

2019年8月26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 松 下 浩 一
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2019年8月23日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(23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
23	ダイワ上場投信－東証REIT Core指数	2528	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。

上記の掲載番号3～5のファンドにおきましては、繰上償還および重大な約款変更を行うため、2019年9月12日を基準日として11月11日までを異議申立期間とした異議申立手続きを行い、繰上償還及び重大な約款変更の可否を11月18日に決定する予定です。詳細は2019年8月20日開示の『ダイワ上場投信－トピックス・コア30／東証電気機器株価指数／東証銀行業株価指数 繰上償還および重大な約款変更に係る異議申立手続きの基準日設定のお知らせ』をご参照ください。

以上

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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
(2019年8月23日 現在)

120,176,729 口

2. 『ダイワ上場投信一日経225』の純資産総額
(2019年8月23日 現在)

2,537,782,282,069 円

3. 『ダイワ上場投信一日経225』の一口あたりの純資産額
(2019年8月23日 現在)

21,117.1 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
(2019年8月23日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2019年8月26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 = 2019年8月26日
追加設定日 = 2019年8月30日

2019年8月26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 松 下 浩 一
(コード番号 1305)
問合せ先 経営企画部 岡 田 美 範
(TEL. 03-5555-4946)

『ダイワ上場投信ートピックス』に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信ートピックス』の上場受益権口数

(2019年8月23日 現在)

2,730,469,157 口

2. 『ダイワ上場投信ートピックス』の純資産総額

(2019年8月23日 現在)

4,259,577,955,867 円

3. 『ダイワ上場投信ートピックス』の一口あたりの純資産額

(2019年8月23日 現在)

1,560.02 円

4. 『ダイワ上場投信ートピックス』の一口あたりの純資産額と
『東証株価指数(TOPIX)』の終値の変動率に係る乖離率

(2019年8月23日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2019年8月26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 = 2019年8月26日
追加設定日 = 2019年8月30日

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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―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
(2019年8月23日 現在)

1,116,565 口

2. 『ダイワ上場投信―トピックス・コア30』の純資産総額
(2019年8月23日 現在)

756,321,238 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
(2019年8月23日 現在)

677.364 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
(2019年8月23日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2019年8月26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 = 2019年8月26日
追加設定日 = 2019年8月30日

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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

(2019年8月23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

(2019年8月23日 現在)

2,212,673,773 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

(2019年8月23日 現在)

2,161.447 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

(2019年8月23日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2019年8月26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 = 2019年8月26日
追加設定日 = 2019年8月30日

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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
(2019年8月23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
(2019年8月23日 現在)

567,533,866 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
(2019年8月23日 現在)

121.427 円

4. 『ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数』の一口あたりの純資産額と
『東証銀行業株価指数』の終値の変動率に係る乖離率
(2019年8月23日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2019年8月26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 = 81	2	7161 じもとホールディングス	1,600
バスケット提示日 = 2019年8月26日	3	7167 めぶきフィナンシャルグループ	12,500
追加設定日 = 2019年8月30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	4,000
	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	15,200
	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	1,100
	11	7322 三十三フィナンシャルグループ	200
	12	7327 第四北越フィナンシャルグループ	400
	13	8303 新生銀行	1,800
	14	8304 あおぞら銀行	1,300
	15	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	166,200
	16	8308 りそなホールディングス	26,500
	17	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	4,700
	18	8316 三井住友フィナンシャルグループ	17,000
	19	8331 千葉銀行	8,300
	20	8334 群馬銀行	4,800
	21	8336 武蔵野銀行	400
	22	8337 千葉興業銀行	700
	23	8338 筑波銀行	1,000
	24	8341 七十七銀行	800
	25	8342 青森銀行	200
	26	8343 秋田銀行	200
	27	8344 山形銀行	300
	28	8345 岩手銀行	200
	29	8346 東邦銀行	2,200
	30	8349 東北銀行	100
	31	8350 みちのく銀行	200
	32	8354 ふくおかフィナンシャルグループ	2,100
	33	8355 静岡銀行	6,000
	34	8356 十六銀行	300
	35	8358 スルガ銀行	2,500
	36	8359 八十二銀行	5,800
	37	8360 山梨中央銀行	300
	38	8361 大垣共立銀行	500
	39	8362 福井銀行	200
	40	8363 北國銀行	200
	41	8364 清水銀行	100
	42	8366 滋賀銀行	500
	43	8367 南都銀行	400
	44	8368 百五銀行	2,200
	45	8369 京都銀行	900
	46	8370 紀陽銀行	900
	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	2,100

ダイワ上場投信—東証銀行業株価指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
51	8383	鳥取銀行	100
52	8385	伊予銀行	3,200
53	8386	百十四銀行	300
54	8387	四国銀行	300
55	8388	阿波銀行	400
56	8392	大分銀行	100
57	8393	宮崎銀行	200
58	8395	佐賀銀行	100
59	8397	沖縄銀行	200
60	8399	琉球銀行	600
61	8410	セブン銀行	8,200
62	8411	みずほフィナンシャルグループ	328,200
63	8416	高知銀行	100
64	8418	山口フィナンシャルグループ	3,000
65	8521	長野銀行	100
66	8522	名古屋銀行	200
67	8524	北洋銀行	3,600
68	8527	愛知銀行	100
69	8530	中京銀行	100
70	8537	大光銀行	100
71	8541	愛媛銀行	300
72	8542	トマト銀行	100
73	8544	京葉銀行	1,000
74	8550	栃木銀行	1,200
75	8551	北日本銀行	100
76	8558	東和銀行	400
77	8562	福島銀行	200
78	8563	大東銀行	100
79	8600	トモニホールディングス	1,900
80	8713	フィデアホールディングス	2,300
81	8714	池田泉州ホールディングス	2,600

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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
(2019年8月23日 現在)

22,039,478 口

2. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の純資産総額
(2019年8月23日 現在)

25,743,101,168 円

3. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の一口あたりの純資産額
(2019年8月23日 現在)

1,168.045 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
(2019年8月23日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2019年8月26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 = 2019年8月26日

追加設定日 = 2019年8月30日

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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
(2019年8月23日 現在)

16,037,790 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の純資産総額
(2019年8月23日 現在)

217,185,242,487 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の一口あたりの純資産額
(2019年8月23日 現在)

13,542.093 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
(2019年8月23日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2019年8月26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 = 2019年8月26日
追加設定日 = 2019年8月30日

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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
(2019年8月23日 現在)

805,000 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
(2019年8月23日 現在)

10,498,123,933 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
(2019年8月23日 現在)

13,041.15 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
(2019年8月23日 現在)

0.16 %

●「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。

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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
(2019年8月23日 現在)

2,370,000 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
(2019年8月23日 現在)

7,413,621,490 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
(2019年8月23日 現在)

3,128.11 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
(2019年8月23日 現在)

-0.17 %

●「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。

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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

(2019年8月23日 現在)

144,000 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

(2019年8月23日 現在)

1,588,312,892 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

(2019年8月23日 現在)

11,029.95 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

(2019年8月23日 現在)

0.31 %

●「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。

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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
(2019年8月23日 現在)

390,000 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
(2019年8月23日 現在)

1,544,920,494 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
(2019年8月23日 現在)

3,961.33 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
(2019年8月23日 現在)

-0.31 %

●「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。

【「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。

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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
(2019年8月23日 現在)

11,420,168 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
(2019年8月23日 現在)

80,895,143,972 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
(2019年8月23日 現在)

7,083.53 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
(2019年8月23日 現在)

-0.09 %

●「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。

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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
(2019年8月23日 現在)

2,231,600 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
(2019年8月23日 現在)

17,803,651,891 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
(2019年8月23日 現在)

7,977.98 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
(2019年8月23日 現在)

-0.16 %

●「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。

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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
(2019年8月23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
(2019年8月23日 現在)

519,947,047 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
(2019年8月23日 現在)

8,665.78 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
(2019年8月23日 現在)

0.16 %

●「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。

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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
(2019年8月23日 現在)

162,000 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
(2019年8月23日 現在)

1,273,090,131 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
(2019年8月23日 現在)

7,858.58 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
(2019年8月23日 現在)

-0.09 %

●「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。

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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
(2019年8月23日 現在)

177,900 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
(2019年8月23日 現在)

954,307,906 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
(2019年8月23日 現在)

5,364.29 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
(2019年8月23日 現在)

-0.17 %

●「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。

2019年8月26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 松下 浩一
(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
(2019年8月23日 現在)

2,381,764 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
(2019年8月23日 現在)

42,201,104,506 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
(2019年8月23日 現在)

17,718.42 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
(2019年8月23日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2019年8月26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	1802 大林組	4,100	
銘柄数 = 150	2	1878 大東建託	800	
バスケット提示日 = 2019年8月26日	3	1925 大和ハウス工業	5,300	
追加設定日 = 2019年8月30日	4	2269 明治ホールディングス	1,000	
	5	2331 総合警備保障	500	
※「○」で表示した銘柄は	6	2371 カカクコム	1,700	
現金拠出で対応する銘柄です。	7	2433 博報堂DYホールディングス	2,500	
	8	2502 アサヒグループホールディングス	2,900	
	9	2503 キリンホールディングス	4,400	
	10	2587 サントリー食品インターナショナル	1,200	
	11	2702 日本マクドナルドホールディングス	400	
	12	2802 味の素	1,800	
	13	2897 日清食品ホールディングス	400	
	14	3003 ヒューリック	900	
	15	3401 帝人	1,000	
	16	3402 東レ	5,500	
	17	3405 クラレ	2,000	
	18	3436 SUMCO	1,800	
	19	4004 昭和電工	500	
	20	4005 住友化学	9,700	
	21	4118 カネカ	200	
	22	4151 協和キリン	900	
	23	4183 三井化学	600	
	24	4185 JSR	1,100	
	25	4188 三菱ケミカルホールディングス	7,100	
	26	4204 積水化学工業	2,500	
	27	4217 日立化成	700	
	28	4307 野村総合研究所	2,900	
	29	4324 電通	500	
	30	4452 花王	5,500	
	31	4503 アステラス製薬	25,400	
	32	4506 大日本住友製薬	1,100	
	33	4507 塩野義製薬	3,100	
	34	4508 田辺三菱製薬	1,100	
	35	4519 中外製薬	1,600	
	36	4523 エーザイ	1,800	
	37	4528 小野薬品工業	2,000	
	38	4530 久光製薬	300	○
	39	4536 参天製薬	2,500	
	40	4543 テルモ	4,600	
	41	4568 第一三共	2,300	
	42	4578 大塚ホールディングス	1,700	
	43	4581 大正製薬ホールディングス	200	
	44	4689 ヤフー	26,800	
	45	4704 トレンドマイクロ	1,500	
	46	4751 サイバーエージェント	600	
	47	4901 富士フイルムホールディングス	900	
	48	4902 コニカミノルタ	2,000	
	49	4927 ポーラ・オルビスホールディングス	700	
	50	5019 出光興産	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
51	5020	JXTGホールディングス	13,100	
52	5101	横浜ゴム	600	
53	5108	ブリヂストン	5,700	
54	5233	太平洋セメント	700	
55	5333	日本碍子	1,700	
56	5334	日本特殊陶業	1,100	
57	5401	日本製鉄	3,900	
58	5406	神戸製鋼所	300	
59	5486	日立金属	1,200	
60	5802	住友電気工業	4,300	
61	5938	LIXILグループ	200	
62	5947	リンナイ	200	
63	6146	ディスコ	300	
64	6178	日本郵政	5,500	
65	6301	小松製作所	8,200	
66	6305	日立建機	300	
67	6326	クボタ	6,100	
68	6383	ダイフク	500	
69	6448	ブラザー工業	1,300	
70	6460	セガサミーホールディングス	400	
71	6471	日本精工	1,800	
72	6479	ミネベアミツミ	2,100	
73	6501	日立製作所	7,600	
74	6503	三菱電機	9,400	
75	6504	富士電機	800	
76	6506	安川電機	2,300	○
77	6594	日本電産	800	
78	6645	オムロン	1,300	
79	6701	日本電気	700	
80	6723	ルネサスエレクトロニクス	2,900	
81	6724	セイコーエプソン	1,600	
82	6752	パナソニック	11,900	
83	6758	ソニー	9,900	
84	6857	アドバンテスト	2,300	
85	6869	シスメックス	1,700	
86	6902	デンソー	2,400	
87	6952	カシオ計算機	1,200	
88	6963	ローム	500	
89	6971	京セラ	1,100	
90	7011	三菱重工業	500	
91	7012	川崎重工業	600	
92	7013	IHI	600	
93	7182	ゆうちょ銀行	1,700	
94	7202	いすゞ自動車	3,100	
95	7203	トヨタ自動車	8,200	
96	7205	日野自動車	1,700	
97	7211	三菱自動車工業	4,300	
98	7261	マツダ	2,000	
99	7270	SUBARU	4,000	
100	7282	豊田合成	300	

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	7731 ニコン	1,800	
	102	7733 オリンパス	2,100	
	103	7751 キヤノン	5,500	
	104	7752 リコー	1,000	
	105	7912 大日本印刷	600	
	106	7974 任天堂	400	
	107	8002 丸紅	7,900	
	108	8028 ユニー・ファミリーマートホールディングス	700	○
	109	8031 三井物産	4,400	
	110	8035 東京エレクトロン	600	
	111	8058 三菱商事	3,000	
	112	8113 ユニ・チャーム	3,800	
	113	8267 イオン	1,600	○
	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	33,500	
	116	8308 りそなホールディングス	6,100	
	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	3,100	
	119	8410 セブン銀行	5,200	
	120	8411 みずほフィナンシャルグループ	74,500	
	121	8473 SBIホールディングス	800	
	122	8570 イオンフィナンシャルサービス	400	
	123	8591 オリックス	7,700	
	124	8593 三菱UFJリース	800	
	125	8601 大和証券グループ本社	3,500	
	126	8604 野村ホールディングス	7,400	
	127	8630 SOMPOホールディングス	1,800	
	128	8697 日本取引所グループ	6,600	
	129	8725 MS&ADインシュアランスグループホールディングス	4,200	
	130	8750 第一生命ホールディングス	7,500	
	131	8766 東京海上ホールディングス	4,700	
	132	8795 T&Dホールディングス	4,200	
	133	8801 三井不動産	3,800	
	134	8905 イオンモール	600	○
	135	9201 日本航空	600	
	136	9202 ANAホールディングス	400	
	137	9432 日本電信電話	3,300	
	138	9433 KDDI	13,400	
	139	9437 NTTドコモ	10,400	
	140	9502 中部電力	1,100	
	141	9503 関西電力	1,200	
	142	9506 東北電力	600	
	143	9531 東京瓦斯	1,700	
	144	9532 大阪瓦斯	1,300	
	145	9533 東邦瓦斯	200	
	146	9602 東宝	700	○
	147	9613 エヌ・ティ・ティ・データ	3,400	
	148	9783 ベネッセホールディングス	200	
	149	9831 ヤマダ電機	2,000	
	150	9984 ソフトバンクグループ	2,600	

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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

(2019年8月23日 現在)

45,010,246 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の純資産総額

(2019年8月23日 現在)

96,359,220,285 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

(2019年8月23日 現在)

2,140.829 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

(2019年8月23日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2019年8月26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 = 2019年8月26日
追加設定日 = 2019年8月30日

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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
(2019年8月23日 現在)

9,938,382 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数』の純資産総額
(2019年8月23日 現在)

8,669,699,384 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
(2019年8月23日 現在)

872.345 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
(2019年8月23日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2019年8月26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 = 2019年8月26日	3	1928 積水ハウス	600
追加設定日 = 2019年8月30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	1,200
	6	4502 武田薬品工業	1,200
	7	5020 JXTGホールディングス	3,000
	8	5108 プリヂェストーン	600
	9	5401 日本製鉄	800
	10	5411 ジェイ エフ イー ホールディングス	500
	11	6301 小松製作所	800
	12	6902 デンソー	400
	13	6954 ファナック	200
	14	7201 日産自動車	2,200
	15	7202 いすゞ自動車	600
	16	7203 トヨタ自動車	700
	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	1,300
	22	8002 丸紅	1,800
	23	8031 三井物産	1,500
	24	8035 東京エレクトロン	100
	25	8053 住友商事	1,100
	26	8058 三菱商事	1,300
	27	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,700
	28	8308 りそなホールディングス	2,000
	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	24,600
	32	8591 オリックス	1,200
	33	8601 大和証券グループ本社	1,500
	34	8725 MS&ADインシュアランスグループホールディングス	500
	35	8750 第一生命ホールディングス	1,000
	36	8766 東京海上ホールディングス	600
	37	9201 日本航空	300
	38	9433 KDDI	1,500
	39	9437 NTTドコモ	1,100
	40	9503 関西電力	700

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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
(2019年8月23日 現在)

559,509 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
(2019年8月23日 現在)

1,027,131,661 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
(2019年8月23日 現在)

1,835.773 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
(2019年8月23日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2019年8月26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	現金拠出
単位 = 1 バスケット	1	1605 国際石油開発帝石	900	
銘柄数 = 137	2	1801 大成建設	200	
バスケット提示日 = 2019年8月26日	3	1802 大林組	300	
追加設定日 = 2019年8月30日	4	1803 清水建設	300	
	5	1812 鹿島建設	100	
※「○」で表示した銘柄は	6	1878 大東建託	100	
現金拠出で対応する銘柄です。	7	1925 大和ハウス工業	600	
	8	1928 積水ハウス	300	
	9	2229 カルビー	100	
	10	2371 カカクコム	200	
	11	2502 アサヒグループホールディングス	100	
	12	2503 キリンホールディングス	300	
	13	2587 サントリー食品インターナショナル	100	
	14	2768 双日	500	
	15	2784 アルフレッサ ホールディングス	100	
	16	2802 味の素	100	
	17	2871 ニチレイ	100	
	18	3003 ヒューリック	100	
	19	3064 MonotaRO	100	
	20	3086 J. フロント リテイリング	100	○
	21	3092 ZOZO	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	500	
	26	3405 クラレ	200	
	27	3407 旭化成	1,100	
	28	3861 王子ホールディングス	200	
	29	4005 住友化学	800	
	30	4021 日産化学	100	
	31	4088 エア・ウォーター	100	
	32	4151 協和キリン	100	
	33	4185 JSR	100	
	34	4188 三菱ケミカルホールディングス	800	
	35	4205 日本ゼオン	100	
	36	4217 日立化成	100	
	37	4307 野村総合研究所	200	
	38	4321 ケネディクス	100	
	39	4403 日油	100	
	40	4452 花王	500	
	41	4502 武田薬品工業	400	
	42	4503 アステラス製薬	1,700	
	43	4506 大日本住友製薬	100	
	44	4507 塩野義製薬	300	
	45	4508 田辺三菱製薬	100	
	46	4519 中外製薬	100	
	47	4523 エーザイ	100	
	48	4536 参天製薬	200	
	49	4568 第一三共	100	
	50	4578 大塚ホールディングス	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	現金拠出
	51	4613 関西ペイント	100	
	52	4661 オリエンタルランド	100	
	53	4689 ヤフー	1,900	
	54	4716 日本オラクル	100	
	55	4739 伊藤忠テクノソリューションズ	100	
	56	4755 楽天	500	
	57	4901 富士フイルムホールディングス	100	
	58	4902 コニカミノルタ	100	
	59	4911 資生堂	300	
	60	4912 ライオン	200	
	61	5020 JXTGホールディングス	2,800	
	62	5108 ブリヂストン	400	
	63	5332 TOTO	100	
	64	5333 日本碍子	100	
	65	5334 日本特殊陶業	100	
	66	5411 ジェイ エフ イー ホールディングス	100	
	67	5486 日立金属	100	
	68	5802 住友電気工業	300	
	69	5991 日本発条	100	
	70	6005 三浦工業	100	
	71	6098 リクルートホールディングス	1,100	
	72	6301 小松製作所	600	
	73	6326 クボタ	500	
	74	6367 ダイキン工業	200	
	75	6479 ミネベアミツミ	300	
	76	6503 三菱電機	1,000	
	77	6504 富士電機	100	
	78	6594 日本電産	100	
	79	6645 オムロン	100	
	80	6724 セイコーエプソン	100	
	81	6758 ソニー	400	
	82	6770 アルプスアルパイン	100	
	83	6841 横河電機	100	
	84	6845 アズビル	100	
	85	6869 シスメックス	200	
	86	6952 カシオ計算機	100	
	87	6988 日東電工	100	
	88	7182 ゆうちょ銀行	200	
	89	7186 コンコルディア・フィナンシャルグループ	300	
	90	7211 三菱自動車工業	200	
	91	7459 メディパルホールディングス	100	
	92	7751 キヤノン	300	
	93	7752 リコー	100	
	94	7832 バンダイナムコホールディングス	200	
	95	7911 凸版印刷	100	
	96	7912 大日本印刷	100	
	97	7951 ヤマハ	100	
	98	7956 ビジョン	100	
	99	8002 丸紅	800	
	100	8031 三井物産	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	現金拠出
	101	8056 日本ユニシス	100	
	102	8058 三菱商事	200	
	103	8113 ユニ・チャーム	300	
	104	8267 イオン	100	○
	105	8303 新生銀行	100	
	106	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	3,100	
	107	8308 りそなホールディングス	1,100	
	108	8331 千葉銀行	400	
	109	8355 静岡銀行	200	
	110	8359 八十二銀行	100	
	111	8379 広島銀行	100	
	112	8411 みずほフィナンシャルグループ	5,900	
	113	8591 オリックス	800	
	114	8601 大和証券グループ本社	400	
	115	8604 野村ホールディングス	600	
	116	8630 SOMPOホールディングス	300	
	117	8697 日本取引所グループ	800	
	118	8725 MS&ADインシュアランスグループホールディングス	600	
	119	8750 第一生命ホールディングス	1,000	
	120	8795 T&Dホールディングス	600	
	121	8801 三井不動産	400	
	122	8802 三菱地所	300	
	123	8905 イオンモール	100	○
	124	9005 東京急行電鉄	100	
	125	9007 小田急電鉄	100	
	126	9143 SGホールディングス	100	
	127	9201 日本航空	100	
	128	9202 ANAホールディングス	100	
	129	9433 KDDI	1,200	
	130	9437 NTTドコモ	1,000	
	131	9502 中部電力	100	
	132	9508 九州電力	100	
	133	9531 東京瓦斯	500	
	134	9532 大阪瓦斯	300	
	135	9602 東宝	100	○
	136	9613 エヌ・ティ・ティ・データ	200	
	137	9735 セコム	100	

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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
(2019年8月23日 現在)

1,978,752 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
(2019年8月23日 現在)

3,689,911,115 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
(2019年8月23日 現在)

1,864.767 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
(2019年8月23日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2019年8月26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 = 2019年8月26日
追加設定日 = 2019年8月30日

2019年8月26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 松 下 浩 一
(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

(2019年8月23日 現在)

1,712,708 口

2. 『ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index』の純資産総額

(2019年8月23日 現在)

1,930,332,296 円

3. 『ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index』の一口あたりの純資産額

(2019年8月23日 現在)

1,127.064 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

(2019年8月23日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2019年8月26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 = 2019年8月26日
追加設定日 = 2019年8月30日

2019年8月26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 松 下 浩 一
(コード番号 2528)
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 Core指数』
に関する日々の開示事項

1. 『ダイワ上場投信－東証REIT Core指数』の上場受益権口数
(2019年8月23日 現在)

7,495,050 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT Core指数』の純資産総額
(2019年8月23日 現在)

9,193,296,484 円

3. 『ダイワ上場投信－東証REIT Core指数』の一口あたりの純資産額
(2019年8月23日 現在)

1,226.582 円

4. 『ダイワ上場投信－東証REIT Core指数』の一口あたりの純資産額と
『東証REIT Core 指数』の終値の変動率に係る乖離率
(2019年8月23日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2019年8月26日 現在)

[掲載番号:23]

ダイワ上場投信－東証REIT Core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 = 2019年8月26日
追加設定日 = 2019年8月30日