

各 位

2023年2月24日

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 猿田 隆
問合せ先 委託業務管理部長 野口 晃男
(TEL.03-6205-0259)

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2023年2月22日現在の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(3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
3	SMDAMトピックス上場投信	2557	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くと、各銘柄の状況が表示されます。

以上

[掲載番号:1]

2023年2月24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 猿田 隆
(コード番号 1397)
問合せ先 委託業務管理部長 野口 晃男
(TEL.03-6205-0259)

『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(2023年2月22日現在)

2,913,919 口

2. 上場ETFの純資産総額(2023年2月22日現在)

79,759,203,537 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2023年2月22日現在)

27,371.80 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
(2023年2月22日現在)

0.00 %

(参考)乖離率の計算式

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

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 27,371.80	日経225の終値 27,104.32
前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額 27,744.17	前営業日の日経225の終値 27,473.10

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)

2023年2月24日

○ 設定ポートフォリオ

※設定申込受付日(2023年2月28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	ニッスイ	1,000
2	1605	INPEX	400
3	1721	コムシスホールディングス	1,000
4	1801	大成建設	200
5	1802	大林組	1,000
6	1803	清水建設	1,000
7	1808	長谷工コーポレーション	200
8	1812	鹿島建設	500
9	1925	大和ハウス	1,000
10	1928	積水ハウス	1,000
11	1963	日揮ホールディングス	1,000
12	2002	日清製粉G本社	1,000
13	2269	明治ホールディングス	200
14	2282	日本ハム	500
15	2413	エムスリー	2,400
16	2432	ティー・エヌ・エー	300
17	2501	サッポロホールディングス	200
18	2502	アサヒグループホールディングス	1,000
19	2503	キリンHD	1,000
20	2531	宝ホールディングス	1,000
21	2768	双日	100
22	2801	キッコーマン	1,000
23	2802	味の素	1,000
24	2871	ニチレイ	500
25	2914	日本たばこ産業	1,000
26	3086	J. フロントリテイリング	500
27	3099	三越伊勢丹HD	1,000
28	3101	東洋紡	100
29	3289	東急不動産HD	1,000
30	3382	セブン&アイ・HLDGS	1,000
31	3401	帝人	200
32	3402	東レ	1,000
33	3405	クラレ	1,000
34	3407	旭化成	1,000
35	3436	SUMCO	100
36	3659	ネクソン	2,000
37	3861	王子ホールディングス	1,000
38	3863	日本製紙	100
39	4004	レゾナック・ホールディングス	100
40	4005	住友化学	1,000
41	4021	日産化学	1,000
42	4042	東ソー	500
43	4043	トクヤマ	200
44	4061	デンカ	200
45	4063	信越化学	1,000
46	4151	協和キリン	1,000
47	4183	三井化学	200

48	4188	三菱ケミカルグループ [°]	500
49	4208	UBE	100
50	4324	電通グループ [°]	1,000
51	4452	花 王	1,000
52	4502	武田薬品	1,000
53	4503	アステラス製薬	5,000
54	4506	住友ファーマ	1,000
55	4507	塩野義製薬	1,000
56	4519	中外製薬	3,000
57	4523	エーサイ	1,000
58	4543	テルモ	4,000
59	4568	第一三共	3,000
60	4578	大塚ホールディングス	1,000
61	4631	DIC	100
62	4689	Zホールディングス	400
63	4704	トレンドマイクロ	1,000
64	4751	サイバーエージェント	800
65	4755	楽天グループ [°]	1,000
66	4901	富士フィルムHLDGS	1,000
67	4902	コニカミノルタ	1,000
68	4911	資 生 堂	1,000
69	5019	出光興産	400
70	5020	ENEOSホールディングス	1,000
71	5101	横浜ゴム	500
72	5108	ブリヂストン	1,000
73	5201	AGC	200
74	5202	日本板硝子	100
75	5214	日本電気硝子	300
76	5232	住友大阪セメント	100
77	5233	太平洋セメント	100
78	5301	東海カーボン	1,000
79	5332	TOTO	500
80	5333	日本碍子	1,000
81	5401	日本製鉄	100
82	5406	神戸製鋼所	100
83	5411	JFEホールディングス	100
84	5541	大平洋金属	100
85	5631	日本製鋼所	200
86	5703	日本軽金属HD	100
87	5706	三井金属	100
88	5707	東邦亜鉛	100
89	5711	三菱マテリアル	100
90	5713	住友鉱山	500
91	5714	DOWAホールディングス	200
92	5801	古河電工	100
93	5802	住友電工	1,000
94	5803	フジクラ	1,000
95	5831	しづおかファイナンシャルク	1,000
96	6098	リクルートホールディングス	3,000
97	6103	オーケマ	200
98	6113	アマダ	1,000
99	6178	日本郵政	1,000
100	6273	SMC	100
101	6301	小松製作所	1,000
102	6302	住友重機械	200
103	6305	日立建機	1,000
104	6326	クボタ	1,000
105	6361	荏原製作所	200

106	6367	ダイキン工業	1,000
107	6471	日本精工	1,000
108	6472	N T N	1,000
109	6473	ジェイテクト	1,000
110	6479	ミネベアミツミ	1,000
111	6501	日立	200
112	6503	三菱電機	1,000
113	6504	富士電機	200
114	6506	安川電機	1,000
115	6594	日本電産	800
116	6645	オムロン	1,000
117	6674	ジーエス・ユアサ コーポ	200
118	6701	日本電気	100
119	6702	富士通	100
120	6724	セイコーエフソン	2,000
121	6752	パナソニック ホールディングス	1,000
122	6753	シャープ	1,000
123	6758	ソニーグループ	1,000
124	6762	T D K	3,000
125	6770	アルプスアルバイン	1,000
126	6841	横河電機	1,000
127	6857	アドバンテスト	2,000
128	6861	キーエンス	100
129	6902	デンソー	1,000
130	6952	カシオ	1,000
131	6954	ファナック	1,000
132	6971	京セラ	2,000
133	6976	太陽誘電	1,000
134	6981	村田製作所	800
135	6988	日東電工	1,000
136	7003	三井E&SHD	100
137	7004	日立造船	200
138	7011	三菱重工業	100
139	7012	川崎重工業	100
140	7013	IHI	100
141	7186	コンコルディア・フィナンシャル	1,000
142	7201	日産自動車	1,000
143	7202	いすゞ自動車	500
144	7203	トヨタ自動車	5,000
145	7205	日野自動車	1,000
146	7211	三菱自動車工業	100
147	7261	マツダ	200
148	7267	本田技研	2,000
149	7269	スズキ	1,000
150	7270	SUBARU	1,000
151	7272	ヤマハ発動機	1,000
152	7731	ニコン	1,000
153	7733	オリンパス	4,000
154	7735	SCREENホールディングス	200
155	7741	HOYA	500
156	7751	キヤノン	1,500
157	7752	リコー	1,000
158	7762	シチズン時計	1,000
159	7832	バンダイナムコHLDGS	1,000
160	7911	凸版印刷	500
161	7912	大日本印刷	500
162	7951	ヤマハ	1,000
163	7974	任天堂	1,000

164	8001	伊藤忠	1,000
165	8002	丸紅	1,000
166	8015	豊田通商	1,000
167	8031	三井物産	1,000
168	8035	東京エレクトロン	1,000
169	8053	住友商事	1,000
170	8058	三菱商事	1,000
171	8233	高島屋	500
172	8252	丸井グループ	1,000
173	8253	クレディセゾン	1,000
174	8267	イオン	1,000
175	8304	あおぞら銀行	100
176	8306	三菱UFJフィナンシャルG	1,000
177	8308	りそなホールディングス	100
178	8309	三井住友トラストHD	100
179	8316	三井住友フィナンシャルG	100
180	8331	千葉銀行	1,000
181	8354	ふくおかフィナンシャルG	200
182	8411	みずほフィナンシャルG	100
183	8591	オリックス	1,000
184	8601	大和証券G本社	1,000
185	8604	野村ホールディングス	1,000
186	8628	松井証券	1,000
187	8630	SOMPOホールディングス	200
188	8697	日本取引所グループ	1,000
189	8725	MS&AD	300
190	8750	第一生命HLDGS	100
191	8766	東京海上HD	1,500
192	8795	T&Dホールディングス	200
193	8801	三井不動産	1,000
194	8802	三菱地所	1,000
195	8804	東京建物	500
196	8830	住友不動産	1,000
197	9001	東武鉄道	200
198	9005	東急	500
199	9007	小田急電鉄	500
200	9008	京王電鉄	200
201	9009	京成電鉄	500
202	9020	東日本旅客鉄道	100
203	9021	西日本旅客鉄道	100
204	9022	東海旅客鉄道	100
205	9064	ヤマトホールディングス	1,000
206	9101	日本郵船	300
207	9104	商船三井	300
208	9107	川崎汽船	300
209	9147	NIPPON EXPRESS	100
210	9202	ANAホールディングス	100
211	9301	三菱倉庫	500
212	9432	日本電信電話	400
213	9433	KDDI	6,000
214	9434	ソフトバンク	1,000
215	9501	東京電力HD	100
216	9502	中部電力	100
217	9503	関西電力	100
218	9531	東京瓦斯	200
219	9532	大阪瓦斯	200
220	9602	東宝	100
221	9613	NTTデータ	5,000

222	9735	セコム	1,000
223	9766	コナミケループ [®]	1,000
224	9983	ファーストリテイリング [®]	3,000
225	9984	ソフトバンクグループ [®]	6,000

[掲載番号:2]

2023年2月24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 猿田 隆
(コード番号 1398)
問合せ先 委託業務管理部長 野口 晃男
(TEL.03-6205-0259)

『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(2023年2月22日現在)

54, 047, 982 口

2. 上場ETFの純資産総額(2023年2月22日現在)

101, 713, 875, 933 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2023年2月22日現在)

1, 881. 92 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 (2023年2月22日現在)

0. 00 %

(参考)乖離率の計算式

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

上場ETFの一口あたりの純資産額 1,881.92	+	東証REIT指数の終値 1,832.70
前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額 1,877.67	-	前営業日の東証REIT指数の終値 1,828.52

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)

2023年2月24日

○ 設定ポートフォリオ

※設定申込受付日(2023年2月28日)は
設定不可日のため受け付けておりません。

[掲載番号:3]

2023年2月24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 猿田 隆
(コード番号 2557)
問合せ先 委託業務管理部長 野口 晃男
(TEL.03-6205-0259)

『SMDAMトピックス上場投信』に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2023年2月22日現在)

19,455,347 口

2. 上場ETFの純資産総額(2023年2月22日現在)

38,776,183,844 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2023年2月22日現在)

1,993.09 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と東証株価指数(TOPIX)の終値の変動率に係る乖離率
(2023年2月22日現在)

0.00 %

(参考)乖離率の計算式

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

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 1,993.09	TOPIXの終値 1,975.25
前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額 2,015.46	前営業日のTOPIXの終値 1,997.46

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)

2023年2月24日

○ 設定ポートフォリオ

※設定申込受付日(2023年2月28日)は
設定不可日のため受け付けておりません。