

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10月23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10月26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10月23日 現在)

126,029,795 口

2. 『ダイワ上場投信一日経225』の純資産総額

(2020年10月23日 現在)

3,045,811,541,769 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10月23日 現在)

24,167.4 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10月23日 現在)

-0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年10月26日 現在)

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バスケット	1	1332 日本水産	2,000
銘柄数 = 225	2	1333 マルハニチロ	200
バスケット提示日 = 2020年10月26日	3	1605 国際石油開発帝石	800
追加設定日 = 2020年10月30日	4	1721 コムシスホールディングス	2,000
	5	1801 大成建設	400
	6	1802 大林組	2,000
	7	1803 清水建設	2,000
	8	1808 長谷工コーポレーション	400
	9	1812 鹿島建設	1,000
	10	1925 大和ハウス工業	2,000
	11	1928 積水ハウス	2,000
	12	1963 日揮ホールディングス	2,000
	13	2002 日清製粉グループ本社	2,000
	14	2269 明治ホールディングス	400
	15	2282 日本ハム	1,000
	16	2413 エムスリー	4,800
	17	2432 ディー・エヌ・エー	600
	18	2501 サッポロホールディングス	400
	19	2502 アサヒグループホールディングス	2,000
	20	2503 キリンホールディングス	2,000
	21	2531 宝ホールディングス	2,000
	22	2768 双日	200
	23	2801 キッコーマン	2,000
	24	2802 味の素	2,000
	25	2871 ニチレイ	1,000
	26	2914 日本たばこ産業	2,000
	27	3086 J. フロント リテイリング	1,000
	28	3099 三越伊勢丹ホールディングス	2,000
	29	3101 東洋紡	200
	30	3103 ユニチカ	200
	31	3105 日清紡ホールディングス	2,000
	32	3289 東急不動産ホールディングス	2,000
	33	3382 セブン&アイ・ホールディングス	2,000
	34	3401 帝人	400
	35	3402 東レ	2,000
	36	3405 クラレ	2,000
	37	3407 旭化成	2,000
	38	3436 SUMCO	200
	39	3659 ネクソン	4,000
	40	3861 王子ホールディングス	2,000
	41	3863 日本製紙	200
	42	4004 昭和電工	200
	43	4005 住友化学	2,000
	44	4021 日産化学	2,000
	45	4042 東ソー	1,000
	46	4043 トクヤマ	400
	47	4061 デンカ	400
	48	4063 信越化学工業	2,000
	49	4151 協和キリン	2,000
	50	4183 三井化学	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
51	4188	三菱ケミカルホールディングス	1,000
52	4208	宇部興産	200
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	6,000
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	200
90	5706	三井金属鉱業	200
91	5707	東邦亜鉛	200
92	5711	三菱マテリアル	200
93	5713	住友金属鉱山	1,000
94	5714	DOWAホールディングス	400
95	5801	古河電気工業	200
96	5802	住友電気工業	2,000
97	5803	フジクラ	2,000
98	5901	東洋製罐グループホールディングス	2,000
99	6098	リクルートホールディングス	6,000
100	6103	オークマ	400

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
101	6113	アマダ	2,000
102	6178	日本郵政	2,000
103	6301	小松製作所	2,000
104	6302	住友重機械工業	400
105	6305	日立建機	2,000
106	6326	クボタ	2,000
107	6361	荏原製作所	400
108	6367	ダイキン工業	2,000
109	6471	日本精工	2,000
110	6472	NTN	2,000
111	6473	ジェイテクト	2,000
112	6479	ミネベアミツミ	2,000
113	6501	日立製作所	400
114	6503	三菱電機	2,000
115	6504	富士電機	400
116	6506	安川電機	2,000
117	6645	オムロン	2,000
118	6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	400
119	6701	日本電気	200
120	6702	富士通	200
121	6703	沖電気工業	200
122	6724	セイコーエプソン	4,000
123	6752	パナソニック	2,000
124	6758	ソニー	2,000
125	6762	TDK	2,000
126	6770	アルプスアルパイン	2,000
127	6841	横河電機	2,000
128	6857	アドバンテスト	4,000
129	6902	デンソー	2,000
130	6952	カシオ計算機	2,000
131	6954	ファナック	2,000
132	6971	京セラ	4,000
133	6976	太陽誘電	2,000
134	6988	日東電工	2,000
135	7003	三井E&Sホールディングス	200
136	7004	日立造船	400
137	7011	三菱重工業	200
138	7012	川崎重工業	200
139	7013	IHI	200
140	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,000
141	7201	日産自動車	2,000
142	7202	いすゞ自動車	1,000
143	7203	トヨタ自動車	2,000
144	7205	日野自動車	2,000
145	7211	三菱自動車工業	200
146	7261	マツダ	400
147	7267	本田技研工業	4,000
148	7269	スズキ	2,000
149	7270	SUBARU	2,000
150	7272	ヤマハ発動機	2,000

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
151	7731	ニコン	2,000
152	7733	オリンパス	8,000
153	7735	SCREENホールディングス	400
154	7751	キヤノン	3,000
155	7752	リコー	2,000
156	7762	シチズン時計	2,000
157	7832	バンダイナムコホールディングス	2,000
158	7911	凸版印刷	1,000
159	7912	大日本印刷	1,000
160	7951	ヤマハ	2,000
161	8001	伊藤忠商事	2,000
162	8002	丸紅	2,000
163	8015	豊田通商	2,000
164	8031	三井物産	2,000
165	8035	東京エレクトロン	2,000
166	8053	住友商事	2,000
167	8058	三菱商事	2,000
168	8233	高島屋	1,000
169	8252	丸井グループ	2,000
170	8253	クレディセゾン	2,000
171	8267	イオン	2,000
172	8303	新生銀行	200
173	8304	あおぞら銀行	200
174	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,000
175	8308	りそなホールディングス	200
176	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	200
177	8316	三井住友フィナンシャルグループ	200
178	8331	千葉銀行	2,000
179	8354	ふくおかフィナンシャルグループ	400
180	8355	静岡銀行	2,000
181	8411	みずほフィナンシャルグループ	200
182	8601	大和証券グループ本社	2,000
183	8604	野村ホールディングス	2,000
184	8628	松井証券	2,000
185	8630	SOMPOホールディングス	500
186	8697	日本取引所グループ	2,000
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	8750	第一生命ホールディングス	200
189	8766	東京海上ホールディングス	1,000
190	8795	T&Dホールディングス	400
191	8801	三井不動産	2,000
192	8802	三菱地所	2,000
193	8804	東京建物	1,000
194	8830	住友不動産	2,000
195	9001	東武鉄道	400
196	9005	東急	1,000
197	9007	小田急電鉄	1,000
198	9008	京王電鉄	400
199	9009	京成電鉄	1,000
200	9020	東日本旅客鉄道	200

ダイワ上場投信一日経225(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
201	9021	西日本旅客鉄道	200
202	9022	東海旅客鉄道	200
203	9062	日本通運	200
204	9064	ヤマトホールディングス	2,000
205	9101	日本郵船	200
206	9104	商船三井	200
207	9107	川崎汽船	200
208	9202	ANAホールディングス	200
209	9301	三菱倉庫	1,000
210	9412	スカパーJSATホールディングス	200
211	9432	日本電信電話	800
212	9433	KDDI	12,000
213	9434	ソフトバンク	2,000
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10月26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10月23日 現在)

3,494,939,239 口

2. 『ダイワ上場投信―トピックス』の純資産総額

(2020年10月23日 現在)

5,966,675,036,162 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10月23日 現在)

1,707.23 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10月23日 現在)

-0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年10月26日 現在)

[掲載番号:2]

ダイワ上場投信ートピックス(設定ポートフォリオ)

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

バスケット提示日 = 2020年10月26日
追加設定日 = 2020年10月30日

2020年10月26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10月23日 現在)

7,013,373 口

2. 『ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials』の純資産総額
(2020年10月23日 現在)

9,050,193,150 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10月23日 現在)

1,290.419 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10月23日 現在)

-0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年10月26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10月26日
追加設定日 = 2020年10月30日

2020年10月26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10月23日 現在)

17,532,294 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400』の純資産総額
(2020年10月23日 現在)

261,570,639,805 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10月23日 現在)

14,919.362 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10月23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10月26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 = 374	2	1333 マルハニチロ	100	
バスケット提示日 = 2020年10月26日	3	1605 国際石油開発帝石	2,100	
追加設定日 = 2020年10月30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	2,300	
	62	3003 ヒューリック	900	
	63	3038 神戸物産	300	○
	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	200	
	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	300	
	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	3,000	
	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	200	
	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 日本酸素ホールディングス	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	2,800	
	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	500	
	115	4403 日油	200	
	116	4452 花王	1,000	
	117	4502 武田薬品工業	2,700	
	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	3,600	
	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	5,700	
	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	1,900	
	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	6,300	
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	1,900	
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	100	
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	1,600	
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	2,900	
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	4,200	
205	6504	富士電機	300	
206	6506	安川電機	500	
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	4,800	
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	2,200	
245	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,400	
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	300	
	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	4,300	
	284	8015 豊田通商	500	
	285	8020 兼松	200	
	286	8031 三井物産	3,600	
	287	8035 東京エレクトロン	300	
	288	8053 住友商事	2,600	
	289	8056 日本ユニシス	100	
	290	8058 三菱商事	2,700	
	291	8088 岩谷産業	100	
	292	8111 ゴールドウイン	100	
	293	8113 ユニ・チャーム	900	
	294	8252 丸井グループ	400	
	295	8267 イオン	1,600	
	296	8273 イズミ	100	
	297	8282 ケーズホールディングス	400	
	298	8283 PALTAC	100	
	299	8303 新生銀行	300	
	300	8304 あおぞら銀行	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
	301	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	20,900
	302	8308	りそなホールディングス	4,500
	303	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	800
	304	8316	三井住友フィナンシャルグループ	2,800
	305	8331	千葉銀行	1,400
	306	8410	セブン銀行	1,400
	307	8411	みずほフィナンシャルグループ	5,600
	308	8439	東京センチュリー	100
	309	8473	SBIホールディングス	500
	310	8570	イオンフィナンシャルサービス	300
	311	8585	オリエントコーポレーション	1,100
	312	8591	オリックス	2,600
	313	8593	三菱UFJリース	1,100
	314	8601	大和証券グループ本社	3,300
	315	8604	野村ホールディングス	7,300
	316	8628	松井証券	200
	317	8630	SOMPOホールディングス	800
	318	8697	日本取引所グループ	1,200
	319	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
	320	8750	第一生命ホールディングス	2,300
	321	8766	東京海上ホールディングス	1,500
	322	8795	T&Dホールディングス	1,200
	323	8801	三井不動産	2,000
	324	8802	三菱地所	2,900
	325	8804	東京建物	400
	326	8830	住友不動産	900
	327	8850	スターツコーポレーション	100
	328	8876	リログループ	200
	329	8905	イオンモール	200
	330	9001	東武鉄道	400
	331	9003	相鉄ホールディングス	200
	332	9005	東急	1,100
	333	9007	小田急電鉄	600
	334	9008	京王電鉄	200
	335	9009	京成電鉄	300
	336	9020	東日本旅客鉄道	700
	337	9021	西日本旅客鉄道	400
	338	9022	東海旅客鉄道	300
	339	9024	西武ホールディングス	500
	340	9041	近鉄グループホールディングス	400
	341	9042	阪急阪神ホールディングス	500
	342	9045	京阪ホールディングス	200
	343	9048	名古屋鉄道	400
	344	9062	日本通運	100
	345	9064	ヤマトホールディングス	700
	346	9065	山九	100
	347	9086	日立物流	100
	348	9201	日本航空	700
	349	9202	ANAホールディングス	700
	350	9404	日本テレビホールディングス	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
351	9432	日本電信電話	4,200	
352	9433	KDDI	3,000	
353	9437	NTTドコモ	2,900	
354	9502	中部電力	1,300	
355	9503	関西電力	1,600	
356	9506	東北電力	1,000	
357	9508	九州電力	900	
358	9513	電源開発	300	
359	9531	東京瓦斯	800	
360	9532	大阪瓦斯	800	
361	9602	東宝	200	
362	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	1,100	
363	9678	カナモト	100	○
364	9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	200	
365	9697	カプコン	200	
366	9706	日本空港ビルデング	100	
367	9719	SCSK	100	
368	9735	セコム	400	
369	9766	コナミホールディングス	100	
370	9843	ニトリホールディングス	200	
371	9962	ミスミグループ本社	500	
372	9983	ファーストリテイリング	100	
373	9984	ソフトバンクグループ	2,000	
374	9989	サンドラッグ	200	

2020年10月26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10月23日 現在)

294,655 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10月23日 現在)

4,801,160,522 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10月23日 現在)

16,294.18 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10月23日 現在)

-0.45 %

● 「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10月26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10月23日 現在)

7,205,875 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10月23日 現在)

12,963,336,307 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10月23日 現在)

1,799.00 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10月23日 現在)

0.44 %

●「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10月26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10月23日 現在)

120,279 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10月23日 現在)

1,552,251,293 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10月23日 現在)

12,905.42 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10月23日 現在)

-0.68 %

● 「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、複数日以上の変算期間では、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10月26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10月23日 現在)

955,571 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10月23日 現在)

2,490,810,521 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10月23日 現在)

2,606.62 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10月23日 現在)

0.67 %

● 「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10月26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10月23日 現在)

2,989,738 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10月23日 現在)

16,633,130,351 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10月23日 現在)

5,563.41 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10月23日 現在)

0.22 %

●「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10月26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10月23日 現在)

3,022,870 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10月23日 現在)

20,028,480,592 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10月23日 現在)

6,625.65 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10月23日 現在)

0.34 %

● 「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10月26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10月23日 現在)

60,000 口

2. 『ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス』の純資産総額
(2020年10月23日 現在)

616,423,530 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10月23日 現在)

10,273.73 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10月23日 現在)

-0.67 %

● 「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10月26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10月23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10月23日 現在)

920,631,366 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10月23日 現在)

6,483.32 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10月23日 現在)

0.33 %

● 「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10月26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10月23日 現在)

180,200 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10月23日 現在)

613,133,603 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10月23日 現在)

3,402.52 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10月23日 現在)

0.66 %

● 「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10月26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10月23日 現在)

2,084,148 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10月23日 現在)

41,217,486,687 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10月23日 現在)

19,776.66 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10月23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10月26日 現在)

ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
単位 = 1 バスケット	1	1878 大東建託	500	
銘柄数 = 149	2	1925 大和ハウス工業	4,300	
バスケット提示日 = 2020年10月26日	3	2269 明治ホールディングス	600	
追加設定日 = 2020年10月30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	
※「○」で表示した銘柄は	6	2502 アサヒグループホールディングス	2,200	
現金拠出で対応する銘柄です。	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	1,700	
	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	19,100	
	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	6,300	
	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	10,100	
	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	20,600	
	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 ブリヂストン	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	現金拠出
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	4,000	
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	9,400	
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	1,300	
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	1,400	
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	9,700	
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	現金拠出
101	8001	伊藤忠商事	7,800	
102	8002	丸紅	5,500	
103	8031	三井物産	3,500	
104	8035	東京エレクトロン	1,300	
105	8058	三菱商事	2,400	
106	8113	ユニ・チャーム	3,600	
107	8267	イオン	1,000	
108	8304	あおぞら銀行	400	
109	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	27,500	
110	8308	りそなホールディングス	8,800	
111	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	1,000	
112	8316	三井住友フィナンシャルグループ	2,600	
113	8410	セブン銀行	3,900	
114	8411	みずほフィナンシャルグループ	6,400	
115	8473	SBIホールディングス	800	
116	8591	オリックス	8,300	
117	8593	三菱UFJリース	900	
118	8601	大和証券グループ本社	3,200	
119	8604	野村ホールディングス	9,000	
120	8630	SOMPOホールディングス	2,800	
121	8697	日本取引所グループ	5,700	
122	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	4,700	
123	8750	第一生命ホールディングス	6,900	
124	8766	東京海上ホールディングス	5,300	
125	8795	T&Dホールディングス	3,600	
126	8905	イオンモール	500	
127	9021	西日本旅客鉄道	1,000	
128	9143	SGホールディングス	2,100	○
129	9201	日本航空	700	
130	9202	ANAホールディングス	400	
131	9432	日本電信電話	6,900	
132	9433	KDDI	6,700	
133	9434	ソフトバンク	5,100	
134	9437	NTTドコモ	9,000	
135	9502	中部電力	600	
136	9503	関西電力	700	
137	9506	東北電力	900	
138	9508	九州電力	800	
139	9513	電源開発	200	
140	9531	東京瓦斯	1,400	
141	9532	大阪瓦斯	1,400	
142	9533	東邦瓦斯	200	
143	9602	東宝	600	
144	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	3,200	
145	9719	SCSK	500	
146	9735	セコム	900	
147	9783	ベネッセホールディングス	200	
148	9983	ファーストリテイリング	300	
149	9984	ソフトバンクグループ	2,700	

2020年10月26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10月23日 現在)

75,602,657 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT指数』の純資産総額

(2020年10月23日 現在)

130,924,439,836 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10月23日 現在)

1,731.744 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10月23日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年10月26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10月26日
追加設定日 = 2020年10月30日

2020年10月26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10月23日 現在)

16,217,338 口

2. 『ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数』の純資産総額
(2020年10月23日 現在)

13,782,447,694 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10月23日 現在)

849.859 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10月23日 現在)

-0.03 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年10月26日 現在)

ダイワ上場投信－TOPIX高配当40指数(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バスケット	1	1605 国際石油開発帝石	1,000
銘柄数 = 40	2	1878 大東建託	100
バスケット提示日 = 2020年10月26日	3	1925 大和ハウス工業	600
追加設定日 = 2020年10月30日	4	1928 積水ハウス	700
	5	2914 日本たばこ産業	1,100
	6	3407 旭化成	1,300
	7	4188 三菱ケミカルホールディングス	1,300
	8	4502 武田薬品工業	1,000
	9	5020 ENEOSホールディングス	2,900
	10	5108 プリヂェストン	500
	11	6178 日本郵政	1,500
	12	6301 小松製作所	900
	13	6902 デンソー	400
	14	7011 三菱重工業	300
	15	7202 いすゞ自動車	600
	16	7203 トヨタ自動車	600
	17	7267 本田技研工業	1,500
	18	7270 SUBARU	600
	19	7751 キヤノン	1,000
	20	8001 伊藤忠商事	1,300
	21	8002 丸紅	2,000
	22	8031 三井物産	1,700
	23	8035 東京エレクトロン	100
	24	8053 住友商事	1,200
	25	8058 三菱商事	1,300
	26	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,600
	27	8308 りそなホールディングス	2,100
	28	8309 三井住友トラスト・ホールディングス	400
	29	8316 三井住友フィナンシャルグループ	1,300
	30	8411 みずほフィナンシャルグループ	2,600
	31	8591 オリックス	1,200
	32	8601 大和証券グループ本社	1,500
	33	8604 野村ホールディングス	3,400
	34	8725 MS&ADインシュアランスグループホールディングス	500
	35	8750 第一生命ホールディングス	1,100
	36	8766 東京海上ホールディングス	700
	37	9433 KDDI	1,300
	38	9434 ソフトバンク	1,700
	39	9437 NTTドコモ	1,400
	40	9503 関西電力	700

2020年10月26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10月23日 現在)

510,127 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10月23日 現在)

1,041,283,127 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10月23日 現在)

2,041.223 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10月23日 現在)

0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年10月26日 現在)

ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数(WIN) (設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数	現金拠出
単位 = 1 バスケット	1	1605 国際石油開発帝石	800	
銘柄数 = 153	2	1801 大成建設	100	
バスケット提示日 = 2020年10月26日	3	1802 大林組	300	
追加設定日 = 2020年10月30日	4	1803 清水建設	300	
	5	1812 鹿島建設	100	
※「○」で表示した銘柄は	6	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	3141 ウェルシアホールディングス	100	
	27	3289 東急不動産ホールディングス	100	
	28	3401 帝人	100	
	29	3402 東レ	400	
	30	3405 クラレ	100	
	31	3407 旭化成	900	
	32	3626 TIS	200	
	33	3861 王子ホールディングス	400	
	34	4005 住友化学	600	
	35	4151 協和キリン	100	
	36	4183 三井化学	100	
	37	4185 JSR	100	
	38	4188 三菱ケミカルホールディングス	300	
	39	4202 ダイセル	100	
	40	4204 積水化学工業	200	
	41	4205 日本ゼオン	100	
	42	4307 野村総合研究所	300	
	43	4321 ケネディクス	200	
	44	4452 花王	400	
	45	4502 武田薬品工業	100	
	46	4503 アステラス製薬	1,800	
	47	4506 大日本住友製薬	100	
	48	4507 塩野義製薬	300	
	49	4519 中外製薬	700	
	50	4523 エーザイ	200	

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	4543 テルモ	300	
	53	4568 第一三共	700	
	54	4578 大塚ホールディングス	200	
	55	4612 日本ペイントホールディングス	100	
	56	4661 オリエンタルランド	200	
	57	4689 Zホールディングス	1,500	
	58	4732 ユー・エス・エス	200	
	59	4739 伊藤忠テクノソリューションズ	100	
	60	4755 楽天	100	
	61	4768 大塚商会	100	
	62	4901 富士フイルムホールディングス	100	
	63	4902 コニカミノルタ	100	
	64	4911 資生堂	300	
	65	4912 ライオン	100	
	66	5020 ENEOSホールディングス	1,400	
	67	5108 プリヂストン	400	
	68	5332 TOTO	100	
	69	5333 日本碍子	100	
	70	5334 日本特殊陶業	100	
	71	5423 東京製鐵	100	
	72	5486 日立金属	100	
	73	5802 住友電気工業	300	
	74	6098 リクルートホールディングス	1,100	
	75	6301 小松製作所	300	
	76	6367 ダイキン工業	100	
	77	6448 ブラザー工業	100	
	78	6479 ミネベアミツミ	200	
	79	6503 三菱電機	700	
	80	6594 日本電産	100	
	81	6645 オムロン	100	
	82	6701 日本電気	100	
	83	6724 セイコーエプソン	100	
	84	6758 ソニー	300	
	85	6841 横河電機	100	
	86	6845 アズビル	100	
	87	6857 アドバンテスト	100	
	88	6869 シスメックス	100	
	89	6902 デンソー	200	
	90	6952 カシオ計算機	100	
	91	6981 村田製作所	200	
	92	7182 ゆうちょ銀行	200	
	93	7211 三菱自動車工業	100	
	94	7261 マツダ	200	
	95	7337 ひろぎんホールディングス	100	
	96	7453 良品計画	200	
	97	7459 メディパルホールディングス	100	
	98	7701 島津製作所	100	
	99	7731 ニコン	100	
	100	7751 キヤノン	200	

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	7752 リコー	100	
	102	7762 シチズン時計	100	
	103	7832 バンダイナムコホールディングス	200	
	104	7911 凸版印刷	100	
	105	7956 ピジョン	100	
	106	8001 伊藤忠商事	800	
	107	8002 丸紅	500	
	108	8031 三井物産	200	
	109	8035 東京エレクトロン	100	
	110	8056 日本ユニシス	100	
	111	8058 三菱商事	200	
	112	8113 ユニ・チャーム	200	
	113	8233 高島屋	100	
	114	8252 丸井グループ	100	
	115	8267 イオン	100	
	116	8282 ケーズホールディングス	100	
	117	8303 新生銀行	100	
	118	8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,800	
	119	8308 りそなホールディングス	900	
	120	8316 三井住友フィナンシャルグループ	300	
	121	8331 千葉銀行	300	
	122	8355 静岡銀行	200	
	123	8411 みずほフィナンシャルグループ	500	
	124	8473 SBIホールディングス	100	
	125	8524 北洋銀行	100	
	126	8585 オリエン特コーポレーション	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	200	○
	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10月26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10月23日 現在)

1,788,049 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10月23日 現在)

3,672,723,326 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10月23日 現在)

2,054.040 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10月23日 現在)

-0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年10月26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10月26日	3	1801 大成建設	100	
追加設定日 = 2020年10月30日	4	1802 大林組	300	
	5	1803 清水建設	300	
※「○」で表示した銘柄は	6	1812 鹿島建設	200	
現金拠出で対応する銘柄です。	7	1860 戸田建設	100	
	8	1911 住友林業	100	
	9	1925 大和ハウス工業	300	
	10	1928 積水ハウス	300	
	11	2267 ヤクルト本社	100	
	12	2503 キリンホールディングス	400	
	13	2587 サントリー食品インターナショナル	100	
	14	2784 アルフレッサ ホールディングス	100	
	15	2801 キッコーマン	100	
	16	2802 味の素	200	
	17	2871 ニチレイ	100	
	18	3003 ヒューリック	100	
	19	3038 神戸物産	100	○
	20	3105 日清紡ホールディングス	100	
	21	3197 すかいらーくホールディングス	100	
	22	3227 MCUBS MidCity投資法人 投資証券	1	
	23	3231 野村不動産ホールディングス	100	
	24	3249 産業ファンド投資法人 投資証券	1	
	25	3283 日本プロロジスリート投資法人 投資証券	1	
	26	3289 東急不動産ホールディングス	300	
	27	3295 ヒューリックリート投資法人 投資証券	1	
	28	3401 帝人	100	
	29	3402 東レ	700	
	30	3405 クラレ	200	
	31	3407 旭化成	600	
	32	3462 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	2	
	33	3941 レンゴー	100	
	34	4004 昭和電工	100	
	35	4005 住友化学	700	
	36	4063 信越化学工業	200	
	37	4151 協和キリン	100	
	38	4183 三井化学	100	
	39	4188 三菱ケミカルホールディングス	600	
	40	4202 ダイセル	100	
	41	4204 積水化学工業	200	
	42	4272 日本化薬	100	
	43	4307 野村総合研究所	200	
	44	4321 ケネディクス	100	
	45	4452 花王	200	
	46	4503 アステラス製薬	900	
	47	4506 大日本住友製薬	100	
	48	4507 塩野義製薬	100	
	49	4519 中外製薬	300	
	50	4523 エーザイ	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
	51	4528 小野薬品工業	200	
	52	4536 参天製薬	200	
	53	4568 第一三共	800	
	54	4578 大塚ホールディングス	200	
	55	4613 関西ペイント	100	
	56	4661 オリエンタルランド	100	
	57	4732 ユー・エス・エス	100	
	58	4755 楽天	400	
	59	4902 コニカミノルタ	200	
	60	4911 資生堂	200	
	61	5020 ENEOSホールディングス	1,500	
	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	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	900	
	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	1,100	
	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	200	
	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	1,000	
	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	300	
	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트コーポレーション	300	
	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	300	
	125	8801 三井不動産	500	
	126	8802 三菱地所	600	
	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	200	○
	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 ヤマダホールディングス	400	

2020年10月26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10月23日 現在)

1,237,691 口

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

(2020年10月23日 現在)

1,503,407,665 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10月23日 現在)

1,214.687 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10月23日 現在)

-0.02 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年10月26日 現在)

ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index(設定ポートフォリオ)

	コード	銘柄名	株数
単位 = 1 バスケット	1	1605 国際石油開発帝石	300
銘柄数 = 143	2	1801 大成建設	100
バスケット提示日 = 2020年10月26日	3	1802 大林組	300
追加設定日 = 2020年10月30日	4	1803 清水建設	200
	5	1812 鹿島建設	200
	6	1925 大和ハウス工業	200
	7	1928 積水ハウス	200
	8	2002 日清製粉グループ本社	100
	9	2433 博報堂DYホールディングス	200
	10	2502 アサヒグループホールディングス	200
	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	400
	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	200
	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	300
	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	700
	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
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	ブリヂストン	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	5938	LIXILグループ	100
64	6098	リクルートホールディングス	600
65	6301	小松製作所	400
66	6326	クボタ	500
67	6367	ダイキン工業	100
68	6448	ブラザー工業	100
69	6471	日本精工	200
70	6473	ジェイテクト	100
71	6502	東芝	200
72	6503	三菱電機	900
73	6504	富士電機	100
74	6594	日本電産	200
75	6645	オムロン	100
76	6701	日本電気	100
77	6702	富士通	100
78	6724	セイコーエプソン	100
79	6752	パナソニック	800
80	6753	シャープ	100
81	6758	ソニー	500
82	6841	横河電機	100
83	6845	アズビル	100
84	6857	アドバンテスト	100
85	6869	シスメックス	100
86	6902	デンソー	200
87	6952	カシオ計算機	100
88	6976	太陽誘電	100
89	6981	村田製作所	300
90	7011	三菱重工業	100
91	7012	川崎重工業	100
92	7201	日産自動車	700
93	7203	トヨタ自動車	900
94	7205	日野自動車	100
95	7211	三菱自動車工業	200
96	7259	アイシン精機	100
97	7261	マツダ	200
98	7269	スズキ	200
99	7272	ヤマハ発動機	100
100	7731	ニコン	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
101	7733	オリンパス	400
102	7751	キヤノン	300
103	7752	リコー	200
104	7911	凸版印刷	100
105	7912	大日本印刷	200
106	7936	アシックス	100
107	7951	ヤマハ	100
108	8001	伊藤忠商事	600
109	8002	丸紅	700
110	8031	三井物産	700
111	8053	住友商事	500
112	8058	三菱商事	500
113	8113	ユニ・チャーム	100
114	8252	丸井グループ	100
115	8267	イオン	500
116	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,800
117	8308	りそなホールディングス	800
118	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	100
119	8316	三井住友フィナンシャルグループ	500
120	8411	みずほフィナンシャルグループ	1,000
121	8572	アコム	100
122	8593	三菱UFJリース	200
123	8601	大和証券グループ本社	600
124	8604	野村ホールディングス	1,100
125	8630	SOMPOホールディングス	100
126	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	200
127	8750	第一生命ホールディングス	400
128	8766	東京海上ホールディングス	200
129	8795	T&Dホールディングス	200
130	8801	三井不動産	400
131	8802	三菱地所	400
132	9021	西日本旅客鉄道	100
133	9064	ヤマトホールディングス	200
134	9101	日本郵船	100
135	9202	ANAホールディングス	100
136	9432	日本電信電話	600
137	9433	KDDI	900
138	9437	NTTドコモ	600
139	9513	電源開発	100
140	9531	東京瓦斯	300
141	9532	大阪瓦斯	300
142	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	200
143	9735	セコム	100

2020年10月26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10月23日 現在)

6,701,645 口

2. 『ダイワ上場投信－東証REIT Core指数』の純資産総額
(2020年10月23日 現在)

6,649,828,787 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10月23日 現在)

992.268 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10月23日 現在)

-0.00 %

5. (別紙)設定にかかる株式のポートフォリオ (2020年10月26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10月26日
追加設定日 = 2020年10月30日