

平成28年12月1日

各 位

管理会社名 三井住友アセットマネジメント株式会社
(管理会社コード 15624)
代表者名 代表取締役社長兼CEO 松下 隆史
問合せ先 資産管理部長 小泉 和士
(TEL.03-5405-0762)

上場ETF(管理会社:三井住友アセットマネジメント)に関する日々の開示事項

三井住友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、以下のとおり平成28年11月30日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(2銘柄)

| 掲載番号 | 銘柄名 | 銘柄コード | 上場取引所 |
|------|-----------------------------------|-------|-------|
| 1 | SMAM 日経225上場投信 | 1397 | 東 |
| 2 | SMAM 東証REIT指数上場投信 | 1398 | 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、各銘柄をクリックしていただくと、各銘柄の状況が表示されます。

以上

〔掲載番号:1〕

平成28年12月1日

各 位

管理会社名 三井住友アセットマネジメント株式会社
(管理会社コード 15624)
代表者名 代表取締役社長兼CEO 松下 隆史
(コード番号 1397)
問合せ先 資産管理部長 小泉 和士
(TEL.03-5405-0762)

『SMAM 日経225上場投信』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11月30日現在)

2, 104, 074 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年11月30日現在)

38, 700, 131, 576 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年11月30日現在)

18, 392. 95 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と日経225の終値の変動率に係る乖離率

(平成28年11月30日現在)

0. 00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{日経225の終値}}{\text{前営業日の日経225の終値}} \right] \times 100$$

18,392.95 / 18,390.38 - 18,308.48 / 18,307.04

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

(別紙参照)

平成28年12月1日

○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(平成28年12月5日)、設定受付日(平成28年12月6日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

総銘柄数: 225

| | コード | 銘柄名 | 株式数 |
|----|------|-----------------|-------|
| 1 | 1332 | 日本水産 | 2,000 |
| 2 | 1333 | マルハニチロ | 200 |
| 3 | 1605 | 国際石油開発帝石 | 800 |
| 4 | 1721 | コムシスホールディングス | 2,000 |
| 5 | 1801 | 大成建設 | 2,000 |
| 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 | 2,000 |
| 10 | 1925 | 大和ハウス工業 | 2,000 |
| 11 | 1928 | 積水ハウス | 2,000 |
| 12 | 1963 | 日揮 | 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 | 2,000 |
| 16 | 2432 | ディー・エヌ・エー | 600 |
| 17 | 2501 | サッポロホールディングス | 400 |
| 18 | 2502 | アサヒグループホールディングス | 2,000 |
| 19 | 2503 | キリンホールディングス | 2,000 |
| 20 | 2531 | 宝ホールディングス | 2,000 |
| 21 | 2768 | 双日 | 200 |
| 22 | 2801 | キッコーマン | 2,000 |
| 23 | 2802 | 味の素 | 2,000 |
| 24 | 2871 | ニチレイ | 1,000 |
| 25 | 2914 | 日本たばこ産業 | 2,000 |
| 26 | 3086 | J. フロント リテイリング | 1,000 |
| 27 | 3099 | 三越伊勢丹ホールディングス | 2,000 |
| 28 | 3101 | 東洋紡 | 2,000 |
| 29 | 3103 | ユニチカ | 2,000 |
| 30 | 3105 | 日清紡ホールディングス | 2,000 |
| 31 | 3289 | 東急不動産ホールディングス | 2,000 |
| 32 | 3382 | セブン&アイ・ホールディングス | 2,000 |
| 33 | 3401 | 帝人 | 400 |
| 34 | 3402 | 東レ | 2,000 |
| 35 | 3405 | クラレ | 2,000 |
| 36 | 3407 | 旭化成 | 2,000 |
| 37 | 3436 | SUMCO | 200 |
| 38 | 3861 | 王子ホールディングス | 2,000 |
| 39 | 3863 | 日本製紙 | 200 |
| 40 | 3865 | 北越紀州製紙 | 2,000 |
| 41 | 4004 | 昭和電工 | 200 |
| 42 | 4005 | 住友化学 | 2,000 |
| 43 | 4021 | 日産化学工業 | 2,000 |
| 44 | 4042 | 東ソー | 2,000 |
| 45 | 4043 | トクヤマ | 2,000 |
| 46 | 4061 | デンカ | 2,000 |
| 47 | 4063 | 信越化学工業 | 2,000 |

| | | | |
|-----|------|--------------------|--------|
| 48 | 4151 | 協和発酵キリン | 2,000 |
| 49 | 4183 | 三井化学 | 2,000 |
| 50 | 4188 | 三菱ケミカルホールディングス | 1,000 |
| 51 | 4208 | 宇部興産 | 2,000 |
| 52 | 4272 | 日本化薬 | 2,000 |
| 53 | 4324 | 電通 | 2,000 |
| 54 | 4452 | 花王 | 2,000 |
| 55 | 4502 | 武田薬品工業 | 2,000 |
| 56 | 4503 | アステラス製薬 | 10,000 |
| 57 | 4506 | 大日本住友製薬 | 2,000 |
| 58 | 4507 | 塩野義製薬 | 2,000 |
| 59 | 4519 | 中外製薬 | 2,000 |
| 60 | 4523 | エーザイ | 2,000 |
| 61 | 4543 | テルモ | 4,000 |
| 62 | 4568 | 第一三共 | 2,000 |
| 63 | 4689 | ヤフー | 800 |
| 64 | 4704 | トレンドマイクロ | 2,000 |
| 65 | 4755 | 楽天 | 2,000 |
| 66 | 4901 | 富士フイルムホールディングス | 2,000 |
| 67 | 4902 | コニカミノルタ | 2,000 |
| 68 | 4911 | 資生堂 | 2,000 |
| 69 | 5002 | 昭和シェル石油 | 2,000 |
| 70 | 5020 | JXホールディングス | 2,000 |
| 71 | 5101 | 横浜ゴム | 1,000 |
| 72 | 5108 | ブリヂストン | 2,000 |
| 73 | 5201 | 旭硝子 | 2,000 |
| 74 | 5202 | 日本板硝子 | 200 |
| 75 | 5214 | 日本電気硝子 | 3,000 |
| 76 | 5232 | 住友大阪セメント | 2,000 |
| 77 | 5233 | 太平洋セメント | 2,000 |
| 78 | 5301 | 東海カーボン | 2,000 |
| 79 | 5332 | TOTO | 1,000 |
| 80 | 5333 | 日本碍子 | 2,000 |
| 81 | 5401 | 新日鐵住金 | 200 |
| 82 | 5406 | 神戸製鋼所 | 200 |
| 83 | 5411 | ジェイ エフ イー ホールディングス | 200 |
| 84 | 5413 | 日新製鋼 | 200 |
| 85 | 5541 | 大平洋金属 | 2,000 |
| 86 | 5631 | 日本製鋼所 | 400 |
| 87 | 5703 | 日本軽金属ホールディングス | 2,000 |
| 88 | 5706 | 三井金属鉱業 | 2,000 |
| 89 | 5707 | 東邦亜鉛 | 2,000 |
| 90 | 5711 | 三菱マテリアル | 200 |
| 91 | 5713 | 住友金属鉱山 | 2,000 |
| 92 | 5714 | DOWAホールディングス | 2,000 |
| 93 | 5715 | 古河機械金属 | 2,000 |
| 94 | 5801 | 古河電気工業 | 200 |
| 95 | 5802 | 住友電気工業 | 2,000 |
| 96 | 5803 | フジクラ | 2,000 |
| 97 | 5901 | 東洋製罐グループホールディングス | 2,000 |
| 98 | 6103 | オークマ | 2,000 |
| 99 | 6113 | アマダホールディングス | 2,000 |
| 100 | 6301 | 小松製作所 | 2,000 |
| 101 | 6302 | 住友重機械工業 | 2,000 |
| 102 | 6305 | 日立建機 | 2,000 |
| 103 | 6326 | クボタ | 2,000 |
| 104 | 6361 | 荏原製作所 | 400 |
| 105 | 6366 | 千代田化工建設 | 2,000 |

| | | | |
|-----|------|----------------------|-------|
| 106 | 6367 | ダイキン工業 | 2,000 |
| 107 | 6471 | 日本精工 | 2,000 |
| 108 | 6472 | NTN | 2,000 |
| 109 | 6473 | ジェイテクト | 2,000 |
| 110 | 6479 | ミネベア | 2,000 |
| 111 | 6501 | 日立製作所 | 2,000 |
| 112 | 6502 | 東芝 | 2,000 |
| 113 | 6503 | 三菱電機 | 2,000 |
| 114 | 6504 | 富士電機 | 2,000 |
| 115 | 6506 | 安川電機 | 2,000 |
| 116 | 6508 | 明電舎 | 2,000 |
| 117 | 6674 | ジーエス・ユアサ コーポレーション | 2,000 |
| 118 | 6701 | 日本電気 | 2,000 |
| 119 | 6702 | 富士通 | 2,000 |
| 120 | 6703 | 沖電気工業 | 200 |
| 121 | 6752 | パナソニック | 2,000 |
| 122 | 6758 | ソニー | 2,000 |
| 123 | 6762 | TDK | 2,000 |
| 124 | 6767 | ミツミ電機 | 2,000 |
| 125 | 6770 | アルプス電気 | 2,000 |
| 126 | 6773 | パイオニア | 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 | 三井造船 | 2,000 |
| 136 | 7004 | 日立造船 | 400 |
| 137 | 7011 | 三菱重工業 | 2,000 |
| 138 | 7012 | 川崎重工業 | 2,000 |
| 139 | 7013 | IHI | 2,000 |
| 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 | 富士重工業 | 2,000 |
| 150 | 7272 | ヤマハ発動機 | 2,000 |
| 151 | 7731 | ニコン | 2,000 |
| 152 | 7733 | オリンパス | 2,000 |
| 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 | 7911 | 凸版印刷 | 2,000 |
| 158 | 7912 | 大日本印刷 | 2,000 |
| 159 | 7951 | ヤマハ | 2,000 |
| 160 | 8001 | 伊藤忠商事 | 2,000 |
| 161 | 8002 | 丸紅 | 2,000 |
| 162 | 8015 | 豊田通商 | 2,000 |
| 163 | 8028 | ユニー・ファミリーマートホールディングス | 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 | 2,000 |
| 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 | 2,000 |
| 173 | 8304 | あおぞら銀行 | 2,000 |
| 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 | 2,000 |
| 180 | 8355 | 静岡銀行 | 2,000 |
| 181 | 8411 | みずほフィナンシャルグループ | 2,000 |
| 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 | 8725 | MS&ADインシュアランスグループホール | 600 |
| 187 | 8729 | ソニーフィナンシャルホールディングス | 400 |
| 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 | 2,000 |
| 196 | 9005 | 東京急行電鉄 | 2,000 |
| 197 | 9007 | 小田急電鉄 | 1,000 |
| 198 | 9008 | 京王電鉄 | 2,000 |
| 199 | 9009 | 京成電鉄 | 1,000 |
| 200 | 9020 | 東日本旅客鉄道 | 200 |
| 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 | 2,000 |
| 204 | 9064 | ヤマトホールディングス | 2,000 |
| 205 | 9101 | 日本郵船 | 2,000 |
| 206 | 9104 | 商船三井 | 2,000 |
| 207 | 9107 | 川崎汽船 | 2,000 |
| 208 | 9202 | ANAホールディングス | 2,000 |
| 209 | 9301 | 三菱倉庫 | 2,000 |
| 210 | 9412 | スカパーJSATホールディングス | 200 |
| 211 | 9432 | 日本電信電話 | 400 |
| 212 | 9433 | KDDI | 12,000 |
| 213 | 9437 | NTTドコモ | 200 |
| 214 | 9501 | 東京電力ホールディングス | 200 |
| 215 | 9502 | 中部電力 | 200 |
| 216 | 9503 | 関西電力 | 200 |
| 217 | 9531 | 東京瓦斯 | 2,000 |
| 218 | 9532 | 大阪瓦斯 | 2,000 |
| 219 | 9602 | 東宝 | 200 |
| 220 | 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ | 2,000 |
| 221 | 9681 | 東京ドーム | 1,000 |

| | | | |
|-----|------|-------------|-------|
| 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 | 6,000 |

〔掲載番号:2〕

平成28年12月1日

各 位

| | |
|-------|---------------------------------------|
| 管理会社名 | 三井住友アセットマネジメント株式会社 (管理会社コード 15624) |
| 代表者名 | 代表取締役社長兼CEO 松下 隆史 (コード番号 1398) |
| 問合せ先 | 資産管理部長 小泉 和士 (TEL.03-5405-0762) |

『SMAM 東証REIT指数上場投信』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11月30日現在)

17,028,916 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年11月30日現在)

30,944,524,901 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年11月30日現在)

1,817.18 円

4. 上場ETF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
(平成28年11月30日現在)

-0.01 %

(参考)乖離率の計算式

$$\left[\frac{\begin{array}{l} \text{上場ETFの一口あたりの純資産額} + \text{一口あたりの収益分配金} \\ 1,817.18 \end{array}}{\begin{array}{l} \text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額} \\ 1,796.19 \end{array}} - \frac{\begin{array}{l} \text{東証REIT指数の終値} \\ 1,796.89 \end{array}}{\begin{array}{l} \text{前営業日の東証REIT指数の終値} \\ 1,775.92 \end{array}} \right] \times 100$$

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

(別紙参照)

平成28年12月1日

○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(平成28年12月5日)、設定受付日(平成28年12月6日)は
設定不可日のため受け付けておりません。