

2019年12月5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12月4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12月5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12月4日現在)

2, 563, 657 口

2. 上場ETFの純資産総額(2019年12月4日現在)

59, 614, 956, 673 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2019年12月4日現在)

23, 253. 87 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12月4日現在)

0. 00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

23,253.87 / 23,499.44 - 23,135.23 / 23,379.81

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12月5日

○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(2019年12月9日)、設定受付日(2019年12月10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	麒麟ホールディングス	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12月5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12月4日現在)

45, 857, 745 口

2. 上場ETFの純資産総額(2019年12月4日現在)

101, 885, 138, 103 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2019年12月4日現在)

2, 221. 77 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12月4日現在)

0. 00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

$\frac{2,221.77}{2,227.60} - \frac{2,184.32}{2,190.05}$

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12月5日

○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(2019年12月9日)、設定受付日(2019年12月10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	37
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	14
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	41
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	84
21	3451	トーセイ・リート投資法人 投資証券	6
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	54
43	8954	オリックス不動産投資法人 投資証券	57
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	4
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