平成29年11月28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29年11月27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29年11月28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29年11月27日現在)

3，070，229 口

2．上場ETFの純資産総額(平成29年11月27日現在)

69，492，989，303 円

3．上場ETFの一口あたりの純資産額(平成29年11月27日現在)

22，634．46 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29年11月27日現在）

0．00 %

（参考）乖離率の計算式

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

$$\left[\frac{22{,}634.46}{22{,}690.60} - \frac{22{,}495.99}{22{,}550.85}\right] \times 100$$

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29年11月28日

○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日（平成29年11月30日）、設定受付日（平成29年12月1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	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	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	200
29	3103	ユニチカ	200
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	4004	昭和電工	200
41	4005	住友化学	2,000
42	4021	日産化学工業	2,000
43	4042	東ソー	1,000
44	4043	トクヤマ	400
45	4061	デンカ	400
46	4063	信越化学工業	2,000
47	4151	協和発酵キリン	2,000

48	4183	三井化学	400
49	4188	三菱ケミカルホールディングス	1,000
50	4208	宇部興産	200
51	4272	日本化薬	2,000
52	4324	電通	2,000
53	4452	花王	2,000
54	4502	武田薬品工業	2,000
55	4503	アステラス製薬	10,000
56	4506	大日本住友製薬	2,000
57	4507	塩野義製薬	2,000
58	4519	中外製薬	2,000
59	4523	エーザイ	2,000
60	4543	テルモ	4,000
61	4568	第一三共	2,000
62	4578	大塚ホールディングス	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	JXTG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	400
74	5202	日本板硝子	200
75	5214	日本電気硝子	600
76	5232	住友大阪セメント	2,000
77	5233	太平洋セメント	200
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	200
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	200
89	5707	東邦亜鉛	200
90	5711	三菱マテリアル	200
91	5713	住友金属鉱山	1,000
92	5714	DOWAホールディングス	400
93	5715	古河機械金属	200
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	6098	リクルートホールディングス	6,000
99	6103	オークマ	400
100	6113	アマダホールディングス	2,000
101	6178	日本郵政	2,000
102	6301	小松製作所	2,000
103	6302	住友重機械工業	400
104	6305	日立建機	2,000
105	6326	クボタ	2,000

106	6361	荏原製作所	400
107	6366	千代田化工建設	2,000
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	2,000
114	6503	三菱電機	2,000
115	6504	富士電機	2,000
116	6506	安川電機	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	200
119	6702	富士通	2,000
120	6703	沖電気工業	200
121	6724	セイコーエプソン	4,000
122	6752	パナソニック	2,000
123	6758	ソニー	2,000
124	6762	TDK	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	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
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	1,000
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	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	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	400
196	9005	東京急行電鉄	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
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	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	400
218	9532	大阪瓦斯	400
219	9602	東宝	200
220	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	10,000
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29年11月28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29年11月27日現在)

27，801，324 口

2．上場ETFの純資産総額(平成29年11月27日現在)

47，109，562，827 円

3．上場ETFの一口あたりの純資産額(平成29年11月27日現在)

1，694．51 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29年11月27日現在）

0．00 %

（参考）乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額 + 一口あたりの収益分配金}\ 1{,}694.51}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}\ 1{,}703.22} - \frac{\text{東証REIT指数の終値}\ 1{,}674.27}{\text{前営業日の東証REIT指数の終値}\ 1{,}682.92}\right] \times 100$$

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29年11月28日

○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日（平成29年11月30日）、設定受付日（平成29年12月1日）分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

総銘柄数：59

	コード	銘柄名	投資口数
1	3226	日本アコモデーションファンド投資法人　投資証券	12
2	3227	MCUBS　MidCity投資法人　投資証券	7
3	3234	森ヒルズリート投資法人　投資証券	38
4	3249	産業ファンド投資法人　投資証券	10
5	3269	アドバンス・レジデンス投資法人　投資証券	33
6	3278	ケネディクス・レジデンシャル投資法人　投資証券	8
7	3279	アクティビア・プロパティーズ投資法人　投資証券	16
8	3281	GLP投資法人　投資証券	63
9	3282	コンフォリア・レジデンシャル投資法人　投資証券	13
10	3283	日本プロロジスリート投資法人　投資証券	45
11	3287	星野リゾート・リート投資法人　投資証券	5
12	3290	Oneリート投資法人　投資証券	4
13	3292	イオンリート投資法人　投資証券	34
14	3295	ヒューリックリート投資法人　投資証券	24
15	3296	日本リート投資法人　投資証券	10
16	3298	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人　投資証券	20
17	3308	日本ヘルスケア投資法人　投資証券	2
18	3309	積水ハウス・リート投資法人　投資証券	22
19	3451	トーセイ・リート投資法人　投資証券	5
20	3453	ケネディクス商業リート投資法人　投資証券	13
21	3455	ヘルスケア＆メディカル投資法人　投資証券	4
22	3459	サムティ・レジデンシャル投資法人　投資証券	6
23	3460	ジャパン・シニアリビング投資法人　投資証券	2
24	3462	野村不動産マスターファンド投資法人　投資証券	103
25	3463	いちごホテルリート投資法人　投資証券	6
26	3466	ラサールロジポート投資法人　投資証券	27
27	3468	スターアジア不動産投資法人　投資証券	7
28	3470	マリモ地方創生リート投資法人　投資証券	2
29	3471	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人　投資証券	6
30	3472	大江戸温泉リート投資法人　投資証券	5
31	3473	さくら総合リート投資法人　投資証券	9
32	3476	投資法人みらい　投資証券	5
33	3478	森トラスト・ホテルリート投資法人　投資証券	8
34	3481	三菱地所物流リート投資法人　投資証券	3
35	8951	日本ビルファンド投資法人　投資証券	35
36	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人　投資証券	34
37	8953	日本リテールファンド投資法人　投資証券	69
38	8954	オリックス不動産投資法人　投資証券	69
39	8955	日本プライムリアルティ投資法人　投資証券	23
40	8956	プレミア投資法人　投資証券	32
41	8957	東急リアル・エステート投資法人　投資証券	24
42	8958	グローバル・ワン不動産投資法人　投資証券	6
43	8960	ユナイテッド・アーバン投資法人　投資証券	79
44	8961	森トラスト総合リート投資法人　投資証券	26
45	8963	インヴィンシブル投資法人　投資証券	99
46	8964	フロンティア不動産投資法人　投資証券	12
47	8966	平和不動産リート投資法人　投資証券	22

48	8967	日本ロジスティクスファンド投資法人　投資証券	24
49	8968	福岡リート投資法人　投資証券	17
50	8972	ケネディクス・オフィス投資法人　投資証券	11
51	8973	積水ハウス・レジデンシャル投資法人　投資証券	27
52	8975	いちごオフィスリート投資法人　投資証券	28
53	8976	大和証券オフィス投資法人　投資証券	8
54	8977	阪急リート投資法人　投資証券	15
55	8979	スターツプロシード投資法人　投資証券	6
56	8984	大和ハウスリート投資法人　投資証券	37
57	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人　投資証券	104
58	8986	日本賃貸住宅投資法人　投資証券	40
59	8987	ジャパンエクセレント投資法人　投資証券	32