

平成30年3月14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3月13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3月14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3月13日 現在)

**109,120,014 口**

2. 『ダイワ上場投信一日経225』の純資産総額  
(平成30年3月13日 現在)

**2,463,973,440,604 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3月13日 現在)

**22,580.4 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3月13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3月14日 現在)

## ダイワ上場投信一日経225(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   | 1332 日本水産            | 2,000 |
| 銘柄数 = 225             | 2   | 1333 マルハニチロ          | 200   |
| バスケット提示日 = 平成30年3月14日 | 3   | 1605 国際石油開発帝石        | 800   |
| 追加設定日 = 平成30年3月20日    | 4   | 1721 コムシスホールディングス    | 2,000 |
|                       | 5   | 1801 大成建設            | 400   |
|                       | 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             | 200   |
|                       | 29  | 3103 ユニチカ            | 200   |
|                       | 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  | 4004 昭和電工            | 200   |
|                       | 41  | 4005 住友化学            | 2,000 |
|                       | 42  | 4021 日産化学工業          | 2,000 |
|                       | 43  | 4042 東ソー             | 1,000 |
|                       | 44  | 4043 トクヤマ            | 400   |
|                       | 45  | 4061 デンカ             | 400   |
|                       | 46  | 4063 信越化学工業          | 2,000 |
|                       | 47  | 4151 協和発酵キリン         | 2,000 |
|                       | 48  | 4183 三井化学            | 400   |
|                       | 49  | 4188 三菱ケミカルホールディングス  | 1,000 |
|                       | 50  | 4208 宇部興産            | 200   |

## ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

|     | コード  | 銘柄名                | 株数     |
|-----|------|--------------------|--------|
| 51  | 4272 | 日本化薬               | 2,000  |
| 52  | 4324 | 電通                 | 2,000  |
| 53  | 4452 | 花王                 | 2,000  |
| 54  | 4502 | 武田薬品工業             | 2,000  |
| 55  | 4503 | アステラス製薬            | 10,000 |
| 56  | 4506 | 大日本住友製薬            | 2,000  |
| 57  | 4507 | 塩野義製薬              | 2,000  |
| 58  | 4519 | 中外製薬               | 2,000  |
| 59  | 4523 | エーザイ               | 2,000  |
| 60  | 4543 | テルモ                | 4,000  |
| 61  | 4568 | 第一三共               | 2,000  |
| 62  | 4578 | 大塚ホールディングス         | 2,000  |
| 63  | 4689 | ヤフー                | 800    |
| 64  | 4704 | トレンドマイクロ           | 2,000  |
| 65  | 4755 | 楽天                 | 2,000  |
| 66  | 4901 | 富士フイルムホールディングス     | 2,000  |
| 67  | 4902 | コニカミノルタ            | 2,000  |
| 68  | 4911 | 資生堂                | 2,000  |
| 69  | 5002 | 昭和シェル石油            | 2,000  |
| 70  | 5020 | JXTGホールディングス       | 2,000  |
| 71  | 5101 | 横浜ゴム               | 1,000  |
| 72  | 5108 | ブリヂストン             | 2,000  |
| 73  | 5201 | 旭硝子                | 400    |
| 74  | 5202 | 日本板硝子              | 200    |
| 75  | 5214 | 日本電気硝子             | 600    |
| 76  | 5232 | 住友大阪セメント           | 2,000  |
| 77  | 5233 | 太平洋セメント            | 200    |
| 78  | 5301 | 東海カーボン             | 2,000  |
| 79  | 5332 | TOTO               | 1,000  |
| 80  | 5333 | 日本碍子               | 2,000  |
| 81  | 5401 | 新日鐵住金              | 200    |
| 82  | 5406 | 神戸製鋼所              | 200    |
| 83  | 5411 | ジェイ エフ イー ホールディングス | 200    |
| 84  | 5413 | 日新製鋼               | 200    |
| 85  | 5541 | 大太平洋金属             | 200    |
| 86  | 5631 | 日本製鋼所              | 400    |
| 87  | 5703 | 日本軽金属ホールディングス      | 2,000  |
| 88  | 5706 | 三井金属鉱業             | 200    |
| 89  | 5707 | 東邦亜鉛               | 200    |
| 90  | 5711 | 三菱マテリアル            | 200    |
| 91  | 5713 | 住友金属鉱山             | 1,000  |
| 92  | 5714 | DOWAホールディングス       | 400    |
| 93  | 5715 | 古河機械金属             | 200    |
| 94  | 5801 | 古河電気工業             | 200    |
| 95  | 5802 | 住友電気工業             | 2,000  |
| 96  | 5803 | フジクラ               | 2,000  |
| 97  | 5901 | 東洋製罐グループホールディングス   | 2,000  |
| 98  | 6098 | リクルートホールディングス      | 6,000  |
| 99  | 6103 | オークマ               | 400    |
| 100 | 6113 | アマダホールディングス        | 2,000  |

## ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

|  | コード | 銘柄名                      | 株数    |
|--|-----|--------------------------|-------|
|  | 101 | 6178 日本郵政                | 2,000 |
|  | 102 | 6301 小松製作所               | 2,000 |
|  | 103 | 6302 住友重機械工業             | 400   |
|  | 104 | 6305 日立建機                | 2,000 |
|  | 105 | 6326 クボタ                 | 2,000 |
|  | 106 | 6361 荏原製作所               | 400   |
|  | 107 | 6366 千代田化工建設             | 2,000 |
|  | 108 | 6367 ダイキン工業              | 2,000 |
|  | 109 | 6471 日本精工                | 2,000 |
|  | 110 | 6472 NTN                 | 2,000 |
|  | 111 | 6473 ジェイテクト              | 2,000 |
|  | 112 | 6479 ミネベアミツミ             | 2,000 |
|  | 113 | 6501 日立製作所               | 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 | 6674 ジーエス・ユアサ コーポレーション   | 2,000 |
|  | 118 | 6701 日本電気                | 200   |
|  | 119 | 6702 富士通                 | 2,000 |
|  | 120 | 6703 沖電気工業               | 200   |
|  | 121 | 6724 セイコーエプソン            | 4,000 |
|  | 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                | 200   |
|  | 136 | 7004 日立造船                | 400   |
|  | 137 | 7011 三菱重工業               | 200   |
|  | 138 | 7012 川崎重工業               | 200   |
|  | 139 | 7013 IHI                 | 200   |
|  | 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 SUBARU              | 2,000 |
|  | 150 | 7272 ヤマハ発動機              | 2,000 |

## ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

|     | コード  | 銘柄名                       | 株数    |
|-----|------|---------------------------|-------|
| 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                     | 1,000 |
| 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                      | 200   |
| 173 | 8304 | あおぞら銀行                    | 200   |
| 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ディングス | 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                      | 400   |
| 196 | 9005 | 東京急行電鉄                    | 1,000 |
| 197 | 9007 | 小田急電鉄                     | 1,000 |
| 198 | 9008 | 京王電鉄                      | 400   |
| 199 | 9009 | 京成電鉄                      | 1,000 |
| 200 | 9020 | 東日本旅客鉄道                   | 200   |

## ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

|     | コード  | 銘柄名              | 株数     |
|-----|------|------------------|--------|
| 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             | 200    |
| 204 | 9064 | ヤマトホールディングス      | 2,000  |
| 205 | 9101 | 日本郵船             | 200    |
| 206 | 9104 | 商船三井             | 200    |
| 207 | 9107 | 川崎汽船             | 200    |
| 208 | 9202 | ANAホールディングス      | 200    |
| 209 | 9301 | 三菱倉庫             | 1,000  |
| 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             | 400    |
| 218 | 9532 | 大阪瓦斯             | 400    |
| 219 | 9602 | 東宝               | 200    |
| 220 | 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ     | 10,000 |
| 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  |

平成30年3月14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3月13日 現在)

**1,840,677,604 口**

2. 『ダイワ上場投信―トピックス』の純資産総額  
(平成30年3月13日 現在)

**3,367,332,779,888 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3月13日 現在)

**1,829.40 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3月13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3月14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3月14日  
追加設定日 = 平成30年3月20日

平成30年3月14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3月13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3月13日 現在)

**2,040,682,890 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3月13日 現在)

**783.770 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3月13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3月14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3月14日  
追加設定日 = 平成30年3月20日

平成30年3月14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3月13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3月13日 現在)

2,704,895,151 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3月13日 現在)

2,642.273 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3月13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3月14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3月14日  
追加設定日 = 平成30年3月20日

平成30年3月14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3月13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3月13日 現在)

**834,930,004 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3月13日 現在)

**178.638 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3月13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3月14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   | 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   |
| バスケット提示日 = 平成30年3月14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3月20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   | 169,800 |
|                       | 13  | 8308 りそなホールディングス         | 26,600  |
|                       | 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     | 18,400  |
|                       | 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              | 2,000   |
|                       | 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 | 329,500 |
| 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           | 3,700   |
| 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   | 2,400   |
| 85 | 8714 | 池田泉州ホールディングス   | 2,600   |



平成30年3月14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3月13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3月13日 現在)

**4,650,818,035 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3月13日 現在)

**1,332.301 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3月13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3月14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3月14日  
追加設定日 = 平成30年3月20日

平成30年3月14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3月13日 現在)

**10,593,992 口**

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の純資産総額  
(平成30年3月13日 現在)

**165,817,382,752 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3月13日 現在)

**15,652.021 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3月13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3月14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3月14日  
追加設定日 = 平成30年3月20日

平成30年3月14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3月13日 現在)

1,015,000 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3月13日 現在)

14,856,026,828 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3月13日 現在)

14,636.48 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3月13日 現在)

-0.59 %

●「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30年3月14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3月13日 現在)

**2,260,000 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3月13日 現在)

**7,844,894,008 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3月13日 現在)

**3,471.19 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3月13日 現在)

**0.58 %**

●「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3月14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3月13日 現在)

**530,000 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3月13日 現在)

**7,796,115,259 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3月13日 現在)

**14,709.65 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3月13日 現在)

**-0.37 %**

●「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3月14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3月13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3月13日 現在)

**1,233,509,311 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3月13日 現在)

**3,627.97 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3月13日 現在)

**0.36 %**

●「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3月14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3月13日 現在)

**966,272 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3月13日 現在)

**7,094,915,789 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3月13日 現在)

**7,342.57 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3月13日 現在)

**0.29 %**

●「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3月14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3月13日 現在)

**1,513,500 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3月13日 現在)

**11,369,385,508 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3月13日 現在)

**7,511.98 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3月13日 現在)

**0.18 %**

●「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3月14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3月13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3月13日 現在)

677,941,590 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3月13日 現在)

11,299.03 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3月13日 現在)

-1.21 %

●「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 of 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3月14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3月13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3月13日 現在)

**5,628,033,854 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3月13日 現在)

**7,464.24 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3月13日 現在)

**0.60 %**

●「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3月14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3月13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3月13日 現在)

340,463,478 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3月13日 現在)

5,014.19 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3月13日 現在)

1.21 %

●「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3月14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3月13日 現在)

**3,569,443 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3月13日 現在)

**72,039,093,252 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3月13日 現在)

**20,182.17 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3月13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3月14日 現在)

[掲載番号:17]

## 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)

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3月14日  
追加設定日 = 平成30年3月20日



平成30年3月14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3月13日 現在)

27,133,876 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の純資産総額  
(平成30年3月13日 現在)

45,778,054,183 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3月13日 現在)

1,687.118 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3月13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3月14日 現在)

## ダイワ上場投信－東証REIT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   | 3226 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券      | 14  |
| 銘柄数 = 58              | 2   | 3227 MCUBS MidCity投資法人 投資証券       | 48  |
| バスケット提示日 = 平成30年3月14日 | 3   | 3234 森ヒルズリート投資法人 投資証券             | 47  |
| 追加設定日 = 平成30年3月20日    | 4   | 3249 産業ファンド投資法人 投資証券              | 50  |
|                       | 5   | 3269 アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券         | 40  |
|                       | 6   | 3278 ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券 | 22  |
|                       | 7   | 3279 アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券      | 20  |
|                       | 8   | 3281 GLP投資法人 投資証券                 | 90  |
|                       | 9   | 3282 コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券      | 16  |
|                       | 10  | 3283 日本プロロジスリート投資法人 投資証券          | 58  |
|                       | 11  | 3287 星野リゾート・リート投資法人 投資証券          | 7   |
|                       | 12  | 3290 Oneリート投資法人 投資証券              | 5   |
|                       | 13  | 3292 イオンリート投資法人 投資証券              | 41  |
|                       | 14  | 3295 ヒューリックリート投資法人 投資証券           | 29  |
|                       | 15  | 3296 日本リート投資法人 投資証券               | 12  |
|                       | 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   | 192 |
|                       | 17  | 3308 日本ヘルスケア投資法人 投資証券             | 2   |
|                       | 18  | 3309 積水ハウス・リート投資法人 投資証券           | 27  |
|                       | 19  | 3451 トーセイ・リート投資法人 投資証券            | 7   |
|                       | 20  | 3453 ケネディクス商業リート投資法人 投資証券         | 16  |
|                       | 21  | 3455 ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券         | 5   |
|                       | 22  | 3459 サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券        | 8   |
|                       | 23  | 3462 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券       | 128 |
|                       | 24  | 3463 いちごホテルリート投資法人 投資証券           | 7   |
|                       | 25  | 3466 ラサールロジポート投資法人 投資証券           | 33  |
|                       | 26  | 3468 スターアジア不動産投資法人 投資証券           | 10  |
|                       | 27  | 3470 マリモ地方創生リート投資法人 投資証券          | 3   |
|                       | 28  | 3471 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券     | 8   |
|                       | 29  | 3472 大江戸温泉リート投資法人 投資証券            | 7   |
|                       | 30  | 3473 さくら総合リート投資法人 投資証券            | 10  |
|                       | 31  | 3476 投資法人みらい 投資証券                 | 6   |
|                       | 32  | 3478 森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券        | 9   |
|                       | 33  | 3481 三菱地所物流リート投資法人 投資証券           | 4   |
|                       | 34  | 8951 日本ビルファンド投資法人 投資証券            | 42  |
|                       | 35  | 8952 ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券        | 41  |
|                       | 36  | 8953 日本リテールファンド投資法人 投資証券          | 83  |
|                       | 37  | 8954 オリックス不動産投資法人 投資証券            | 86  |
|                       | 38  | 8955 日本プライムリアルティ投資法人 投資証券         | 27  |
|                       | 39  | 8956 プレミア投資法人 投資証券                | 39  |
|                       | 40  | 8957 東急リアル・エステート投資法人 投資証券         | 29  |
|                       | 41  | 8958 グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券         | 7   |
|                       | 42  | 8960 ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券         | 96  |
|                       | 43  | 8961 森トラスト総合リート投資法人 投資証券          | 31  |
|                       | 44  | 8963 インヴィンシブル投資法人 投資証券            | 119 |
|                       | 45  | 8964 フロンティア不動産投資法人 投資証券           | 15  |
|                       | 46  | 8966 平和不動産リート投資法人 投資証券            | 27  |
|                       | 47  | 8967 日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券       | 29  |
|                       | 48  | 8968 福岡リート投資法人 投資証券               | 22  |
|                       | 49  | 8972 ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券         | 13  |
|                       | 50  | 8973 積水ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券       | 33  |

ダイワ上場投信－東証REIT指数(設定ポートフォリオ)

|    | コード  | 銘柄名                   | 株数  |
|----|------|-----------------------|-----|
| 51 | 8975 | いちごオフィスリート投資法人 投資証券   | 34  |
| 52 | 8976 | 大和証券オフィス投資法人 投資証券     | 9   |
| 53 | 8977 | 阪急リート投資法人 投資証券        | 19  |
| 54 | 8979 | スターツプロシード投資法人 投資証券    | 7   |
| 55 | 8984 | 大和ハウスリート投資法人 投資証券     | 50  |
| 56 | 8985 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券 | 125 |
| 57 | 8986 | 日本賃貸住宅投資法人 投資証券       | 49  |
| 58 | 8987 | ジャパンエクセレント投資法人 投資証券   | 39  |

平成30年3月14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3月13日 現在)

**8,412,060 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3月13日 現在)

**9,122,153,490 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3月13日 現在)

**1,084.414 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3月13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3月14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3月14日 | 3   | 1928 積水ハウス                     | 700    |
| 追加設定日 = 平成30年3月20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                    | 600    |
|                       | 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                        | 1,600  |
|                       | 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         | 6,900  |
|                       | 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                | 3,300  |
|                       | 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3月14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3月13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3月13日 現在)

**1,052,696,504 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3月13日 現在)

**2,062.170 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3月13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3月14日 現在)

## 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)

|                       | コード | 銘柄名                   | 株数    |
|-----------------------|-----|-----------------------|-------|
| 単位 = 1 バスケット          | 1   | 1719 安藤・間             | 100   |
| 銘柄数 = 137             | 2   | 1802 大林組              | 500   |
| バスケット提示日 = 平成30年3月14日 | 3   | 1803 清水建設             | 400   |
| 追加設定日 = 平成30年3月20日    | 4   | 1893 五洋建設             | 200   |
|                       | 5   | 1911 住友林業             | 100   |
|                       | 6   | 1928 積水ハウス            | 300   |
|                       | 7   | 2002 日清製粉グループ本社       | 100   |
|                       | 8   | 2229 カルビー             | 100   |
|                       | 9   | 2371 カカクコム            | 200   |
|                       | 10  | 2413 エムスリー            | 300   |
|                       | 11  | 2432 ディー・エヌ・エー        | 100   |
|                       | 12  | 2502 アサヒグループホールディングス  | 200   |
|                       | 13  | 2503 キリンホールディングス      | 200   |
|                       | 14  | 2587 サントリー食品インターナショナル | 100   |
|                       | 15  | 2768 双日               | 300   |
|                       | 16  | 2801 キッコーマン           | 100   |
|                       | 17  | 2802 味の素              | 200   |
|                       | 18  | 2809 キューピー            | 100   |
|                       | 19  | 2871 ニチレイ             | 100   |
|                       | 20  | 3003 ヒューリック           | 100   |
|                       | 21  | 3092 スタートトゥデイ         | 200   |
|                       | 22  | 3099 三越伊勢丹ホールディングス    | 100   |
|                       | 23  | 3289 東急不動産ホールディングス    | 100   |
|                       | 24  | 3401 帝人               | 100   |
|                       | 25  | 3402 東レ               | 800   |
|                       | 26  | 3405 クラレ              | 200   |
|                       | 27  | 3407 旭化成              | 1,000 |
|                       | 28  | 3626 TIS              | 100   |
|                       | 29  | 4151 協和発酵キリン          | 100   |
|                       | 30  | 4185 JSR              | 100   |
|                       | 31  | 4188 三菱ケミカルホールディングス   | 1,000 |
|                       | 32  | 4202 ダイセル             | 200   |
|                       | 33  | 4205 日本ゼオン            | 100   |
|                       | 34  | 4217 日立化成             | 100   |
|                       | 35  | 4272 日本化薬             | 100   |
|                       | 36  | 4307 野村総合研究所          | 100   |
|                       | 37  | 4401 ADEKA            | 100   |
|                       | 38  | 4403 日油               | 100   |
|                       | 39  | 4502 武田薬品工業           | 200   |
|                       | 40  | 4503 アステラス製薬          | 2,300 |
|                       | 41  | 4506 大日本住友製薬          | 100   |
|                       | 42  | 4507 塩野義製薬            | 400   |
|                       | 43  | 4508 田辺三菱製薬           | 100   |
|                       | 44  | 4519 中外製薬             | 200   |
|                       | 45  | 4536 参天製薬             | 200   |
|                       | 46  | 4631 DIC              | 100   |
|                       | 47  | 4661 オリエンタルランド        | 200   |
|                       | 48  | 4666 パーク24            | 100   |
|                       | 49  | 4689 ヤフー              | 1,700 |
|                       | 50  | 4704 トレンドマイクロ         | 100   |

## 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)

|     | コード  | 銘柄名                | 株数    |
|-----|------|--------------------|-------|
| 51  | 4716 | 日本オラクル             | 100   |
| 52  | 4755 | 楽天                 | 400   |
| 53  | 4902 | コニカミノルタ            | 100   |
| 54  | 4911 | 資生堂                | 100   |
| 55  | 4912 | ライオン               | 200   |
| 56  | 4927 | ポーラ・オルビスホールディングス   | 100   |
| 57  | 5002 | 昭和シェル石油            | 200   |
| 58  | 5108 | ブリヂストン             | 500   |
| 59  | 5332 | TOTO               | 100   |
| 60  | 5333 | 日本碍子               | 100   |
| 61  | 5334 | 日本特殊陶業             | 100   |
| 62  | 5411 | ジェイ エフ イー ホールディングス | 200   |
| 63  | 5486 | 日立金属               | 100   |
| 64  | 6005 | 三浦工業               | 100   |
| 65  | 6098 | リクルートホールディングス      | 1,000 |
| 66  | 6301 | 小松製作所              | 400   |
| 67  | 6326 | クボタ                | 500   |
| 68  | 6361 | 荏原製作所              | 100   |
| 69  | 6367 | ダイキン工業             | 200   |
| 70  | 6370 | 栗田工業               | 100   |
| 71  | 6472 | NTN                | 100   |
| 72  | 6501 | 日立製作所              | 3,000 |
| 73  | 6503 | 三菱電機               | 1,200 |
| 74  | 6594 | 日本電産               | 100   |
| 75  | 6645 | オムロン               | 200   |
| 76  | 6701 | 日本電気               | 100   |
| 77  | 6724 | セイコーエプソン           | 100   |
| 78  | 6770 | アルプス電気             | 100   |
| 79  | 6841 | 横河電機               | 100   |
| 80  | 6869 | シスメックス             | 200   |
| 81  | 6925 | ウシオ電機              | 100   |
| 82  | 6952 | カシオ計算機             | 100   |
| 83  | 6988 | 日東電工               | 100   |
| 84  | 7011 | 三菱重工業              | 100   |
| 85  | 7182 | ゆうちょ銀行             | 200   |
| 86  | 7211 | 三菱自動車工業            | 100   |
| 87  | 7276 | 小糸製作所              | 100   |
| 88  | 7459 | メディパルホールディングス      | 100   |
| 89  | 7731 | ニコン                | 100   |
| 90  | 7741 | HOYA               | 400   |
| 91  | 7751 | キャノン               | 500   |
| 92  | 7752 | リコー                | 100   |
| 93  | 7762 | シチズン時計             | 100   |
| 94  | 7832 | バンダイナムコホールディングス    | 200   |
| 95  | 7912 | 大日本印刷              | 100   |
| 96  | 7956 | ピジョン               | 100   |
| 97  | 8002 | 丸紅                 | 700   |
| 98  | 8031 | 三井物産               | 400   |
| 99  | 8036 | 日立ハイテクノロジーズ        | 100   |
| 100 | 8053 | 住友商事               | 300   |



## 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)

|     | コード  | 銘柄名                       | 株数    |
|-----|------|---------------------------|-------|
| 101 | 8252 | 丸井グループ                    | 100   |
| 102 | 8253 | クレディセゾン                   | 100   |
| 103 | 8267 | イオン                       | 100   |
| 104 | 8306 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ         | 3,900 |
| 105 | 8331 | 千葉銀行                      | 1,000 |
| 106 | 8334 | 群馬銀行                      | 200   |
| 107 | 8341 | 七十七銀行                     | 100   |
| 108 | 8358 | スルガ銀行                     | 200   |
| 109 | 8379 | 広島銀行                      | 100   |
| 110 | 8410 | セブン銀行                     | 700   |
| 111 | 8411 | みずほフィナンシャルグループ            | 8,100 |
| 112 | 8591 | オリックス                     | 1,100 |
| 113 | 8593 | 三菱UFJリース                  | 100   |
| 114 | 8604 | 野村ホールディングス                | 1,100 |
| 115 | 8630 | SOMPOホールディングス             | 300   |
| 116 | 8697 | 日本取引所グループ                 | 800   |
| 117 | 8725 | MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 600   |
| 118 | 8750 | 第一生命ホールディングス              | 500   |
| 119 | 8766 | 東京海上ホールディングス              | 500   |
| 120 | 8795 | T&Dホールディングス               | 600   |
| 121 | 8848 | レオパレス21                   | 400   |
| 122 | 8905 | イオンモール                    | 100   |
| 123 | 9005 | 東京急行電鉄                    | 100   |
| 124 | 9021 | 西日本旅客鉄道                   | 100   |
| 125 | 9201 | 日本航空                      | 200   |
| 126 | 9202 | ANAホールディングス               | 100   |
| 127 | 9433 | KDDI                      | 1,800 |
| 128 | 9437 | NTTドコモ                    | 900   |
| 129 | 9502 | 中部電力                      | 200   |
| 130 | 9507 | 四国電力                      | 100   |
| 131 | 9531 | 東京瓦斯                      | 500   |
| 132 | 9532 | 大阪瓦斯                      | 500   |
| 133 | 9533 | 東邦瓦斯                      | 100   |
| 134 | 9602 | 東宝                        | 100   |
| 135 | 9684 | スクウェア・エニックス・ホールディングス      | 100   |
| 136 | 9766 | コナミホールディングス               | 100   |
| 137 | 9843 | ニトリホールディングス               | 100   |

平成30年3月14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3月13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3月13日 現在)

**2,125,445,215 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3月13日 現在)

**2,040.969 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3月13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3月14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3月14日  
追加設定日 = 平成30年3月20日

平成30年3月14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3月13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3月13日 現在)

**2,155,884,936 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3月13日 現在)

**1,312.611 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3月13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3月14日 現在)

## ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index(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   | 1605 国際石油開発帝石        | 600   |
| 銘柄数 = 126             | 2   | 1801 大成建設            | 200   |
| バスケット提示日 = 平成30年3月14日 | 3   | 1802 大林組             | 500   |
| 追加設定日 = 平成30年3月20日    | 4   | 1812 鹿島建設            | 1,000 |
|                       | 5   | 1911 住友林業            | 100   |
|                       | 6   | 1925 大和ハウス工業         | 300   |
|                       | 7   | 1928 積水ハウス           | 200   |
|                       | 8   | 2002 日清製粉グループ本社      | 100   |
|                       | 9   | 2331 総合警備保障          | 100   |
|                       | 10  | 2502 アサヒグループホールディングス | 200   |
|                       | 11  | 2503 キリンホールディングス     | 300   |
|                       | 12  | 2801 キッコーマン          | 100   |
|                       | 13  | 2802 味の素             | 200   |
|                       | 14  | 2914 日本たばこ産業         | 500   |
|                       | 15  | 3003 ヒューリック          | 100   |
|                       | 16  | 3289 東急不動産ホールディングス   | 200   |
|                       | 17  | 3382 セブン&アイ・ホールディングス | 600   |
|                       | 18  | 3401 帝人              | 100   |
|                       | 19  | 3405 クラレ             | 300   |
|                       | 20  | 3407 旭化成             | 1,000 |
|                       | 21  | 3436 SUMCO           | 100   |
|                       | 22  | 3861 王子ホールディングス      | 1,000 |
|                       | 23  | 3863 日本製紙            | 100   |
|                       | 24  | 4004 昭和電工            | 100   |
|                       | 25  | 4005 住友化学            | 1,000 |
|                       | 26  | 4062 イビデン            | 100   |
|                       | 27  | 4151 協和発酵キリン         | 100   |
|                       | 28  | 4183 三井化学            | 200   |
|                       | 29  | 4185 JSR             | 200   |
|                       | 30  | 4188 三菱ケミカルホールディングス  | 1,100 |
|                       | 31  | 4204 積水化学工業          | 200   |
|                       | 32  | 4217 日立化成            | 100   |
|                       | 33  | 4452 花王              | 200   |
|                       | 34  | 4502 武田薬品工業          | 300   |
|                       | 35  | 4503 アステラス製薬         | 900   |
|                       | 36  | 4506 大日本住友製薬         | 100   |
|                       | 37  | 4508 田辺三菱製薬          | 100   |
|                       | 38  | 4519 中外製薬            | 100   |
|                       | 39  | 4523 エーザイ            | 100   |
|                       | 40  | 4568 第一三共            | 300   |
|                       | 41  | 4661 オリエンタルランド       | 100   |
|                       | 42  | 4689 ヤフー             | 500   |
|                       | 43  | 4901 富士フイルムホールディングス  | 200   |
|                       | 44  | 4902 コニカミノルタ         | 200   |
|                       | 45  | 4911 資生堂             | 200   |
|                       | 46  | 4912 ライオン            | 100   |
|                       | 47  | 5002 昭和シェル石油         | 100   |
|                       | 48  | 5201 旭硝子             | 200   |
|                       | 49  | 5332 TOTO            | 100   |
|                       | 50  | 5334 日本特殊陶業          | 100   |

## ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index(設定ポートフォリオ)

|     | コード  | 銘柄名               | 株数    |
|-----|------|-------------------|-------|
| 51  | 5486 | 日立金属              | 200   |
| 52  | 5803 | フジクラ              | 200   |
| 53  | 5938 | LIXILグループ         | 200   |
| 54  | 6268 | ナブテスコ             | 100   |
| 55  | 6301 | 小松製作所             | 700   |
| 56  | 6305 | 日立建機              | 100   |
| 57  | 6326 | クボタ               | 900   |
| 58  | 6361 | 荏原製作所             | 100   |
| 59  | 6366 | 千代田化工建設           | 100   |
| 60  | 6471 | 日本精工              | 200   |
| 61  | 6472 | NTN               | 300   |
| 62  | 6503 | 三菱電機              | 1,600 |
| 63  | 6504 | 富士電機              | 1,000 |
| 64  | 6506 | 安川電機              | 200   |
| 65  | 6645 | オムロン              | 200   |
| 66  | 6701 | 日本電気              | 100   |
| 67  | 6702 | 富士通               | 1,000 |
| 68  | 6724 | セイコーエプソン          | 100   |
| 69  | 6752 | パナソニック            | 900   |
| 70  | 6753 | シャープ              | 100   |
| 71  | 6758 | ソニー               | 500   |
| 72  | 6762 | TDK               | 100   |
| 73  | 6841 | 横河電機              | 200   |
| 74  | 6845 | アズビル              | 100   |
| 75  | 6857 | アドバンテスト           | 100   |
| 76  | 6869 | シスメックス            | 100   |
| 77  | 6902 | デンソー              | 200   |
| 78  | 6925 | ウシオ電機             | 100   |
| 79  | 6952 | カシオ計算機            | 100   |
| 80  | 7011 | 三菱重工業             | 200   |
| 81  | 7012 | 川崎重工業             | 100   |
| 82  | 7201 | 日産自動車             | 800   |
| 83  | 7203 | トヨタ自動車            | 1,100 |
| 84  | 7261 | マツダ               | 200   |
| 85  | 7701 | 島津製作所             | 200   |
| 86  | 7731 | ニコン               | 100   |
| 87  | 7733 | オリンパス             | 100   |
| 88  | 7752 | リコー               | 300   |
| 89  | 7912 | 大日本印刷             | 200   |
| 90  | 7936 | アシックス             | 100   |
| 91  | 7951 | ヤマハ               | 100   |
| 92  | 8002 | 丸紅                | 1,300 |
| 93  | 8031 | 三井物産              | 1,300 |
| 94  | 8035 | 東京エレクトロン          | 100   |
| 95  | 8252 | 丸井グループ            | 200   |
| 96  | 8267 | イオン               | 500   |
| 97  | 8306 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 4,900 |
| 98  | 8308 | りそなホールディングス       | 800   |
| 99  | 8309 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 100   |
| 100 | 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ   | 500   |

## ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index(設定ポートフォリオ)

|     | コード  | 銘柄名                       | 株数    |
|-----|------|---------------------------|-------|
| 101 | 8359 | 八十二銀行                     | 200   |
| 102 | 8411 | みずほフィナンシャルグループ            | 9,700 |
| 103 | 8572 | アコム                       | 100   |
| 104 | 8593 | 三菱UFJリース                  | 200   |
| 105 | 8601 | 大和証券グループ本社                | 1,000 |
| 106 | 8604 | 野村ホールディングス                | 1,200 |
| 107 | 8630 | SOMPOホールディングス             | 100   |
| 108 | 8725 | MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 200   |
| 109 | 8750 | 第一生命ホールディングス              | 400   |
| 110 | 8766 | 東京海上ホールディングス              | 300   |
| 111 | 8795 | T&Dホールディングス               | 200   |
| 112 | 8802 | 三菱地所                      | 400   |
| 113 | 9020 | 東日本旅客鉄道                   | 300   |
| 114 | 9021 | 西日本旅客鉄道                   | 100   |
| 115 | 9101 | 日本郵船                      | 100   |
| 116 | 9104 | 商船三井                      | 100   |
| 117 | 9107 | 川崎汽船                      | 100   |
| 118 | 9202 | ANAホールディングス               | 100   |
| 119 | 9432 | 日本電信電話                    | 200   |
| 120 | 9433 | KDDI                      | 400   |
| 121 | 9437 | NTTドコモ                    | 300   |
| 122 | 9531 | 東京瓦斯                      | 400   |
| 123 | 9532 | 大阪瓦斯                      | 400   |
| 124 | 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ              | 300   |
| 125 | 9783 | ベネッセホールディングス              | 100   |
| 126 | 9984 | ソフトバンクグループ                | 200   |