

各 位

会社名 日興アセットマネジメント株式会社
 (管理会社コード: 13084)
 代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
 問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
 (TEL 03 - 6447 - 6627)

上場ETF (管理会社:日興アセットマネジメント)に関する日々の開示事項

日興アセットマネジメント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
 2020年9月25日現在の状況をご報告します。

上場 ETF 銘柄 (28銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	上場インデックスファンド225	1330	東
2	上場インデックスファンドTOPIX	1308	東
3	上場インデックスファンド中国A株(パンダ)E Fund CSI300	1322	東
4	上場インデックスファンドJリート(東証REIT指数)隔月分配型	1345	東
5	上場インデックスファンド海外債券(FTSE WGBI)毎月分配型	1677	東
6	上場インデックスファンド海外先進国株式 (MSCI-KOKUSAI)	1680	東
7	上場インデックスファンド海外新興国株式 (MSCIエマージング)	1681	東
8	上場インデックスファンド日本高配当(東証配当フォーカス100)	1698	東
9	上場インデックスファンド米国株式 (S&P500)	1547	東
10	上場インデックスファンド世界株式 (MSCI ACWI) 除く日本	1554	東
11	上場インデックスファンド豪州リート(S&P/ASX200 A-REIT)	1555	東
12	上場インデックスファンド新興国債券	1566	東
13	上場インデックスファンド日経225(ミニ)	1578	東
14	上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financials	1586	東
15	上場インデックスファンドJPX日経インデックス400	1592	東
16	上場インデックスファンド日経レバレッジ指数	1358	東
17	上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティ	1399	東
18	上場インデックスファンド日本経済貢献株	1481	東
19	上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジなし)	1486	東
20	上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジあり)	1487	東
21	上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティ(β ヘッジ)	1490	東
22	上場インデックスファンドアジアリート	1495	東
23	上場インデックスファンド米国株式(S&P500)為替ヘッジあり	2521	東
24	上場インデックスファンドJリート(東証REIT指数)隔月分配型(ミニ)	2552	東
25	上場インデックスファンド米国株式(ダウ平均)為替ヘッジあり	2562	東
26	上場インデックスファンド日経ESGリート	2566	東
27	上場インデックスファンド米国株式(NASDAQ100)為替ヘッジなし	2568	東
28	上場インデックスファンド米国株式(NASDAQ100)為替ヘッジあり	2569	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、各銘柄の状況が表示されます。

以 上

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1330)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド225に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (2020年9月25日現在)

127,919,823 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

3,044,626,090,800 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

23,801 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と日経225株価指数の終値の変動率に係る乖離率

(2020年9月25日現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経225株価指数の終値}}{\text{前営業日の日経225株価指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:1]

上場インデックスファンド225 PCF (ユニット株式)

[2020/09/28 は設定交換申込不可日のため開示を行いません]

設定のお申込みに関しましては、お申し込み不可日であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される日については、受益証券の取得のお申込みを受付ける場合があります。

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1308)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンドTOPIXに関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (2020年9月25日現在)

3,512,646,233 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

5,847,596,410,509 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

1,664.73 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と東証株価指数の終値の変動率に係る乖離率
(2020年9月25日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{東証株価指数の終値}}{\text{前営業日の東証株価指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:2]

上場インデックスファンドTOPIX PCF (ユニット株式)

[2020/09/28 は設定交換申込不可日のため開示を行いません]

設定のお申込みに関しましては、お申し込み不可日であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される日については、受益証券の取得のお申込みを受付ける場合があります。

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1322)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド中国A株(パンダ)E Fund CSI300に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

340,020 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

2,321,803,043 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

6,828 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と円換算したCSI300指数の終値の変動率に係る乖離率

(2020年9月25日現在)

0.23%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したCSI300指数の終値}}{\text{前営業日の円換算したCSI300指数の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1345)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンドリート(東証REIT指数)隔月分配型に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

119,708,188 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

209,520,385,791 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

1,750.26 円

4. 上場ETF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

(2020年9月25日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{東証REIT指数の終値}}{\text{前営業日の東証REIT指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:4]

上場インデックスファンドJリート PCF (ユニット投資口)

[2020/09/28 申込分]

NO.	銘柄コード	銘柄名	投資口数
1	2971	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	4
2	2972	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	6
3	2979	SOSiLA物流リート投資法人 投資証券	5
4	3226	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	8
5	3227	MCUBS MidCity投資法人 投資証券	29
6	3234	森ヒルズリート投資法人 投資証券	28
7	3249	産業ファンド投資法人 投資証券	33
8	3269	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	22
9	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	15
10	3279	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	12
11	3281	GLP投資法人 投資証券	67
12	3282	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	10
13	3283	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	35
14	3287	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	4
15	3290	Oneリート投資法人 投資証券	4
16	3292	イオンリート投資法人 投資証券	24
17	3295	ヒューリックリート投資法人 投資証券	19
18	3296	日本リート投資法人 投資証券	8
19	3298	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	150
20	3309	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	69
21	3451	トーセイ・リート投資法人 投資証券	5
22	3453	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	9
23	3455	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	5
24	3459	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	5
25	3462	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	76
26	3463	いちごホテルリート投資法人 投資証券	4
27	3466	ラサールロジポート投資法人 投資証券	26
28	3468	スターアジア不動産投資法人 投資証券	24
29	3470	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	2
30	3471	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	7
31	3472	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	4
32	3476	投資法人みらい 投資証券	25
33	3478	森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	5
34	3481	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	5
35	3487	CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	6
36	3488	ザイマックス・リート投資法人 投資証券	4
37	3492	タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	7
38	3493	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	7
39	8951	日本ビルファンド投資法人 投資証券	23
40	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	23
41	8953	日本リテールファンド投資法人 投資証券	44
42	8954	オリックス不動産投資法人 投資証券	47
43	8955	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	15
44	8956	プレミア投資法人 投資証券	21
45	8957	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	16
46	8958	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	16
47	8960	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	50
48	8961	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	17
49	8963	インヴェンシブル投資法人 投資証券	98
50	8964	フロンティア不動産投資法人 投資証券	8
51	8966	平和不動産リート投資法人 投資証券	15

52	8967	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	15
53	8968	福岡リート投資法人 投資証券	12
54	8972	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	7
55	8975	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	19
56	8976	大和証券オフィス投資法人 投資証券	5
57	8977	阪急阪神リート投資法人 投資証券	11
58	8979	スターツプロシード投資法人 投資証券	4
59	8984	大和ハウスリート投資法人 投資証券	33
60	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	75
61	8986	大和証券リビング投資法人 投資証券	30
62	8987	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	22

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1677)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド海外債券 (FTSE WGBI) 毎月分配型に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (2020年9月25日現在)

612,200 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

31,331,939,271 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

51,179 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の終値の変動率に係る乖離率
(2020年9月25日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{WGBI指数の終値}}{\text{前営業日のWGBI指数の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1680)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド海外先進国株式 (MSCI-KOKUSAI)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (2020年9月25日現在)

5,545,020 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

14,098,962,333 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

2,542.64 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
円換算したMSCI-KOKUSAIインデックスの終値の変動率に係る乖離率

(2020年9月25日現在)

0.11%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したMSCI-KOKUSAIインデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したMSCI-KOKUSAIインデックスの終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1681)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド海外新興国株式 (MSCIエマージング)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (2020年9月25日現在)

4,316,630 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

6,112,889,251 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

1,416.13 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
円換算したMSCI-エマージング・マーケットインデックスの終値の変動率に係る乖離率

(2020年9月25日現在)

0.33%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したMSCI-エマージング・マーケットインデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したMSCI-エマージング・マーケットインデックスの終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1698)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド日本高配当(東証配当フォーカス100)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

7,599,241 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

10,723,893,480 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

1,411.18 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と東証配当フォーカス100指数の終値の変動率に係る乖離率

(2020年9月25日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{東証配当フォーカス100指数の終値}}{\text{前営業日の東証配当フォーカス100指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:8]

上場インデックスファンド日本高配当(東証配当フォーカス100) PCF(ユニット株式)

[2020/09/28 は設定交換申込不可日のため開示を行いません]

設定のお申込みに関しましては、お申し込み不可日であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される日については、受益証券の取得のお申込みを受付ける場合があります。

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1547)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド米国株式 (S&P500)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (2020年9月25日現在)

4,859,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

18,132,613,521 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

3,731.76 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と円換算したS&P500指数の終値の変動率に係る乖離率

(2020年9月25日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したS\&P500指数の終値}}{\text{前営業日の円換算したS\&P500指数の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1554)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド世界株式 (MSCI ACWI) 除く日本に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (2020年9月25日現在)

1,956,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

4,212,900,913 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

2,153.83 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と

円換算したMSCI ACWI ex Japanインデックスの終値の変動率に係る乖離率

(2020年9月25日現在)

0.15%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したMSCI ACWI ex Japanインデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したMSCI ACWI ex Japanインデックスの終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1555)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド豪州リート(S&P/ASX200 A-REIT)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

8,780,830 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

11,308,094,265 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

1,287.82 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
円換算したS&P/ASX200 A-REIT指数の終値の変動率に係る乖離率

(2020年9月25日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したS\&P/ASX200 A-REIT指数の終値}}{\text{前営業日の円換算したS\&P/ASX200 A-REIT指数の終値}} \right) \times 100$$

2020年9月28日

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1566)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド新興国債券に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

443,400 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

19,076,843,313 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

43,024 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と円換算したブルームバーグ・バークレイズ自国通貨建て新興市場国債・10%国キャップ・インデックスの終値の変動率に係る乖離率

(2020年9月25日現在)

0.62%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したブルームバーグ・バークレイズ自国通貨建て新興市場国債・10\%国キャップ・インデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したブルームバーグ・バークレイズ自国通貨建て新興市場国債・10\%国キャップ・インデックスの終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1578)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド日経225(ミニ)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

4,350,180 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

8,036,461,440 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

1,847.4 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と日経225株価指数の終値の変動率に係る乖離率

(2020年9月25日現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経225株価指数の終値}}{\text{前営業日の日経225株価指数の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1586)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financialsに関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (2020年9月25日現在)

12,762,514 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

18,501,968,842 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

1,449.7 円

4. 上場ETF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
(2020年9月25日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{TOPIX Ex-Financialsの終値}}{\text{前営業日のTOPIX Ex-Financialsの終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1592)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンドJPX日経インデックス400に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (2020年9月25日現在)

176,094,914 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

236,458,473,367 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

1,342.8 円

4. 上場ETF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
(2020年9月25日現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{JPX日経インデックス 400の終値}}{\text{前営業日のJPX日経インデックス 400の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1358)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド日経レバレッジ指数に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (2020年9月25日現在)

121,582 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

2,324,978,032 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

19,123 円

4. 上場ETF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
(2020年9月25日現在)

0.02%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経平均レバレッジ・インデックスの終値}}{\text{前営業日の日経平均レバレッジ・インデックスの終値}} \right) \times 100$$

※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

・日経平均レバレッジ・インデックスは、前営業日に対する当該営業日の騰落率が、同期間の日経平均株価の騰落率の2倍となるよう計算されます。しかしながら、2営業日以上離れた期間における日経平均レバレッジ・インデックスの騰落率は、複利効果により、一般に日経平均株価の2倍とはならず、計算上、差が生じます。

・2営業日以上離れた期間における日経平均レバレッジ・インデックスの騰落率と日経平均株価の騰落率の2倍との差は、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。ただし一般に、一定のレンジ内で日経平均株価の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、日経平均レバレッジ・インデックスの指数値は逡減する可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差が大きくなる傾向があります。

※日経平均レバレッジ・インデックスと基準価額の主なカイ離要因

当ファンドは、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に一致させることをめざしますが、次のような要因があるため、同指数と一致した推移をすることをお約束できるものではありません。

・株価指数先物取引の値動きと日経平均株価の値動きが一致しないこと。また、投資対象とする上場インデックスファンド225などの上場投資信託証券の値動きと日経平均株価の値動きが一致しないこと。

・日々の追加設定・解約などに対応した株価指数先物取引や投資対象とする上場インデックスファンド225などの上場投資信託証券の約定価格と評価価格(終値)に差が生じること。

・日経平均株価の採用銘柄の変更や資本異動などによってポートフォリオの調整が行なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、信託報酬、売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。

・組入銘柄の配当金や有価証券の貸付による品貸料が発生すること。

※金融商品取引所で取引される市場価格と基準価額のカイ離

・当ファンドは東京証券取引所に上場され公に取引されますが、市場価格は、主に当ファンドの需要、当ファンドの運用成果および投資者が代替的な投資と比較して当ファンドが全般的にどの程度魅力的であるか、などの評価に左右されます。したがって、当ファンドの市場価格が、基準価額を下回って取引されるかまたは上回って取引されるかは予測することはできません。

2020年9月28日

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1399)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティに関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

5,591,602 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

7,530,390,401 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

1,346.73 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とMSCIジャパンIMIカスタム高流動性高利回り
低ボラティリティ指数の終値の変動率に係る乖離率

(2020年9月25日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{MSCIジャパンIMIカスタム高流動性高利回り低ボラティリティ指数の終値}}{\text{前営業日のMSCIジャパンIMIカスタム高流動性高利回り低ボラティリティ指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:17]

上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティ PCF (ユニット株式)

[2020/09/28 は設定交換申込不可日のため開示を行いません]

設定のお申込みに関しましては、お申し込み不可日であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される日については、受益証券の取得のお申込みを受付ける場合があります。

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1481)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド日本経済貢献株に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

1,583,690 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

2,566,530,325 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

1,620.6 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とJPX/S&P 設備・人材投資指数の終値の変動率に係る乖離率
(2020年9月25日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{JPX/S\&P 設備・人材投資指数の終値}}{\text{前営業日のJPX/S\&P 設備・人材投資指数の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1486)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジなし)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

986,900 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

21,690,619,200 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

21,979 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とS&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て)の
終値の変動率に係る乖離率

(2020年9月25日現在)

0.03%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{S\&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て)の終値}}{\text{前営業日のS\&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て)の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1487)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジあり)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

401,592 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

7,909,390,379 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

19,695 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とS&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て、円ヘッジ)の
終値の変動率に係る乖離率

(2020年9月25日現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{S\&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て、円ヘッジ)の終値}}{\text{前営業日のS\&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て、円ヘッジ)の終値}} \right) \times 100$$

< 価格形成及び為替ヘッジがない場合との差異 >

対象指標は、「円建て為替ヘッジなし指数」の投資成果について、為替変動の影響を低減するために100%の円ヘッジを行った場合の投資成果を表します。そのため、「現地通貨建て為替ヘッジなし指数」と類似の値動きをします。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。また、対象指標には為替ヘッジコストが反映されるため、「現地通貨建て為替ヘッジなし指数」との投資成果に差異が生じます。

< 為替ヘッジコストについて >

為替ヘッジには、対象通貨との金利差分等の為替ヘッジコストが発生する場合があります。例えば円ヘッジを行う場合、円の金利が為替ヘッジを行う通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替及び金利の動向等によっては、為替ヘッジに伴うヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。

< 留意すべき投資スタイル等 >

為替変動損益は為替ヘッジによって基本的には相殺されるため、円建ての投資成果については為替変動の影響を低減した値動きとなります。

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
 代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
 (コード番号 1490)
 問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
 (TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティ(β ヘッジ)に関する
 日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (2020年9月25日現在)

845,535 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

6,805,067,840 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

8,048 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
 MSCIジャパンIMIカスタムロングショート戦略85%+円キャッシュ15%指数の終値の変動率に係る乖離率
 (2020年9月25日現在)

0.11%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{MSCIジャパンIMIカスタムロングショート戦略85\%+円キャッシュ15\%指数の終値}}{\text{前営業日のMSCIジャパンIMIカスタムロングショート戦略85\%+円キャッシュ15\%指数の終値}} \right) \times 100$$

< 指数の特性 >

ベータヘッジを行なうことにより、指標の変動率が株式市場全体の変動率に対して中立的となることをめざしています。

< 原指数(MSCIジャパンIMIカスタム高流動性高利回り低ボラティリティ指数)との相違 >

原指数に比べて、株式市場全体の動きに影響されにくく、また、日々の値動きが小さくなる傾向があります。このため、原指数に比べて、利益・損失の額が小さくなる傾向があります。

< 留意すべき投資スタイル >

株式市場全体の下落による損失を軽減させる効果が期待できる反面、株式市場全体の上昇による収益機会も限定されることがあります。したがって、株式市場全体の値動きを捉えることをめざす投資家や、短期的な収益獲得をめざす投資家は、期待する投資成果が得られにくいいため、留意が必要です。

※当ファンドの詳細な内容については、以下の当社HPをご覧ください。

www.nikkoam.com/products/etf/lineup/msci-jbeta

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 1495)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンドアジアリートに関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

252,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

2,426,426,304 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

9,629 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
FTSE EPRA/NAREIT アジア(除く日本)リート10%キャップ指数の終値の変動率に係る乖離率
(2020年9月25日現在)

0.31%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{FTSE EPRA/NAREIT アジア(除く日本)リート10\%キャップ指数の終値}}{\text{前営業日のFTSE EPRA/NAREIT アジア(除く日本)リート10\%キャップ指数の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 2521)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド米国株式(S&P500)為替ヘッジありに関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

24,110,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

27,433,510,867 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

1,137.85 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と円換算したS&P500指数(円ヘッジ)の終値の変動率に係る乖離率
(2020年9月25日現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算したS\&P500指数(円ヘッジ)の終値}}{\text{前営業日の円換算したS\&P500指数(円ヘッジ)の終値}} \right) \times 100$$

<価格形成及び為替ヘッジがない場合との差異>

対象指標は、「円建て為替ヘッジなし指数」の投資成果について、為替変動の影響を低減するために100%の円ヘッジを行った場合の投資成果を表します。そのため、「現地通貨建て為替ヘッジなし指数」と類似の値動きをします。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。また、対象指標には為替ヘッジコストが反映されるため、「現地通貨建て為替ヘッジなし指数」との投資成果に差異が生じます。

<為替ヘッジコストについて>

為替ヘッジには、対象通貨との金利差分等の為替ヘッジコストが発生する場合があります。例えば円ヘッジを行う場合、円の金利が為替ヘッジを行う通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替及び金利の動向等によっては、為替ヘッジに伴うヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。

<留意すべき投資スタイル等>

為替変動損益は為替ヘッジによって基本的には相殺されるため、円建ての投資成果については為替変動の影響を低減した値動きとなります。

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 2552)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンドJリート(東証REIT指数)隔月分配型(ミニ)に関する 日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

4,762,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

8,819,832,654 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

1,852.1 円

4. 上場ETF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

(2020年9月25日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{東証REIT指数の終値}}{\text{前営業日の東証REIT指数の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 2562)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド米国株式(ダウ平均)為替ヘッジありに関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

1,860,400 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

4,309,122,610 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

2,316.23 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と
ダウ・ジョーンズ工業株価平均(TTM、円建て、円ヘッジ)の終値の変動率に係る乖離率
(2020年9月25日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{ダウ・ジョーンズ工業株価平均(TTM、円建て、円ヘッジ)の終値}}{\text{前営業日のダウ・ジョーンズ工業株価平均(TTM、円建て、円ヘッジ)の終値}} \right) \times 100$$

<価格形成及び為替ヘッジがない場合との差異>

対象指標は、「円建て為替ヘッジなし指数」の投資成果について、為替変動の影響を低減するために100%の円ヘッジを行った場合の投資成果を表します。そのため、「現地通貨建て為替ヘッジなし指数」と類似の値動きをします。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。また、対象指標には為替ヘッジコストが反映されるため、「現地通貨建て為替ヘッジなし指数」との投資成果に差異が生じます。

<為替ヘッジコストについて>

為替ヘッジには、対象通貨との金利差分等の為替ヘッジコストが発生する場合があります。例えば円ヘッジを行う場合、円の金利が為替ヘッジを行う通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替及び金利の動向等によっては、為替ヘッジに伴うヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。

<留意すべき投資スタイル等>

為替変動損益は為替ヘッジによって基本的には相殺されるため、円建ての投資成果については為替変動の影響を低減した値動きとなります。

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 2566)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド日経ESGリートに関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

4,905,200 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

4,759,322,709 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

970.26 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と日経ESG-REIT指数の終値の変動率に係る乖離率
(2020年9月25日現在)

△ 0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経ESG-REIT指数の終値}}{\text{前営業日の日経ESG-REIT指数の終値}} \right) \times 100$$

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定

(別紙参照)

[掲載番号:26]

上場インデックスファンド日経ESGリート PCF(ユニット投資口)

[2020/09/28 申込分]

NO.	銘柄コード	銘柄名	株数(株)
1	2971	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	2
2	2972	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	2
3	3226	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	3
4	3227	MCUBS MidCity投資法人 投資証券	15
5	3234	森ヒルズリート投資法人 投資証券	14
6	3249	産業ファンド投資法人 投資証券	16
7	3269	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	10
8	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	7
9	3279	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	6
10	3281	GLP投資法人 投資証券	31
11	3282	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	5
12	3283	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	20
13	3287	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	1
14	3290	Oneリート投資法人 投資証券	1
15	3292	イオンリート投資法人 投資証券	13
16	3295	ヒューリックリート投資法人 投資証券	10
17	3296	日本リート投資法人 投資証券	3
18	3298	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	65
19	3309	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	31
20	3451	トーセイ・リート投資法人 投資証券	2
21	3453	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	4
22	3455	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	2
23	3459	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	4
24	3462	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	39
25	3463	いちごホテルリート投資法人 投資証券	2
26	3466	ラサールロジポート投資法人 投資証券	11
27	3468	スターアジア不動産投資法人 投資証券	10
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	2
29	3472	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	1
30	3476	投資法人みらい 投資証券	9
31	3478	森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	3
32	3481	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	2
33	3487	CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2
34	3488	ザイマックス・リート投資法人 投資証券	1
35	3492	タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	3
36	3493	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	4
37	8951	日本ビルファンド投資法人 投資証券	12
38	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	11
39	8953	日本リテールファンド投資法人 投資証券	20
40	8954	オリックス不動産投資法人 投資証券	21
41	8955	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	8
42	8956	プレミア投資法人 投資証券	10
43	8957	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	7
44	8958	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	7
45	8960	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	24
46	8961	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	10
47	8963	インヴィンシブル投資法人 投資証券	35
48	8964	フロンティア不動産投資法人 投資証券	4
49	8966	平和不動産リート投資法人 投資証券	7
50	8967	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	7
51	8968	福岡リート投資法人 投資証券	6

52	8972	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	3
53	8975	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	11
54	8976	大和証券オフィス投資法人 投資証券	4
55	8977	阪急阪神リート投資法人 投資証券	5
56	8979	スターツプロシード投資法人 投資証券	1
57	8984	大和ハウスリート投資法人 投資証券	16
58	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証	33
59	8986	大和証券リビング投資法人 投資証券	15
60	8987	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	10

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 2568)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド米国株式(NASDAQ100)為替ヘッジなしに関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

50,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

99,005,474 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

1,980.11

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とNASDAQ100指数(円換算ベース)の終値の変動率に係る乖離率
(2020年9月25日現在)

△ 0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{NASDAQ100指数(円換算ベース)の終値}}{\text{前営業日のNASDAQ100指数(円換算ベース)の終値}} \right) \times 100$$

各 位

管理会社名 日興アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 安倍 秀雄
(コード番号 2569)
問合せ先 事務企画部 菊原 美緒
(TEL 03 - 6447 - 6627)

上場インデックスファンド米国株式(NASDAQ100)為替ヘッジありに関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年9月25日現在)

50,000 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月25日現在)

98,344,105 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月25日現在)

1,966.88

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とNASDAQ100指数(円建て、円ヘッジ)の終値の変動率に係る乖離率
(2020年9月25日現在)

0.05%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{NASDAQ100指数(円建て、円ヘッジ)の終値}}{\text{前営業日のNASDAQ100指数(円建て、円ヘッジ)の終値}} \right) \times 100$$

< 価格形成及び為替ヘッジがない場合との差異 >

対象指標は、「円建て為替ヘッジなし指数」の投資成果について、為替変動の影響を低減するために100%の円ヘッジを行った場合の投資成果を表します。そのため、「現地通貨建て為替ヘッジなし指数」と類似の値動きをします。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。また、対象指標には為替ヘッジコストが反映されるため、「現地通貨建て為替ヘッジなし指数」との投資成果に差異が生じます。

< 為替ヘッジコストについて >

為替ヘッジには、対象通貨との金利差分等の為替ヘッジコストが発生する場合があります。例えば円ヘッジを行う場合、円の金利が為替ヘッジを行う通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替及び金利の動向等によっては、為替ヘッジに伴うヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。

< 留意すべき投資スタイル等 >

為替変動損益は為替ヘッジによって基本的には相殺されるため、円建ての投資成果については為替変動の影響を低減した値動きとなります。