

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

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
2020年1月24日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(20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・TOPIX Ex-Financials | 1585 | 東 |
| 4 | ダイワ上場投信－JPX日経400 | 1599 | 東 |
| 5 | ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス | 1365 | 東 |
| 6 | 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 |
| 7 | ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ(2倍)指数 | 1367 | 東 |
| 8 | ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース(-2倍)指数 | 1368 | 東 |
| 9 | ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス | 1456 | 東 |
| 10 | ダイワ上場投信－TOPIXインバース(-1倍)指数 | 1457 | 東 |
| 11 | ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス | 1464 | 東 |
| 12 | ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス | 1465 | 東 |
| 13 | 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 |
| 14 | ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数 | 1479 | 東 |
| 15 | ダイワ上場投信－東証REIT指数 | 1488 | 東 |
| 16 | ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数 | 1651 | 東 |
| 17 | ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN) | 1652 | 東 |
| 18 | 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 |
| 19 | ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index | 1654 | 東 |
| 20 | 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。

以上

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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

(2020年1月24日 現在)

120,608,650 口

2. 『ダイワ上場投信一日経225』の純資産総額

(2020年1月24日 現在)

2,956,823,642,151 円

3. 『ダイワ上場投信一日経225』の一口あたりの純資産額

(2020年1月24日 現在)

24,515.9 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

(2020年1月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年1月27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 | 現金拠出 |
|-----------------------|-----|----------------------|-------|------|
| 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 = 2020年1月27日 | 3 | 1605 国際石油開発帝石 | 800 | |
| 追加設定日 = 2020年1月31日 | 4 | 1721 コムシスホールディングス | 2,000 | |
| | 5 | 1801 大成建設 | 400 | |
| ※「○」で表示した銘柄は | 6 | 1802 大林組 | 2,000 | |
| 現金拠出で対応する銘柄です。 | 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 | 現金拠出 |
|-----|------|--------------------|--------|------|
| 51 | 4208 | 宇部興産 | 200 | |
| 52 | 4272 | 日本化薬 | 2,000 | |
| 53 | 4324 | 電通グループ | 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 | ユニカミノルタ | 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 | 現金拠出 |
|--|-----|--------------------------|-------|------|
| | 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 | 現金拠出 |
|-----|------|---------------------------|-------|------|
| 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 | |

[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)

| | コード | 銘柄名 | 株数 | 現金拠出 |
|-----|------|------------------|--------|------|
| 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 | 800 | |
| 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 | |

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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

(2020年1月24日 現在)

2,867,788,643 口

2. 『ダイワ上場投信―トピックス』の純資産総額

(2020年1月24日 現在)

5,210,638,396,765 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

(2020年1月24日 現在)

1,816.95 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

(2020年1月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年1月27日 現在)

[掲載番号:2]

ダイワ上場投信ートピックス(設定ポートフォリオ)

本日をバスケット提示日とする追加設定日は下記のとおりですが、追加設定日前の受付日が受付停止日になっているため、バスケットの提示は行いません。

バスケット提示日 = 2020年1月27日
追加設定日 = 2020年1月31日

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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
(2020年1月24日 現在)

21,943,295 口

2. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の純資産総額
(2020年1月24日 現在)

29,490,409,783 円

3. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の一口あたりの純資産額
(2020年1月24日 現在)

1,343.937 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
(2020年1月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年1月27日 現在)

[掲載番号:3]

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 = 2020年1月27日
追加設定日 = 2020年1月31日

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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
(2020年1月24日 現在)

16,683,155 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の純資産総額
(2020年1月24日 現在)

261,452,965,454 円

3. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の一口あたりの純資産額
(2020年1月24日 現在)

15,671.674 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
(2020年1月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年1月27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 = 378 | 2 | 1333 マルハニチロ | 100 | |
| バスケット提示日 = 2020年1月27日 | 3 | 1605 国際石油開発帝石 | 2,200 | |
| 追加設定日 = 2020年1月31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 | 1,700 | |
| | 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 | 400 | |
| | 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 | 1,100 | |
| | 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 | 2,900 | |
| | 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 | 400 | |
| | 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 | 500 | |
| | 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 | 600 | |
| | 115 | 4324 電通グループ | 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 | 4516 日本新薬 | 100 | |
| | 123 | 4519 中外製薬 | 400 | |
| | 124 | 4521 科研製薬 | 100 | |
| | 125 | 4523 エーザイ | 500 | |
| | 126 | 4528 小野薬品工業 | 900 | |
| | 127 | 4530 久光製薬 | 100 | |
| | 128 | 4536 参天製薬 | 800 | |
| | 129 | 4543 テルモ | 1,200 | |
| | 130 | 4555 沢井製薬 | 100 | |
| | 131 | 4568 第一三共 | 1,200 | |
| | 132 | 4578 大塚ホールディングス | 800 | |
| | 133 | 4587 ペプチドリーム | 200 | |
| | 134 | 4612 日本ペイントホールディングス | 300 | |
| | 135 | 4613 関西ペイント | 500 | |
| | 136 | 4631 DIC | 200 | |
| | 137 | 4661 オリエンタルランド | 400 | |
| | 138 | 4666 パーク24 | 200 | |
| | 139 | 4681 リゾートトラスト | 200 | |
| | 140 | 4684 オービック | 100 | |
| | 141 | 4689 Zホールディングス | 5,500 | |
| | 142 | 4704 トレンドマイクロ | 200 | |
| | 143 | 4716 日本オラクル | 100 | |
| | 144 | 4732 ユー・エス・エス | 400 | |
| | 145 | 4739 伊藤忠テクノソリューションズ | 200 | |
| | 146 | 4751 サイバーエージェント | 200 | |
| | 147 | 4755 楽天 | 1,800 | |
| | 148 | 4768 大塚商会 | 200 | |
| | 149 | 4819 デジタルガレージ | 100 | |
| | 150 | 4849 エン・ジャパン | 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 | 4902 | コニカミノルタ | 900 | |
| 152 | 4911 | 資生堂 | 800 | |
| 153 | 4912 | ライオン | 500 | |
| 154 | 4922 | コーセー | 100 | |
| 155 | 4927 | ポーラ・オルビスホールディングス | 200 | |
| 156 | 4967 | 小林製薬 | 100 | |
| 157 | 5019 | 出光興産 | 500 | |
| 158 | 5020 | JXTGホールディングス | 6,200 | |
| 159 | 5021 | コスモエネルギーホールディングス | 100 | |
| 160 | 5101 | 横浜ゴム | 200 | |
| 161 | 5108 | ブリヂストン | 1,300 | |
| 162 | 5110 | 住友ゴム工業 | 400 | |
| 163 | 5201 | AGC | 400 | |
| 164 | 5233 | 太平洋セメント | 300 | |
| 165 | 5301 | 東海カーボン | 400 | |
| 166 | 5332 | TOTO | 300 | |
| 167 | 5333 | 日本碍子 | 500 | |
| 168 | 5334 | 日本特殊陶業 | 300 | |
| 169 | 5393 | ニチアス | 100 | |
| 170 | 5401 | 日本製鉄 | 1,800 | |
| 171 | 5411 | ジェイ エフ イー ホールディングス | 1,100 | |
| 172 | 5486 | 日立金属 | 400 | |
| 173 | 5703 | 日本軽金属ホールディングス | 1,000 | |
| 174 | 5713 | 住友金属鉱山 | 500 | |
| 175 | 5714 | DOWAホールディングス | 100 | |
| 176 | 5801 | 古河電気工業 | 100 | |
| 177 | 5802 | 住友電気工業 | 1,500 | |
| 178 | 5929 | 三和ホールディングス | 400 | |
| 179 | 5947 | リンナイ | 100 | |
| 180 | 5975 | 東プレ | 100 | |
| 181 | 6028 | テクノプロ・ホールディングス | 100 | |
| 182 | 6098 | リクルートホールディングス | 2,800 | |
| 183 | 6113 | アマダホールディングス | 500 | |
| 184 | 6136 | オーエスジー | 200 | |
| 185 | 6141 | DMG森精機 | 300 | |
| 186 | 6146 | ディスコ | 100 | |
| 187 | 6201 | 豊田自動織機 | 300 | |
| 188 | 6268 | ナブテスコ | 200 | |
| 189 | 6273 | SMC | 100 | |
| 190 | 6301 | 小松製作所 | 1,900 | |
| 191 | 6302 | 住友重機械工業 | 200 | |
| 192 | 6305 | 日立建機 | 200 | |
| 193 | 6324 | ハーモニック・ドライブ・システムズ | 100 | |
| 194 | 6326 | クボタ | 2,200 | |
| 195 | 6367 | ダイキン工業 | 500 | |
| 196 | 6383 | ダイフク | 200 | |
| 197 | 6432 | 竹内製作所 | 100 | |
| 198 | 6448 | ブラザー工業 | 500 | |
| 199 | 6463 | TPR | 100 | |
| 200 | 6471 | 日本精工 | 800 | |

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 | 6473 | ジェイテクト | 400 | |
| 202 | 6479 | ミネベアミツミ | 800 | |
| 203 | 6481 | THK | 200 | |
| 204 | 6501 | 日立製作所 | 2,000 | |
| 205 | 6503 | 三菱電機 | 4,100 | |
| 206 | 6504 | 富士電機 | 200 | |
| 207 | 6506 | 安川電機 | 400 | |
| 208 | 6586 | マキタ | 500 | |
| 209 | 6594 | 日本電産 | 500 | |
| 210 | 6641 | 日新電機 | 100 | |
| 211 | 6645 | オムロン | 400 | |
| 212 | 6701 | 日本電気 | 500 | |
| 213 | 6702 | 富士通 | 400 | |
| 214 | 6723 | ルネサスエレクトロニクス | 2,000 | |
| 215 | 6724 | セイコーエプソン | 500 | |
| 216 | 6728 | アルバック | 100 | |
| 217 | 6752 | パナソニック | 4,700 | |
| 218 | 6755 | 富士通ゼネラル | 100 | |
| 219 | 6758 | ソニー | 1,800 | |
| 220 | 6762 | TDK | 200 | |
| 221 | 6770 | アルプスアルパイン | 400 | |
| 222 | 6806 | ヒロセ電機 | 100 | |
| 223 | 6841 | 横河電機 | 400 | |
| 224 | 6845 | アズビル | 300 | |
| 225 | 6849 | 日本光電工業 | 200 | |
| 226 | 6856 | 堀場製作所 | 100 | |
| 227 | 6857 | アドバンテスト | 300 | |
| 228 | 6861 | キーエンス | 300 | |
| 229 | 6869 | シスメックス | 300 | |
| 230 | 6902 | デンソー | 900 | |
| 231 | 6920 | レーザーテック | 200 | |
| 232 | 6923 | スタンレー電気 | 300 | |
| 233 | 6952 | カシオ計算機 | 400 | |
| 234 | 6954 | ファナック | 400 | |
| 235 | 6965 | 浜松ホトニクス | 300 | |
| 236 | 6971 | 京セラ | 600 | |
| 237 | 6976 | 太陽誘電 | 200 | |
| 238 | 6981 | 村田製作所 | 1,200 | |
| 239 | 6988 | 日東電工 | 300 | |
| 240 | 7011 | 三菱重工業 | 700 | |
| 241 | 7012 | 川崎重工業 | 300 | |
| 242 | 7013 | IHI | 300 | |
| 243 | 7148 | FPG | 100 | |
| 244 | 7164 | 全国保証 | 100 | |
| 245 | 7167 | めぶきフィナンシャルグループ | 2,100 | |
| 246 | 7186 | コンコルディア・フィナンシャルグループ | 2,400 | |
| 247 | 7202 | いすゞ自動車 | 1,200 | |
| 248 | 7203 | トヨタ自動車 | 1,600 | |
| 249 | 7205 | 日野自動車 | 500 | |
| 250 | 7259 | アイシン精機 | 300 | |

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 | 7261 | マツダ | 1,200 | |
| 252 | 7267 | 本田技研工業 | 3,200 | |
| 253 | 7269 | スズキ | 800 | |
| 254 | 7270 | SUBARU | 1,300 | |
| 255 | 7272 | ヤマハ発動機 | 500 | |
| 256 | 7276 | 小糸製作所 | 200 | |
| 257 | 7282 | 豊田合成 | 100 | |
| 258 | 7309 | シマノ | 200 | |
| 259 | 7313 | テイ・エス テック | 100 | |
| 260 | 7419 | ノジマ | 100 | |
| 261 | 7453 | 良品計画 | 500 | |
| 262 | 7458 | 第一興商 | 100 | |
| 263 | 7459 | メディアパルホールディングス | 400 | |
| 264 | 7532 | バン・パシフィック・インターナショナルホールディングス | 900 | |
| 265 | 7550 | ゼンショーホールディングス | 200 | |
| 266 | 7575 | 日本ライフライン | 100 | |
| 267 | 7649 | スギホールディングス | 100 | |
| 268 | 7701 | 島津製作所 | 500 | |
| 269 | 7729 | 東京精密 | 100 | |
| 270 | 7731 | ニコン | 700 | |
| 271 | 7733 | オリンパス | 2,300 | |
| 272 | 7735 | SCREENホールディングス | 100 | |
| 273 | 7741 | HOYA | 800 | |
| 274 | 7747 | 朝日インテック | 500 | |
| 275 | 7751 | キヤノン | 2,200 | |
| 276 | 7832 | バンダイナムコホールディングス | 400 | |
| 277 | 7846 | パイロットコーポレーション | 100 | |
| 278 | 7867 | タカラトミー | 200 | |
| 279 | 7951 | ヤマハ | 200 | |
| 280 | 7956 | ビジョン | 200 | |
| 281 | 7974 | 任天堂 | 300 | |
| 282 | 7988 | ニフコ | 200 | |
| 283 | 8001 | 伊藤忠商事 | 2,800 | |
| 284 | 8002 | 丸紅 | 4,200 | |
| 285 | 8015 | 豊田通商 | 500 | |
| 286 | 8020 | 兼松 | 200 | |
| 287 | 8028 | ファミリーマート | 300 | |
| 288 | 8031 | 三井物産 | 3,500 | |
| 289 | 8035 | 東京エレクトロン | 300 | |
| 290 | 8036 | 日立ハイテクノロジーズ | 100 | |
| 291 | 8053 | 住友商事 | 2,500 | |
| 292 | 8056 | 日本ユニシス | 100 | |
| 293 | 8058 | 三菱商事 | 2,800 | |
| 294 | 8088 | 岩谷産業 | 100 | |
| 295 | 8111 | ゴールドウイン | 100 | |
| 296 | 8113 | ユニ・チャーム | 800 | |
| 297 | 8252 | 丸井グループ | 400 | |
| 298 | 8267 | イオン | 1,600 | |
| 299 | 8273 | イズミ | 100 | |
| 300 | 8282 | ケーズホールディングス | 400 | |

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 | 8283 PALTAC | 100 | |
| | 302 | 8303 新生銀行 | 300 | |
| | 303 | 8304 あおぞら銀行 | 200 | |
| | 304 | 8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 20,500 | |
| | 305 | 8308 りそなホールディングス | 4,400 | |
| | 306 | 8309 三井住友トラスト・ホールディングス | 800 | |
| | 307 | 8316 三井住友フィナンシャルグループ | 2,700 | |
| | 308 | 8331 千葉銀行 | 1,400 | |
| | 309 | 8410 セブン銀行 | 1,400 | |
| | 310 | 8411 みずほフィナンシャルグループ | 54,900 | |
| | 311 | 8439 東京センチュリー | 100 | |
| | 312 | 8473 SBIホールディングス | 500 | |
| | 313 | 8570 イオンフィナンシャルサービス | 200 | |
| | 314 | 8585 オリエン트コーポレーション | 1,100 | |
| | 315 | 8591 オリックス | 2,500 | |
| | 316 | 8593 三菱UFJリース | 1,000 | |
| | 317 | 8601 大和証券グループ本社 | 3,200 | |
| | 318 | 8604 野村ホールディングス | 7,100 | |
| | 319 | 8628 松井証券 | 200 | |
| | 320 | 8630 SOMPOホールディングス | 800 | |
| | 321 | 8697 日本取引所グループ | 1,200 | |
| | 322 | 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 | |
| | 323 | 8729 ソニーフィナンシャルホールディングス | 300 | |
| | 324 | 8750 第一生命ホールディングス | 2,300 | |
| | 325 | 8766 東京海上ホールディングス | 1,400 | |
| | 326 | 8795 T&Dホールディングス | 1,200 | |
| | 327 | 8801 三井不動産 | 2,000 | |
| | 328 | 8802 三菱地所 | 2,800 | |
| | 329 | 8804 東京建物 | 400 | |
| | 330 | 8830 住友不動産 | 900 | |
| | 331 | 8850 スターツコーポレーション | 100 | |
| | 332 | 8876 リロググループ | 200 | |
| | 333 | 8905 イオンモール | 200 | |
| | 334 | 9001 東武鉄道 | 400 | |
| | 335 | 9003 相鉄ホールディングス | 200 | |
| | 336 | 9005 東急 | 1,000 | |
| | 337 | 9007 小田急電鉄 | 600 | |
| | 338 | 9008 京王電鉄 | 200 | |
| | 339 | 9009 京成電鉄 | 300 | |
| | 340 | 9020 東日本旅客鉄道 | 700 | |
| | 341 | 9021 西日本旅客鉄道 | 400 | |
| | 342 | 9022 東海旅客鉄道 | 300 | |
| | 343 | 9024 西武ホールディングス | 600 | |
| | 344 | 9041 近鉄グループホールディングス | 400 | |
| | 345 | 9042 阪急阪神ホールディングス | 500 | |
| | 346 | 9045 京阪ホールディングス | 200 | |
| | 347 | 9048 名古屋鉄道 | 400 | |
| | 348 | 9062 日本通運 | 100 | |
| | 349 | 9064 ヤマトホールディングス | 700 | |
| | 350 | 9065 山九 | 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 |
|-----|------|----------------------|-------|------|
| 351 | 9086 | 日立物流 | 100 | |
| 352 | 9201 | 日本航空 | 700 | |
| 353 | 9202 | ANAホールディングス | 700 | |
| 354 | 9404 | 日本テレビホールディングス | 300 | |
| 355 | 9432 | 日本電信電話 | 4,100 | |
| 356 | 9433 | KDDI | 3,000 | |
| 357 | 9437 | NTTドコモ | 3,000 | |
| 358 | 9502 | 中部電力 | 1,300 | |
| 359 | 9503 | 関西電力 | 1,600 | |
| 360 | 9506 | 東北電力 | 1,000 | |
| 361 | 9508 | 九州電力 | 800 | |
| 362 | 9513 | 電源開発 | 300 | |
| 363 | 9531 | 東京瓦斯 | 800 | |
| 364 | 9532 | 大阪瓦斯 | 800 | |
| 365 | 9602 | 東宝 | 200 | |
| 366 | 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ | 1,100 | |
| 367 | 9678 | カナモト | 100 | |
| 368 | 9684 | スクウェア・エニックス・ホールディングス | 200 | |
| 369 | 9697 | カプコン | 200 | |
| 370 | 9706 | 日本空港ビルデング | 100 | |
| 371 | 9719 | SCSK | 100 | |
| 372 | 9735 | セコム | 400 | |
| 373 | 9766 | コナミホールディングス | 100 | |
| 374 | 9843 | ニトリホールディングス | 200 | |
| 375 | 9962 | ミスミグループ本社 | 500 | |
| 376 | 9983 | ファーストリテイリング | 100 | |
| 377 | 9984 | ソフトバンクグループ | 1,900 | |
| 378 | 9989 | サンドラッグ | 200 | |

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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
(2020年1月24日 現在)

285,000 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
(2020年1月24日 現在)

4,951,685,338 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
(2020年1月24日 現在)

17,374.33 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
(2020年1月24日 現在)

0.15 %

●「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。

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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
(2020年1月24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
(2020年1月24日 現在)

11,080,403,389 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
(2020年1月24日 現在)

2,250.97 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
(2020年1月24日 現在)

-0.16 %

●「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 of 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。

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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

(2020年1月24日 現在)

114,000 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

(2020年1月24日 現在)

1,690,997,686 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

(2020年1月24日 現在)

14,833.31 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

(2020年1月24日 現在)

0.40 %

●「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。

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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
(2020年1月24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
(2020年1月24日 現在)

1,737,354,054 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
(2020年1月24日 現在)

2,848.12 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
(2020年1月24日 現在)

-0.41 %

●「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。

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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
(2020年1月24日 現在)

4,352,168 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
(2020年1月24日 現在)

26,221,388,684 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
(2020年1月24日 現在)

6,024.90 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
(2020年1月24日 現在)

-0.08 %

●「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。

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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
(2020年1月24日 現在)

2,143,600 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
(2020年1月24日 現在)

14,513,574,925 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
(2020年1月24日 現在)

6,770.65 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
(2020年1月24日 現在)

-0.21 %

●「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。

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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
(2020年1月24日 現在)

60,000 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の純資産総額
(2020年1月24日 現在)

703,535,163 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
(2020年1月24日 現在)

11,725.59 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
(2020年1月24日 現在)

0.40 %

●「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。

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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
(2020年1月24日 現在)

272,000 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
(2020年1月24日 現在)

1,808,804,438 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
(2020年1月24日 現在)

6,650.02 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
(2020年1月24日 現在)

-0.20 %

●「JPX日経400インバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点

対象指標とする「JPX日経400インバース・インデックス」は原指標の「JPX日経インデックス400」の変動率の「-1倍」(マイナス1倍)の値動きになる指数で、「JPX日経インデックス400」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-1倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上での計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「JPX日経インデックス400」の変動率の「-1倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「JPX日経インデックス400」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「JPX日経インデックス400」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逓減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逓減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。

【「JPX日経400インバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】

ファンドの基準価額の変動率とJPX日経400インバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をJPX日経400インバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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
(2020年1月24日 現在)

107,900 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
(2020年1月24日 現在)

413,165,446 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
(2020年1月24日 現在)

3,829.15 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
(2020年1月24日 現在)

-0.40 %

●「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」に内在する性質に関する注意点
対象指標とする「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」は原指標の「JPX日経インデックス400」の変動率の「-2倍」(マイナス2倍)の値動きになる指数で、「JPX日経インデックス400」の1日の変化率(前日終値と当日終値とを比較して算出)を「-2倍」したものを前日の指数値に乗じて算出されます。指標と原指標は完全な逆相関ではないため、複数日以上
の計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「JPX日経インデックス400」の変動率の「-2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「JPX日経インデックス400」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性がありますが、一般に、「JPX日経インデックス400」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逡減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逡減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」とファンドの基準価額の乖離に関する注意点】
ファンドの基準価額の変動率とJPX日経400ダブルインバース・インデックスの変動率とを一致させることを目指しますが、信託報酬、売買委託手数料、監査費用等の費用負担、追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異等の影響により、基準価額の変動率をJPX日経400ダブルインバース・インデックスの変動率と一致させることをお約束できるものではありません。

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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
(2020年1月24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
(2020年1月24日 現在)

49,821,946,187 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
(2020年1月24日 現在)

20,918.09 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
(2020年1月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年1月27日 現在)

ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資(設定ポートフォリオ)

| | コード | 銘柄名 | 株数 |
|-----------------------|-----|-----------------------|--------|
| 単位 = 1 バスケット | 1 | 1878 大東建託 | 600 |
| 銘柄数 = 149 | 2 | 1925 大和ハウス工業 | 4,700 |
| バスケット提示日 = 2020年1月27日 | 3 | 2269 明治ホールディングス | 700 |
| 追加設定日 = 2020年1月31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 電通グループ | 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 | 4519 中外製薬 | 1,600 |
| | 29 | 4523 エーザイ | 2,200 |
| | 30 | 4528 小野薬品工業 | 1,500 |
| | 31 | 4530 久光製薬 | 300 |
| | 32 | 4536 参天製薬 | 1,800 |
| | 33 | 4543 テルモ | 4,400 |
| | 34 | 4568 第一三共 | 3,200 |
| | 35 | 4578 大塚ホールディングス | 1,800 |
| | 36 | 4689 Zホールディングス | 18,600 |
| | 37 | 4704 トレンドマイクロ | 1,500 |
| | 38 | 4751 サイバーエージェント | 600 |
| | 39 | 4901 富士フイルムホールディングス | 1,600 |
| | 40 | 4902 コニカミノルタ | 1,800 |
| | 41 | 4911 資生堂 | 3,200 |
| | 42 | 4927 ポーラ・オルビスホールディングス | 500 |
| | 43 | 5019 出光興産 | 400 |
| | 44 | 5020 JXTGホールディングス | 8,200 |
| | 45 | 5101 横浜ゴム | 500 |
| | 46 | 5108 ブリヂストン | 5,200 |
| | 47 | 5233 太平洋セメント | 800 |
| | 48 | 5333 日本碍子 | 1,200 |
| | 49 | 5334 日本特殊陶業 | 600 |
| | 50 | 5401 日本製鉄 | 3,400 |

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 | 5411 | ジェイ エフ イー ホールディングス | 800 |
| 52 | 5486 | 日立金属 | 900 |
| 53 | 5802 | 住友電気工業 | 4,300 |
| 54 | 5938 | LIXILグループ | 500 |
| 55 | 5947 | リンナイ | 200 |
| 56 | 6146 | ディスコ | 200 |
| 57 | 6178 | 日本郵政 | 2,400 |
| 58 | 6301 | 小松製作所 | 7,300 |
| 59 | 6305 | 日立建機 | 300 |
| 60 | 6326 | クボタ | 6,600 |
| 61 | 6383 | ダイフク | 1,000 |
| 62 | 6448 | ブラザー工業 | 1,600 |
| 63 | 6460 | セガサミーホールディングス | 400 |
| 64 | 6465 | ホシザキ | 500 |
| 65 | 6471 | 日本精工 | 1,300 |
| 66 | 6479 | ミネベアミツミ | 1,100 |
| 67 | 6501 | 日立製作所 | 7,400 |
| 68 | 6503 | 三菱電機 | 9,800 |
| 69 | 6504 | 富士電機 | 700 |
| 70 | 6506 | 安川電機 | 1,700 |
| 71 | 6594 | 日本電産 | 600 |
| 72 | 6645 | オムロン | 500 |
| 73 | 6701 | 日本電気 | 1,000 |
| 74 | 6723 | ルネサスエレクトロニクス | 1,600 |
| 75 | 6724 | セイコーエプソン | 1,300 |
| 76 | 6752 | パナソニック | 16,700 |
| 77 | 6758 | ソニー | 8,600 |
| 78 | 6770 | アルプスアルパイン | 1,100 |
| 79 | 6857 | アドバンテスト | 2,100 |
| 80 | 6869 | シスメックス | 1,500 |
| 81 | 6902 | デンソー | 2,000 |
| 82 | 6952 | カシオ計算機 | 1,100 |
| 83 | 6963 | ローム | 400 |
| 84 | 6971 | 京セラ | 1,100 |
| 85 | 7011 | 三菱重工業 | 500 |
| 86 | 7012 | 川崎重工業 | 500 |
| 87 | 7013 | IHI | 400 |
| 88 | 7182 | ゆうちょ銀行 | 1,400 |
| 89 | 7186 | コンコルディア・フィナンシャルグループ | 2,700 |
| 90 | 7202 | いすゞ自動車 | 2,500 |
| 91 | 7203 | トヨタ自動車 | 7,600 |
| 92 | 7205 | 日野自動車 | 1,700 |
| 93 | 7211 | 三菱自動車工業 | 3,000 |
| 94 | 7261 | マツダ | 1,900 |
| 95 | 7270 | SUBARU | 3,200 |
| 96 | 7282 | 豊田合成 | 300 |
| 97 | 7731 | ニコン | 1,300 |
| 98 | 7733 | オリンパス | 6,400 |
| 99 | 7751 | キヤノン | 5,100 |
| 100 | 7752 | リコー | 1,100 |

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 | 7912 | 大日本印刷 | 300 |
| 102 | 7974 | 任天堂 | 500 |
| 103 | 8001 | 伊藤忠商事 | 8,900 |
| 104 | 8002 | 丸紅 | 6,600 |
| 105 | 8028 | ファミリーマート | 1,300 |
| 106 | 8031 | 三井物産 | 3,200 |
| 107 | 8035 | 東京エレクトロン | 1,400 |
| 108 | 8058 | 三菱商事 | 2,600 |
| 109 | 8113 | ユニ・チャーム | 3,900 |
| 110 | 8267 | イオン | 1,200 |
| 111 | 8304 | あおぞら銀行 | 400 |
| 112 | 8306 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 31,300 |
| 113 | 8308 | りそなホールディングス | 9,400 |
| 114 | 8309 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 1,000 |
| 115 | 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ | 2,800 |
| 116 | 8410 | セブン銀行 | 4,000 |
| 117 | 8411 | みずほフィナンシャルグループ | 68,300 |
| 118 | 8473 | SBIホールディングス | 800 |
| 119 | 8570 | イオンフィナンシャルサービス | 300 |
| 120 | 8591 | オリックス | 7,900 |
| 121 | 8593 | 三菱UFJリース | 900 |
| 122 | 8601 | 大和証券グループ本社 | 3,600 |
| 123 | 8604 | 野村ホールディングス | 7,400 |
| 124 | 8630 | SOMPOホールディングス | 2,700 |
| 125 | 8697 | 日本取引所グループ | 6,500 |
| 126 | 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 |
| 127 | 8750 | 第一生命ホールディングス | 8,300 |
| 128 | 8766 | 東京海上ホールディングス | 5,500 |
| 129 | 8795 | T&Dホールディングス | 4,100 |
| 130 | 8801 | 三井不動産 | 2,400 |
| 131 | 8905 | イオンモール | 600 |
| 132 | 9143 | SGホールディングス | 1,000 |
| 133 | 9201 | 日本航空 | 800 |
| 134 | 9202 | ANAホールディングス | 500 |
| 135 | 9432 | 日本電信電話 | 7,500 |
| 136 | 9433 | KDDI | 7,400 |
| 137 | 9437 | NTTドコモ | 11,400 |
| 138 | 9502 | 中部電力 | 600 |
| 139 | 9503 | 関西電力 | 700 |
| 140 | 9506 | 東北電力 | 900 |
| 141 | 9513 | 電源開発 | 300 |
| 142 | 9531 | 東京瓦斯 | 1,400 |
| 143 | 9532 | 大阪瓦斯 | 1,300 |
| 144 | 9533 | 東邦瓦斯 | 200 |
| 145 | 9602 | 東宝 | 700 |
| 146 | 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ | 3,500 |
| 147 | 9783 | ベネッセホールディングス | 200 |
| 148 | 9831 | ヤマダ電機 | 1,800 |
| 149 | 9984 | ソフトバンクグループ | 4,900 |

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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

(2020年1月24日 現在)

54,364,824 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の純資産総額

(2020年1月24日 現在)

122,492,983,922 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

(2020年1月24日 現在)

2,253.166 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

(2020年1月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年1月27日 現在)

[掲載番号:15]

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 = 2020年1月27日
追加設定日 = 2020年1月31日

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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
(2020年1月24日 現在)

11,146,424 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数』の純資産総額
(2020年1月24日 現在)

11,062,377,310 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
(2020年1月24日 現在)

992.460 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
(2020年1月24日 現在)

0.01 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年1月27日 現在)

[掲載番号:16]

ダイワ上場投信－TOPIX高配当40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 = 2020年1月27日
追加設定日 = 2020年1月31日

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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
(2020年1月24日 現在)

609,259 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
(2020年1月24日 現在)

1,298,967,943 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
(2020年1月24日 現在)

2,132.046 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
(2020年1月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年1月27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 | 600 | |
| 銘柄数 = 154 | 2 | 1801 大成建設 | 100 | |
| バスケット提示日 = 2020年1月27日 | 3 | 1802 大林組 | 300 | |
| 追加設定日 = 2020年1月31日 | 4 | 1803 清水建設 | 300 | |
| | 5 | 1812 鹿島建設 | 100 | |
| ※「○」で表示した銘柄は | 6 | 1821 三井住友建設 | 100 | |
| 現金拠出で対応する銘柄です。 | 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 | 700 | |
| | 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 | 4307 野村総合研究所 | 200 | |
| | 44 | 4452 花王 | 500 | |
| | 45 | 4502 武田薬品工業 | 200 | |
| | 46 | 4503 アステラス製薬 | 1,700 | |
| | 47 | 4506 大日本住友製薬 | 100 | |
| | 48 | 4507 塩野義製薬 | 300 | |
| | 49 | 4519 中外製薬 | 100 | |
| | 50 | 4523 エーザイ | 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 | 4536 参天製薬 | 100 | |
| | 52 | 4568 第一三共 | 200 | |
| | 53 | 4578 大塚ホールディングス | 100 | |
| | 54 | 4661 オリエンタルランド | 100 | |
| | 55 | 4689 Zホールディングス | 1,000 | |
| | 56 | 4739 伊藤忠テクノソリューションズ | 100 | |
| | 57 | 4755 楽天 | 500 | |
| | 58 | 4901 富士フイルムホールディングス | 100 | |
| | 59 | 4902 コニカミノルタ | 100 | |
| | 60 | 4911 資生堂 | 300 | |
| | 61 | 4912 ライオン | 100 | |
| | 62 | 5020 JXTGホールディングス | 1,400 | |
| | 63 | 5108 プリヂェストーン | 400 | |
| | 64 | 5332 TOTO | 100 | |
| | 65 | 5333 日本碍子 | 100 | |
| | 66 | 5334 日本特殊陶業 | 100 | |
| | 67 | 5411 ジェイ エフ イー ホールディングス | 100 | |
| | 68 | 5423 東京製鐵 | 100 | |
| | 69 | 5486 日立金属 | 100 | |
| | 70 | 5802 住友電気工業 | 300 | |
| | 71 | 5991 日本発条 | 100 | |
| | 72 | 6098 リクルートホールディングス | 1,000 | |
| | 73 | 6301 小松製作所 | 400 | |
| | 74 | 6326 クボタ | 400 | |
| | 75 | 6367 ダイキン工業 | 100 | |
| | 76 | 6448 ブラザー工業 | 100 | |
| | 77 | 6479 ミネベアミツミ | 200 | |
| | 78 | 6503 三菱電機 | 700 | |
| | 79 | 6594 日本電産 | 100 | |
| | 80 | 6645 オムロン | 100 | |
| | 81 | 6724 セイコーエプソン | 100 | |
| | 82 | 6758 ソニー | 400 | |
| | 83 | 6841 横河電機 | 100 | |
| | 84 | 6869 シスメックス | 100 | |
| | 85 | 6902 デンソー | 100 | |
| | 86 | 6952 カシオ計算機 | 100 | |
| | 87 | 6988 日東電工 | 100 | |
| | 88 | 7182 ゆうちょ銀行 | 100 | |
| | 89 | 7186 コンコルディア・フィナンシャルグループ | 200 | |
| | 90 | 7205 日野自動車 | 100 | |
| | 91 | 7211 三菱自動車工業 | 200 | |
| | 92 | 7261 マツダ | 100 | |
| | 93 | 7459 メディパルホールディングス | 100 | |
| | 94 | 7701 島津製作所 | 100 | |
| | 95 | 7730 マニー | 100 | |
| | 96 | 7731 ニコン | 100 | |
| | 97 | 7741 HOYA | 400 | |
| | 98 | 7751 キヤノン | 200 | |
| | 99 | 7752 リコー | 100 | |
| | 100 | 7762 シチズン時計 | 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 |
|--|-----|--------------------------------|-------|------|
| | 101 | 7832 バンダイナムコホールディングス | 200 | |
| | 102 | 7911 凸版印刷 | 100 | |
| | 103 | 7951 ヤマハ | 100 | |
| | 104 | 7956 ビジョン | 100 | |
| | 105 | 8001 伊藤忠商事 | 800 | |
| | 106 | 8002 丸紅 | 500 | |
| | 107 | 8031 三井物産 | 200 | |
| | 108 | 8035 東京エレクトロン | 100 | |
| | 109 | 8056 日本ユニシス | 100 | |
| | 110 | 8058 三菱商事 | 200 | |
| | 111 | 8113 ユニ・チャーム | 300 | |
| | 112 | 8233 高島屋 | 100 | |
| | 113 | 8267 イオン | 100 | |
| | 114 | 8282 ケーズホールディングス | 100 | |
| | 115 | 8303 新生銀行 | 100 | |
| | 116 | 8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 3,000 | |
| | 117 | 8308 りそなホールディングス | 900 | |
| | 118 | 8316 三井住友フィナンシャルグループ | 300 | |
| | 119 | 8331 千葉銀行 | 400 | |
| | 120 | 8355 静岡銀行 | 200 | |
| | 121 | 8359 八十二銀行 | 100 | |
| | 122 | 8379 広島銀行 | 100 | |
| | 123 | 8410 セブン銀行 | 500 | |
| | 124 | 8411 みずほフィナンシャルグループ | 5,600 | |
| | 125 | 8473 SBIホールディングス | 100 | |
| | 126 | 8524 北洋銀行 | 100 | |
| | 127 | 8585 オリエン트コーポレーション | 200 | |
| | 128 | 8591 オリックス | 1,000 | |
| | 129 | 8601 大和証券グループ本社 | 300 | |
| | 130 | 8604 野村ホールディングス | 500 | |
| | 131 | 8630 SOMPOホールディングス | 300 | |
| | 132 | 8697 日本取引所グループ | 700 | |
| | 133 | 8725 MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 500 | |
| | 134 | 8750 第一生命ホールディングス | 1,000 | |
| | 135 | 8795 T&Dホールディングス | 600 | |
| | 136 | 8801 三井不動産 | 300 | |
| | 137 | 8802 三菱地所 | 300 | |
| | 138 | 8905 イオンモール | 100 | |
| | 139 | 9005 東急 | 100 | |
| | 140 | 9143 SGホールディングス | 100 | |
| | 141 | 9201 日本航空 | 100 | |
| | 142 | 9432 日本電信電話 | 700 | |
| | 143 | 9433 KDDI | 1,100 | |
| | 144 | 9437 NTTドコモ | 1,000 | |
| | 145 | 9502 中部電力 | 100 | |
| | 146 | 9507 四国電力 | 100 | |
| | 147 | 9508 九州電力 | 100 | |
| | 148 | 9531 東京瓦斯 | 300 | |
| | 149 | 9532 大阪瓦斯 | 300 | |
| | 150 | 9602 東宝 | 100 | |

[掲載番号:17]

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 |
|-----|------|--------------|-----|------|
| 151 | 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ | 200 | |
| 152 | 9697 | カプコン | 100 | |
| 153 | 9735 | セコム | 100 | |
| 154 | 9984 | ソフトバンクグループ | 200 | |

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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
(2020年1月24日 現在)

2,791,942 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
(2020年1月24日 現在)

6,060,110,744 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
(2020年1月24日 現在)

2,170.572 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
(2020年1月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年1月27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asket | 1 | 1605 国際石油開発帝石 | 500 | |
| 銘柄数 = 150 | 2 | 1721 コムシスホールディングス | 100 | |
| Basket提示日 = 2020年1月27日 | 3 | 1801 大成建設 | 100 | |
| 追加設定日 = 2020年1月31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 | 200 | |
| | 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 すかいらー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 | 100 | |
| | 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 | 4519 中外製薬 | 100 | |
| | 48 | 4523 エーザイ | 100 | |
| | 49 | 4528 小野薬品工業 | 200 | |
| | 50 | 4536 参天製薬 | 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 | 4568 | 第一三共 | 300 | |
| 52 | 4578 | 大塚ホールディングス | 200 | |
| 53 | 4613 | 関西ペイント | 100 | |
| 54 | 4661 | オリエンタルランド | 100 | |
| 55 | 4732 | ユー・エス・エス | 100 | |
| 56 | 4755 | 楽天 | 400 | |
| 57 | 4902 | ユニカミノルタ | 200 | |
| 58 | 4911 | 資生堂 | 200 | |
| 59 | 4912 | ライオン | 100 | |
| 60 | 5020 | JXTGホールディングス | 1,400 | |
| 61 | 5201 | AGC | 100 | |
| 62 | 5332 | TOTO | 100 | |
| 63 | 5333 | 日本碍子 | 100 | |
| 64 | 5334 | 日本特殊陶業 | 100 | |
| 65 | 5486 | 日立金属 | 100 | |
| 66 | 5703 | 日本軽金属ホールディングス | 200 | |
| 67 | 5713 | 住友金属鉱山 | 100 | |
| 68 | 6098 | リクルートホールディングス | 600 | |
| 69 | 6301 | 小松製作所 | 400 | |
| 70 | 6326 | クボタ | 500 | |
| 71 | 6367 | ダイキン工業 | 100 | |
| 72 | 6460 | セガサミーホールディングス | 100 | |
| 73 | 6472 | NTN | 200 | |
| 74 | 6481 | THK | 100 | |
| 75 | 6503 | 三菱電機 | 800 | |
| 76 | 6504 | 富士電機 | 100 | |
| 77 | 6506 | 安川電機 | 100 | |
| 78 | 6645 | オムロン | 100 | |
| 79 | 6701 | 日本電気 | 100 | |
| 80 | 6702 | 富士通 | 100 | |
| 81 | 6752 | パナソニック | 1,000 | |
| 82 | 6753 | シャープ | 100 | |
| 83 | 6754 | アンリツ | 100 | |
| 84 | 6758 | ソニー | 600 | |
| 85 | 6841 | 横河電機 | 100 | |
| 86 | 6845 | アズビル | 100 | |
| 87 | 6861 | キーエンス | 100 | |
| 88 | 6869 | シスメックス | 100 | |
| 89 | 6902 | デンソー | 200 | |
| 90 | 6923 | スタンレー電気 | 100 | |
| 91 | 6952 | カシオ計算機 | 100 | |
| 92 | 6971 | 京セラ | 100 | |
| 93 | 6981 | 村田製作所 | 300 | |
| 94 | 6988 | 日東電工 | 100 | |
| 95 | 7011 | 三菱重工業 | 100 | |
| 96 | 7012 | 川崎重工業 | 100 | |
| 97 | 7203 | トヨタ自動車 | 1,000 | |
| 98 | 7205 | 日野自動車 | 100 | |
| 99 | 7701 | 島津製作所 | 100 | |
| 100 | 7731 | ニコン | 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 | 7762 シチズン時計 | 100 | |
| | 102 | 7912 大日本印刷 | 100 | |
| | 103 | 7936 アシックス | 100 | |
| | 104 | 7951 ヤマハ | 100 | |
| | 105 | 8035 東京エレクトロン | 100 | |
| | 106 | 8113 ユニ・チャーム | 200 | |
| | 107 | 8252 丸井グループ | 100 | |
| | 108 | 8267 イオン | 300 | |
| | 109 | 8282 ケーズホールディングス | 100 | |
| | 110 | 8308 りそなホールディングス | 900 | |
| | 111 | 8309 三井住友トラスト・ホールディングス | 100 | |
| | 112 | 8316 三井住友フィナンシャルグループ | 600 | |
| | 113 | 8331 千葉銀行 | 200 | |
| | 114 | 8355 静岡銀行 | 200 | |
| | 115 | 8382 中国銀行 | 100 | |
| | 116 | 8418 山口フィナンシャルグループ | 100 | |
| | 117 | 8591 オリックス | 600 | |
| | 118 | 8593 三菱UFJリース | 200 | |
| | 119 | 8630 SOMPOホールディングス | 100 | |
| | 120 | 8697 日本取引所グループ | 200 | |
| | 121 | 8725 MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 200 | |
| | 122 | 8750 第一生命ホールディングス | 500 | |
| | 123 | 8766 東京海上ホールディングス | 300 | |
| | 124 | 8795 T&Dホールディングス | 200 | |
| | 125 | 8801 三井不動産 | 400 | |
| | 126 | 8802 三菱地所 | 500 | |
| | 127 | 8953 日本リートファンド投資法人 投資証券 | 1 | |
| | 128 | 8954 オリックス不動産投資法人 投資証券 | 1 | |
| | 129 | 9001 東武鉄道 | 100 | |
| | 130 | 9005 東急 | 200 | |
| | 131 | 9007 小田急電鉄 | 100 | |
| | 132 | 9020 東日本旅客鉄道 | 100 | |
| | 133 | 9021 西日本旅客鉄道 | 100 | |
| | 134 | 9022 東海旅客鉄道 | 100 | |
| | 135 | 9041 近鉄グループホールディングス | 100 | |
| | 136 | 9042 阪急阪神ホールディングス | 100 | |
| | 137 | 9048 名古屋鉄道 | 100 | |
| | 138 | 9101 日本郵船 | 100 | |
| | 139 | 9104 商船三井 | 100 | |
| | 140 | 9142 九州旅客鉄道 | 100 | |
| | 141 | 9432 日本電信電話 | 600 | |
| | 142 | 9433 KDDI | 800 | |
| | 143 | 9437 NTTドコモ | 600 | |
| | 144 | 9502 中部電力 | 300 | |
| | 145 | 9504 中国電力 | 100 | |
| | 146 | 9508 九州電力 | 200 | |
| | 147 | 9531 東京瓦斯 | 200 | |
| | 148 | 9532 大阪瓦斯 | 200 | |
| | 149 | 9735 セコム | 100 | |
| | 150 | 9831 ヤマダ電機 | 300 | |

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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

(2020年1月24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

(2020年1月24日 現在)

2,252,053,964 円

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

(2020年1月24日 現在)

1,314.908 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

(2020年1月24日 現在)

0.01 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年1月27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 | 現金拠出 |
|-----------------------|-----|----------------------|-----|------|
| 単位 = 1 バスケット | 1 | 1605 国際石油開発帝石 | 300 | |
| 銘柄数 = 138 | 2 | 1801 大成建設 | 100 | |
| バスケット提示日 = 2020年1月27日 | 3 | 1802 大林組 | 300 | |
| 追加設定日 = 2020年1月31日 | 4 | 1803 清水建設 | 200 | |
| | 5 | 1812 鹿島建設 | 200 | |
| ※「○」で表示した銘柄は | 6 | 1925 大和ハウス工業 | 200 | |
| 現金拠出で対応する銘柄です。 | 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 | 4063 信越化学工業 | 200 | |
| | 28 | 4151 協和キリン | 100 | |
| | 29 | 4183 三井化学 | 100 | |
| | 30 | 4185 JSR | 100 | |
| | 31 | 4188 三菱ケミカルホールディングス | 500 | |
| | 32 | 4204 積水化学工業 | 100 | |
| | 33 | 4307 野村総合研究所 | 100 | |
| | 34 | 4324 電通グループ | 200 | |
| | 35 | 4452 花王 | 200 | |
| | 36 | 4502 武田薬品工業 | 600 | |
| | 37 | 4503 アステラス製薬 | 800 | |
| | 38 | 4506 大日本住友製薬 | 100 | |
| | 39 | 4519 中外製薬 | 100 | |
| | 40 | 4523 エーザイ | 100 | |
| | 41 | 4528 小野薬品工業 | 200 | |
| | 42 | 4536 参天製薬 | 100 | |
| | 43 | 4568 第一三共 | 300 | |
| | 44 | 4661 オリエンタルランド | 100 | |
| | 45 | 4689 Zホールディングス | 800 | |
| | 46 | 4755 楽天 | 600 | |
| | 47 | 4901 富士フイルムホールディングス | 100 | |
| | 48 | 4902 コニカミノルタ | 100 | |
| | 49 | 4911 資生堂 | 100 | |
| | 50 | 4912 ライオン | 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 | 現金拠出 |
|-----|------|---------------|-------|------|
| 51 | 5020 | JXTGホールディングス | 1,000 | |
| 52 | 5108 | ブリヂストン | 200 | |
| 53 | 5201 | AGC | 100 | |
| 54 | 5332 | TOTO | 100 | |
| 55 | 5334 | 日本特殊陶業 | 100 | |
| 56 | 5401 | 日本製鉄 | 300 | |
| 57 | 5486 | 日立金属 | 100 | |
| 58 | 5802 | 住友電気工業 | 300 | |
| 59 | 5803 | フジクラ | 100 | |
| 60 | 5938 | LIXILグループ | 100 | |
| 61 | 6098 | リクルートホールディングス | 600 | |
| 62 | 6268 | ナブテスコ | 100 | |
| 63 | 6301 | 小松製作所 | 400 | |
| 64 | 6326 | クボタ | 500 | |
| 65 | 6367 | ダイキン工業 | 100 | |
| 66 | 6471 | 日本精工 | 200 | |
| 67 | 6472 | NTN | 200 | |
| 68 | 6473 | ジェイテクト | 100 | |
| 69 | 6502 | 東芝 | 200 | |
| 70 | 6503 | 三菱電機 | 900 | |
| 71 | 6504 | 富士電機 | 100 | |
| 72 | 6594 | 日本電産 | 100 | |
| 73 | 6645 | オムロン | 100 | |
| 74 | 6701 | 日本電気 | 100 | |
| 75 | 6702 | 富士通 | 100 | |
| 76 | 6724 | セイコーエプソン | 100 | |
| 77 | 6752 | パナソニック | 800 | |
| 78 | 6753 | シャープ | 100 | |
| 79 | 6758 | ソニー | 500 | |
| 80 | 6762 | TDK | 100 | |
| 81 | 6841 | 横河電機 | 100 | |
| 82 | 6845 | アズビル | 100 | |
| 83 | 6857 | アドバンテスト | 100 | |
| 84 | 6869 | シスメックス | 100 | |
| 85 | 6902 | デンソー | 200 | |
| 86 | 6952 | カシオ計算機 | 100 | |
| 87 | 6981 | 村田製作所 | 300 | |
| 88 | 7011 | 三菱重工業 | 100 | |
| 89 | 7012 | 川崎重工業 | 100 | |
| 90 | 7201 | 日産自動車 | 700 | |
| 91 | 7203 | トヨタ自動車 | 900 | |
| 92 | 7205 | 日野自動車 | 100 | |
| 93 | 7261 | マツダ | 200 | |
| 94 | 7269 | スズキ | 200 | |
| 95 | 7272 | ヤマハ発動機 | 100 | |
| 96 | 7731 | ニコン | 100 | |
| 97 | 7733 | オリンパス | 400 | |
| 98 | 7751 | キヤノン | 300 | |
| 99 | 7752 | リコー | 200 | |
| 100 | 7762 | シチズン時計 | 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 | 現金拠出 |
|-----|------|---------------------------|-------|------|
| 101 | 7911 | 凸版印刷 | 100 | |
| 102 | 7912 | 大日本印刷 | 200 | |
| 103 | 7936 | アシックス | 100 | |
| 104 | 7951 | ヤマハ | 100 | |
| 105 | 8001 | 伊藤忠商事 | 600 | |
| 106 | 8002 | 丸紅 | 700 | |
| 107 | 8031 | 三井物産 | 800 | |
| 108 | 8053 | 住友商事 | 500 | |
| 109 | 8058 | 三菱商事 | 600 | |
| 110 | 8113 | ユニ・チャーム | 100 | |
| 111 | 8252 | 丸井グループ | 100 | |
| 112 | 8267 | イオン | 500 | |
| 113 | 8306 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 4,500 | |
| 114 | 8308 | りそなホールディングス | 800 | |
| 115 | 8309 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 100 | |
| 116 | 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ | 500 | |
| 117 | 8411 | みずほフィナンシャルグループ | 9,200 | |
| 118 | 8572 | アコム | 100 | |
| 119 | 8593 | 三菱UFJリース | 200 | |
| 120 | 8601 | 大和証券グループ本社 | 500 | |
| 121 | 8604 | 野村ホールディングス | 1,100 | |
| 122 | 8630 | SOMPOホールディングス | 100 | |
| 123 | 8725 | MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 200 | |
| 124 | 8750 | 第一生命ホールディングス | 400 | |
| 125 | 8766 | 東京海上ホールディングス | 200 | |
| 126 | 8795 | T&Dホールディングス | 200 | |
| 127 | 8801 | 三井不動産 | 300 | |
| 128 | 8802 | 三菱地所 | 400 | |
| 129 | 9021 | 西日本旅客鉄道 | 100 | |
| 130 | 9101 | 日本郵船 | 100 | |
| 131 | 9202 | ANAホールディングス | 100 | |
| 132 | 9432 | 日本電信電話 | 600 | |
| 133 | 9433 | KDDI | 800 | |
| 134 | 9437 | NTTドコモ | 500 | |
| 135 | 9531 | 東京瓦斯 | 400 | |
| 136 | 9532 | 大阪瓦斯 | 400 | |
| 137 | 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ | 200 | |
| 138 | 9783 | ベネッセホールディングス | 100 | |

2020年1月27日

各 位

会社名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者名 代表取締役社長 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
(2020年1月24日 現在)

6,307,004 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT Core指数』の純資産総額
(2020年1月24日 現在)

8,060,689,724 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
(2020年1月24日 現在)

1,278.054 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
(2020年1月24日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年1月27日 現在)

[掲載番号:20]

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 = 2020年1月27日
追加設定日 = 2020年1月31日