

平成30年2月21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30年2月20日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(22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
19	ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数	1651	東
20	ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN)	1652	東
21	ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数	1653	東
22	ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index	1654	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30年2月21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30年2月20日 現在)

108,647,839 口

2. 『ダイワ上場投信一日経225』の純資産総額
(平成30年2月20日 現在)

2,447,430,065,978 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30年2月20日 現在)

22,526.3 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30年2月20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30年2月21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30年2月21日
追加設定日 = 平成30年2月27日

平成30年2月21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―トピックス』に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信―トピックス』の上場受益権口数
(平成30年2月20日 現在)

1,794,807,554 口

2. 『ダイワ上場投信―トピックス』の純資産総額
(平成30年2月20日 現在)

3,304,146,467,926 円

3. 『ダイワ上場投信―トピックス』の一口あたりの純資産額
(平成30年2月20日 現在)

1,840.95 円

4. 『ダイワ上場投信―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30年2月20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30年2月21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30年2月21日
追加設定日 = 平成30年2月27日

平成30年2月21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30年2月20日 現在)

2,603,675 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30年2月20日 現在)

2,062,283,595 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30年2月20日 現在)

792.066 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30年2月20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30年2月21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30年2月21日
追加設定日 = 平成30年2月27日

平成30年2月21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30年2月20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30年2月20日 現在)

2,650,529,019 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30年2月20日 現在)

2,589.166 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30年2月20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30年2月21日 現在)

[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)

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30年2月21日
追加設定日 = 平成30年2月27日

平成30年2月21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30年2月20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30年2月20日 現在)

866,828,673 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30年2月20日 現在)

185.463 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30年2月20日 現在)

-0.01 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成30年2月21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asket	1	7150 島根銀行	100
銘柄数 = 85	2	7161 じもとホールディングス	1,600
Basket提示日 = 平成30年2月21日	3	7167 めぶきフィナンシャルグループ	12,600
追加設定日 = 平成30年2月27日	4	7173 東京TYフィナンシャルグループ	300
	5	7180 九州フィナンシャルグループ	4,000
	6	7182 ゆうちょ銀行	6,900
	7	7184 富山第一銀行	600
	8	7186 コンコルディア・フィナンシャルグループ	14,700
	9	7189 西日本フィナンシャルホールディングス	1,600
	10	8303 新生銀行	2,100
	11	8304 あおぞら銀行	1,400
	12	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	170,900
	13	8308 りそなホールディングス	26,500
	14	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	4,800
	15	8316 三井住友フィナンシャルグループ	18,300
	16	8324 第四銀行	300
	17	8325 北越銀行	200
	18	8331 千葉銀行	9,000
	19	8334 群馬銀行	4,900
	20	8336 武蔵野銀行	400
	21	8337 千葉興業銀行	700
	22	8338 筑波銀行	1,000
	23	8341 七十七銀行	800
	24	8342 青森銀行	200
	25	8343 秋田銀行	200
	26	8344 山形銀行	300
	27	8345 岩手銀行	200
	28	8346 東邦銀行	2,200
	29	8349 東北銀行	100
	30	8350 みちのく銀行	200
	31	8354 ふくおかフィナンシャルグループ	10,000
	32	8355 静岡銀行	6,000
	33	8356 十六銀行	300
	34	8358 スルガ銀行	2,500
	35	8359 八十二銀行	4,400
	36	8360 山梨中央銀行	1,000
	37	8361 大垣共立銀行	400
	38	8362 福井銀行	200
	39	8363 北國銀行	300
	40	8364 清水銀行	100
	41	8366 滋賀銀行	2,000
	42	8367 南都銀行	300
	43	8368 百五銀行	2,300
	44	8369 京都銀行	900
	45	8370 紀陽銀行	900
	46	8374 三重銀行	100
	47	8377 ほくほくフィナンシャルグループ	1,600
	48	8379 広島銀行	3,600
	49	8381 山陰合同銀行	1,400
	50	8382 中国銀行	1,700

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	8383	鳥取銀行	100
52	8385	伊予銀行	3,500
53	8386	百十四銀行	3,000
54	8387	四国銀行	400
55	8388	阿波銀行	2,000
56	8392	大分銀行	100
57	8393	宮崎銀行	200
58	8395	佐賀銀行	100
59	8396	十八銀行	1,000
60	8397	沖縄銀行	200
61	8399	琉球銀行	500
62	8410	セブン銀行	9,100
63	8411	みずほフィナンシャルグループ	328,700
64	8416	高知銀行	100
65	8418	山口フィナンシャルグループ	2,000
66	8521	長野銀行	100
67	8522	名古屋銀行	200
68	8524	北洋銀行	3,600
69	8527	愛知銀行	100
70	8529	第三銀行	100
71	8530	中京銀行	100
72	8537	大光銀行	100
73	8541	愛媛銀行	300
74	8542	トマト銀行	100
75	8543	みなと銀行	200
76	8544	京葉銀行	2,000
77	8545	関西アーバン銀行	300
78	8550	栃木銀行	1,300
79	8551	北日本銀行	100
80	8558	東和銀行	400
81	8562	福島銀行	200
82	8563	大東銀行	100
83	8600	トモニホールディングス	2,000
84	8713	フィデアホールディングス	2,300
85	8714	池田泉州ホールディングス	2,600

平成30年2月21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30年2月20日 現在)

3,490,816 口

2. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の純資産総額
(平成30年2月20日 現在)

4,665,837,992 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30年2月20日 現在)

1,336.604 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30年2月20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30年2月21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30年2月21日
追加設定日 = 平成30年2月27日

平成30年2月21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30年2月20日 現在)

10,690,295 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の純資産総額
(平成30年2月20日 現在)

168,304,822,372 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30年2月20日 現在)

15,743.702 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30年2月20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30年2月21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30年2月21日
追加設定日 = 平成30年2月27日

平成30年2月21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30年2月20日 現在)

915,000 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30年2月20日 現在)

13,378,488,377 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30年2月20日 現在)

14,621.30 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30年2月20日 現在)

0.48 %

●「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。

【「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30年2月21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30年2月20日 現在)

2,360,000 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30年2月20日 現在)

8,304,121,015 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30年2月20日 現在)

3,518.70 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30年2月20日 現在)

-0.50 %

●「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30年2月21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30年2月20日 現在)

140,000 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30年2月20日 現在)

2,088,144,059 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30年2月20日 現在)

14,915.31 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30年2月20日 現在)

0.76 %

●「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30年2月21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30年2月20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30年2月20日 現在)

1,226,777,499 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30年2月20日 現在)

3,608.17 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30年2月20日 現在)

-0.77 %

●「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30年2月21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30年2月20日 現在)

1,059,172 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30年2月20日 現在)

7,821,803,155 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30年2月20日 現在)

7,384.83 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30年2月20日 現在)

-0.25 %

●「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30年2月21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30年2月20日 現在)

1,533,500 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30年2月20日 現在)

11,481,415,704 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30年2月20日 現在)

7,487.07 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30年2月20日 現在)

-0.38 %

●「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30年2月21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30年2月20日 現在)

60,000 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30年2月20日 現在)

688,896,066 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30年2月20日 現在)

11,481.60 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30年2月20日 現在)

0.76 %

●「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30年2月21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30年2月20日 現在)

754,000 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30年2月20日 現在)

5,604,540,139 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30年2月20日 現在)

7,433.08 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30年2月20日 現在)

-0.39 %

●「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30年2月21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30年2月20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30年2月20日 現在)

338,233,589 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30年2月20日 現在)

4,981.35 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30年2月20日 現在)

-0.76 %

●「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。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30年2月21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30年2月20日 現在)

3,805,251 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30年2月20日 現在)

76,993,593,540 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30年2月20日 現在)

20,233.51 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30年2月20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30年2月21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	1925 大和ハウス工業	5,800	
銘柄数 = 150	2	2002 日清製粉グループ本社	900	
バスケット提示日 = 平成30年2月21日	3	2121 ミクシィ	200	
追加設定日 = 平成30年2月27日	4	2212 山崎製パン	500	
	5	2229 カルビー	1,000	
※「○」で表示した銘柄は	6	2331 総合警備保障	500	
現金拠出で対応する銘柄です。	7	2371 カカコム	1,500	
	8	2502 アサヒグループホールディングス	2,800	
	9	2503 キリンホールディングス	5,300	
	10	2587 サントリー食品インターナショナル	900	
	11	2702 日本マクドナルドホールディングス	400	
	12	2801 キッコーマン	700	
	13	2802 味の素	2,400	
	14	2875 東洋水産	600	
	15	2897 日清食品ホールディングス	100	
	16	3003 ヒューリック	1,200	
	17	3231 野村不動産ホールディングス	600	
	18	3289 東急不動産ホールディングス	1,500	
	19	3401 帝人	800	
	20	3402 東レ	6,700	
	21	3405 クラレ	1,300	
	22	3407 旭化成	9,500	
	23	3436 SUMCO	600	
	24	4005 住友化学	8,000	
	25	4063 信越化学工業	1,600	
	26	4091 大陽日酸	600	
	27	4118 カネカ	1,000	
	28	4182 三菱瓦斯化学	900	
	29	4183 三井化学	600	
	30	4185 JSR	1,000	
	31	4188 三菱ケミカルホールディングス	10,400	
	32	4204 積水化学工業	3,300	
	33	4217 日立化成	1,000	
	34	4307 野村総合研究所	900	
	35	4324 電通	1,300	
	36	4452 花王	5,800	
	37	4502 武田薬品工業	2,700	
	38	4503 アステラス製薬	25,600	
	39	4506 大日本住友製薬	1,000	
	40	4507 塩野義製薬	2,700	
	41	4508 田辺三菱製薬	1,100	
	42	4519 中外製薬	1,500	
	43	4523 エーザイ	1,700	
	44	4528 小野薬品工業	2,200	
	45	4543 テルモ	1,100	
	46	4578 大塚ホールディングス	1,500	
	47	4689 ヤフー	14,900	
	48	4704 トレンドマイクロ	1,200	
	49	4755 楽天	5,200	
	50	4901 富士フイルムホールディングス	2,400	

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	4902	コニカミノルタ	2,100	
52	4911	資生堂	1,900	
53	5019	出光興産	200	
54	5020	JXTGホールディングス	4,700	
55	5101	横浜ゴム	400	
56	5108	ブリヂストン	6,800	
57	5233	太平洋セメント	700	
58	5332	TOTO	600	
59	5333	日本碍子	800	
60	5334	日本特殊陶業	900	
61	5401	新日鐵住金	1,600	
62	5406	神戸製鋼所	500	
63	5713	住友金属鉱山	500	
64	5802	住友電気工業	3,300	
65	5901	東洋製罐グループホールディングス	400	
66	5938	LIXILグループ	900	
67	6098	リクルートホールディングス	7,300	
68	6146	ディスコ	200	
69	6201	豊田自動織機	600	
70	6301	小松製作所	2,200	
71	6305	日立建機	500	
72	6326	クボタ	6,400	
73	6367	ダイキン工業	1,400	
74	6383	ダイフク	600	
75	6448	ブラザー工業	800	
76	6460	セガサミーホールディングス	700	
77	6473	ジェイテクト	1,100	
78	6479	ミネベアミツミ	1,000	
79	6481	THK	400	
80	6501	日立製作所	38,000	
81	6594	日本電産	1,200	
82	6645	オムロン	1,700	
83	6701	日本電気	1,200	
84	6723	ルネサスエレクトロニクス	1,900	
85	6724	セイコーエプソン	700	
86	6752	パナソニック	7,300	
87	6758	ソニー	4,700	
88	6841	横河電機	1,500	
89	6861	キーエンス	800	
90	6869	シスメックス	1,900	
91	6902	デンソー	2,400	
92	6923	スタンレー電気	600	
93	6952	カシオ計算機	1,200	
94	6971	京セラ	1,400	
95	6981	村田製作所	1,100	
96	6988	日東電工	1,300	
97	7011	三菱重工業	1,500	
98	7013	IHI	400	
99	7203	トヨタ自動車	8,800	
100	7205	日野自動車	1,600	

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	7259 アイシン精機	1,100	
	102	7261 マツダ	1,800	
	103	7282 豊田合成	300	
	104	7731 ニコン	600	
	105	7733 オリンパス	700	
	106	7751 キヤノン	6,000	
	107	7752 リコー	2,900	
	108	7911 凸版印刷	2,000	
	109	7912 大日本印刷	400	
	110	7974 任天堂	300	
	111	8035 東京エレクトロン	800	
	112	8113 ユニ・チャーム	3,400	
	113	8267 イオン	1,900	○
	114	8304 あおぞら銀行	400	
	115	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	34,200	
	116	8308 りそなホールディングス	12,900	
	117	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	900	
	118	8316 三井住友フィナンシャルグループ	3,300	
	119	8358 スルガ銀行	1,500	
	120	8410 セブン銀行	5,100	
	121	8411 みずほフィナンシャルグループ	80,300	
	122	8473 SBIホールディングス	500	
	123	8570 イオンフィナンシャルサービス	300	
	124	8593 三菱UFJリース	900	
	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	12,100	
	127	8697 日本取引所グループ	7,200	
	128	8729 ソニーフィナンシャルホールディングス	900	
	129	8750 第一生命ホールディングス	4,300	
	130	8766 東京海上ホールディングス	3,700	
	131	8795 T&Dホールディングス	2,800	
	132	8801 三井不動産	3,600	
	133	8802 三菱地所	4,100	
	134	8905 イオンモール	700	○
	135	9005 東京急行電鉄	2,800	
	136	9021 西日本旅客鉄道	900	
	137	9045 京阪ホールディングス	400	
	138	9101 日本郵船	300	
	139	9202 ANAホールディングス	800	
	140	9432 日本電信電話	1,200	
	141	9433 KDDI	19,000	
	142	9437 NTTドコモ	5,200	
	143	9502 中部電力	1,200	
	144	9508 九州電力	600	
	145	9531 東京瓦斯	1,500	
	146	9532 大阪瓦斯	1,600	
	147	9533 東邦瓦斯	300	
	148	9602 東宝	700	○
	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	2,200	

平成30年2月21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30年2月20日 現在)

26,340,856 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の純資産総額
(平成30年2月20日 現在)

45,865,612,884 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30年2月20日 現在)

1,741.235 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30年2月20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30年2月21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30年2月21日
追加設定日 = 平成30年2月27日

平成30年2月21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 1651)
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高配当40指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数』の上場受益権口数
(平成30年2月20日 現在)

7,714,670 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数』の純資産総額
(平成30年2月20日 現在)

8,509,122,273 円

3. 『ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数』の一口あたりの純資産額
(平成30年2月20日 現在)

1,102.979 円

4. 『ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数』の一口あたりの純資産額と
『TOPIX高配当40指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成30年2月20日 現在)

0.01 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (平成30年2月21日 現在)

ダイワ上場投信－TOPIX高配当40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	1878 大東建託	100
銘柄数 = 40	2	1925 大和ハウス工業	600
バスケット提示日 = 平成30年2月21日	3	1928 積水ハウス	700
追加設定日 = 平成30年2月27日	4	2914 日本たばこ産業	1,200
	5	4188 三菱ケミカルホールディングス	1,300
	6	4502 武田薬品工業	700
	7	4503 アステラス製薬	2,000
	8	4523 エーザイ	200
	9	4568 第一三共	500
	10	5020 JXTGホールディングス	3,100
	11	5108 ブリヂストン	700
	12	6902 デンソー	400
	13	7011 三菱重工業	300
	14	7186 コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,100
	15	7201 日産自動車	2,300
	16	7202 いすゞ自動車	600
	17	7203 トヨタ自動車	900
	18	7261 マツダ	600
	19	7267 本田技研工業	1,700
	20	7270 SUBARU	600
	21	7751 キヤノン	1,000
	22	8001 伊藤忠商事	1,400
	23	8002 丸紅	1,500
	24	8031 三井物産	1,600
	25	8053 住友商事	1,200
	26	8058 三菱商事	1,300
	27	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,000
	28	8308 りそなホールディングス	2,100
	29	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	400
	30	8316 三井住友フィナンシャルグループ	1,200
	31	8411 みずほフィナンシャルグループ	25,700
	32	8591 オリックス	1,300
	33	8601 大和証券グループ本社	2,000
	34	8604 野村ホールディングス	3,200
	35	8725 MS&ADインシュアランスグループホールディングス	500
	36	8750 第一生命ホールディングス	1,100
	37	8766 東京海上ホールディングス	700
	38	9201 日本航空	300
	39	9433 KDDI	1,500
	40	9437 NTTドコモ	1,400

平成30年2月21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 1652)
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日本株女性活躍指数(WIN)』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN)』の上場受益権口数
(平成30年2月20日 現在)

510,480 口

2. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN)』の純資産総額
(平成30年2月20日 現在)

1,057,977,509 円

3. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN)』の一口あたりの純資産額
(平成30年2月20日 現在)

2,072.515 円

4. 『ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN)』の一口あたりの純資産額と
『MSCI日本株女性活躍指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成30年2月20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30年2月21日 現在)

[掲載番号:20]

ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN) (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30年2月21日
追加設定日 = 平成30年2月27日

平成30年2月21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 1653)
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ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数』の上場受益権口数
(平成30年2月20日 現在)

1,041,390 口

2. 『ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数』の純資産総額
(平成30年2月20日 現在)

2,137,954,326 円

3. 『ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数』の一口あたりの純資産額
(平成30年2月20日 現在)

2,052.981 円

4. 『ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数』の一口あたりの純資産額と
『MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数』の終値の変動率に係る乖離率
(平成30年2月20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30年2月21日 現在)

[掲載番号:21]

ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(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30年2月21日
追加設定日 = 平成30年2月27日

平成30年2月21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 1654)
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－FTSE Blossom Japan Index』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index』の上場受益権口数
(平成30年2月20日 現在)

1,642,440 口

2. 『ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index』の純資産総額
(平成30年2月20日 現在)

2,185,905,924 円

3. 『ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index』の一口あたりの純資産額
(平成30年2月20日 現在)

1,330.889 円

4. 『ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index』の一口あたりの純資産額と
『FTSE Blossom Japan Index』の終値の変動率に係る乖離率
(平成30年2月20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30年2月21日 現在)

[掲載番号:22]

ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index(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30年2月21日
追加設定日 = 平成30年2月27日