	2,000
53	8387	四国銀行	2,000
54	8388	阿波銀行	2,000
55	8392	大分銀行	1,000
56	8393	宮崎銀行	2,000
57	8395	佐賀銀行	1,000
58	8396	十八銀行	1,000
59	8397	沖縄銀行	200
60	8399	琉球銀行	500
61	8410	セブン銀行	8,600
62	8411	みずほフィナンシャルグループ	312,700
63	8416	高知銀行	1,000
64	8418	山口フィナンシャルグループ	2,000
65	8521	長野銀行	100
66	8522	名古屋銀行	200
67	8524	北洋銀行	3,800
68	8527	愛知銀行	100
69	8529	第三銀行	100
70	8530	中京銀行	100
71	8537	大光銀行	1,000
72	8541	愛媛銀行	300
73	8542	トマト銀行	100
74	8543	みなと銀行	200
75	8544	京葉銀行	2,000
76	8545	関西アーバン銀行	300
77	8550	栃木銀行	1,300
78	8551	北日本銀行	100
79	8558	東和銀行	4,000
80	8562	福島銀行	2,000
81	8563	大東銀行	1,000
82	8600	トモニホールディングス	1,900
83	8713	フィデアホールディングス	2,200
84	8714	池田泉州ホールディングス	2,400

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1585)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

5,414,903 口

2. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

6,667,138,724 円

3. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

1,231.257 円

4. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』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8月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成29年8月25日 現在)

[掲載番号:6]

ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials (設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成29年8月25日
追加設定日 = 平成29年8月31日

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1599)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

9,601,476 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

136,859,221,762 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

14,253.977 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』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8月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成29年8月25日 現在)

[掲載番号:7]

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成29年8月25日
追加設定日 = 平成29年8月31日

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1365)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

1,045,000 口

2. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

11,850,065,534 円

3. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

11,339.78 円

4. 『ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス』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8月24日 現在)

-0.20 %

●「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

対象指標とする「日経平均レバレッジ・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「2倍」の値動きになる指数で、「日経平均株価」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な正相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「日経平均株価」の変動率の「2倍」とはならず、計算上、差が生じます。こ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。一般に、「日経平均株価」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「日経平均レバレッジ・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率と日経平均レバレッジ・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、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と一致させることをお約束できるものではありません。

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1366)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

2,030,000 口

2. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

9,774,108,606 円

3. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

4,814.83 円

4. 『ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『日経平均ダブルインバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年8月24日 現在)

0.19 %

●「日経平均ダブルインバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「日経平均ダブルインバース・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「-2倍」(マイナス2倍)の値動きになる指数で、「日経平均株価」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上の計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「日経平均株価」の変動率の「-2倍」とはならず、計算上、差が生じます。こ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。一般に、「日経平均株価」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「日経平均ダブルインバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率と日経平均ダブルインバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率を日経平均ダブルインバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1367)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

150,000 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

1,818,451,806 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

12,123.01 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIXレバレッジ(2倍)指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年8月24日 現在)

-0.15 %

●「TOPIXレバレッジ(2倍)指数」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「TOPIXレバレッジ(2倍)指数」は原指標の「TOPIX」の変動率の「2倍」の値動きになる指数で、「TOPIX」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な正相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「TOPIX」の変動率の「2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「TOPIX」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。一般に、「TOPIX」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「TOPIXレバレッジ(2倍)指数」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とTOPIXレバレッジ(2倍)指数の変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、TOPIXの値動きとTOPIX先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をTOPIXレバレッジ(2倍)指数の変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1368)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

340,000 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

1,586,848,548 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

4,667.20 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIXダブルインバース(-2倍)指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年8月24日 現在)

0.14 %

●「TOPIXダブルインバース(-2倍)指数」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「TOPIXダブルインバース(-2倍)指数」は原指標の「TOPIX」の変動率の「-2倍」(マイナス2倍)の値動きになる指数で、「TOPIX」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「TOPIX」の変動率の「-2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「TOPIX」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。一般に、「TOPIX」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「TOPIXダブルインバース(-2倍)指数」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とTOPIXダブルインバース(-2倍)指数の変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、TOPIXの値動きとTOPIX先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をTOPIXダブルインバース(-2倍)指数の変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1456)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

1,109,002 口

2. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

9,550,029,305 円

3. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

8,611.37 円

4. 『ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『日経平均インバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年8月24日 現在)

0.10 %

●「日経平均インバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「日経平均インバース・インデックス」は原指標の「日経平均株価」の変動率の「-1倍」(マイナス1倍)の値動きになる指数で、「日経平均株価」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-1倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「日経平均株価」の変動率の「-1倍」とはならず、計算上、差が生じます。こ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。一般に、「日経平均株価」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。

【「日経平均インバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率と日経平均インバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、日経平均株価の値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率を日経平均インバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1457)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

593,000 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

5,037,808,447 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

8,495.46 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIXインバース(-1倍)指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年8月24日 現在)

0.07 %

●「TOPIXインバース(-1倍)指数」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「TOPIXインバース(-1倍)指数」は原指標の「TOPIX」の変動率の「-1倍」(マイナス1倍)の値動きになる指数で、「TOPIX」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-1倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「TOPIX」の変動率の「-1倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「TOPIX」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。一般に、「TOPIX」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。

【「TOPIXインバース(-1倍)指数」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とTOPIXインバース(-1倍)指数の変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、TOPIXの値動きと日経平均先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をTOPIXインバース(-1倍)指数の変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1464)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

70,000 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

652,766,051 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

9,325.23 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『JPX日経400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8月24日 現在)

-0.37 %

●「JPX日経400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

対象指標とする「JPX日経400レバレッジ・インデックス」は原指標の「JPX日経インデックス400」の変動率の「2倍」の値動きになる指数で、「JPX日経インデックス400」の1日の変化率（前日終値と当日終値とを比較して算出）を「2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な正相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「JPX日経インデックス400」の変動率の「2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「JPX日経インデックス400」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。一般に、「JPX日経インデックス400」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「JPX日経400レバレッジ・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とJPX日経400レバレッジ・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をJPX日経400レバレッジ・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1465)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

959,000 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

8,092,947,086 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

8,438.94 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『JPX日経400インバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年8月24日 現在)

0.18 %

●「JPX日経400インバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「JPX日経400インバース・インデックス」は原指標の「JPX日経インデックス400」の変動率の「-1倍」(マイナス1倍)の値動きになる指数で、「JPX日経インデックス400」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-1倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「JPX日経インデックス400」の変動率の「-1倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「JPX日経インデックス400」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。一般に、「JPX日経インデックス400」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。

【「JPX日経400インバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とJPX日経400インバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をJPX日経400インバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1466)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

67,900 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

437,898,699 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

6,449.17 円

4. 『ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の一口あたりの純資産額と
『JPX日経400ダブルインバース・インデックス』の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年8月24日 現在)

0.37 %

●「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点
対象指標とする「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」は原指標の「JPX日経インデックス400」の変動率の「-2倍」(マイナス2倍)の値動きになる指数で、「JPX日経インデックス400」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上
の計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「JPX日経インデックス400」の変動率の「-2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「JPX日経インデックス400」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が、一般に、「JPX日経インデックス400」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逡減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逡減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】
ファンドの基準価額の変動率とJPX日経400ダブルインバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をJPX日経400ダブルインバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1479)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

4,335,657 口

2. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

80,294,722,436 円

3. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

18,519.62 円

4. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数』の一口あたりの純資産額と
『MSCI日本株人材設備投資指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成29年8月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成29年8月25日 現在)

ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
単位 = 1 バスケット	1	1878 大東建託	600	
銘柄数 = 150	2	1925 大和ハウス工業	5,700	
バスケット提示日 = 平成29年8月25日	3	2002 日清製粉グループ本社	700	
追加設定日 = 平成29年8月31日	4	2121 ミクシィ	200	
	5	2212 山崎製パン	600	
※「○」で表示した銘柄は	6	2229 カルビー	1,000	
現金拠出で対応する銘柄です。	7	2331 総合警備保障	500	
	8	2371 カカコム	1,600	
	9	2413 エムスリー	2,800	
	10	2503 キリンホールディングス	4,700	
	11	2587 サントリー食品インターナショナル	1,000	
	12	2702 日本マクドナルドホールディングス	200	
	13	2801 キッコーマン	900	
	14	2802 味の素	2,500	
	15	2875 東洋水産	700	
	16	2897 日清食品ホールディングス	300	
	17	3003 ヒューリック	1,300	
	18	3231 野村不動産ホールディングス	500	
	19	3289 東急不動産ホールディングス	1,500	
	20	3401 帝人	400	
	21	3402 東レ	6,900	
	22	3405 クラレ	1,400	
	23	3407 旭化成	10,000	
	24	4005 住友化学	3,000	
	25	4063 信越化学工業	1,700	
	26	4091 大陽日酸	600	
	27	4118 カネカ	1,000	
	28	4151 協和発酵キリン	1,300	
	29	4182 三菱瓦斯化学	600	
	30	4183 三井化学	3,000	
	31	4185 JSR	1,000	
	32	4188 三菱ケミカルホールディングス	9,400	
	33	4204 積水化学工業	1,900	
	34	4217 日立化成	1,000	
	35	4307 野村総合研究所	1,100	
	36	4324 電通	1,500	
	37	4452 花王	6,200	
	38	4502 武田薬品工業	5,100	
	39	4503 アステラス製薬	30,000	
	40	4507 塩野義製薬	2,900	
	41	4508 田辺三菱製薬	1,100	
	42	4519 中外製薬	1,600	
	43	4523 エーザイ	2,100	
	44	4528 小野薬品工業	2,300	
	45	4543 テルモ	1,400	
	46	4544 みらかホールディングス	700	
	47	4578 大塚ホールディングス	1,700	
	48	4689 ヤフー	15,600	
	49	4704 トレンドマイクロ	1,100	
	50	4755 楽天	4,800	

ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
51	4901	富士フイルムホールディングス	1,900	
52	4902	コニカミノルタ	2,200	
53	4911	資生堂	2,100	
54	5020	JXTGホールディングス	8,300	
55	5101	横浜ゴム	400	
56	5108	ブリヂストン	7,300	
57	5233	太平洋セメント	9,000	
58	5332	TOTO	600	
59	5333	日本碍子	800	
60	5334	日本特殊陶業	1,200	
61	5401	新日鐵住金	1,000	
62	5406	神戸製鋼所	600	
63	5713	住友金属鉱山	1,000	
64	5802	住友電気工業	3,500	
65	5901	東洋製罐グループホールディングス	300	
66	5938	LIXILグループ	900	
67	6098	リクルートホールディングス	8,800	
68	6146	ディスコ	200	
69	6201	豊田自動織機	600	
70	6301	小松製作所	4,300	
71	6305	日立建機	500	
72	6326	クボタ	6,900	
73	6367	ダイキン工業	1,600	
74	6448	ブラザー工業	900	
75	6460	セガサミーホールディングス	800	
76	6473	ジェイテクト	900	
77	6479	ミネベアミツミ	1,100	
78	6481	THK	700	
79	6501	日立製作所	30,000	
80	6594	日本電産	1,000	
81	6645	オムロン	1,600	
82	6701	日本電気	15,000	
83	6724	セイコーエプソン	600	
84	6752	パナソニック	14,900	
85	6841	横河電機	1,500	
86	6869	シスメックス	2,000	
87	6902	デンソー	2,200	
88	6923	スタンレー電気	600	
89	6952	カシオ計算機	1,200	
90	6963	ローム	200	
91	6971	京セラ	1,500	
92	6981	村田製作所	1,200	
93	6988	日東電工	1,200	
94	7011	三菱重工業	11,000	
95	7013	IHI	7,000	
96	7203	トヨタ自動車	7,200	
97	7205	日野自動車	1,500	
98	7259	アイシン精機	1,200	
99	7261	マツダ	1,700	
100	7276	小糸製作所	700	

ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
	101	7282 豊田合成	300	
	102	7309 シマノ	500	
	103	7731 ニコン	1,300	
	104	7733 オリンパス	1,200	
	105	7751 キヤノン	5,900	
	106	7752 リコー	2,600	
	107	7911 凸版印刷	2,000	
	108	7912 大日本印刷	2,000	
	109	7936 アシックス	900	
	110	8015 豊田通商	600	
	111	8035 東京エレクトロン	600	
	112	8113 ユニ・チャーム	3,200	
	113	8252 丸井グループ	600	
	114	8267 イオン	2,000	○
	115	8304 あおぞら銀行	5,000	
	116	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	35,800	
	117	8308 りそなホールディングス	10,800	
	118	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	900	
	119	8316 三井住友フィナンシャルグループ	3,200	
	120	8358 スルガ銀行	1,500	
	121	8410 セブン銀行	5,600	
	122	8411 みずほフィナンシャルグループ	114,900	
	123	8570 イオンフィナンシャルサービス	400	
	124	8591 オリックス	7,500	
	125	8601 大和証券グループ本社	4,000	
	126	8604 野村ホールディングス	7,700	
	127	8697 日本取引所グループ	9,200	
	128	8729 ソニーフィナンシャルホールディングス	1,000	
	129	8795 T&Dホールディングス	3,000	
	130	8801 三井不動産	4,000	
	131	8802 三菱地所	3,500	
	132	8905 イオンモール	700	○
	133	9005 東京急行電鉄	2,900	
	134	9021 西日本旅客鉄道	800	
	135	9045 京阪ホールディングス	2,000	
	136	9101 日本郵船	4,000	
	137	9202 ANAホールディングス	5,000	
	138	9432 日本電信電話	2,700	
	139	9433 KDDI	17,900	
	140	9437 NTTドコモ	11,600	
	141	9502 中部電力	1,800	
	142	9506 東北電力	1,000	
	143	9508 九州電力	1,800	
	144	9531 東京瓦斯	8,000	
	145	9532 大阪瓦斯	10,000	
	146	9533 東邦瓦斯	2,000	
	147	9602 東宝	700	○
	148	9613 エヌ・ティ・ティ・データ	3,000	
	149	9783 ベネッセホールディングス	200	
	150	9984 ソフトバンクグループ	2,700	

平成29年8月25日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 岩 本 信 之
(コード番号 1488)
問合せ先 経営企画部 近 藤 龍 一 郎
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信－東証REIT指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の上場受益権口数
(平成29年8月24日 現在)

19,394,144 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の純資産総額
(平成29年8月24日 現在)

33,674,949,344 円

3. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の一口あたりの純資産額
(平成29年8月24日 現在)

1,736.346 円

4. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』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8月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成29年8月25日 現在)

[掲載番号:18]

ダイワ上場投信－東証REIT指数(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 平成29年8月25日
追加設定日 = 平成29年8月31日