

平成 28 年 1 月 26 日

各 位

管理会社名 サムスン資産運用株式会社
(管理会社コード 13134)
代表者名 代表理事社長 具 聖勳
問合せ先 (代理人)西村あさひ法律事務所
弁護士 伊東 啓
(TEL. 03-6250-6200)

上場ETF(管理会社:サムスン資産運用)に関する日々の開示事項

サムスン資産運用株式会社を管理会社として上場する ETF 銘柄につきまして、以下の通り、日々の開示事項の状況をご報告致します。

上場ETF(2 銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	サムスンKODEX200証券上場指数投資信託[株式]	1313	東
2	サムスンKODEXサムスングループ株証券上場指数投資信託[株式]	1584	東

※ 各銘柄の状況につきましては、次の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頂きますと、各銘柄の状況が表示されます。

以上

平成 28 年 1 月 26 日

[掲載番号:1]

各 位

管理会社名 サムスン資産運用株式会社
 (管理会社コード 13134)
 代表者名 代表理事社長 具 聖勳
 (銘柄コード 1313(外国 ETF))
 問合せ先 (代理人)西村あさひ法律事務所
 弁護士 伊東 啓
 (TEL. 03-6250-6200)

サムスン KODEX200 証券上場指数投資信託[株式]に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成 28 年 1 月 26 日現在)

182,250,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成 28 年 1 月 25 日現在)

(平成 28 年 1 月 25 日に三菱東京 UFJ 銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値 1 ウォン=0.0993 円で計算)

424,278,186,524 円 (4,272,690,700,139 ウォン)

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成 28 年 1 月 25 日現在)

(平成 28 年 1 月 25 日に三菱東京 UFJ 銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値 1 ウォン=0.0993 円で計算)

2,328.00 円 (23,444.12 ウォン)

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と(KOSPI200×100)の終値の変動率に係る乖離率

(平成 28 年 1 月 25 日現在)

-0.01 %

(参考)乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{上場 ETF の一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場 ETF の一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{KOSPI200 の終値}}{\text{前営業日の KOSPI200 の終値}} \right] \times 100$$

* 平成 28 年 1 月 25 日 KOSPI200 終値 230.21 ポイント

指標価格については、 https://eng.krx.co.kr/m1/m1_1/m1_1_1/JHPENG01001_01.jsp

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定（平成 28 年 1 月 26 日設定分）

No	KR コード	コード	銘柄名	株式数
1			(現金)	(23,919,508 ウォン)
2	KR7005930003	005930	SamsungElec	201
3	KR7015760002	015760	KEPCO	585
4	KR7005380001	005380	HyundaiMtr	281
5	KR7028260008	028260	SAMSUNG C&T	155
6	KR7012330007	012330	Mobis	124
7	KR7090430000	090430	AMOREPACIFIC	59
8	KR7035420009	035420	NAVER	48
9	KR7000660001	000660	SK hynix	1,060
10	KR7018260000	018260	SAMSUNG SDS	57
11	KR7051910008	051910	LGCHEM	85
12	KR7032830002	032830	SAMSUNG LIFE	182
13	KR7000270009	000270	KiaMtr	480
14	KR7055550008	055550	ShinhanGroup	777
15	KR7034730002	034730	SK	64
16	KR7017670001	017670	SKTelecom	103
17	KR7051900009	051900	LGH&H	17
18	KR7005490008	005490	POSCO	135
19	KR7000810002	000810	SamsungF&MIns	65
20	KR7033780008	033780	KT&G	200
21	KR7096770003	096770	SK Innovation	127
22	KR7003550001	003550	LG Corp.	172
23	KR7002790004	002790	AmoreG	51
24	KR7105560007	105560	KBFinancialGroup	667
25	KR7066570003	066570	LGELECTRONICS	193
26	KR7010950004	010950	S-Oil	82
27	KR7011170008	011170	LOTTE CHEMICAL Corp	28
28	KR7035250000	035250	Kangwonland	254
29	KR7001040005	001040	CJ	24
30	KR7010130003	010130	KorZinc	16
31	KR7034220004	034220	LG Display	423
32	KR7128940004	128940	HanmiPharm	11
33	KR7086280005	086280	HYUNDAIGLOVIS	34
34	KR7021240007	021240	COWAY	92
35	KR7023530009	023530	LOTTE SHOPPING	18
36	KR7006400006	006400	SAMSUNG SDI CO.,LTD.	94
37	KR7030200000	030200	KT	404
38	KR7047810007	047810	KOREA AEROSPACE	125
39	KR7009540006	009540	HHI	89
40	KR7004020004	004020	HYUNDAI STEEL	157
41	KR7009240003	009240	Hanssem	17

No	KRコード	コード	銘柄名	株式数
42	KR7024110009	024110	IBK	505
43	KR7086790003	086790	HANAFINANCIALGR	510
44	KR7001800002	001800	ORION	7
45	KR7088350004	088350	HANWHA LIFE	792
46	KR7000030007	000030	Woori Bank	552
47	KR7161390000	161390	HANKOOK TIRE	136
48	KR7097950000	097950	CJ CheilJedang	15
49	KR7036570000	036570	NCsoft	32
50	KR7000120006	000120	CJ korea express	17
51	KR7139480008	139480	emart	38
52	KR7007070006	007070	GS Retail	49
53	KR7007310006	007310	Ottogi	3
54	KR7005830005	005830	DongbuIns	78
55	KR7078930005	078930	GS	94
56	KR7051600005	051600	KEPCO KPS	41
57	KR7002380004	002380	KCC	10
58	KR7009830001	009830	HanwhaChem	193
59	KR7032640005	032640	LG Uplus	519
60	KR7009150004	009150	SamsungElecMech	108
61	KR7004800009	004800	Hyosung	42
62	KR7012750006	012750	S-1	46
63	KR7000720003	000720	HyundaiEng&Const	130
64	KR7000100008	000100	Yuhan	15
65	KR7029780004	029780	SAMSUNG CARD	63
66	KR7004990008	004990	LotteConf	1
67	KR7012630000	012630	Hyundai Dvp Co	116
68	KR7036460004	036460	Kogas	67
69	KR7005610001	005610	SamlipGenFood	4
70	KR7069960003	069960	HYUNDAIDEPTST	28
71	KR7011210002	011210	HYUNDAI WIA	27
72	KR7004370003	004370	Nongshim	6
73	KR7016360000	016360	SamsungSecu	104
74	KR7008770000	008770	HtlShilla	61
75	KR7005300009	005300	LotteChilsung	1
76	KR7006280002	006280	GC Corp	11
77	KR7000210005	000210	DaelimInd	51
78	KR7006800007	006800	DaewooSecu	329
79	KR7000880005	000880	Hanwha	82
80	KR7005940002	005940	NHIS	281
81	KR7030000004	030000	CheilWorldwide	145
82	KR7071050009	071050	KIH	76
83	KR7010140002	010140	SamsungHvyInd	275
84	KR7105630008	105630	Hansae	30
85	KR7047040001	047040	DWEC	383

No	KR コード	コード	銘柄名	株式数
86	KR7005440003	005440	HYUNDAIGREENFOOD	99
87	KR7037620002	037620	MIRAEASSETSEC	133
88	KR7111770004	111770	Youngone Corp	40
89	KR7138930003	138930	BNK Financial Group	522
90	KR7161890009	161890	KOREA KOLMAR	31
91	KR7004170007	004170	Shinsegae	14
92	KR7011070000	011070	LG Innotek	26
93	KR7000080002	000080	HITEJINRO	58
94	KR7014820005	014820	DWS	7
95	KR7006120000	006120	SKChem	31
96	KR7003490000	003490	KAL	70
97	KR7012450003	012450	HANWHA TECHWIN	68
98	KR7000670000	000670	Youngpoong	1
99	KR7034020008	034020	DHICO	105
100	KR7192820009	192820	COSMAX	12
101	KR7000240002	000240	HANKOOK TIRE WORLDWI	43
102	KR7000150003	000150	DOOSAN	13
103	KR7047050000	047050	DWIC	75
104	KR7185750007	185750	CHONGKUNDANG	13
105	KR7010060002	010060	OCI	28
106	KR7011780004	011780	KumhoPetrochem	33
107	KR7120110002	120110	KOLON IND	30
108	KR7049770001	049770	DongwonF&B	2
109	KR7000070003	000070	SAMYANGHOLDINGS	8
110	KR7170900005	170900	Donga ST	11
111	KR7114090004	114090	GKL	57
112	KR7010620003	010620	HyundaiMipoDock	18
113	KR7001740000	001740	SKNetworks	270
114	KR7001680008	001680	Daesang	38
115	KR7002270007	002270	LotteFood	1
116	KR7003450004	003450	HyundaiSecu	261
117	KR7064960008	064960	S&T MOTIV	15
118	KR7017800004	017800	HyundaiElev	25
119	KR7007570005	007570	IlyangPharm	23
120	KR7108670001	108670	LG HAUSYS	11
121	KR7010120004	010120	LSINDUSTRIALSYSTEMS	30
122	KR7006260004	006260	LS	33
123	KR7145990008	145990	SYC	5
124	KR7068870005	068870	LGLS	21
125	KR7003410008	003410	SsangyongCement	103
126	KR7011790003	011790	SKC	38
127	KR7042660001	042660	DSME	254
128	KR7006650006	006650	KPIC	5
129	KR7002350007	002350	NEXENTIRE	72

No	KR コード	コード	銘柄名	株式数
130	KR7003000007	003000	BukwangPharm	45
131	KR7001120005	001120	LGInt	49
132	KR7052690005	052690	KEPCO E&C	24
133	KR7010780005	010780	IS DONGSEO	17
134	KR7064350002	064350	HYUNDAI ROTEM	83
135	KR7025540006	025540	KorElecTerm	14
136	KR7073240004	073240	KUMHOTIRE	252
137	KR7004000006	004000	SamsungFineChem	32
138	KR7069620003	069620	DAEWOONG PHARM	10
139	KR7000640003	000640	Donga Socio Holdings	7
140	KR7020000006	020000	Handsome	26
141	KR7033920000	033920	Muhak	26
142	KR7001430008	001430	SBC	23
143	KR7003620002	003620	SsangyongMtr	58
144	KR7005740006	005740	CrownConf	1
145	KR7042670000	042670	DSINFRA	207
146	KR7093050003	093050	LF	34
147	KR7000230003	000230	IldongPharm	31
148	KR7019680008	019680	DAEKYO	53
149	KR7115390007	115390	L&L	33
150	KR7003300001	003300	HanilCement	8
151	KR7014680003	014680	Hanchem	16
152	KR7079430005	079430	HYUNDAILIVART	19
153	KR7005180005	005180	Binggrae	11
154	KR7069260008	069260	Huchems	45
155	KR7103140000	103140	POONGSAN	36
156	KR7060980000	060980	HALLA HOLDINGS	13
157	KR7011200003	011200	HyundaiMercMar	258
158	KR7002240000	002240	KISWire	11
159	KR7009290008	009290	KwangdongPharm	60
160	KR7002960003	002960	HankookShellOil	1
161	KR7034120006	034120	SBS	25
162	KR7005850003	005850	SLCORP	25
163	KR7004490009	004490	Global&YuasaBtry	16
164	KR7000050005	000050	Kyungbang	2
165	KR7007340003	007340	DongahTire	20
166	KR7003920006	003920	NamyangDairy	1
167	KR7036580009	036580	FARMSCO	29
168	KR7020150009	020150	ILJIN MATERIALS	29
169	KR7004710000	004710	HansolTechnics	35
170	KR7025860008	025860	NamhaeChem	43
171	KR7029530003	029530	SINDOH	10
172	KR7001230002	001230	DongkukStlMill	105
173	KR7008490005	008490	SUHEUNG	12

No	KRコード	コード	銘柄名	株式数
174	KR7093370005	093370	FOOSUNG	93
175	KR7028050003	028050	SamsungEng	281
176	KR7005090006	005090	SAMKWANG GLASS	5
177	KR7003570009	003570	S&TDynamics	39
178	KR7014830004	014830	UNID	6
179	KR7008060006	008060	DaeduckElec	63
180	KR7104700000	104700	KISCO	8
181	KR7007690001	007690	KukdoChem	8
182	KR7003200003	003200	IlshinSpng	2
183	KR7097230007	097230	HANJIN HVY IND	100
184	KR7078520004	078520	ABLE C&C	18
185	KR7003030004	003030	SeAhStl	5
186	KR7004150009	004150	HANSOL HOLDINGS	55
187	KR7007860000	007860	SEOYON	25
188	KR7009580002	009580	Moorim P&P	55
189	KR7004700001	004700	ChokwangLeat	3
190	KR7084870005	084870	THE BASIC HOUSE	21
191	KR7082740002	082740	Doosan Engine	46

平成 28 年 1 月 26 日

[掲載番号:2]

各 位

管理会社名 サムスン資産運用株式会社
 (管理会社コード 13134)
 代表者名 代表理事社長 具 聖勳
 (銘柄コード 1584(外国 ETF))
 問合せ先 (代理人)西村あさひ法律事務所
 弁護士 伊東 啓
 (TEL.03-6250-6200)

サムスン KODEX サムスングループ株証券上場指数投資信託[株式]に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成 28 年 1 月 26 日現在)

136,500,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成 28 年 1 月 25 日現在)

(平成 28 年 1 月 25 日に三菱東京 UFJ 銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値 1 ウォン=0.0993 円で計算)

68,533,316,924 円 (690,164,319,475 ウォン)

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成 28 年 1 月 25 日現在)

(平成 28 年 1 月 25 日に三菱東京 UFJ 銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値 1 ウォン=0.0993 円で計算)

502.08 円 (5,056.15 ウォン)

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額とサムスングループ指数の終値の変動率に係る乖離率

(平成 28 年 1 月 25 日現在)

-0.07 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{上場 ETF の一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場 ETF の一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{サムスングループ指数の終値}}{\text{前営業日のサムスングループ指数の終値}} \right] \times 100$$

* 平成 28 年 1 月 25 日 サムスングループ指数終値 5,010.79 ポイント

指標価格については、 <http://www.kodex.com/samsungjp.jsp>

5. 受益証券を取得するために必要な株式のポートフォリオの確定（平成 28 年 1 月 26 日設定分）

No	KR コード	コード	銘柄名	株式数
1			(現金)	(11,912,174 ウォン)
2	KR7005930003	005930	SamsungElec	105
3	KR7028260008	028260	SAMSUNG C&T	505
4	KR7018260000	018260	SAMSUNG SDS	183
5	KR7032830002	032830	SAMSUNG LIFE	592
6	KR7000810002	000810	SamsungF&MIns	210
7	KR7006400006	006400	SAMSUNG SDI CO.,LTD.	305
8	KR7009150004	009150	SamsungElecMech	354
9	KR7012750006	012750	S-1	146
10	KR7029780004	029780	SAMSUNG CARD	206
11	KR7016360000	016360	SamsungSecu	339
12	KR7008770000	008770	HtlShilla	197
13	KR7030000004	030000	CheilWorldwide	477
14	KR7010140002	010140	SamsungHvyInd	888
15	KR7004000006	004000	SamsungFineChem	99
16	KR7028050003	028050	SamsungEng	928