

平成30年8月27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 岡 田 美 範
(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8月24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8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

112,433,609 口

2. 『ダイワ上場投信一日経225』の純資産総額
(平成30年8月24日 現在)

2,590,026,584,301 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8月24日 現在)

23,036.1 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30年8月27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8月27日
追加設定日 = 平成30年8月31日

平成30年8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

2,154,074,976 口

2. 『ダイワ上場投信―トピックス』の純資産総額

(平成30年8月24日 現在)

3,818,566,279,098 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8月24日 現在)

1,772.72 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30年8月27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8月27日
追加設定日 = 平成30年8月31日

平成30年8月27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 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信ートピックス・コア30』
に関する日々の開示事項

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

2,603,675 口

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

1,958,896,381 円

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

752.358 円

4. 『ダイワ上場投信ートピックス・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30年8月27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8月27日
追加設定日 = 平成30年8月31日

平成30年8月27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 岡 田 美 範
(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30年8月24日 現在)

2,494,772,448 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8月24日 現在)

2,437.015 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30年8月27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8月27日
追加設定日 = 平成30年8月31日

平成30年8月27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 岡 田 美 範
(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30年8月24日 現在)

768,170,823 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8月24日 現在)

164.355 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30年8月27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 = 83	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8月27日	3	7167 めぶきフィナンシャルグループ	12,400
追加設定日 = 平成30年8月31日	4	7173 東京きらぼし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	3,900
	6	7182 ゆうちょ銀行	6,800
	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	14,300
	9	7189 西日本フィナンシャルホールディングス	1,500
	10	7321 関西みらいフィナンシャルグループ	1,000
	11	7322 三十三フィナンシャルグループ	200
	12	8303 新生銀行	2,000
	13	8304 あおぞら銀行	1,400
	14	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	166,700
	15	8308 りそなホールディングス	26,300
	16	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	4,700
	17	8316 三井住友フィナンシャルグループ	18,100
	18	8324 第四銀行	300
	19	8325 北越銀行	200
	20	8331 千葉銀行	8,500
	21	8334 群馬銀行	4,800
	22	8336 武蔵野銀行	400
	23	8337 千葉興業銀行	700
	24	8338 筑波銀行	1,000
	25	8341 七十七銀行	800
	26	8342 青森銀行	200
	27	8343 秋田銀行	200
	28	8344 山形銀行	300
	29	8345 岩手銀行	200
	30	8346 東邦銀行	2,100
	31	8349 東北銀行	100
	32	8350 みちのく銀行	200
	33	8354 ふくおかフィナンシャルグループ	10,000
	34	8355 静岡銀行	6,000
	35	8356 十六銀行	300
	36	8358 スルガ銀行	2,400
	37	8359 八十二銀行	4,300
	38	8360 山梨中央銀行	1,000
	39	8361 大垣共立銀行	400
	40	8362 福井銀行	200
	41	8363 北國銀行	300
	42	8364 清水銀行	100
	43	8366 滋賀銀行	2,000
	44	8367 南都銀行	300
	45	8368 百五銀行	2,300
	46	8369 京都銀行	900
	47	8370 紀陽銀行	900
	48	8377 ほくほくフィナンシャルグループ	1,600
	49	8379 広島銀行	3,500
	50	8381 山陰合同銀行	1,400

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	8382	中国銀行	1,700
52	8383	鳥取銀行	100
53	8385	伊予銀行	3,400
54	8386	百十四銀行	3,000
55	8387	四国銀行	400
56	8388	阿波銀行	2,000
57	8392	大分銀行	100
58	8393	宮崎銀行	200
59	8395	佐賀銀行	100
60	8396	十八銀行	1,000
61	8397	沖縄銀行	200
62	8399	琉球銀行	500
63	8410	セブン銀行	9,000
64	8411	みずほフィナンシャルグループ	325,200
65	8416	高知銀行	100
66	8418	山口フィナンシャルグループ	3,000
67	8521	長野銀行	100
68	8522	名古屋銀行	200
69	8524	北洋銀行	3,600
70	8527	愛知銀行	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	8544	京葉銀行	2,000
76	8550	栃木銀行	1,200
77	8551	北日本銀行	100
78	8558	東和銀行	400
79	8562	福島銀行	200
80	8563	大東銀行	100
81	8600	トモニホールディングス	2,000
82	8713	フィデアホールディングス	2,300
83	8714	池田泉州ホールディングス	2,500

平成30年8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

19,123,646 口

2. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の純資産総額
(平成30年8月24日 現在)

25,090,408,848 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8月24日 現在)

1,312.010 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30年8月27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8月27日
追加設定日 = 平成30年8月31日

平成30年8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

12,363,737 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の純資産総額
(平成30年8月24日 現在)

189,050,299,475 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8月24日 現在)

15,290.709 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30年8月27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8月27日
追加設定日 = 平成30年8月31日

平成30年8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

675,000 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8月24日 現在)

10,494,336,279 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8月24日 現在)

15,547.16 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8月24日 現在)

-0.10 %

●「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30年8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

2,170,000 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8月24日 現在)

6,733,563,230 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8月24日 現在)

3,103.02 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8月24日 現在)

0.09 %

●「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8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

324,000 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8月24日 現在)

4,585,867,908 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8月24日 現在)

14,153.91 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8月24日 現在)

0.17 %

●「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8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

300,000 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8月24日 現在)

1,083,924,202 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8月24日 現在)

3,613.08 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8月24日 現在)

-0.18 %

●「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8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

1,090,772 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8月24日 現在)

7,590,797,584 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8月24日 現在)

6,959.11 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8月24日 現在)

0.05 %

●「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8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

547,100 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8月24日 現在)

4,111,693,133 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8月24日 現在)

7,515.43 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8月24日 現在)

-0.09 %

●「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8月27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 岡 田 美 範
(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8月24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8月24日 現在)

655,587,844 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8月24日 現在)

10,926.46 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8月24日 現在)

0.39 %

●「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8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

432,000 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8月24日 現在)

3,217,875,003 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8月24日 現在)

7,448.78 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8月24日 現在)

-0.20 %

●「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8月27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 岡 田 美 範
(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30年8月24日 現在)

337,214,414 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8月24日 現在)

4,966.34 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8月24日 現在)

-0.40 %

●「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30年8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

3,510,295 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8月24日 現在)

70,234,806,678 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8月24日 現在)

20,008.23 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30年8月27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	6,000	
銘柄数 = 150	2	2002 日清製粉グループ本社	800	
バスケット提示日 = 平成30年8月27日	3	2212 山崎製パン	600	
追加設定日 = 平成30年8月31日	4	2229 カルビー	900	
	5	2331 総合警備保障	500	
※「○」で表示した銘柄は	6	2371 カカクコム	1,500	
現金拠出で対応する銘柄です。	7	2502 アサヒグループホールディングス	1,400	
	8	2503 キリンホールディングス	5,700	
	9	2587 サントリー食品インターナショナル	1,000	
	10	2702 日本マクドナルドホールディングス	300	
	11	2801 キッコーマン	700	
	12	2802 味の素	2,200	
	13	2875 東洋水産	600	
	14	2897 日清食品ホールディングス	100	
	15	3003 ヒューリック	1,000	
	16	3231 野村不動産ホールディングス	600	
	17	3289 東急不動産ホールディングス	1,600	
	18	3401 帝人	900	
	19	3402 東レ	6,800	
	20	3405 クラレ	1,900	
	21	3407 旭化成	9,300	
	22	3436 SUMCO	700	
	23	4005 住友化学	8,000	
	24	4063 信越化学工業	1,800	
	25	4118 カネカ	1,000	
	26	4182 三菱瓦斯化学	800	
	27	4183 三井化学	500	
	28	4188 三菱ケミカルホールディングス	7,900	
	29	4204 積水化学工業	2,400	
	30	4217 日立化成	700	
	31	4307 野村総合研究所	900	
	32	4324 電通	1,000	
	33	4452 花王	5,200	
	34	4502 武田薬品工業	2,400	
	35	4503 アステラス製薬	22,600	
	36	4506 大日本住友製薬	900	
	37	4507 塩野義製薬	2,600	
	38	4508 田辺三菱製薬	1,300	
	39	4519 中外製薬	1,400	
	40	4523 エーザイ	1,300	
	41	4528 小野薬品工業	2,100	
	42	4530 久光製薬	400	○
	43	4536 参天製薬	2,400	
	44	4543 テルモ	1,000	
	45	4568 第一三共	1,900	
	46	4578 大塚ホールディングス	2,100	
	47	4689 ヤフー	14,300	
	48	4704 トレンドマイクロ	1,300	
	49	4751 サイバーエージェント	800	
	50	4755 楽天	7,100	

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	2,400	
	52	4902 コニカミノルタ	1,500	
	53	4911 資生堂	2,300	
	54	5020 JXTGホールディングス	6,300	
	55	5101 横浜ゴム	500	
	56	5108 ブリヂストン	5,500	
	57	5233 太平洋セメント	500	
	58	5333 日本碍子	700	
	59	5334 日本特殊陶業	900	
	60	5401 新日鐵住金	1,600	
	61	5406 神戸製鋼所	700	
	62	5411 ジェイ エフ イー ホールディングス	1,100	
	63	5713 住友金属鉱山	800	
	64	5802 住友電気工業	3,400	
	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	700	
	67	6098 リクルートホールディングス	9,000	
	68	6146 ディスコ	200	
	69	6201 豊田自動織機	600	
	70	6301 小松製作所	2,800	
	71	6305 日立建機	700	
	72	6326 クボタ	5,400	
	73	6383 ダイフク	700	
	74	6448 ブラザー工業	900	
	75	6460 セガサミーホールディングス	400	
	76	6471 日本精工	1,500	
	77	6473 ジェイテクト	1,100	
	78	6479 ミネベアミツミ	1,300	
	79	6501 日立製作所	36,000	
	80	6503 三菱電機	10,900	
	81	6504 富士電機	4,000	
	82	6594 日本電産	1,000	
	83	6645 オムロン	1,500	
	84	6701 日本電気	900	
	85	6723 ルネサスエレクトロニクス	4,800	
	86	6724 セイコーエプソン	600	
	87	6752 パナソニック	6,700	
	88	6758 ソニー	7,300	
	89	6841 横河電機	1,400	
	90	6861 キーエンス	900	
	91	6869 シスメックス	2,000	
	92	6902 デンソー	2,300	
	93	6923 スタンレー電気	700	
	94	6952 カシオ計算機	1,300	
	95	6963 ローム	300	
	96	6971 京セラ	1,500	
	97	6981 村田製作所	1,000	
	98	7011 三菱重工業	1,300	
	99	7012 川崎重工業	500	
	100	7013 IHI	500	

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	7203 トヨタ自動車	8,200	
	102	7205 日野自動車	1,600	
	103	7259 アイシン精機	1,100	
	104	7261 マツダ	1,300	
	105	7282 豊田合成	300	
	106	7731 ニコン	700	
	107	7733 オリンパス	600	
	108	7751 キヤノン	5,000	
	109	7752 リコー	2,400	
	110	7912 大日本印刷	300	
	111	7974 任天堂	300	
	112	8035 東京エレクトロン	600	
	113	8113 ユニ・チャーム	2,900	
	114	8267 イオン	1,400	○
	115	8304 あおぞら銀行	400	
	116	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	29,100	
	117	8308 りそなホールディングス	14,400	
	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	2,900	
	120	8358 スルガ銀行	1,400	
	121	8410 セブン銀行	5,100	
	122	8411 みずほフィナンシャルグループ	78,600	
	123	8473 SBIホールディングス	500	
	124	8570 イオンフィナンシャルサービス	400	
	125	8591 オリックス	3,700	
	126	8593 三菱UFJリース	900	
	127	8601 大和証券グループ本社	3,900	
	128	8604 野村ホールディングス	10,000	
	129	8630 SOMPOホールディングス	1,900	
	130	8697 日本取引所グループ	6,200	
	131	8729 ソニーフィナンシャルホールディングス	1,000	
	132	8750 第一生命ホールディングス	3,900	
	133	8766 東京海上ホールディングス	2,700	
	134	8795 T&Dホールディングス	2,400	
	135	8801 三井不動産	3,400	
	136	8802 三菱地所	3,300	
	137	8905 イオンモール	600	○
	138	9005 東京急行電鉄	2,600	
	139	9202 ANAホールディングス	700	
	140	9432 日本電信電話	1,400	
	141	9433 KDDI	19,100	
	142	9437 NTTドコモ	11,200	
	143	9502 中部電力	1,100	
	144	9508 九州電力	600	
	145	9531 東京瓦斯	2,000	
	146	9532 大阪瓦斯	1,400	
	147	9602 東宝	700	○
	148	9613 エヌ・ティ・ティ・データ	2,200	
	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	2,100	

平成30年8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

35,177,014 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の純資産総額
(平成30年8月24日 現在)

63,419,364,422 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8月24日 現在)

1,802.864 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30年8月27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8月27日
追加設定日 = 平成30年8月31日

平成30年8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

8,421,206 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8月24日 現在)

8,888,542,208 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8月24日 現在)

1,055.495 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8月24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8月27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8月27日	3	1928 積水ハウス	700
追加設定日 = 平成30年8月31日	4	2914 日本たばこ産業	1,100
	5	4188 三菱ケミカルホールディングス	1,400
	6	4502 武田薬品工業	700
	7	4503 アステラス製薬	1,900
	8	5020 JXTGホールディングス	3,100
	9	5108 プリヂストーン	600
	10	5401 新日鐵住金	900
	11	5411 ジェイ エフ イー ホールディングス	500
	12	6902 デンソー	400
	13	7011 三菱重工業	300
	14	7201 日産自動車	2,300
	15	7202 いすゞ自動車	600
	16	7203 トヨタ自動車	800
	17	7261 マツダ	600
	18	7267 本田技研工業	1,500
	19	7270 SUBARU	600
	20	7751 キヤノン	1,000
	21	8001 伊藤忠商事	1,400
	22	8002 丸紅	1,600
	23	8031 三井物産	1,600
	24	8035 東京エレクトロン	100
	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	8,100
	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	25,800
	32	8591 オリックス	1,300
	33	8601 大和証券グループ本社	1,600
	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	1,700
	40	9437 NTTドコモ	1,400

平成30年8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

560,310 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8月24日 現在)

1,157,738,821 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8月24日 現在)

2,066.247 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30年8月27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8月27日
追加設定日 = 平成30年8月31日

平成30年8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

1,140,680 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8月24日 現在)

2,306,656,769 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8月24日 現在)

2,022.177 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8月24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8月27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8月27日
追加設定日 = 平成30年8月31日

平成30年8月27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 岡 田 美 範
(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8月24日 現在)

1,719,790 口

2. 『ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index』の純資産総額
(平成30年8月24日 現在)

2,209,710,206 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8月24日 現在)

1,284.872 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8月24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8月27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8月27日
追加設定日 = 平成30年8月31日