

2019年11月25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11月22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、2019年12月19日に東京証券取引所において上場廃止となり、2019年12月20日に繰上償還することが決定しております。なお、取引所での最終売買日は2019年12月18日です。詳細は2019年11月18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(確定)のお知らせ』をご参照ください。

以上

2019年11月25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11月22日 現在)

118,068,991 口

2. 『ダイワ上場投信一日経225』の純資産総額

(2019年11月22日 現在)

2,804,042,220,270 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11月22日 現在)

23,749.2 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11月22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11月25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 = 2019年11月25日	3	1605 国際石油開発帝石	800
追加設定日 = 2019年11月29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	1,000
	10	1925 大和ハウス工業	2,000
	11	1928 積水ハウス	2,000
	12	1963 日揮ホールディングス	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	1,000
	16	2413 エムスリー	4,800
	17	2432 ディー・エヌ・エー	600
	18	2501 サッポロホールディングス	400
	19	2502 アサヒグループホールディングス	2,000
	20	2503 キリンホールディングス	2,000
	21	2531 宝ホールディングス	2,000
	22	2768 双日	200
	23	2801 キッコーマン	2,000
	24	2802 味の素	2,000
	25	2871 ニチレイ	1,000
	26	2914 日本たばこ産業	2,000
	27	3086 J. フロント リテイリング	1,000
	28	3099 三越伊勢丹ホールディングス	2,000
	29	3101 東洋紡	200
	30	3103 ユニチカ	200
	31	3105 日清紡ホールディングス	2,000
	32	3289 東急不動産ホールディングス	2,000
	33	3382 セブン&アイ・ホールディングス	2,000
	34	3401 帝人	400
	35	3402 東レ	2,000
	36	3405 クラレ	2,000
	37	3407 旭化成	2,000
	38	3436 SUMCO	200
	39	3861 王子ホールディングス	2,000
	40	3863 日本製紙	200
	41	4004 昭和電工	200
	42	4005 住友化学	2,000
	43	4021 日産化学	2,000
	44	4042 東ソー	1,000
	45	4043 トクヤマ	400
	46	4061 デンカ	400
	47	4063 信越化学工業	2,000
	48	4151 協和キリン	2,000
	49	4183 三井化学	400
	50	4188 三菱ケミカルホールディングス	1,000

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
51	4208	宇部興産	200
52	4272	日本化薬	2,000
53	4324	電通	2,000
54	4452	花王	2,000
55	4502	武田薬品工業	2,000
56	4503	アステラス製薬	10,000
57	4506	大日本住友製薬	2,000
58	4507	塩野義製薬	2,000
59	4519	中外製薬	2,000
60	4523	エーザイ	2,000
61	4543	テルモ	8,000
62	4568	第一三共	2,000
63	4578	大塚ホールディングス	2,000
64	4631	DIC	200
65	4689	Zホールディングス	800
66	4704	トレンドマイクロ	2,000
67	4751	サイバーエージェント	400
68	4755	楽天	2,000
69	4901	富士フイルムホールディングス	2,000
70	4902	コニカミノルタ	2,000
71	4911	資生堂	2,000
72	5019	出光興産	800
73	5020	JXTGホールディングス	2,000
74	5101	横浜ゴム	1,000
75	5108	ブリヂストン	2,000
76	5201	AGC	400
77	5202	日本板硝子	200
78	5214	日本電気硝子	600
79	5232	住友大阪セメント	200
80	5233	太平洋セメント	200
81	5301	東海カーボン	2,000
82	5332	TOTO	1,000
83	5333	日本碍子	2,000
84	5401	日本製鉄	200
85	5406	神戸製鋼所	200
86	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	200
87	5541	大太平洋金属	200
88	5631	日本製鋼所	400
89	5703	日本軽金属ホールディングス	2,000
90	5706	三井金属鉱業	200
91	5707	東邦亜鉛	200
92	5711	三菱マテリアル	200
93	5713	住友金属鉱山	1,000
94	5714	DOWAホールディングス	400
95	5801	古河電気工業	200
96	5802	住友電気工業	2,000
97	5803	フジクラ	2,000
98	5901	東洋製罐グループホールディングス	2,000
99	6098	リクルートホールディングス	6,000
100	6103	オークマ	400

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	6113 アマダホールディングス	2,000
	102	6178 日本郵政	2,000
	103	6301 小松製作所	2,000
	104	6302 住友重機械工業	400
	105	6305 日立建機	2,000
	106	6326 クボタ	2,000
	107	6361 荏原製作所	400
	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	400
	114	6503 三菱電機	2,000
	115	6504 富士電機	400
	116	6506 安川電機	2,000
	117	6645 オムロン	2,000
	118	6674 ジーエス・ユアサ コーポレーション	400
	119	6701 日本電気	200
	120	6702 富士通	200
	121	6703 沖電気工業	200
	122	6724 セイコーエプソン	4,000
	123	6752 パナソニック	2,000
	124	6758 ソニー	2,000
	125	6762 TDK	2,000
	126	6770 アルプスアルパイン	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E&Sホールディングス	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	8,000
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	7832	バンダイナムコホールディングス	2,000
158	7911	凸版印刷	1,000
159	7912	大日本印刷	1,000
160	7951	ヤマハ	2,000
161	8001	伊藤忠商事	2,000
162	8002	丸紅	2,000
163	8015	豊田通商	2,000
164	8028	ファミリーマート	8,000
165	8031	三井物産	2,000
166	8035	東京エレクトロン	2,000
167	8053	住友商事	2,000
168	8058	三菱商事	2,000
169	8233	高島屋	1,000
170	8252	丸井グループ	2,000
171	8253	クレディセゾン	2,000
172	8267	イオン	2,000
173	8303	新生銀行	200
174	8304	あおぞら銀行	200
175	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,000
176	8308	りそなホールディングス	200
177	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	200
178	8316	三井住友フィナンシャルグループ	200
179	8331	千葉銀行	2,000
180	8354	ふくおかフィナンシャルグループ	400
181	8355	静岡銀行	2,000
182	8411	みずほフィナンシャルグループ	2,000
183	8601	大和証券グループ本社	2,000
184	8604	野村ホールディングス	2,000
185	8628	松井証券	2,000
186	8630	SOMPOホールディングス	500
187	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	600
188	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	400
189	8750	第一生命ホールディングス	200
190	8766	東京海上ホールディングス	1,000
191	8795	T&Dホールディングス	400
192	8801	三井不動産	2,000
193	8802	三菱地所	2,000
194	8804	東京建物	1,000
195	8830	住友不動産	2,000
196	9001	東武鉄道	400
197	9005	東急	1,000
198	9007	小田急電鉄	1,000
199	9008	京王電鉄	400
200	9009	京成電鉄	1,000

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
201	9020	東日本旅客鉄道	200
202	9021	西日本旅客鉄道	200
203	9022	東海旅客鉄道	200
204	9062	日本通運	200
205	9064	ヤマトホールディングス	2,000
206	9101	日本郵船	200
207	9104	商船三井	200
208	9107	川崎汽船	200
209	9202	ANAホールディングス	200
210	9301	三菱倉庫	1,000
211	9412	スカパーJSATホールディングス	200
212	9432	日本電信電話	400
213	9433	KDDI	12,000
214	9437	NTTドコモ	200
215	9501	東京電力ホールディングス	200
216	9502	中部電力	200
217	9503	関西電力	200
218	9531	東京瓦斯	400
219	9532	大阪瓦斯	400
220	9602	東宝	200
221	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	10,000
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	12,000

2019年11月25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―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

(2019年11月22日 現在)

2,828,260,370 口

2. 『ダイワ上場投信―トピックス』の純資産総額

(2019年11月22日 現在)

5,016,101,021,053 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

(2019年11月22日 現在)

1,773.56 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

(2019年11月22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11月25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11月25日
追加設定日 = 2019年11月29日

2019年11月25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11月22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11月22日 現在)

854,731,724 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11月22日 現在)

765.501 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11月22日 現在)

-0.01 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2019年11月25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11月25日
追加設定日 = 2019年11月29日

2019年11月25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11月22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11月22日 現在)

2,600,664,729 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11月22日 現在)

2,540.456 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11月22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11月25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11月25日
追加設定日 = 2019年11月29日

2019年11月25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11月22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11月22日 現在)

661,927,148 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11月22日 現在)

141.623 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11月22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11月25日 現在)

[掲載番号:5]

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)

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11月25日
追加設定日 = 2019年11月29日

2019年11月25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11月22日 現在)

21,943,295 口

2. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の純資産総額
(2019年11月22日 現在)

29,050,909,879 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11月22日 現在)

1,323.908 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11月22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11月25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11月25日
追加設定日 = 2019年11月29日

2019年11月25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11月22日 現在)

16,286,236 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の純資産総額
(2019年11月22日 現在)

250,900,685,841 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11月22日 現在)

15,405.689 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11月22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11月25日 現在)

ダイワ上場投信－JPX日経400(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	1332 日本水産	600	
銘柄数 = 380	2	1333 マルハニチロ	100	
バスケット提示日 = 2019年11月25日	3	1605 国際石油開発帝石	2,200	
追加設定日 = 2019年11月29日	4	1719 安藤・間	300	
	5	1720 東急建設	200	
※「○」で表示した銘柄は	6	1721 コムシスホールディングス	200	
現金拠出で対応する銘柄です。	7	1801 大成建設	400	
	8	1802 大林組	1,300	
	9	1803 清水建設	1,300	
	10	1808 長谷工コーポレーション	500	
	11	1812 鹿島建設	1,000	
	12	1820 西松建設	100	
	13	1821 三井住友建設	300	
	14	1824 前田建設工業	300	
	15	1860 戸田建設	500	
	16	1861 熊谷組	100	
	17	1878 大東建託	200	
	18	1881 NIPPO	100	
	19	1893 五洋建設	500	
	20	1911 住友林業	300	
	21	1925 大和ハウス工業	1,300	
	22	1928 積水ハウス	1,400	
	23	1951 協和エクシオ	200	
	24	1959 九電工	100	
	25	2121 ミクシィ	100	
	26	2127 日本M&Aセンター	300	
	27	2146 UTグループ	100	
	28	2175 エス・エム・エス	100	
	29	2181 パーソルホールディングス	400	
	30	2201 森永製菓	100	
	31	2206 江崎グリコ	100	
	32	2229 カルビー	200	
	33	2267 ヤクルト本社	300	
	34	2269 明治ホールディングス	300	
	35	2282 日本ハム	200	
	36	2327 日鉄ソリューションズ	100	
	37	2331 総合警備保障	200	
	38	2337 いちご	500	
	39	2371 カカココム	300	
	40	2379 ディップ	100	
	41	2412 ベネフィット・ワン	100	
	42	2413 エムスリー	900	
	43	2427 アウトソーシング	200	
	44	2432 ディー・エヌ・エー	200	
	45	2433 博報堂DYホールディングス	500	
	46	2502 アサヒグループホールディングス	900	
	47	2503 キリンホールディングス	1,800	
	48	2587 サントリー食品インターナショナル	300	
	49	2651 ローソン	100	
	50	2670 エービーシー・マート	100	

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
	51	2702 日本マクドナルドホールディングス	200	
	52	2768 双日	2,200	
	53	2782 セリア	100	
	54	2784 アルフレッサ ホールディングス	500	
	55	2801 キッコーマン	300	
	56	2802 味の素	900	
	57	2809 キューピー	200	○
	58	2871 ニチレイ	200	
	59	2875 東洋水産	200	
	60	2897 日清食品ホールディングス	200	
	61	2914 日本たばこ産業	2,400	
	62	3003 ヒューリック	800	
	63	3038 神戸物産	100	
	64	3048 ビックカメラ	200	
	65	3064 MonotaRO	300	
	66	3086 J. フロント リテイリング	500	
	67	3088 マツモトキヨシホールディングス	200	
	68	3092 ZOZO	300	
	69	3116 トヨタ紡織	100	
	70	3141 ウエルシアホールディングス	100	
	71	3148 クリエイトSDホールディングス	100	○
	72	3167 TOKAIホールディングス	200	
	73	3197 すかいらーくホールディングス	500	
	74	3231 野村不動産ホールディングス	200	
	75	3254 プレサンスコーポレーション	100	
	76	3288 オープンハウス	100	
	77	3289 東急不動産ホールディングス	1,100	
	78	3291 飯田グループホールディングス	300	
	79	3360 シップヘルスケアホールディングス	100	
	80	3382 セブン&アイ・ホールディングス	1,600	
	81	3391 ツルハホールディングス	100	
	82	3401 帝人	300	
	83	3402 東レ	2,900	
	84	3405 クラレ	600	
	85	3407 旭化成	2,700	
	86	3436 SUMCO	500	
	87	3543 コメダホールディングス	100	
	88	3626 TIS	100	
	89	3659 ネクソン	1,200	
	90	3668 コロプラ	100	
	91	3765 ガンホー・オンライン・エンターテイメント	100	
	92	3769 GMOペイメントゲートウェイ	100	
	93	3861 王子ホールディングス	1,700	
	94	4004 昭和電工	300	
	95	4005 住友化学	3,000	
	96	4021 日産化学	200	
	97	4042 東ソー	600	
	98	4043 トクヤマ	100	
	99	4061 デンカ	100	
	100	4063 信越化学工業	700	

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
101	4088	エア・ウォーター	300	
102	4091	大陽日酸	400	
103	4151	協和キリン	400	
104	4182	三菱瓦斯化学	400	
105	4183	三井化学	400	
106	4185	JSR	400	
107	4188	三菱ケミカルホールディングス	2,700	
108	4202	ダイセル	600	
109	4204	積水化学工業	900	
110	4206	アイカ工業	100	
111	4208	宇部興産	200	
112	4217	日立化成	200	
113	4246	ダイキョーニシカワ	100	
114	4307	野村総合研究所	700	
115	4324	電通	400	
116	4403	日油	200	
117	4452	花王	1,000	
118	4502	武田薬品工業	2,600	
119	4503	アステラス製薬	3,600	
120	4506	大日本住友製薬	300	
121	4507	塩野義製薬	500	
122	4508	田辺三菱製薬	500	
123	4516	日本新薬	100	
124	4519	中外製薬	400	
125	4521	科研製薬	100	
126	4523	エーザイ	500	
127	4528	小野薬品工業	900	
128	4530	久光製薬	100	
129	4536	参天製薬	800	
130	4543	テルモ	1,200	
131	4555	沢井製薬	100	
132	4568	第一三共	1,200	
133	4578	大塚ホールディングス	800	
134	4587	ペプチドリーム	200	
135	4612	日本ペイントホールディングス	300	
136	4613	関西ペイント	500	
137	4631	DIC	200	
138	4661	オリエンタルランド	400	
139	4666	パーク24	200	
140	4681	リゾートトラスト	200	
141	4684	オービック	100	
142	4689	Zホールディングス	5,600	
143	4704	トレンドマイクロ	200	
144	4716	日本オラクル	100	○
145	4732	ユー・エス・エス	400	
146	4739	伊藤忠テクノソリューションズ	200	
147	4751	サイバーエージェント	200	
148	4755	楽天	1,800	
149	4768	大塚商会	200	
150	4819	デジタルガレージ	100	

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
151	4849	エン・ジャパン	100	
152	4902	コニカミノルタ	900	
153	4911	資生堂	800	
154	4912	ライオン	500	
155	4922	コーセー	100	
156	4927	ポーラ・オルビスホールディングス	200	
157	4967	小林製薬	100	
158	5019	出光興産	500	
159	5020	JXTGホールディングス	6,400	
160	5021	コスモエネルギーホールディングス	100	
161	5101	横浜ゴム	200	
162	5108	ブリヂストン	1,300	
163	5110	住友ゴム工業	400	
164	5201	AGC	400	
165	5233	太平洋セメント	300	
166	5301	東海カーボン	400	
167	5332	TOTO	300	
168	5333	日本碍子	500	
169	5334	日本特殊陶業	300	
170	5393	ニチアス	100	
171	5401	日本製鉄	1,800	
172	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	1,100	
173	5486	日立金属	400	
174	5703	日本軽金属ホールディングス	1,000	
175	5713	住友金属鉱山	500	
176	5714	DOWAホールディングス	100	
177	5801	古河電気工業	100	
178	5802	住友電気工業	1,500	
179	5929	三和ホールディングス	400	
180	5947	リンナイ	100	
181	5975	東プレ	100	
182	6028	テクノプロ・ホールディングス	100	
183	6098	リクルートホールディングス	2,800	
184	6113	アマダホールディングス	500	
185	6136	オーエスジー	200	○
186	6141	DMG森精機	300	
187	6146	ディスコ	100	
188	6201	豊田自動織機	300	
189	6268	ナブテスコ	200	
190	6273	SMC	100	
191	6301	小松製作所	1,900	
192	6302	住友重機械工業	200	
193	6305	日立建機	200	
194	6324	ハーモニック・ドライブ・システムズ	100	
195	6326	クボタ	2,200	
196	6367	ダイキン工業	500	
197	6383	ダイフク	200	
198	6432	竹内製作所	100	
199	6448	ブラザー工業	500	
200	6463	TPR	100	

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
201	6471	日本精工	800	
202	6473	ジェイテクト	400	
203	6479	ミネベアミツミ	800	
204	6481	THK	200	
205	6501	日立製作所	2,000	
206	6503	三菱電機	4,100	
207	6504	富士電機	200	
208	6506	安川電機	400	
209	6586	マキタ	500	
210	6594	日本電産	500	
211	6641	日新電機	100	
212	6645	オムロン	400	
213	6701	日本電気	500	
214	6702	富士通	400	
215	6723	ルネサスエレクトロニクス	2,000	
216	6724	セイコーエプソン	500	
217	6728	アルバック	100	
218	6752	パナソニック	4,700	
219	6755	富士通ゼネラル	100	
220	6758	ソニー	1,800	
221	6762	TDK	200	
222	6770	アルプスアルパイン	400	
223	6806	ヒロセ電機	100	
224	6841	横河電機	400	
225	6845	アズビル	300	
226	6849	日本光電工業	200	
227	6856	堀場製作所	100	
228	6857	アドバンテスト	300	
229	6861	キーエンス	300	
230	6869	シスメックス	300	
231	6902	デンソー	900	
232	6920	レーザーテック	100	
233	6923	スタンレー電気	300	
234	6952	カシオ計算機	400	
235	6954	ファナック	400	
236	6965	浜松ホトニクス	300	
237	6971	京セラ	600	
238	6976	太陽誘電	200	
239	6981	村田製作所	1,200	
240	6988	日東電工	300	
241	7011	三菱重工業	700	
242	7012	川崎重工業	300	
243	7013	IHI	300	
244	7148	FPG	100	
245	7164	全国保証	100	
246	7167	めぶきフィナンシャルグループ	2,100	
247	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,400	
248	7202	いすゞ自動車	1,200	
249	7203	トヨタ自動車	1,600	
250	7205	日野自動車	500	

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
	251	7259 アイシン精機	300	
	252	7261 マツダ	1,200	
	253	7267 本田技研工業	3,200	
	254	7269 スズキ	800	
	255	7270 SUBARU	1,300	
	256	7272 ヤマハ発動機	500	
	257	7276 小糸製作所	200	
	258	7282 豊田合成	100	
	259	7309 シマノ	200	
	260	7313 ティ・エス テック	100	
	261	7419 ノジマ	100	
	262	7453 良品計画	500	
	263	7458 第一興商	100	
	264	7459 メディパルホールディングス	400	
	265	7532 パン・バシフィック・インターナショナルホールディングス	1,000	
	266	7550 ゼンショーホールディングス	200	
	267	7575 日本ライフライン	100	
	268	7649 スギホールディングス	100	
	269	7701 島津製作所	500	
	270	7729 東京精密	100	
	271	7731 ニコン	700	
	272	7733 オリンパス	2,300	
	273	7735 SCREENホールディングス	100	
	274	7741 HOYA	800	
	275	7747 朝日インテック	500	
	276	7751 キヤノン	2,200	
	277	7832 バンダイナムコホールディングス	400	
	278	7846 パイロットコーポレーション	100	
	279	7867 タカラトミー	200	
	280	7951 ヤマハ	200	
	281	7956 ビジョン	200	
	282	7974 任天堂	300	
	283	7988 ニフコ	200	
	284	8001 伊藤忠商事	2,800	
	285	8002 丸紅	4,200	
	286	8015 豊田通商	500	
	287	8020 兼松	200	
	288	8028 ファミリーマート	300	
	289	8031 三井物産	3,600	
	290	8035 東京エレクトロン	300	
	291	8036 日立ハイテクノロジーズ	100	
	292	8053 住友商事	2,600	
	293	8056 日本ユニシス	100	
	294	8058 三菱商事	2,900	
	295	8088 岩谷産業	100	
	296	8111 ゴールドウイン	100	
	297	8113 ユニ・チャーム	800	
	298	8252 丸井グループ	400	
	299	8267 イオン	1,600	
	300	8273 イズミ	100	

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
	301	8282 ケーズホールディングス	400	
	302	8283 PALTAC	100	
	303	8303 新生銀行	300	
	304	8304 あおぞら銀行	200	
	305	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	20,700	
	306	8308 りそなホールディングス	4,500	
	307	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	800	
	308	8316 三井住友フィナンシャルグループ	2,700	
	309	8331 千葉銀行	1,400	
	310	8410 セブン銀行	1,400	
	311	8411 みずほフィナンシャルグループ	55,300	
	312	8439 東京センチュリー	100	
	313	8473 SBIホールディングス	500	
	314	8570 イオンフィナンシャルサービス	200	
	315	8585 オリエン트コーポレーション	1,100	
	316	8591 オリックス	2,500	
	317	8593 三菱UFJリース	1,000	
	318	8601 大和証券グループ本社	3,300	
	319	8604 野村ホールディングス	7,200	
	320	8628 松井証券	200	
	321	8630 SOMPOホールディングス	800	
	322	8697 日本取引所グループ	1,200	
	323	8725 MS&ADインシュアランスグループホールディングス	1,100	
	324	8729 ソニーフィナンシャルホールディングス	300	
	325	8750 第一生命ホールディングス	2,300	
	326	8766 東京海上ホールディングス	1,500	
	327	8795 T&Dホールディングス	1,300	
	328	8801 三井不動産	2,000	
	329	8802 三菱地所	2,900	
	330	8804 東京建物	400	
	331	8830 住友不動産	900	
	332	8850 スターツコーポレーション	100	
	333	8876 リロググループ	200	
	334	8905 イオンモール	200	
	335	9001 東武鉄道	400	
	336	9003 相鉄ホールディングス	200	
	337	9005 東急	1,000	
	338	9007 小田急電鉄	600	
	339	9008 京王電鉄	200	
	340	9009 京成電鉄	300	
	341	9020 東日本旅客鉄道	700	
	342	9021 西日本旅客鉄道	400	
	343	9022 東海旅客鉄道	300	
	344	9024 西武ホールディングス	600	
	345	9041 近鉄グループホールディングス	400	
	346	9042 阪急阪神ホールディングス	500	
	347	9045 京阪ホールディングス	200	
	348	9048 名古屋鉄道	400	
	349	9062 日本通運	100	
	350	9064 ヤマトホールディングス	700	

ダイワ上場投信－JPX日経400(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
351	9065	山九	100	
352	9086	日立物流	100	
353	9201	日本航空	700	
354	9202	ANAホールディングス	700	
355	9404	日本テレビホールディングス	300	
356	9432	日本電信電話	2,100	
357	9433	KDDI	3,000	
358	9437	NTTドコモ	3,000	
359	9502	中部電力	1,300	
360	9503	関西電力	1,600	
361	9506	東北電力	1,000	
362	9508	九州電力	900	
363	9513	電源開発	300	
364	9531	東京瓦斯	800	
365	9532	大阪瓦斯	800	
366	9602	東宝	200	
367	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	1,100	
368	9627	アインホールディングス	100	
369	9678	カナモト	100	
370	9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	200	
371	9697	カプコン	200	
372	9706	日本空港ビルデング	100	
373	9719	SCSK	100	
374	9735	セコム	400	
375	9766	コナミホールディングス	100	
376	9843	ニトリホールディングス	200	
377	9962	ミスミグループ本社	500	
378	9983	ファーストリテイリング	100	
379	9984	ソフトバンクグループ	1,900	
380	9989	サンドラッグ	200	

2019年11月25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11月22日 現在)

365,000 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11月22日 現在)

5,988,808,061 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11月22日 現在)

16,407.69 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11月22日 現在)

0.05 %

●「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11月25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11月22日 現在)

4,922,500 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11月22日 現在)

11,958,316,240 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11月22日 現在)

2,429.32 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11月22日 現在)

-0.05 %

●「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11月25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11月22日 現在)

124,000 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11月22日 現在)

1,760,551,489 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11月22日 現在)

14,198.00 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11月22日 現在)

0.11 %

●「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11月25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11月22日 現在)

610,000 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11月22日 現在)

1,840,412,146 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11月22日 現在)

3,017.07 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11月22日 現在)

-0.11 %

●「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。

2019年11月25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11月22日 現在)

10,485,168 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11月22日 現在)

65,548,393,194 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11月22日 現在)

6,251.53 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11月22日 現在)

-0.03 %

●「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11月25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11月22日 現在)

2,368,600 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11月22日 現在)

16,498,152,615 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11月22日 現在)

6,965.36 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11月22日 現在)

-0.06 %

●「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11月25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11月22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11月22日 現在)

668,332,433 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11月22日 現在)

11,138.87 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11月22日 現在)

0.09 %

●「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11月25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11月22日 現在)

202,000 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11月22日 現在)

1,386,988,078 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11月22日 現在)

6,866.28 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11月22日 現在)

-0.05 %

●「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11月25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11月22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11月22日 現在)

727,199,884 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11月22日 現在)

4,087.69 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11月22日 現在)

-0.10 %

●「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11月25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11月22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11月22日 現在)

48,079,256,769 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11月22日 現在)

20,186.41 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11月22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11月25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
単位 = 1 バスケット	1	1878 大東建託	600
銘柄数 = 150	2	1925 大和ハウス工業	4,700
バスケット提示日 = 2019年11月25日	3	2269 明治ホールディングス	700
追加設定日 = 2019年11月29日	4	2331 総合警備保障	500
	5	2433 博報堂DYホールディングス	1,500
	6	2502 アサヒグループホールディングス	3,000
	7	2503 キリンホールディングス	2,800
	8	2702 日本マクドナルドホールディングス	300
	9	2802 味の素	2,000
	10	2897 日清食品ホールディングス	300
	11	3003 ヒューリック	900
	12	3231 野村不動産ホールディングス	500
	13	3401 帝人	900
	14	3402 東レ	4,400
	15	3436 SUMCO	1,400
	16	4004 昭和電工	500
	17	4005 住友化学	7,500
	18	4151 協和キリン	800
	19	4185 JSR	700
	20	4204 積水化学工業	2,700
	21	4217 日立化成	600
	22	4307 野村総合研究所	2,900
	23	4324 電通	400
	24	4452 花王	6,700
	25	4503 アステラス製薬	21,900
	26	4506 大日本住友製薬	800
	27	4507 塩野義製薬	3,400
	28	4508 田辺三菱製薬	800
	29	4519 中外製薬	1,600
	30	4523 エーザイ	2,200
	31	4528 小野薬品工業	1,500
	32	4530 久光製薬	300
	33	4536 参天製薬	1,800
	34	4543 テルモ	4,400
	35	4568 第一三共	3,200
	36	4578 大塚ホールディングス	1,900
	37	4689 Zホールディングス	18,600
	38	4704 トレンドマイクロ	1,500
	39	4751 サイバーエージェント	600
	40	4901 富士フイルムホールディングス	1,600
	41	4902 コニカミノルタ	1,800
	42	4911 資生堂	3,200
	43	4927 ポーラ・オルビスホールディングス	500
	44	5019 出光興産	400
	45	5020 JXTGホールディングス	8,200
	46	5101 横浜ゴム	500
	47	5108 プリヂェストン	5,200
	48	5233 太平洋セメント	800
	49	5333 日本碍子	1,200
	50	5334 日本特殊陶業	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
51	5401	日本製鉄	3,400
52	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	800
53	5486	日立金属	900
54	5802	住友電気工業	4,400
55	5938	LIXILグループ	500
56	5947	リンナイ	200
57	6146	ディスコ	200
58	6178	日本郵政	2,500
59	6301	小松製作所	7,300
60	6305	日立建機	300
61	6326	クボタ	6,600
62	6383	ダイフク	1,000
63	6448	ブラザー工業	1,600
64	6460	セガサミーホールディングス	500
65	6465	ホシザキ	500
66	6471	日本精工	1,300
67	6479	ミネベアミツミ	1,100
68	6501	日立製作所	7,400
69	6503	三菱電機	9,900
70	6504	富士電機	700
71	6506	安川電機	1,800
72	6594	日本電産	600
73	6645	オムロン	500
74	6701	日本電気	1,000
75	6723	ルネサスエレクトロニクス	1,600
76	6724	セイコーエプソン	1,300
77	6752	パナソニック	16,700
78	6758	ソニー	8,600
79	6770	アルプスアルパイン	1,100
80	6857	アドバンテスト	2,100
81	6869	シスメックス	1,500
82	6902	デンソー	2,000
83	6952	カシオ計算機	1,100
84	6963	ローム	400
85	6971	京セラ	1,100
86	7011	三菱重工業	500
87	7012	川崎重工業	500
88	7013	IHI	400
89	7182	ゆうちょ銀行	1,400
90	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,700
91	7202	いすゞ自動車	2,500
92	7203	トヨタ自動車	7,700
93	7205	日野自動車	1,700
94	7211	三菱自動車工業	3,000
95	7261	マツダ	1,900
96	7270	SUBARU	3,300
97	7282	豊田合成	300
98	7731	ニコン	1,300
99	7733	オリンパス	6,400
100	7751	キヤノン	5,100

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
	101	7752 リコー	1,100
	102	7912 大日本印刷	300
	103	7974 任天堂	500
	104	8001 伊藤忠商事	8,900
	105	8002 丸紅	6,600
	106	8028 ファミリーマート	1,300
	107	8031 三井物産	3,200
	108	8035 東京エレクトロン	1,400
	109	8058 三菱商事	2,600
	110	8113 ユニ・チャーム	3,900
	111	8267 イオン	1,200
	112	8304 あおぞら銀行	400
	113	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	31,400
	114	8308 りそなホールディングス	9,400
	115	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	1,000
	116	8316 三井住友フィナンシャルグループ	2,800
	117	8410 セブン銀行	4,000
	118	8411 みずほフィナンシャルグループ	68,500
	119	8473 SBIホールディングス	900
	120	8570 イオンフィナンシャルサービス	300
	121	8591 オリックス	7,900
	122	8593 三菱UFJリース	900
	123	8601 大和証券グループ本社	3,600
	124	8604 野村ホールディングス	7,400
	125	8630 SOMPOホールディングス	2,700
	126	8697 日本取引所グループ	6,500
	127	8725 MS&ADインシュアランスグループホールディングス	3,900
	128	8750 第一生命ホールディングス	8,300
	129	8766 東京海上ホールディングス	5,500
	130	8795 T&Dホールディングス	4,100
	131	8801 三井不動産	2,400
	132	8905 イオンモール	600
	133	9143 SGホールディングス	1,000
	134	9201 日本航空	800
	135	9202 ANAホールディングス	500
	136	9432 日本電信電話	3,700
	137	9433 KDDI	7,400
	138	9437 NTTドコモ	11,400
	139	9502 中部電力	600
	140	9503 関西電力	700
	141	9506 東北電力	900
	142	9513 電源開発	300
	143	9531 東京瓦斯	1,400
	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	3,500
	148	9783 ベネッセホールディングス	200
	149	9831 ヤマダ電機	1,800
	150	9984 ソフトバンクグループ	4,900

2019年11月25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11月22日 現在)

52,851,227 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の純資産総額

(2019年11月22日 現在)

119,877,992,962 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11月22日 現在)

2,268.216 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11月22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11月25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11月25日
追加設定日 = 2019年11月29日

2019年11月25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11月22日 現在)

11,726,032 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数』の純資産総額
(2019年11月22日 現在)

11,551,866,228 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11月22日 現在)

985.147 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11月22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11月25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11月25日	3	1928 積水ハウス	600
追加設定日 = 2019年11月29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	2,900
	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	500
	16	7203 トヨタ自動車	700
	17	7261 マツダ	500
	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	1,900
	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	8,800
	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	300
	30	8316 三井住友フィナンシャルグループ	1,100
	31	8411 みずほフィナンシャルグループ	24,900
	32	8591 オリックス	1,100
	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	700
	37	9201 日本航空	300
	38	9433 KDDI	1,300
	39	9437 NTTドコモ	1,300
	40	9503 関西電力	700

2019年11月25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11月22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11月22日 現在)

1,163,332,348 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11月22日 現在)

2,079.202 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11月22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11月25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	1605 国際石油開発帝石	600
銘柄数 = 155	2	1801 大成建設	100
バスケット提示日 = 2019年11月25日	3	1802 大林組	300
追加設定日 = 2019年11月29日	4	1803 清水建設	300
	5	1812 鹿島建設	100
	6	1821 三井住友建設	100
	7	1878 大東建託	100
	8	1925 大和ハウス工業	500
	9	1928 積水ハウス	300
	10	2002 日清製粉グループ本社	100
	11	2229 カルビー	100
	12	2337 いちご	100
	13	2371 カカクコム	100
	14	2412 ベネフィット・ワン	100
	15	2413 エムスリー	300
	16	2492 インフォマート	100
	17	2502 アサヒグループホールディングス	100
	18	2503 キリンホールディングス	100
	19	2587 サントリー食品インターナショナル	100
	20	2768 双日	400
	21	2784 アルフレッサ ホールディングス	100
	22	2801 キッコーマン	100
	23	2802 味の素	100
	24	3003 ヒューリック	100
	25	3064 MonotaRO	100
	26	3086 J. フロント リテイリング	100
	27	3099 三越伊勢丹ホールディングス	100
	28	3289 東急不動産ホールディングス	100
	29	3401 帝人	100
	30	3402 東レ	400
	31	3405 クラレ	100
	32	3407 旭化成	900
	33	3861 王子ホールディングス	300
	34	4005 住友化学	800
	35	4088 エア・ウォーター	100
	36	4151 協和キリン	100
	37	4183 三井化学	100
	38	4185 JSR	100
	39	4188 三菱ケミカルホールディングス	400
	40	4202 ダイセル	100
	41	4204 積水化学工業	200
	42	4205 日本ゼオン	100
	43	4217 日立化成	100
	44	4307 野村総合研究所	200
	45	4452 花王	500
	46	4502 武田薬品工業	200
	47	4503 アステラス製薬	1,700
	48	4506 大日本住友製薬	100
	49	4507 塩野義製薬	300
	50	4519 中外製薬	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	4523	エーザイ	100
52	4536	参天製薬	100
53	4568	第一三共	200
54	4578	大塚ホールディングス	100
55	4661	オリエントランド	100
56	4689	Zホールディングス	1,000
57	4739	伊藤忠テクノソリューションズ	100
58	4755	楽天	500
59	4901	富士フイルムホールディングス	100
60	4902	コニカミノルタ	100
61	4911	資生堂	300
62	4912	ライオン	100
63	5020	JXTGホールディングス	1,400
64	5108	ブリヂストン	400
65	5332	TOTO	100
66	5333	日本碍子	100
67	5334	日本特殊陶業	100
68	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	100
69	5423	東京製鐵	100
70	5486	日立金属	100
71	5802	住友電気工業	300
72	5991	日本発条	100
73	6098	リクルートホールディングス	1,000
74	6301	小松製作所	400
75	6326	クボタ	400
76	6367	ダイキン工業	100
77	6448	ブラザー工業	100
78	6479	ミネベアミツミ	200
79	6503	三菱電機	700
80	6594	日本電産	100
81	6645	オムロン	100
82	6724	セイコーエプソン	100
83	6758	ソニー	500
84	6841	横河電機	100
85	6869	シスメックス	100
86	6902	デンソー	100
87	6952	カシオ計算機	100
88	6988	日東電工	100
89	7182	ゆうちょ銀行	100
90	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	200
91	7205	日野自動車	100
92	7211	三菱自動車工業	200
93	7261	マツダ	100
94	7459	メディアバルホールディングス	100
95	7701	島津製作所	100
96	7730	マニー	100
97	7731	ニコン	100
98	7741	HOYA	400
99	7751	キヤノン	200
100	7752	リコー	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
101	7762	シチズン時計	100
102	7832	バンダイナムコホールディングス	200
103	7911	凸版印刷	100
104	7951	ヤマハ	100
105	7956	ビジョン	100
106	8001	伊藤忠商事	800
107	8002	丸紅	500
108	8031	三井物産	200
109	8035	東京エレクトロン	100
110	8056	日本ユニシス	100
111	8058	三菱商事	200
112	8113	ユニ・チャーム	300
113	8233	高島屋	100
114	8267	イオン	100
115	8282	ケーズホールディングス	100
116	8303	新生銀行	100
117	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	3,000
118	8308	りそなホールディングス	900
119	8316	三井住友フィナンシャルグループ	300
120	8331	千葉銀行	400
121	8355	静岡銀行	200
122	8359	八十二銀行	100
123	8379	広島銀行	100
124	8410	セブン銀行	500
125	8411	みずほフィナンシャルグループ	5,600
126	8473	SBIホールディングス	100
127	8524	北洋銀行	100
128	8585	オリエントコーポレーション	200
129	8591	オリックス	1,000
130	8601	大和証券グループ本社	300
131	8604	野村ホールディングス	500
132	8630	SOMPOホールディングス	300
133	8697	日本取引所グループ	700
134	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	500
135	8750	第一生命ホールディングス	1,100
136	8795	T&Dホールディングス	600
137	8801	三井不動産	300
138	8802	三菱地所	300
139	8905	イオンモール	100
140	9005	東急	100
141	9143	SGホールディングス	100
142	9201	日本航空	100
143	9432	日本電信電話	300
144	9433	KDDI	1,100
145	9437	NTTドコモ	1,000
146	9502	中部電力	100
147	9507	四国電力	100
148	9508	九州電力	100
149	9531	東京瓦斯	300
150	9532	大阪瓦斯	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
151	9602	東宝	100
152	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	200
153	9697	カプコン	100
154	9735	セコム	100
155	9984	ソフトバンクグループ	200

2019年11月25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11月22日 現在)

2,315,772 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11月22日 現在)

4,894,482,555 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11月22日 現在)

2,113.543 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11月22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11月25日 現在)

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)

	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	500	
銘柄数 = 151	2	1721 コムシスホールディングス	100	
バスケット提示日 = 2019年11月25日	3	1801 大成建設	100	
追加設定日 = 2019年11月29日	4	1802 大林組	300	
	5	1803 清水建設	300	
※「○」で表示した銘柄は	6	1812 鹿島建設	200	
現金拠出で対応する銘柄です。	7	1860 戸田建設	100	
	8	1911 住友林業	100	
	9	1925 大和ハウス工業	300	
	10	1928 積水ハウス	300	
	11	2267 ヤクルト本社	100	
	12	2503 キリンホールディングス	400	
	13	2587 サントリー食品インターナショナル	100	
	14	2784 アルフレッサ ホールディングス	100	
	15	2801 キッコーマン	100	
	16	2802 味の素	200	
	17	3003 ヒューリック	100	
	18	3105 日清紡ホールディングス	100	
	19	3197 すかいらくホールディングス	100	
	20	3227 MCUBS MidCity投資法人 投資証券	1	
	21	3231 野村不動産ホールディングス	100	
	22	3249 産業ファンド投資法人 投資証券	1	
	23	3283 日本プロロジスリート投資法人 投資証券	1	○
	24	3289 東急不動産ホールディングス	300	
	25	3292 イオンリート投資法人 投資証券	1	
	26	3401 帝人	100	
	27	3402 東レ	600	
	28	3405 クラレ	100	
	29	3407 旭化成	600	
	30	3462 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	2	
	31	3941 レンゴー	100	
	32	4004 昭和電工	100	
	33	4005 住友化学	700	
	34	4063 信越化学工業	200	
	35	4151 協和キリン	100	
	36	4183 三井化学	100	
	37	4188 三菱ケミカルホールディングス	600	
	38	4202 ダイセル	100	
	39	4204 積水化学工業	200	
	40	4272 日本化薬	100	
	41	4307 野村総合研究所	200	
	42	4321 ケネディクス	100	
	43	4452 花王	200	
	44	4503 アステラス製薬	800	
	45	4506 大日本住友製薬	100	
	46	4507 塩野義製薬	100	
	47	4508 田辺三菱製薬	100	
	48	4519 中外製薬	100	
	49	4523 エーザイ	100	
	50	4528 小野薬品工業	200	

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)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
51	4536	参天製薬	200	
52	4568	第一三共	300	
53	4578	大塚ホールディングス	200	
54	4613	関西ペイント	100	
55	4661	オリエンタルランド	100	
56	4732	ユー・エス・エス	100	
57	4755	楽天	400	
58	4902	コニカミノルタ	200	
59	4911	資生堂	200	
60	4912	ライオン	100	
61	5020	JXTGホールディングス	1,400	
62	5201	AGC	100	
63	5332	TOTO	100	
64	5333	日本碍子	100	
65	5334	日本特殊陶業	100	
66	5486	日立金属	100	
67	5703	日本軽金属ホールディングス	200	
68	5713	住友金属鉱山	100	
69	6098	リクルートホールディングス	600	
70	6301	小松製作所	400	
71	6326	クボタ	500	
72	6367	ダイキン工業	100	
73	6460	セガサミーホールディングス	100	
74	6472	NTN	200	
75	6481	THK	100	
76	6503	三菱電機	800	
77	6504	富士電機	100	
78	6506	安川電機	100	
79	6645	オムロン	100	
80	6701	日本電気	100	
81	6702	富士通	100	
82	6752	パナソニック	1,000	
83	6753	シャープ	100	
84	6754	アンリツ	100	
85	6758	ソニー	600	
86	6841	横河電機	100	
87	6845	アズビル	100	
88	6861	キーエンス	100	
89	6869	シスメックス	100	
90	6902	デンソー	200	
91	6923	スタンレー電気	100	
92	6952	カシオ計算機	100	
93	6971	京セラ	100	
94	6981	村田製作所	300	
95	6988	日東電工	100	
96	7011	三菱重工業	100	
97	7012	川崎重工業	100	
98	7203	トヨタ自動車	1,000	
99	7205	日野自動車	100	
100	7701	島津製作所	100	

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)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
	101	7731 ニコン	100	
	102	7762 シチズン時計	100	
	103	7912 大日本印刷	100	
	104	7936 アシックス	100	
	105	7951 ヤマハ	100	
	106	8035 東京エレクトロン	100	
	107	8113 ユニ・チャーム	200	
	108	8252 丸井グループ	100	
	109	8267 イオン	300	
	110	8282 ケーズホールディングス	100	
	111	8308 りそなホールディングス	900	
	112	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	100	
	113	8316 三井住友フィナンシャルグループ	600	
	114	8331 千葉銀行	200	
	115	8355 静岡銀行	200	
	116	8382 中国銀行	100	
	117	8418 山口フィナンシャルグループ	100	
	118	8591 オリックス	600	
	119	8593 三菱UFJリース	200	
	120	8630 SOMPOホールディングス	100	
	121	8697 日本取引所グループ	200	
	122	8725 MS&ADインシュアランスグループホールディングス	200	
	123	8750 第一生命ホールディングス	500	
	124	8766 東京海上ホールディングス	300	
	125	8795 T&Dホールディングス	200	
	126	8801 三井不動産	400	
	127	8802 三菱地所	500	
	128	8953 日本リートファンド投資法人 投資証券	1	
	129	8954 オリックス不動産投資法人 投資証券	1	
	130	9001 東武鉄道	100	
	131	9005 東急	200	
	132	9007 小田急電鉄	100	
	133	9020 東日本旅客鉄道	100	
	134	9021 西日本旅客鉄道	100	
	135	9022 東海旅客鉄道	100	
	136	9041 近鉄グループホールディングス	100	
	137	9042 阪急阪神ホールディングス	100	
	138	9048 名古屋鉄道	100	
	139	9101 日本郵船	100	
	140	9104 商船三井	100	
	141	9142 九州旅客鉄道	100	
	142	9432 日本電信電話	300	
	143	9433 KDDI	800	
	144	9437 NTTドコモ	600	
	145	9502 中部電力	300	
	146	9504 中国電力	100	
	147	9508 九州電力	200	
	148	9531 東京瓦斯	200	
	149	9532 大阪瓦斯	200	
	150	9735 セコム	100	

[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)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
151	9831	ヤマダ電機	300	

2019年11月25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11月22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11月22日 現在)

2,211,008,671 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11月22日 現在)

1,290.943 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11月22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11月25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	300
銘柄数 = 140	2	1801 大成建設	100
バスケット提示日 = 2019年11月25日	3	1802 大林組	300
追加設定日 = 2019年11月29日	4	1803 清水建設	300
	5	1812 鹿島建設	200
	6	1925 大和ハウス工業	200
	7	1928 積水ハウス	200
	8	2002 日清製粉グループ本社	100
	9	2433 博報堂DYホールディングス	200
	10	2502 アサヒグループホールディングス	100
	11	2503 キリンホールディングス	300
	12	2768 双日	600
	13	2801 キッコーマン	100
	14	2802 味の素	200
	15	2914 日本たばこ産業	400
	16	3003 ヒューリック	100
	17	3289 東急不動産ホールディングス	200
	18	3382 セブン&アイ・ホールディングス	600
	19	3401 帝人	100
	20	3402 東レ	600
	21	3405 クラレ	100
	22	3407 旭化成	500
	23	3436 SUMCO	100
	24	3861 王子ホールディングス	400
	25	4004 昭和電工	100
	26	4005 住友化学	600
	27	4062 イビデン	100
	28	4063 信越化学工業	200
	29	4151 協和キリン	100
	30	4183 三井化学	100
	31	4185 JSR	100
	32	4188 三菱ケミカルホールディングス	500
	33	4204 積水化学工業	100
	34	4307 野村総合研究所	100
	35	4324 電通	200
	36	4452 花王	200
	37	4502 武田薬品工業	600
	38	4503 アステラス製薬	800
	39	4506 大日本住友製薬	100
	40	4508 田辺三菱製薬	100
	41	4519 中外製薬	100
	42	4523 エーザイ	100
	43	4528 小野薬品工業	200
	44	4536 参天製薬	100
	45	4568 第一三共	300
	46	4661 オリエンタルランド	100
	47	4689 Zホールディングス	800
	48	4755 楽天	600
	49	4901 富士フイルムホールディングス	100
	50	4902 コニカミノルタ	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	4911	資生堂	100
52	4912	ライオン	100
53	5020	JXTGホールディングス	1,000
54	5108	ブリヂストン	200
55	5201	AGC	100
56	5332	TOTO	100
57	5334	日本特殊陶業	100
58	5401	日本製鉄	300
59	5486	日立金属	100
60	5802	住友電気工業	300
61	5803	フジクラ	100
62	5938	LIXILグループ	100
63	6098	リクルートホールディングス	600
64	6268	ナブテスコ	100
65	6301	小松製作所	400
66	6326	クボタ	500
67	6367	ダイキン工業	100
68	6471	日本精工	200
69	6472	NTN	200
70	6473	ジェイテクト	100
71	6502	東芝	200
72	6503	三菱電機	1,000
73	6504	富士電機	100
74	6594	日本電産	100
75	6645	オムロン	100
76	6701	日本電気	100
77	6702	富士通	100
78	6724	セイコーエプソン	100
79	6752	パナソニック	800
80	6753	シャープ	100
81	6758	ソニー	500
82	6762	TDK	100
83	6841	横河電機	100
84	6845	アズビル	100
85	6857	アドバンテスト	100
86	6869	シスメックス	100
87	6902	デンソー	200
88	6925	ウシオ電機	100
89	6952	カシオ計算機	100
90	6981	村田製作所	300
91	7011	三菱重工業	100
92	7012	川崎重工業	100
93	7201	日産自動車	700
94	7203	トヨタ自動車	900
95	7205	日野自動車	100
96	7261	マツダ	200
97	7269	スズキ	200
98	7272	ヤマハ発動機	100
99	7731	ニコン	100
100	7733	オリンパス	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	7751	キヤノン	300
102	7752	リコー	200
103	7911	凸版印刷	100
104	7912	大日本印刷	200
105	7936	アシックス	100
106	7951	ヤマハ	100
107	8002	丸紅	800
108	8031	三井物産	800
109	8053	住友商事	500
110	8058	三菱商事	600
111	8113	ユニ・チャーム	100
112	8252	丸井グループ	200
113	8267	イオン	500
114	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,700
115	8308	りそなホールディングス	800
116	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	100
117	8316	三井住友フィナンシャルグループ	500
118	8411	みずほフィナンシャルグループ	9,600
119	8572	アコム	100
120	8593	三菱UFJリース	200
121	8601	大和証券グループ本社	600
122	8604	野村ホールディングス	1,300
123	8630	SOMPOホールディングス	100
124	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	200
125	8750	第一生命ホールディングス	400
126	8766	東京海上ホールディングス	200
127	8795	T&Dホールディングス	200
128	8801	三井不動産	400
129	8802	三菱地所	400
130	9021	西日本旅客鉄道	100
131	9101	日本郵船	100
132	9104	商船三井	100
133	9202	ANAホールディングス	100
134	9432	日本電信電話	300
135	9433	KDDI	900
136	9437	NTTドコモ	600
137	9531	東京瓦斯	400
138	9532	大阪瓦斯	400
139	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	200
140	9783	ベネッセホールディングス	100

2019年11月25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11月22日 現在)

6,207,934 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT Core指数』の純資産総額
(2019年11月22日 現在)

8,054,607,165 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11月22日 現在)

1,297.470 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11月22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11月25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11月25日
追加設定日 = 2019年11月29日