

2019年10月17日

各 位

管理会社名 三井住友DS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 川田 崇
(TEL.03-5405-0800)

上場ETF(管理会社:三井住友DS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DS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2019年10月16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 | SMDAM日経225上場投信 | 1397 | 東 |
| 2 | SMDAM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]

2019年10月17日

各 位

管理会社名 三井住友DS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 川田 崇
(TEL.03-5405-0800)

『SMDAM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(2019年10月16日現在)

2, 887, 366 口

2. 上場ETFの純資産総額(2019年10月16日現在)

65, 235, 989, 926 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2019年10月16日現在)

22, 593. 60 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

(2019年10月16日現在)

0. 00 %

(参考)乖離率の計算式

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

22,593.60 / 22,326.01 - 22,472.92 / 22,207.21

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)

2019年10月17日

○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(2019年10月21日)、設定受付日(2019年10月23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 | 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 | 3861 | 王子ホールディングス | 2,000 |
| 40 | 3863 | 日本製紙 | 200 |
| 41 | 4004 | 昭和電工 | 200 |
| 42 | 4005 | 住友化学 | 2,000 |
| 43 | 4021 | 日産化学 | 2,000 |
| 44 | 4042 | 東ソー | 1,000 |
| 45 | 4043 | トクヤマ | 400 |
| 46 | 4061 | デンカ | 400 |
| 47 | 4063 | 信越化学工業 | 2,000 |

| | | | |
|-----|------|--------------------|--------|
| 48 | 4151 | 協和キリン | 2,000 |
| 49 | 4183 | 三井化学 | 400 |
| 50 | 4188 | 三菱ケミカルホールディングス | 1,000 |
| 51 | 4208 | 宇部興産 | 200 |
| 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 | 8,000 |
| 62 | 4568 | 第一三共 | 2,000 |
| 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 | コニカミノルタ | 2,000 |
| 71 | 4911 | 資生堂 | 2,000 |
| 72 | 5019 | 出光興産 | 800 |
| 73 | 5020 | JXTG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 | 2,000 |
| 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 |
| 101 | 6113 | アマダホールディングス | 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 |
| 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 | 8028 | ファミリーマート | 8,000 |
| 165 | 8031 | 三井物産 | 2,000 |
| 166 | 8035 | 東京エレクトロン | 2,000 |
| 167 | 8053 | 住友商事 | 2,000 |
| 168 | 8058 | 三菱商事 | 2,000 |
| 169 | 8233 | 高島屋 | 1,000 |
| 170 | 8252 | 丸井グループ | 2,000 |
| 171 | 8253 | クレディセゾン | 2,000 |
| 172 | 8267 | イオン | 2,000 |
| 173 | 8303 | 新生銀行 | 200 |
| 174 | 8304 | あおぞら銀行 | 200 |
| 175 | 8306 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 2,000 |
| 176 | 8308 | りそなホールディングス | 200 |
| 177 | 8309 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 200 |
| 178 | 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ | 200 |
| 179 | 8331 | 千葉銀行 | 2,000 |
| 180 | 8354 | ふくおかフィナンシャルグループ | 400 |
| 181 | 8355 | 静岡銀行 | 2,000 |
| 182 | 8411 | みずほフィナンシャルグループ | 2,000 |
| 183 | 8601 | 大和証券グループ本社 | 2,000 |
| 184 | 8604 | 野村ホールディングス | 2,000 |
| 185 | 8628 | 松井証券 | 2,000 |
| 186 | 8630 | SOMPOホールディングス | 500 |
| 187 | 8725 | MS&ADインシュアランスグループホール | 600 |
| 188 | 8729 | ソニーフィナンシャルホールディングス | 400 |
| 189 | 8750 | 第一生命ホールディングス | 200 |
| 190 | 8766 | 東京海上ホールディングス | 1,000 |
| 191 | 8795 | T&Dホールディングス | 400 |
| 192 | 8801 | 三井不動産 | 2,000 |
| 193 | 8802 | 三菱地所 | 2,000 |
| 194 | 8804 | 東京建物 | 1,000 |
| 195 | 8830 | 住友不動産 | 2,000 |
| 196 | 9001 | 東武鉄道 | 400 |
| 197 | 9005 | 東急 | 1,000 |
| 198 | 9007 | 小田急電鉄 | 1,000 |
| 199 | 9008 | 京王電鉄 | 400 |
| 200 | 9009 | 京成電鉄 | 1,000 |
| 201 | 9020 | 東日本旅客鉄道 | 200 |
| 202 | 9021 | 西日本旅客鉄道 | 200 |
| 203 | 9022 | 東海旅客鉄道 | 200 |
| 204 | 9062 | 日本通運 | 200 |
| 205 | 9064 | ヤマトホールディングス | 2,000 |
| 206 | 9101 | 日本郵船 | 200 |
| 207 | 9104 | 商船三井 | 200 |
| 208 | 9107 | 川崎汽船 | 200 |
| 209 | 9202 | ANAホールディングス | 200 |
| 210 | 9301 | 三菱倉庫 | 1,000 |
| 211 | 9412 | スカパーJSATホールディングス | 200 |
| 212 | 9432 | 日本電信電話 | 400 |
| 213 | 9433 | KDDI | 12,000 |
| 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 |

[掲載番号:2]

2019年10月17日

各 位

管理会社名 三井住友DS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 川田 崇
(TEL.03-5405-0800)

『SMDAM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(2019年10月16日現在)

40,088,209 口

2. 上場ETFの純資産総額(2019年10月16日現在)

91,172,991,812 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2019年10月16日現在)

2,274.31 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
(2019年10月16日現在)

0.00 %

(参考)乖離率の計算式

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

$\frac{2,274.31}{2,250.46} - \frac{2,244.59}{2,221.04}$

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)

2019年10月17日

○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(2019年10月21日)、設定受付日(2019年10月23日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

総銘柄数:63

| | コード | 銘柄名 | 投資口数 |
|----|------|------------------------------|------|
| 1 | 2971 | エスコンジャパンリート投資法人 投資証券 | 3 |
| 2 | 2972 | サンケイリアルエステート投資法人 投資証券 | 4 |
| 3 | 3226 | 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券 | 10 |
| 4 | 3227 | MCUBS MidCity投資法人 投資証券 | 34 |
| 5 | 3234 | 森ヒルズリート投資法人 投資証券 | 33 |
| 6 | 3249 | 産業ファンド投資法人 投資証券 | 36 |
| 7 | 3269 | アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券 | 27 |
| 8 | 3278 | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券 | 18 |
| 9 | 3279 | アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券 | 15 |
| 10 | 3281 | GLP投資法人 投資証券 | 72 |
| 11 | 3282 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券 | 12 |
| 12 | 3283 | 日本プロロジスリート投資法人 投資証券 | 42 |
| 13 | 3287 | 星野リゾート・リート投資法人 投資証券 | 4 |
| 14 | 3290 | Oneリート投資法人 投資証券 | 5 |
| 15 | 3292 | イオンリート投資法人 投資証券 | 31 |
| 16 | 3295 | ヒューリックリート投資法人 投資証券 | 25 |
| 17 | 3296 | 日本リート投資法人 投資証券 | 9 |
| 18 | 3298 | インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券 | 186 |
| 19 | 3308 | 日本ヘルスケア投資法人 投資証券 | 1 |
| 20 | 3309 | 積水ハウス・リート投資法人 投資証券 | 85 |
| 21 | 3451 | トーセイ・リート投資法人 投資証券 | 5 |
| 22 | 3453 | ケネディクス商業リート投資法人 投資証券 | 11 |
| 23 | 3455 | ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券 | 6 |
| 24 | 3459 | サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券 | 6 |
| 25 | 3462 | 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券 | 90 |
| 26 | 3463 | いちごホテルリート投資法人 投資証券 | 5 |
| 27 | 3466 | ラサールロジポート投資法人 投資証券 | 27 |
| 28 | 3468 | スターアジア不動産投資法人 投資証券 | 10 |
| 29 | 3470 | マリモ地方創生リート投資法人 投資証券 | 2 |
| 30 | 3471 | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券 | 7 |
| 31 | 3472 | 大江戸温泉リート投資法人 投資証券 | 5 |
| 32 | 3473 | さくら総合リート投資法人 投資証券 | 6 |
| 33 | 3476 | 投資法人みらい 投資証券 | 31 |
| 34 | 3478 | 森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券 | 7 |
| 35 | 3481 | 三菱地所物流リート投資法人 投資証券 | 6 |
| 36 | 3487 | CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券 | 4 |
| 37 | 3488 | ザイマックス・リート投資法人 投資証券 | 4 |
| 38 | 3492 | タカラレーベン不動産投資法人 投資証券 | 8 |
| 39 | 3493 | 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券 | 4 |
| 40 | 8951 | 日本ビルファンド投資法人 投資証券 | 28 |
| 41 | 8952 | ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券 | 29 |
| 42 | 8953 | 日本リテールファンド投資法人 投資証券 | 55 |
| 43 | 8954 | オリックス不動産投資法人 投資証券 | 58 |
| 44 | 8955 | 日本プライムリアルティ投資法人 投資証券 | 18 |
| 45 | 8956 | プレミア投資法人 投資証券 | 26 |
| 46 | 8957 | 東急リアル・エステート投資法人 投資証券 | 19 |
| 47 | 8958 | グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券 | 20 |

| | | | |
|----|------|------------------------|-----|
| 48 | 8960 | ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券 | 65 |
| 49 | 8961 | 森トラスト総合リート投資法人 投資証券 | 21 |
| 50 | 8963 | インヴィンシブル投資法人 投資証券 | 127 |
| 51 | 8964 | フロンティア不動産投資法人 投資証券 | 10 |
| 52 | 8966 | 平和不動産リート投資法人 投資証券 | 18 |
| 53 | 8967 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券 | 19 |
| 54 | 8968 | 福岡リート投資法人 投資証券 | 15 |
| 55 | 8972 | ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券 | 9 |
| 56 | 8975 | いちごオフィスリート投資法人 投資証券 | 22 |
| 57 | 8976 | 大和証券オフィス投資法人 投資証券 | 7 |
| 58 | 8977 | 阪急阪神リート投資法人 投資証券 | 13 |
| 59 | 8979 | スターツプロシード投資法人 投資証券 | 5 |
| 60 | 8984 | 大和ハウスリート投資法人 投資証券 | 39 |
| 61 | 8985 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券 | 93 |
| 62 | 8986 | 日本賃貸住宅投資法人 投資証券 | 33 |
| 63 | 8987 | ジャパンエクセレント投資法人 投資証券 | 26 |