

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
(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 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

上場ETF(管理会社:大和アセットマネジメント)に関する日々の開示事項

大和アセットマネジメント株式会社を管理会社として上場するETF銘柄について、以下のとおり2020年7月22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7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1320)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

124,229,978 口

2. 『ダイワ上場投信一日経225』の純資産総額
(2020年7月22日 現在)

2,887,347,959,279 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7月22日 現在)

23,242.0 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7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 (2020年7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7月27日	3	1605 国際石油開発帝石	800	
追加設定日 = 2020年7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	6,000	
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	ENEOS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	現金拠出
101	6113	アマダ	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	8697	日本取引所グループ	2,000	
188	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	600	
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7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1305)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

3,422,422,654 口

2. 『ダイワ上場投信―トピックス』の純資産総額

(2020年7月22日 現在)

5,609,346,270,380 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7月22日 現在)

1,639.00 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7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 (2020年7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7月27日
追加設定日 = 2020年7月31日

2020年7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1585)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

8,969,805 口

2. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の純資産総額
(2020年7月22日 現在)

11,126,487,068 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7月22日 現在)

1,240.438 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7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 (2020年7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7月27日
追加設定日 = 2020年7月31日

2020年7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1599)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

17,184,638 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の純資産総額
(2020年7月22日 現在)

246,696,643,767 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7月22日 現在)

14,355.650 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7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 (2020年7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 = 375	2	1333 マルハニチロ	100	
バスケット提示日 = 2020年7月27日	3	1605 国際石油開発帝石	2,100	
追加設定日 = 2020年7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	100	
	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 カカクコム	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	600	
	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	2,300	
	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	2,200	
	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	400	
	89	3659 ネクソン	1,000	
	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	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	4246 ダイキョーニシカワ	100	
	113	4307 野村総合研究所	600	
	114	4324 電通グループ	400	
	115	4403 日油	200	
	116	4452 花王	1,000	
	117	4502 武田薬品工業	2,600	
	118	4503 アステラス製薬	3,600	
	119	4506 大日本住友製薬	300	
	120	4507 塩野義製薬	500	
	121	4516 日本新薬	100	
	122	4519 中外製薬	1,300	
	123	4521 科研製薬	100	
	124	4523 エーザイ	500	
	125	4528 小野薬品工業	1,000	
	126	4530 久光製薬	100	
	127	4536 参天製薬	800	
	128	4543 テルモ	1,200	
	129	4555 沢井製薬	100	
	130	4568 第一三共	1,200	
	131	4578 大塚ホールディングス	900	
	132	4587 ペプチドリーム	200	
	133	4612 日本ペイントホールディングス	300	
	134	4613 関西ペイント	500	
	135	4631 DIC	200	
	136	4661 オリエンタルランド	400	
	137	4666 パーク24	200	
	138	4681 リゾートトラスト	200	
	139	4684 オービック	100	
	140	4689 Zホールディングス	5,600	
	141	4704 トレンドマイクロ	200	
	142	4716 日本オラクル	100	
	143	4732 ユー・エス・エス	400	
	144	4739 伊藤忠テクノソリューションズ	200	
	145	4751 サイバーエージェント	200	
	146	4755 楽天	1,800	
	147	4768 大塚商会	200	
	148	4819 デジタルガレージ	100	
	149	4849 エン・ジャパン	100	
	150	4902 コニカミノルタ	900	

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	4911	資生堂	800	
152	4912	ライオン	500	
153	4922	コーセー	100	
154	4927	ポーラ・オルビスホールディングス	200	
155	4967	小林製薬	100	
156	5019	出光興産	500	
157	5020	ENEOSホールディングス	6,200	
158	5021	コスモエネルギーホールディングス	100	
159	5101	横浜ゴム	200	
160	5108	ブリヂストン	1,100	
161	5110	住友ゴム工業	400	
162	5201	AGC	400	
163	5233	太平洋セメント	300	
164	5301	東海カーボン	400	
165	5332	TOTO	300	
166	5333	日本碍子	500	
167	5334	日本特殊陶業	300	
168	5393	ニチアス	100	
169	5401	日本製鉄	1,800	
170	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	1,100	
171	5486	日立金属	400	
172	5703	日本軽金属ホールディングス	1,000	
173	5713	住友金属鉱山	500	
174	5714	DOWAホールディングス	100	
175	5801	古河電気工業	100	
176	5802	住友電気工業	1,500	
177	5929	三和ホールディングス	400	
178	5947	リンナイ	100	
179	5975	東プレ	100	
180	6028	テクノプロ・ホールディングス	100	
181	6098	リクルートホールディングス	2,800	
182	6113	アマダ	500	
183	6136	オーエスジー	200	
184	6141	DMG森精機	300	
185	6146	ディスコ	100	
186	6201	豊田自動織機	300	
187	6268	ナブテスコ	200	
188	6273	SMC	100	
189	6301	小松製作所	1,900	
190	6302	住友重機械工業	200	
191	6305	日立建機	200	
192	6324	ハーモニック・ドライブ・システムズ	100	
193	6326	クボタ	2,200	
194	6367	ダイキン工業	500	
195	6383	ダイフク	200	
196	6432	竹内製作所	100	
197	6448	ブラザー工業	500	
198	6463	TPR	100	
199	6471	日本精工	800	
200	6473	ジェイテクト	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
201	6479	ミネベアミツミ	800	
202	6481	THK	300	
203	6501	日立製作所	2,000	
204	6503	三菱電機	4,100	
205	6504	富士電機	200	
206	6506	安川電機	400	
207	6586	マキタ	500	
208	6594	日本電産	1,000	
209	6641	日新電機	100	
210	6645	オムロン	400	
211	6701	日本電気	500	
212	6702	富士通	400	
213	6723	ルネサスエレクトロニクス	1,800	
214	6724	セイコーエプソン	500	
215	6728	アルバック	100	
216	6752	パナソニック	4,700	
217	6755	富士通ゼネラル	100	
218	6758	ソニー	1,800	
219	6762	TDK	200	
220	6770	アルプスアルパイン	400	
221	6806	ヒロセ電機	100	
222	6841	横河電機	400	
223	6845	アズビル	300	
224	6849	日本光電工業	200	
225	6856	堀場製作所	100	
226	6857	アドバンテスト	300	
227	6861	キーエンス	300	
228	6869	シスメックス	300	
229	6902	デンソー	900	
230	6920	レーザーテック	200	
231	6923	スタンレー電気	300	
232	6952	カシオ計算機	400	
233	6954	ファナック	400	
234	6965	浜松ホトニクス	300	
235	6971	京セラ	600	
236	6976	太陽誘電	200	
237	6981	村田製作所	1,200	
238	6988	日東電工	300	
239	7011	三菱重工業	700	
240	7012	川崎重工業	300	
241	7013	IHI	300	
242	7148	FPG	100	
243	7164	全国保証	100	
244	7167	めぶきフィナンシャルグループ	2,100	
245	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,300	
246	7202	いすゞ自動車	1,200	
247	7203	トヨタ自動車	1,600	
248	7205	日野自動車	500	
249	7259	アイシン精機	300	
250	7261	マツダ	1,200	

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	7267	本田技研工業	3,300	
252	7269	スズキ	800	
253	7270	SUBARU	1,300	
254	7272	ヤマハ発動機	600	
255	7276	小糸製作所	200	
256	7282	豊田合成	100	
257	7309	シマノ	200	
258	7313	テイ・エス テック	100	
259	7419	ノジマ	100	
260	7453	良品計画	500	
261	7458	第一興商	100	
262	7459	メディカルホールディングス	400	
263	7532	パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	900	
264	7550	ゼンショーホールディングス	200	
265	7575	日本ライフライン	100	
266	7649	スギホールディングス	100	
267	7701	島津製作所	500	
268	7729	東京精密	100	
269	7731	ニコン	600	
270	7733	オリンパス	2,300	
271	7735	SCREENホールディングス	100	
272	7741	HOYA	800	
273	7747	朝日インテック	500	
274	7751	キヤノン	2,100	
275	7832	バンダイナムコホールディングス	400	
276	7846	パイロットコーポレーション	100	
277	7867	タカラトミー	200	
278	7951	ヤマハ	200	
279	7956	ピジョン	300	
280	7974	任天堂	300	
281	7988	ニフコ	200	
282	8001	伊藤忠商事	2,900	
283	8002	丸紅	4,200	
284	8015	豊田通商	500	
285	8020	兼松	200	
286	8028	ファミリーマート	300	
287	8031	三井物産	3,500	
288	8035	東京エレクトロン	300	
289	8053	住友商事	2,600	
290	8056	日本ユニシス	100	
291	8058	三菱商事	2,700	
292	8088	岩谷産業	100	
293	8111	ゴールドウイン	100	
294	8113	ユニ・チャーム	900	
295	8252	丸井グループ	400	
296	8267	イオン	1,600	
297	8273	イズミ	100	
298	8282	ケーズホールディングス	400	
299	8283	PALTAC	100	
300	8303	新生銀行	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
	301	8304	あおぞら銀行	200
	302	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	20,600
	303	8308	りそなホールディングス	4,400
	304	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	800
	305	8316	三井住友フィナンシャルグループ	2,700
	306	8331	千葉銀行	1,400
	307	8410	セブン銀行	1,400
	308	8411	みずほフィナンシャルグループ	55,500
	309	8439	東京センチュリー	100
	310	8473	SBIホールディングス	500
	311	8570	イオンフィナンシャルサービス	200
	312	8585	オリエン特コーポレーション	1,100
	313	8591	オリックス	2,500
	314	8593	三菱UFJリース	1,000
	315	8601	大和証券グループ本社	3,300
	316	8604	野村ホールディングス	7,200
	317	8628	松井証券	200
	318	8630	SOMPOホールディングス	800
	319	8697	日本取引所グループ	1,200
	320	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
	321	8750	第一生命ホールディングス	2,300
	322	8766	東京海上ホールディングス	1,400
	323	8795	T&Dホールディングス	1,200
	324	8801	三井不動産	2,000
	325	8802	三菱地所	2,900
	326	8804	東京建物	400
	327	8830	住友不動産	900
	328	8850	スターツコーポレーション	100
	329	8876	リログループ	200
	330	8905	イオンモール	200
	331	9001	東武鉄道	400
	332	9003	相鉄ホールディングス	200
	333	9005	東急	1,000
	334	9007	小田急電鉄	600
	335	9008	京王電鉄	200
	336	9009	京成電鉄	300
	337	9020	東日本旅客鉄道	700
	338	9021	西日本旅客鉄道	400
	339	9022	東海旅客鉄道	300
	340	9024	西武ホールディングス	500
	341	9041	近鉄グループホールディングス	400
	342	9042	阪急阪神ホールディングス	500
	343	9045	京阪ホールディングス	200
	344	9048	名古屋鉄道	400
	345	9062	日本通運	100
	346	9064	ヤマトホールディングス	700
	347	9065	山九	100
	348	9086	日立物流	100
	349	9201	日本航空	700
	350	9202	ANA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	9404	日本テレビホールディングス	300	
352	9432	日本電信電話	4,100	
353	9433	KDDI	3,000	
354	9437	NTTドコモ	2,900	
355	9502	中部電力	1,300	
356	9503	関西電力	1,600	
357	9506	東北電力	1,000	
358	9508	九州電力	900	
359	9513	電源開発	300	
360	9531	東京瓦斯	800	
361	9532	大阪瓦斯	800	
362	9602	東宝	200	
363	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	1,100	
364	9678	カナモト	100	
365	9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	200	
366	9697	カブコン	200	
367	9706	日本空港ビルデング	100	
368	9719	SCSK	100	
369	9735	セコム	400	
370	9766	コナミホールディングス	100	
371	9843	ニトリホールディングス	200	
372	9962	ミスミグループ本社	500	
373	9983	ファーストリテイリング	100	
374	9984	ソフトバンクグループ	2,000	
375	9989	サンドラッグ	200	

2020年7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1365)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

377,000 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7月22日 現在)

5,731,517,195 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7月22日 現在)

15,202.96 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7月22日 現在)

0.36 %

● 「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、対象指標は通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、対象指標の通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7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1366)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

7,584,875 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7月22日 現在)

15,041,265,103 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7月22日 現在)

1,983.06 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7月22日 現在)

-0.38 %

●「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7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1367)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22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7月22日 現在)

1,371,598,832 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7月22日 現在)

12,031.57 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7月22日 現在)

0.60 %

● 「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、複数日以上計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「TOPIX」の変動率の「2倍」とはならず、計算上、差が生じます。この差は当該期間中の「TOPIX」の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、「TOPIX」の値動きが一定の範囲内で上昇・下落を繰り返した場合に、マイナスの方向に差が生じ、対象指標は逡減する可能性が高くなります。また、一般に、当該期間が長くなればなるほどその差が大きくなり、対象指標の逡減が強まる特性を持ちます。したがって、当ファンドは、一般的に中長期の投資には向かず、比較的短期間の投資に向く金融商品です。また、原指標に連動するファンドに比べ、当ファンドでは利益・損失の額が大きくなることにも注意が必要です。

【「TOPIX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7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1368)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

1,125,571 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7月22日 現在)

3,249,454,258 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7月22日 現在)

2,886.94 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7月22日 現在)

-0.61 %

● 「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7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1456)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

3,125,138 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7月22日 現在)

18,221,594,413 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7月22日 現在)

5,830.65 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7月22日 現在)

-0.19 %

●「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。

【「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7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1457)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

2,836,300 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7月22日 現在)

19,727,658,893 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7月22日 現在)

6,955.42 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7月22日 現在)

-0.31 %

● 「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7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1464)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7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
(2020年7月22日 現在)

578,277,608 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7月22日 現在)

9,637.96 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7月22日 現在)

0.97 %

● 「J P X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「J P X日経400レバレッジ・インデックス」は原指標の「J P X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、「J P X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、複数日以上の変動期間では、複利効果のため指数値は一般的に「J P X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「J P X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、「J P X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。

【「J P X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J P X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、J P X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J P X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7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1465)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

142,000 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7月22日 現在)

963,895,193 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7月22日 現在)

6,787.99 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7月22日 現在)

-0.49 %

● 「J P X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「J P X日経400インバース・インデックス」は原指標の「J P X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、「J P X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「J P X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「J P X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、「J P X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。

【「J P X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J P X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、J P X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J P X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7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1466)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

350,200 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7月22日 現在)

1,311,152,998 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7月22日 現在)

3,744.01 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7月22日 現在)

-0.98 %

● 「J P X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「J P X日経400ダブルインバース・インデックス」は原指標の「J P X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、「J P X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、複数日以上計算期間では、複利効果のため指数値は一般的に「J P X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「J P X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、「J P X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、対象指標は通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、対象指標の通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。

【「J P X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J P X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、J P X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J P X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7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1479)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

2,143,283 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7月22日 現在)

41,289,331,291 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7月22日 現在)

19,264.53 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7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 (2020年7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	500
銘柄数 = 150	2	1925 大和ハウス工業	4,300
バスケット提示日 = 2020年7月27日	3	2269 明治ホールディングス	600
追加設定日 = 2020年7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	1,400
	6	2502 アサヒグループホールディングス	2,200
	7	2503 キリンホールディングス	4,000
	8	2702 日本マクドナルドホールディングス	200
	9	2802 味の素	1,900
	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	400
	13	3401 帝人	700
	14	3402 東レ	3,800
	15	3436 SUMCO	900
	16	4004 昭和電工	200
	17	4005 住友化学	5,500
	18	4151 協和キリン	1,600
	19	4185 JSR	700
	20	4204 積水化学工業	2,500
	21	4307 野村総合研究所	3,000
	22	4324 電通グループ	200
	23	4452 花王	5,000
	24	4503 アステラス製薬	19,000
	25	4506 大日本住友製薬	1,000
	26	4507 塩野義製薬	3,300
	27	4516 日本新薬	300
	28	4519 中外製薬	6,200
	29	4523 エーザイ	2,300
	30	4528 小野薬品工業	1,500
	31	4530 久光製薬	300
	32	4536 参天製薬	1,600
	33	4543 テルモ	4,200
	34	4568 第一三共	3,400
	35	4578 大塚ホールディングス	2,300
	36	4689 Zホールディングス	20,500
	37	4704 トレンドマイクロ	1,400
	38	4739 伊藤忠テクノソリューションズ	700
	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	1,700
	41	4911 資生堂	3,000
	42	4927 ポーラ・オルビスホールディングス	700
	43	5019 出光興産	300
	44	5020 ENEOSホールディングス	7,100
	45	5101 横浜ゴム	500
	46	5108 プリヂェストン	4,800
	47	5233 太平洋セメント	700
	48	5333 日本碍子	1,100
	49	5334 日本特殊陶業	500
	50	5401 日本製鉄	3,500

ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
51	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	600
52	5486	日立金属	800
53	5802	住友電気工業	3,900
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	5,800
59	6305	日立建機	200
60	6326	クボタ	5,100
61	6383	ダイフク	900
62	6448	ブラザー工業	1,400
63	6460	セガサミーホールディングス	500
64	6465	ホシザキ	400
65	6471	日本精工	900
66	6501	日立製作所	8,800
67	6503	三菱電機	9,300
68	6504	富士電機	600
69	6506	安川電機	1,100
70	6594	日本電産	1,000
71	6645	オムロン	500
72	6701	日本電気	1,200
73	6723	ルネサスエレクトロニクス	2,400
74	6724	セイコーエプソン	1,100
75	6752	パナソニック	15,500
76	6758	ソニー	3,600
77	6857	アドバンテスト	2,000
78	6861	キーエンス	1,300
79	6869	シスメックス	1,400
80	6902	デンソー	1,800
81	6952	カシオ計算機	1,100
82	6963	ローム	400
83	6971	京セラ	1,100
84	7011	三菱重工業	300
85	7182	ゆうちょ銀行	1,400
86	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,600
87	7202	いすゞ自動車	2,200
88	7203	トヨタ自動車	8,300
89	7205	日野自動車	1,600
90	7211	三菱自動車工業	1,900
91	7261	マツダ	1,900
92	7270	SUBARU	2,800
93	7272	ヤマハ発動機	1,300
94	7282	豊田合成	300
95	7731	ニコン	1,100
96	7733	オリンパス	9,600
97	7751	キヤノン	4,100
98	7752	リコー	1,000
99	7912	大日本印刷	400
100	7974	任天堂	500

ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
101	8001	伊藤忠商事	7,700
102	8002	丸紅	5,500
103	8028	ファミリーマート	900
104	8031	三井物産	3,500
105	8035	東京エレクトロン	1,300
106	8058	三菱商事	2,300
107	8113	ユニ・チャーム	3,600
108	8267	イオン	1,000
109	8304	あおぞら銀行	400
110	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	27,400
111	8308	りそなホールディングス	8,800
112	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	1,000
113	8316	三井住友フィナンシャルグループ	2,600
114	8410	セブン銀行	3,800
115	8411	みずほフィナンシャルグループ	63,500
116	8473	SBIホールディングス	800
117	8591	オリックス	8,200
118	8593	三菱UFJリース	900
119	8601	大和証券グループ本社	3,200
120	8604	野村ホールディングス	8,900
121	8630	SOMPOホールディングス	2,800
122	8697	日本取引所グループ	5,600
123	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	4,600
124	8750	第一生命ホールディングス	6,900
125	8766	東京海上ホールディングス	5,300
126	8795	T&Dホールディングス	3,600
127	8905	イオンモール	500
128	9021	西日本旅客鉄道	900
129	9143	SGホールディングス	1,100
130	9201	日本航空	700
131	9202	ANAホールディングス	400
132	9432	日本電信電話	6,900
133	9433	KDDI	6,700
134	9434	ソフトバンク	5,100
135	9437	NTTドコモ	8,900
136	9502	中部電力	600
137	9503	関西電力	700
138	9506	東北電力	900
139	9508	九州電力	800
140	9513	電源開発	200
141	9531	東京瓦斯	1,400
142	9532	大阪瓦斯	1,400
143	9533	東邦瓦斯	200
144	9602	東宝	600
145	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	3,200
146	9719	SCSK	500
147	9735	セコム	900
148	9783	ベネッセホールディングス	200
149	9983	ファーストリテイリング	300
150	9984	ソフトバンクグループ	2,700

2020年7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1488)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

71,406,386 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の純資産総額
(2020年7月22日 現在)

122,504,667,463 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7月22日 現在)

1,715.598 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7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 (2020年7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7月27日
追加設定日 = 2020年7月31日

2020年7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1651)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

16,217,400 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数』の純資産総額
(2020年7月22日 現在)

13,415,851,446 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7月22日 現在)

827.250 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7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 (2020年7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7月27日
追加設定日 = 2020年7月31日

2020年7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1652)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

658,969 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7月22日 現在)

1,304,184,885 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7月22日 現在)

1,979.129 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7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 (2020年7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	800	
銘柄数 = 153	2	1801 大成建設	100	
バスケット提示日 = 2020年7月27日	3	1802 大林組	300	
追加設定日 = 2020年7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	1928 積水ハウス	300	○
現金拠出で対応する銘柄です。	7	2002 日清製粉グループ本社	100	
	8	2229 カルビー	100	
	9	2337 いちご	100	
	10	2371 カカクコム	100	
	11	2412 ベネフィット・ワン	100	
	12	2413 エムスリー	300	
	13	2492 インフォマート	100	
	14	2502 アサヒグループホールディングス	100	
	15	2503 キリンホールディングス	200	
	16	2587 サントリー食品インターナショナル	100	
	17	2768 双日	300	
	18	2784 アルフレッサ ホールディングス	100	
	19	2801 キッコーマン	100	
	20	2802 味の素	200	
	21	2871 ニチレイ	100	
	22	3003 ヒューリック	100	
	23	3064 MonotaRO	100	
	24	3086 J. フロント リテイリング	100	
	25	3099 三越伊勢丹ホールディングス	100	
	26	3289 東急不動産ホールディングス	100	
	27	3401 帝人	100	
	28	3402 東レ	400	
	29	3405 クラレ	100	
	30	3407 旭化成	900	
	31	3626 TIS	200	
	32	3861 王子ホールディングス	400	
	33	4005 住友化学	600	
	34	4151 協和キリン	100	
	35	4183 三井化学	100	
	36	4185 JSR	100	
	37	4188 三菱ケミカルホールディングス	300	
	38	4202 ダイセル	100	
	39	4204 積水化学工業	200	
	40	4205 日本ゼオン	100	
	41	4307 野村総合研究所	300	
	42	4321 ケネディクス	200	
	43	4452 花王	400	
	44	4502 武田薬品工業	100	
	45	4503 アステラス製薬	1,800	
	46	4506 大日本住友製薬	100	
	47	4507 塩野義製薬	300	
	48	4519 中外製薬	700	
	49	4523 エーザイ	200	
	50	4536 参天製薬	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	現金拠出
	51	4543 テルモ	300	
	52	4568 第一三共	200	
	53	4578 大塚ホールディングス	200	
	54	4612 日本ペイントホールディングス	100	
	55	4661 オリエンタルランド	200	
	56	4689 Zホールディングス	1,500	
	57	4732 ユー・エス・エス	200	
	58	4739 伊藤忠テクノソリューションズ	100	
	59	4755 楽天	100	
	60	4768 大塚商会	100	
	61	4901 富士フイルムホールディングス	100	
	62	4902 コニカミノルタ	100	
	63	4911 資生堂	300	
	64	4912 ライオン	100	
	65	5020 ENEOSホールディングス	1,400	
	66	5108 ブリヂストン	400	
	67	5332 TOTO	100	
	68	5333 日本碍子	100	
	69	5334 日本特殊陶業	100	
	70	5423 東京製鐵	100	
	71	5486 日立金属	100	
	72	5802 住友電気工業	300	
	73	6098 リクルートホールディングス	1,100	
	74	6301 小松製作所	300	
	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	6701 日本電気	100	
	82	6724 セイコーエプソン	100	
	83	6758 ソニー	300	
	84	6841 横河電機	100	
	85	6845 アズビル	100	
	86	6857 アドバンテスト	100	
	87	6869 シスメックス	100	
	88	6902 デンソー	100	
	89	6952 カシオ計算機	100	
	90	6981 村田製作所	200	
	91	7182 ゆうちょ銀行	200	
	92	7211 三菱自動車工業	100	
	93	7261 マツダ	100	
	94	7453 良品計画	200	
	95	7459 メディパルホールディングス	100	
	96	7701 島津製作所	100	
	97	7731 ニコン	100	
	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 ピジョン	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	200	
	112	8233 高島屋	100	
	113	8252 丸井グループ	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	2,800	
	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	300	
	121	8355 静岡銀行	200	
	122	8379 広島銀行	100	
	123	8411 みずほフィナンシャルグループ	5,400	
	124	8473 SBIホールディングス	100	
	125	8524 北洋銀行	100	
	126	8585 オリエン트コーポレーション	200	
	127	8591 オリックス	1,100	
	128	8601 大和証券グループ本社	300	
	129	8604 野村ホールディングス	800	
	130	8630 SOMPOホールディングス	400	
	131	8697 日本取引所グループ	700	
	132	8725 MS&ADインシュアランスグループホールディングス	700	
	133	8750 第一生命ホールディングス	900	
	134	8795 T&Dホールディングス	500	
	135	8801 三井不動産	200	
	136	8802 三菱地所	300	
	137	9005 東急	100	
	138	9020 東日本旅客鉄道	100	
	139	9042 阪急阪神ホールディングス	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	600	
	143	9433 KDDI	1,000	
	144	9437 NTTドコモ	800	
	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	9735	セコム	100	
153	9984	ソフトバンクグループ	200	

2020年7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1653)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

2,429,893 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7月22日 現在)

4,854,232,773 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7月22日 現在)

1,997.715 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7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 (2020年7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 バスケット	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	
バスケット提示日 = 2020年7月27日	3	1801 大成建設	100	
追加設定日 = 2020年7月31日	4	1802 大林組	300	
	5	1803 清水建設	200	
※「○」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	2871 ニチレイ	100	
	18	3003 ヒューリック	100	
	19	3105 日清紡ホールディングス	100	
	20	3197 すかいらくホールディングス	100	
	21	3227 MCUBS MidCity投資法人 投資証券	1	
	22	3231 野村不動産ホールディングス	100	
	23	3249 産業ファンド投資法人 投資証券	1	○
	24	3283 日本プロロジスリート投資法人 投資証券	1	
	25	3289 東急不動産ホールディングス	300	
	26	3295 ヒューリックリート投資法人 投資証券	1	
	27	3401 帝人	100	
	28	3402 東レ	600	
	29	3405 クラレ	100	
	30	3407 旭化成	600	
	31	3462 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	2	
	32	3941 レンゴー	100	
	33	4004 昭和電工	100	
	34	4005 住友化学	700	
	35	4063 信越化学工業	200	
	36	4151 協和キリン	100	
	37	4183 三井化学	100	
	38	4188 三菱ケミカルホールディングス	600	
	39	4202 ダイセル	100	
	40	4204 積水化学工業	200	
	41	4272 日本化薬	100	
	42	4307 野村総合研究所	100	
	43	4321 ケネディクス	100	
	44	4452 花王	200	
	45	4503 アステラス製薬	800	
	46	4506 大日本住友製薬	100	
	47	4507 塩野義製薬	100	
	48	4519 中外製薬	300	
	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	5020	ENEOSホールディングス	1,400	
61	5332	TOTO	100	
62	5333	日本碍子	100	
63	5334	日本特殊陶業	100	
64	5486	日立金属	100	
65	5703	日本軽金属ホールディングス	300	
66	5713	住友金属鉱山	100	
67	6098	リクルートホールディングス	600	
68	6268	ナブテスコ	100	
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	6503	三菱電機	800	
75	6504	富士電機	100	
76	6506	安川電機	100	
77	6645	オムロン	100	
78	6701	日本電気	100	
79	6702	富士通	100	
80	6752	パナソニック	1,000	
81	6753	シャープ	100	
82	6754	アンリツ	100	
83	6758	ソニー	600	
84	6762	TDK	100	
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	6981	村田製作所	300	
93	6988	日東電工	100	
94	7011	三菱重工業	100	
95	7012	川崎重工業	100	
96	7203	トヨタ自動車	1,000	
97	7205	日野自動車	100	
98	7701	島津製作所	100	
99	7731	ニコン	100	
100	7762	シチズン時計	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	7912	大日本印刷	100	
102	7936	アシックス	100	
103	7951	ヤマハ	100	
104	8035	東京エレクトロン	100	
105	8113	ユニ・チャーム	200	
106	8252	丸井グループ	100	
107	8267	イオン	300	
108	8282	ケーズホールディングス	100	
109	8308	りそなホールディングス	900	
110	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	200	
111	8316	三井住友フィナンシャルグループ	600	
112	8331	千葉銀行	200	
113	8355	静岡銀行	200	
114	8382	中国銀行	100	
115	8418	山口フィナンシャルグループ	100	
116	8585	オリエントコーポレーション	200	
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	200	
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	日本リテールファンド投資法人 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	9142	九州旅客鉄道	100	
140	9143	SGホールディングス	100	
141	9432	日本電信電話	600	
142	9433	KDDI	700	
143	9437	NTTドコモ	500	
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7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 1654)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

1,634,043 口

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

(2020年7月22日 現在)

1,918,902,470 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7月22日 現在)

1,174.328 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7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 (2020年7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 = 147	2	1801 大成建設	100	
バスケット提示日 = 2020年7月27日	3	1802 大林組	300	
追加設定日 = 2020年7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	500	
	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	500	
	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	3626 TIS	100	
	25	3861 王子ホールディングス	300	
	26	4004 昭和電工	100	
	27	4005 住友化学	600	
	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 電通グループ	100	
	36	4452 花王	200	
	37	4502 武田薬品工業	600	
	38	4503 アステラス製薬	700	
	39	4506 大日本住友製薬	100	
	40	4507 塩野義製薬	100	
	41	4519 中外製薬	200	
	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	200	
	46	4661 オリエンタルランド	100	
	47	4689 Zホールディングス	900	
	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	200	

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	4911 資生堂	100	
	52	4912 ライオン	100	
	53	5020 ENEOSホールディングス	1,000	
	54	5108 プリヂストン	200	
	55	5201 AGC	100	
	56	5301 東海カーボン	100	
	57	5332 TOTO	100	
	58	5334 日本特殊陶業	100	
	59	5401 日本製鉄	300	
	60	5411 ジェイ エフ イー ホールディングス	200	
	61	5486 日立金属	100	
	62	5802 住友電気工業	300	
	63	5803 フジクラ	100	
	64	5938 LIXILグループ	100	
	65	6098 リクルートホールディングス	600	
	66	6268 ナブテスコ	100	
	67	6301 小松製作所	400	
	68	6326 クボタ	500	
	69	6367 ダイキン工業	100	
	70	6448 ブラザー工業	100	
	71	6471 日本精工	200	
	72	6472 NTN	200	
	73	6473 ジェイテクト	100	
	74	6502 東芝	200	
	75	6503 三菱電機	900	
	76	6504 富士電機	100	
	77	6594 日本電産	200	
	78	6645 オムロン	100	
	79	6701 日本電気	100	
	80	6702 富士通	100	
	81	6724 セイコーエプソン	100	
	82	6752 パナソニック	800	
	83	6753 シャープ	100	
	84	6758 ソニー	400	
	85	6762 TDK	100	
	86	6841 横河電機	100	
	87	6845 アズビル	100	
	88	6857 アドバンテス	100	
	89	6869 シスメックス	100	
	90	6902 デンソー	200	
	91	6952 カシオ計算機	100	
	92	6981 村田製作所	200	
	93	7011 三菱重工業	100	
	94	7012 川崎重工業	100	
	95	7201 日産自動車	700	
	96	7203 トヨタ自動車	900	
	97	7205 日野自動車	100	
	98	7211 三菱自動車工業	200	
	99	7259 アイシン精機	100	
	100	7261 マツダ	200	

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	7269 スズキ	200	
	102	7272 ヤマハ発動機	100	
	103	7731 ニコン	100	
	104	7733 オリンパス	400	
	105	7751 キヤノン	300	
	106	7752 リコー	200	
	107	7762 シチズン時計	100	
	108	7911 凸版印刷	100	
	109	7912 大日本印刷	200	
	110	7936 アシックス	100	
	111	7951 ヤマハ	100	
	112	8001 伊藤忠商事	600	
	113	8002 丸紅	700	
	114	8031 三井物産	700	
	115	8053 住友商事	500	
	116	8058 三菱商事	500	
	117	8113 ユニ・チャーム	100	
	118	8252 丸井グループ	100	
	119	8267 イオン	500	
	120	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,600	
	121	8308 りそなホールディングス	800	
	122	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	100	
	123	8316 三井住友フィナンシャルグループ	500	
	124	8411 みずほフィナンシャルグループ	9,400	
	125	8572 アコム	100	
	126	8593 三菱UFJリース	200	
	127	8601 大和証券グループ本社	600	
	128	8604 野村ホールディングス	1,100	
	129	8630 SOMPOホールディングス	100	
	130	8725 MS&ADインシュアランスグループホールディングス	200	
	131	8750 第一生命ホールディングス	400	
	132	8766 東京海上ホールディングス	200	
	133	8795 T&Dホールディングス	200	
	134	8801 三井不動産	300	
	135	8802 三菱地所	400	
	136	9021 西日本旅客鉄道	100	
	137	9064 ヤマトホールディングス	200	
	138	9101 日本郵船	100	
	139	9202 ANAホールディングス	100	
	140	9432 日本電信電話	600	
	141	9433 KDDI	800	
	142	9437 NTTドコモ	600	
	143	9513 電源開発	100	
	144	9531 東京瓦斯	300	
	145	9532 大阪瓦斯	300	
	146	9613 エヌ・ティ・ティ・データ	200	
	147	9735 セコム	100	

2020年7月27日

各 位

会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者名 代表取締役社長 松 下 浩 一
(コード番号 2528)
問合せ先 営業企画部 岩 崎 論
(TEL. 03-5555-4821)

『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7月22日 現在)

6,503,265 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT Core指数』の純資産総額
(2020年7月22日 現在)

6,240,390,908 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7月22日 現在)

959.578 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7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 (2020年7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7月27日
追加設定日 = 2020年7月31日