

ダイワ上場投信 - FTSE Blossom Japan Index 組み入れ状況のお知らせ

2017年10月19日

平素は、「ダイワ上場投信 - FTSE Blossom Japan Index」をご愛顧賜り、厚く御礼申し上げます。
当ファンドにおける9月末時点の組み入れ状況についてお知らせいたします。

主要な資産の状況

比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成			株式 市場・上場別構成		株式 業種別構成	
資産	銘柄数	比率		合計98.9%	東証33業種名	比率
国内株式	150	98.9%	一部(東証・名証)	98.7%	電気機器	14.1%
国内株式先物	1	1.1%	二部(東証・名証)	0.2%	輸送用機器	10.2%
不動産投資信託等	---	---	新興市場他	---	化学	9.0%
コール・ローン、その他		1.1%	その他	---	銀行業	8.6%
合計	151	---			機械	6.6%
					情報・通信業	5.9%
					医薬品	5.8%
					食料品	5.0%
					建設業	4.2%
					その他	29.5%

組入上位10銘柄			合計29.8%	
銘柄名		東証33業種名	比率	
トヨタ自動車		輸送用機器	7.3%	
三菱UFJフィナンシャルG		銀行業	3.5%	
東日本旅客鉄道		陸運業	2.8%	
三菱電機		電気機器	2.8%	
セブン&アイ・HLDGS		小売業	2.5%	
小松製作所		機械	2.3%	
三井物産		卸売業	2.2%	
ソニー		電気機器	2.2%	
三井住友フィナンシャルG		銀行業	2.1%	
武田薬品		医薬品	2.1%	

先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

バーゼル規制(金融機関の自己資本比率規制)等のリスク算定が必要の際は販売会社にご連絡ください。

当資料のお取り扱いにおけるご注意

当資料は、ファンドの状況や関連する情報等をお知らせするために大和投資信託により作成されたものです。当ファンドのお申込みにあたっては、「投資信託説明書(交付目録見書)」の内容を必ずご確認のうえ、ご自身でご判断ください。投資信託は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではありません。信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。投資信託は預貯金とは異なります。投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。証券会社以外でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。当資料は、信頼できると考えられる情報源から作成していますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。運用実績などの記載内容は過去の実績であり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。また、税金、手数料等を考慮していませんので、投資者のみなさまの実質的な投資成果を示すものではありません。当資料の中で記載されている内容、数値、図表、意見等は資料作成時点のものであり、今後予告なく変更されることがあります。当資料の中で個別企業名が記載されている場合、それらはあくまでも参考のために掲載したものであり、各企業の推奨を目的とするものではありません。また、ファンドに今後組み入れることを、示唆・保証するものではありません。分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

販売会社等についてのお問い合わせ 大和投資信託 フリーダイヤル0120-106212(営業日の9:00~17:00) HP <http://www.daiwa-am.co.jp/>

大和投資信託

Daiwa Asset Management

No.	銘柄コード	銘柄名	数量(株)	評価金額(円)	組入比率
1	7203	トヨタ自動車	22,600	151,646,000	7.2923%
2	8306	三菱UFJフィナンシャルG	99,600	72,777,720	3.4997%
3	9020	東日本旅客鉄道	5,700	59,194,500	2.8465%
4	6503	三菱電機	32,800	57,662,400	2.7728%
5	3382	セブン&アイ・HLDGS	11,800	51,271,000	2.4655%
6	6301	小松製作所	15,200	48,655,200	2.3397%
7	8031	三井物産	27,800	46,231,400	2.2232%
8	6758	ソニー	10,900	45,627,400	2.1941%
9	8316	三井住友フィナンシャルG	10,300	44,496,000	2.1397%
10	4502	武田薬品	6,900	42,876,600	2.0618%
11	9984	ソフトバンクグループ	4,400	39,969,600	1.9220%
12	8411	みずほフィナンシャルG	196,600	38,749,860	1.8634%
13	2914	日本たばこ産業	10,300	37,986,400	1.8267%
14	6326	クボタ	18,500	37,841,750	1.8197%
15	3407	旭化成	22,000	30,470,000	1.4652%
16	6752	パナソニック	18,400	30,001,200	1.4427%
17	9433	KDDI	9,400	27,889,800	1.3412%
18	4452	花王	4,200	27,804,000	1.3370%
19	4503	アステラス製薬	18,700	26,769,050	1.2873%
20	4661	オリエンタルランド	2,900	24,864,600	1.1957%
21	4188	三菱ケミカルHLDGS	22,600	24,227,200	1.1650%
22	6902	デンソー	4,200	23,910,600	1.1498%
23	8766	東京海上HD	5,400	23,770,800	1.1431%
24	9531	東京瓦斯	8,300	22,891,400	1.1008%
25	8035	東京エレクトロン	1,300	22,464,000	1.0802%
26	---	NK400先物 2912月	15	22,185,000	1.0668%
27	9021	西日本旅客鉄道	2,800	21,901,600	1.0532%
28	1925	大和ハウス	5,600	21,756,000	1.0462%
29	7011	三菱重工業	4,700	20,910,300	1.0055%
30	1801	大成建設	3,500	20,650,000	0.9930%
31	8002	丸紅	26,000	19,981,000	0.9608%
32	2503	キリンHD	7,200	19,065,600	0.9168%
33	6645	オムロン	3,300	18,909,000	0.9093%
34	7201	日産自動車	16,700	18,612,150	0.8950%
35	4005	住友化学	26,000	18,278,000	0.8789%
36	8802	三菱地所	9,100	17,804,150	0.8562%
37	8750	第一生命HLDGS	8,800	17,767,200	0.8544%
38	8267	イオン	10,600	17,622,500	0.8474%
39	9432	日本電信電話	3,400	17,533,800	0.8432%
40	9437	NTTドコモ	6,700	17,222,350	0.8282%
41	1812	鹿島建設	15,000	16,770,000	0.8064%
42	9532	大阪瓦斯	7,900	16,526,800	0.7947%
43	8604	野村ホールディングス	26,000	16,380,000	0.7877%
44	4911	資生堂	3,400	15,306,800	0.7361%
45	6762	TDK	2,000	15,280,000	0.7348%
46	1802	大林組	11,200	15,108,800	0.7265%
47	2502	アサヒグループHD	3,300	15,034,800	0.7230%
48	4568	第一三共	5,900	14,974,200	0.7201%
49	1605	国際石油開発帝石	11,900	14,226,450	0.6841%
50	8725	MS&AD	3,900	14,129,700	0.6795%
51	4901	富士フイルムHLDGS	3,200	13,974,400	0.6720%
52	4523	エーザイ	2,400	13,862,400	0.6666%
53	6702	富士通	16,000	13,374,400	0.6431%
54	5201	旭硝子	3,200	13,360,000	0.6424%
55	6506	安川電機	3,700	13,190,500	0.6343%
56	3405	クラレ	6,200	13,044,800	0.6273%
57	5938	LIXILグループ	4,300	12,839,800	0.6174%
58	8630	SOMPOホールディングス	2,800	12,258,400	0.5895%
59	7912	大日本印刷	4,500	12,118,500	0.5827%
60	8309	三井住友トラストHD	2,900	11,776,900	0.5663%
61	5332	TOTO	2,400	11,376,000	0.5470%
62	4183	三井化学	3,200	10,944,000	0.5263%
63	7911	凸版印刷	9,000	10,044,000	0.4830%
64	7701	島津製作所	4,500	9,972,000	0.4795%
65	8308	りそなホールディングス	16,900	9,768,200	0.4697%
66	2802	味の素	4,400	9,662,400	0.4646%

No.	銘柄コード	銘柄名	数量(株)	評価金額(円)	組入比率
67	7733	オリンパス	2,500	9,525,000	0.4580%
68	1928	積水ハウス	5,000	9,482,500	0.4560%
69	4519	中外製薬	2,000	9,340,000	0.4491%
70	6869	シスメックス	1,300	9,334,000	0.4488%
71	3861	王子ホールディングス	15,000	9,105,000	0.4378%
72	7012	川崎重工業	2,400	8,952,000	0.4305%
73	7261	マツダ	4,900	8,452,500	0.4065%
74	6268	ナブテスコ	1,900	7,942,000	0.3819%
75	4004	昭和電工	2,200	7,711,000	0.3708%
76	9202	ANAホールディングス	1,800	7,666,200	0.3686%
77	6841	横河電機	4,000	7,664,000	0.3685%
78	8601	大和証券G本社	12,000	7,647,600	0.3678%
79	8795	T&Dホールディングス	4,600	7,514,100	0.3613%
80	4185	J S R	3,300	7,055,400	0.3393%
81	3401	帝人	3,100	6,875,800	0.3306%
82	4204	積水化学	3,100	6,863,400	0.3300%
83	6963	ローム	700	6,748,000	0.3245%
84	6361	荏原製作所	1,700	6,349,500	0.3053%
85	9101	日本郵船	2,700	6,315,300	0.3037%
86	2282	日本ハム	2,000	6,190,000	0.2977%
87	9613	NTTデータ	5,100	6,140,400	0.2953%
88	9104	商船三井	1,800	6,138,000	0.2952%
89	6701	日本電気	2,000	6,100,000	0.2933%
90	7752	リコー	5,500	6,017,000	0.2893%
91	6305	日立建機	1,800	6,003,000	0.2887%
92	6724	セイコーエプソン	2,200	5,990,600	0.2881%
93	6471	日本精工	3,900	5,916,300	0.2845%
94	7731	ニコン	3,000	5,853,000	0.2815%
95	7951	ヤマハ	1,400	5,810,000	0.2794%
96	2331	総合警備保障	1,100	5,676,000	0.2729%
97	4689	ヤフー	10,600	5,660,400	0.2722%
98	6504	富士電機	9,000	5,616,000	0.2701%
99	5486	日立金属	3,500	5,481,000	0.2636%
100	6845	アズビル	1,100	5,307,500	0.2552%
101	4217	日立化成	1,700	5,244,500	0.2522%
102	2651	ローソン	700	5,215,000	0.2508%
103	2801	キッコーマン	1,500	5,190,000	0.2496%
104	4508	田辺三菱製薬	2,000	5,160,000	0.2481%
105	8252	丸井グループ	3,200	5,155,200	0.2479%
106	4912	ライオン	2,200	4,518,800	0.2173%
107	9783	ベネッセホールディングス	1,100	4,466,000	0.2148%
108	4151	協和発酵キリン	2,300	4,402,200	0.2117%
109	2002	日清製粉G本社	2,300	4,335,500	0.2085%
110	9107	川崎汽船	1,400	4,144,000	0.1993%
111	6753	シャープ	1,200	4,074,000	0.1959%
112	5334	日本特殊陶業	1,700	4,071,500	0.1958%
113	5803	フジクラ	4,500	4,068,000	0.1956%
114	4307	野村総合研究所	900	3,951,000	0.1900%
115	4902	コニカミノルタ	3,700	3,418,800	0.1644%
116	3863	日本製紙	1,600	3,347,200	0.1610%
117	6472	N T N	7,000	3,332,000	0.1602%
118	5002	昭和シェル石油	2,500	3,237,500	0.1557%
119	4062	イビデン	1,800	3,227,400	0.1552%
120	3436	SUMCO	1,800	3,186,000	0.1532%
121	3003	ヒューリック	2,800	3,088,400	0.1485%
122	6952	カシオ	1,900	3,009,600	0.1447%
123	6857	アドバンテスト	1,400	2,947,000	0.1417%
124	5947	リンナイ	300	2,889,000	0.1389%
125	6925	ウシオ電機	1,900	2,851,900	0.1371%
126	3289	東急不動産HD	4,000	2,716,000	0.1306%
127	4922	コーセー	200	2,578,000	0.1240%
128	2871	ニチレイ	900	2,542,500	0.1223%
129	7936	アシックス	1,500	2,514,000	0.1209%
130	7735	SCREENホールディングス	300	2,340,000	0.1125%
131	8359	八十二銀行	3,200	2,249,600	0.1082%
132	4506	大日本住友製薬	1,500	2,196,000	0.1056%

No.	銘柄コード	銘柄名	数量(株)	評価金額(円)	組入比率
133	5101	横浜ゴム	900	2,088,000	0.1004%
134	5021	コスモエネルギーHLDGS	800	2,060,000	0.0991%
135	8036	日立ハイテクノロジーズ	500	2,040,000	0.0981%
136	8593	三菱UFJリース	3,400	2,026,400	0.0974%
137	8439	東京センチュリー	400	2,024,000	0.0973%
138	2810	ハウス食品G本社	600	2,007,000	0.0965%
139	6366	千代田化工建	3,000	1,974,000	0.0949%
140	1911	住友林業	1,100	1,936,000	0.0931%
141	6849	日本光電工業	700	1,702,400	0.0819%
142	4739	伊藤忠テクノソリューションズ	400	1,680,000	0.0808%
143	2501	サッポロホールディングス	500	1,517,500	0.0730%
144	9719	S C S K	300	1,432,500	0.0689%
145	8572	アコム	2,900	1,264,400	0.0608%
146	6756	日立国際電気	400	1,232,000	0.0592%
147	8060	キャノンマーケティングJPN	400	1,075,600	0.0517%
148	8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	800	896,000	0.0431%
149	7862	トッパン・フォームズ	700	835,800	0.0402%
150	8586	日立キャピタル	300	802,200	0.0386%
151	9409	テレビ朝日HD	300	672,300	0.0323%

以上

ダイワ上場投信 - FTSE Blossom Japan Index

お申し込みの際は、必ず「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。

ファンドの目的・特色

ファンドの目的

信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を「FTSE Blossom Japan Index」の変動率に一致させることを目的とします。

ファンドの特色

1. 信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を「FTSE Blossom Japan Index」の変動率に一致させることを目的として、「FTSE Blossom Japan Index」に採用されている銘柄（採用予定を含みます。）の株式に投資します。

「FTSE Blossom Japan Index」について

FTSE Blossom Japan IndexはFTSE International Limitedにより選定されたESG（環境、社会、ガバナンス）要因への対応力が優れた企業で構成される株価指数です。

ESG Ratingsは、市場参加者がステューワードシップ活動および対話（エンゲージメント）に活用できる明確なESG基準に基づいて行なわれます。

ESG Ratingsに用いる評価項目は、事業活動そのものが属する業種と、それが行なわれる地理的条件に合わせて決定されます。また、企業行動や投資家ニーズ、社会の関心など、時代の変遷に対応するために定期的に見直しが行なわれます。

原則として6月と12月の年2回、ESG Ratingsの見直しとそれに基づいた指数構成銘柄の見直し、および時価総額に基づいた構成比率の見直しを行いません。

2. 当ファンドは、通常の証券投資信託とは異なる仕組みを有しています。

受益権は、東京証券取引所に上場され、株式と同様に売買することができます。

追加設定は、株式により行ないます。

受益権を株式と交換することができます。

収益分配金は、名義登録受益者に対して支払われます。

くわしくは「投資信託説明書（交付目論見書）」の「ファンドの目的・特色」をご覧ください。

ダイワ上場投信 - FTSE Blossom Japan Index

お申し込みの際は、必ず「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。

ファンドの目的・特色

●指数の著作権等について

"The Daiwa ETF FTSE Blossom Japan Index is not in any way sponsored, endorsed, sold or promoted by FTSE International Limited ("FTSE") or the London Stock Exchange Group companies ("LSEG") (together the "Licensor Parties") and none of the Licensor Parties make any claim, prediction, warranty or representation whatsoever, expressly or impliedly, either as to (i) the results to be obtained from the use of the FTSE Blossom Japan Index (the "Index") (upon which the Daiwa ETF FTSE Blossom Japan Index is based), (ii) the figure at which the Index is said to stand at any particular time on any particular day or otherwise, or (iii) the suitability of the Index for the purpose to which it is being put in connection with the Daiwa ETF FTSE Blossom Japan Index.

None of the Licensor Parties have provided or will provide any financial or investment advice or recommendation in relation to the Index to Daiwa Asset Management Co.Ltd. or to its clients. The Index is calculated by FTSE or its agent. None of the Licensor Parties shall be (a) liable (whether in negligence or otherwise) to any person for any error in the Index or (b) under any obligation to advise any person of any error therein.

All rights in the Index vest in FTSE. "FTSE®" is a trade mark of LSEG and is used by FTSE under licence" .

ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Indexは、いかなる形式においてもFTSEインターナショナルリミテッド（以下「FTSE」）またはロンドン証券取引所グループ各社（以下「LSEG」）（以下「FTSE」と「LSEG」を併せて「ライセンサ」）によって出資、保証、販売または販売促進されることはございません。そして、ライセンサのいかなる当事者も、明示的にも黙示的にも、次に関するいかなる請求、予測、保証または表明は行いません。(i)（ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Indexの基となる）当該指数の使用により得られる結果 (ii) 特定の日時等にインデックスが示す数値 (iii) ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Indexに対するインデックスの適合性

また、ライセンサのいかなる当事者も、大和証券投資信託委託株式会社に対して当該インデックスに関連した財務助言、投資助言、または勧告は行いません。当該インデックスはFTSEまたはその代理人によって計算されますが、ライセンサのいかなる当事者も (a) 指数における瑕疵について（過失の有無を問わず）何人にも責任を負いません。(b) 何人にも瑕疵について知らせる義務はございません。

インデックスのすべての権利はFTSEに帰属します。「FTSE®」はLSEGの商標であり、ライセンスに基づきFTSEによって使用されます。

ダイワ上場投信 - FTSE Blossom Japan Index

お申し込みの際は、必ず「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。

投資リスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。投資信託は預貯金とは異なります。基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

「株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）」、「その他」
 基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。
 基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。
 くわしくは「投資信託説明書（交付目論見書）」の「投資リスク」をご覧ください。

ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用		
	料率等	費用の内容
取得時手数料	販売会社が定めるものとします。	取得時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。
信託財産留保額	ありません。	
交換時手数料	販売会社が定めるものとします。	受益権の交換に関する事務等の対価です。
投資者が信託財産で間接的に負担する費用		
運用管理費用（信託報酬）	毎日、次のイ・の額にロ・の額を加算して得た額 イ．信託財産の純資産総額に年率 0.162% (税抜 0.15%) 以内を乗じて得た額 ロ．信託財産に属する株式の貸付けにかかる品貸料に 54% (税抜 50%) 以内の率を乗じて得た額	
その他の費用・手数料	受益権の上場にかかる費用および対象株価指数の商標の使用料（商標使用料）ならびにこれらにかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。 有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、監査報酬等を信託財産でご負担いただきます。 売買委託手数料などの「その他の費用・手数料」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。	

取得時手数料・交換時手数料について、くわしくは販売会社にお問合わせください。
 手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。
 くわしくは「投資信託説明書（交付目論見書）」の「手続・手数料等」をご覧ください。

設定・運用：

大和投資信託

Daiwa Asset Management

商号等 大和証券投資信託委託株式会社
 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第352号
 加入協会 一般社団法人投資信託協会
 一般社団法人日本投資顧問業協会